

淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:淳厚基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 31 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至2023年06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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
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	12
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
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
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	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55

§8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§9 开放式基金份额变动	58
§10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	淳厚优加一年持有混合	
基金主代码	017107	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年12月19日	
基金管理人	淳厚基金管理有限公司	
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	208,731,966.93份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	淳厚优加一年持有混合A	淳厚优加一年持有混合C
下属分级基金的交易代码	017107	017108
报告期末下属分级基金的份额总额	175,666,007.96份	33,065,958.97份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险、保持资产流动性的基础上，通过大类资产配置，力争达到控制波动率、获取稳定收益的投资目标。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> 1、资产配置策略 2、债券投资策略 <ol style="list-style-type: none"> (1) 久期策略 (2) 收益率曲线策略 (3) 类属配置策略 (4) 信用债及资产支持证券策略 (5) 可转换债券策略 3、股票投资策略 4、港股投资策略 5、存托凭证投资策略 6、衍生品投资策略

	<p>(1) 股指期货投资策略</p> <p>(2) 国债期货投资策略</p> <p>(3) 股票期权投资策略</p> <p>(4) 信用衍生品策略</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×15%+经人民币汇率调整的 中证港股通综合指数收益率×5%+中债综合全价（总 值）指数收益率×80%
风险收益特征	<p>本基金属于混合型证券投资基金，其预期风险收 益水平低于股票型证券投资基金、高于债券型证券投 资基金、货币市场基金。</p> <p>本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机 制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则 等差异带来的特有风险。</p>

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		淳厚基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	沈志婷	秦一楠
	联系电话	021-60602373	010-66060069
	电子邮箱	shenzt@purekindfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4000009738	95599
传真		021-60607060	010-68121816
注册地址		上海市虹口区临潼路170号60 7室	北京市东城区建国门内大街6 9号
办公地址		上海市浦东新区丁香路778号 丁香国际大厦西塔7F	北京市西城区复兴门内大街2 8号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200135	100031
法定代表人		邢媛	谷澍

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	http://www.purekindfund.com/

文的管理人互联网网 址	
基金中期报告备置地 点	上海市浦东新区丁香路778号丁香国际大厦西塔7F

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	淳厚基金管理有限公司	上海市浦东新区丁香路778号丁香国际大厦西塔7F

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	淳厚优加一年持有 混合A	淳厚优加一年持有 混合C
本期已实现收益	2,424,737.47	389,872.20
本期利润	4,494,923.75	779,010.35
加权平均基金份额本期利润	0.0256	0.0236
本期加权平均净值利润率	2.54%	2.34%
本期基金份额净值增长率	2.56%	2.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	2,429,978.89	386,388.79
期末可供分配基金份额利润	0.0138	0.0117
期末基金资产净值	180,167,082.87	33,841,561.38
期末基金份额净值	1.0256	1.0235
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	2.56%	2.35%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、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

淳厚优加一年持有混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.28%	0.22%	0.58%	0.17%	0.70%	0.05%
过去三个月	1.93%	0.17%	-0.07%	0.16%	2.00%	0.01%
过去六个月	2.56%	0.16%	0.88%	0.17%	1.68%	-0.01%
自基金合同生效起至今	2.56%	0.15%	0.87%	0.16%	1.69%	-0.01%

淳厚优加一年持有混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.26%	0.23%	0.58%	0.17%	0.68%	0.06%
过去三个月	1.83%	0.17%	-0.07%	0.16%	1.90%	0.01%
过去六个月	2.36%	0.16%	0.88%	0.17%	1.48%	-0.01%
自基金合同生效起至今	2.35%	0.15%	0.87%	0.16%	1.48%	-0.01%

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

淳厚优加一年持有混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年12月19日-2023年06月30日)



注：本基金基金合同生效日为2022年12月19日，至报告期末未满1年。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例均符合基金合同约定。

淳厚优加一年持有混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年12月19日-2023年06月30日)



