

泉果旭源三年持有期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:泉果基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期: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及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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年03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。

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 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况..... | 10 |
| § 4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作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..... | 13 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 14 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 14 |
| 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..... | 14 |
| § 5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 14 |
| 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..... | 15 |
| § 6 审计报告 | 15 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 15 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 15 |
| § 7 年度财务报表 | 17 |
| 7.1 资产负债表..... | 17 |
| 7.2 利润表..... | 18 |
| 7.3 净资产变动表..... | 19 |
| 7.4 报表附注..... | 20 |
| § 8 投资组合报告 | 50 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 50 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 50 |
| 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..... | 51 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 52 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 54 |
| 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..... | 54 |
| 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..... | 54 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 54 |
| 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 | 54 |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 54 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 54 |
| 8.12 投资组合报告附注 | 55 |
| § 9 基金份额持有人信息 | 55 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 56 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 56 |
| 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 | 56 |
| § 10 开放式基金份额变动 | 56 |
| § 11 重大事件揭示 | 57 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 57 |
| 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 | 57 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 57 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 57 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 57 |
| 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 | 57 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 58 |
| 11.8 其他重大事件 | 58 |
| § 12 影响投资者决策的其他重要信息 | 60 |
| 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 60 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 60 |
| § 13 备查文件目录 | 60 |
| 13.1 备查文件目录 | 60 |
| 13.2 存放地点 | 60 |
| 13.3 查阅方式 | 61 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|---------------------|--------------------|
| 基金名称 | 泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 泉果旭源三年持有期混合 | |
| 基金主代码 | 016709 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2022 年 10 月 18 日 | |
| 基金管理人 | 泉果基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 16,947,479,465.85 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 泉果旭源三年持有期混合 A | 泉果旭源三年持有期混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 016709 | 016710 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 14,499,931,981.86 份 | 2,447,547,483.99 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>在大类资产配置上,本基金采取定性与定量研究相结合的方法,在严格控制投资组合风险的前提下,确定或调整投资组合中各大类资产的配置比例。</p> <p>在股票投资方面,本基金将依托专业的研究力量,在行业分析的基础上,本基金坚持基本面研究,遵循“自下而上”选股策略,通过对定性和定量因素的综合分析,精选个股进行投资;在债券投资方面,本基金将以宏观形势及利率分析为基础,结合货币政策、财政政策的实施情况,以及国际金融市场基准利率水平及变化情况,预测未来基准利率水平变化趋势与幅度,采用久期策略、收益率曲线策略、个券选择策略和信用策略等债券投资策略。对于可转换债券和可交换债券等特殊品种,根据其特点采取相应的投资策略。</p> <p>此外,本基金还会运用存托凭证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略和参与融资业务策略等。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*20%+中债综合全价指数收益率*20% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。本基金除了投资 A 股外,还可根据法律法规规定投资港股通标的股票。若本基金投资港股通标的股票,除了需要承担与境内证券投资基金类 |

| | |
|--|--|
| | 似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |
|--|--|

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 | | 泉果基金管理有限公司 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李云亮 | 张姗 |
| | 联系电话 | 021-63188889 | 400-61-95555 |
| | 电子邮箱 | service@qgfund.com | zhangshan_1027@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-158-6599 | 400-61-95555 |
| 传真 | | 021-62066669 | 0755-83195201 |
| 注册地址 | | 上海市长宁区哈密路 1500 号 I-22 幢 22 层 288 室 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区南洋泾路 555 号陆家嘴金融街区 19 号楼 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 邮政编码 | | 200135 | 518040 |
| 法定代表人 | | 任莉 | 缪建民 |

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.qgfund.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人办公场所 |

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） | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼 |
| 注册登记机构 | 泉果基金管理有限公司 | 上海市浦东新区南洋泾路 555 号陆家嘴金融街区 19 号楼 |

§ 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 10 月 18 日（基金合同生效日） -2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|--------|--|

| | 泉果旭源三年持有 期混合 A | 泉果旭源三年持有 期混合 C | 泉果旭源三年持有 期混合 A | 泉果旭源三年持有 期混合 C |
|----------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 本期已实现收益 | -369,762,354.81 | -70,596,213.95 | -5,976,524.68 | -1,897,970.61 |
| 本期利润 | -4,054,574,351.09 | -700,002,535.38 | -51,464,814.43 | -8,530,369.50 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2914 | -0.3012 | -0.0060 | -0.0068 |
| 本期加权平均净值利润率 | -32.38% | -33.60% | -0.59% | -0.67% |
| 本期基金份额净值增长率 | -25.87% | -26.16% | -0.60% | -0.68% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2023 年末 | | 2022 年末 | |
| 期末可供分配利润 | -3,814,429,878.01 | -652,511,971.23 | -51,464,814.43 | -8,530,369.50 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2631 | -0.2666 | -0.0060 | -0.0068 |
| 期末基金资产净值 | 10,685,502,103.85 | 1,795,035,512.76 | 8,593,885,260.51 | 1,253,587,227.07 |
| 期末基金份额净值 | 0.7369 | 0.7334 | 0.9940 | 0.9932 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2023 年末 | | 2022 年末 | |
| 基金份额累计净值增长率 | -26.31% | -26.66% | -0.60% | -0.68% |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金合同于 2022 年 10 月 18 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

泉果旭源三年持有期混合 A 净值表现

| 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 |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -9.83% | 1.33% | -5.36% | 0.65% | -4.47% | 0.68% |
| 过去六个月 | -22.91% | 1.21% | -8.58% | 0.69% | -14.33% | 0.52% |
| 过去一年 | -25.87% | 1.14% | -8.91% | 0.69% | -16.96% | 0.45% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | -26.31% | 1.07% | -5.68% | 0.78% | -20.63% | 0.29% |
|------------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|

泉果旭源三年持有期混合 C 净值表现

| 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -9.91% | 1.33% | -5.36% | 0.65% | -4.55% | 0.68% |
| 过去六个月 | -23.07% | 1.22% | -8.58% | 0.69% | -14.49% | 0.53% |
| 过去一年 | -26.16% | 1.15% | -8.91% | 0.69% | -17.25% | 0.46% |
| 自基金合同生效起至今 | -26.66% | 1.07% | -5.68% | 0.78% | -20.98% | 0.29% |

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

泉果旭源三年持有期混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年10月18日-2023年12月31日)

