

泉果嘉源三年持有期混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:泉果基金管理有限公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 08 月 30 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08月28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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年01月01日起至2024年06月30日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 1 |
| 1.1 重要提示 | 1 |
| 1.2 目录 | 2 |
| § 2 基金简介 | 4 |
| 2.1 基金基本情况 | 4 |
| 2.2 基金产品说明 | 4 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 5 |
| 2.5 其他相关资料 | 5 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 5 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 5 |
| 3.2 基金净值表现 | 6 |
| § 4 管理人报告 | 7 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 8 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 8 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 9 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 10 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 10 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 11 |
| § 5 托管人报告 | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 11 |
| 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 | 11 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 11 |
| § 6 半年度财务会计报告(未经审计) | 11 |
| 6.1 资产负债表 | 11 |
| 6.2 利润表 | 13 |
| 6.3 净资产变动表 | 13 |
| 6.4 报表附注 | 14 |
| § 7 投资组合报告 | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 40 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 41 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 42 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 43 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 44 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 45 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 45 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 45 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 45 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 45 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 45 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 45 |

| | |
|---|-----------|
| § 8 基金份额持有人信息 | 46 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 46 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 47 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况..... | 47 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 47 |
| § 10 重大事件揭示 | 48 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 48 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 48 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 48 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 48 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 48 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 48 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 48 |
| 10.8 其他重大事件..... | 49 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 50 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 50 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 50 |
| § 12 备查文件目录 | 50 |
| 12.1 备查文件目录..... | 50 |
| 12.2 存放地点..... | 50 |
| 12.3 查阅方式..... | 50 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---------------------|--------------------|------------------|
| 基金名称 | 泉果嘉源三年持有期混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 泉果嘉源三年持有期混合 | |
| 基金主代码 | 019624 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2023 年 12 月 05 日 | |
| 基金管理人 | 泉果基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 上海浦东发展银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 745,511,169.97 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 泉果嘉源三年持有期混合 A | 泉果嘉源三年持有期混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 019624 | 019625 |
| 报告期末下属分级基金的份 额总额 | 544,888,723.43 份 | 200,622,446.54 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金以基本面研究分析为立足点，通过积极主动的组合管理，精选优质上市公司进行投资，在严格控制风险的前提下，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，本基金将综合考虑宏观与微观经济、市场与政策等多方面因素，对股票、债券等大类资产的风险收益特征进行动态跟踪，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大类资产配置比例；在股票投资方面，本基金将托专业的研究力量，主要采用自下而上的股票投资策略，综合运用定性分析和定量分析相结合的方法，在优选行业的基础上，通过综合分析上市公司的中长期业绩质量、成长性和估值水平等，筛选出估值合理、基本面良好且具有良好成长性的股票进行投资；在债券投资方面，本基金将以价值分析为主线，结合宏观环境分析和微观市场定价实施债券组合管理。对于可转换债券和可交换债券等特殊品种，将根据其债性和股性特征采取相应的投资策略。对于对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、资产构成、信用风险、流动性等影响资产支持证券价值的因素，评估资产支持证券的投资价值并做出相应的投资决策。</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 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李云亮 | 朱萍 |
| | 联系电话 | 021-63188889 | 021-31888888 |
| | 电子邮箱 | service@qgfund.com | zhup02@spdb.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-158-6599 | 95528 |
| 传真 | | 021-62066669 | 021-63602540 |
| 注册地址 | | 上海市长宁区哈密路 1500 号 I-22 幢 22 层 288 室 | 上海市中山东一路 12 号 |
| 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 | 上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋 |
| 邮政编码 | | 200135 | 200126 |
| 法定代表人 | | 任莉 | 张为忠 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.qgfund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 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 |
|--------|------------|--------------------------------|
| 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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2024 年 01 月 01 日-2024 年 06 月 30 日） | |
|---------------|--|----------------|
| | 泉果嘉源三年持有期混合 A | 泉果嘉源三年持有期混合 C |
| 本期已实现收益 | 2,676,926.39 | 579,017.83 |
| 本期利润 | 17,138,536.02 | 5,895,380.00 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0315 | 0.0294 |
| 本期加权平均净值利润率 | 3.09% | 2.90% |
| 本期基金份额净值增长率 | 3.14% | 2.94% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2024 年 06 月 30 日） | |
| 期末可供分配利润 | 2,757,924.96 | 552,142.55 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0051 | 0.0028 |
| 期末基金资产净值 | 562,912,176.45 | 206,787,794.34 |
| 期末基金份额净值 | 1.0331 | 1.0307 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末（2024 年 06 月 30 日） | |
| 基金份额累计净值增长率 | 3.31% | 3.07% |

