

国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 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	5
2.4 信息披露方式	6
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（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45

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.....	45
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.....	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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.....	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	49
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	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国寿安保华兴灵活配置混合
基金主代码	005683
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 4 月 28 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	96,240,074.40 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活运用多种投资策略,在经济结构转型、产业升级大背景下,积极挖掘沪港深市场中潜在的投资机会,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。在大类资产配置上,在具备足够多本基金所定义的投资标的时,优先考虑股票类资产的配置,剩余资产将配置于债券和现金等大类资产上。除主要的股票及债券投资外,本基金还可通过投资衍生工具等,进一步为基金组合规避风险、增强收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×35%+恒生指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金,预期风险收益水平相应会高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中高风险/收益的投资品种。本基金将投资港股通标的股票,需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国寿安保基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	韩占锋	郭明
	联系电话	010-50850744	010-66105799
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009-258-258	95588
传真		010-50850776	010-66105798
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100033	100140

法定代表人	王军辉	陈四清
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国寿安保基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

§ 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 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	256,065.32
本期利润	-5,145,082.99
加权平均基金份额本期利润	-0.0404
本期加权平均净值利润率	-2.44%
本期基金份额净值增长率	-1.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	58,210,883.96
期末可供分配基金份额利润	0.6049
期末基金资产净值	154,450,958.36
期末基金份额净值	1.6049
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	64.69%

注：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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

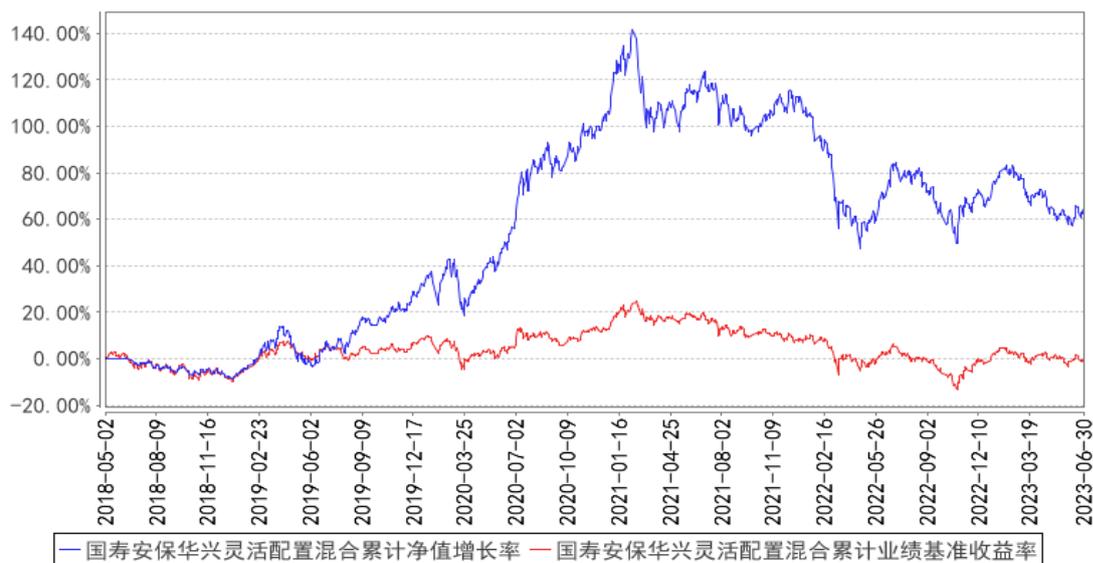
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.33%	1.02%	2.61%	0.74%	1.72%	0.28%
过去三个月	-3.85%	0.91%	-2.04%	0.66%	-1.81%	0.25%
过去六个月	-1.97%	0.87%	0.31%	0.69%	-2.28%	0.18%

过去一年	-10.39%	1.07%	-5.77%	0.85%	-4.62%	0.22%
过去三年	3.84%	1.27%	-5.70%	0.86%	9.54%	0.41%
自基金合同生效起至今	64.69%	1.23%	-0.67%	0.86%	65.36%	0.37%

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

国寿安保华兴灵活配置混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2018 年 04 月 28 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为 2018 年 04 月 28 日至 2023 年 06 月 30 日。

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

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可（2013）1308 号文核准，于 2013 年 10 月 29 日设立，公司注册资本 12.88 亿元人民币，公司股东为中国人寿资产管理有限公司，其持有股份 85.03%，AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED（澳大利亚安保资本投资有限公司），其持有股份 14.97%。

截至 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 94 只公募证券投资基金和部分私募资产管

理计划，公司管理资产总规模为 3226.04 亿元，其中公募证券投资基金管理规模为 2507.58 亿元。

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		
李捷	基金经理	2018 年 4 月 28 日	-	15 年	金融学硕士，曾任德勤华永会计师事务所高级审计师，中国国际金融有限公司分析员，财富里昂证券有限责任公司投资分析师。2013 年 12 月加入国寿安保基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。现任国寿安保灵活优选混合型证券投资基金、国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金、国寿安保强国智造灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保稳瑞混合型证券投资基金、国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保裕安混合型证券投资基金、国寿安保华丰混合型证券投资基金、国寿安保稳隆混合型证券投资基金和国寿安保裕丰混合型证券投资基金基金经理。

注：任职日期为基金合同生效日。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》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守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于基金份额持有人为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，不存在违反基金合同和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

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。本报告期，不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；且不

