

长盛国企改革主题灵活配置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：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 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、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 29 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。

报告期内，本基金自 2023 年 8 月 21 日起年管理费率由 1.5%调整为 1.2%，年托管费率由 0.25%调整为 0.2%。详情参阅 2023 年 8 月 19 日披露的《长盛基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》。

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

本年度报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、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	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
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	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	51

8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
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	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	63
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	63
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	63
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	63
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
8.12 投资组合报告附注	63
§ 9 基金份额持有人信息	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
§ 10 开放式基金份额变动	64
§ 11 重大事件揭示	65
11.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
11.4 基金投资策略的改变	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.8 其他重大事件	70
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 13 备查文件目录	72
13.1 备查文件目录	72
13.2 存放地点	72
13.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	长盛国企改革混合
基金主代码	001239
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 4 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,041,372,296.44 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标在于把握中国国企改革所蕴含的投资机会，分享国企改革带给上市公司的投资收益，在严格控制投资风险的基础上，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>(一) 大类资产配置</p> <p>在大类资产配置中，本基金将主要考虑宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策因素，动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。</p> <p>(二) 国企改革主题上市公司的界定</p> <p>本基金投资的国企改革主题公司，主要分为两类：</p> <p>一是直接或间接受益于已经公告的国企改革方案（含预案，下同）的上市公司。国企改革方案包括但不限于资产重组方案、股权激励方案及纳入国有资本投资运营平台方案等。该类上市公司包括通过改革将使经营状况和盈利能力获得提升的国有企业，参与国有企业改革并使经营状况和盈利能力获得提升的上市公司，以及其他在国企改革进程中获得发展机遇或利润增长点的上市公司。</p> <p>二是处于国企改革的重点区域、行业，且改革预期较确定的国有企业，或与上述国有企业有较大业务关联的上市公司。</p> <p>(三) 股票投资策略</p> <p>本基金将考察改革对央企和地方国企不同的影响、改革对各个行业的不同影响，筛选出具有投资机会的上市公司股票，构建并动态调整国企改革主题股票精选池。通过对内在价值、相对价值、收购价值等方面的研究，而筛选出估值水平相对合理或低估的上市公司股票，并本着审慎精选的原则，根据市场波动情况构建股票组合并进行动态调整。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其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。

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	长盛基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	张利宁	任航
	联系电话	010-86497608	010-66060069
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	400-888-2666、010-86497888	95599	
传真	010-86497999	010-68121816	
注册地址	深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市东城区建国门内大街 69 号	
办公地址	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9	
邮政编码	100029	100031	
法定代表人	胡甲	谷澍	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
注册登记机构	长盛基金管理有限公司	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-95,120,279.35	-141,991,270.88	141,134,511.33
本期利润	-92,458,941.32	-237,289,506.69	8,225,878.86
加权平均基金份额本期利润	-0.0906	-0.2395	0.0078
本期加权平均净值利润率	-22.61%	-47.36%	1.21%
本期基金份额净值增长率	-23.31%	-37.66%	0.16%

3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-722,835,844.41	-607,935,448.55	-380,501,525.05
期末可供分配基金份额利润	-0.6941	-0.6008	-0.3878
期末基金资产净值	318,536,452.03	404,015,491.73	628,290,791.67
期末基金份额净值	0.306	0.399	0.640
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-69.40%	-60.10%	-36.00%

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

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-11.82%	1.36%	-2.88%	0.40%	-8.94%	0.96%
过去六个月	-35.98%	1.67%	-4.44%	0.42%	-31.54%	1.25%
过去一年	-23.31%	2.00%	-3.41%	0.42%	-19.90%	1.58%
过去三年	-52.11%	1.98%	-12.38%	0.55%	-39.73%	1.43%
过去五年	-17.07%	1.76%	21.05%	0.60%	-38.12%	1.16%
自基金合同生效起至今	-69.40%	1.76%	2.68%	0.68%	-72.08%	1.08%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%

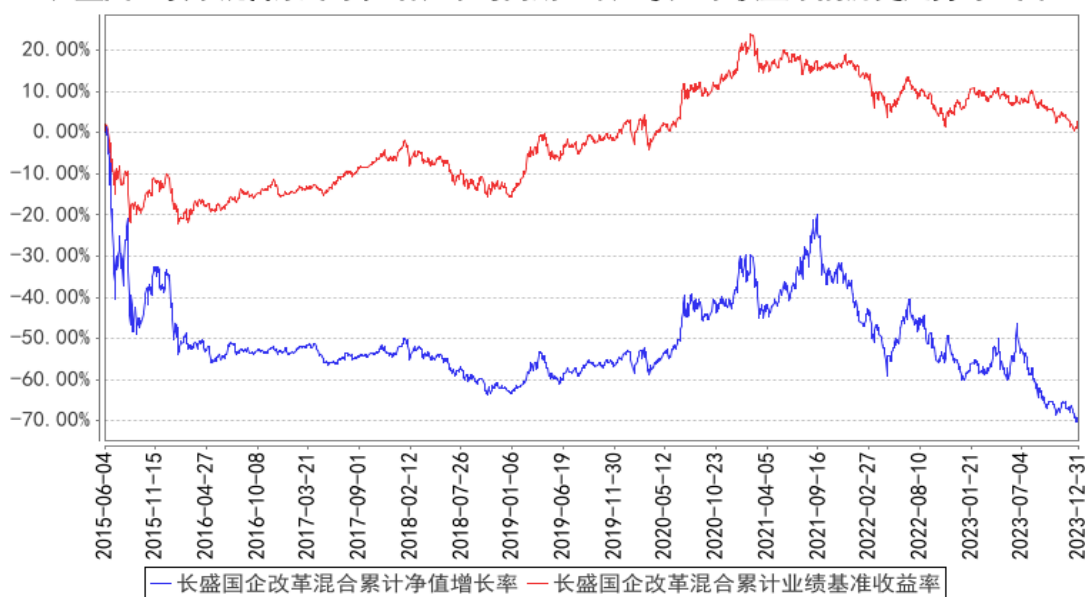
沪深 300 指数是中证指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。

中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债，旨在全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。该指数具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 50%、50%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

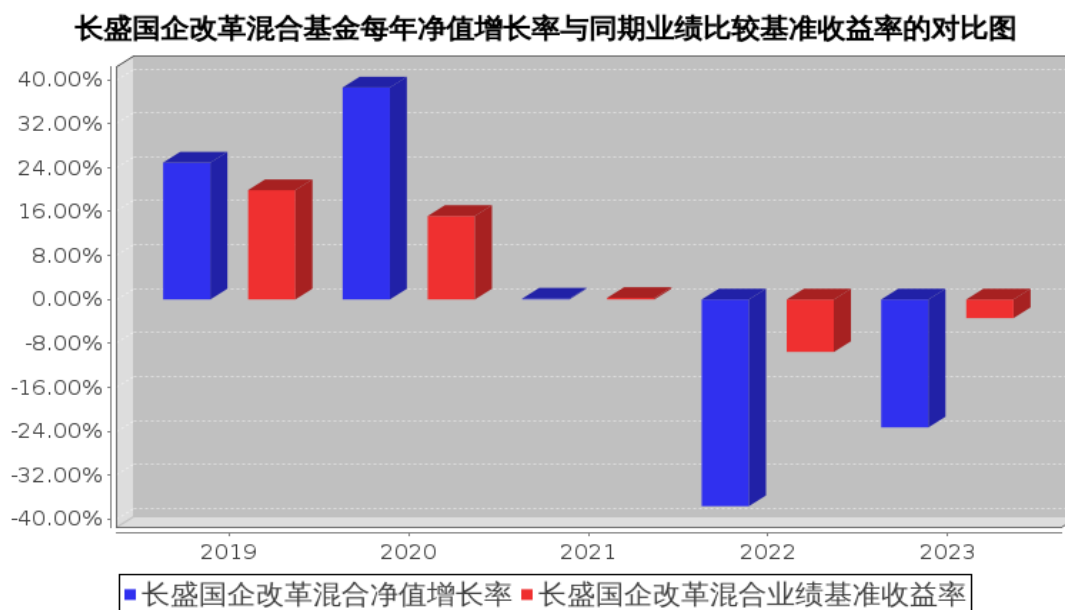
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛国企改革混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

