

宝盈消费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：宝盈基金管理有限公司

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 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 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及其更新。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金财务会计报告出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 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 | 6 |
| 2.4 信息披露方式 | 7 |
| 2.5 其他相关资料 | 7 |
| § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 8 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况 | 9 |
| § 4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 12 |
| 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 | 13 |
| 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 | 13 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 14 |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 14 |
| § 5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 | 14 |
| § 6 审计报告 | 15 |
| 6.1 审计报告基本信息 | 15 |
| 6.2 审计报告的基本内容 | 15 |
| § 7 年度财务报表 | 17 |
| 7.1 资产负债表 | 17 |
| 7.2 利润表 | 18 |
| 7.3 净资产变动表 | 19 |
| 7.4 报表附注 | 21 |
| § 8 投资组合报告 | 58 |

| | |
|--|-----------|
| 8.1 期末基金资产组合情况 | 58 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 58 |
| 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 | 59 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 61 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 63 |
| 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 | 64 |
| § 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 | 65 |
| 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 | 65 |
| 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 | 65 |
| § 10 开放式基金份额变动 | 65 |
| § 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 | 66 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 66 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 66 |
| 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 | 68 |
| § 12 影响投资者决策的其他重要信息 | 70 |
| 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 | 70 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 70 |
| § 13 备查文件目录 | 70 |
| 13.1 备查文件目录 | 70 |
| 13.2 存放地点 | 71 |
| 13.3 查阅方式 | 71 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---------------------|
| 基金名称 | 宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 宝盈消费主题混合 |
| 基金主代码 | 003715 |
| 交易代码 | 003715 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 1 月 4 日 |
| 基金管理人 | 宝盈基金管理有限公司 |
| 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 | 213,003,531.95 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金重点投资于符合时代发展趋势的消费主题行业公司，追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金的投资策略具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略、金融衍生品投资策略和参与融资业务的投资策略组成。</p> <p>(一) 大类资产配置策略</p> <p>本基金的大类资产配置策略以投资目标为中心，一方面尽力规避相关资产的下行风险，另一方面使组合能够跟踪某类资产的上行趋势。本基金将在基金合同约定的投资范围内，结合对宏观经济形势与资本市场环境的深入剖析，自上而下地实施积极的大类资产配置策略。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>1、消费主题的界定</p> <p>随着社会经济、文化的发展、技术进步、人口结构的变化，消费主题在国民经济发展不同阶段将体现不同的内涵和外延。本基金重点投资于符合时代发展趋势的消费主题行业公司，包括有形商品消费行业和以生活服务业为代表的新型泛消费行业，具体界定如下：</p> <p>(1) 有形商品消费：指提供实物消费商品的行业，如食品饮料、纺织服装、家电、汽车、家用轻工等。</p> <p>(2) 生活服务消费：指不以实物形式而以劳务形式作为消费载体，为居民生活提供服务的泛消费行业，具体包括餐饮旅游、医疗健康、家政服务、金融服务、教育、通信、影视传媒、文化出版、体育休闲、商贸零售等。</p> <p>基于本基金对消费主题的界定，本基金可投资的行业包括：建筑装饰、汽车、家用电器、纺织服装、轻工制造、商业贸易、农林牧渔、食品饮料、休闲服务、医疗保健、传媒、通信、金融服务等。</p> <p>未来如果由于经济发展、生活方式变化或政策调整造成消费主题行业的覆盖范围发生变动，基金管理人有权对上述界定进行调整和修订。</p> <p>2、主题投资策略</p> |

| | |
|--------|--|
| | <p>在可投资行业的基础上,本基金重点关注消费行业的两类投资机会:</p> <p>(1) 由于社会人口构成、消费偏好或需求变化带来增长的消费主题行业公司;</p> <p>(2) 消费行业间的融合或与其他技术、商业模式相结合衍生出的新兴消费行业蕴含的投资机会,如互联网融合、科技进步所带来的新兴消费形态,或国内人口结构变化带来的消费行业融合发展机会等。</p> <p>3、个股精选策略</p> <p>本基金在主题筛选的基础上,通过定性分析与定量分析相结合的方法,精选上市公司进行投资。</p> <p>4、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将结合宏观经济状况和发行人所处行业的景气度,关注发行人基本面情况、公司竞争优势、公司治理结构、有关信息披露情况、市场估值等因素,通过定性分析和定量分析相结合的办法,选择投资价值高的存托凭证进行投资,谨慎决定存托凭证的标的选择和配置比例。</p> <p>(三) 固定收益类资产投资策略</p> <p>在进行固定收益类资产投资时,本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券投资策略和资产支持证券投资策略,选择合适时机投资于低估的债券品种,通过积极主动管理,获得超额收益。</p> <p>(四) 金融衍生品投资策略</p> <p>1、权证投资策略</p> <p>本基金还可能运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中,基金管理人主要通过采取有效的组合策略,将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具。</p> <p>2、股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。</p> <p>(五) 参与融资业务的投资策略</p> <p>本基金参与融资业务时将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的个股。本基金力争利用融资业务的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,从而更好地实现本基金的投资目标。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证消费服务领先指数收益率×70%+中证综合债券指数收益率×30% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金。 |

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 | | 宝盈基金管理有限公司 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 张磊 | 任航 |
| | 联系电话 | 0755-83276688 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | zhangl@byfunds.com | tgxxpl@abchina.com |

| | | |
|--------|------------------------------|------------------------------|
| 客户服务电话 | 400-8888-300 | 95599 |
| 传真 | 0755-83515599 | 010-68121816 |
| 注册地址 | 深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501 | 北京市东城区建国门内大街 69 号 |
| 办公地址 | 广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 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 | 518034 | 100031 |
| 法定代表人 | 严震 | 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 | www.byfunds.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人处 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------------------|------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙) | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼 |
| 注册登记机构 | 宝盈基金管理有限公司 | 广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 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 | 11,663,668.10 | 7,558,431.04 | 48,916,117.01 |
| 本期利润 | 11,004,623.93 | -24,390,154.36 | 14,392,182.87 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0474 | -0.1166 | 0.0924 |
| 本期加权平均净值利润率 | 2.61% | -6.56% | 4.89% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.51% | -8.77% | 4.34% |
| 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 | 171,167,576.22 | 244,492,346.77 | 135,127,362.59 |
| 期末可供分配基金份额 | 0.8036 | 0.7765 | 0.8520 |

| | | | |
|--------------|----------------|----------------|----------------|
| 利润 | | | |
| 期末基金资产净值 | 385,472,088.98 | 561,260,444.32 | 309,933,247.18 |
| 期末基金份额净值 | 1.8097 | 1.7827 | 1.9541 |
| 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 | 78.14% | 75.48% | 92.36% |