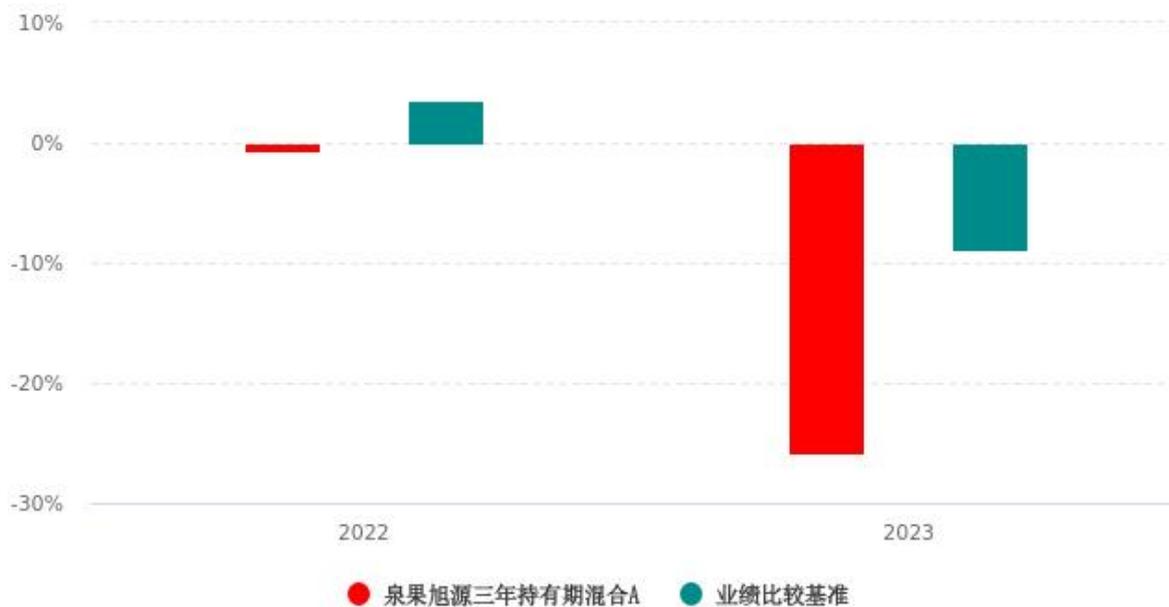


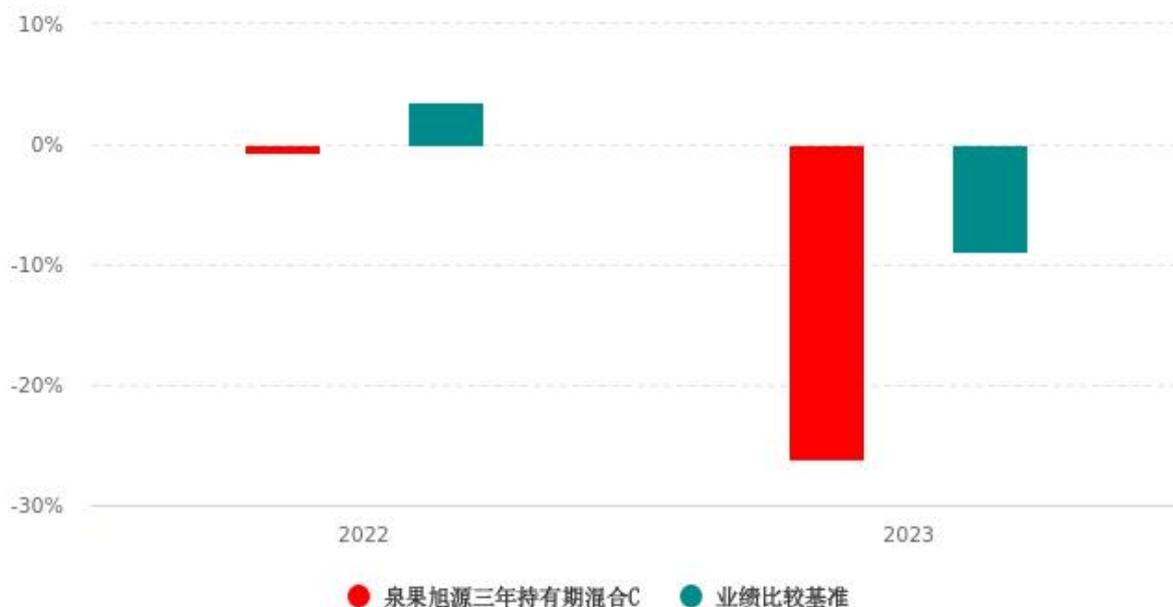
泉果旭源三年持有期混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年10月18日-2023年12月31日)



注：根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

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：本基金合同于 2022 年 10 月 18 日生效，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2022 年 10 月 18 日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泉果基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会证监许可[2022]260 号文批准，于 2022 年 2 月 8 日取得营业执照正式成立，并于 2022 年 7 月 13 日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。公司注册地上海，注册资本一亿元人民币。公司坚持“专业投研+专业服务”双轮驱动，坚持理性投资及专业的投资者服务陪伴，致力于为持有人创造长期可持续的投资回报。截至 2023 年 12 月 31 日，公司共管理三只公募基金，即泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金、泉果思源三年持有期混合型证券投资基金、泉果嘉源三年持有期混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年 | 说明 |
|----|----|-----------------|------|-------|----|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| | | | | | |

| | | | | 限 | |
|----|----------|------------|---|-----|---|
| 赵诣 | 本基金的基金经理 | 2022-10-18 | - | 11年 | 赵诣先生，硕士研究生，泉果基金管理有限公司公募投资部基金经理。2022年10月18日至今任泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金基金经理。曾任申银万国证券研究所中小盘研究员、机械研究员，农银汇理基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理、投资部副总经理（主持工作）、投资部总经理等。具备基金从业资格。 |

注：1、上述表格内本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期分别为公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵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守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规关于公平交易的规定，本基金管理人制定了《泉果基金管理有限公司公平交易制度》，建立了公平交易相关控制流程，保证在投资管理活动中公平对待各投资组合，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立规范、完善的研究管理机制，为公司旗下所有投资组合提供公平的研究服务和支持，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司建立投资授权体系，明确公司投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，并建立投资对象备选库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合，保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。公司将投资管理职能与交易执行职能相隔离，公司的交易实行集中交易制度，并建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。公司建立投资交易行为的日常监控和分析评估机制，并于每季度和每年度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（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，通过对投资交易行为的监控、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，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节严格控制，确保各投资组合得到公平对待，并通过对投资交易行为的监控、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。本报告期内本基金管理人严格遵守公平交易制度，公平对待旗下管理的各投资组合，未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，未出现本基金管理人管理的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，本基金与本基金管理人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

在经历了 2022 年的大幅调整之后，进入 2023 年，市场整体呈现震荡走势，结构分化明显。上半年，在数字中国以及 ChatGPT 主题的催化下，以通信、传媒、计算机为代表的 TMT 板块涨幅较大；下半年，以煤炭、公用事业为主的高分红板块领涨市场，而美容护理、商贸零售、房地产等行业领跌。全年上证指数下跌 3.7%，深证成指下跌 13.54%，创业板指下跌 19.41%。