存在所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交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，A 股市场整体呈现先扬后抑的走势，上证综指小幅上涨约 3.65%，深圳成指基本持平，沪深 300 下跌 0.75%，创业板指下跌约 5.6%。行业结构分化较为显著，上半年表现较好的行业分别为通信、传媒、计算机、机械设备等，表现相对较弱的行业分别为商贸零售、房地产、美容护理、建筑材料等。港股市场跟随国内市场调整，恒生指数下跌 4.37%。

2023 年上半年，国寿安保华兴基金维持了较高的权益配置比例，进一步优化持仓结构，兑现了部分受主题催化表现较好的公司，增配了制造业中具备中长期竞争力、估值合理、未来盈利趋势有望持续向上的细分领域优质公司。在行业配置上，A 股市场配置比例相对较高的有：机械设备、电力设备、食品饮料、电子、家用电器、医药生物、汽车、基础化工、计算机、轻工制造等盈利能力较强或长期增长潜力较好的行业。港股市场配置比例相对较高的行业包括：科技、消费、金融等。

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 1.6049 元；本报告期基金份额净值增长率为 -1.97%，业绩比较基准收益率为 0.31%。

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 2023 年下半年，我们认为，短期来看，资本市场政策底或已出现，随着稳增长一系列政策陆续出台，以及海外货币政策收紧存在边际转向的可能，与经济相关的行业有望出现业绩改善和估值修复的机会。中期看，行业升级和产业转型仍将延续，科技成长、高端制造等高新技术企业在经济高质量发展的大背景下有望持续受益。权益市场经过二季度以来的调整，风险收益比已再次大幅提升。从行业结构性角度看，代表未来经济发展方向的龙头公司和具有一定壁垒的优质专精特新企业有望获得更好的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设有基金估值委员会，估值委员会负责人由主管运营工作的公司领导担任，委员由运营管理部负责人、合规管理部负责人、研究部负责人以及各相关投资部门负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经验。估值委员

会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。

上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司分别签署服务协议，其中中债金融估值中心有限公司按约定提供固定收益品种信用减值数据和在银行间同业市场交易的固定收益品种估值数据，中证指数有限公司提供在交易所市场交易的固定收益品种估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——国寿安保基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对国寿安保基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,560,013.06	2,477,067.21
结算备付金		86,212.56	105,418.30
存出保证金		11,927.71	8,501.60
交易性金融资产	6.4.7.2	153,001,362.57	208,545,627.90
其中：股票投资		143,597,882.38	196,129,548.09
基金投资		-	-
债券投资		9,403,480.19	12,416,079.81
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		269,342.04	384,863.53
应收股利		28,767.64	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		154,957,625.58	211,521,478.54
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 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		-	-
应付清算款		28,870.33	-
应付赎回款		64.39	8,087.25
应付管理人报酬		217,174.45	268,276.92
应付托管费		36,195.73	44,712.84
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.36

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	224,362.32	247,570.36
负债合计		506,667.22	568,647.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	96,240,074.40	128,848,379.55
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	58,210,883.96	82,104,451.26
净资产合计		154,450,958.36	210,952,830.81
负债和净资产总计		154,957,625.58	211,521,478.54

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.6049 元，基金份额总额 96,240,074.40 份。

6.2 利润表

会计主体：国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-3,225,332.37	-49,055,753.93
1. 利息收入		5,370.04	13,544.91
其中：存款利息收入	6.4.7.13	5,370.04	9,190.88
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		-	4,354.03
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,156,450.64	2,086,518.63
其中：股票投资收益	6.4.7.14	295,869.78	-239,703.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	149,005.58	181,415.53
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
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	1,711,575.28	2,144,806.58
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	-5,401,148.31	-51,156,241.30
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	13,995.26	423.83
减：二、营业总支出		1,919,750.62	2,199,453.53
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1,571,059.15	1,802,125.55
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	261,843.21	300,354.24
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	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		0.07	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	86,848.19	96,973.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,145,082.99	-51,255,207.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,145,082.99	-51,255,207.46
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-5,145,082.99	-51,255,207.46

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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（基金净值）	128,848,379.55	-	82,104,451.26	210,952,830.81
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）	128,848,379.55	-	82,104,451.26	210,952,830.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-32,608,305.15	-	-23,893,567.30	-56,501,872.45
（一）、综合收益总额	-	-	-5,145,082.99	-5,145,082.99
（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）	-32,608,305.15	-	-18,748,484.31	-51,356,789.46

其中：1. 基金申购款	2,377,188.09	-	1,617,668.77	3,994,856.86
2. 基金赎回款	-34,985,493.24	-	-20,366,153.08	-55,351,646.32
（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）	96,240,074.40	-	58,210,883.96	154,450,958.36
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	165,494,984.96	-	177,611,775.83	343,106,760.79
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）	165,494,984.96	-	177,611,775.83	343,106,760.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-43,008,467.40	-	-80,740,120.51	-123,748,587.91
（一）、综合收益总额	-	-	-51,255,207.46	-51,255,207.46
（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）	-43,008,467.40	-	-29,484,913.05	-72,493,380.45
其中：1. 基金申购款	116,046.55	-	90,376.66	206,423.21
2. 基金赎回款	-43,124,513.95	-	-29,575,289.71	-72,699,803.66
（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）	122,486,517.56	-	96,871,655.32	219,358,172.88