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。

2、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。

4、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。

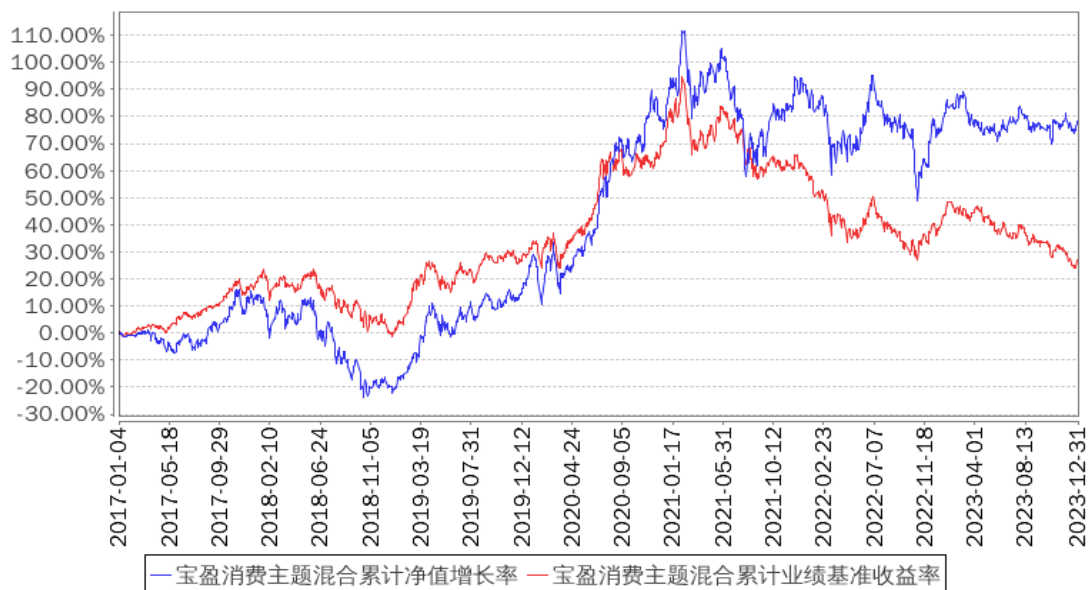
3.2 基金净值表现

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 | 1.35% | 0.67% | -4.86% | 0.61% | 6.21% | 0.06% |
| 过去六个月 | 0.32% | 0.63% | -6.31% | 0.64% | 6.63% | -0.01% |
| 过去一年 | 1.51% | 0.66% | -8.98% | 0.66% | 10.49% | 0.00% |
| 过去三年 | -3.37% | 1.21% | -27.54% | 0.92% | 24.17% | 0.29% |
| 过去五年 | 121.91% | 1.27% | 26.61% | 0.94% | 95.30% | 0.33% |
| 自基金合同生效起至今 | 78.14% | 1.30% | 26.96% | 0.91% | 51.18% | 0.39% |

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

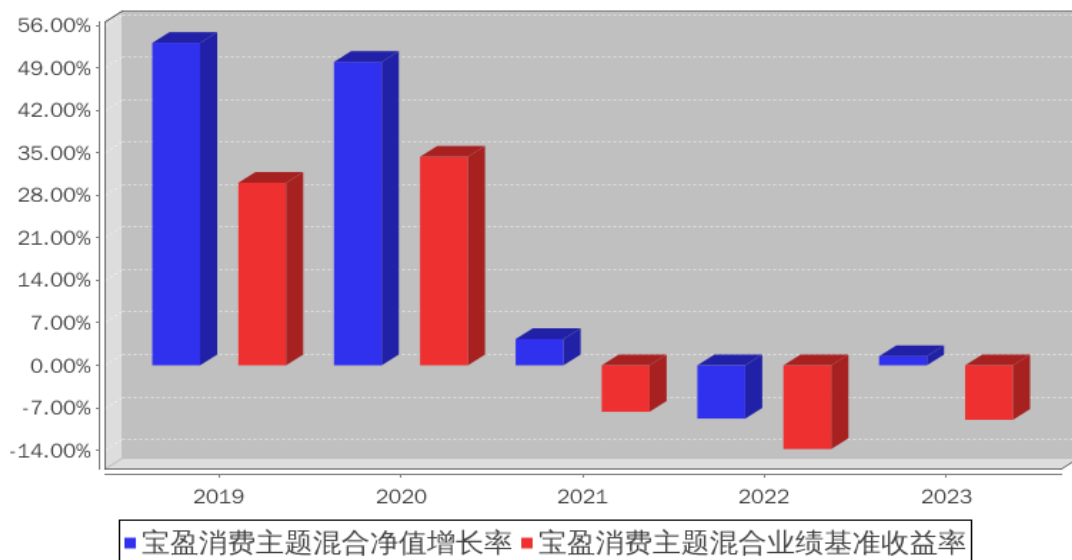
宝盈消费主题混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金由鸿阳证券投资基金转型而来，转型生效日期为 2017 年 1 月 4 日。

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

宝盈消费主题混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金由鸿阳证券投资基金转型而来，转型生效日期为 2017 年 1 月 4 日。

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

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。公司目前管理宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海混合、宝盈策略增长混合、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选混合、宝盈核心优势混合、宝盈货币、宝盈中证 100 指数增强、宝盈新价值混合、宝盈祥瑞混合、宝盈科技 30 混合、宝盈睿丰创新混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈祥瑞混合、宝盈科技 30 混合、宝盈睿丰创新混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰混合、宝盈优势产业混合、宝盈新锐混合、宝盈医疗健康沪港深股票、宝盈国家安全沪港深股票、宝盈互联网沪港深混合、宝盈消费主题混合（由原基金鸿阳转型而来）、宝盈盈泰纯债债券、宝盈人工智能股票、宝盈安泰短债债券、宝盈祥颐定期开放混合、宝盈聚享定期开放债券、宝盈品牌消费股票、宝盈盈润纯债债券、宝盈融源可转债债券、宝盈聚丰两年定开债券、宝盈研究精选混合、宝盈祥利稳健配置混合、宝盈祥泽混合、宝盈鸿盛债券、宝盈龙头优选股票、宝盈祥明一年定开混合、宝盈盈旭纯债债券、宝盈现代服务业混合、宝盈创新驱动股票、宝盈聚福 39 个月定开债、宝盈发展新动能股票、宝盈祥裕增强回报混合、宝盈盈沛纯债债券、宝盈基础产业混合、宝盈智慧生活混合、宝盈祥乐一年持有期混合、宝盈祥庆 9 个月持有混合、宝盈优质成长混合、宝盈成长精选混合、宝盈品质甄选混合、宝盈祥和 9 个月定开混合、宝盈安盛中短债债券、宝盈祥琪混合、宝盈新能源产业混合发起式、宝盈国证证券龙头指数发起式、宝盈聚鑫一年定期开放债券发起式、宝盈中证沪港深科技龙头指数发起式、宝盈半导体产业混合发起式、宝盈中证同业存单 AAA 指数 7 天持有、宝盈华证龙头红利 50 指数发起式六十一只基金，公司恪守价值投资的投资理念，并逐渐形成了稳健、规范的投资风格。公司拥有一支经验丰富的投资管理团队，在研究方面，公司汇聚着一批从事宏观经济、行业、上市公司、债券和金融工程研究的专业人才，为公司的投资决策提供科学的研究支持；在投资方面，公司的基金经理具有丰富的证券市场投资经验，以自己的专业知识致力于获得良好业绩，努力为投资者创造丰厚的回报。