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。

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

泉果嘉源三年持有期混合 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | 0.62% | 0.49% | -2.21% | 0.39% | 2.83% | 0.10% |
| 过去三个月 | 2.26% | 0.43% | 0.52% | 0.60% | 1.74% | -0.17% |
| 过去六个月 | 3.14% | 0.33% | 2.44% | 0.72% | 0.70% | -0.39% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.31% | 0.31% | 2.28% | 0.71% | 1.03% | -0.40% |

泉果嘉源三年持有期混合 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | 0.59% | 0.49% | -2.21% | 0.39% | 2.80% | 0.10% |
| 过去三个月 | 2.14% | 0.43% | 0.52% | 0.60% | 1.62% | -0.17% |
| 过去六个月 | 2.94% | 0.33% | 2.44% | 0.72% | 0.50% | -0.39% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.07% | 0.30% | 2.28% | 0.71% | 0.79% | -0.41% |

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

泉果嘉源三年持有期混合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
(2023年12月05日-2024年06月30日)



泉果嘉源三年持有期混合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
(2023年12月05日-2024年06月30日)



注：1、本基金合同于 2023 年 12 月 05 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2、根据基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为 6 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。

§ 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2024年6月30日，公司共管理五只公募基金，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、泉果泰然30天持有期债券型证券投资基金、泉果泰岩3个月定期开放债券型证券投资基金。

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 | | |
| 钱思佳 | 本基金的基金经理 | 2023-12-05 | - | 16年 | 钱思佳女士，硕士研究生，泉果基金管理有限公司公募投资部基金经理。2023年12月5日至今任泉果嘉源三年持有期混合型证券投资基金基金经理。曾任上海东方证券资产管理有限公司研究部高级研究员、专户投资部投资主办人、私募权益投资部总经理助理、资深投资经理、公募权益投资部基金经理等。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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。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

今年以来 A 股市场十分艰难，上半年全 A 指数累计跌幅达到 19.91%。以中信一级行业指数为例，在 30 个细分子行业中实现上涨的行业仅有银行、煤炭、石油石化、家电、电力及公用事业、有色金属、交通运输、和通信指数，其中超过 10% 涨幅的仅有银行、煤炭、石油石化和家电四个行业指数；从所有沪深两市约 5100 只个股来看，实现正收益的个股数量仅有 718 只；主要市场指数全线下跌，从 7 月的数据来看，市场表现继续恶化，可以说今年以来的 A 股市场是一个胜率很低的市场。

在本产品建仓初期，面对已经深幅调整 2 年的市场，整体来说我们是积极和乐观的，但同时也充分认识到中国正处于金融周期的下半场、宏观经济也正在经历高质量发展的转型时期，在仓位上我们仍然是相对谨慎和保守的，一季度末的仓位约为 30%，二季度末加仓至 60%，并继续保持在 60-65% 之间运行。对于投资机会的挖掘，我们从中长期的投资视角出发，选择在当下复杂的宏观、微观市场环境下依靠公司整体竞争力实现业绩持续增长，且通过我们的深度研究，对业绩增长的可预测性判断相对确定性较高的标的进行投资，我们相信业绩持续增长的基本面足以让股价在波动的市场环境下穿越中长期的投资周期，最终兑现公司实际的经营实力。

在二季报中，我们提出关注行业竞争格局改善带来的投资机会，例如：中国液晶面板行业在经历了近十年来的投资过热后，行业供给已逐步恢复理性，供需结构正逐步改善；油轮航运行业也将迎来供需改善的时点，虽然国际物流行业会因地缘政治、战争等非经常性因素而产生较大波动，但是新船订单数据向市场展示了未来 2-3 年的新增供给情况，我们需要对需求端有细致的研究，从而做出对油轮航运周期景气程度的判断。供给侧带来竞争格局的改善的投资机会，可以通过前瞻研究和中期跟踪进行捕捉，其投资逻辑也相对明晰：供给端来看，在连续多年的经济调整周期中，会有越来越多的行业积累数年的投资不足，使得未来几年新增供给受限；需求端来看，一方面需求侧本身就具备跟随宏观经济周期波动的特性，另一方面也会有一些行业的需求受到全球供应链重塑或者中国经济转型的拉动，累计的供给侧影响将在这些时点上带来供需格局的改善。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泉果嘉源三年持有期混合 A 基金份额净值为 1.0331 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 3.14%，同期业绩比较基准收益率为 2.44%；截至报告期末泉果嘉源三年持有期混合 C 基金份额净值为 1.0307 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.94%，同期业绩比较基准收益率为 2.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望全球下半年的国际局势仍然不容乐观，地缘冲突不断、国际贸易壁垒筑起、货运物流的不畅等也为前几个季度表现亮眼的出口链蒙上了一层担忧情绪。高居不下的利率已经对发达国家的需求产生了一些抑制作用，因此今年以来发达国家的货币政策也变得相对不同步。美国的大选后，其对中国的贸易政策或有可能产生负向影响，这对于出口链投资机会的前景增加了较大的不确定性。然而从中长期的角度，在中国经济处于转型期的时间里，企业的出海能力将成为众多企业中期实现业绩持续增长的重要动能之一，这也将是我们寻找投资机会的重要抓手。在当下全球生态中，全球再工业化是一个 1-3 年、甚至更长时间维度内持续推进的逻辑，与之相关的工业金属、设备及零部件等制造业投资端拉动的需求都值得重视。