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：

鄂华

王文英

于晓树

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

国寿安保华兴灵活配置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[2018]170号《关于准予国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册,由国寿安保基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 233,407,327.60 元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2018)验字第 61090605_A05 号予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 04 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 233,430,478.74 份基金份额,其中认购资金利息折合 23,151.14 份基金份额。本基金的基金管理人为国寿安保基金管理有限公司(以下简称“国寿安保”),基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保华兴灵活配置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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、国债、中央银行票据、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债、证券公司短期公司债、资产支持证券、可转换债券、可交换债券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、权证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)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 0-95%,其中投资于国内依法发行上市的股票比例占基金资产的 0-95%,投资于港股通标的股票比例占股票资产的 0-50%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内

的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的投资范围包括港股通标的股票，基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*35%+恒生指数收益率*35%+中证综合债券指数收益率*30%。

本财务报表由本基金的基金管理人国寿安保于 2023 年 08 月 30 日批准报出。

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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“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》、《国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与上年度会计报表相一致。

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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基

金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

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 6 月 30 日
活期存款	1,560,013.06
等于：本金	1,559,852.11
加：应计利息	160.95
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	1,560,013.06

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	150,061,031.70	-	143,597,882.38	-6,463,149.32	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	9,274,632.30	96,250.19	9,403,480.19	32,597.70
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	9,274,632.30	96,250.19	9,403,480.19	32,597.70

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	159,335,664.00	96,250.19	153,001,362.57	-6,430,551.62

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于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

本基金于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

本基金于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 债权投资

本基金于本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

本基金于本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金于本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	140,059.76
其中：交易所市场	140,059.76
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	224,362.32

6.4.7.10 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6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	128,848,379.55	128,848,379.55
本期申购	2,377,188.09	2,377,188.09
本期赎回（以“-”号填列）	-34,985,493.24	-34,985,493.24
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	96,240,074.40	96,240,074.40

注：本期申购包含基金红利再投资、转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金于本报告期间无其他综合收益。

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	95,334,530.07	-13,230,078.81	82,104,451.26
本期利润	256,065.32	-5,401,148.31	-5,145,082.99
本期基金份额交易产生的变动数	-25,156,140.10	6,407,655.79	-18,748,484.31
其中：基金申购款	1,759,765.17	-142,096.40	1,617,668.77
基金赎回款	-26,915,905.27	6,549,752.19	-20,366,153.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	70,434,455.29	-12,223,571.33	58,210,883.96

6.4.7.13 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6月30日
活期存款利息收入	4,099.12
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	1,184.49
其他	86.43
合计	5,370.04

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	295,869.78
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	295,869.78

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	108,115,598.84
减：卖出股票成本总额	107,552,014.55
减：交易费用	267,714.51
买卖股票差价收入	295,869.78

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

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	119,836.46
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	29,169.12
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	149,005.58

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,865,304.07
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,672,063.16
减：应计利息总额	164,063.81
减：交易费用	7.98
买卖债券差价收入	29,169.12

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期间无资产支持证券投资产生的收益/损失。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金于本报告期无贵金属投资产生的收益/损失。

6.4.7.18 衍生工具收益

本基金于本报告期无衍生工具产生的收益/损失。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,711,575.28
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	1,711,575.28

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-5,401,148.31
股票投资	-5,436,495.47
债券投资	35,347.16
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	-5,401,148.31

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	13,995.26
合计	13,995.26

6.4.7.22 信用减值损失

本基金于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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,587.18
证券组合费	958.45
合计	86,848.19

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

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未发生变化。

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
国寿安保	基金管理人、注册登记机构、直销机构
工商银行	基金托管人、销售机构
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
安保资本投资有限公司（简称“安保资本”）	基金管理人的股东
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	基金管理人的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	与基金管理人同受集团公司控制的公司、销售机构
国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”）	基金管理人的子公司
广发银行股份有限公司（简称“广发银行”）	基金管理人股东之股东的联营企业

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的交易。

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1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,571,059.15	1,802,125.55
其中：支付销售机构的客户维护费	19,133.54	19,121.42

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	261,843.21	300,354.24

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

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无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

本基金于本报告期及上年度可比期间均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

本基金于本报告期及上年度可比期间均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

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
报告期初持有的基金份额	14,568,210.29	14,568,210.29
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-

报告期末持有的基金份额	14,568,210.29	14,568,210.29
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	15.14%	11.89%

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）
中国人寿	76,002,600.00	78.97	76,002,600.00	58.99

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
工商银行	1,560,013.06	4,099.12	2,475,195.42	6,893.44

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	27.93	33.03	67	1,871.31	2,213.01	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	271	3,219.48	5,696.42	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	18.88	19.60	93	1,755.84	1,822.80	-

001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	88	1,819.84	2,243.12	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	114	1,753.32	1,695.18	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	38	1,690.24	1,500.24	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	28.84	30.78	112	3,230.08	3,447.36	-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	42.45	32.97	156	6,622.20	5,143.32	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	170	7,004.00	7,257.30	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	99	5,593.50	5,240.07	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	131	4,454.00	4,575.83	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	5日	新股未上市	25.82	25.82	1,490	38,471.80	38,471.80	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	139	6,412.07	4,781.60	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	49.17	112	6,482.56	5,507.04	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	35.66	33.26	200	7,132.00	6,652.00	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	72.50	58.42	91	6,597.50	5,316.22	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	50.00	30.71	242	12,100.00	7,431.82	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	7日	新股未上市	36.90	36.90	930	34,317.00	34,317.00	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	268	8,098.96	6,834.00	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	44.18	25.10	195	6,141.02	4,894.50	锁定期内发生送股
301292	海科新源	2023年6月29日	6日	新股未上市	19.99	19.99	2,912	58,210.88	58,210.88	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	187	5,535.20	13,355.54	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股流通受限	26.80	22.32	376	10,076.80	8,392.32	-
301305	朗坤	2023年5月	6个月	新股流	25.25	19.69	268	6,767.00	5,276.92	-

