

博道嘉泰回报混合型证券投资基金

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2024 年 03 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年3月27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。

本报告期自2023年01月01日起至2023年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
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	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	64
8.1 期末基金资产组合情况	64
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	65
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	66
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	73
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	73
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	73
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	73
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	74

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	74
8.12 投资组合报告附注.....	74
§9 基金份额持有人信息.....	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	75
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	75
§10 开放式基金份额变动.....	75
§11 重大事件揭示.....	76
11.1 基金份额持有人大会决议.....	76
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76
11.4 基金投资策略的改变.....	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	77
11.8 其他重大事件.....	78
§12 备查文件目录.....	80
12.1 备查文件目录.....	80
12.2 存放地点.....	80
12.3 查阅方式.....	81

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道嘉泰回报混合型证券投资基金
基金简称	博道嘉泰回报混合
基金主代码	008208
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年12月19日
基金管理人	博道基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	587,235,589.48份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置和投资管理，力争实现长期稳健的投资回报。
投资策略	充分发挥基金管理人的研究优势，在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，确定并动态调整大类资产的投资比例。通过宏观、中观和微观不同层面影响行业景气度和行业市场表现因素的综合分析，挑选出预期具有较好市场表现的行业，选择个股时重点关注具有良好治理结构、独特商业模式、领先技术、有核心竞争力的产品以及优秀管理能力、具有稳定持续分红能力、估值水平合理的企业。本基金债券投资策略主要包括久期管理策略、期限结构配置策略、类属配置策略、个券选择等积极的投资策略。本基金的可转换债券和可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、流通受限证券投资策略、存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证800指数收益率×30%+三年期人民币定期存款基准利率（税后）×70%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市

	场基金。
--	------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	博道基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛
	联系电话	021-80226288
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn
客户服务电话	400-085-2888	95595
传真	021-80226289	010-63639132
注册地址	上海市虹口区东大名路1158号301室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码	200122	100033
法定代表人	莫泰山	王江

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.bdfund.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼
注册登记机构	博道基金管理有限公司	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023年	2022年	2021年
本期已实现收益	-96,739,326.81	-243,164,831.76	260,669,555.00
本期利润	-127,027,306.09	-479,428,018.70	215,253,096.89
加权平均基金份额 本期利润	-0.1876	-0.5467	0.2598
本期加权平均净值 利润率	-12.09%	-31.72%	13.11%
本期基金份额净值 增长率	-12.55%	-22.12%	18.38%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末	2022年末	2021年末
期末可供分配利润	107,429,288.73	258,408,301.16	674,592,619.38
期末可供分配基金 份额利润	0.1829	0.3359	0.6052
期末基金资产净值	822,139,995.29	1,231,514,622.93	2,291,253,478.92
期末基金份额净值	1.4000	1.6010	2.0557
3.1.3 累计期末指标	2023年末	2022年末	2021年末
基金份额累计净值 增长率	40.00%	60.10%	105.57%

注：1、上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，计入费用后的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。

3.2 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	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④

		准差②	率③	率标准差④		
过去三个月	-3.81%	0.92%	-1.49%	0.24%	-2.32%	0.68%
过去六个月	-9.92%	0.89%	-2.30%	0.25%	-7.62%	0.64%
过去一年	-12.55%	0.91%	-1.37%	0.25%	-11.18%	0.66%
过去三年	-19.38%	1.27%	-4.39%	0.32%	-14.99%	0.95%
自基金合同生效起至今	40.00%	1.32%	5.44%	0.35%	34.56%	0.97%

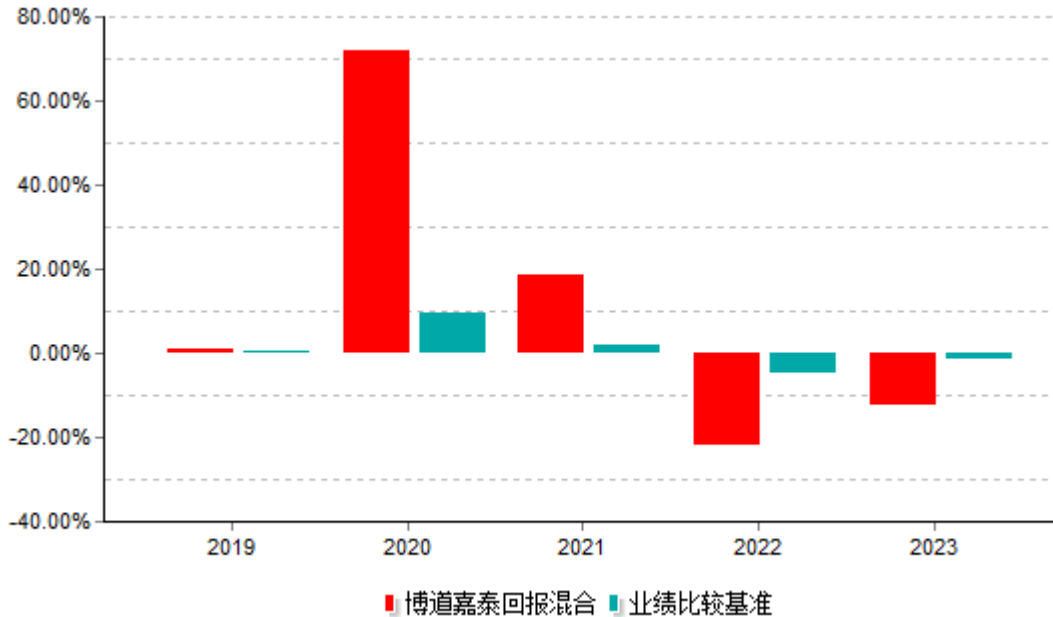
注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

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



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：基金合同生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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

博道基金管理有限公司由中国证监会证监许可[2017]822号文核准设立，于2017年6月12日成立，注册地在中国上海，注册资本为1亿元人民币。截至报告期末，公司旗下发行并管理了28只公募基金：博道启航混合型证券投资基金、博道卓远混合型证券投资基金、博道中证500指数增强型证券投资基金、博道沪深300指数增强型证券投资基金、博道远航混合型证券投资基金、博道叁佰智航股票型证券投资基金、博道志远混合型证券投资基金、博道伍佰智航股票型证券投资基金、博道嘉泰回报混合型证券投资基金、博道久航混合型证券投资基金、博道嘉瑞混合型证券投资基金、博道安远6个月持有期混合型证券投资基金、博道嘉元混合型证券投资基金、博道嘉兴一年持有期混合型证券投资基金、博道睿见一年持有期混合型证券投资基金、博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金、博道嘉丰混合型证券投资基金、博道消费智航股票型证券投资基金、博道盛彦混合型证券投资基金、博道成长智航股票型证券投资基金、博道盛兴一年持有期混