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 | | |
| 杨思亮 | 本基金、宝盈新价值灵 | 2018 年 10 月 25 日 | - | 11 年 | 杨思亮先生，中央财经大学国际金融硕士。2011 年 6 月至 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| 活配置混合型证券投资基金、宝盈品牌消费股票型证券投资基金、宝盈品质甄选混合型证券投资基金、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金、宝盈增强收益债券型证券投资基金基金经理 | | | | 2014年4月在大成基金管理有限公司研究部担任研究员；2014年4月至2015年4月在大成创新资本管理有限公司专户投资部担任投资经理助理；2015年4月加入宝盈基金管理有限公司，先后担任研究部研究员、专户投资部投资经理助理、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金、宝盈现代服务业混合型证券投资基金、宝盈龙头优选股票型证券投资基金基金经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。 |
|--|--|--|--|---|

注：1、本基金基金经理非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定，证券从业年限的计算截至2023年12月31日。

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

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值（元） | 任职时间 |
|-----|----------|---------|------------------|-------------|
| 杨思亮 | 公募基金 | 6 | 5,019,118,542.80 | 2018年03月03日 |
| | 私募资产管理计划 | 1 | 106,545,721.51 | 2023年07月03日 |
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 7 | 5,125,664,264.31 | - |

4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理兼任专户投资经理的，薪酬激励与客户盈利情况密切相关，鼓励为客户创造绝对收益。主要与专户产品业绩报酬及管理费挂钩，根据管理难度及综合贡献核算奖励。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

我公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控。

公司对不同投资组合，尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，形成《公平交易分析报告》，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，但是完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

公司对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控，并定期制作公平交易分析报告，对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明，本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内；在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，无损害基金持有人利益的行为。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，建立和完善了兼任相关的制度及流程，确保兼任基金经理公平对待其管理的所有投资组合。通过对基金经理的投资交易行为进行监控和分析，本报告期内，两两组合间各项操作、流程及事后分析均正常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

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

国际方面，发达经济体采用积极的财政政策+从紧的货币政策组合应对持续高企的通胀，在实现通胀水平持续回落的同时，保持了较为稳健的就业与增长。国内方面，由于本轮复苏面临逆周期调节与结构转型的双重压力，复苏斜率较为平坦，同时结构调整持续推进。

本基金基于对投资所处时代背景的理解，聚焦于能够持续贡献现金流的投资标的，我们也深刻体会到芒格先生所言的“最值得拥有的企业是当它停止增长时，现金会大量涌现的企业”。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.8097 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.51%，业绩比较基准收益率为-8.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国际方面，发达经济体的财政支出已达高位，预计在 2024 年将实现财政政策与货币政策的再平衡过程，但基于供给侧的紧张局面仍未缓解的现状，预计降息幅度与节奏或将弱于市场预期；我们维持此前判断，本轮通胀的核心矛盾在供给侧，要解决各国贫富差距持续加剧、全球供应链重塑及大宗商品资本开支不足等供给侧的结构性矛盾，需求侧或将付出预期外的代价，发达经济体如何结束本轮加息周期仍是我们最为关注的不确定性的来源。

国内角度，伴随逆周期调节政策的逐步发力，以房地产产业链为代表的顺周期行业预计将逐步企稳，对经济的负向拖累将持续趋缓，同时，伴随资本市场制度建设的持续完善，中小股东利益预计将得到更多关注，资本市场或将逐步进入新的发展阶段。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，公司监察稽核部门通过加强对基金投资交易业务的日常投资监控、交易流程检查、注册登记、客户服务等业务进行日常跟踪检查等工作，不断加强和完善对投资交易的事前、事中和事后控制，并定期出具专项监察报告及合规性报告等，对基金投资运作的合规性情况等进行总结和报告。

通过以上工作，在本报告期内本基金运作过程中未发生关联交易、内幕交易，也不存在本基金管理人管理的各基金之间的违规交叉交易，基金运作整体合法合规。

本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

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和基金合同关于估值的约定，对基金

持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人设立估值委员会，由公司投研、运营的分管领导、督察长及研究部、投资部门（权益投资部、固定收益部等）、风险管理部、基金运营部、监察稽核部总经理共同组成，以上人员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善公司估值政策和程序，定期评价估值政策和程序修订的适用性。日常基金资产的估值程序，由基金运营部负责执行。对需要进行估值调整的投资品种，管理人启动估值调整程序，并与基金托管人协商一致，必要时征求会计师事务所的专业意见，由估值委员会会议定估值方案，基金运营部具体执行。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供有关债券品种、流通受限股票等估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

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—宝盈基金管理有限公司 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，宝盈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，宝盈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

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 | 普华永道中天审字(2024)第 24546 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 | 宝盈消费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 | <p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“宝盈消费主题基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了宝盈消费主题基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于宝盈消费主题基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p> |
| 强调事项 | - |
| 其他事项 | - |
| 其他信息 | - |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>宝盈消费主题基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估宝盈消费主</p> |

| | |
|------------------------|--|
| | <p>题基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算宝盈消费主题基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督宝盈消费主题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>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对宝盈消费主题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宝盈消费主题基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| <p>会计师事务所的名称</p> | <p>普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)</p> |
| <p>注册会计师的姓名</p> | <p>周祎 肖菊</p> |
| <p>会计师事务所的地址</p> | <p>中国·上海市</p> |
| <p>审计报告日期</p> | <p>2024 年 03 月 27 日</p> |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：宝盈消费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 | 154,334,941.79 | 111,581,228.65 |
| 结算备付金 | | 300,458.70 | 1,109,646.94 |
| 存出保证金 | | 79,057.75 | 144,245.83 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 206,467,193.02 | 466,565,314.43 |
| 其中：股票投资 | | 206,467,193.02 | 466,565,314.43 |
| 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 | 29,995,783.57 | - |
| 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 | | 917,502.52 | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,035,167.24 | 101,112.73 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 393,130,104.59 | 579,501,548.58 |
| 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 | | 6,776,118.01 | 16,812,435.41 |
| 应付赎回款 | | 113,144.91 | 75,367.70 |

| | | | |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 应付管理人报酬 | | 369,134.67 | 655,570.16 |
| 应付托管费 | | 61,522.44 | 109,261.70 |
| 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 | 338,095.58 | 588,469.29 |
| 负债合计 | | 7,658,015.61 | 18,241,104.26 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.10 | 214,304,512.76 | 316,768,097.55 |
| 未分配利润 | 7.4.7.11 | 171,167,576.22 | 244,492,346.77 |
| 净资产合计 | | 385,472,088.98 | 561,260,444.32 |
| 负债和净资产总计 | | 393,130,104.59 | 579,501,548.58 |