国内经济处于重要的转型时期，而国际宏观、政治、经济局势亦扑朔迷离，这些不稳定性因素的叠加使得风险偏好仍处于较低的位置，市场的低迷表现正是反映了对这类因素的担忧。我们在对市场谨慎的同时仍将抱有乐观的心态，我们相信股价终将与经营业绩相匹配，因此我们会积极寻找经营可期的投资标的力求为投资者实现收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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。

4.7 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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对泉果嘉源三年持有期混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对泉果嘉源三年持有期混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由泉果基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：泉果嘉源三年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------|---------|----------------------|-----------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 37,714,843.83 | 160,965,130.08 |
| 结算备付金 | | 1,198,494.35 | 180,082,642.32 |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 540,830,207.88 | 119,052,620.76 |

| | | | |
|---------------|------------|-----------------------------|------------------------------|
| 其中：股票投资 | | 467,458,472.29 | 14,982,845.00 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 73,371,735.59 | 104,069,775.76 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 192,679,000.00 | 287,183,195.36 |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | 61,126.09 | - |
| 应收申购款 | | 89.92 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 772,483,762.07 | 747,283,588.52 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 1,727,831.26 | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 756,053.76 | 637,062.30 |
| 应付托管费 | | 126,008.92 | 106,177.05 |
| 应付销售服务费 | | 67,707.27 | 57,126.76 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 1,708.41 | 16,511.40 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 104,481.66 | 10,000.00 |
| 负债合计 | | 2,783,791.28 | 826,877.51 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 745,511,169.97 | 745,307,569.81 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 24,188,800.82 | 1,149,141.20 |
| 净资产合计 | | 769,699,970.79 | 746,456,711.01 |
| 负债和净资产总计 | | 772,483,762.07 | 747,283,588.52 |

注：1、报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 745,511,169.97 份。其中泉果嘉源三年持有期混合 A 基金份额净值 1.0331 元，基金份额总额 544,888,723.43 份；泉果嘉源三年持有期混合 C 基金份额净值 1.0307 元，基金份额总额 200,622,446.54 份。

2、本基金合同于 2023 年 12 月 05 日生效，可比期间不完整。

6.2 利润表

会计主体：泉果嘉源三年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|----------------------------|------------|---------------------------------------|
| 一、营业总收入 | | 28,811,113.11 |
| 1. 利息收入 | | 4,259,516.94 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 2,633,654.59 |
| 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 | | 1,625,862.35 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 4,773,624.37 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -2,293,727.76 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.11 | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.12 | 858,918.95 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13 | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | 66,519.71 |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 6,141,913.47 |
| 其他投资收益 | | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 19,777,971.80 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | - |
| 减：二、营业总支出 | | 5,777,197.09 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 4,518,014.80 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 753,002.43 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 404,808.87 |
| 4. 投资顾问费 | | - |
| 5. 利息支出 | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.19 | - |
| 7. 税金及附加 | | 5,242.41 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.20 | 96,128.58 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 23,033,916.02 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 23,033,916.02 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - |
| 六、综合收益总额 | | 23,033,916.02 |

6.3 净资产变动表

会计主体：泉果嘉源三年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 | | |
|--|---------------------------------------|---------------|----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 745,307,569.81 | 1,149,141.20 | 746,456,711.01 |
| 二、本期期初净资产 | 745,307,569.81 | 1,149,141.20 | 746,456,711.01 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 203,600.16 | 23,039,659.62 | 23,243,259.78 |
| (一)、综合收益总额 | - | 23,033,916.02 | 23,033,916.02 |
| (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) | 203,600.16 | 5,743.60 | 209,343.76 |
| 其中：1.基金申购款 | 203,600.16 | 5,743.60 | 209,343.76 |
| 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 | 745,511,169.97 | 24,188,800.82 | 769,699,970.79 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王国斌

王国斌

王一鸣

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泉果嘉源三年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2023]2091号文《关于准予泉果嘉源三年持有期混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由泉果基金管理有限公司向社会公开募集。基金合同于2023年12月5日生效。首次设立基金募集规模为745,307,569.81份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2023）验字第70059594_B01号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为泉果基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、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、次级债、可转换债券、分离交易可转换债券、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）。本基金可根据相关法律法规的规定和基金合同的约定参与融资业务。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。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：股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为 60%-95%（其中，投资于港股通标的股票占股票资产的比例为 0%-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、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。本基金以基本面研究分析为立足点，通过积极主动的组合管理，精选优质上市公司进行投资，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