合型证券投资基金、博道研究恒选混合型证券投资基金、博道和瑞多元稳健6个月持有期混合型证券投资基金、博道惠泰优选混合型证券投资基金、博道和祥多元稳健债券型证券投资基金、博道中证1000指数增强型证券投资基金、博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金和博道红利智航股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
张迎军	博道嘉泰回报混合、博道嘉瑞混合、博道嘉元混合、博道嘉兴一年持有期混合、博道嘉丰混合的基金经理、研究总监兼基金投资部总经理	2019-12-19	-	23年	张迎军先生，中国籍，经济学硕士。2000年7月至2003年3月担任申银万国证券研究所市场研究部、策略研究部研究员，2003年4月至2006年11月担任中国太平洋保险（集团）股份有限公司资金运用管理中心投资经理，2006年12月至2008年5月担任太平洋资产管理有限公司组合管理部组合经理，2008年8月至2015年7月担任交银施罗德基金管理有限公司基金经理、固定收益部副总经理、权益部副总经理、投资副总监，2015年9月至2018年11月担任上海放山资产管理有限公司总经理。2019年5月加入博道基金管理有限公司，现任研究总监兼基金投资部总经理。具有基金从业资格。自2019年12月19日起担任博

					道嘉泰回报混合型证券投资基金基金经理至今、自2019年12月30日起担任博道嘉瑞混合型证券投资基金基金经理至今、自2020年3月4日起担任博道嘉元混合型证券投资基金基金经理至今、自2020年10月23日起担任博道嘉兴一年持有期混合型证券投资基金基金经理至今、自2021年2月1日起担任博道嘉丰混合型证券投资基金基金经理至今。
--	--	--	--	--	--

注：1、对基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，"离职日期"为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，"任职日期"和"离职日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

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《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本公司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所管理的所有资产组合投资运作的公平。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。制度中包含的主要控制方法如下：

(1) 公司建立资源共享的投资研究信息平台，所有研究成果对所有投资组合公平开放，确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

(2) 公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度，建立了合理且可操作的公平交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。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。

(3) 公司建立了清晰的投资授权制度，明确各层级投资决策主体的职责和权限划分，组合投资经理充分发挥专业判断能力，不受他人干预，在授权范围内独立行使投资决策权，维护公平的投资管理环境，维护所管理投资组合的合法利益，保证各投资组合交易决策的客观性和独立性，防范不公平及异常交易的发生。

(4) 公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上，根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库，组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

(5) 公司交易部和监察稽核部进行日常投资交易行为监控，监察稽核部负责对各投资组合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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等，本基金管理人未发现违反公平交易制度的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，本公司管理的所有投资组合参与交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况共发生10次，经检查未发现异常；本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

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A股市场波动幅度超过年初市场预期。全年沪深300下跌11.38%，中证500下跌7.42%，中证1000下跌6.28%，上证指数下跌3.70%，创业板指下跌19.41%，恒生指数下跌13.82%。从行业来看，通信、传媒、煤炭表现较好，分别上涨了24.78%、19.84%、13.39%，消费者服务、房地产、电力设备新能源表现较差，分别下跌41.18%、24.80%、24.65%。虽然本基金2022年4季度前十大重仓股中布局的人工智能、造船等行业龙头公司在2023年全年股价表现很不错，2023年下半年在半导体设备、煤炭、减肥药等行业与

板块的配置也均获得较好收益，但由于本基金重仓的新能源行业全年股价跌幅巨大且大幅低于预期，本基金2023年全年业绩表现相对较弱。

“周期之上有周期”，相信经历过2023年A股市场洗礼后，对这句名言的深刻内涵会有进一步的理解。

2023年的A股市场无疑是艰难的。按照“政策底--市场底--经济底”的历史经验，先有政策底，经过一到两个季度的时间传导，形成经济底，投资者预期先行的缘故，市场底一般会在政策底与经济底之间形成。而这一次，无论是宏观经济政策，还是针对股市的利好政策，都清晰地表明了政策底的出现，尽管是弱复苏，以季度GDP度量的经济增长，也在疫情后进入复苏趋势，为什么投资者期盼的市场底却还没有有效形成？

2023年A股市场的焦点矛盾，可以用一句话来概括：如果2022年A股市场表现归因为以外因（美联储加息、海外地缘政治冲突、疫情影响）为主，那么2023年A股市场的疲弱则将其归因为内外因结合。2022年在经济基本面没有发生明显好转的情况下，A股市场在2022年4月26日和10月底却能走出了两轮力度较大的上涨行情，可以理解为市场相信，外因主导的负面冲击总会随着时间的推移过去。当这些外因消除，重新回到正常场景时，经济增长与股票市场会回到原来的轨道运行，所以多数投资者按照原有周期轮回的预期依旧存在。回顾2023年，从市场层面来看，仍然存在一些中期的核心问题：1）从大的周期角度上来看，中国经济增长进入新旧动能转换期，以住宅为代表的房地产行业承压，短期内新动能还难以有效对冲下行压力，造成上市公司业绩整体承压。2）地方政府债务问题以及债务规模约束，使得货币政策与财政政策效用的向下传导效率下降。从市场本身的角度来看，过往A股市场诞生长期成长股的三大主赛道的投资逻辑都面临挑战，具体来看包括：1）城镇化：以房地产为代表的相关产业链受到房地产进入下行周期的影响。房地产产业链是过去20年里A股市场诞生很多十倍股的赛道，当房地产行业整体承压时，这些产业链的所有投资逻辑都需重新审视。2）消费：当投资者预期会从消费升级进入阶段性的消费降级时，整个食品饮料板块总体估值就会处于收缩过程之中。3）制造业：制造业追求规模经济，价格战在所难免。当经济处于下行周期时有较高需求增长的中游制造行业，反而因竞争加剧导致行业竞争格局恶化，例如2023年的新能源行业。当以上三个主要赛道中长期的投资逻辑都出现阶段性的改变时，整个市场就缺乏中长周期比较清晰可以持续的领涨主线了。

如果站在周期视角讨论问题，会发现A股市场正在经历多重周期共振的影响。长周期的人口周期与地缘政治周期，中周期的地产周期与地方债务约束周期，短周期的美联储加息周期与疫情的伤疤效应，以及更短周期的国内经济库存周期，各种负面影响从各种维度冲击影响了2023年的A股市场与投资者的预期，因此，本轮市场底出现的条件与构筑的方式才会与过往周期有所不同。