注：本基金基金合同生效日为2022年12月19日，至报告期末未满1年。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例均符合基金合同约定。

§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

淳厚基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2018】1618号文批准，于2018年11月3日成立，是由六位资深专业人士发起设立的公募基金管理公司。公司注册地上海，注册资本金为1亿元人民币。公司于2019年2月1日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。本基金管理人拥有公募、特定客户资产管理等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资等方面为客户提供资产管理解决方案。

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		
祁洁萍	基金经理、总经理助理、固定收益投资部总监	2022-12-19	-	15年	东华大学理学硕士。曾任永赢基金管理有限公司固定收益部固定收益总监，光大证券股份有限公司证券投资总部投资顾问、执行董事，平安证券有限责任公司研究所债券研究员。2018年加入淳厚基金，现任淳厚基金管理有限公司总经理助理、固定收益投资部总监、淳厚中短债债券型证券投资基金基金经理、淳厚安心87个月定期开放债券型证券投资基

					金基金经理、淳厚益加增强债券型证券投资基金基金经理、淳厚稳宁6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、淳厚中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理、淳厚稳丰债券型证券投资基金基金经理、淳厚中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理、淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
薛莉丽	基金经理、副总经理兼研究部总监	2023-02-13	-	16年	上海财经大学经济学硕士。曾任兴业证券证券投资部（权益自营部）投资经理、总经理助理、部门副总监。2019年加入淳厚基金，现任淳厚基金副总经理兼研究部总监、淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理、淳厚信睿核心精选混合型证券投资基金基金经理、淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金经理、淳厚益加增强债券型证券投资基金基金经理、淳厚鑫淳一年持有期混合型证券投资基金基金经理、淳厚现代服务业股票型证券投资基金基金经理、淳厚鑫悦商业模式优选混合型证券投资基金基金经理、淳

					厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--------------------------

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；
2、证券从业年限计算标准遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、本基金《基金合同》等法律文件和其他相关法律法规的规定，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，力争为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保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。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司交易部和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形，未发现异常交易行为。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

上半年，债券市场收益率趋势性下行。一季度配置资金陆续进场，前期抛售较多的理财资金重新转为净买入，信用表现强势，信用利差逐步压缩，信用利差下行逐步由高等级转为中低等级、银行二级债转至银行永续债，四季度大幅调整品种均迎来了估值修复。利率品种则受制于信贷预期向好，10年国债收益率维持弱势。春节过后市场预期分化，弱复苏逐步得到市场确认，对应利率开始逐步回落。二季度复苏预期逐步修正，债券市场行情由前期利差修复转为全面下行，叠加银行存款利率调降和政策利率下调，进一步加剧市场做多热情。上半年10年期国债收益率累计下行约20BP，10年期国开债累计下行约16BP。权益市场方面，上半年主要指数涨跌互现，代表其市场的wind全A上涨3%，沪深300下跌0.74%，创业板指下跌5.6%，国证2000指数上涨7%。行业层面亦呈现涨跌互现，成长类板块中TMT行业一枝独秀，泛消费板块中家电、纺服表现较好，泛周期板块中建筑、石油石化表现良好。港股在去年Q4大幅反弹后上半年有一定的回调，恒生指数下跌4%，恒生科技指数下跌5%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末淳厚优加一年持有混合A基金份额净值为1.0256元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.56%，同期业绩比较基准收益率为0.88%；截至报告期末淳厚优加一年持有混合C基金份额净值为1.0235元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.36%，同期业绩比较基准收益率为0.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后期，政治局会议表态提升市场政策预期。关注后期地产、财政、货币相关政策的落地节奏。预期随着政策的落地基本面逐步筑底，扰动因子动能逐步增强。库存方面，上半年企业需求不足带动企业被动累库，企业累库程度接近于2015年周期底部，关注政策需求同库存周期能否形成合力，对应债市方面，建议均衡配置。