从全年来看，泉果旭源产品净值下跌 26% 左右，表现不及预期。在操作上，上半年我们基本完成建仓，下半年组合仓位上相较前期没有大的变化，整体更加集中。随着市场的变化，在经济刺激的政策逐步出台、管理层对市场的重视程度进一步提高以及国际局势改善的情况下，我们持股更加集中于具有全球竞争力的企业，这使得组合在 8 月以来北向资金历史级别的流出过程中调整幅度较大。我们认为，判断市场走势对我们而言是相对困难的事情，但是我们一直强调，当优质的公司出现快速调整并进入有性价比的阶段，我们将进一步提高仓位。本质而言，我们希望的是能选择到优秀的公司，并伴随其一起成长，因此我们会以更长远的眼光来看待组合里的公司。目前组合持仓方向变化不大，主要集中在新能源、汽车及零部件、计算机、电子、机械、军工等高端制造行业，消费及互联网行业，以及稳健增长、高股息率的企业。

回顾过去，基金重仓股从 2021 年年初开始已经经历了连续 3 年的调整，尤其是在 2023 年，由于美联储加息带来汇率的波动、美债收益率创 2008 年金融危机以来的新高、国际局势的变化、以及公募基金发行遇冷，市场从资金面到情绪面都产生了较大的扰动，北上资金、公募基金持仓较多，国际化程度较高的公司股价出现更大的调整。但部分公司从经营到竞争力方面仍在持续增强。

展望未来一段时间，在受情绪影响的这部分公司估值已经进入历史底部区域的情况下，一旦全球流动性、汇率、国际局势有一定的转向，都会对这些好公司的股价产生正面的影响，而目前我们已经能看到越来越多积极的变化，需要等待好的因素实现从量变到质变。

对于新能源行业，一方面在过去 2 到 3 年行业快速增长的过程中，产能得到快速的扩张；另一

方面，由于国际环境的影响，国内的产能出海受到了一定的限制，使得供需两端都出现了较大的影响，带来全产业链价格超预期的下跌。政策方面，近期我们可以看到监管开始限制企业的无序融资，意味着企业更需要靠自身的经营来实现稳步扩张，在供给端进行了约束，产业链的资本开支在年中也已经出现逆转；同时随着近期产业链价格的触底，下游终端需求和补库需求有望开始提升，从而在供需两端出现改善。头部公司在这轮降价周期中经受住了很好的压力测试，国际环境波动带来的影响也验证了国内有一批公司具有极强的全球竞争力，考虑到过去两年产业链公司股价出现大幅调整，在行业周期底部叠加估值历史底部、行业空间仍然巨大的情况下，对于新能源行业公司的未来表现我们越来越乐观。2023 年是确定竞争格局的一年，后续公司间的分化会非常明显，我们会倾向于选择具有海外扩张能力并且已经处在实施扩张过程中的企业。

整体投资方向上我们没有特别大的变化，更加关注有“增量”的方向，一个是技术进步带来需求提升的方向，包括新能源和 AI 应用；另外一个是在“国内大循环为主体，国内国际双循环相互促进”定调下的国产替代、补短板的方向，尤其是以航空发动机、国产算力基础设施、半导体为主的高端制造业，需求复苏的消费行业，以及稳健增长、高股息率企业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泉果旭源三年持有期混合 A 基金份额净值为 0.7369 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-25.87%，同期业绩比较基准收益率为-8.91%；截至报告期末泉果旭源三年持有期混合 C 基金份额净值为 0.7334 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-26.16%，同期业绩比较基准收益率为-8.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，全球经济开始回归正常，因此在宏观层面我们更需要关注两个方向：从国际上来看，2024 年是全球大选年，情绪面和政策面的扰动会比较大，同时美联储缩表进入尾声，需要关注拐点什么时候出现；从国内来看，在经历了 2023 年的过渡之后，需要关注稳经济的政策和力度。整体而言，宏观上 2024 年会出现边际的改善，同时经过过去一年的调整，以及企业业绩的增长，整体市场的估值有了进一步的回落，对于新的一年我们并不悲观。但是全球流动性的收紧仍然在制约估值的扩张，因此更多是结构性的机会，我们仍然通过自下而上选择优秀的公司陪伴其成长。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司日常监察稽核工作主要由合规稽核部和风险管理部根据职责分工开展，2023 年主要开展了如下工作：

合规管理履职方面，包括但不限于：（1）切实履行日常合规管理职责。包括但不限于：合规审查、合规宣导与培训、合规报告、合规咨询、合规检查/稽核、监管沟通与配合等方面；（2）加强员工执业行为管理。强化员工投资行为申报管理、强化通讯工具管控、定期和不定期对员工职务通讯行为进行合规检查等；（3）积极跟进各项法律事务。主要包括对潜在风险领域的法律法规及司法案例等进行深入研究，紧扣公司各项业务需求，提供有力的法律支持等；（4）稳步开展反洗钱各项工

作。按要求履行日常反洗钱义务，开展多样化的反洗钱宣传，及时履行反洗钱报送义务，持续推动反洗钱系统功能迭代、流程优化，持续完善反洗钱内控体系等；（5）深入开展合规专题研究。根据业务发展进行相关专题问题研究，为推动业务开展提供参考。

风险管理履职方面，包括但不限于：（1）切实履行日常风险管理职责，对产品投资运作进行事前事中事后全流程风险管理，包括但不限于：风控条款审核、风控阈值设置、风控指标监控、风控报告等；（2）梳理并修订风险管理相关制度，优化内部风控规则及操作流程，持续完善风险管理规则体系；（3）加强对产品投资运作中市场风险、流动性风险、信用风险的监测、评估、报告，开展定期及不定期压力测试工作，不断提升风险管理水平；（4）加强风险管理系统建设。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。本基金管理人建立有估值委员会，负责建立健全估值决策体系，配备有投资、研究、会计和风控等岗位的资深人员。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本报告期内，上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、《基金合同》的约定以及本基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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 20356 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 | 泉果旭源三年持有期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>我们审计了泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金(以下简称“泉果旭源三年持有期混合基金”)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,公允反映了泉果旭源三年持有期混合基金 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,我们独立于泉果旭源三年持有期混合基金,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>泉果旭源三年持有期混合基金的基金管理人泉果基金管理有限公司(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泉果旭源三年持有期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泉果旭源三年持有期混合基金、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泉果旭源三年持有期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,就可能对泉果旭源三年持有期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泉果旭源三年持有期混合基金不能持续经营。</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。 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。 | |
| 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 | 陈熹 | 成磊 |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼 | |
| 审计报告日期 | 2024-03-27 | |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 泉果旭源三年持有期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 | 904,540,951.95 | 1,228,762,724.31 |
| 结算备付金 | | 19,086.18 | 720,157.75 |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 11,590,961,208.17 | 6,632,253,334.45 |
| 其中: 股票投资 | | 11,526,051,881.05 | 6,632,253,334.45 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 64,909,327.12 | - |
| 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 | - | 2,001,171,261.09 |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 333,214.31 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 12,495,854,460.61 | 9,862,907,477.60 |
| 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 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 12,412,701.12 | 12,734,654.82 |
| 应付托管费 | | 2,068,783.50 | 2,122,442.45 |
| 应付销售服务费 | | 595,084.53 | 432,366.90 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 274.85 | 37,525.85 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.6 | 240,000.00 | 108,000.00 |
| 负债合计 | | 15,316,844.00 | 15,434,990.02 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.7 | 16,947,479,465.85 | 9,907,467,671.51 |
| 未分配利润 | 7.4.7.8 | -4,466,941,849.24 | -59,995,183.93 |
| 净资产合计 | | 12,480,537,616.61 | 9,847,472,487.58 |
| 负债和净资产总计 | | 12,495,854,460.61 | 9,862,907,477.60 |