3.2.3 过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内较早成立的十家基金管理公司之一，公司注册资本为人民币 2.06 亿元。长盛基金总部设在北京，在北京、上海、成都、深圳等地设有分支机构，下设长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司两家全资子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司（DBS Bank Ltd.）占注册资本的 33%，安徽省信用融资担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司拥有公募基金、社保基金、特定客户资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格，同时可担任私募资产管理计划和境外 QFII 基金的投资顾问。截至 2023 年 12 月 31 日，基金管理人共管理七十只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。

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		

代毅	本基金基金经理，长盛城镇化主题混合型证券投资基金基金经理。	2020年4月21日	-	13年	代毅先生，硕士。2010年7月加入长盛基金管理有限公司，曾任行业研究员、基金经理助理等职务。
----	-------------------------------	------------	---	-----	--

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金的基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公司公平交易细则》，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

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》及公司相关制度等规定，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

公司对管理的不同投资组合过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易原则及利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现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% 的交易。

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年全年，上证指数、沪深 300、创业板指数分别下跌 3.7%、11.38%、19.41%，其中创业板、科创板指数跌幅较多；万得全 A 等权指数上涨 8.79%，反映出市场个股活跃，北向资金、机构重仓个股因资金流出股价承受较大的压力。

A 股市场增量资金不明显，全年新发基金规模和北向资金流入相比 22 年有明显降低，美欧金融机构的部分资金流出明显。存量博弈依然是市场的重要特征，趋势动量策略资金特别是量化资金，放大了市场波动，尤其在策略趋同的情况下导致板块暴涨暴跌和极致分化。市场预期中国经济增速提质增效，在缺乏增量资金的结构下，高估值是股票投资最大的风险。新能源赛道和地产产业链跌幅靠前，受 AI 产业趋势推动 TMT 全年涨幅靠前但相比年中高点大幅回落，能源板块一枝独秀上涨贯穿全年，成为 A 股投资全年的胜负手。

2023 年我国经济复苏的底部特征明显，经济趋势稳中向好，在量上实现稳定增长。2023 年我国 GDP 实际增长 5.2%，全年工业增加值增长 4.6%，好于 2023 年两会定下的 5% 的增长目标。缘于需求结构发生重要变化，政府投资主动加码，民间投资转弱，消费整体修复但缺乏向上动力，国内价格始终偏弱，叠加出口价格同比表现弱势，使得市场的微观感受偏弱。

在宏微观经济均面临一定压力的背景下，2023 年我国的财政政策比货币政策呈现更强的宽松

力度。财政政策方面，既有总量角度稳增长，又有结构调整和转型升级。货币政策方面，央行多措并举推动流动性合理充裕。

消费、投资、出口三驾马车分别来看，消费整体修复但缺乏向上动力，出口价格持续偏弱，制约出口数量增速回升带动出口名义增速改善，房地产投资对经济显著拖累，房地产销售、竣工、开工面积均不容乐观，但是地产行业最坏的时刻已经过去，隐患逐点清除，同时基建投资回升，一定程度对冲了地产的下行，但在地方财政压力加大与隐性债务约束下，对经济拉动不显著。

对比国际国内，一方面美联储加息到达顶部区域，但美国经济有较强的韧性—核心 CPI、就业等数据较好，短期还看不到降息的动作，巴以冲突（中东局势）、俄乌冲突仍然是地缘政治的焦点并影响到原油、航运等局部供需结构；另一方面国内决策层出台了更多的财政货币政策稳经济，进一步放松了北上深广一线城市的地产政策，促进了成交量，继续积极化解地方债务但也带来了暂时的紧缩影响。

2023 年是党的二十大报告落地的第一年，是全面建设社会主义现代化国家开局起步关键时期的第一年，我们从年末的中央经济工作会议可以看到高质量发展是全面建设社会主义现代化国家的首要任务。从年初到年尾看，A 股涨跌暗线之一就是“高质量”逐渐优于“高增速”发展。或许，未来一年还将延续这一趋势。

整体看市场资金回归个股盈利和股息的节奏慢慢加快，市场估值、成交等指标已经在较长一段时间里呈现底部特征，大部分资产价格已经计入较多的谨慎预期。相比去年大多数时候，本基金策略一方面继续积极寻找业绩增速足够快同时估值合理的个股，寻找行业新的基本面线索，另一方面也逐渐提高公司高质量盈利的权重。中长期来看只有遵循产业发展逻辑，符合国家战略方向的行业和管理、技术等领先的优秀公司才能胜出。

按照基金合同，基金经理坚持深化国企改革全局思想和细化政策的研究，以国企改革中能够提质增效、提升盈利能力的行业和个股为主要配置方向。结合基金主题要求，本基金将在个股配置上转变为极大的聚焦于国有上市公司。行业配置整体将转向均衡风格，寻找数字经济、AI、自主可控、高端制造、能源安全和医疗健康等方面与深化国企改革能够有交集的优势行业和绩优国企。全年看基金投资方向先后聚焦于信创、算力、数据要素、医药、油运、汽车零部件、工程机械、能源等方面的国有企业，精选业绩确定性高的优秀个股和潜在的国企改革标的。

从大类资产配置和公募基金定位的角度，本基金权益仓位偏高，个股集中度也偏高，这两者加大了组合的回撤风险，需要在后续做出改进，风格上需要更加灵活的去应对经济环境和市场环境的变化。2023 年前期净值主要跟随 AI 相关板块，并随之出现了回调，但是随着配置方向均衡化和进一步聚焦国企，后续要精选出相关方向能够兑现盈利的个股。本基金将努力做好基金仓位

管理和基金的风险暴露管理，力争控制好回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.306 元；本报告期基金份额净值增长率为-23.31%，业绩比较基准收益率为-3.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年我国经济运行仍将面临诸多挑战和风险，不确定因素中外部扰动较多，但总体来说仍然是企稳回升年。总量看，按照二十大报告我国需要实现年均 5%左右的经济增长。从结构看，创新是“第一动力”，消费是经济增长的持久动力。新开工项目方面，由于今年春节较晚，进入 3 月后将会持续发力，同时大概率中央政府投资会加大对经济的支持力度。

2024 年是多个国家和地区的大选年，特别是美国总统换届大选影响最为重大。一方面我们需要观察特朗普上台的概率及其两党竞选时对中国极限施压，另一方面要观察的是美联储降息路径，强劲的经济数据一再推迟了美联储降息，但是降息虽迟但到。美联储降息将削弱了美元的强势地位，压制资本继续回流美国，同时也给了我们更大的货币政策工具空间。

2024 年中国将迈入新一轮需求逐渐回暖、产能逐渐出清下资产回报率改善、盈利预期提升的新周期，高质量发展将会初显成果，可以想象下半年的投资机会将比上半年多很多。在 2023 年 4 季度我们看到与 A 股盈利高度相关的工业企业利润开始筑底回升，合理外推 2024 年会有更多的稳增长政策发力并且在经济指标上看到效果。虽然具体哪些行业具有相对明显优势还有待观察，但我们可以合理推测以数据要素、AI 及其应用、汽车和工业制造智能化、生物技术等科技创新发挥主导作用的新质生产力可能会经济增长新的火车头。在新质生产力逐渐形成的背景下，勤奋聪颖的 A 股投资者将会挖掘出新的相关投资机会。

但我们也应看到：在产能过剩、需求偏弱的环境下，补库存的脉冲相对更短，企业盈利的改善可能一波三折，外需的变化影响变大，都将增加我们投资的难度。因此，市场运行到现在，个人认为今年将是盈利及其成长的确定性强于可能性的一年。市场将以企业盈利为基础，寻找业绩增速足够快同时估值合理的个股，寻找行业新的基本面线索。龙头公司的产业地位和盈利的稳定性强于行业内的中小公司，过去三年的估值折价有可能倒过来享受估值溢价。

发展新质生产力是推动高质量发展的内在要求和重要着力点。遵循产业发展逻辑，符合国家战略方向的行业和管理、技术等领先的优秀公司将会胜出。对于本基金而言，新质生产力如何与城镇化相关标的结合将会是今年我持续思考的问题。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人遵循合规运作、保护基金投资者利益的原则，结合监管要求、市场

形势及自身业务发展需要，由独立于业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产的运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时督促相关部门改进，并定期制作检查报告报送公司管理层。具体工作情况如下：

1、加强合规宣导与培训，持续推动公司合规文化建设。报告期内，监察稽核部通过外请专业机构、内部自学、岗前培训、基金经理合规谈话、合规考试等多种形式，有重点、有针对性地开展合规培训工作，及时组织学习法律法规与监管文件，深化员工合规理念，提升员工合规工作技能。