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

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

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

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

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

资产的账面余额；

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

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

6.4.4.10 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等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，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、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

6.4.4.12 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金额。

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6. 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税

[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 |
|----------------|----------------------|
| 活期存款 | 21,520,122.12 |
| 等于：本金 | 21,518,093.64 |
| 加：应计利息 | 2,028.48 |
| 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 | 16,194,721.71 |
| 等于：本金 | 16,189,360.82 |
| 加：应计利息 | 5,360.89 |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 37,714,843.83 |

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。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 | | | | |
|---------------|----------------------|---------------|----------------|---------------|-------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | 445,784,733.10 | - | 467,458,472.29 | 21,673,739.19 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 73,432,862.71 | 738,241.89 | 73,371,735.59 | -799,369.01 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 73,432,862.71 | 738,241.89 | 73,371,735.59 | -799,369.01 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 519,217,595.81 | 738,241.89 | 540,830,207.88 | 20,874,370.18 | |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 | |
|-------|----------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 192,679,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 192,679,000.00 | - |

注：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。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 |
|-------------|----------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | - |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 104,481.66 |
| 合计 | 104,481.66 |

6.4.7.7 实收基金

泉果嘉源三年持有期混合 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 | |
|------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 544,787,533.15 | 544,787,533.15 |

| | | |
|---------------|----------------|----------------|
| 本期申购 | 101,190.28 | 101,190.28 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 544,888,723.43 | 544,888,723.43 |

泉果嘉源三年持有期混合 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 200,520,036.66 | 200,520,036.66 |
| 本期申购 | 102,409.88 | 102,409.88 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 200,622,446.54 | 200,622,446.54 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

泉果嘉源三年持有期混合 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 | 80,318.69 | 801,475.83 | 881,794.52 |
| 本期期初 | 80,318.69 | 801,475.83 | 881,794.52 |
| 本期利润 | 2,676,926.39 | 14,461,609.63 | 17,138,536.02 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 679.88 | 2,442.60 | 3,122.48 |
| 其中：基金申购款 | 679.88 | 2,442.60 | 3,122.48 |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 2,757,924.96 | 15,265,528.06 | 18,023,453.02 |

泉果嘉源三年持有期混合 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 | -27,575.87 | 294,922.55 | 267,346.68 |
| 本期期初 | -27,575.87 | 294,922.55 | 267,346.68 |
| 本期利润 | 579,017.83 | 5,316,362.17 | 5,895,380.00 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 700.59 | 1,920.53 | 2,621.12 |
| 其中：基金申购款 | 700.59 | 1,920.53 | 2,621.12 |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 552,142.55 | 5,613,205.25 | 6,165,347.80 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 40,295.69 |
| 定期存款利息收入 | 590,083.34 |
| 其他存款利息收入 | 116,288.87 |
| 结算备付金利息收入 | 1,886,986.69 |
| 其他 | - |
| 合计 | 2,633,654.59 |

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。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 156,546,104.27 |
| 减：卖出股票成本总额 | 158,001,484.20 |
| 减：交易费用 | 838,347.83 |
| 买卖股票差价收入 | -2,293,727.76 |

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|------------------------------|---------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 446,466.40 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 412,452.55 |
| 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 | 858,918.95 |

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 76,920,408.81 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 75,531,511.09 |
| 减：应计利息总额 | 973,447.63 |
| 减：交易费用 | 2,997.54 |
| 买卖债券差价收入 | 412,452.55 |

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|
| 股指期货投资收益 | 68,560.00 |
| 减：其他衍生工具收益应缴纳增值税 | 1,996.89 |
| 减：交易费用 | 43.40 |
| 合计 | 66,519.71 |

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 6,141,913.47 |
| 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 | 6,141,913.47 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 19,777,971.80 |
| ——股票投资 | 21,293,397.19 |
| ——债券投资 | -1,515,425.39 |
| ——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 | 19,777,971.80 |
|----|---------------|

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 34,809.32 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 证券组合费 | 1,646.92 |
| 合计 | 96,128.58 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------------------|-----------------------|
| 泉果基金管理有限公司(以下简称“泉果基金”) | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“上海浦东发展银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 自然人股东 | 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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 4,518,014.80 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 1,795,795.75 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 2,722,219.05 |

注：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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 753,002.43 |

注：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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 | | |
|----------------|---------------------------------------|---------------|----|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 泉果嘉源三年持有期混合 A | 泉果嘉源三年持有期混合 C | 合计 |
| | | | |

| | | | |
|----------|---|-----------|-----------|
| 泉果基金 | - | 29.89 | 29.89 |
| 上海浦东发展银行 | - | 14,939.58 | 14,939.58 |
| 合计 | - | 14,969.47 | 14,969.47 |