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金份额净值为人民币 1.8097 元，基金份额总额 213,003,531.95 份。

7.2 利润表

会计主体：宝盈消费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 | | 18,211,209.33 | -17,702,605.79 |
| 1. 利息收入 | | 974,727.24 | 312,822.63 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.12 | 816,619.50 | 312,822.63 |
| 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 | | 158,107.74 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 17,405,481.72 | 13,700,730.58 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.13 | 5,622,888.30 | 7,052,380.04 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.14 | 478,735.22 | 6,398.74 |
| 资产支持证券投资 | 7.4.7.15 | - | - |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.16 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.17 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|----------------------|-----------------------|
| 股利收益 | 7.4.7.18 | 11,303,858.20 | 6,641,951.80 |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.19 | -659,044.17 | -31,948,585.40 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.20 | 490,044.54 | 232,426.40 |
| 减：二、营业总支出 | | 7,206,585.40 | 6,687,548.57 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 5,981,980.78 | 5,538,940.04 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 996,996.71 | 923,156.84 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | - | - |
| 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 | 7.4.7.21 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 7.11 | - |
| 8. 其他费用 | 7.4.7.22 | 227,600.80 | 225,451.69 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 11,004,623.93 | -24,390,154.36 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 11,004,623.93 | -24,390,154.36 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 11,004,623.93 | -24,390,154.36 |

7.3 净资产变动表

会计主体：宝盈消费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 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 316,768,097.55 | - | 244,492,346.77 | 561,260,444.32 |
| 二、本期期初净资产 | 316,768,097.55 | - | 244,492,346.77 | 561,260,444.32 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -102,463,584.79 | - | -73,324,770.55 | -175,788,355.34 |

| | | | | |
|--|-----------------------|--------|-----------------|-----------------|
| (一)、综合收益总额 | - | - | 11,004,623.93 | 11,004,623.93 |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列) | -102,463,584.79 | - | -84,329,394.48 | -186,792,979.27 |
| 其中：1. 基金申购款 | 64,892,727.86 | - | 51,959,742.17 | 116,852,470.03 |
| 2. 基金赎回款 | -167,356,312.65 | - | -136,289,136.65 | -303,645,449.30 |
| (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 | 214,304,512.76 | - | 171,167,576.22 | 385,472,088.98 |
| 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 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 159,572,519.48 | - | 150,360,727.70 | 309,933,247.18 |
| 二、本期期初净资产 | 159,572,519.48 | - | 150,360,727.70 | 309,933,247.18 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 157,195,578.07 | - | 94,131,619.07 | 251,327,197.14 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -24,390,154.36 | -24,390,154.36 |
| (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) | 157,195,578.07 | - | 118,521,773.43 | 275,717,351.50 |
| 其中：1. 基金申购款 | 200,087,540.51 | - | 152,048,644.94 | 352,136,185.45 |
| 2. 基金赎回款 | -42,891,962.44 | - | -33,526,871.51 | -76,418,833.95 |
| (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 | 316,768,097.55 | - | 244,492,346.77 | 561,260,444.32 |

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：

杨凯

张献锦

何瑜

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

宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予鸿阳证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2016]2472号)准予,根据原鸿阳证券投资基金(以下简称“基金鸿阳”)基金份额持有人大会于 2016 年 11 月 3 日至 2016 年 12 月 2 日决议通过的《关于鸿阳证券投资基金转型有关事项的议案》,由原基金鸿阳转型而来。原基金鸿阳为契约型封闭式基金,于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市,存续期限至 2017 年 1 月 3 日止。根据深交所《终止上市通知书》(深证上[2016]998 号),原基金鸿阳于 2017 年 1 月 4 日起终止上市。原基金鸿阳更名为宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金,《鸿阳证券投资基金基金合同》失效的同时《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。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为宝盈基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

原基金鸿阳于基金合同失效前基金资产净值为 2,019,432,510.69 元,已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《关于原鸿阳证券投资基金份额折算结果的公告》的有关规定,本基金于 2017 年 1 月 19 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 0.993916887,并于 2017 年 1 月 19 日进行了变更登记。

本基金于基金合同生效后自 2017 年 1 月 4 日至 2017 年 1 月 17 日期间内开放集中申购,共募集人民币 469,526,783.14 元,其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息 29,755.64 元,经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 066 号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2017 年 1 月 19 日基金份额折算后的基金份额净值 1.0000 元折合为 469,526,783.14 份基金份额,其中包括集中申购资金利息折合的 29,755.64 份基金份额,并于 2017

年 1 月 19 日进行了确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券（包括国内依法发行的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金可参与融资业务。本基金的投资组合比例为：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）投资占基金资产的比例为 0% - 95%，其中投资于消费主题行业公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金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，保持现金或者到期日在一年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；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%。

本财务报表由本基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司于审计报告日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，

并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中（该类别次于其他所有工具类别），所有工具具有相同的特征（例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同）；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括本基金的任何影响）。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中基协字[2022]566号《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

根据中国证监会于2024年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明

确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|----------------|------------------|------------------|
| | 2023 年 12 月 31 日 | 2022 年 12 月 31 日 |
| 活期存款 | 154,334,941.79 | 111,581,228.65 |
| 等于：本金 | 154,302,869.40 | 111,561,905.71 |
| 加：应计利息 | 32,072.39 | 19,322.94 |
| 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 | 154,334,941.79 | 111,581,228.65 |

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 | 205,772,143.11 | - | 206,467,193.02 | 695,049.91 |
| 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 | 205,772,143.11 | - | 206,467,193.02 | 695,049.91 |
| 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 | 465,211,220.35 | - | 466,565,314.43 | 1,354,094.08 |
| 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 | 465,211,220.35 | - | 466,565,314.43 | 1,354,094.08 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | |
|-------|--------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 29,995,783.57 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 29,995,783.57 | - |
| 项目 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | - | - |

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

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 | 49.60 | 88.09 |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 应付交易费用 | 149,045.98 | 519,381.20 |
| 其中：交易所市场 | 149,045.98 | 519,381.20 |
| 银行间市场 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 预提费用 | 189,000.00 | 69,000.00 |
| 合计 | 338,095.58 | 588,469.29 |

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 | 314,844,787.38 | 316,768,097.55 |
| 本期申购 | 64,498,666.43 | 64,892,727.86 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -166,339,921.86 | -167,356,312.65 |
| 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 | 213,003,531.95 | 214,304,512.76 |