	环境	月 15 日		通受限						
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	32.34	31.86	243	7,858.62	7,741.98	-
301310	鑫宏业	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流通受限	67.28	65.43	141	9,486.48	9,225.63	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.29	51.12	158	5,101.82	8,076.96	-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股流通受限	20.67	26.17	427	8,826.09	11,174.59	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股流通受限	13.06	20.62	522	6,817.32	10,763.64	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	114	4,452.84	4,487.04	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	76.80	107.95	114	8,755.20	12,306.30	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	405	5,998.05	5,560.65	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流通受限	32.60	30.37	148	4,824.80	4,494.76	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	80	5,876.00	3,731.20	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	337	5,914.35	5,644.75	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	50.00	48.39	118	5,900.00	5,710.02	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	23.77	42.89	271	6,441.67	11,623.19	-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	71.88	92.60	88	6,325.44	8,148.80	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	33.73	31.85	190	6,408.70	6,051.50	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	24.66	22.51	235	5,795.10	5,289.85	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	23.80	32.84	219	5,212.20	7,191.96	-
301383	天键股份	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流通受限	46.16	35.72	197	9,093.52	7,036.84	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	29.99	23.79	217	6,507.83	5,162.43	-
301387	光大同创	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	58.32	45.36	176	10,264.32	7,983.36	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	6 日	新股未上市	26.68	26.68	2,208	58,909.44	58,909.44	-

301397	溯联股份	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	53.27	40.20	131	6,978.37	5,266.20	-
301399	英特科技	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	43.99	51.57	153	6,730.47	7,890.21	-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	486	7,892.64	8,237.70	-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	172	4,532.20	5,263.20	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	28.75	21.02	316	9,085.00	6,642.32	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	279	5,577.21	4,715.10	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	5日	新股未上市	57.66	57.66	1,051	60,600.66	60,600.66	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6日	新股未上市	39.78	39.78	1,346	53,543.88	53,543.88	-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	547	3,599.26	4,146.26	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	209	2,165.24	2,474.56	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	189	2,203.74	2,317.14	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	63	1,636.74	1,545.39	-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	214	3,809.20	3,828.46	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	127	2,019.30	2,170.43	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	159	5,747.85	6,062.67	-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	375	5,310.00	6,078.75	-
688352	顾中科技	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	591	7,151.10	7,133.37	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	23.60	64.67	203	4,790.80	13,128.01	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	208	3,993.60	5,310.24	-
688433	华曙	2023年4月	6个月	新股流	26.66	31.50	176	4,692.16	5,544.00	-

	高科	月 7 日		通受限						
688435	英方软件	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股流通受限	38.66	73.03	2,068	79,948.88	151,026.04	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	37.88	29.49	330	12,500.40	9,731.70	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	75.00	90.76	77	5,775.00	6,988.52	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	5.69	5.41	2,029	11,545.01	10,976.89	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	11.10	17.04	773	8,580.30	13,171.92	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.52	42.37	233	7,577.16	9,872.21	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	33.99	29.49	144	4,894.56	4,246.56	-
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	39.99	36.71	188	7,518.12	6,901.48	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	20.92	19.16	249	5,209.08	4,770.84	-
688522	纳睿雷达	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股流通受限	46.68	51.50	1,455	67,919.40	74,932.50	-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流通受限	21.86	23.85	280	6,120.80	6,678.00	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	152.38	135.97	64	9,752.32	8,702.08	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	35.00	51.23	124	4,340.00	6,352.52	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	43.67	53.05	127	5,546.09	6,737.35	-
688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.17	23.50	263	5,567.71	6,180.50	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	12.68	22.31	392	4,970.56	8,745.52	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	30.26	25.33	196	5,930.96	4,964.68	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股流通受限	135.80	120.41	63	8,555.40	7,585.83	-
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	125.80	118.03	46	5,786.80	5,429.38	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	184	4,920.16	7,485.12	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股流通受限	11.18	14.59	499	5,578.82	7,280.41	-

688603	天承科技	2023年6月30日	6日	新股未上市	55.00	55.00	765	42,075.00	42,075.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	550	5,874.00	6,787.00	-
688623	二元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	52	6,545.76	4,513.08	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	563	5,213.38	10,466.17	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	153	3,867.84	4,570.11	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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银行间市场债券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交易所市场债券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

本基金于本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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以董事会风险管理委员会为核心的，由董事会风险管理委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计

息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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在基金运作过程中严格按照相关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的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持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，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现