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 类基金份额前一日的基础资产净值

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期末未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

泉果嘉源三年持有期混合 A

份额单位：份

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|----------------------------------|---------------------------------------|
| 基金合同生效日（2023 年 12 月 05 日）持有的基金份额 | 5,000,500.00 |
| 报告期初持有的基金份额 | 5,000,500.00 |
| 报告期间申购/买入总份额 | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 5,000,500.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.92% |

注：1. 基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

2. 本报告期无基金管理人运用固有资金投资泉果嘉源三年持有期混合 C 的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

泉果嘉源三年持有期混合 A

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 | | 上年度末 2023 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 | 6,293,044.51 | 1.15% | 6,292,076.18 | 1.15% |

注：本报告期末无其他关联方投资泉果嘉源三年持有期混合 C 的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 | |
|----------|---------------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 上海浦东发展银行 | 21,520,122.12 | 40,295.69 |

注：本基金的部分银行存款由基金托管人上海浦东发展银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|-----------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 40,929,287.26 | 82,229,360.23 |
| 合计 | 40,929,287.26 | 82,229,360.23 |

注：债券信用评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分为国债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|-----------------------|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | 32,442,448.33 | 21,636,632.52 |
| 未评级 | - | 203,783.01 |
| 合计 | 32,442,448.33 | 21,840,415.53 |

注：债券信用评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分为国债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券(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 6.4.12。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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| | | | | | | | |
|-----|--------|--------|----------|-------|-------|-----|----|
| 本期末 | 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 |
|-----|--------|--------|----------|-------|-------|-----|----|

| | | | | | | | |
|-------------|----------------|--------------|---|---------------|---|----------------|----------------|
| 2024年06月30日 | | | | | 上 | | |
| 资产 | | | | | | | |
| 货币资金 | 37,714,843.83 | - | - | - | - | - | 37,714,843.83 |
| 结算备付金 | 1,198,494.35 | - | - | - | - | - | 1,198,494.35 |
| 交易性金融资产 | 40,929,287.26 | 3,288,393.81 | - | 29,154,054.52 | - | 467,458,472.29 | 540,830,207.88 |
| 买入返售金融资产 | 192,679,000.00 | - | - | - | - | - | 192,679,000.00 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 61,126.09 | 61,126.09 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 89.92 | 89.92 |
| 资产总计 | 272,521,625.44 | 3,288,393.81 | - | 29,154,054.52 | - | 467,519,688.30 | 772,483,762.07 |

| | | | | | | | |
|---------|----------------|--------------|---|---------------|---|----------------|----------------|
| 计 | | | | | | | |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | 1,727,831.26 | 1,727,831.26 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 756,053.76 | 756,053.76 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 126,008.92 | 126,008.92 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 67,707.27 | 67,707.27 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 1,708.41 | 1,708.41 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 104,481.66 | 104,481.66 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 2,783,791.28 | 2,783,791.28 |
| 利率敏感度 | 272,521,625.44 | 3,288,393.81 | - | 29,154,054.52 | - | 464,735,897.02 | 769,699,970.79 |

| 缺口 | | | | | | | |
|-----------------------------|----------------|------------|---------------|---------------|------|---------------|----------------|
| 上年度末 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 | 160,965,130.08 | - | - | - | - | - | 160,965,130.08 |
| 结算备付金 | 180,082,642.32 | - | - | - | - | - | 180,082,642.32 |
| 交易性金融资产 | 40,573,275.84 | 203,783.01 | 41,656,084.39 | 21,636,632.52 | - | 14,982,845.00 | 119,052,620.76 |
| 买入返售金融资产 | 287,183,195.36 | - | - | - | - | - | 287,183,195.36 |
| 资产总计 | 668,804,243.60 | 203,783.01 | 41,656,084.39 | 21,636,632.52 | - | 14,982,845.00 | 747,283,588.52 |
| 负债 | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|---------|----------------|------------|---------------|---------------|---|---------------|----------------|
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 637,062.30 | 637,062.30 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 106,177.05 | 106,177.05 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 57,126.76 | 57,126.76 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 16,511.40 | 16,511.40 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 10,000.00 | 10,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 826,877.51 | 826,877.51 |
| 利率敏感度缺口 | 668,804,243.60 | 203,783.01 | 41,656,084.39 | 21,636,632.52 | - | 14,155,967.49 | 746,456,711.01 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | |
|----|--------------------|
| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |
|----|--------------------|

| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
|------------------|------------------|-----------------------------|-----------------------|
| | | 本期末 2024 年 06 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
| | 1. 市场利率下降 25 个基点 | 227,893.31 | 249,400.50 |
| 2. 市场利率上升 25 个基点 | -225,647.05 | -247,178.32 | |