站在2023年底时点看，我们认为不宜继续悲观。首先，让市场信心不足的两个焦点问题是房地产下行与地方债务问题，政策方案已逐步清晰，三个着力点--保障性住房、

城中村改造、“平急两用”基础设施，逐步勾画出了未来房地产发展新模式的基本轮廓。增发国债替换部分地方债务、规范约束地方政府财政预算，有利于防范化解局部金融风险的爆发。而且我们要注意到，预期在5%以上的2023年中国经济增速，是在房地产下行并且没有强刺激政策出台的背景下实现的。也就是说，中国经济增长结构转型正在取得明显进步。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金份额净值及业绩表现请见"3.1 主要会计数据和财务指标"及"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"部分披露。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2024年，宏观层面的核心看点几乎与2023年一样，决定估值的分子端--中国经济的持续复苏，分母端--美联储是否有降息趋势。我们认为，美联储有较大概率进入降息周期，中国经济增长去地产化的结构转型趋势还将继续，预期这两个因素都有望对市场产生积极影响，分歧点主要在弹性上。

虽然股票市场是宏观经济与社会发展的映射，但股票市场有其自身的规律。现阶段A股市场最大的利好，就是股价包含足够的负面预期（例如沪深300指数股权风险溢价处于两倍标准差的水平），目前政策环境也是相对处于历史上最好的时期，我们应该用乐观态度关注政策与市场出现的积极变化（例如部分行业底部的出现）。基于资产溢价的情况看，股市股权风险溢价再度达到2倍标准差的水平，而债券市场的期限利率和信用利差已经被压到极致，从中长期战略配置角度判断，虽然很难准确预测股票债券资产溢价何时回归，但方向是明确的，目前A股的定价与估值水平存在较大的修正空间与投资机会。

经过2023年市场的洗礼，展望2024年的A股市场，本基金管理人认为可以从以下几个维度去寻找投资机会。

1、周期视角：美联储是否有更为明确的信号开启降息周期，以及中国经济在没有强刺激政策下进一步延续复苏态势，是决定是否会有春季躁动行情以及行情力度的重要变量。

2、深度价值投资机会：在投资者对经济增长前景信心不足，市场处于底部区域时期，往往会出现较好的深度价值投资机会，深度价值的标准如下：第一、PE/PB指标衡量的估值处于很低水平。第二、较高且稳定的分红率。随着中国经济从高速增长阶段向高质量增长阶段转变，一些行业的供给侧开始出清，龙头公司资本开支逐渐下降，伴随着政策鼓励分红，高比例分红成为常态化，行业的周期属性减弱价值特征增强，这样，深度价值投资机会就逐渐呈现。无论从赔率还是胜率判断，深度价值或都是投资的最佳击球点。低波红利类资产从2021年到2023年连续三年走强，我们认为伴随中国经济结构

的转变、资本市场真正深度价值的回归，在较为不确定世界中，相关板块的资源资产优势，使得红利具有长期的投资价值，而国企改革，尤其是国央企改革+资本市场改革的融合，可能意味着重估期权。

3、关注新的变化，追随创新步伐：当周期处于下行阶段，市场的焦点会更多聚焦在新的变化上。而创新特别是科技创新，则是最耀眼的变化。作为中国科技创新的代表之一，华为无疑值得关注，密切跟踪华为产业链可能是追随创新步伐的便捷路径。此外，2024年新的变化还可能自于两个方面，预期内的，比如对A股市场相关制度完善与经济刺激的政策，预期外的，比如时局变化与市场周期运行误判的纠偏。

4、寻找有品牌有定价权的出海企业：当“产能过剩、内需不足、内循环依然存在堵点”时，出口不仅具有宏观意义，在中观与微观也具有重要意义。相对而言，一些海外发达国家在专利保护、品牌意识、反不正当价格竞争等方面，为企业创造了更好的商业环境。当部分出海的中国企业逐步树立自身品牌具备定价权时，获得高于国内市场并且相对稳定的毛利与净利率，这样的成长股投资逻辑会更能被市场所接受。

5、“困境反转”类公司：2023年，传媒、计算机等板块表现突出，一方面可能是源于插上了人工智能的翅膀，更深层次的原因，本基金认为是具备了“困境反转”的基本条件。经过2年多的市场下跌，目前多数行业与公司的股价与基本面都处于寻底区域，也就具备了“困境”的一些基本特征。是否出现“反转”的契机，一方面需要关注经济与行业运行周期的变化，特别是二阶拐点的出现，另一方面需要关注外部变量的产生。外部变量可以是政策，也可以是技术创新的外溢效应，或者其他。此外，我们观察到2023年产业主题投资在A股市场重新占据重要位置，预计2024年这一趋势仍将延续。而主题投资与“困境反转”具有诸多共振的元素，因此，2024年A股市场最大的投资机会可能依然还是来自于看似产业主题投资的“困境反转”类机会。对于坚持价值投资框架的主动管理型基金经理而言，需要与时俱进，不断完善与升级自我的投资框架，才能更好地把握“困境反转”类投资机会。

本基金将坚持“以长期视角正确把握公司的合理价值，以合理价格买入优秀公司”的基本原则，尊重市场、顺势而为，面对市场出现的新变化，在控制组合整体风险的前提下，保持开放心态努力参与，勤勉尽责，力争为投资者获得有竞争力的收益水平。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023年度，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管理人监督管理办法》、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》等有关法规，本基金管理人诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，落实风险控制，强化监察稽核职能，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金投资人的合法权益。本报告期内，本基金管理人为了确保公司业务的规范运作，主要做了以下工作：

（一）持续完善公司内部控制制度和业务流程，推动制度流程的及时更新。

公司持续以提升制度和业务流程的指导性和执行力为强化内部控制的重要抓手，以内部管理制度的全面修订和公司主要业务流程的梳理为工作重点。结合本报告期新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，贯彻落实新法规及新的监管要求。公司着重关注于公司的核心增值流程，通过对流程的研究、梳理、再造等过程实现管理上风险和回报的平衡。

（二）深化事前事中合规及风险管理，提高合规管理及风险控制有效性。

强化事前事中合规审查，严格审核信息披露文件、基金宣传推介材料等，着力防范各类合规风险。在风险管理方面，夯实事前防范、事中控制和事后监督等各阶段工作，重点加强对信用风险、流动性风险等风险的管理。

（三）全面开展内部监督检查，强化公司内部控制。

公司监察稽核部坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察。通过对基金投资、销售、运营等部门的内部控制关键点进行定期和不定期检查，促进公司内部控制制度规范、执行有效，风险管理水平不断提升。

（四）强化培训教育，持续提高全员风险合规意识。

公司积极推动各项新法规落实和风险合规教育工作。通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、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，估值委员会成员由营运分管领导、督察长、基金事务部负责人、投委会主席、研究部负责人、投资运营部负责人、监察稽核部负责人及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的投资研究相关人员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司估值委员会审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，中国光大银行股份有限公司在博道嘉泰回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《博道嘉泰回报混合型证券投资基金2023年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第26542号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	博道嘉泰回报混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了博道嘉泰回报混合型证券投资基金(以下简称“博道嘉泰回报混合基金”)的财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表,2023年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了博道嘉泰回报混合基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于博道嘉泰回报混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无