2、持续完善公司制度规章体系建设。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时督促、提示业务部门进行相关制度、流程的新订、修订与完善，保证公司制度规章的合法合规、全面、适时、有效。报告期内，公司除完成有关制度的新订、修订工作外，还要求业务部门就制度、流程变化内容与其他相关执行部门进行沟通，确保各相关部门对新订、修订内容的理解保持一致，保证制度、流程被严格执行。

3、加强合规监督，确保受托资产投资运作合法合规。紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、受托资产合同及公司制度等的规定，全面把控受托资产投资运作风险点，并以前述风险点为依据，检查、监督各受托资产投资运作合规情况。根据《公司公平交易细则》的规定，通过量化分析、日常合规监督及事后专项检查评估等，确保公司旗下各受托资产被公平对待，防范非公平交易和利益输送。

4、加强专项稽核与检查力度，完善发现问题与改进情况的跟踪、落实机制，保障公司运营及受托资产投资运作合规。报告期内，公司监察稽核部开展定期、临时专项稽核，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、员工行为、信息技术等。此外，根据业务发展需要、监管机构通报的业内问题，以及公司在日常监督中发现的问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题改进效率与效果，合理保障公司及受托资产合规、稳健运作。

5、参与新产品设计、新业务、新流程的合规论证工作，提供合规意见或建议，确保依法合规开展相关业务。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保护基金投资者的利益为宗旨，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、受托资产合规运作。

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，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值工作小组，负责制定、评估、复核和修订基金估值程序和技术，适时更新估值相关制度，指导并监督各类投资品种的估值程序，评估会计政策变更的影响，对证券投资基金估值方法进行最终决策等。估值工作小组由总经理担任组长，督察长担任副组长，小组成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本基金本报告期内不存在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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——长盛基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，长盛基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要

方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，长盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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	安永华明（2024）审字第 70015799_A12 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	长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
其他信息	长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错

	<p>报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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>（1）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>（2）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>（3）评价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>（4）对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，就可能导致对长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资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长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）</p>

注册会计师的姓名	贺耀	王海彦
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛国企改革主题灵活配置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	26,552,833.79	47,712,610.49
结算备付金		3,978,295.04	2,085,093.56
存出保证金		423,974.17	258,440.89
交易性金融资产	7.4.7.2	280,312,372.79	345,134,426.45
其中：股票投资		280,312,372.79	345,134,426.45
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		10,758,629.23	21,280,243.28
应收股利		-	-
应收申购款		166,051.29	127,492.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		322,192,156.31	416,598,307.19
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		878,257.60	10,800,087.42
应付赎回款		460,376.01	92,202.30
应付管理人报酬		338,565.51	545,004.00
应付托管费		56,427.58	90,833.98
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	1,922,077.58	1,054,687.76
负债合计		3,655,704.28	12,582,815.46
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	1,041,372,296.44	1,011,950,940.28
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-722,835,844.41	-607,935,448.55
净资产合计		318,536,452.03	404,015,491.73
负债和净资产总计		322,192,156.31	416,598,307.19

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.306 元，基金份额总额 1,041,372,296.44 份。

7.2 利润表

会计主体：长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-85,515,011.66	-228,308,369.41
1. 利息收入		648,030.75	642,830.41
其中：存款利息收入	7.4.7.13	648,030.75	642,830.41
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-89,064,852.86	-133,790,568.61
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-90,816,493.82	-136,244,233.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-

资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	1,751,640.96	2,453,664.54
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.20	2,661,338.03	-95,298,235.81
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	240,472.42	137,604.60
减：二、营业总支出		6,943,929.66	8,981,137.28
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,768,180.42	7,511,576.12
2. 托管费	7.4.10.2.2	961,363.55	1,251,929.31
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	214,385.69	217,631.85
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-92,458,941.32	-237,289,506.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-92,458,941.32	-237,289,506.69
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-92,458,941.32	-237,289,506.69

7.3 净资产变动表

会计主体：长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 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	1,011,950,940.28	-607,935,448.55	404,015,491.73
二、本期期初净资产	1,011,950,940.28	-607,935,448.55	404,015,491.73
三、本期增减变动额	29,421,356.16	-114,900,395.86	-85,479,039.70

(减少以“-”号填列)			
(一)、综合收益总额	-	-92,458,941.32	-92,458,941.32
(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)	29,421,356.16	-22,441,454.54	6,979,901.62
其中: 1. 基金申购款	219,746,961.69	-130,845,680.05	88,901,281.64
2. 基金赎回款	-190,325,605.53	108,404,225.51	-81,921,380.02
(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	1,041,372,296.44	-722,835,844.41	318,536,452.03
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 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	981,164,091.29	-352,873,299.62	628,290,791.67
二、本期期初净资产	981,164,091.29	-352,873,299.62	628,290,791.67
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	30,786,848.99	-255,062,148.93	-224,275,299.94
(一)、综合收益总额	-	-237,289,506.69	-237,289,506.69
(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)	30,786,848.99	-17,772,642.24	13,014,206.75
其中: 1. 基金申购款	131,144,349.43	-65,931,721.06	65,212,628.37
2. 基金赎回款	-100,357,500.44	48,159,078.82	-52,198,421.62
(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	1,011,950,940.28	-607,935,448.55	404,015,491.73
-----------	------------------	-----------------	----------------

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：

<u>胡甲</u>	<u>刁俊东</u>	<u>龚珉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛国企改革主题灵活配置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[2015]568 号《关于准予长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的注册，由长盛基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2015 年 6 月 4 日生效，于基金合同生效日，本基金规模为 3,250,867,544.91 份基金份额。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和注册登记机构为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行、上市的股票）、债券、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的 0%-95%；其中投资于国企改革主题的股票和债券不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券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。本基金业绩比较基准： $50\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收益率}$ 。

7.4.2 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 2 号《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。

7.4.3 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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，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。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

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的有关过去事项、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。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变

动形成的利得或损失计入当期损益。对于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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

7.4.4.12 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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‰；

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、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。

7.4.6.2 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征增值税试点的通知》的规定，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，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；

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，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人

可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

7.4.6.3 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[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。

7.4.6.4 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。

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	26,552,833.79	47,712,610.49
等于：本金	26,539,774.79	47,689,405.28
加：应计利息	13,059.00	23,205.21
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	26,552,833.79	47,712,610.49

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	292,145,786.47	-	280,312,372.79	-11,833,413.68
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	292,145,786.47	-	280,312,372.79	-11,833,413.68

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	359,629,178.16	-	345,134,426.45	-14,494,751.71
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	359,629,178.16	-	345,134,426.45	-14,494,751.71

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无。

7.4.7.5 债权投资

无。

7.4.7.6 其他债权投资

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 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	55.48	20.24
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,742,022.10	864,667.52
其中：交易所市场	1,742,022.10	864,667.52
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	190,000.00

合计	1,922,077.58	1,054,687.76
----	--------------	--------------

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,011,950,940.28	1,011,950,940.28
本期申购	219,746,961.69	219,746,961.69
本期赎回（以“-”号填列）	-190,325,605.53	-190,325,605.53
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,041,372,296.44	1,041,372,296.44

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-537,783,795.06	-70,151,653.49	-607,935,448.55
本期期初	-537,783,795.06	-70,151,653.49	-607,935,448.55
本期利润	-95,120,279.35	2,661,338.03	-92,458,941.32
本期基金份额交易产生的变动数	-16,092,056.16	-6,349,398.38	-22,441,454.54
其中：基金申购款	-122,185,889.07	-8,659,790.98	-130,845,680.05
基金赎回款	106,093,832.91	2,310,392.60	108,404,225.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-648,996,130.57	-73,839,713.84	-722,835,844.41

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	590,772.59	586,718.03
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	50,922.23	48,958.00
其他	6,335.93	7,154.38
合计	648,030.75	642,830.41

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-90,816,493.82	-136,244,233.15
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-90,816,493.82	-136,244,233.15

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	4,221,788,623.32	3,308,681,911.76
减：卖出股票成本总额	4,301,219,114.77	3,435,360,649.98
减：交易费用	11,386,002.37	9,565,494.93
买卖股票差价收入	-90,816,493.82	-136,244,233.15

7.4.7.15 债券投资收益

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利 收益	1,751,640.96	2,453,664.54
其中：证券出借权益补 偿收入	-	-
基金投资产生的股利 收益	-	-
合计	1,751,640.96	2,453,664.54