权益市场方面，继续做好自下而上择股，对宏观经济做中性预期，优选个股，不押注市场风格。相较于上半年的极致分化，下半年市场的表现或更加均衡。我们目前依旧看好数字化、消费升级、能源革命等产业方向，同时对自主可控产业安全的命题保持持

持续关注，基于产业视角寻找符合时代背景的具备可持续竞争优势的优质企业，力争为持有人创造可持续的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，应参照协会通知执行。

报告期内，本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会主任委员由分管运营的首席信息官（副总经理级）担任，专业委员若干名，由权益投资部、固定收益投资部、研究部、运营保障部、监察稽核部、风险管理部、市场综合部等部门负责人或其指定人员组成。

估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理可列席公司估值委员会，不介入基金日常估值业务，但可参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，但不能参与表决，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人会同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，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，本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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-淳厚基金管理有限公司2023年1月1日至2023年6月30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, 淳厚基金管理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

本托管人认为，淳厚基金管理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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,800,123.82	13,538,335.49
结算备付金		23.09	20,005,000.01
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	230,560,100.00	-
其中：股票投资		49,201,180.61	-
基金投资		-	-
债券投资		181,358,919.39	-
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	-	175,004,044.74
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		66,240.00	-
应收申购款		21.74	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		232,426,508.65	208,547,380.24
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		18,006,390.67	-
应付清算款		86,357.49	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		174,924.14	68,531.02
应付托管费		34,984.84	13,706.21
应付销售服务费		11,066.27	4,345.67
应付投资顾问费		-	-
应交税费		12,562.39	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	91,578.60	-
负债合计		18,417,864.40	86,582.90
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	208,731,966.93	208,459,977.98
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	5,276,677.32	819.36
净资产合计		214,008,644.25	208,460,797.34
负债和净资产总计		232,426,508.65	208,547,380.24

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额总额208,731,966.93份，其中下属A类基金份额净值1.0256元，基金份额总额175,666,007.96份；下属C类基金份额净值1.0235元，基金份额总额33,065,958.97份。

6.2 利润表

会计主体：淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至2023年0 6月30日
一、营业总收入		6,734,880.88
1.利息收入		309,019.89
其中：存款利息收入	6.4.7.9	58,222.66
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		250,797.23
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,966,536.56
其中：股票投资收益	6.4.7.10	919,256.58
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	2,498,349.98

资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	548,930.00
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）	6.4.7.15	2,459,324.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-
减：二、营业总支出		1,460,946.78
1. 管理人报酬		1,041,627.22
2. 托管费		208,325.47
3. 销售服务费		65,969.22
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		39,835.26
其中：卖出回购金融资产支出		39,835.26
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-
7. 税金及附加		5,102.43
8. 其他费用	6.4.7.18	100,087.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,273,934.10
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,273,934.10
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		5,273,934.10

注：本基金基金合同生效日为2022年12月19日，故无上年度可比区间数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	208,459,977.98	-	819.36	208,460,797.34
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	208,459,977.98	-	819.36	208,460,797.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	271,988.95	-	5,275,857.96	5,547,846.91
（一）、综合收益总额	-	-	5,273,934.10	5,273,934.10
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	271,988.95	-	1,923.86	273,912.81
其中：1.基金申购款	271,988.95	-	1,923.86	273,912.81
2.基金赎回款	-	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产	-	-	-	-

生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	208,731,966.93	-	5,276,677.32	214,008,644.25