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 16,947,479,465.85 份，其中泉果旭源三年持有期混合 A 基金份额净值 0.7369 元，基金份额总额 14,499,931,981.86 份；泉果旭源三年持有期混合 C 基金份额净值 0.7334 元，基金份额总额 2,447,547,483.99 份。

7.2 利润表

会计主体：泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 10 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日 |
|-------------------|----------|---------------------------------------|---|
| 一、营业总收入 | | -4,509,604,876.97 | -23,615,751.46 |
| 1. 利息收入 | | 22,805,100.30 | 17,032,811.68 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.9 | 21,431,592.90 | 13,317,291.16 |
| 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 | | 1,373,507.40 | 3,715,520.52 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -218,191,659.56 | 11,472,125.50 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.10 | -323,534,166.16 | 7,619,221.33 |
| 基金投资收益 | 7.4.7.11 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|-------------------|----------------|
| 债券投资收益 | 7.4.7.12 | 10,650,778.19 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.13 | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 94,691,728.41 | 3,852,904.17 |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | -4,314,218,317.71 | -52,120,688.64 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 244,972,009.50 | 36,379,432.47 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 202,566,408.06 | 30,200,530.39 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 33,761,068.01 | 5,033,421.73 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 8,282,395.94 | 1,025,578.00 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 4,276.82 | 11,146.55 |
| 8. 其他费用 | 7.4.7.18 | 357,860.67 | 108,755.80 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -4,754,576,886.47 | -59,995,183.93 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -4,754,576,886.47 | -59,995,183.93 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -4,754,576,886.47 | -59,995,183.93 |

7.3 净资产变动表

会计主体：泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 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 | 9,907,467,671.51 | -59,995,183.93 | 9,847,472,487.58 |
| 二、本期期初净资产 | 9,907,467,671.51 | -59,995,183.93 | 9,847,472,487.58 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 7,040,011,794.34 | -4,406,946,665.31 | 2,633,065,129.03 |
| （一）、综合收益总额 | - | -4,754,576,886.47 | -4,754,576,886.47 |
| （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） | 7,040,011,794.34 | 347,630,221.16 | 7,387,642,015.50 |
| 其中：1. 基金申购款 | 7,040,011,794.34 | 347,630,221.16 | 7,387,642,015.50 |

| | | | |
|--|---|-------------------|-------------------|
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 16,947,479,465.85 | -4,466,941,849.24 | 12,480,537,616.61 |
| 项 目 | 上年度可比期间 2022 年 10 月 18 日(基金合同生效日)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 | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 9,907,467,671.51 | - | 9,907,467,671.51 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | - | -59,995,183.93 | -59,995,183.93 |
| (一)、综合收益总额 | - | -59,995,183.93 | -59,995,183.93 |
| (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) | - | - | - |
| 其中: 1. 基金申购款 | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 9,907,467,671.51 | -59,995,183.93 | 9,847,472,487.58 |

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:

| | | |
|--------------------------|---------------------------|------------------------|
| 王国斌 _____ 基金管理人负责人 | 王国斌 _____ 主管会计工作负责人 | 孙媛 _____ 会计机构负责人 |
|--------------------------|---------------------------|------------------------|

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]1994号《关于准予泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金注册的批复》注册,由泉果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《泉果旭源三年持有期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9,907,280,202.80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(2022)第0833号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2022年10月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为9,907,467,671.51份基金份额,其中认购资金利息折合187,468.71份基金份额。本基金的基金管理人为泉果基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

本基金对每份基金份额设置三年最短持有期(红利再投资所得基金份额按该原份额的持有期限计算)。其中,最短持有期起始日指基金合同生效日(对认购份额而言)、每份基金份额申购确认日(对申购份额而言)或每份基金份额转换转入确认日(对转换转入份额而言);最短持有期到期日指每份基金份额最短持有期起始日三年后年度对日(指某一特定日期在后续日历年中的对应日期,若该日历年中不存在对应日期的或该年度对日为非工作日的,则顺延至下一个工作日)的前一自然日。基金管理人可根据实际情况依法决定本基金开始办理申购的具体日期,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。自认购份额的最短持有期限到期日(即自基金合同生效日起的三年后的年度对日的前一自然日)的下一个工作日(含该日)起,基金管理人开始办理赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

根据《泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。其中 A 类基金份额是在投资者认购、申购时收取认购费、申购费、而不从该类别基金资产中计提销售服务费的一类基金份额; C 类基金份额是在投资者认购、申购时不收取认购费、申购费用,但从该类别基金资产中计提销售服务费的一类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泉果旭源三年持有期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国内依法公开发行上市股票(包括主板、创业板以及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转换债券的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可交换债券)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率*60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*20%+中债综合全价指数收益率*20%。

本财务报表由本基金的基金管理人泉果基金管理有限公司于 2024 年 3 月 27 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》、本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

本基金本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。

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。比较财务报表的实际编制期间为 2022 年 10 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日。

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业务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业务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。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损

益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响);

(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具,列报于净资产。

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、托管费和销售服务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

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下,基金管理人可根据实际情况对本基金进行收益分配,具体分配方案以公告为准;若基金合同生效不满3个月,本基金可不进行收益分配;

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

(3) 基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4) 本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权,由于本基金A类基金份额不收取销售服务

费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

(5) 对于收益分配方式为红利再投资的基金份额，每份基金份额（原份额）所获得的红利再投资份额的持有期限，按该原份额的持有期限计算，即与原份额最短持有期到期日相同；

(6) 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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 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，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产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[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。

(4)对基金通过沪港通/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/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。

(5)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。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。基金通过沪港通/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。

(6)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 | 99,934,711.02 | 86,729,145.23 |
| 等于：本金 | 99,924,109.40 | 86,719,871.02 |
| 加：应计利息 | 10,601.62 | 9,274.21 |
| 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 | 804,606,240.93 | 1,142,033,579.08 |
| 等于：本金 | 804,428,213.64 | 1,141,770,552.79 |
| 加：应计利息 | 178,027.29 | 263,026.29 |
| 减：坏账准备 | - | - |
| 合计 | 904,540,951.95 | 1,228,762,724.31 |

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

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 | | 15,894,114,593.02 | - | 11,526,051,881.05 | -4,368,062,711.97 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 63,139,400.00 | 46,221.50 | 64,909,327.12 | 1,723,705.62 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 63,139,400.00 | 46,221.50 | 64,909,327.12 | 1,723,705.62 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 15,957,253,993.02 | 46,221.50 | 11,590,961,208.17 | -4,366,339,006.35 |
| 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 | | 6,684,374,023.09 | - | 6,632,253,334.45 | -52,120,688.64 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 6,684,374,023.09 | - | 6,632,253,334.45 | -52,120,688.64 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