7.4.7.11 未分配利润

单位：人民币元

| 目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 上年度末 | 283,331,616.99 | -38,839,270.22 | 244,492,346.77 |
| 本期期初 | 283,331,616.99 | -38,839,270.22 | 244,492,346.77 |
| 本期利润 | 11,663,668.10 | -659,044.17 | 11,004,623.93 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -98,782,164.24 | 14,452,769.76 | -84,329,394.48 |
| 其中：基金申购款 | 61,124,606.83 | -9,164,864.66 | 51,959,742.17 |
| 金赎回款 | -159,906,771.07 | 23,617,634.42 | -136,289,136.65 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 196,213,120.85 | -25,045,544.63 | 171,167,576.22 |

7.4.7.12 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 | 808,305.43 | 304,250.95 |
| 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 | 6,189.47 | 7,228.31 |
| 其他 | 2,124.60 | 1,343.37 |
| 合计 | 816,619.50 | 312,822.63 |

7.4.7.13 股票投资收益

7.4.7.13.1 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 | 5,622,888.30 | 7,052,380.04 |
| 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 | 5,622,888.30 | 7,052,380.04 |

7.4.7.13.2 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 | 631,333,363.35 | 546,105,395.36 |
| 减：卖出股票成本总额 | 624,166,440.88 | 537,176,651.55 |
| 减：交易费用 | 1,544,034.17 | 1,876,363.77 |
| 买卖股票差价收入 | 5,622,888.30 | 7,052,380.04 |

7.4.7.13.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|--------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 1,974.94 | 6,700.27 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债 | 476,760.28 | -301.53 |

| | | |
|----------------|------------|----------|
| 券到期兑付) 差价收入 | | |
| 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 | 478,735.22 | 6,398.74 |

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 9,663,563.87 | 3,068,400.00 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 9,172,930.92 | 3,000,300.00 |
| 减：应计利息总额 | 13,118.36 | 68,400.00 |
| 减：交易费用 | 754.31 | 1.53 |
| 买卖债券差价收入 | 476,760.28 | -301.53 |

7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.15 资产支持证券投资收益

7.4.7.15.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.15.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.15.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 贵金属投资收益

7.4.7.16.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 衍生工具收益

7.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.18 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 | 11,303,858.20 | 6,641,951.80 |
| 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 | 11,303,858.20 | 6,641,951.80 |

7.4.7.19 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 | -659,044.17 | -31,948,585.40 |
| 股票投资 | -659,044.17 | -31,948,285.40 |
| 债券投资 | - | -300.00 |
| 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 | -659,044.17 | -31,948,585.40 |

7.4.7.20 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 | 467,670.76 | 155,684.03 |
| 基金转换费收入 | 22,373.78 | 76,742.37 |
| 合计 | 490,044.54 | 232,426.40 |

7.4.7.21 信用减值损失

无。

7.4.7.22 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 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 审计费用 | 60,000.00 | 60,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 银行汇划费用 | 10,400.80 | 8,251.69 |
| 债券账户维护费 | 36,000.00 | 36,000.00 |
| 其他 | 1,200.00 | 1,200.00 |
| 合计 | 227,600.80 | 225,451.69 |

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|-----------------------|
| 宝盈基金管理有限公司（“宝盈基金”） | 基金管理人、基金注册登记机构、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 |

| | |
|--------------------------|-----------|
| 中国对外经济贸易信托有限公司(“中国外贸信托”) | 基金管理人的股东 |
| 中铁信托有限责任公司(“中铁信托”) | 基金管理人的股东 |
| 中铁宝盈资产管理有限公司(“中铁宝盈”) | 基金管理人的子公司 |

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

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年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 | 5,981,980.78 | 5,538,940.04 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 677,423.81 | 542,855.92 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 5,304,556.97 | 4,996,084.12 |

注：自2023年1月1日至2023年8月27日，支付基金管理人宝盈基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

根据本基金的基金管理人于2023年8月25日发布的《宝盈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》，自2023年8月28日起，支付基金管理人宝盈基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公

式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年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 | 996,996.71 | 923,156.84 |

注：自2023年1月1日至2023年8月27日，支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

根据本基金的基金管理人于2023年8月25日发布的《宝盈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》，自2023年8月28日起，支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

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自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 | 154,334,941.79 | 808,305.43 | 111,581,228.65 | 304,250.95 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