注：本基金基金合同生效日为2022年12月19日，故无上年度可比区间数据。

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：

邢媛

刘远新

李述银

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

淳厚优加一年持有期混合型证券投资基金(以下简称"本基金")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[2022] 2488号《关于准予淳厚优加一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准，由淳厚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《淳厚优加一年持有期混合型证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")负责公开募集。本基金的基金管理人为淳厚基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。本基金于2022年12月19日募集成立，募集期为自2022年11月18日至2022年12月15日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，本基金共募集有效净认购资金，208,446,983.49元，折合208,446,983.49份淳厚优加一年持有混合基金份额(其中：A类基金份额为175,402,724.32份；C类基金份额为33,044,259.17份)。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币12,994.49元，折合12,994.49份淳厚优加一年持有混合基金份额(其中：A类基金份额为8,574.35份；C类基金份额为4,420.14份)，以上收到的实收基金共计人民币208,459,977.98元，折合208,459,977.98份淳厚优加一年持有混合基金份额(其中：A类基金份额为175,411,298.67份；C类基金份额为33,048,679.31份)，有效认购户数为2,185户。按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《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》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围包括债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债、地方政府债、可交换债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、国内依法发行上市的股票（包含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、国债期货、股指期货、股票期权、信用衍生品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。本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×15%+经人民币汇率调整的中证港股通综合指数收益率×5%+中债综合全价（总值）指数收益率×80%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的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”)编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2023年6月30日的财务状况以及2023年上半年的经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币，记账本位币单位为元。

6.4.4.3 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。

① 债务工具

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：

1) 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。

2) 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债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

② 权益工具

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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以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衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等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；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其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；

(7) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除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利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 本基金的管理人报酬、托管费、销售服务费等按《基金合同》约定的方法进行计提。

(2) 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

(3) 其他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。

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润可能有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 当日申购的基金份额自下一交易日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个交易日起，不享有基金的收益分配权益；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 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,本基金确定以下股票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，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)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(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、可交换债券、可分离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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度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、可交换债券、可分离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固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《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[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号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，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、对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5、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。

6、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、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	544,500.69
等于：本金	544,244.60
加：应计利息	256.09
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	1,255,623.13

等于：本金	1,255,419.22
加：应计利息	203.91
减：坏账准备	-
合计	1,800,123.82

注：其他存款-本金本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	47,750,666.70	-	49,201,180.61	1,450,513.91	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	18,532,544.35	198,207.12	18,900,007.12	169,255.65
	银行间市场	160,469,445.13	1,149,912.27	162,458,912.27	839,554.87
	合计	179,001,989.48	1,348,119.39	181,358,919.39	1,008,810.52
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	226,752,656.18	1,348,119.39	230,560,100.00	2,459,324.43	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06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	3,310.33
其中：交易所市场	-
银行间市场	3,310.33
应付利息	-
预提费用-审计费	13,884.51
预提费用-信息披露费	74,383.76
合计	91,578.60

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 淳厚优加一年持有混合A

金额单位：人民币元

项目 (淳厚优加一年持有混合A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	175,411,298.67	175,411,298.67
本期申购	254,709.29	254,709.29
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	175,666,007.96	175,666,007.96

6.4.7.7.2 淳厚优加一年持有混合C

金额单位：人民币元

项目	本期

(淳厚优加一年持有混合C)	2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	33,048,679.31	33,048,679.31
本期申购	17,279.66	17,279.66
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	33,065,958.97	33,065,958.97

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 淳厚优加一年持有混合A

单位：人民币元

项目 (淳厚优加一年持有混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	4,346.44	-	4,346.44
本期利润	2,424,737.47	2,070,186.28	4,494,923.75
本期基金份额交易产生的变动数	894.98	909.74	1,804.72
其中：基金申购款	894.98	909.74	1,804.72
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,429,978.89	2,071,096.02	4,501,074.91

6.4.7.8.2 淳厚优加一年持有混合C

单位：人民币元

项目 (淳厚优加一年持有混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-3,527.08	-	-3,527.08
本期利润	389,872.20	389,138.15	779,010.35
本期基金份额交易产生的变动数	43.67	75.47	119.14

其中：基金申购款	43.67	75.47	119.14
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	386,388.79	389,213.62	775,602.41

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	4,188.05
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	27,399.51
结算备付金利息收入	26,635.10
其他	-
合计	58,222.66