金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 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	1,560,013.06	-	-	-	1,560,013.06
结算备付金	86,212.56	-	-	-	86,212.56
存出保证金	11,927.71	-	-	-	11,927.71
交易性金融资产	9,403,480.19	-	-	-143,597,882.38	153,001,362.57
应收股利	-	-	-	28,767.64	28,767.64
应收清算款	-	-	-	269,342.04	269,342.04
资产总计	11,061,633.52	-	-	-143,895,992.06	154,957,625.58
负债					
应付赎回款	-	-	-	64.39	64.39
应付管理人报酬	-	-	-	217,174.45	217,174.45
应付托管费	-	-	-	36,195.73	36,195.73
应付清算款	-	-	-	28,870.33	28,870.33
其他负债	-	-	-	224,362.32	224,362.32
负债总计	-	-	-	506,667.22	506,667.22
利率敏感度缺口	11,061,633.52	-	-	-143,389,324.84	154,450,958.36
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	2,477,067.21	-	-	-	2,477,067.21
结算备付金	105,418.30	-	-	-	105,418.30
存出保证金	8,501.60	-	-	-	8,501.60
交易性金融资产	12,416,079.81	-	-	-196,129,548.09	208,545,627.90
应收清算款	-	-	-	384,863.53	384,863.53
资产总计	15,007,066.92	-	-	-196,514,411.62	211,521,478.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,087.25	8,087.25
应付管理人报酬	-	-	-	268,276.92	268,276.92
应付托管费	-	-	-	44,712.84	44,712.84
应交税费	-	-	-	0.36	0.36
其他负债	-	-	-	247,570.36	247,570.36
负债总计	-	-	-	568,647.73	568,647.73
利率敏感度缺口	15,007,066.92	-	-	-195,945,763.89	210,952,830.81

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为 6.09%(2022 年 12 月 31 日：5.89%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

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，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 6 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	17,334,007.69	-	17,334,007.69
应收股利	-	28,767.64	-	28,767.64
资产合计	-	17,362,775.33	-	17,362,775.33
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	-	17,362,775.33	-	17,362,775.33
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	27,122,357.37	-	27,122,357.37
资产合计	-	27,122,357.37	-	27,122,357.37
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	-	27,122,357.37	-	27,122,357.37

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	假设本基金的单一外币汇率变化 5%，其他变量不变；	
	此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动。	
分析	相关风险变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	量的变动	本期末 (2023 年 6 月 30 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	+5 个基准点	868,138.77	1,356,117.87
	-5 个基准点	-868,138.77	-1,356,117.87

注：此表为外汇风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，汇率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的股票公允价值的变动对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

基金管理人通过对宏观经济和资本市场的深入分析，采用主动的投资管理策略，把握不同时期各金融市场的收益水平，在约定的投资比例下，合理配置股票、债券、货币市场工具等各类资产，在严格控制下行风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 6 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	143,597,882.38	92.97	196,129,548.09	92.97
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	9,403,480.19	6.09	12,416,079.81	5.89
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	153,001,362.57	99.06	208,545,627.90	98.86

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	+5%	7,267,120.25	11,393,752.96
	-5%	-7,267,120.25	-11,393,752.96

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。此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、可能的变动时，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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	142,450,335.41	195,231,083.48
第二层次	9,749,608.85	12,416,079.81
第三层次	801,418.31	898,464.61
合计	153,001,362.57	208,545,627.90

6.4.14.2.2 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和债券，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，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和债券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、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

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资产和负债主要包括应收款项和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	143,597,882.38	92.67
	其中：股票	143,597,882.38	92.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,403,480.19	6.07
	其中：债券	9,403,480.19	6.07
	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	1,646,225.62	1.06
8	其他各项资产	310,037.39	0.20
9	合计	154,957,625.58	100.00

注：上述表权益投资中通过港股通交易机制投资的港股金额为人民币 17,334,007.69 元，占基金净资产的比例为 11.22%。

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	-	-
C	制造业	122,408,595.50	79.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.02
E	建筑业	4,487.57	0.00
F	批发和零售业	23,370.23	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	778,549.11	0.50
J	金融业	2,233,200.00	1.45
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	756,810.75	0.49
N	水利、环境和公共设施管理业	10,058.52	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	13,355.54	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	126,263,874.69	81.75

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（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	3,668,226.51	2.38
消费者常用品	1,902,966.72	1.23
能源	-	-
金融	5,292,681.51	3.43
医疗保健	1,201,708.74	0.78
工业	-	-
信息技术	1,008,738.32	0.65
电信服务	4,259,685.89	2.76
公用事业	-	-
地产建筑业	-	-
合计	17,334,007.69	11.22

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	300470	中密控股	120,040	5,548,248.80	3.59
2	600519	贵州茅台	3,000	5,073,000.00	3.28
3	603876	鼎胜新材	187,000	3,588,530.00	2.32
4	300443	金雷股份	98,000	3,474,100.00	2.25
5	688121	卓然股份	92,000	3,440,800.00	2.23
6	00700	腾讯控股	10,800	3,301,868.53	2.14
7	002475	立讯精密	92,895	3,014,442.75	1.95
8	300769	德方纳米	27,020	2,978,414.60	1.93
9	603345	安井食品	20,000	2,936,000.00	1.90
10	300750	宁德时代	12,000	2,745,480.00	1.78
11	603063	禾望电气	88,000	2,706,000.00	1.75
12	00388	香港交易所	9,800	2,667,251.26	1.73
13	01299	友邦保险	36,000	2,625,430.25	1.70
14	002372	伟星新材	121,200	2,489,448.00	1.61
15	600276	恒瑞医药	51,800	2,481,220.00	1.61
16	002126	银轮股份	134,000	2,371,800.00	1.54
17	600031	三一重工	134,172	2,231,280.36	1.44
18	300217	东方电热	374,300	2,193,398.00	1.42
19	000860	顺鑫农业	65,000	2,189,850.00	1.42
20	03690	美团-W	18,800	2,119,853.30	1.37
21	000333	美的集团	32,723	1,928,039.16	1.25
22	603195	公牛集团	20,054	1,926,387.24	1.25
23	603878	武进不锈	226,000	1,909,700.00	1.24
24	00291	华润啤酒	40,000	1,902,966.72	1.23
25	601311	骆驼股份	204,200	1,894,976.00	1.23
26	301273	瑞晨环保	60,089	1,884,391.04	1.22
27	300124	汇川技术	28,700	1,842,827.00	1.19
28	002415	海康威视	55,000	1,821,050.00	1.18
29	300408	三环集团	61,700	1,810,895.00	1.17
30	688288	鸿泉物联	68,088	1,730,796.96	1.12
31	600887	伊利股份	58,400	1,653,888.00	1.07
32	603899	晨光股份	34,400	1,535,616.00	0.99
33	688355	明志科技	50,000	1,521,000.00	0.98
34	600036	招商银行	45,000	1,474,200.00	0.95
35	603486	科沃斯	18,300	1,423,191.00	0.92
36	603867	新化股份	35,000	1,417,500.00	0.92
37	688080	映翰通	28,751	1,405,923.90	0.91
38	002960	青鸟消防	75,000	1,365,750.00	0.88
39	688007	光峰科技	65,016	1,355,583.60	0.88
40	300041	回天新材	114,200	1,347,560.00	0.87