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 | | | |
|---------------|-----------------------|----------------|-----------|----------------|
| | 美元折合人民币 | 港币折合人民币 | 其他币种折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 交易性金融资产 | - | 153,985,147.23 | - | 153,985,147.23 |
| 应收股利 | - | 61,126.09 | - | 61,126.09 |
| 资产合计 | - | 154,046,273.32 | - | 154,046,273.32 |
| 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 | - | 154,046,273.32 | - | 154,046,273.32 |
| 项目 | 上年度末 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 | | | | |
| 资产合计 | - | - | - | - |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | - | - | - |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|------------------|-----------------------------|-----------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2024 年 06 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |

| | | |
|-------------------|---------------|---|
| 1. 所有外币相对人民币升值 5% | 7,702,313.67 | - |
| 2. 所有外币相对人民币贬值 5% | -7,702,313.67 | - |

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 | | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | |
|---------------|----------------------|---------------|-----------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 467,458,472.29 | 60.73 | 14,982,845.00 | 2.01 |
| 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 | 467,458,472.29 | 60.73 | 14,982,845.00 | 2.01 |

6.4.13.4.3.2 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 2024 年 06 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
| | 1. 业绩比较基准上升 5% | 28,441,167.88 | 1,024,645.97 |
| | 2. 业绩比较基准下降 5% | -28,441,167.88 | -1,024,645.97 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------------|-----------------------|
| 第一层次 | 499,900,920.62 | 36,619,477.52 |
| 第二层次 | 40,929,287.26 | 82,433,143.24 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 540,830,207.88 | 119,052,620.76 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 467,458,472.29 | 60.51 |
| | 其中：股票 | 467,458,472.29 | 60.51 |
| 2 | 基金投资 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 3 | 固定收益投资 | 73,371,735.59 | 9.50 |
| | 其中：债券 | 73,371,735.59 | 9.50 |
| | 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 | 192,679,000.00 | 24.94 |
| | 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 | 38,913,338.18 | 5.04 |
| 8 | 其他各项资产 | 61,216.01 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 772,483,762.07 | 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 153,985,147.23 元，占基金资产净值比例 20.01%。

3、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 3,043,000.00 | 0.40 |
| C | 制造业 | 252,271,542.06 | 32.78 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 15,322,181.00 | 1.99 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 40,842,710.00 | 5.31 |
| 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 | 1,993,892.00 | 0.26 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 313,473,325.06 | 40.73 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|------|----------------|--------------|
| 通信服务 | 70,744,145.01 | 9.19 |
| 金融 | 43,706,784.91 | 5.68 |
| 工业 | 26,908,033.35 | 3.50 |
| 可选消费 | 8,812,504.95 | 1.14 |
| 医药卫生 | 3,813,679.01 | 0.50 |
| 合计 | 153,985,147.23 | 20.01 |

注：以上行业分类采用中证行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|--------|-----------|---------------|------------------|
| 1 | 600941 | 中国移动 | 349,900 | 37,614,250.00 | 4.89 |
| 1 | 00941 | 中国移动 | 464,500 | 32,643,369.22 | 4.24 |
| 2 | 002475 | 立讯精密 | 1,595,286 | 62,710,692.66 | 8.15 |
| 3 | 00700 | 腾讯控股 | 112,100 | 38,100,775.79 | 4.95 |
| 4 | 02328 | 中国财险 | 2,568,000 | 22,734,493.73 | 2.95 |
| 5 | 000100 | TCL 科技 | 5,232,120 | 22,602,758.40 | 2.94 |
| 6 | 601567 | 三星医疗 | 566,800 | 19,838,000.00 | 2.58 |
| 7 | 300856 | 科思股份 | 601,000 | 19,238,010.00 | 2.50 |
| 8 | 600519 | 贵州茅台 | 13,100 | 19,222,809.00 | 2.50 |
| 9 | 01138 | 中远海能 | 1,886,000 | 17,454,128.83 | 2.27 |
| 10 | 002270 | 华明装备 | 746,000 | 16,591,040.00 | 2.16 |
| 11 | 002073 | 软控股份 | 2,034,600 | 15,035,694.00 | 1.95 |
| 12 | 002831 | 裕同科技 | 558,100 | 14,281,779.00 | 1.86 |
| 13 | 002444 | 巨星科技 | 477,100 | 11,784,370.00 | 1.53 |
| 14 | 002984 | 森麒麟 | 371,300 | 8,944,617.00 | 1.16 |
| 15 | 03988 | 中国银行 | 2,528,000 | 8,882,931.90 | 1.15 |
| 16 | 601100 | 恒立液压 | 189,600 | 8,831,568.00 | 1.15 |
| 17 | 02313 | 申洲国际 | 126,300 | 8,812,504.95 | 1.14 |
| 18 | 600900 | 长江电力 | 300,800 | 8,699,136.00 | 1.13 |
| 19 | 002126 | 银轮股份 | 440,800 | 7,674,328.00 | 1.00 |
| 20 | 002415 | 海康威视 | 237,100 | 7,328,761.00 | 0.95 |
| 21 | 002409 | 雅克科技 | 110,600 | 6,957,846.00 | 0.90 |
| 22 | 01288 | 农业银行 | 2,196,000 | 6,694,179.24 | 0.87 |
| 23 | 600236 | 桂冠电力 | 863,500 | 6,623,045.00 | 0.86 |
| 24 | 00317 | 中船防务 | 362,000 | 5,814,866.82 | 0.76 |
| 25 | 600079 | 人福医药 | 325,900 | 5,595,703.00 | 0.73 |
| 26 | 01398 | 工商银行 | 1,274,000 | 5,395,180.04 | 0.70 |
| 27 | 01177 | 中国生物制药 | 1,565,000 | 3,813,679.01 | 0.50 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 28 | 00152 | 深圳国际 | 640,000 | 3,639,037.70 | 0.47 |
| 29 | 605377 | 华旺科技 | 261,800 | 3,468,850.00 | 0.45 |
| 30 | 300442 | 润泽科技 | 134,800 | 3,228,460.00 | 0.42 |
| 31 | 603993 | 洛阳钼业 | 358,000 | 3,043,000.00 | 0.40 |
| 32 | 300308 | 中际旭创 | 15,700 | 2,164,716.00 | 0.28 |
| 33 | 300012 | 华测检测 | 198,200 | 1,993,892.00 | 0.26 |