注：其他存款利息收入为券商保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	32,200,004.16
减：卖出股票成本总额	31,151,537.63
减：交易费用	129,209.95
买卖股票差价收入	919,256.58

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	2,348,821.03

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	149,528.95
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,498,349.98

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	110,932,133.58
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	109,853,990.62
减：应计利息总额	924,190.10
减：交易费用	4,423.91
买卖债券差价收入	149,528.95

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	548,930.00
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	548,930.00
----	------------

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	2,459,324.43
——股票投资	1,450,513.91
——债券投资	1,008,810.52
——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	2,459,324.43

6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	13,884.51
信息披露费	74,383.76

证券出借违约金	-
汇划手续费	4,118.91
账户维护费	7,500.00
银行结算费用	200.00
合计	100,087.18

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无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，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

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
淳厚基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

- 1、本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。
- 2、本基金基金合同生效日为2022年12月19日，故无上年度可比区间数据。

6.4.10.1.2 权证交易

- 1、本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。
- 2、本基金基金合同生效日为2022年12月19日，故无上年度可比区间数据。

6.4.10.1.3 债券交易

- 1、本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。
- 2、本基金基金合同生效日为2022年12月19日，故无上年度可比区间数据。

6.4.10.1.4 债券回购交易

- 1、本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。
- 2、本基金基金合同生效日为2022年12月19日，故无上年度可比区间数据。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

- 1、本基金本报告期无应支付关联方的佣金。
- 2、本基金基金合同生效日为2022年12月19日，故无上年度可比区间数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,041,627.22
其中：支付销售机构的客户维护费	213,946.33

注：1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.00%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数；

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、本基金基金合同生效日为2022年12月19日，故无上年度可比区间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	208,325.47

注：1、支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当

年天数。

2、本基金基金合同生效日为2022年12月19日，故无上年度可比区间数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	淳厚优加一年持有混合A	淳厚优加一年持有混合C	合计
淳厚基金管理有限公司	0.00	3,233.61	3,233.61
中国农业银行股份有限公司	0.00	3,171.64	3,171.64
合计	0.00	6,405.25	6,405.25

注：1、支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值0.40%的年费率计提，每日计提，按月支付给注册登记机构，再由注册登记机构代付给销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。C类基金销售服务费的计算公式为：C类基金份额的每日应计提的销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。

2、本基金基金合同生效日为2022年12月19日，故无上年度可比区间数据。

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

本基金本报告期内未发生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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

淳厚优加一年持有混合A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
	报告期初持有的基金份额
报告期间申购/买入总份额	0.00

报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	2,991,026.92
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.70%

淳厚优加一年持有混合C

份额单位：份

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%

注：

- 1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。
- 2、本基金管理人运用固有资金申赎（包含转换）本基金所适用费率符合基金合同、招募说明书及相关公告的规定。
- 3、报告期末持有的基金份额占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分子采用各自级别的份额。
- 4、本基金基金合同生效日为2022年12月19日，故无上年度可比区间数据。

6.4.10.4.2 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

本报告期除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入

中国农业 银行股份 有限公司	544,500.69	4,188.05
----------------------	------------	----------

注：

- 1、本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。
- 2、本基金基金合同生效日为2022年12月19日，故无上年度可比区间数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年06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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2023年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额18,006,390.67元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
160210	16国开10	2023-07-04	102.80	100,000	10,279,590.17
210213	21国开13	2023-07-03	100.70	85,000	8,559,797.96
210213	21国开13	2023-07-04	100.70	6,000	604,221.03
合计				191,000	19,443,609.16

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

6.4.13.2 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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的托管行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，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；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	31,206,700.18	-
AAA以下	20,806,389.04	-
未评级	90,626,758.48	-
合计	142,639,847.70	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，除在附注“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时