41	600559	老白干酒	53,600	1,313,736.00	0.85
42	002850	科达利	9,900	1,309,275.00	0.85
43	002600	领益智造	188,000	1,299,080.00	0.84
44	300421	力星股份	108,800	1,299,072.00	0.84
45	603517	绝味食品	34,522	1,282,492.30	0.83
46	002311	海大集团	26,866	1,258,403.44	0.81
47	002493	荣盛石化	108,000	1,257,120.00	0.81
48	002675	东诚药业	85,100	1,251,821.00	0.81
49	002959	小熊电器	14,600	1,219,100.00	0.79
50	002801	微光股份	44,000	1,190,640.00	0.77
51	600885	宏发股份	37,235	1,185,934.75	0.77
52	688633	星球石墨	26,568	1,179,353.52	0.76
53	603816	顾家家居	30,200	1,152,130.00	0.75
54	001255	博菲电气	30,000	1,143,600.00	0.74
55	000568	泸州老窖	5,100	1,068,807.00	0.69
56	601689	拓普集团	13,050	1,053,135.00	0.68
57	002402	和而泰	61,800	1,049,364.00	0.68
58	002979	雷赛智能	43,800	1,040,688.00	0.67
59	601799	星宇股份	8,400	1,038,240.00	0.67
60	603583	捷昌驱动	47,482	1,022,762.28	0.66
61	603668	天马科技	67,200	1,010,016.00	0.65
62	02382	舜宇光学科技	14,000	1,008,738.32	0.65
63	603203	快克智能	31,278	962,736.84	0.62
64	01024	快手-W	19,400	957,817.36	0.62
65	000596	古井贡酒	3,800	940,044.00	0.61
66	300767	震安科技	36,000	912,960.00	0.59
67	603833	欧派家居	9,500	910,100.00	0.59
68	600882	妙可蓝多	40,600	904,568.00	0.59
69	002025	航天电器	14,000	893,200.00	0.58
70	002236	大华股份	45,000	888,750.00	0.58
71	001311	多利科技	15,219	874,027.17	0.57
72	002993	奥海科技	25,000	848,000.00	0.55
73	688208	道通科技	27,968	847,710.08	0.55
74	300057	万顺新材	100,000	840,000.00	0.54
75	02313	申洲国际	12,000	827,016.06	0.54
76	002518	科士达	20,500	820,205.00	0.53
77	002935	天奥电子	38,800	767,464.00	0.50
78	000819	岳阳兴长	39,000	763,620.00	0.49
79	002142	宁波银行	30,000	759,000.00	0.49
80	000786	北新建材	30,000	735,300.00	0.48
81	09926	康方生物	22,000	717,023.85	0.46
82	002139	拓邦股份	50,000	652,500.00	0.42
83	688308	欧科亿	16,020	640,800.00	0.41

84	600587	新华医疗	18,000	635,940.00	0.41
85	300347	泰格医药	9,000	580,860.00	0.38
86	300496	中科创达	6,000	578,100.00	0.37
87	603181	皇马科技	50,073	557,813.22	0.36
88	600690	海尔智家	22,000	516,560.00	0.33
89	688006	杭可科技	16,000	487,520.00	0.32
90	02269	药明生物	14,000	484,684.89	0.31
91	09868	小鹏汽车-W	8,000	368,792.00	0.24
92	00175	吉利汽车	40,000	352,565.15	0.23
93	002773	康弘药业	18,000	344,160.00	0.22
94	688311	盟升电子	3,200	223,808.00	0.14
95	688581	安杰思	1,660	203,128.24	0.13
96	688475	萤石网络	4,105	175,940.30	0.11
97	688073	毕得医药	2,400	169,872.00	0.11
98	688435	英方软件	2,068	151,026.04	0.10
99	688257	新锐股份	3,247	86,077.97	0.06
100	603801	志邦家居	2,400	79,248.00	0.05
101	688522	纳睿雷达	1,455	74,932.50	0.05
102	001301	尚太科技	1,164	65,544.84	0.04
103	301486	致尚科技	1,051	60,600.66	0.04
104	301395	仁信新材	2,208	58,909.44	0.04
105	301292	海科新源	2,912	58,210.88	0.04
106	301232	飞沃科技	904	54,657.19	0.04
107	301488	豪恩汽电	1,346	53,543.88	0.03
108	688582	芯动联科	1,040	47,588.72	0.03
109	688603	天承科技	765	42,075.00	0.03
110	301202	朗威股份	1,490	38,471.80	0.02
111	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
112	301261	恒工精密	930	34,317.00	0.02
113	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.01
114	301301	川宁生物	1,546	13,852.16	0.01
115	301293	三博脑科	187	13,355.54	0.01
116	688472	阿特斯	773	13,171.92	0.01
117	688361	中科飞测	203	13,128.01	0.01
118	301325	曼恩斯特	114	12,306.30	0.01
119	301358	湖南裕能	271	11,623.19	0.01
120	301317	鑫磊股份	427	11,174.59	0.01
121	688469	中芯集成	2,029	10,976.89	0.01
122	301320	豪江智能	522	10,763.64	0.01
123	688629	华丰科技	563	10,466.17	0.01
124	688478	晶升股份	233	9,872.21	0.01
125	688443	智翔金泰	330	9,731.70	0.01
126	301310	鑫宏业	141	9,225.63	0.01