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	2,661,338.03	-95,298,235.81
股票投资	2,661,338.03	-95,298,235.81
债券投资	-	-
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	2,661,338.03	-95,298,235.81

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	239,204.63	133,838.53
基金转换费收入	1,267.79	3,766.07
合计	240,472.42	137,604.60

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
----	---	---

	月 31 日	日
审计费用	60,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	34,385.69	27,631.85
合计	214,385.69	217,631.85

7.4.7.24 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大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
长盛基金管理有限公司（“长盛基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
新加坡星展银行有限公司（“星展银行”）	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用融资担保集团有限公司	基金管理人的股东
长盛创富资产管理有限公司（“长盛创富”）	基金管理人的全资子公司
长盛基金（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
国元期货有限公司（“国元期货”）	基金管理人股东的控股子公司

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
国元证券	1,123,165,998.06	13.30	541,576,845.89	8.17

7.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国元证券	1,055,386.31	14.52	459,533.20	26.38
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国元证券	504,371.98	8.89	163,561.50	18.92

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	5,768,180.42
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,476,378.35	3,240,445.09
应支付基金管理人的净管理费	3,291,802.07	4,271,131.03

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金自2023年8月21日起年管理费率由1.5%调整为1.2%。详情参阅2023年8月19日披露的《长盛基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》。基金管理费计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费	961,363.55

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金自 2023 年 8 月 21 日起年托管费率由 0.25%调整为 0.20%。详情参阅 2023 年 8 月 19 日披露的《长盛基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》。基金托管费计算方法如下：

$$H=E \times \text{年托管费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 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
中国农业银行	26,552,833.79	590,772.59	47,712,610.49	586,718.03
合计	26,552,833.79	590,772.59	47,712,610.49	586,718.03

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于国元期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按约定利率计息，存出保证金不计息。于 2023 年 12 月 31 日，本基金存放于国元期货的结算备付金余额为人民币 1,024,260.00 元，无存出保证金余额（2022 年 12 月 31 日：结算备付金余额为人民币 1,016,819.05 元，无存出保证金余额）。于 2023 年度，本基金当期结算备付金利息收入人民币 7,440.95 元（2022 年度：人民币 7,385.84 元）。

7.4.11 利润分配情况

无。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001239	永达股份	2023 年 12 月 4 日	6 个月	限售期锁定	12.05	21.94	189	2,277.45	4,146.66	-
001306	夏厦精密	2023 年 11 月 9 日	6 个月	限售期锁定	53.63	84.62	64	3,432.32	5,415.68	-
001326	联域股份	2023 年 11 月 1 日	6 个月	限售期锁定	41.18	51.74	99	4,076.82	5,122.26	-
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月	限售期锁定	41.00	46.28	87	3,567.00	4,026.36	-
001378	德冠新材	2023 年 10 月 23 日	6 个月	限售期锁定	31.68	36.39	205	6,494.40	7,459.95	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	限售期锁定	25.82	31.77	306	7,900.92	9,721.62	-

301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	限售期锁定	28.88	34.64	321	9,270.48	11,119.44	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	限售期锁定	21.00	22.21	458	9,618.00	10,172.18	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	限售期锁定	55.68	37.55	248	13,808.64	9,312.40	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	限售期锁定	33.25	70.25	164	5,453.00	11,521.00	-
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	限售期锁定	29.38	59.36	332	9,754.16	19,707.52	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	限售期锁定	31.90	44.48	208	6,635.20	9,251.84	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	限售期锁定	57.66	47.16	320	18,451.20	15,091.20	-
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	限售期锁定	5.32	40.76	867	4,612.44	35,338.92	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	限售期锁定	41.66	67.77	128	5,332.48	8,674.56	-
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	限售期锁定	19.50	28.90	371	7,234.50	10,721.90	-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	限售期锁定	23.97	20.89	431	10,331.07	9,003.59	-
301505	苏州规	2023年7月12日	6个月	限售期锁定	26.35	35.79	194	5,111.90	6,943.26	-

	划									
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	限售期锁定	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	限售期锁定	16.82	32.25	419	7,047.58	13,512.75	-
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	限售期锁定	12.00	35.00	396	4,752.00	13,860.00	-
301515	港通医疗	2023年7月13日	6个月	限售期锁定	31.16	28.26	230	7,166.80	6,499.80	-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	限售期锁定	6.87	20.06	604	4,149.48	12,116.24	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	限售期锁定	26.87	51.90	185	4,970.95	9,601.50	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	限售期锁定	67.88	52.74	141	9,571.08	7,436.34	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	限售期锁定	99.57	81.46	123	12,247.11	10,019.58	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	限售期锁定	2.66	5.26	5,911	15,723.26	31,091.86	-
301528	多浦乐	2023年8月17日	6个月	限售期锁定	71.80	68.86	148	10,626.40	10,191.28	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	限售期锁定	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301548	崇	2023	6个月	限售	66.80	59.03	130	8,684.00	7,673.90	-

	德科技	年9月11日		期锁定							
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	限售期锁定	37.56	43.58	243	9,127.08	10,589.94	-	
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	限售期锁定	22.88	39.68	224	5,125.12	8,888.32	-	
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	限售期锁定	7.33	13.67	1,306	9,572.98	17,853.02	-	
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	限售期锁定	24.22	18.25	436	10,559.92	7,957.00	-	
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	限售期锁定	23.23	43.26	246	5,714.58	10,641.96	-	
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	限售期锁定	11.25	11.85	558	6,277.50	6,612.30	-	
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	限售期锁定	1.70	5.23	2,585	4,394.50	13,519.55	-	
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	限售期锁定	16.80	34.50	194	3,259.20	6,693.00	-	
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	限售期锁定	23.10	23.32	170	3,927.00	3,964.40	-	
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	限售期锁定	14.23	21.96	238	3,386.74	5,226.48	-	
603119	浙	2023	6个月	限售	15.32	23.86	226	3,462.32	5,392.36	-	

	江 荣 泰	年7月 21日		期锁 定						
603193	润 本 股 份	2023 年10 月9日	6个月	限售 期锁 定	17.38	17.02	224	3,893.12	3,812.48	-
603231	索 宝 蛋 白	2023 年12 月6日	6个月	限售 期锁 定	21.29	22.26	156	3,321.24	3,472.56	-
603270	金 帝 股 份	2023 年8月 25日	6个月	限售 期锁 定	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天 元 智 能	2023 年10 月16 日	6个月	限售 期锁 定	9.50	20.45	178	1,691.00	3,640.10	-
603276	恒 兴 新 材	2023 年9月 18日	6个月	限售 期锁 定	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安 邦 护 卫	2023 年12 月13 日	6个月	限售 期锁 定	19.10	40.47	88	1,680.80	3,561.36	-
688548	广 钢 气 体	2023 年8月 8日	6个月	限售 期锁 定	9.87	12.74	1,525	15,051.75	19,428.50	-
688549	中 巨 芯	2023 年8月 30日	6个月	限售 期锁 定	5.18	8.09	2,254	11,675.72	18,234.86	-
688563	航 材 股 份	2023 年7月 12日	6个月	限售 期锁 定	78.99	60.47	333	26,303.67	20,136.51	-
688582	芯 动 联 科	2023 年6月 21日	6个月	限售 期锁 定	26.74	38.32	529	14,145.46	20,271.28	-
688591	泰 凌	2023 年8月	6个月	限售 期锁	24.98	28.02	568	14,188.64	15,915.36	-

	微	18 日		定						
688592	司南导航	2023 年 8 月 7 日	6 个月	限售期锁定	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
688602	康鹏科技	2023 年 7 月 13 日	6 个月	限售期锁定	8.66	11.05	1,066	9,231.56	11,779.30	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	限售期锁定	55.00	74.10	140	7,700.00	10,374.00	-
688612	威迈斯	2023 年 7 月 19 日	6 个月	限售期锁定	47.29	37.94	250	11,822.50	9,485.00	-
688627	精智达	2023 年 7 月 11 日	6 个月	限售期锁定	46.77	87.67	222	10,382.94	19,462.74	-
688638	誉辰智能	2023 年 7 月 4 日	6 个月	限售期锁定	83.90	59.65	141	11,829.90	8,410.65	-
688646	逸飞激光	2023 年 7 月 21 日	6 个月	限售期锁定	46.80	36.06	219	10,249.20	7,897.14	-
688648	中邮科技	2023 年 11 月 6 日	6 个月	限售期锁定	15.18	24.91	303	4,599.54	7,547.73	-
688651	盛邦安全	2023 年 7 月 19 日	6 个月	限售期锁定	39.90	46.03	178	7,102.20	8,193.34	-
688652	京仪装备	2023 年 11 月 22 日	6 个月	限售期锁定	31.95	57.06	281	8,977.95	16,033.86	-
688653	康希通信	2023 年 11 月 10 日	6 个月	限售期锁定	10.50	18.86	648	6,804.00	12,221.28	-
688657	浩	2023	6 个月	限售	103.40	79.31	89	9,202.60	7,058.59	-