变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时关于未来现金流的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,800,123.82	-	-	-	1,800,123.82
结算备付金	23.09	-	-	-	23.09
交易性金融资产	38,556,125.24	142,802,794.15	-	49,201,180.61	230,560,100.00
应收股利	-	-	-	66,240.00	66,240.00
应收申购款	-	-	-	21.74	21.74
资产总计	40,356,272.15	142,802,794.15	-	49,267,442.35	232,426,508.65
负债					
卖出回购金融资产款	18,006,390.67	-	-	-	18,006,390.67
应付清算款	-	-	-	86,357.49	86,357.49

淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金 2023 年中期报告

应付管理人报酬	-	-	-	174,924.14	174,924.14
应付托管费	-	-	-	34,984.84	34,984.84
应付销售服务费	-	-	-	11,066.27	11,066.27
应交税费	-	-	-	12,562.39	12,562.39
其他负债	-	-	-	91,578.60	91,578.60
负债总计	18,006,390.67	-	-	411,473.73	18,417,864.40
利率敏感度缺口	22,349,881.48	142,802,794.15	-	48,855,968.62	214,008,644.25
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	13,538,335.49	-	-	-	13,538,335.49
结算备付金	20,005,000.01	-	-	-	20,005,000.01
买入返售金融资产	175,004,044.74	-	-	-	175,004,044.74
资产总计	208,547,380.24	-	-	-	208,547,380.24
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	68,531.02	68,531.02
应付托管费	-	-	-	13,706.21	13,706.21
应付销售服务费	-	-	-	4,345.67	4,345.67
负债总计	-	-	-	86,582.90	86,582.90
利率敏感度缺口	208,547,380.24	-	-	-86,582.90	208,460,797.34

口					
---	--	--	--	--	--

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率下降25个基点	683,684.30	-
	市场利率上升25个基点	-678,869.25	-

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	8,177,501.61	-	8,177,501.61
资产合计	-	8,177,501.61	-	8,177,501.61
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	8,177,501.61	-	8,177,501.61
项目	上年度末			

	2022年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	所有港币均相对人民币升值5%	408,875.08	-
	所有港币均相对人民币贬值5%	-408,875.08	-

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	49,201,180.61	22.99	-	-

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	181,358,919.39	84.74	-	-
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	230,560,100.00	107.73	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、假定业绩比较基准变化5%，其他市场变量不变；		
	2、Beta系数是根据组合在过去一个年度的净值数据和业绩比较基准数据回归得出，对于成立不足一年的组合，取自成立以来的数据计算。		
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06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	7,108,367.68	-
	业绩比较基准下降5%	-7,108,367.68	-

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能变动时，将对基金资产净值产生的影响。

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。

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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	60,011,646.91	-
第二层次	170,548,453.09	-
第三层次	-	-
合计	230,560,100.00	-

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	49,201,180.61	21.17
	其中：股票	49,201,180.61	21.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	181,358,919.39	78.03
	其中：债券	181,358,919.39	78.03
	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	1,800,146.91	0.77
8	其他各项资产	66,261.74	0.03
9	合计	232,426,508.65	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为8,177,501.61元，占基金总资产比例3.52%。

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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	30,573,159.00	14.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	814,500.00	0.38
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,120,500.00	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	699,000.00	0.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,495,700.00	2.57

J	金融业	701,120.00	0.33
K	房地产业	1,231,200.00	0.58
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	388,500.00	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	41,023,679.00	19.17

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例 (%)
非日常生活消费品	4,076,995.56	1.91
日常消费品	3,019,668.90	1.41
信息技术	1,080,837.15	0.51
合计	8,177,501.61	3.82

注:以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

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	H00921	海信家电	220,000	4,076,995.56	1.91
2	H00168	青岛啤酒股份	46,000	3,019,668.90	1.41
3	600131	国网信通	120,000	2,422,800.00	1.13
4	601126	四方股份	150,000	2,278,500.00	1.06
5	002158	汉钟精机	90,000	2,246,400.00	1.05
6	002011	盾安环境	160,000	2,212,800.00	1.03