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 | 2,001,171,261.09 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 2,001,171,261.09 | - |

注：上年度末交易所买入返售证券余额中包含的交易所固收平台质押式协议回购的余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

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 | - | - |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 应付交易费用 | - | - |
| 其中：交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 预提费用 | 240,000.00 | 108,000.00 |
| 合计 | 240,000.00 | 108,000.00 |

7.4.7.7 实收基金

泉果旭源三年持有期混合 A

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 | 8,645,350,074.94 | 8,645,350,074.94 |
| 本期申购 | 5,854,581,906.92 | 5,854,581,906.92 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 14,499,931,981.86 | 14,499,931,981.86 |

泉果旭源三年持有期混合 C

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 | 1,262,117,596.57 | 1,262,117,596.57 |
| 本期申购 | 1,185,429,887.42 | 1,185,429,887.42 |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 2,447,547,483.99 | 2,447,547,483.99 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

泉果旭源三年持有期混合 A

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 | -5,976,524.68 | -45,488,289.75 | -51,464,814.43 |
| 本期期初 | -5,976,524.68 | -45,488,289.75 | -51,464,814.43 |
| 本期利润 | -369,762,354.81 | -3,684,811,996.28 | -4,054,574,351.09 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,938,240.80 | 288,671,046.71 | 291,609,287.51 |
| 其中：基金申购款 | 2,938,240.80 | 288,671,046.71 | 291,609,287.51 |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -372,800,638.69 | -3,441,629,239.32 | -3,814,429,878.01 |

泉果旭源三年持有期混合 C

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 | -1,897,970.61 | -6,632,398.89 | -8,530,369.50 |
| 本期期初 | -1,897,970.61 | -6,632,398.89 | -8,530,369.50 |
| 本期利润 | -70,596,213.95 | -629,406,321.43 | -700,002,535.38 |

| | | | |
|----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,049,003.80 | 57,069,937.45 | 56,020,933.65 |
| 其中：基金申购款 | -1,049,003.80 | 57,069,937.45 | 56,020,933.65 |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -73,543,188.36 | -578,968,782.87 | -652,511,971.23 |

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 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------------------------------------|---|
| 活期存款利息收入 | 634,771.47 | 317,381.77 |
| 定期存款利息收入 | - | - |
| 其他存款利息收入 | 9,082,375.16 | 2,546,457.10 |
| 结算备付金利息收入 | 11,714,446.27 | 10,453,452.29 |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 21,431,592.90 | 13,317,291.16 |

注：其他存款利息收入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产生的利息。

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------------------------------------|---|
| 卖出股票成交总额 | 3,770,692,972.69 | 531,639,500.54 |
| 减：卖出股票成本总额 | 4,074,533,409.98 | 517,005,113.27 |
| 减：交易费用 | 19,693,728.87 | 7,015,165.94 |
| 买卖股票差价收入 | -323,534,166.16 | 7,619,221.33 |

7.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无基金投资收益。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 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 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日 |
|------------------------------|---------------------------------------|---|
| 债券投资收益——利息收入 | 52,103.97 | - |
| 债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入 | 10,598,674.22 | - |
| 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 | 10,650,778.19 | - |

7.4.7.12.2 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 10 月 18 日(基金合同生效日)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 | 44,755,695.08 | - |
| 减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额 | 34,145,100.00 | - |
| 减：应计利息总额 | 7,445.21 | - |
| 减：交易费用 | 4,475.65 | - |
| 买卖债券差价收入 | 10,598,674.22 | - |

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 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 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日 |
|----|---------------------------------------|---|
|----|---------------------------------------|---|

| | | |
|---------------|---------------|--------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 94,691,728.41 | 3,852,904.17 |
| 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 | 94,691,728.41 | 3,852,904.17 |

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日 |
|------------------------|---------------------------------------|---|
| 1. 交易性金融资产 | -4,314,218,317.71 | -52,120,688.64 |
| ——股票投资 | -4,315,942,023.33 | -52,120,688.64 |
| ——债券投资 | 1,723,705.62 | - |
| ——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 | -4,314,218,317.71 | -52,120,688.64 |

7.4.7.17 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间无其他收入。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 10 月 18 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日 |
|----------|---------------------------------------|---|
| 审计费用 | 120,000.00 | 88,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 20,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 银行汇划费 | 4,738.09 | 355.80 |
| 账户维护费 | 13,500.00 | - |
| 港股通证券组合费 | 99,622.58 | - |
| 证券账户开户费 | - | 400.00 |
| 合计 | 357,860.67 | 108,755.80 |

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|-----------------------|
| 泉果基金管理有限公司（“泉果基金”） | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 任莉 | 基金管理人的自然人股东 |
| 王国斌 | 基金管理人的自然人股东 |
| 姜荷泽 | 基金管理人的自然人股东 |
| 上海泉至清企业管理中心（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 上海泉至澈企业管理中心（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 上海泉至澄企业管理中心（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 上海果至行企业管理中心（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 李云亮 | 基金管理人的自然人股东 |

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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 10 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日 |
|----------------|---------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 202,566,408.06 | 30,200,530.39 |

| | | |
|------------------|----------------|---------------|
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 94,689,263.72 | 13,853,150.87 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 107,877,144.34 | 16,347,379.52 |

注：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 13 日期间，本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

每日应计提的基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.50% ÷ 当年天数

根据《泉果基金管理有限公司关于调低旗下公募基金费率并修订基金合同的公告》，经与基金托管人协商一致，自 2023 年 8 月 14 日起，本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。

管理费的计算方法如下：

每日应计提的基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.20% ÷ 当年天数

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

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 10 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日 |
|----------------|---------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 33,761,068.01 | 5,033,421.73 |

注：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 13 日期间，本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

每日应计提的基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% ÷ 当年天数

根据《泉果基金管理有限公司关于调低旗下公募基金费率并修订基金合同的公告》，经与基金托管人协商一致，自 2023 年 8 月 14 日起，本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。

托管费的计算方法如下：

每日应计提的基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% ÷ 当年天数

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 | | |
|----------------|---------------------------------------|---------------|----|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 泉果旭源三年持有期混合 A | 泉果旭源三年持有期混合 C | 合计 |
| | | | |

| | | | |
|----------------|---|---------------|--------------|
| 泉果基金 | - | 14,323.72 | 14,323.72 |
| 招商银行 | - | 5,848,934.78 | 5,848,934.78 |
| 合计 | - | 5,863,258.50 | 5,863,258.50 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2022 年 10 月 18 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 泉果旭源三年持有期混合 A | 泉果旭源三年持有期混合 C | 合计 |
| 泉果基金 | - | 1,797.86 | 1,797.86 |
| 招商银行 | - | 682,923.49 | 682,923.49 |
| 合计 | - | 684,721.35 | 684,721.35 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性按照指定路径支付。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 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

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

本基金本报告期及上年度可比期间未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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 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

泉果旭源三年持有期混合 A

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2023 年 12 月 31 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 |
| 自然人股东 | 5,248,194.54 | 0.04% | 4,654,387.78 | 0.05% |