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

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|-------------|-----|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 001239 | 永达股份 | 2023年12月4日 | 6个月 | 新股流通受限 | 12.05 | 19.92 | 189 | 2,277.45 | 3,764.88 | - |
| 001306 | 夏厦精密 | 2023年11月9日 | 6个月 | 新股流通受限 | 53.63 | 75.36 | 64 | 3,432.32 | 4,823.04 | - |
| 001326 | 联域股份 | 2023年11月1日 | 6个月 | 新股流通受限 | 41.18 | 48.64 | 99 | 4,076.82 | 4,815.36 | - |
| 001358 | 兴欣新材 | 2023年12月14日 | 6个月 | 新股流通受限 | 41.00 | 44.16 | 87 | 3,567.00 | 3,841.92 | - |
| 301172 | 君 | 2023 | 6个月 | 新股 | 31.33 | 38.16 | 438 | 13,722.54 | 16,714.08 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------------------|--------------------|-----|----------------------------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| | 逸 数 码 | 年7月 19日 | | 流 通 受 限 | | | | | | |
| 301210 | 金 杨 股 份 | 2023 年6月 21日 | 6个月 | 新 股 流 通 受 限 | 57.88 | 45.48 | 281 | 16,264.28 | 12,779.88 | - |
| 301251 | 威 尔 高 | 2023 年8月 30日 | 6个月 | 新 股 流 通 受 限 | 28.88 | 34.59 | 321 | 9,270.48 | 11,103.39 | - |
| 301261 | 恒 工 精 密 | 2023 年6月 29日 | 6个月 | 新 股 流 通 受 限 | 36.90 | 50.85 | 198 | 7,306.20 | 10,068.30 | - |
| 301272 | 英 华 特 | 2023 年7月 6日 | 6个月 | 新 股 流 通 受 限 | 51.39 | 53.38 | 173 | 8,890.47 | 9,234.74 | - |
| 301291 | 明 阳 电 气 | 2023 年6月 21日 | 6个月 | 新 股 流 通 受 限 | 38.13 | 28.36 | 564 | 21,505.32 | 15,995.04 | - |
| 301292 | 海 科 新 源 | 2023 年6月 29日 | 6个月 | 新 股 流 通 受 限 | 19.99 | 19.35 | 583 | 11,654.17 | 11,281.05 | - |
| 301329 | 信 音 电 子 | 2023 年7月 5日 | 6个月 | 新 股 流 通 受 限 | 21.00 | 22.23 | 458 | 9,618.00 | 10,181.34 | - |
| 301348 | 蓝 箭 电 子 | 2023 年8月 1日 | 6个月 | 新 股 流 通 受 限 | 18.08 | 44.57 | 613 | 11,083.04 | 27,321.41 | - |
| 301362 | 民 爆 光 电 | 2023 年7月 27日 | 6个月 | 新 股 流 通 受 限 | 51.05 | 38.52 | 336 | 17,152.80 | 12,942.72 | - |
| 301371 | 敷 尔 佳 | 2023 年7月 24日 | 6个月 | 新 股 流 通 受 限 | 55.68 | 37.58 | 215 | 11,971.20 | 8,079.70 | - |
| 301381 | 赛 维 时 代 | 2023 年7月 5日 | 6个月 | 新 股 流 通 受 限 | 20.45 | 29.69 | 571 | 11,676.95 | 16,952.99 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------|-----|--------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| 301393 | 昊帆生物 | 2023年7月5日 | 6个月 | 新股流通受限 | 67.68 | 59.37 | 175 | 11,844.00 | 10,389.75 | - |
| 301413 | 安培龙 | 2023年12月11日 | 6个月 | 新股流通受限 | 33.25 | 58.19 | 164 | 5,453.00 | 9,543.16 | - |
| 301418 | 协昌科技 | 2023年8月10日 | 6个月 | 新股流通受限 | 51.88 | 50.20 | 189 | 9,805.32 | 9,487.80 | - |
| 301421 | 波长光电 | 2023年8月16日 | 6个月 | 新股流通受限 | 29.38 | 59.37 | 332 | 9,754.16 | 19,710.84 | - |
| 301456 | 盘古智能 | 2023年7月6日 | 6个月 | 新股流通受限 | 37.96 | 30.39 | 307 | 11,653.72 | 9,329.73 | - |
| 301459 | 丰茂股份 | 2023年12月6日 | 6个月 | 新股流通受限 | 31.90 | 39.84 | 208 | 6,635.20 | 8,286.72 | - |
| 301469 | 恒达新材 | 2023年8月10日 | 6个月 | 新股流通受限 | 36.58 | 33.09 | 275 | 10,059.50 | 9,099.75 | - |
| 301486 | 致尚科技 | 2023年6月30日 | 6个月 | 新股流通受限 | 57.66 | 47.25 | 259 | 14,933.94 | 12,237.75 | - |
| 301487 | 盟固利 | 2023年8月1日 | 6个月 | 新股流通受限 | 5.32 | 40.96 | 867 | 4,612.44 | 35,512.32 | - |
| 301488 | 豪恩汽电 | 2023年6月26日 | 6个月 | 新股流通受限 | 39.78 | 69.09 | 262 | 10,422.36 | 18,101.58 | - |
| 301489 | 思泉新材 | 2023年10月16日 | 6个月 | 新股流通受限 | 41.66 | 64.11 | 128 | 5,332.48 | 8,206.08 | - |
| 301498 | 乖 | 2023 | 6个月 | 新股 | 39.99 | 38.81 | 310 | 12,396.90 | 12,031.10 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------|-----|--------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| | 宝宠物 | 年8月9日 | | 流通受限 | | | | | | |
| 301499 | 维科精密 | 2023年7月13日 | 6个月 | 新股流通受限 | 19.50 | 28.93 | 371 | 7,234.50 | 10,733.03 | - |
| 301500 | 飞南资源 | 2023年9月13日 | 6个月 | 新股流通受限 | 23.97 | 20.89 | 413 | 9,899.61 | 8,627.57 | - |
| 301505 | 苏州规划 | 2023年7月12日 | 6个月 | 新股流通受限 | 26.35 | 35.81 | 194 | 5,111.90 | 6,947.14 | - |
| 301507 | 民生健康 | 2023年8月24日 | 6个月 | 新股流通受限 | 10.00 | 15.85 | 840 | 8,400.00 | 13,314.00 | - |
| 301508 | 中机认检 | 2023年11月23日 | 6个月 | 新股流通受限 | 16.82 | 26.68 | 419 | 7,047.58 | 11,178.92 | - |
| 301509 | 金凯生科 | 2023年7月26日 | 6个月 | 新股流通受限 | 56.56 | 62.23 | 217 | 12,273.52 | 13,503.91 | - |
| 301510 | 固高科技 | 2023年8月4日 | 6个月 | 新股流通受限 | 12.00 | 35.01 | 396 | 4,752.00 | 13,863.96 | - |
| 301511 | 德福科技 | 2023年8月8日 | 6个月 | 新股流通受限 | 28.00 | 22.67 | 528 | 14,784.00 | 11,969.76 | - |
| 301515 | 港通医疗 | 2023年7月13日 | 6个月 | 新股流通受限 | 31.16 | 28.27 | 230 | 7,166.80 | 6,502.10 | - |
| 301516 | 中远通 | 2023年12月1日 | 6个月 | 新股流通受限 | 6.87 | 15.51 | 604 | 4,149.48 | 9,368.04 | - |
| 301517 | 陕西 | 2023年10 | 6个月 | 新股流通 | 26.87 | 43.69 | 185 | 4,970.95 | 8,082.65 | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------|-----|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|--|
| | 华达 | 月9日 | | 受限 | | | | | | | |
| 301518 | 长华化学 | 2023年7月26日 | 6个月 | 新股流通受限 | 25.75 | 23.01 | 385 | 9,913.75 | 8,858.85 | - | |
| 301519 | 舜禹股份 | 2023年7月19日 | 6个月 | 新股流通受限 | 20.93 | 20.21 | 442 | 9,251.06 | 8,932.82 | - | |
| 301520 | 万邦医药 | 2023年9月18日 | 6个月 | 新股流通受限 | 67.88 | 52.74 | 150 | 10,182.00 | 7,911.00 | - | |
| 301525 | 儒竞科技 | 2023年8月23日 | 6个月 | 新股流通受限 | 99.57 | 81.46 | 110 | 10,952.70 | 8,960.60 | - | |
| 301526 | 国际复材 | 2023年12月19日 | 6个月 | 新股流通受限 | 2.66 | 4.45 | 6,069 | 16,143.54 | 27,007.05 | - | |
| 301528 | 多浦乐 | 2023年8月17日 | 6个月 | 新股流通受限 | 71.80 | 68.91 | 145 | 10,411.00 | 9,991.95 | - | |
| 301529 | 福赛科技 | 2023年8月31日 | 6个月 | 新股流通受限 | 36.60 | 37.88 | 182 | 6,661.20 | 6,894.16 | - | |
| 301533 | 威马农机 | 2023年8月7日 | 6个月 | 新股流通受限 | 29.50 | 33.16 | 225 | 6,637.50 | 7,461.00 | - | |