其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>博道嘉泰回报混合基金的基金管理人博道基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估博道嘉泰回报混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算博道嘉泰回报混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督博道嘉泰回报混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未</p>

	<p>能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对博道嘉泰回报混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博道嘉泰回报混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	叶尔甸、李隐煜
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼
审计报告日期	2024-03-22

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博道嘉泰回报混合型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	50,551,594.46	10,423,359.70
结算备付金		2,978.46	2,954.43
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	773,246,335.41	1,163,467,110.22
其中：股票投资		649,634,169.60	936,577,021.64
基金投资		-	-
债券投资		123,612,165.81	226,890,088.58
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	59,981,654.80
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		52,508.45	127,982.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		823,853,416.78	1,234,003,061.74
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		-	-
应付赎回款		571,894.86	803,588.68
应付管理人报酬		826,724.86	1,298,454.66
应付托管费		103,340.61	162,306.82
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,321.01	1,794.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	210,140.15	222,294.48
负债合计		1,713,421.49	2,488,438.81
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	587,235,589.48	769,193,705.32
未分配利润	7.4.7.8	234,904,405.81	462,320,917.61
净资产合计		822,139,995.29	1,231,514,622.93
负债和净资产总计		823,853,416.78	1,234,003,061.74

注：报告截止日2023年12月31日，基金份额净值1.4000元，基金份额总额587,235,589.48份。

7.2 利润表

会计主体：博道嘉泰回报混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
一、营业总收入		-112,580,738.92	-458,671,972.93
1.利息收入		799,864.93	1,295,420.76
其中：存款利息收入	7.4.7.9	197,837.99	151,383.27
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		602,026.94	1,144,037.49
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-83,283,783.64	-225,477,632.26
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-67,801,007.23	-234,815,421.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-23,276,827.76	1,653,306.74
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	7,794,051.35	7,684,482.22
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-30,287,979.28	-236,263,186.94
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	191,159.07	1,773,425.51
减：二、营业总支出		14,446,567.17	20,756,045.77
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	12,657,312.18	18,236,679.92
2.托管费	7.4.10.2.2	1,582,163.96	2,279,585.03
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	20,338.36
其中：卖出回购金融资产支出		-	20,338.36
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		1,376.61	1,557.63

8.其他费用	7.4.7.17	205,714.42	217,884.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-127,027,306.09	-479,428,018.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-127,027,306.09	-479,428,018.70
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-127,027,306.09	-479,428,018.70

7.3 净资产变动表

会计主体：博道嘉泰回报混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	769,193,705.32	462,320,917.61	1,231,514,622.93
二、本期期初净资产	769,193,705.32	462,320,917.61	1,231,514,622.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-181,958,115.84	-227,416,511.80	-409,374,627.64
（一）、综合收益总额	-	-127,027,306.09	-127,027,306.09
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-181,958,115.84	-100,389,205.71	-282,347,321.55
其中：1.基金申购款	84,942,343.77	52,260,605.73	137,202,949.50

2.基金赎回款	-266,900,459.61	-152,649,811.44	-419,550,271.05
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	587,235,589.48	234,904,405.81	822,139,995.29
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,114,585,819.22	1,176,667,659.70	2,291,253,478.92
二、本期期初净资产	1,114,585,819.22	1,176,667,659.70	2,291,253,478.92
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-345,392,113.90	-714,346,742.09	-1,059,738,855.99
(一)、综合收益总额	-	-479,428,018.70	-479,428,018.70
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-345,392,113.90	-234,918,723.39	-580,310,837.29
其中: 1.基金申购款	246,951,514.62	190,194,259.49	437,145,774.11
2.基金赎回款	-592,343,628.52	-425,112,982.88	-1,017,456,611.40
(三)、本期向基金份额持有人分配	-	-	-

利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	769,193,705.32	462,320,917.61	1,231,514,622.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

莫泰山

张丽

严娅

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博道嘉泰回报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[2019]2122号《关于准予博道嘉泰回报混合型证券投资基金注册的批复》注册，由博道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《博道嘉泰回报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299,909,660.46元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2019）第0750号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道嘉泰回报混合型证券投资基金基金合同》于2019年12月19日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为300,004,705.92份基金份额，其中认购资金利息折合95,045.46份基金份额。本基金的基金管理人为博道基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道嘉泰回报混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、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、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）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、同业存单、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、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为30%-80%。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，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为中证800指数收益率×30%+三年期人民币定期存款基准利率（税后）×70%。

本财务报表由本基金的基金管理人博道基金管理有限公司于2024年3月22日批准报出。

7.4.2 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》、《博道嘉泰回报混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(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。

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：

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，

包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映

公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和

资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称"指引")，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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，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债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对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。

(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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	5,451,074.09	6,075,324.68
等于：本金	5,449,874.07	6,073,993.22
加：应计利息	1,200.02	1,331.46
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	45,100,520.37	4,348,035.02
等于：本金	45,098,138.66	4,343,878.07
加：应计利息	2,381.71	4,156.95
减：坏账准备	-	-
合计	50,551,594.46	10,423,359.70

注：其他存款本期末及上年度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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	769,570,703.90	-	649,634,169.60	-119,936,534.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	137,323,977.24	850,787.61	123,612,165.81	-14,562,599.04
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	137,323,977.24	850,787.61	123,612,165.81	-14,562,599.04
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		906,894,681.14	850,787.61	773,246,335.41	-134,499,133.34
项目	上年度末 2022年12月31日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,009,966,109.87	-	936,577,021.64	-73,389,088.23
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	256,501,143.53	1,211,010.88	226,890,088.58	-30,822,065.83
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	256,501,143.53	1,211,010.88	226,890,088.58	-30,822,065.83
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,266,467,253.40	1,211,010.88	1,163,467,110.22	-104,211,154.06

注：如果本报告期末或上年度末本基金持有中国存托凭证，则股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	59,981,654.80	-
银行间市场	-	-
合计	59,981,654.80	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券
无。

7.4.7.5 其他资产
无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	140.15	2,294.48
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用-审计费	80,000.00	90,000.00
预提费用-信息披露费	130,000.00	130,000.00
合计	210,140.15	222,294.48

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	769,193,705.32	769,193,705.32
本期申购	84,942,343.77	84,942,343.77
本期赎回（以“-”号填列）	-266,900,459.61	-266,900,459.61
本期末	587,235,589.48	587,235,589.48