7	601231	环旭电子	120,000	1,795,200.00	0.84
8	603589	口子窖	35,000	1,727,250.00	0.81
9	300770	新媒股份	32,000	1,467,520.00	0.69
10	300627	华测导航	45,000	1,461,150.00	0.68
11	603043	广州酒家	50,000	1,413,000.00	0.66
12	600885	宏发股份	40,000	1,274,000.00	0.60
13	600223	福瑞达	120,000	1,231,200.00	0.58
14	603515	欧普照明	60,030	1,218,609.00	0.57
15	002518	科士达	30,000	1,200,300.00	0.56
16	603369	今世缘	22,000	1,161,600.00	0.54
17	601607	上海医药	50,000	1,120,500.00	0.52
18	002402	和而泰	65,000	1,103,700.00	0.52
19	000651	格力电器	30,000	1,095,300.00	0.51
20	601702	华峰铝业	80,000	1,094,400.00	0.51
21	H03888	金山软件	38,000	1,080,837.15	0.51
22	600399	抚顺特钢	100,000	1,020,000.00	0.48
23	301208	中亦科技	18,000	995,940.00	0.47
24	603297	永新光学	12,000	958,800.00	0.45
25	600332	白云山	30,000	956,400.00	0.45
26	002705	新宝股份	50,000	901,500.00	0.42
27	002463	沪电股份	40,000	837,600.00	0.39
28	000598	兴蓉环境	150,000	814,500.00	0.38
29	001380	华纬科技	23,000	749,570.00	0.35
30	688425	铁建重工	150,000	721,500.00	0.34
31	002595	豪迈科技	20,000	702,600.00	0.33
32	300033	同花顺	4,000	701,120.00	0.33
33	601598	中国外运	150,000	699,000.00	0.33
34	300800	力合科技	50,000	690,500.00	0.32
35	603225	新凤鸣	60,000	663,000.00	0.31
36	688061	灿瑞科技	12,000	633,960.00	0.30
37	600536	中国软件	13,000	609,440.00	0.28

38	301328	维峰电子	8,000	455,520.00	0.21
39	301306	西测测试	10,000	388,500.00	0.18

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300033	同花顺	3,431,202.00	1.65
2	002158	汉钟精机	3,250,413.00	1.56
3	H00168	青岛啤酒 股份	2,979,652.14	1.43
4	301255	通力科技	2,746,767.00	1.32
5	603589	口子窖	2,712,047.00	1.30
6	300847	中船汉光	2,511,886.00	1.20
7	000651	格力电器	2,416,824.00	1.16
8	601126	四方股份	2,354,412.00	1.13
9	600131	国网信通	2,234,550.00	1.07
10	H00921	海信家电	2,208,006.00	1.06
11	600223	福瑞达	2,150,334.00	1.03
12	301306	西测测试	2,115,727.25	1.01
13	002011	盾安环境	2,111,846.00	1.01
14	601231	环旭电子	2,020,530.00	0.97
15	002033	丽江股份	1,902,315.00	0.91
16	601607	上海医药	1,876,653.00	0.90
17	300014	亿纬锂能	1,871,102.00	0.90
18	601006	大秦铁路	1,806,711.60	0.87
19	603369	今世缘	1,671,478.00	0.80
20	603297	永新光学	1,663,905.00	0.80

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300033	同花顺	3,494,811.00	1.68
2	301255	通力科技	3,107,482.00	1.49
3	300847	中船汉光	2,466,705.00	1.18
4	002033	丽江股份	1,827,109.00	0.88
5	601006	大秦铁路	1,718,706.00	0.82
6	600845	宝信软件	1,612,766.45	0.77
7	300014	亿纬锂能	1,607,634.00	0.77
8	300383	光环新网	1,571,501.00	0.75
9	301306	西测测试	1,423,216.00	0.68
10	002222	福晶科技	1,379,830.00	0.66
11	000651	格力电器	1,374,273.00	0.66
12	688559	海目星	1,240,678.39	0.60
13	600642	申能股份	1,052,234.00	0.50
14	002158	汉钟精机	980,026.00	0.47
15	600223	福瑞达	889,564.00	0.43
16	601607	上海医药	843,514.98	0.40
17	603018	华设集团	808,813.84	0.39
18	600079	人福医药	750,094.00	0.36
19	000988	华工科技	709,356.00	0.34
20	300745	欣锐科技	597,000.00	0.29