	辰软件	年9月25日		期锁定						
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	限售期锁定	40.83	43.40	178	7,267.74	7,725.20	-
688702	盛科通信	2023年9月6日	6个月	限售期锁定	42.66	48.19	271	11,560.86	13,059.49	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	限售期锁定	29.66	36.38	267	7,919.22	9,713.46	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	限售期锁定	69.98	60.10	152	10,636.96	9,135.20	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	限售期锁定	28.03	57.51	165	4,624.95	9,489.15	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

3、本基金可作为特定投资者，参与上市公司公开或非公开发行股份认购。本基金可作为特定投资者所认购的非公开发行股份，自发行结束之日起6个月内不得转让。

4、本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起6个月。本基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

5、本基金可以通过网下发行获配的创业板股票。发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；监察稽核部和风险管理部负责监察公司风险管理措施的执行；各职能部门在一定范围内负责本部门的风险评估和监控。

本基金在日常经营活动中面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估，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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2022 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

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

本基金所持大部分证券在证券交易所上市或在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

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

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 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	26,539,774.79	-	-	13,059.00	26,552,833.79
结算备付金	3,975,085.72	-	-	3,209.32	3,978,295.04
存出保证金	423,783.47	-	-	190.70	423,974.17
交易性金融资产	-	-	-	-280,312,372.79	280,312,372.79
应收申购款	-	-	-	166,051.29	166,051.29
应收清算款	-	-	-	10,758,629.23	10,758,629.23
资产总计	30,938,643.98	-	-	-291,253,512.33	322,192,156.31
负债					
应付赎回款	-	-	-	460,376.01	460,376.01
应付管理人报酬	-	-	-	338,565.51	338,565.51
应付托管费	-	-	-	56,427.58	56,427.58
应付清算款	-	-	-	878,257.60	878,257.60
其他负债	-	-	-	1,922,077.58	1,922,077.58
负债总计	-	-	-	3,655,704.28	3,655,704.28
利率敏感度缺口	30,938,643.98	-	-	-287,597,808.05	318,536,452.03
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	47,689,405.28	-	-	23,205.21	47,712,610.49
结算备付金	2,082,746.38	-	-	2,347.18	2,085,093.56
存出保证金	258,324.69	-	-	116.20	258,440.89
交易性金融资产	-	-	-	-345,134,426.45	345,134,426.45
应收申购款	-	-	-	127,492.52	127,492.52
应收清算款	-	-	-	21,280,243.28	21,280,243.28
资产总计	50,030,476.35	-	-	-366,567,830.84	416,598,307.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	92,202.30	92,202.30
应付管理人报酬	-	-	-	545,004.00	545,004.00
应付托管费	-	-	-	90,833.98	90,833.98
应付清算款	-	-	-	10,800,087.42	10,800,087.42

其他负债	-	-	-	1,054,687.76	1,054,687.76
负债总计	-	-	-	12,582,815.46	12,582,815.46
利率敏感度缺口	50,030,476.35	-	-	-353,985,015.38	404,015,491.73

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进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

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	280,312,372.79	88.00	345,134,426.45	85.43
合计	280,312,372.79	88.00	345,134,426.45	85.43

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%	32,385,898.91	39,778,183.57
2. 业绩比较基准下 降 5%	-32,385,898.91	-39,778,183.57

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	279,583,822.72	344,601,295.79
第二层次	-	-
第三层次	728,550.07	533,130.66
合计	280,312,372.79	345,134,426.45

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

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 1 月 1 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	-	533,130.66	533,130.66
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,375,754.07	1,375,754.07
转出第三层次	-	1,568,144.88	1,568,144.88
当期利得或损失总额	-	387,810.22	387,810.22
其中：计入损益的利得或损失	-	387,810.22	387,810.22
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	728,550.07	728,550.07
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	-	179,806.80	179,806.80
项目	上年度可比期间 2022年1月1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	-	4,374,947.76	4,374,947.76
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,864,556.93	1,864,556.93
转出第三层次	-	5,499,474.55	5,499,474.55
当期利得或损失总额	-	-206,899.48	-206,899.48
其中：计入损益的利得或损失	-	-206,899.48	-206,899.48
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	533,130.66	533,130.66
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	-	-23,940.15	-23,940.15

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	采用的估	不可观察输入值
----	-------	------	---------

	价值	值技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	728,550.07	平均价格 亚式期权 模型	预期年化波动率	0.187297-1.531612	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	533,130.66	平均价格 亚式期权 模型	预期年化波动率	0.190909-0.879166	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

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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 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。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	280,312,372.79	87.00
	其中：股票	280,312,372.79	87.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	30,531,128.83	9.48
8	其他各项资产	11,348,654.69	3.52
9	合计	322,192,156.31	100.00

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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	188,067,652.97	59.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	14,827,694.40	4.65
F	批发和零售业	4,424,176.25	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	15,918,612.30	5.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,400,750.16	11.43
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	9,336,125.36	2.93
M	科学研究和技术服务业	27,892.35	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	29,469.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	11,280,000.00	3.54
S	综合	-	-
	合计	280,312,372.79	88.00

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	000680	山推股份	3,300,000	16,302,000.00	5.12

2	002281	光迅科技	570,000	16,245,000.00	5.10
3	300212	易华录	515,000	16,196,750.00	5.08
4	000988	华工科技	539,900	16,067,424.00	5.04
5	600771	广誉远	590,000	15,924,100.00	5.00
6	600026	中远海能	1,300,000	15,912,000.00	5.00
7	000818	航锦科技	500,000	15,690,000.00	4.93
8	000915	华特达因	530,000	15,348,800.00	4.82
9	000032	深桑达 A	700,080	14,827,694.40	4.65
10	600609	金杯汽车	2,870,000	13,948,200.00	4.38
11	300502	新易盛	273,000	13,464,360.00	4.23
12	300394	天孚通信	130,000	11,897,600.00	3.74
13	603083	剑桥科技	300,000	11,316,000.00	3.55
14	300308	中际旭创	100,000	11,291,000.00	3.54
15	300654	世纪天鸿	1,000,000	11,280,000.00	3.54
16	688668	鼎通科技	200,090	11,068,978.80	3.47
17	688041	海光信息	150,000	10,647,000.00	3.34
18	300058	蓝色光标	1,299,800	9,332,564.00	2.93
19	300757	罗博特科	100,000	8,139,000.00	2.56
20	300085	银之杰	500,000	7,160,000.00	2.25
21	002315	焦点科技	200,000	6,626,000.00	2.08
22	688111	金山办公	20,000	6,324,000.00	1.99
23	603353	和顺石油	170,000	4,396,200.00	1.38
24	688657	浩辰软件	886	72,747.33	0.02
25	688249	晶合集成	2,752	47,472.00	0.01
26	301487	盟固利	867	35,338.92	0.01
27	301526	国际复材	5,911	31,091.86	0.01
28	000888	峨眉山 A	3,300	29,469.00	0.01
29	688582	芯动联科	529	20,271.28	0.01
30	688563	航材股份	333	20,136.51	0.01
31	301421	波长光电	332	19,707.52	0.01
32	688627	精智达	222	19,462.74	0.01
33	688548	广钢气体	1,525	19,428.50	0.01
34	688549	中巨芯	2,254	18,234.86	0.01
35	301558	三态股份	1,306	17,853.02	0.01
36	301363	美好医疗	445	16,376.00	0.01
37	688652	京仪装备	281	16,033.86	0.01
38	688591	泰凌微	568	15,915.36	0.00
39	301486	致尚科技	320	15,091.20	0.00
40	301510	固高科技	396	13,860.00	0.00
41	601096	宏盛华源	2,585	13,519.55	0.00
42	301508	中机认检	419	13,512.75	0.00
43	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
44	688702	盛科通信	271	13,059.49	0.00