注：

- 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
- 2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

7.4.7.8 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	258,408,301.16	203,912,616.45	462,320,917.61
本期期初	258,408,301.16	203,912,616.45	462,320,917.61
本期利润	-96,739,326.81	-30,287,979.28	-127,027,306.09
本期基金份额交易产生的变动数	-54,239,685.62	-46,149,520.09	-100,389,205.71
其中：基金申购款	26,821,940.10	25,438,665.63	52,260,605.73
基金赎回款	-81,061,625.72	-71,588,185.72	-152,649,811.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	107,429,288.73	127,475,117.08	234,904,405.81

7.4.7.9 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 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
活期存款利息收入	41,136.15	42,683.96

定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	156,677.81	108,675.42
结算备付金利息收入	24.03	23.89
其他	-	-
合计	197,837.99	151,383.27

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
卖出股票成交总额	1,495,336,710.03	1,676,115,599.01
减：卖出股票成本总额	1,559,624,726.95	1,906,869,285.50
减：交易费用	3,512,990.31	4,061,734.73
买卖股票差价收入	-67,801,007.23	-234,815,421.22

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	1,618,344.74	2,466,196.40
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	-24,895,172.50	-812,889.66
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	-23,276,827.76	1,653,306.74

7.4.7.11.2 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12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	321,268,152.92	481,885,548.66
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	343,795,691.33	479,128,828.58
减：应计利息总额	2,367,634.09	3,558,900.41
减：交易费用	-	10,709.33
买卖债券差价收入	-24,895,172.50	-812,889.66

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.13 衍生工具收益

无。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
股票投资产生的股利收益	7,794,051.35	7,684,482.22
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	7,794,051.35	7,684,482.22

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	-30,287,979.28	-236,263,186.94
——股票投资	-46,547,446.07	-189,281,912.81
——债券投资	16,259,466.79	-46,981,274.13
——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	-30,287,979.28	-236,263,186.94

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
基金赎回费收入	191,044.80	1,708,619.68
转换费收入	114.27	64,805.83
合计	191,159.07	1,773,425.51

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产；
2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年
----	-------------------------	------------------------------

	12月31日	12月31日
审计费用	80,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
汇划手续费	5,714.42	7,884.83
合计	205,714.42	217,884.83

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博道基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国光大银行股份有限公司("光大银行")	基金托管人、基金销售机构
上海博道投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海博道如思投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
上海博道如见投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
上海博道如舍投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
上海博道如知投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
莫泰山	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至20 22年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,657,312.18	18,236,679.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,332,195.95	4,040,199.79
应支付基金管理人的净管理费	9,325,116.23	14,196,480.13

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,582,163.96	2,279,585.03

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至 2023年12月31日	2022年01月01日至 2022年12月31日
报告期初持有的基金份额	3,000,150.12	3,000,150.12
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	1,460,000.00	-
报告期末持有的基金份额	1,540,150.12	3,000,150.12
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.26%	0.39%

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；

3、如果本报告期间发生认购、申购、转换入、红利再投、赎回、转换出等业务，本基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

上海博道投资管理有限公司及本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间大于100万份。（上年度末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间50~100万份。）

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年01月01日至2023年12月31日		2022年01月01日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行	5,451,074.09	41,136.15	6,075,324.68	42,683.96

注：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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
688548	广钢气体	2023-08-08	6个月以上	科创板打新限售	9.87	12.75	3,918	38,670.66	49,954.50	-
688563	航材股份	2023-07-12	6个月以上	科创板打新限售	78.99	60.49	764	60,348.36	46,214.36	-
301526	国际复材	2023-12-19	6个月以上	创业板打新限售	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
603296	华勤技术	2023-08-01	6个月以上	主板打新限售	80.80	77.75	459	37,087.20	35,687.25	-
301487	盟固利	2023-08-01	6个月以上	创业板打新限售	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-

				售							
688549	中巨芯	2023-08-30	6个月以上	科创板打新限售	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-	
301291	明阳电气	2023-06-21	6个月以上	创业板打新限售	38.13	28.36	1,206	45,984.78	34,202.16	-	
301348	蓝箭电子	2023-08-01	6个月以上	创业板打新限售	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-	
688702	盛科通信	2023-09-06	6个月以上	科创板打新限售	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-	
688582	芯动联科	2023-06-21	6个月以上	科创板打新限售	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-	
688652	京仪装备	2023-11-22	6个月以上	科创板打新限售	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-	
301525	儒竞科技	2023-08-23	6个月以上	创业板打新限售	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-	
301498	乖宝宠物	2023-08-09	6个月以上	创业板打新限售	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-	

301371	敷尔佳	2023-07-24	6个月以上	创业板打新限售	55.68	37.58	557	31,013.76	20,932.06	-
301370	国科恒泰	2023-07-03	6个月以上	创业板打新限售	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301421	波长光电	2023-08-16	6个月以上	创业板打新限售	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301558	三态股份	2023-09-21	6个月以上	创业板打新限售	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
688627	精智达	2023-07-11	6个月以上	科创板打新限售	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
301559	中集环科	2023-09-26	6个月以上	创业板打新限售	24.22	18.24	1,056	25,576.32	19,261.44	-
300904	威力传动	2023-08-02	6个月以上	创业板打新限售	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月以上	创业板打新限售	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301468	博盈	2023-07-12	6个	创业	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	-

	特焊		月以上	板打新限售							
301172	君逸数码	2023-07-19	6个月以上	创业板打新限售	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-	
301509	金凯生科	2023-07-26	6个月以上	创业板打新限售	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-	
301362	民爆光电	2023-07-27	6个月以上	创业板打新限售	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-	
688612	威迈斯	2023-07-19	6个月以上	科创板打新限售	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-	
601096	宏盛华源	2023-12-15	6个月以上	主板打新限售	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-	
301393	昊帆生物	2023-07-05	6个月以上	创业板打新限售	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-	
688610	埃科光电	2023-07-10	6个月以上	科创板打新限售	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-	
601083	锦江航运	2023-11-28	6个月以上	主板打新限售	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-	

301510	固高科技	2023-08-04	6个月以上	创业板打新限售	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301507	民生健康	2023-08-24	6个月以上	创业板打新限售	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月以上	创业板打新限售	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月以上	创业板打新限售	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301456	盘古智能	2023-07-06	6个月以上	创业板打新限售	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
688602	康鹏科技	2023-07-13	6个月以上	科创板打新限售	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688719	爱科赛博	2023-09-20	6个月以上	科创板打新限售	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
301550	斯菱股份	2023-09-06	6个月以上	创业板打新限售	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301508	中机	2023-11-23	6个	创业	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-