127	688562	航天软件	392	8,745.52	0.01
128	688531	日联科技	64	8,702.08	0.01
129	301303	真兰仪表	376	8,392.32	0.01
130	301408	华人健康	486	8,237.70	0.01
131	301360	荣旗科技	88	8,148.80	0.01
132	301315	威士顿	158	8,076.96	0.01
133	301387	光大同创	176	7,983.36	0.01
134	301399	英特科技	153	7,890.21	0.01
135	301307	美利信	243	7,741.98	0.01
136	688576	西山科技	63	7,585.83	0.00
137	301246	宏源药业	242	7,431.82	0.00
138	688593	新相微	499	7,280.41	0.00
139	301141	中科磁业	170	7,257.30	0.00
140	301382	蜂助手	219	7,191.96	0.00
141	688352	颀中科技	591	7,133.37	0.00
142	301383	天键股份	197	7,036.84	0.00
143	688458	美芯晟	77	6,988.52	0.00
144	688484	南芯科技	188	6,901.48	0.00
145	301262	海看股份	268	6,834.00	0.00
146	688620	安凯微	550	6,787.00	0.00
147	688543	国科军工	127	6,737.35	0.00
148	688523	航天环宇	280	6,678.00	0.00
149	301225	恒勃股份	200	6,652.00	0.00
150	301429	森泰股份	316	6,642.32	0.00
151	688535	华海诚科	124	6,352.52	0.00
152	688552	航天南湖	263	6,180.50	0.00
153	688334	西高院	375	6,078.75	0.00
154	688146	中船特气	159	6,062.67	0.00
155	301373	凌玮科技	190	6,051.50	0.00
156	301227	森鹰窗业	218	6,045.14	0.00
157	301357	北方长龙	118	5,710.02	0.00
158	001287	中电港	271	5,696.42	0.00
159	301355	南王科技	337	5,644.75	0.00
160	301332	德尔玛	405	5,560.65	0.00
161	688433	华曙高科	176	5,544.00	0.00
162	301210	金杨股份	112	5,507.04	0.00
163	301223	中荣股份	291	5,447.52	0.00
164	301290	东星医疗	167	5,352.35	0.00
165	688429	时创能源	208	5,310.24	0.00
166	301376	致欧科技	235	5,289.85	0.00
167	301305	朗坤环境	268	5,276.92	0.00
168	301397	溯联股份	131	5,266.20	0.00
169	301428	世纪恒通	172	5,263.20	0.00

170	301157	华塑科技	99	5,240.07	0.00
171	301386	未来电器	217	5,162.43	0.00
172	300804	广康生化	156	5,143.32	0.00
173	688570	天玛智控	196	4,964.68	0.00
174	301281	科源制药	195	4,894.50	0.00
175	301203	国泰环保	139	4,781.60	0.00
176	688512	慧智微	249	4,770.84	0.00
177	301439	泓淋电力	279	4,715.10	0.00
178	301170	锡南科技	131	4,575.83	0.00
179	688631	莱斯信息	153	4,570.11	0.00
180	688623	二元科技	52	4,513.08	0.00
181	301337	亚华电子	148	4,494.76	0.00
182	301323	新莱福	114	4,487.04	0.00
183	688479	友车科技	144	4,246.56	0.00
184	601061	中信金属	547	4,146.26	0.00
185	603135	中重科技	214	3,828.46	0.00
186	301345	涛涛车业	80	3,731.20	0.00
187	001380	华纬科技	112	3,447.36	0.00
188	601065	江盐集团	209	2,474.56	0.00
189	601133	柏诚股份	189	2,317.14	0.00
190	001328	登康口腔	88	2,243.12	0.00
191	001282	三联锻造	67	2,213.01	0.00
192	603137	恒尚节能	127	2,170.43	0.00
193	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
194	001324	长青科技	93	1,822.80	0.00
195	001360	南矿集团	114	1,695.18	0.00
196	603125	常青科技	63	1,545.39	0.00
197	001367	海森药业	38	1,500.24	0.00

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	301273	瑞晨环保	3,273,571.00	1.55
2	601311	骆驼股份	2,907,322.00	1.38
3	300769	德方纳米	2,493,403.00	1.18
4	603063	禾望电气	2,473,742.00	1.17
5	300443	金雷股份	2,381,119.98	1.13
6	688121	卓然股份	2,341,703.00	1.11
7	000860	顺鑫农业	2,262,090.00	1.07
8	603878	武进不锈	1,940,550.00	0.92
9	600559	老白干酒	1,904,494.52	0.90
10	688288	鸿泉物联	1,773,381.07	0.84
11	603668	天马科技	1,758,061.00	0.83