45	688653	康希通信	648	12,221.28	0.00
46	301516	中远通	604	12,116.24	0.00
47	688602	康鹏科技	1,066	11,779.30	0.00
48	301413	安培龙	164	11,521.00	0.00
49	301251	威尔高	321	11,119.44	0.00
50	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
51	301499	维科精密	371	10,721.90	0.00
52	301568	思泰克	246	10,641.96	0.00
53	301550	斯菱股份	243	10,589.94	0.00
54	688603	天承科技	140	10,374.00	0.00
55	301528	多浦乐	148	10,191.28	0.00
56	301329	信音电子	458	10,172.18	0.00
57	601061	中信金属	1,313	10,123.23	0.00
58	301525	儒竞科技	123	10,019.58	0.00
59	301202	朗威股份	306	9,721.62	0.00
60	688716	中研股份	267	9,713.46	0.00
61	301517	陕西华达	185	9,601.50	0.00
62	688720	艾森股份	165	9,489.15	0.00
63	688612	威迈斯	250	9,485.00	0.00
64	301371	敷尔佳	248	9,312.40	0.00
65	301459	丰茂股份	208	9,251.84	0.00
66	688719	爱科赛博	152	9,135.20	0.00
67	301500	飞南资源	431	9,003.59	0.00
68	301555	惠柏新材	224	8,888.32	0.00
69	301489	思泉新材	128	8,674.56	0.00
70	688638	誉辰智能	141	8,410.65	0.00
71	688651	盛邦安全	178	8,193.34	0.00
72	301559	中集环科	436	7,957.00	0.00
73	688646	逸飞激光	219	7,897.14	0.00
74	688693	锆威特	178	7,725.20	0.00
75	301548	崇德科技	130	7,673.90	0.00
76	301273	瑞晨环保	277	7,642.43	0.00
77	688648	中邮科技	303	7,547.73	0.00
78	001378	德冠新材	205	7,459.95	0.00
79	301520	万邦医药	141	7,436.34	0.00
80	301505	苏州规划	194	6,943.26	0.00
81	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
82	603004	鼎龙科技	194	6,693.00	0.00
83	601083	锦江航运	558	6,612.30	0.00
84	301515	港通医疗	230	6,499.80	0.00
85	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
86	001306	夏厦精密	64	5,415.68	0.00
87	603119	浙江荣泰	226	5,392.36	0.00

88	603107	上海汽配	238	5,226.48	0.00
89	001326	联域股份	99	5,122.26	0.00
90	001239	永达股份	189	4,146.66	0.00
91	001358	兴欣新材	87	4,026.36	0.00
92	603075	热威股份	170	3,964.40	0.00
93	603193	润本股份	224	3,812.48	0.00
94	603273	天元智能	178	3,640.10	0.00
95	603373	安邦护卫	88	3,561.36	0.00
96	603231	索宝蛋白	156	3,472.56	0.00
97	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
98	603187	海容冷链	157	2,380.12	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	103,597,800.65	25.64
2	000032	深桑达 A	95,358,694.42	23.60
3	300212	易华录	84,904,843.90	21.02
4	600050	中国联通	65,511,698.00	16.22
5	688498	源杰科技	64,615,578.44	15.99
6	000988	华工科技	64,479,725.54	15.96
7	002230	科大讯飞	60,909,473.50	15.08
8	300308	中际旭创	56,674,964.11	14.03
9	002281	光迅科技	53,296,512.00	13.19
10	300394	天孚通信	51,892,690.78	12.84
11	688041	海光信息	51,762,882.80	12.81
12	688111	金山办公	50,166,103.54	12.42
13	000915	华特达因	49,888,215.21	12.35
14	603985	恒润股份	48,134,765.34	11.91
15	300033	同花顺	47,584,791.00	11.78
16	300620	光库科技	43,652,491.81	10.80
17	600602	云赛智联	43,132,668.80	10.68
18	600026	中远海能	42,550,485.67	10.53
19	002368	太极股份	41,718,383.48	10.33
20	000977	浪潮信息	39,937,601.00	9.89
21	001979	招商蛇口	39,488,189.00	9.77
22	000818	航锦科技	37,425,584.00	9.26
23	002929	润建股份	37,314,759.79	9.24
24	688981	中芯国际	35,841,117.78	8.87
25	300418	昆仑万维	35,748,328.00	8.85
26	603019	中科曙光	35,579,506.00	8.81
27	688256	寒武纪	32,818,143.55	8.12

28	600771	广誉远	31,935,708.30	7.90
29	688668	鼎通科技	31,001,134.94	7.67
30	688205	德科立	29,701,006.53	7.35
31	600186	莲花健康	29,214,734.00	7.23
32	002123	梦网科技	28,955,607.50	7.17
33	600266	城建发展	28,686,185.00	7.10
34	002920	德赛西威	27,741,451.52	6.87
35	600941	中国移动	27,573,751.44	6.82
36	002222	福晶科技	26,825,325.00	6.64
37	688036	传音控股	26,705,760.08	6.61
38	300166	东方国信	26,700,512.00	6.61
39	002602	世纪华通	26,445,136.00	6.55
40	000066	中国长城	25,820,497.00	6.39
41	688262	国芯科技	25,074,799.63	6.21
42	002517	恺英网络	25,065,130.86	6.20
43	600536	中国软件	24,843,042.24	6.15
44	600452	涪陵电力	23,988,348.99	5.94
45	301297	富乐德	23,765,368.00	5.88
46	300229	拓尔思	23,617,195.75	5.85
47	601728	中国电信	23,417,832.00	5.80
48	300634	彩讯股份	22,620,690.00	5.60
49	300475	香农芯创	22,614,126.88	5.60
50	688326	经纬恒润	22,178,475.70	5.49
51	603701	德宏股份	22,166,715.10	5.49
52	002045	国光电器	22,097,581.14	5.47
53	601177	杭齿前进	22,008,583.00	5.45
54	300170	汉得信息	21,898,024.54	5.42
55	688362	甬矽电子	21,867,282.46	5.41
56	300757	罗博特科	21,687,653.00	5.37
57	601138	工业富联	21,586,486.00	5.34
58	000568	泸州老窖	21,367,764.00	5.29
59	601001	晋控煤业	21,047,531.00	5.21
60	603496	恒为科技	20,806,405.00	5.15
61	603383	顶点软件	20,571,226.00	5.09
62	300672	国科微	20,235,642.00	5.01
63	000719	中原传媒	19,691,806.00	4.87
64	002518	科士达	19,542,445.01	4.84
65	603083	剑桥科技	19,444,954.45	4.81
66	300762	上海瀚讯	19,215,816.30	4.76
67	603005	晶方科技	18,506,697.98	4.58
68	300130	新国都	18,310,451.44	4.53
69	600482	中国动力	17,660,707.36	4.37
70	000680	山推股份	17,395,981.00	4.31

71	688629	华丰科技	17,357,172.47	4.30
72	600114	东睦股份	17,249,941.00	4.27
73	600633	浙数文化	17,182,104.00	4.25
74	300260	新莱应材	16,826,511.00	4.16
75	000034	神州数码	16,296,767.50	4.03
76	600703	三安光电	15,809,777.00	3.91
77	300136	信维通信	15,510,163.90	3.84
78	300846	首都在线	15,500,415.45	3.84
79	601360	三六零	15,419,311.00	3.82
80	300271	华宇软件	15,210,835.99	3.76
81	300604	长川科技	14,883,134.67	3.68
82	688352	颀中科技	14,841,506.89	3.67
83	002155	湖南黄金	14,811,162.00	3.67
84	603123	翠微股份	14,771,255.00	3.66
85	000021	深科技	14,721,033.84	3.64
86	600609	金杯汽车	14,563,387.00	3.60
87	002756	永兴材料	14,383,737.30	3.56
88	300571	平治信息	13,928,454.00	3.45
89	300803	指南针	13,788,191.18	3.41
90	601628	中国人寿	13,752,826.64	3.40
91	688047	龙芯中科	13,711,270.27	3.39
92	002315	焦点科技	13,613,707.00	3.37
93	688037	芯源微	13,606,287.42	3.37
94	300398	飞凯材料	13,601,431.00	3.37
95	688579	山大地纬	13,512,519.98	3.34
96	002777	久远银海	13,437,639.91	3.33
97	300654	世纪天鸿	13,274,912.00	3.29
98	601872	招商轮船	12,774,228.80	3.16
99	603859	能科科技	12,751,297.00	3.16
100	300429	强力新材	12,675,931.00	3.14
101	002738	中矿资源	12,560,935.09	3.11
102	688372	伟测科技	12,523,796.07	3.10
103	603138	海量数据	12,322,579.00	3.05
104	603598	引力传媒	12,286,494.16	3.04
105	601939	建设银行	12,080,000.00	2.99
106	605289	罗曼股份	11,999,790.50	2.97
107	001308	康冠科技	11,976,777.30	2.96
108	300002	神州泰岳	11,775,670.00	2.91
109	688118	普元信息	11,735,480.27	2.90
110	300895	铜牛信息	11,693,444.37	2.89
111	002317	众生药业	11,646,857.00	2.88
112	300556	丝路视觉	11,597,703.39	2.87
113	688120	华海清科	11,057,392.07	2.74