注：本报告期末无其他关联方投资泉果旭源三年持有期混合 C 的情况。

7.4.10.6 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 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2022 年 10 月 18 日（基金合同生效日）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 |
| 招商银行 | 99,934,711.02 | 634,771.47 | 86,729,145.23 | 317,381.77 |

注：本基金的部分银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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 |
| 002850 | 科达利 | 2023 年 08 月 10 日 | 6 个月 | 非公开发 | 104.85 | 81.93 | 572,245 | 59,999,888.25 | 46,884,032.85 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--|--|--|--|-------------|--|--|--|--|--|--|
| | | | | 行 限 售 | | | | | | |
|--|--|--|--|-------------|--|--|--|--|--|--|

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与金融工具相关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相应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。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、监事、经营管理层、各部门及全体员工组成的全面风险管理组织架构。董事会负责督促、检查、评价公司风险管理工作；监事负责监督检查董事会和经营管理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改；经营管理层设立风险控制委员会，负责制订相关风险控制政策，审议风险控制方案，指导风险控制措施的实施，协调和督促各部门开展风险管理工作等；风险管理部作为专门部门履行风险管理职责，推动公司风险管理工作，监测、评估、报告公司的整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议等；公司其他各部门及员工直接参与相关业务的风险管理工作。

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。

本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，其他存款存放在券商的证券交易结算资金账户，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以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|-----------------------|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | 64,909,327.12 | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 64,909,327.12 | - |

注：债券信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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于最短持有期届满后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。

于本报告期末，本基金的卖出回购金融资产款(若有)计息且利息金额不重大；除此之外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不付息，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。

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，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。

本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），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（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制。本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）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%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制。

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%。

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。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货币资金、结算备付金、债券投资及买入返售金融资产等。

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 | 904,540,951.95 | - | - | - | - | - | 904,540,951.95 |
| 结算备付金 | 19,086.18 | - | - | - | - | - | 19,086.18 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | 64,909,327.12 | 11,526,051,881.05 | 11,590,961,208.17 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 333,214.31 | 333,214.31 |
| 资产总计 | 904,560,038.13 | - | - | - | 64,909,327.12 | 11,526,385,095.36 | 12,495,854,460.61 |
| 负债 | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|-------------|----------------|--------|------------|-------|---------------|-------------------|-------------------|
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 12,412,701.12 | 12,412,701.12 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 2,068,783.50 | 2,068,783.50 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 595,084.53 | 595,084.53 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 274.85 | 274.85 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 240,000.00 | 240,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 15,316,844.00 | 15,316,844.00 |
| 利率敏感度缺口 | 904,560,038.13 | - | - | - | 64,909,327.12 | 11,511,068,251.36 | 12,480,537,616.61 |
| 上年度末 2022 年 | 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 |

| | | | | | | | |
|----------|------------------|---|---|---|---|------------------|------------------|
| 12月31日 | | | | | | | |
| 资产 | | | | | | | |
| 货币资金 | 1,228,762,724.31 | - | - | - | - | - | 1,228,762,724.31 |
| 结算备付金 | 720,157.75 | - | - | - | - | - | 720,157.75 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 6,632,253,334.45 | 6,632,253,334.45 |
| 买入返售金融资产 | 2,001,171,261.09 | - | - | - | - | - | 2,001,171,261.09 |
| 资产总计 | 3,230,654,143.15 | - | - | - | - | 6,632,253,334.45 | 9,862,907,477.60 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 12,734,654.82 | 12,734,654.82 |
| 应 | - | - | - | - | - | 2,122,442.45 | 2,122,442.45 |

| | | | | | | | | |
|---------------------------------|------------------|---|---|---|---|------------------|------------------|--|
| 付 托 管 费 | | | | | | | | |
| 应 付 销 售 服 务 费 | - | - | - | - | - | 432,366.90 | 432,366.90 | |
| 应 交 税 费 | - | - | - | - | - | 37,525.85 | 37,525.85 | |
| 其 他 负 债 | - | - | - | - | - | 108,000.00 | 108,000.00 | |
| 负 债 总 计 | - | - | - | - | - | 15,434,990.02 | 15,434,990.02 | |
| 利 率 敏 感 度 缺 口 | 3,230,654,143.15 | - | - | - | - | 6,616,818,344.43 | 9,847,472,487.58 | |

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

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|--------------------|-----------------------------|-----------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
| | 1. 市场利率下降 25 个基点 | 880,232.39 | - |
| | 2. 市场利率上升 25 个基点 | -866,250.43 | - |

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | | | |
|---------------|-----------------------|------------------|-----------|------------------|
| | 美元折合人民币 | 港币折合人民币 | 其他币种折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 交易性金融资产 | - | 1,628,406,822.49 | - | 1,628,406,822.49 |
| 资产合计 | - | 1,628,406,822.49 | - | 1,628,406,822.49 |
| 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 | - | 1,628,406,822.49 | - | 1,628,406,822.49 |
| 项目 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | | | |
| | 美元折合人民币 | 港币折合人民币 | 其他币种折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 交易性金融资产 | - | 200,576,551.95 | - | 200,576,551.95 |
| 资产合计 | - | 200,576,551.95 | - | 200,576,551.95 |
| 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 | - | 200,576,551.95 | - | 200,576,551.95 |

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|-------------------|-----------------------------|-----------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
| | 1. 所有外币相对人民币升值 5% | 81,420,341.12 | 10,028,827.60 |
| | 2. 所有外币相对人民币贬值 5% | -81,420,341.12 | -10,028,827.60 |

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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且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。

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 | 11,526,051,881.05 | 92.35 | 6,632,253,334.45 | 67.35 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 11,526,051,881.05 | 92.35 | 6,632,253,334.45 | 67.35 |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准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. 业绩比较基准上升 5% | 966,480,630.99 | 397,468,530.00 |
| | 2. 业绩比较基准下降 5% | -966,480,630.99 | -397,468,530.00 |

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 | 11,544,077,175.32 | 6,517,579,858.45 |
| 第二层次 | - | - |
| 第三层次 | 46,884,032.85 | 114,673,476.00 |
| 合计 | 11,590,961,208.17 | 6,632,253,334.45 |

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的当期期初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。

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 | - | 114,673,476.00 | 114,673,476.00 |
| 当期购买 | - | 377,381,945.20 | 377,381,945.20 |
| 当期出售/结算 | - | - | - |
| 转入第三层次 | - | - | - |
| 转出第三层次 | - | 432,055,532.95 | 432,055,532.95 |
| 当期利得或损失总额 | - | -13,115,855.40 | -13,115,855.40 |
| 其中：计入损益的利得或损失 | - | -13,115,855.40 | -13,115,855.40 |
| 计入其他综合收益的利得或损失 | - | - | - |
| 期末余额 | - | 46,884,032.85 | 46,884,032.85 |
| 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 | - | -13,115,855.40 | -13,115,855.40 |
| 项目 | 上年度可比期间 2022 年 10 月 18 日（基金合同生效日）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 | - | - | - |
| 当期购买 | - | 133,026,506.00 | 133,026,506.00 |
| 当期出售/结算 | - | - | - |
| 转入第三层次 | - | - | - |
| 转出第三层次 | - | - | - |
| 当期利得或损失总额 | - | -18,353,030.00 | -18,353,030.00 |
| 其中：计入损益的利得或损失 | - | -18,353,030.00 | -18,353,030.00 |
| 计入其他综合收益的利得或损失 | - | - | - |
| 期末余额 | - | 114,673,476.00 | 114,673,476.00 |
| 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 | - | -18,353,030.00 | -18,353,030.00 |