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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|--------|---------------|-----------------|
| 1 | 002475 | 立讯精密 | 50,023,820.10 | 6.70 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 39,695,818.00 | 5.32 |
| 3 | 600941 | 中国移动 | 35,218,629.00 | 4.72 |
| 4 | 00941 | 中国移动 | 32,130,017.34 | 4.30 |
| 5 | 00700 | 腾讯控股 | 29,523,625.20 | 3.96 |
| 6 | 02328 | 中国财险 | 24,680,986.54 | 3.31 |
| 7 | 300856 | 科思股份 | 24,502,149.80 | 3.28 |
| 8 | 000100 | TCL 科技 | 24,309,803.40 | 3.26 |
| 9 | 002073 | 软控股份 | 19,736,385.00 | 2.64 |
| 10 | 601567 | 三星医疗 | 18,375,682.00 | 2.46 |
| 11 | 01138 | 中远海能 | 17,524,409.29 | 2.35 |
| 12 | 002270 | 华明装备 | 14,991,989.00 | 2.01 |
| 13 | 002831 | 裕同科技 | 14,646,337.00 | 1.96 |
| 14 | 002415 | 海康威视 | 12,337,679.00 | 1.65 |
| 15 | 600809 | 山西汾酒 | 12,217,704.00 | 1.64 |
| 16 | 002444 | 巨星科技 | 11,261,166.00 | 1.51 |
| 17 | 601100 | 恒立液压 | 10,101,720.00 | 1.35 |
| 18 | 02313 | 申洲国际 | 9,729,100.55 | 1.30 |
| 19 | 603508 | 思维列控 | 9,246,213.20 | 1.24 |
| 20 | 688676 | 金盘科技 | 9,186,669.97 | 1.23 |

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 600519 | 贵州茅台 | 23,604,171.00 | 3.16 |

| | | | | |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 2 | 688676 | 金盘科技 | 11,254,305.76 | 1.51 |
| 3 | 600809 | 山西汾酒 | 10,741,185.50 | 1.44 |
| 4 | 603508 | 思维列控 | 9,835,300.20 | 1.32 |
| 5 | 603565 | 中谷物流 | 9,031,659.56 | 1.21 |
| 6 | 600887 | 伊利股份 | 7,338,856.00 | 0.98 |
| 7 | 002475 | 立讯精密 | 5,838,646.00 | 0.78 |
| 8 | 002073 | 软控股份 | 5,483,196.00 | 0.73 |
| 9 | 603128 | 华贸物流 | 5,420,423.00 | 0.73 |
| 10 | 601058 | 赛轮轮胎 | 5,218,823.00 | 0.70 |
| 11 | 002415 | 海康威视 | 4,672,077.00 | 0.63 |
| 12 | 002353 | 杰瑞股份 | 4,182,081.00 | 0.56 |
| 13 | 002155 | 湖南黄金 | 4,055,007.00 | 0.54 |
| 14 | 000568 | 泸州老窖 | 3,599,849.00 | 0.48 |
| 15 | 002182 | 宝武镁业 | 3,523,175.00 | 0.47 |
| 16 | 603239 | 浙江仙通 | 3,453,898.00 | 0.46 |
| 17 | 601865 | 福莱特 | 3,452,601.00 | 0.46 |
| 18 | 01177 | 中国生物制药 | 3,096,847.20 | 0.41 |
| 19 | 601028 | 玉龙股份 | 3,062,219.00 | 0.41 |
| 20 | 601019 | 山东出版 | 2,798,379.00 | 0.37 |