114	300058	蓝色光标	10,865,193.00	2.69
115	688535	华海诚科	10,849,599.33	2.69
116	300474	景嘉微	10,842,990.60	2.68
117	601900	南方传媒	10,786,423.00	2.67
118	301306	西测测试	10,747,141.34	2.66
119	301299	卓创资讯	10,721,149.68	2.65
120	002864	盘龙药业	10,631,354.00	2.63
121	001309	德明利	10,589,664.00	2.62
122	000155	川能动力	10,532,780.00	2.61
123	300348	长亮科技	10,513,434.00	2.60
124	601689	拓普集团	10,477,831.00	2.59
125	600684	珠江股份	10,469,325.00	2.59
126	300559	佳发教育	10,439,329.00	2.58
127	603650	彤程新材	10,424,688.00	2.58
128	300525	博思软件	10,420,109.50	2.58
129	603296	华勤技术	10,362,128.00	2.56
130	688228	开普云	10,329,766.61	2.56
131	603186	华正新材	10,301,695.00	2.55
132	300494	盛天网络	9,825,742.40	2.43
133	002409	雅克科技	9,691,142.00	2.40
134	300232	洲明科技	9,626,896.60	2.38
135	688766	普冉股份	9,580,483.06	2.37
136	000063	中兴通讯	9,553,922.00	2.36
137	002291	遥望科技	9,477,519.00	2.35
138	688787	海天瑞声	9,350,026.13	2.31
139	601898	中煤能源	9,313,214.00	2.31
140	002378	章源钨业	9,203,353.00	2.28
141	300857	协创数据	9,200,230.00	2.28
142	300151	昌红科技	9,182,305.08	2.27
143	002727	一心堂	9,163,181.65	2.27
144	601633	长城汽车	9,085,635.00	2.25
145	688166	博瑞医药	8,989,263.56	2.22
146	600595	中孚实业	8,935,485.82	2.21
147	002169	智光电气	8,875,596.00	2.20
148	603998	方盛制药	8,767,328.00	2.17
149	603353	和顺石油	8,745,578.00	2.16
150	688012	中微公司	8,551,034.96	2.12
151	688582	芯动联科	8,544,050.97	2.11
152	688147	微导纳米	8,494,617.51	2.10
153	002401	中远海科	8,482,270.00	2.10
154	600276	恒瑞医药	8,394,070.68	2.08
155	600675	中华企业	8,366,345.00	2.07
156	600199	金种子酒	8,199,069.43	2.03

157	300548	博创科技	8,129,795.99	2.01
-----	--------	------	--------------	------

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300502	新易盛	84,494,884.77	20.91
2	000032	深桑达 A	81,442,934.36	20.16
3	300212	易华录	66,840,080.14	16.54
4	600050	中国联通	64,392,692.00	15.94
5	300394	天孚通信	63,206,440.45	15.64
6	600602	云赛智联	60,751,295.35	15.04
7	002230	科大讯飞	57,582,147.00	14.25
8	688498	源杰科技	56,090,114.31	13.88
9	603985	恒润股份	56,085,476.52	13.88
10	688111	金山办公	49,835,938.08	12.34
11	688041	海光信息	49,258,092.85	12.19
12	300308	中际旭创	48,175,085.22	11.92
13	000915	华特达因	46,166,354.57	11.43
14	002368	太极股份	45,551,048.11	11.27
15	000988	华工科技	44,310,102.00	10.97
16	000155	川能动力	43,809,036.20	10.84
17	300033	同花顺	42,151,160.25	10.43
18	603019	中科曙光	42,005,622.00	10.40
19	001979	招商蛇口	39,612,019.58	9.80
20	601728	中国电信	39,377,101.00	9.75
21	300620	光库科技	37,831,832.68	9.36
22	002929	润建股份	35,790,786.92	8.86
23	002466	天齐锂业	35,582,834.95	8.81
24	002324	普利特	35,487,787.70	8.78
25	002281	光迅科技	35,195,888.00	8.71
26	000762	西藏矿业	35,160,465.33	8.70
27	000977	浪潮信息	34,178,168.89	8.46
28	688256	寒武纪	34,046,824.37	8.43
29	300418	昆仑万维	32,461,121.04	8.03
30	688981	中芯国际	32,323,837.54	8.00
31	688036	传音控股	30,927,834.34	7.66
32	688205	德科立	30,357,383.97	7.51
33	600186	莲花健康	29,547,308.51	7.31
34	600266	城建发展	29,530,876.00	7.31
35	002123	梦网科技	28,901,827.13	7.15
36	600941	中国移动	27,452,836.67	6.79
37	002777	久远银海	27,221,178.70	6.74
38	002602	世纪华通	26,522,277.00	6.56

39	300166	东方国信	26,491,807.57	6.56
40	600452	涪陵电力	26,482,859.81	6.55
41	002756	永兴材料	26,404,728.70	6.54
42	002222	福晶科技	26,077,560.92	6.45
43	002920	德赛西威	25,766,950.00	6.38
44	002517	恺英网络	25,717,563.00	6.37
45	002268	电科网安	24,949,714.60	6.18
46	301297	富乐德	24,870,465.50	6.16
47	600026	中远海能	24,828,866.00	6.15
48	300229	拓尔思	23,448,794.36	5.80
49	002738	中矿资源	22,595,012.97	5.59
50	000066	中国长城	22,555,258.00	5.58
51	600536	中国软件	22,025,981.07	5.45
52	300634	彩讯股份	21,876,496.00	5.41
53	688362	甬矽电子	21,769,766.86	5.39
54	600428	中远海特	21,582,579.64	5.34
55	688262	国芯科技	21,365,103.92	5.29
56	000568	泸州老窖	20,963,972.00	5.19
57	002045	国光电器	20,930,995.96	5.18
58	300475	香农芯创	20,565,658.21	5.09
59	300170	汉得信息	20,558,082.99	5.09
60	601001	晋控煤业	20,357,367.00	5.04
61	688326	经纬恒润	20,177,370.84	4.99
62	688668	鼎通科技	20,051,640.61	4.96
63	000818	航锦科技	20,025,356.00	4.96
64	601177	杭齿前进	19,598,826.00	4.85
65	603383	顶点软件	19,118,055.00	4.73
66	300672	国科微	18,981,526.79	4.70
67	688629	华丰科技	18,856,502.33	4.67
68	300130	新国都	18,610,658.00	4.61
69	601138	工业富联	18,433,776.00	4.56
70	600114	东睦股份	18,344,067.50	4.54
71	603701	德宏股份	18,049,305.94	4.47
72	600482	中国动力	17,820,557.04	4.41
73	002518	科士达	17,684,079.89	4.38
74	688047	龙芯中科	17,598,161.75	4.36
75	300762	上海瀚讯	17,356,118.56	4.30
76	603496	恒为科技	17,081,941.76	4.23
77	000719	中原传媒	16,709,137.21	4.14
78	000034	神州数码	16,407,519.00	4.06
79	688208	道通科技	15,738,411.34	3.90
80	603005	晶方科技	15,712,049.00	3.89
81	300122	智飞生物	15,706,035.00	3.89