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 |
| 科达利 | 46,884,032.85 | 平均价格亚式期权模型 | 预期年化波动率 | 0.3627 | 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 |
| 朗新科技 | 114,674,476.00 | 平均价格亚式期权模型 | 预期年化波动率 | 0.4737-0.4788 | 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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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 | 11,526,051,881.05 | 92.24 |
| | 其中：股票 | 11,526,051,881.05 | 92.24 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 64,909,327.12 | 0.52 |
| | 其中：债券 | 64,909,327.12 | 0.52 |
| | 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 | 904,560,038.13 | 7.24 |
| 8 | 其他各项资产 | 333,214.31 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 12,495,854,460.61 | 100.00 |

注：1、银行存款中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。

2、本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 1,628,406,822.49 元，占基金资产净值比例 13.05%。

3、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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 | - | - |
| C | 制造业 | 9,090,707,112.50 | 72.84 |

| | | | |
|---|------------------|------------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 247,524,597.28 | 1.98 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 103,488,559.20 | 0.83 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 333,351,161.88 | 2.67 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | 122,573,627.70 | 0.98 |
| | 合计 | 9,897,645,058.56 | 79.30 |

8.2.2 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(%) |
|------|------------------|--------------|
| 通信服务 | 1,051,909,722.48 | 8.43 |
| 可选消费 | 549,401,819.80 | 4.40 |
| 信息技术 | 27,095,280.21 | 0.22 |
| 合计 | 1,628,406,822.49 | 13.05 |

注：以上行业分类采用中证行业分类标准。

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 | 300750 | 宁德时代 | 6,276,407 | 1,024,686,206.82 | 8.21 |
| 2 | 002812 | 恩捷股份 | 14,428,748 | 819,841,461.36 | 6.57 |
| 3 | 002475 | 立讯精密 | 23,193,300 | 799,009,185.00 | 6.40 |
| 4 | 002850 | 科达利 | 9,047,539 | 762,707,364.09 | 6.11 |
| 5 | 002459 | 晶澳科技 | 33,574,575 | 695,665,194.00 | 5.57 |
| 6 | 002050 | 三花智控 | 21,419,354 | 629,729,007.60 | 5.05 |
| 7 | 00700 | 腾讯控股 | 2,303,800 | 612,963,293.13 | 4.91 |
| 8 | 300101 | 振芯科技 | 26,696,244 | 609,475,250.52 | 4.88 |
| 9 | 603179 | 新泉股份 | 12,009,027 | 608,977,759.17 | 4.88 |
| 10 | 03690 | 美团-W | 7,402,400 | 549,401,819.80 | 4.40 |
| 11 | 002129 | TCL 中环 | 31,767,972 | 496,851,082.08 | 3.98 |
| 12 | 603308 | 应流股份 | 32,789,946 | 469,879,926.18 | 3.76 |

| | | | | | |
|----|--------|------|------------|----------------|------|
| 13 | 01024 | 快手-W | 9,147,700 | 438,946,429.35 | 3.52 |
| 14 | 601012 | 隆基绿能 | 17,775,638 | 407,062,110.20 | 3.26 |
| 15 | 002709 | 天赐材料 | 13,298,588 | 333,528,587.04 | 2.67 |
| 16 | 300682 | 朗新集团 | 20,338,692 | 333,351,161.88 | 2.67 |
| 17 | 002594 | 比亚迪 | 1,187,800 | 235,184,400.00 | 1.88 |
| 18 | 600519 | 贵州茅台 | 116,214 | 200,585,364.00 | 1.61 |
| 19 | 300919 | 中伟股份 | 3,971,400 | 195,114,882.00 | 1.56 |
| 20 | 002832 | 比音勒芬 | 5,744,573 | 182,102,964.10 | 1.46 |
| 21 | 688598 | 金博股份 | 2,395,000 | 167,410,500.00 | 1.34 |
| 22 | 601117 | 中国化学 | 26,019,200 | 165,482,112.00 | 1.33 |
| 23 | 688518 | 联赢激光 | 7,781,513 | 159,365,386.24 | 1.28 |
| 24 | 605117 | 德业股份 | 1,511,509 | 126,815,605.10 | 1.02 |
| 25 | 600603 | 广汇物流 | 15,754,965 | 122,573,627.70 | 0.98 |
| 26 | 002352 | 顺丰控股 | 2,561,598 | 103,488,559.20 | 0.83 |
| 27 | 600970 | 中材国际 | 8,783,992 | 82,042,485.28 | 0.66 |
| 28 | 002466 | 天齐锂业 | 1,089,100 | 60,760,889.00 | 0.49 |
| 29 | 603806 | 福斯特 | 1,997,400 | 48,476,898.00 | 0.39 |
| 30 | 603688 | 石英股份 | 445,000 | 38,661,600.00 | 0.31 |
| 31 | 00981 | 中芯国际 | 1,505,500 | 27,095,280.21 | 0.22 |
| 32 | 601865 | 福莱特 | 704,700 | 18,815,490.00 | 0.15 |

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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 | 002459 | 晶澳科技 | 1,264,801,630.89 | 12.84 |
| 2 | 002812 | 恩捷股份 | 1,113,715,109.18 | 11.31 |
| 3 | 002850 | 科达利 | 792,248,886.25 | 8.05 |
| 4 | 03690 | 美团-W | 727,244,385.98 | 7.39 |
| 5 | 00700 | 腾讯控股 | 711,922,033.33 | 7.23 |
| 6 | 002129 | TCL 中环 | 692,392,405.24 | 7.03 |
| 7 | 300750 | 宁德时代 | 604,701,175.84 | 6.14 |
| 8 | 300101 | 振芯科技 | 553,135,075.40 | 5.62 |
| 9 | 002050 | 三花智控 | 550,614,308.90 | 5.59 |
| 10 | 002475 | 立讯精密 | 536,689,055.03 | 5.45 |
| 11 | 603179 | 新泉股份 | 511,637,219.98 | 5.20 |
| 12 | 01024 | 快手-W | 503,262,762.40 | 5.11 |
| 13 | 002594 | 比亚迪 | 495,228,642.83 | 5.03 |
| 14 | 601012 | 隆基绿能 | 461,236,342.58 | 4.68 |
| 15 | 300682 | 朗新集团 | 276,656,968.01 | 2.81 |
| 16 | 300919 | 中伟股份 | 259,607,450.76 | 2.64 |

| | | | | |
|----|--------|------|----------------|------|
| 17 | 601117 | 中国化学 | 257,850,566.30 | 2.62 |
| 18 | 688518 | 联赢激光 | 227,825,589.43 | 2.31 |
| 19 | 601668 | 中国建筑 | 211,821,508.13 | 2.15 |
| 20 | 605117 | 德业股份 | 202,979,611.81 | 2.06 |