	认检		月以上	板打新限售						
301251	威尔高	2023-08-30	6个月以上	创业板打新限售	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
688592	司南导航	2023-08-07	6个月以上	科创板打新限售	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
301499	维科精密	2023-07-13	6个月以上	创业板打新限售	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
688603	天承科技	2023-06-30	6个月以上	科创板打新限售	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688653	康希通信	2023-11-10	6个月以上	科创板打新限售	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
301528	多浦乐	2023-08-17	6个月以上	创业板打新限售	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301329	信音电子	2023-07-05	6个月以上	创业板打新限售	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301372	科净源	2023-08-03	6个月以上	创业板打新限售	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-

				售							
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月以上	创业板打新限售	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-	
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月以上	创业板打新限售	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-	
688716	中研股份	2023-09-13	6个月以上	科创板打新限售	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-	
301413	安培龙	2023-12-11	6个月以上	创业板打新限售	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-	
301500	飞南资源	2023-09-13	6个月以上	创业板打新限售	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-	
301418	协昌科技	2023-08-10	6个月以上	创业板打新限售	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-	
301516	中远通	2023-12-01	6个月以上	创业板打新限售	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-	
301272	英华特	2023-07-06	6个月以上	创业板打新限售	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-	

301469	恒达新材	2023-08-10	6个月以上	创业板打新限售	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301519	舜禹股份	2023-07-19	6个月以上	创业板打新限售	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301518	长华化学	2023-07-26	6个月以上	创业板打新限售	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301568	思泰克	2023-11-21	6个月以上	创业板打新限售	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6个月以上	创业板打新限售	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6个月以上	创业板打新限售	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
688720	艾森股份	2023-11-29	6个月以上	科创板打新限售	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-
688573	信宇人	2023-08-09	6个月以上	科创板打新限售	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
301489	思泉	2023-10-16	6个	创业	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-

	新材		月以上	板打 新限售							
6886 51	盛邦 安全	2023- 07-19	6个 月以 上	科创 板打 新限售	39.90	46.05	178	7,10 2.20	8,19 6.90	-	
3015 17	陕西 华达	2023- 10-09	6个 月以 上	创业 板打 新限售	26.87	43.69	185	4,97 0.95	8,08 2.65	-	
3015 78	辰奕 智能	2023- 12-21	6个 月以 上	创业 板打 新限售	48.94	68.32	118	5,77 4.92	8,06 1.76	-	
3015 48	崇德 科技	2023- 09-11	6个 月以 上	创业 板打 新限售	66.80	58.99	136	9,08 4.80	8,02 2.64	-	
6886 57	浩辰 软件	2023- 09-25	6个 月以 上	科创 板打 新限售	103.4 0	78.23	101	10,44 3.40	7,90 1.23	-	
6886 46	逸飞 激光	2023- 07-21	6个 月以 上	科创 板打 新限售	46.80	36.07	219	10,24 9.20	7,89 9.33	-	
6886 71	碧兴 物联	2023- 08-02	6个 月以 上	科创 板打 新限售	36.12	34.30	226	8,16 3.12	7,75 1.80	-	
6886 93	锆威 特	2023- 08-10	6个 月以 上	科创 板打 新限售	40.83	43.41	178	7,26 7.74	7,72 6.98	-	

				售							
603275	众辰科技	2023-08-16	6个月以上	主板打新限售	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-	
301533	威马农机	2023-08-07	6个月以上	创业板打新限售	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-	
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6个月以上	主板打新限售	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-	
301555	惠柏新材	2023-10-24	6个月以上	创业板打新限售	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-	
301505	苏州规划	2023-07-12	6个月以上	创业板打新限售	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-	
301529	福赛科技	2023-08-31	6个月以上	创业板打新限售	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-	
301515	港通医疗	2023-07-13	6个月以上	创业板打新限售	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-	
688648	中邮科技	2023-11-06	6个月以上	科创板打新限售	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-	
001378	德冠新材	2023-10-23	6个月以	主板打新	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-	

			上	限售						
688450	光格科技	2023-07-17	6个月以上	科创板打新限售	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6个月以上	主板打新限售	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603270	金帝股份	2023-08-25	6个月以上	主板打新限售	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6个月以上	主板打新限售	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603107	上海汽配	2023-10-25	6个月以上	主板打新限售	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603193	润本股份	2023-10-09	6个月以上	主板打新限售	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
001306	夏厦精密	2023-11-09	6个月以上	主板打新限售	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023-11-01	6个月以上	主板打新限售	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
603075	热威股份	2023-09-01	6个月以上	主板打新限售	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
001239	永达股份	2023-12-04	6个月以上	主板打新限售	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
6032	索宝	2023-	6个	主板	21.29	21.53	161	3,42	3,46	-

31	蛋白	12-06	月以上	打新限售				7.69	6.33	
603273	天元智能	2023-10-16	6个月以上	主板打新限售	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023-09-18	6个月以上	主板打新限售	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023-12-13	6个月以上	主板打新限售	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-

注：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新股中需要限售的部分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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的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风险控制委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系，并明确了相应风险管理职能。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人光大银行，其他存款存放于中信证券（山东）有限责任公司、浙商证券股份有限公司，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。

于2023年12月31日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为9.68%(2022年12月31日：13.27%)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日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。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。

于2023年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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期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。

本基金投资于一家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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同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15%，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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2023年12月31日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2023年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为822,016,079.43元，超过经确认的当日净赎回金额。

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。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	50,551,594.46	-	-	-	-	-	50,551,594.46
结算备付金	2,978.46	-	-	-	-	-	2,978.46
交易性金融资产	8,970,975.56	8,910,882.82	35,045,589.59	64,653,612.70	6,031,105.14	649,634,169.60	773,246,335.41
应收申购款	-	-	-	-	-	52,508.45	52,508.45
资产总计	59,525,548.48	8,910,882.82	35,045,589.59	64,653,612.70	6,031,105.14	649,686,678.05	823,853,416.78
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	571,894.86	571,894.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	826,724.86	826,724.86
应付托管费	-	-	-	-	-	103,340.61	103,340.61
应交税费	-	-	-	-	-	1,321.01	1,321.01
其他负债	-	-	-	-	-	210,140.15	210,140.15
负债总计	-	-	-	-	-	1,713,421.49	1,713,421.49
利率敏感度缺	59,525,548.48	8,910,882.82	35,045,589.59	64,653,612.70	6,031,105.14	647,973,256.56	822,139,995.29