| 301548 | 崇德科技 | 2023年9月11日 | 6个月 | 新股流通受限 | 66.80 | 58.99 | 125 | 8,350.00 | 7,373.75 | - | |
| 301550 | 斯菱股份 | 2023年9月6日 | 6个月 | 新股流通受限 | 37.56 | 43.57 | 240 | 9,014.40 | 10,456.80 | - | |
| 301555 | 惠柏新 | 2023年10月24日 | 6个月 | 新股流通受限 | 22.88 | 32.44 | 224 | 5,125.12 | 7,266.56 | - | |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------|-----|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| | 材 | 日 | | | | | | | | |
| 301558 | 三态股份 | 2023年9月21日 | 6个月 | 新股流通受限 | 7.33 | 13.40 | 1,390 | 10,188.70 | 18,626.00 | - |
| 301559 | 中集环科 | 2023年9月26日 | 6个月 | 新股流通受限 | 24.22 | 18.24 | 447 | 10,826.34 | 8,153.28 | - |
| 301566 | 达利凯普 | 2023年12月22日 | 6个月 | 新股流通受限 | 8.90 | 22.14 | 576 | 5,126.40 | 12,752.64 | - |
| 301568 | 思泰克 | 2023年11月21日 | 6个月 | 新股流通受限 | 23.23 | 35.58 | 246 | 5,714.58 | 8,752.68 | - |
| 301578 | 辰奕智能 | 2023年12月21日 | 6个月 | 新股流通受限 | 48.94 | 68.32 | 118 | 5,774.92 | 8,061.76 | - |
| 601083 | 锦江航运 | 2023年11月28日 | 6个月 | 新股流通受限 | 11.25 | 11.07 | 605 | 6,806.25 | 6,697.35 | - |
| 601096 | 宏盛华源 | 2023年12月15日 | 6个月 | 新股流通受限 | 1.70 | 4.06 | 2,886 | 4,906.20 | 11,717.16 | - |
| 603004 | 鼎龙科技 | 2023年12月20日 | 6个月 | 新股流通受限 | 16.80 | 31.19 | 195 | 3,276.00 | 6,082.05 | - |
| 603075 | 热威股份 | 2023年9月1日 | 6个月 | 新股流通受限 | 23.10 | 23.31 | 158 | 3,649.80 | 3,682.98 | - |
| 603107 | 上海汽配 | 2023年10月25日 | 6个月 | 新股流通受限 | 14.23 | 18.19 | 257 | 3,657.11 | 4,674.83 | - |
| 603119 | 浙江荣 | 2023年7月21日 | 6个月 | 新股流通受限 | 15.32 | 23.87 | 204 | 3,125.28 | 4,869.48 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------------------|---------------------------|------|----------------------------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| | 泰 | | | | | | | | | |
| 603193 | 润 本 股 份 | 2023 年 10 月 9 日 | 6 个月 | 新 股 流 通 受 限 | 17.38 | 16.66 | 261 | 4,536.18 | 4,348.26 | - |
| 603231 | 索 宝 蛋 白 | 2023 年 12 月 6 日 | 6 个月 | 新 股 流 通 受 限 | 21.29 | 21.53 | 161 | 3,427.69 | 3,466.33 | - |
| 603270 | 金 帝 股 份 | 2023 年 8 月 25 日 | 6 个月 | 新 股 流 通 受 限 | 21.77 | 29.58 | 194 | 4,223.38 | 5,738.52 | - |
| 603273 | 天 元 智 能 | 2023 年 10 月 16 日 | 6 个月 | 新 股 流 通 受 限 | 9.50 | 18.97 | 178 | 1,691.00 | 3,376.66 | - |
| 603275 | 众 辰 科 技 | 2023 年 8 月 16 日 | 6 个月 | 新 股 流 通 受 限 | 49.97 | 39.70 | 116 | 5,796.52 | 4,605.20 | - |
| 603276 | 恒 兴 新 材 | 2023 年 9 月 18 日 | 6 个月 | 新 股 流 通 受 限 | 25.73 | 24.88 | 134 | 3,447.82 | 3,333.92 | - |
| 603296 | 华 勤 技 术 | 2023 年 8 月 1 日 | 6 个月 | 新 股 流 通 受 限 | 80.80 | 77.75 | 166 | 13,412.80 | 12,906.50 | - |
| 603373 | 安 邦 护 卫 | 2023 年 12 月 13 日 | 6 个月 | 新 股 流 通 受 限 | 19.10 | 34.75 | 88 | 1,680.80 | 3,058.00 | - |
| 688450 | 光 格 科 技 | 2023 年 7 月 17 日 | 6 个月 | 新 股 流 通 受 限 | 53.09 | 36.42 | 167 | 8,866.03 | 6,082.14 | - |
| 688548 | 广 钢 气 体 | 2023 年 8 月 8 日 | 6 个月 | 新 股 流 通 受 限 | 9.87 | 12.75 | 1,431 | 14,123.97 | 18,245.25 | - |
| 688549 | 中 巨 芯 | 2023 年 8 月 30 日 | 6 个月 | 新 股 流 通 受 限 | 5.18 | 8.09 | 2,199 | 11,390.82 | 17,789.91 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|--------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| 688563 | 航材股份 | 2023年7月12日 | 6个月 | 新股流通受限 | 78.99 | 60.49 | 255 | 20,142.45 | 15,424.95 | - |
| 688573 | 信宇人 | 2023年8月9日 | 6个月 | 新股流通受限 | 23.68 | 28.80 | 285 | 6,748.80 | 8,208.00 | - |
| 688582 | 芯动联科 | 2023年6月21日 | 6个月 | 新股流通受限 | 26.74 | 38.67 | 454 | 12,139.96 | 17,556.18 | - |
| 688591 | 泰凌微 | 2023年8月18日 | 6个月 | 新股流通受限 | 24.98 | 28.02 | 530 | 13,239.40 | 14,850.60 | - |
| 688592 | 司南导航 | 2023年8月7日 | 6个月 | 新股流通受限 | 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 | 新股流通受限 | 8.66 | 11.06 | 856 | 7,412.96 | 9,467.36 | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023年6月30日 | 6个月 | 新股流通受限 | 55.00 | 74.14 | 140 | 7,700.00 | 10,379.60 | - |
| 688610 | 埃科光电 | 2023年7月10日 | 6个月 | 新股流通受限 | 73.33 | 51.00 | 263 | 19,285.79 | 13,413.00 | - |
| 688612 | 威迈斯 | 2023年7月19日 | 6个月 | 新股流通受限 | 47.29 | 37.97 | 203 | 9,599.87 | 7,707.91 | - |
| 688627 | 精智达 | 2023年7月11日 | 6个月 | 新股流通受限 | 46.77 | 87.72 | 222 | 10,382.94 | 19,473.84 | - |
| 688638 | 誉辰智能 | 2023年7月4日 | 6个月 | 新股流通受限 | 83.90 | 59.68 | 141 | 11,829.90 | 8,414.88 | - |
| 688646 | 逸飞激光 | 2023年7月21日 | 6个月 | 新股流通受限 | 46.80 | 36.07 | 219 | 10,249.20 | 7,899.33 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------|-----|--------|--------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| 688648 | 中邮科技 | 2023年11月6日 | 6个月 | 新股流通受限 | 15.18 | 21.43 | 303 | 4,599.54 | 6,493.29 | - |
| 688651 | 盛邦安全 | 2023年7月19日 | 6个月 | 新股流通受限 | 39.90 | 46.05 | 178 | 7,102.20 | 8,196.90 | - |
| 688652 | 京仪装备 | 2023年11月22日 | 6个月 | 新股流通受限 | 31.95 | 52.25 | 305 | 9,744.75 | 15,936.25 | - |
| 688653 | 康希通信 | 2023年11月10日 | 6个月 | 新股流通受限 | 10.50 | 15.99 | 648 | 6,804.00 | 10,361.52 | - |
| 688657 | 浩辰软件 | 2023年9月25日 | 6个月 | 新股流通受限 | 103.40 | 78.23 | 98 | 10,133.20 | 7,666.54 | - |
| 688671 | 碧兴物联 | 2023年8月2日 | 6个月 | 新股流通受限 | 36.12 | 34.30 | 226 | 8,163.12 | 7,751.80 | - |
| 688693 | 锆威特 | 2023年8月10日 | 6个月 | 新股流通受限 | 40.83 | 43.41 | 178 | 7,267.74 | 7,726.98 | - |
| 688702 | 盛科通信 | 2023年9月6日 | 6个月 | 新股流通受限 | 42.66 | 48.18 | 258 | 11,006.28 | 12,430.44 | - |
| 688716 | 中研股份 | 2023年9月13日 | 6个月 | 新股流通受限 | 29.66 | 36.39 | 267 | 7,919.22 | 9,716.13 | - |
| 688719 | 爱科赛博 | 2023年9月20日 | 6个月 | 新股流通受限 | 69.98 | 60.10 | 165 | 11,546.70 | 9,916.50 | - |
| 688720 | 艾森股份 | 2023年11月29日 | 6个月 | 新股流通受限 | 28.03 | 49.84 | 165 | 4,624.95 | 8,223.60 | - |