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（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 | 002050 | 三花智控 | 633,094,552.87 | 6.43 |
| 2 | 002475 | 立讯精密 | 342,124,979.07 | 3.47 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 270,715,874.00 | 2.75 |
| 4 | 300059 | 东方财富 | 256,716,475.07 | 2.61 |
| 5 | 603613 | 国联股份 | 238,634,299.20 | 2.42 |
| 6 | 601668 | 中国建筑 | 223,666,887.16 | 2.27 |
| 7 | 600809 | 山西汾酒 | 209,871,210.32 | 2.13 |
| 8 | 002594 | 比亚迪 | 157,449,995.92 | 1.60 |
| 9 | 601888 | 中国中免 | 134,115,282.74 | 1.36 |
| 10 | 601012 | 隆基绿能 | 116,407,579.66 | 1.18 |
| 11 | 002568 | 百润股份 | 112,783,275.88 | 1.15 |
| 12 | 688385 | 复旦微电 | 102,555,402.66 | 1.04 |
| 13 | 300101 | 振芯科技 | 97,723,945.54 | 0.99 |
| 14 | 603659 | 璞泰来 | 80,640,390.48 | 0.82 |
| 15 | 001301 | 尚太科技 | 75,833,658.10 | 0.77 |
| 16 | 002180 | 纳思达 | 73,377,979.00 | 0.75 |
| 17 | 002850 | 科达利 | 71,569,766.47 | 0.73 |
| 18 | 000933 | 神火股份 | 66,298,569.73 | 0.67 |
| 19 | 002466 | 天齐锂业 | 64,992,361.00 | 0.66 |
| 20 | 00981 | 中芯国际 | 55,326,393.67 | 0.56 |

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（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 | 13,284,273,979.91 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,770,692,972.69 |

注：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。

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 | - | - |
| 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) | 64,909,327.12 | 0.52 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 64,909,327.12 | 0.52 |

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 | 127089 | 晶澳转债 | 631,394 | 64,909,327.12 | 0.52 |

本基金本报告期末仅持有上述债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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 | 333,214.31 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 333,214.31 |

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|---------------|---------------|-----------|
| 1 | 002850 | 科达利 | 46,884,032.85 | 0.38 | 非公开发行流通受限 |

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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

| 份额级别 | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份 额 | 持有人结构 | | | |
|---------------|--------------|---------------|---------------|------------|-------------------|------------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额 比例 | 持有份额 | 占总份额 比例 |
| 泉果旭源三年持有期混合 A | 223,378.00 | 64,912.09 | 77,566,777.25 | 0.53% | 14,422,365,204.61 | 99.47% |
| 泉果旭源三年持有期混合 C | 37,066.00 | 66,032.14 | 15,152,932.01 | 0.62% | 2,432,394,551.98 | 99.38% |
| 合计 | 260,444.00 | 65,071.49 | 92,719,709.26 | 0.55% | 16,854,759,756.59 | 99.45% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|---------------|---------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 泉果旭源三年持有期混合 A | 19,714,273.35 | 0.14% |
| | 泉果旭源三年持有期混合 C | 745,701.40 | 0.03% |
| | 合计 | 20,459,974.75 | 0.12% |

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 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|---------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 泉果旭源三年持有期混合 A | >100 |
| | 泉果旭源三年持有期混合 C | 0 |
| | 合计 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 泉果旭源三年持有期混合 A | >100 |
| | 泉果旭源三年持有期混合 C | 0 |
| | 合计 | >100 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | 泉果旭源三年持有期混合 A | 泉果旭源三年持有期混合 C |
|---------------------------------|-------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2022 年 10 月 18 日)基金份额总额 | 8,645,350,074.94 | 1,262,117,596.57 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 8,645,350,074.94 | 1,262,117,596.57 |
| 本报告期基金总申购份额 | 5,854,581,906.92 | 1,185,429,887.42 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | - | - |
| 本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 14,499,931,981.86 | 2,447,547,483.99 |

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,本基金管理人、本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事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 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以来聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务,本报告年度的审计费用为 120,000 元。

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,本基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

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,本基金托管人的托管业务部门及其相关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 | |
| 兴业证券 | 3 | 16,774,967,007.40 | 100.00% | 12,275,849.87 | 100.00% | - |

注：1、根据《关于新设公募基金管理人证券交易模式转换有关事项的通知》（证监办发[2019]14号）的有关规定，基金产品管理人可选择一家或多家证券公司开展证券交易，并可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》第二条“一家基金管理公司通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金的30%”的分仓规定。

2、本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。

3、本基金报告期内无其他新增或停止使用的交易单元。

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 |
| 兴业证券 | 44,755,695.08 | 100.00% | 5,889,195,000.00 | 100.00% | - | - | - | - |

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 | 泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2023-01-20 |
| 2 | 泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金开放日常申购暨暂停大额申购业务的公告 | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2023-02-06 |
| 3 | 泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金暂停申购业务的公告 | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2023-02-08 |
| 4 | 关于泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告 | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2023-02-14 |
| 5 | 泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金 2022 年年度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2023-03-31 |
| 6 | 泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2023-04-21 |
| 7 | 泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金恢复申购、开放定期定额投资及暂停大额申购业务的公告 | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2023-06-12 |
| 8 | 关于泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告 | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2023-06-21 |
| 9 | 泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2023-07-21 |
| 10 | 泉果基金管理有限公司关于旗下基金开展直销费率优惠活动的公告 | 上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2023-08-12 |
| 11 | 关于泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告 | 证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2023-08-12 |
| 12 | 泉果基金管理有限公司关于调低旗下公募基金费率并修订基金合同的公告 | 上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2023-08-12 |
| 13 | 泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金基金合同 | 中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2023-08-12 |
| 14 | 泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金托管协议 | 中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2023-08-12 |
| 15 | 泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2023 年第 1 号） | 中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2023-08-12 |

| | | | |
|----|---------------------------------------|--------------------|------------|
| 16 | 泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要（更新） | 中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2023-08-12 |
| 17 | 泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要（更新） | 中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2023-08-12 |
| 18 | 泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金 2023 年中期报告 | 中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2023-08-31 |
| 19 | 泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2023-10-25 |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金注册的文件；
- 2、《泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、《泉果旭源三年持有期混合型证券投资基金产品资料概要》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内在规定媒介上公开披露的各项公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所：上海市浦东新区南洋泾路 555 号陆家嘴金融街区 19 号楼。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.qgfund.com)或在办公时间预约前往基金管理人办公场所免费查阅文件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询基金管理人。

客服热线:400-158-6599

客服邮箱:service@qgfund.com

泉果基金管理有限公司
二〇二四年三月二十九日