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 589,183,714.30 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 156,546,104.27 |

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 40,929,287.26 | 5.32 |
| 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) | 32,442,448.33 | 4.21 |
| 8 | 同业存单 | - | - |

| | | | |
|----|----|---------------|------|
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 73,371,735.59 | 9.53 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 019709 | 23 国债 16 | 403,000 | 40,929,287.26 | 5.32 |
| 2 | 110081 | 闻泰转债 | 248,060 | 24,583,303.29 | 3.19 |
| 3 | 113516 | 苏农转债 | 29,900 | 3,288,393.81 | 0.43 |
| 4 | 127085 | 韵达转债 | 20,820 | 2,292,303.11 | 0.30 |
| 5 | 128135 | 洽洽转债 | 20,070 | 2,278,448.12 | 0.30 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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中，中国人民财产保险股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或处罚的情形。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同及公司制度的相关规定。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的其他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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 61,126.09 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 89.92 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 61,216.01 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|---------------|
| 1 | 110081 | 闻泰转债 | 24,583,303.29 | 3.19 |
| 2 | 113516 | 苏农转债 | 3,288,393.81 | 0.43 |
| 3 | 127085 | 韵达转债 | 2,292,303.11 | 0.30 |
| 4 | 128135 | 洽洽转债 | 2,278,448.12 | 0.30 |

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户 | 户均持有 | 持有人结构 |
|------|------|------|-------|
|------|------|------|-------|

| | 数（户） | 的基金份 额 | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
|-----------------------|-----------|-----------|---------------|------------|----------------|------------|
| | | | 持有份额 | 占总份额 比例 | 持有份额 | 占总份额比 例 |
| 泉果嘉源 三年持有 期混合 A | 15,677.00 | 34,757.21 | 26,927,626.09 | 4.94% | 517,961,097.34 | 95.06% |
| 泉果嘉源 三年持有 期混合 C | 5,432.00 | 36,933.44 | 7,696,739.00 | 3.84% | 192,925,707.54 | 96.16% |
| 合计 | 21,109.00 | 35,317.22 | 34,624,365.09 | 4.64% | 710,886,804.88 | 95.36% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|---------------|---------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 泉果嘉源三年持有期混合 A | 13,010,144.34 | 2.39% |
| | 泉果嘉源三年持有期混合 C | 10,143.57 | 0.01% |
| | 合计 | 13,020,287.91 | 1.75% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 泉果嘉源三年持有期混 合 A | 泉果嘉源三年持有期混 合 C |
|-------------------------------------|-------------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2023 年 12 月 05 日）基金份 额总额 | 544,787,533.15 | 200,520,036.66 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 544,787,533.15 | 200,520,036.66 |
| 本报告期基金总申购份额 | 101,190.28 | 102,409.88 |
| 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 | 544,888,723.43 | 200,622,446.54 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未发生改聘会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| | | | | | | |

| | | | 比例 | | | |
|------|---|----------------|---------|------------|---------|---|
| 国投证券 | 4 | 745,729,818.57 | 100.00% | 538,608.99 | 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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 基金交易 | |
|------|---------------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 国投证券 | 78,524,325.05 | 100.00% | 15,244,582,000.00 | 100.00% | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|-------------------------|------------|
| 1 | 泉果嘉源三年持有期混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告 | 中国证券基金电子披露网站、公司官网 | 2024-04-22 |
| 2 | 泉果嘉源三年持有期混合型证券投资基金开放日常申购及定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、中国证券基金电子披露网站、公司官网 | 2024-06-07 |
| 3 | 关于泉果嘉源三年持有期混合型证券投资基金开展直销费率优惠活动的公告 | 中国证券报、中国证券基金电子披露网站、公司官网 | 2024-06-07 |
| 4 | 泉果嘉源三年持有期混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 1 号） | 中国证券基金电子披露网站、公司官网 | 2024-06-28 |
| 5 | 泉果嘉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） | 中国证券基金电子披露网站、公司官网 | 2024-06-28 |
| 6 | 泉果嘉源三年持有期混合型证 | 中国证券基金电子披露网站、公 | 2024-06-28 |

| | | |
|-----------------------------|-----|--|
| 券投资基金（C类份额）基金产 品资料概要（更新） | 司官网 | |
|-----------------------------|-----|--|

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内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。

11.2 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予泉果嘉源三年持有期混合型证券投资基金注册的文件；
- 2、《泉果嘉源三年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泉果嘉源三年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《泉果嘉源三年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、《泉果嘉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。

12.2 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。

12.3 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

二〇二四年八月三十日