口							
上年度末 2022年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	10,423,359.70	-	-	-	-	-	10,423,359.70
结算备付金	2,954.43	-	-	-	-	-	2,954.43
交易性金融资产	14,180,913.29	11,085,998.64	38,179,698.74	135,283,821.76	28,159,656.15	936,577,021.64	1,163,467,110.22
买入返售金融资产	59,981,654.80	-	-	-	-	-	59,981,654.80
应收申购款	-	-	-	-	-	127,982.59	127,982.59
资产总计	84,588,882.22	11,085,998.64	38,179,698.74	135,283,821.76	28,159,656.15	936,705,004.23	1,234,003,061.74
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	803,588.68	803,588.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,298,454.66	1,298,454.66
应付托管费	-	-	-	-	-	162,306.82	162,306.82
应交税费	-	-	-	-	-	1,794.17	1,794.17
其他负债	-	-	-	-	-	222,294.48	222,294.48
负债总计	-	-	-	-	-	2,488,438.81	2,488,438.81
利率敏感度缺口	84,588,882.22	11,085,998.64	38,179,698.74	135,283,821.76	28,159,656.15	934,216,565.42	1,231,514,622.93

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为15.04%(2022年12月31日：18.42%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2022年12月31日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用"自上而下"的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的30%-80%，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保证金以后，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。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，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	649,634,169.60	79.02	936,577,021.64	76.05
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	649,634,169.60	79.02	936,577,021.64	76.05

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证800指数收益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12月31日	上年度末 2022年12月31日
	1.中证800指数收益率上升5%	36,091,046.37	49,493,755.78
	2.中证800指数收益率下降5%	-36,091,046.37	-49,493,755.78

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	727,968,050.42	1,083,361,947.74
第二层次	44,016,565.15	77,042,974.31
第三层次	1,261,719.84	3,062,188.17
合计	773,246,335.41	1,163,467,110.22

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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、债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	3,062,188.17	3,062,188.17
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,558,299.30	2,558,299.30
转出第三层次	-	4,823,978.86	4,823,978.86
当期利得或损失总额	-	465,211.23	465,211.23
其中：计入损益的利	-	465,211.23	465,211.23

得或损失			
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,261,719.84	1,261,719.84
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	161,617.88	161,617.88
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	5,544,832.32	5,544,832.32
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	5,835,980.12	5,835,980.12
转出第三层次	-	8,170,345.30	8,170,345.30
当期利得或损失总额	-	-148,278.97	-148,278.97
其中：计入损益的利得或损失	-	-148,278.97	-148,278.97
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	3,062,188.17	3,062,188.17
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	479,448.42	479,448.42

注：1.于本报告期末，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于本报告期，本基金从第三层次转出的交易性金融资产

均为限售期结束可正常交易的股票投资；

2. 计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期内股票投资	1,261,719.84	平均价格亚式期权模型	预期波动率	14.62%-219.88%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期内股票投资	3,062,188.17	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.91%-247.56%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	649,634,169.60	78.85
	其中：股票	649,634,169.60	78.85

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	123,612,165.81	15.00
	其中：债券	123,612,165.81	15.00
	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	50,554,572.92	6.14
8	其他各项资产	52,508.45	0.01
9	合计	823,853,416.78	100.00

注：银行存款和结算备付金合计余额包含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。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	71,866,921.26	8.74
C	制造业	439,930,702.41	53.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	34,028,088.00	4.14
F	批发和零售业	14,492,143.60	1.76
G	交通运输、仓储和邮政业	13,981.41	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,957,870.79	8.63
J	金融业	18,295,837.56	2.23
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00

M	科学研究和技术服务业	26,564.46	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	19,002.11	0.00
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	649,634,169.60	79.02

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300274	阳光电源	682,300	59,762,657.00	7.27
2	300750	宁德时代	281,918	46,025,932.68	5.60
3	600150	中国船舶	1,511,980	44,512,691.20	5.41
4	688012	中微公司	224,800	34,529,280.00	4.20
5	300751	迈为股份	254,025	32,898,777.75	4.00
6	300049	福瑞股份	722,600	31,498,134.00	3.83
7	603019	中科曙光	686,000	27,090,140.00	3.30
8	300763	锦浪科技	359,782	25,148,761.80	3.06
9	600256	广汇能源	3,423,154	24,441,319.56	2.97
10	600966	博汇纸业	3,932,900	24,423,309.00	2.97
11	000603	盛达资源	2,139,214	23,638,314.70	2.88
12	600050	中国联通	4,778,900	20,931,582.00	2.55
13	603596	伯特利	279,329	19,357,499.70	2.35
14	002368	太极股份	637,400	18,822,422.00	2.29

15	000625	长安汽车	1,113,300	18,736,839.00	2.28
16	000032	深桑达 A	875,700	18,547,326.00	2.26
17	600926	杭州银行	1,827,756	18,295,837.56	2.23
18	002230	科大讯飞	335,700	15,569,766.00	1.89
19	601669	中国电建	3,165,800	15,480,762.00	1.88
20	600546	山煤国际	825,400	14,452,754.00	1.76
21	300408	三环集团	475,800	14,012,310.00	1.70
22	600346	恒力石化	970,100	12,776,217.00	1.55
23	002414	高德红外	1,627,500	11,880,750.00	1.45
24	600348	华阳股份	1,174,350	11,461,656.00	1.39
25	600547	山东黄金	393,300	8,994,771.00	1.09
26	002487	大金重工	301,500	8,025,930.00	0.98
27	603987	康德莱	710,700	6,780,078.00	0.82
28	000063	中兴通讯	247,000	6,540,560.00	0.80
29	002843	泰嘉股份	238,100	6,309,650.00	0.77
30	603737	三棵树	109,400	5,208,534.00	0.63
31	688787	海天瑞声	71,746	5,172,886.60	0.63
32	600536	中国软件	109,070	3,954,878.20	0.48
33	002555	三七互娱	208,816	3,927,828.96	0.48
34	002155	湖南黄金	299,000	3,330,860.00	0.41
35	002595	豪迈科技	95,800	2,851,966.00	0.35
36	300271	华宇软件	307,600	2,519,244.00	0.31
37	301468	博盈特焊	5,979	182,138.25	0.02
38	301223	中荣股份	8,148	147,641.76	0.02
39	301335	天元宠物	5,869	125,596.60	0.02
40	688548	广钢气体	3,918	49,954.50	0.01
41	688563	航材股份	764	46,214.36	0.01
42	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.01
43	603296	华勤技术	459	35,687.25	0.00
44	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
45	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00

46	301291	明阳电气	1,206	34,202.16	0.00
47	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
48	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
49	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
50	688543	国科军工	410	22,919.00	0.00
51	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
52	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
53	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
54	301371	敷尔佳	557	20,932.06	0.00
55	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
56	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
57	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
58	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
59	301559	中集环科	1,056	19,261.44	0.00
60	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00
61	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
62	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
63	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
64	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
65	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
66	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
67	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
68	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
69	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
70	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
71	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
72	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
73	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
74	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
75	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
76	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00