82	300136	信维通信	15,509,298.00	3.84
83	600633	浙数文化	15,388,776.00	3.81
84	603123	翠微股份	15,251,800.20	3.78
85	300260	新莱应材	15,160,389.00	3.75
86	600765	中航重机	15,062,883.19	3.73
87	688352	硕中科技	14,946,249.19	3.70
88	600703	三安光电	14,846,874.00	3.67
89	000021	深科技	14,832,952.00	3.67
90	002155	湖南黄金	14,515,734.80	3.59
91	300604	长川科技	14,489,862.00	3.59
92	300757	罗博特科	14,374,771.00	3.56
93	603598	引力传媒	14,290,000.00	3.54
94	601360	三六零	14,218,118.00	3.52
95	688372	伟测科技	14,012,812.50	3.47
96	688037	芯源微	13,848,789.76	3.43
97	300271	华宇软件	13,562,486.00	3.36
98	603859	能科科技	13,428,752.00	3.32
99	300846	首都在线	13,144,129.00	3.25
100	300571	平治信息	13,003,988.17	3.22
101	300398	飞凯材料	12,997,533.00	3.22
102	300803	指南针	12,898,607.80	3.19
103	601628	中国人寿	12,867,641.00	3.18
104	000546	金圆股份	12,710,279.66	3.15
105	002192	融捷股份	12,396,847.00	3.07
106	300429	强力新材	12,367,813.21	3.06
107	001308	康冠科技	12,208,938.63	3.02
108	601939	建设银行	12,083,939.00	2.99
109	601872	招商轮船	11,808,117.40	2.92
110	688579	山大地纬	11,670,816.86	2.89
111	300773	拉卡拉	11,625,904.30	2.88
112	300525	博思软件	11,592,411.00	2.87
113	002317	众生药业	11,504,673.00	2.85
114	603138	海量数据	11,312,705.00	2.80
115	001309	德明利	11,283,860.00	2.79
116	300002	神州泰岳	10,990,086.02	2.72
117	688120	华海清科	10,950,685.08	2.71
118	600771	广誉远	10,883,692.45	2.69
119	300857	协创数据	10,878,854.00	2.69
120	300348	长亮科技	10,878,394.00	2.69
121	002864	盘龙药业	10,736,860.00	2.66
122	688118	普元信息	10,642,020.72	2.63
123	603296	华勤技术	10,594,351.74	2.62
124	300895	铜牛信息	10,584,231.64	2.62

125	688228	开普云	10,488,576.65	2.60
126	301306	西测测试	10,427,717.90	2.58
127	603650	彤程新材	10,187,958.00	2.52
128	301299	卓创资讯	10,150,100.00	2.51
129	600595	中孚实业	10,149,480.00	2.51
130	002240	盛新锂能	10,097,629.00	2.50
131	603186	华正新材	10,012,232.00	2.48
132	601689	拓普集团	9,979,658.25	2.47
133	300556	丝路视觉	9,920,962.00	2.46
134	002409	雅克科技	9,903,105.00	2.45
135	688535	华海诚科	9,795,814.62	2.42
136	600684	珠江股份	9,700,926.00	2.40
137	605289	罗曼股份	9,521,110.45	2.36
138	300474	景嘉微	9,493,862.15	2.35
139	300559	佳发教育	9,476,907.11	2.35
140	300232	洲明科技	9,470,004.28	2.34
141	300494	盛天网络	9,327,077.00	2.31
142	601898	中煤能源	9,271,546.00	2.29
143	002169	智光电气	9,218,712.00	2.28
144	300151	昌红科技	9,065,600.86	2.24
145	601900	南方传媒	9,030,798.00	2.24
146	000063	中兴通讯	8,868,758.72	2.20
147	601633	长城汽车	8,773,874.00	2.17
148	688166	博瑞医药	8,596,715.98	2.13
149	603998	方盛制药	8,550,505.00	2.12
150	688582	芯动联科	8,401,741.03	2.08
151	002291	遥望科技	8,357,153.00	2.07
152	002727	一心堂	8,274,648.00	2.05
153	600199	金种子酒	8,251,883.64	2.04
154	688012	中微公司	8,243,668.47	2.04
155	600276	恒瑞医药	8,200,576.47	2.03
156	300223	北京君正	8,161,977.00	2.02

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	4,233,735,723.08
卖出股票收入（成交）总额	4,221,788,623.32

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

广誉远：

广誉远中药股份有限公司（以下简称“公司”）于 2023 年 12 月 28 日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《立案告知书》（编号：证监立案字 0172023009 号），因公司涉嫌信息披露违法违规，根据《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，2023 年 12 月 22 日，中国证监会决定对公司立案。

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、基金合同和公司投资制度的规定。

除上述事项外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	423,974.17
2	应收清算款	10,758,629.23
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	166,051.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,348,654.69

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

注：本基金本报告期末投资前十名股票不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与和项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
24,881	41,854.12	1,384,083.22	0.13	1,039,988,213.22	99.87

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	63,767.26	0.0061

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2015 年 6 月 4 日) 基	3,250,867,544.91
----------------------------	------------------

基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	1,011,950,940.28
本报告期基金总申购份额	219,746,961.69
减：本报告期基金总赎回份额	190,325,605.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,041,372,296.44

§ 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

11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

根据公司 2023 年 2 月 18 日召开的第八届董事会相关会议决议，选举胡甲先生担任公司董事长，同时代行公司总经理职务，代行总经理职务期限不超 6 个月；高民和先生不再担任公司董事长，周兵先生不再担任公司总经理职务。公司已按规定向相关监管机构报备并进行公告。

根据公司 2023 年 8 月 30 日召开的第八届董事会相关会议决议，聘任汤琰女士担任公司总经理，董事长胡甲先生不再代为履行公司总经理职务。公司已按规定向相关监管机构报告并发布变更公告。

11.2.2 基金经理的变动情况

本报告期内本基金基金经理未发生变动。

11.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内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没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 60,000.00 元，已连续提供审计服务 9 年。

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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 5 月 11 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改，整改措施主要包括完善内部制度、优化管控流程等
其他	-

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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 (%)	
首创证券	1	1,932,299,320.52	22.89	1,420,963.32	19.56	-
国融证券	2	1,164,866,300.91	13.80	862,863.32	11.88	-
国元证券	1	1,123,165,998.06	13.30	1,055,386.31	14.52	-
国泰君安	2	855,433,766.68	10.13	802,192.84	11.04	-
中金公司	1	679,848,955.23	8.05	633,138.76	8.71	-
中信建投	1	534,280,527.14	6.33	497,576.31	6.85	-
国投证券	3	514,001,684.18	6.09	484,497.95	6.67	-
中泰证券	2	429,574,241.41	5.09	402,292.21	5.54	-
华福证券	1	413,940,713.13	4.90	386,417.23	5.32	-
兴业证券	1	314,177,114.84	3.72	292,591.53	4.03	-
中信证券	2	250,074,580.	2.96	232,893.62	3.21	-

		58				
申万宏源	3	130,637,589.07	1.55	121,662.50	1.67	-
天风证券	2	100,571,730.39	1.19	73,549.86	1.01	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

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	
	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(%)
首创证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证	-	-	-	-	-	-

券						
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
第一创 业	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
粤开证 券	-	-	-	-	-	-
中投证	-	-	-	-	-	-

券						
中银国际	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金租用证券公司交易单元为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元的情况：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
----	--------	----------	----

1	国海证券	上海	1
2	国融证券	深圳	1
3	国融证券	上海	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元的情况:

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	华鑫证券	上海	1

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	长盛基金管理有限公司旗下基金 2022 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 1 月 20 日
2	长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 1 月 20 日
3	长盛基金管理有限公司关于终止部分基金销售机构办理旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 2 日
4	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加华瑞保险为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 8 日
5	长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 15 日
6	长盛基金管理有限公司关于终止部分基金销售机构办理旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 31 日
7	长盛基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 31 日
8	长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 31 日
9	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参与平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 17 日
10	长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 22 日
11	长盛基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 22 日
12	长盛基金管理有限公司关于增加兴业证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投业务与转换业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 28 日
13	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参与平安银行股份有限公司费率优惠	中国证监会指定披露媒介	2023 年 5 月 5 日

	活动的公告		
14	长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2023 年 6 月 26 日
15	长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定披露媒介	2023 年 6 月 26 日
16	长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 7 月 21 日
17	长盛基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 7 月 21 日
18	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加国元证券费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 8 月 10 日
19	长盛基金管理有限公司关于增加海通证券为旗下部分开放式基金代销机构并开通基金定投业务及转换业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 8 月 18 日
20	长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定披露媒介	2023 年 8 月 19 日
21	长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定披露媒介	2023 年 8 月 19 日
22	长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2023 年 8 月 19 日
23	长盛基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 8 月 19 日
24	长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定披露媒介	2023 年 8 月 19 日
25	长盛基金管理有限公司关于增加博时财富为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投、转换及费率优惠业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 8 月 29 日
26	长盛基金管理有限公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 8 月 30 日
27	长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 8 月 30 日
28	长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 9 月 1 日
29	长盛基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 10 月 25 日
30	长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 10 月 25 日

§ 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

本基金本报告期内无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、长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址和/或基金管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2024年3月30日