12	002600	领益智造	1,491,500.00	0.71
13	002518	科士达	1,328,234.00	0.63
14	688355	明志科技	1,320,297.56	0.63
15	603486	科沃斯	1,319,674.00	0.63
16	001255	博菲电气	1,278,554.00	0.61
17	002236	大华股份	1,242,760.00	0.59
18	688080	映翰通	1,223,394.14	0.58
19	001311	多利科技	1,146,705.13	0.54
20	002025	航天电器	1,131,724.00	0.54

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（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	002517	恺英网络	3,267,956.00	1.55
2	300870	欧陆通	3,024,143.00	1.43
3	603027	千禾味业	2,959,895.00	1.40
4	603181	皇马科技	2,364,045.00	1.12
5	300496	中科创达	2,327,091.00	1.10
6	002991	甘源食品	2,161,124.00	1.02
7	603203	快克智能	2,121,589.00	1.01
8	600519	贵州茅台	2,084,815.00	0.99
9	300470	中密控股	2,039,586.00	0.97
10	688628	优利德	1,883,185.94	0.89
11	600036	招商银行	1,876,879.00	0.89
12	603317	天味食品	1,838,452.70	0.87
13	600690	海尔智家	1,763,610.00	0.84
14	600031	三一重工	1,727,976.00	0.82
15	300699	光威复材	1,665,361.00	0.79
16	688059	华锐精密	1,633,080.85	0.77
17	603876	鼎胜新材	1,587,291.00	0.75
18	300568	星源材质	1,576,913.55	0.75
19	002415	海康威视	1,516,524.00	0.72
20	603345	安井食品	1,450,758.00	0.69

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（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	60,221,319.26
卖出股票收入（成交）总额	108,115,598.84

注：本项的“买入股票成本”、“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	9,403,480.19	6.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中: 政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,403,480.19	6.09

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	019688	22 国债 23	50,000	5,055,963.01	3.27
2	019694	23 国债 01	42,000	4,246,605.04	2.75
3	019670	22 国债 05	1,000	100,912.14	0.07

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, 江苏鼎胜新能源材料股份有限公司在报

告编制日前一年内曾受到地方海关的处罚；江苏鼎胜新能源材料股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方应急管理厅的处罚；江苏鼎胜新能源材料股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方自然资源厅的处罚；江苏鼎胜新能源材料股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到生态环境部的处罚；江苏鼎胜新能源材料股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会或其派出机构的处罚；上海卓然工程技术股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方国税局的处罚。

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。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

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，没有投资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	11,927.71
2	应收清算款	269,342.04
3	应收股利	28,767.64
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	310,037.39

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券。

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制的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，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	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	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 (%)
11,577	8,313.04	92,881,125.42	96.51	3,358,948.98	3.49

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	1,206,983.97	1.25

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2018 年 4 月 28 日) 基金份额总额	233,430,478.74
本报告期期初基金份额总额	128,848,379.55
本报告期基金总申购份额	2,377,188.09
减：本报告期基金总赎回份额	34,985,493.24
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	96,240,074.40

注：报告期内基金总申购份额含红利再投资和转换入份额，基金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

本报告期内，基金管理人于 2023 年 1 月 4 日发布公告，鄂华先生自 2023 年 1 月 3 日起任公司总经理、董事，左季庆先生于 2023 年 1 月 3 日离任公司总经理、董事；基金管理人于 2023 年 1 月 6 日发布公告，韩占锋先生自 2023 年 1 月 5 日起任公司督察长，申梦玉先生于 2023 年 1 月 5 日离任公司督察长；基金管理人于 2023 年 1 月 6 日发布公告，董瑞倩女士于 2023 年 1 月 5 日离任公司固定收益投资总监。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门均未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，自 2021 年 10 月 20 日起，改聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

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，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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 (%)	
中信证券	2	78,490,188.15	48.57	72,987.48	52.11	-
长江证券	2	38,519,112.91	23.84	28,145.34	20.10	-
国泰君安	2	31,587,647.95	19.55	29,418.23	21.00	-
银河证券	2	13,002,639.41	8.05	9,508.71	6.79	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 综合实力较强、市场信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营状况稳健；

- (3) 经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- (4) 研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；
- (5) 具有丰富的投行资源和大宗交易信息，愿意积极为我公司提供相关投资机会，能够对公司业务形成支持；
- (6) 具有费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；
- (7) 从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1) 公司根据上述标准确定选用交易单元的证券经营机构；
- (2) 公司和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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 (%)
中信证券	199,599.59	1.62	-	-	-	-
长江证券	3,597,244.00	29.26	-	-	-	-
国泰君安	2,800,436.00	22.78	-	-	-	-
银河证券	5,695,836.00	46.33	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

本报告期内，本基金无其他重大事件。

§ 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		区间					
机构	1	20230101~2023 0612	32,958,423.37	0.00	32,958,423.37	0.00	0.00
	2	20230101~2023 0630	76,002,600.00	0.00	0.00	76,002,600.00	78.97
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20% 的情形,可能存在大额赎回的风险,并导致基金净值波动。此外,机构投资者赎回后,可能导致基金规模大幅减小,不利于基金的正常运作。</p> <p>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,并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。</p>							

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

12.1.1 中国证监会批准国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

12.1.2 《国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

12.1.3 《国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

12.1.5 报告期内国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

12.1.6 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司,地址:北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

12.3 查阅方式

12.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

12.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息: www.gsfc.com.cn

12.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询: 4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日