77	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
78	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
79	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
80	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
81	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
82	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
83	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
84	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
85	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
86	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
87	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
88	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
89	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
90	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
91	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
92	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
93	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
94	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
95	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
96	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
97	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
98	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
99	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
100	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
101	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
102	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
103	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
104	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
105	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
106	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
107	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00

108	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
109	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
110	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
111	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
112	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
113	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
114	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
115	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
116	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
117	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
118	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
119	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
120	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
121	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
122	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
123	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
124	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
125	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
126	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
127	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
128	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
129	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
130	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
131	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
132	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
133	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
134	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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	002230	科大讯飞	68,553,691.96	5.57
2	688012	中微公司	49,335,255.21	4.01
3	601360	三六零	48,913,979.95	3.97
4	000625	长安汽车	48,821,480.49	3.96
5	000603	盛达资源	46,312,389.44	3.76
6	688787	海天瑞声	45,326,934.10	3.68
7	601669	中国电建	44,893,801.00	3.65
8	300049	福瑞股份	43,313,687.00	3.52
9	603019	中科曙光	42,123,042.24	3.42
10	601728	中国电信	40,372,778.00	3.28
11	600050	中国联通	39,899,682.14	3.24
12	600256	广汇能源	37,611,743.78	3.05
13	300418	昆仑万维	33,885,400.00	2.75
14	600536	中国软件	33,065,194.50	2.68
15	002368	太极股份	31,190,462.72	2.53
16	600547	山东黄金	29,726,631.00	2.41
17	000032	深桑达 A	28,912,286.00	2.35
18	000858	五粮液	26,472,219.00	2.15
19	603596	伯特利	25,007,243.20	2.03
20	600188	兖矿能源	23,817,845.88	1.93

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

8.4.2 累计卖出金额超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	002230	科大讯飞	140,462,844.70	11.41
2	603259	药明康德	61,405,792.83	4.99
3	600536	中国软件	48,410,263.26	3.93
4	000975	银泰黄金	47,015,315.40	3.82
5	601360	三六零	45,426,040.05	3.69
6	601728	中国电信	39,367,697.76	3.20
7	600150	中国船舶	37,557,825.00	3.05
8	688787	海天瑞声	36,934,604.37	3.00
9	688012	中微公司	36,812,174.90	2.99
10	603688	石英股份	36,694,338.37	2.98
11	002371	北方华创	34,360,410.00	2.79
12	300274	阳光电源	32,726,780.00	2.66
13	300418	昆仑万维	30,868,670.00	2.51
14	000625	长安汽车	29,236,168.68	2.37
15	002493	荣盛石化	27,461,781.24	2.23
16	000858	五粮液	26,682,197.00	2.17
17	600188	兖矿能源	24,541,579.50	1.99
18	601633	长城汽车	23,370,830.68	1.90
19	600547	山东黄金	23,362,012.20	1.90
20	300049	福瑞股份	23,182,221.00	1.88

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,319,229,320.98
卖出股票收入（成交）总额	1,495,336,710.03

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。

8.5 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	44,016,565.15	5.35
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)	79,595,600.66	9.68
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	123,612,165.81	15.04

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	110085	通22转债	260,820	28,278,797.54	3.44
2	019709	23国债16	140,000	14,073,260.27	1.71
3	110079	杭银转债	116,550	12,617,406.04	1.53
4	019703	23国债10	119,000	12,068,947.40	1.47
5	123133	佩蒂转债	88,560	10,048,187.44	1.22

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	52,508.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,508.45

8.12.4 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	110085	通22转债	28,278,797.54	3.44
2	110079	杭银转债	12,617,406.04	1.53
3	123133	佩蒂转债	10,048,187.44	1.22
4	127006	敖东转债	8,910,882.82	1.08

5	113066	平煤转债	6,031,105.14	0.73
6	123107	温氏转债	4,299,899.33	0.52
7	128095	恩捷转债	3,942,746.22	0.48
8	118004	博瑞转债	3,129,278.05	0.38
9	113049	长汽转债	2,337,298.08	0.28

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
14,845	39,557.80	228,515,491.08	38.91%	358,720,098.40	61.09%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,708,701.16	0.29%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年12月19日)基金份额总额	300,004,705.92
本报告期期初基金份额总额	769,193,705.32
本报告期基金总申购份额	84,942,343.77
减：本报告期基金总赎回份额	266,900,459.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	587,235,589.48

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本期审计费用请见"7.4.7.17其他费用"。自本基金基金合同生效以来，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
浙商证券	2	2,581,010,421.82	93.20%	1,861,662.31	93.13%	-
中信证券（山东）	2	188,271,354.12	6.80%	137,256.41	6.87%	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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
浙商证券	432,949,715.65	100.00%	5,624,404.000.00	97.93%	-	-	-	-
中信证券（山东）	-	-	119,004,000.00	2.07%	-	-	-	-

注：

- 1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；
- 2、基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：
 - （1）经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
 - （2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；

(3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；

(4) 具有较强的为投资人提供资产配置及服务的能力，包括但不限于：产品筛选及评审流程完整，具有较为完善的资产配置，客户服务及陪伴体系等。

3、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
- (2) 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2023-01-20
2	博道嘉泰回报混合型证券投资基金2022年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-20
3	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人关联方承销证券的公告	证券时报、上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-29
4	博道基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2023-03-31
5	博道嘉泰回报混合型证券投资基金2022年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
6	博道基金管理有限公司关于调整“特定投资群体”（养老金客户）适用范围的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-04
7	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2023-04-21
8	博道嘉泰回报混合型证券投资基金2023年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-21

9	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加北京雪球基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-04
10	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人关联方承销证券的公告	上海证券报、证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-10
11	博道基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-06
12	博道基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2023-07-21
13	博道嘉泰回报混合型证券投资基金2023年第二季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-21
14	博道基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下权益基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-24
15	博道基金管理有限公司旗下部分基金中期报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2023-08-31
16	博道嘉泰回报混合型证券投资基金2023年中期报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-31
17	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加平安证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-09-21
18	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2023-10-25
19	博道嘉泰回报混合型证券投	公司网站、中国证监会基金	2023-10-25

	资基金2023年第三季度报告	电子披露网站	
20	博道基金管理有限公司关于旗下基金开展直销转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-24
21	博道嘉泰回报混合型证券投资基金（更新）招募说明书（2023年第1号）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-25
22	博道嘉泰回报混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-25
23	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-27
24	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-28

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道嘉泰回报混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道嘉泰回报混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道嘉泰回报混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道嘉泰回报混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道嘉泰回报混合型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内博道嘉泰回报混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站（www.bdfund.cn）查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博道基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-085-2888（免长途话费）。

博道基金管理有限公司
二〇二四年三月二十九日