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	78,902,204.33
卖出股票收入（成交）总额	32,200,004.16

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	8,089,540.82	3.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,629,530.87	14.31
	其中：政策性金融债	30,629,530.87	14.31
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	131,829,381.40	61.60
7	可转债(可交换债)	10,810,466.30	5.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	181,358,919.39	84.74

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	160210	16国开10	200,000	20,559,180.33	9.61
2	102100367	21兆润投资MTN001	200,000	20,396,233.88	9.53
3	102280987	22大众交通MTN001(绿色)	200,000	20,146,732.24	9.41
4	102281060	22上海大众MTN001	200,000	20,107,825.14	9.40
5	101900992	19珠海港MTN002	100,000	10,610,065.75	4.96

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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收到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	66,240.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	21.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	66,261.74
---	----	-----------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110059	浦发转债	9,728,304.66	4.55
2	113042	上银转债	1,082,161.64	0.51

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不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告因四舍五入的原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
淳厚优加一年持有混合A	1,565	112,246.65	112,095,783.40	63.81%	63,570,224.56	36.19%
淳厚优加一年	683	48,412.82	300,019.00	0.91%	32,765,939.97	99.09%

持有混合C						
合计	2,248	92,852.30	112,395,802.40	53.85%	96,336,164.53	46.15%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。上表展示的比例系四舍五入后的结果。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	淳厚优加一年持有混合A	1,494,799.49	0.85%
	淳厚优加一年持有混合C	270,051.00	0.82%
	合计	1,764,850.49	0.85%

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。上表展示的比例系四舍五入后的结果。

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	淳厚优加一年持有混合A	0
	淳厚优加一年持有混合C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	淳厚优加一年持有混合A	0
	淳厚优加一年持有混合C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	淳厚优加一年持有混合 A	淳厚优加一年持有混合 C
基金合同生效日(2022年12月19日)基金份额总额	175,411,298.67	33,048,679.31
本报告期期初基金份额总额	175,411,298.67	33,048,679.31
本报告期基金总申购份额	254,709.29	17,279.66
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	175,666,007.96	33,065,958.97

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

1、本报告期内基金管理人重大人事变动：

根据本基金管理人2023年4月18日的公告，沈志婷女士担任督察长，谢芳女士离任督察长。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：无。

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，未发生影响公司经营或基金运营业务的诉讼。本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本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

本报告期内，为本基金审计的会计事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

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

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
山西证券	2	109,295,496.89	100.00%	81,663.85	100.00%	-

注：1、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。

2、本报告期本基金新增山西证券上海、深圳两个交易单元。

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		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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
山西证券	45,173,441.74	100.00%	1,185,700.00	100.00%	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。

2、本报告期本基金新增山西证券上海、深圳两个交易单元。

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	淳厚基金管理有限公司关于淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金开展费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-20
2	淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金开放日常申购、转换转入和定期定额投资业务公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-20
3	淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-13
4	淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金招募说明书更新（2023年第1期）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-16
5	淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-16
6	淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-16
7	淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金2023年第1季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-24
8	淳厚基金管理有限公司旗下基金2023年1季度报告提示性公告	《中国证券报》	2023-04-24

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立淳厚基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金设立的文件；
- 3、《淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、《淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

淳厚基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区丁香路778号丁香国际西塔7楼

12.3 查阅方式

上述文件可在淳厚基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到淳厚基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人淳厚基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-000-9738

网址：<http://www.purekindfund.com/>

淳厚基金管理有限公司
二〇二三年八月三十一日