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中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，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。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 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

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。本基金的主要投资对象是基本面良好、投资价值较高的上市公司股票(含存托凭证)，以及债券、权证和其他中国证监会允许基金投资的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些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在董事会下设立风险控制委员会，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管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

于 2023 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种

所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.26%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2023年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|--------------------|----------------|------|------|-----------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 154,334,941.79 | - | - | - | 154,334,941.79 |
| 结算备付金 | 300,458.70 | - | - | - | 300,458.70 |
| 存出保证金 | 79,057.75 | - | - | - | 79,057.75 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | -206,467,193.02 | 206,467,193.02 |
| 买入返售金融资产 | 29,995,783.57 | - | - | - | 29,995,783.57 |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,035,167.24 | 1,035,167.24 |
| 应收清算款 | - | - | - | 917,502.52 | 917,502.52 |
| 资产总计 | 184,710,241.81 | - | - | -208,419,862.78 | 393,130,104.59 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 113,144.91 | 113,144.91 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 369,134.67 | 369,134.67 |
| 应付托管费 | - | - | - | 61,522.44 | 61,522.44 |

| | | | | | |
|--------------------------|----------------|-------|-------|-----------------|----------------|
| 应付清算款 | - | - | - | 6,776,118.01 | 6,776,118.01 |
| 其他负债 | - | - | - | 338,095.58 | 338,095.58 |
| 负债总计 | - | - | - | 7,658,015.61 | 7,658,015.61 |
| 利率敏感度缺口 | 184,710,241.81 | - | - | -200,761,847.17 | 385,472,088.98 |
| 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 | 111,581,228.65 | - | - | - | 111,581,228.65 |
| 结算备付金 | 1,109,646.94 | - | - | - | 1,109,646.94 |
| 存出保证金 | 144,245.83 | - | - | - | 144,245.83 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | -466,565,314.43 | 466,565,314.43 |
| 应收申购款 | - | - | - | 101,112.73 | 101,112.73 |
| 资产总计 | 112,835,121.42 | - | - | -466,666,427.16 | 579,501,548.58 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 75,367.70 | 75,367.70 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 655,570.16 | 655,570.16 |
| 应付托管费 | - | - | - | 109,261.70 | 109,261.70 |
| 应付清算款 | - | - | - | 16,812,435.41 | 16,812,435.41 |
| 其他负债 | - | - | - | 588,469.29 | 588,469.29 |
| 负债总计 | - | - | - | 18,241,104.26 | 18,241,104.26 |
| 利率敏感度缺口 | 112,835,121.42 | - | - | -448,425,322.90 | 561,260,444.32 |

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，实施积极主动的投资策略，运用多种方法进行资产配置：大类资产配置策略以投资目标为中心，一方面尽力规避相关资产的下行风险，另一方面使组合能够跟踪某类资产的上行趋势，大类资产配置策略将在基金合同约定的投资范围

内，结合对宏观经济形势与资本市场环境的深入剖析，自上而下地实施积极的大类资产配置策略；本基金在主题筛选的基础上，通过定性分析与定量分析相结合的方法，精选上市公司进行投资；固定收益类资产投资将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券的投资策略和资产支持证券投资策略，选择合适时机投资于低估的债券品种，通过积极主动管理，获得超额收益。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中：股票投资(含存托凭证)占基金资产的比例为 0% - 95%，其中投资于消费主题行业公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金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，保持现金或者到期日在一年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；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | |
|---------------|-------------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值 比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值 比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 206,467,193.02 | 53.56 | 466,565,314.43 | 83.13 |
| 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 | 206,467,193.02 | 53.56 | 466,565,314.43 | 83.13 |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除中证消费服务领先指数收益率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|-----------|-----------------------------|------------------|--|
| 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) |
|----|-------------------------------|---------------|----------------|
| 分析 | 1. 中证消费服务 领先指数收益率上 升 5% | 7,823,087.44 | 26,021,432.61 |
| | 2. 中证消费服务 领先指数收益率下 降 5% | -7,823,087.44 | -26,021,432.61 |

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 | 205,475,000.00 | 465,411,988.43 |
| 第二层次 | - | - |
| 第三层次 | 992,193.02 | 1,153,326.00 |
| 合计 | 206,467,193.02 | 466,565,314.43 |

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的

不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年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 | - | 1,153,326.00 | 1,153,326.00 |
| 当期购买 | - | - | - |
| 当期出售/结算 | - | - | - |
| 转入第三层次 | - | 2,236,777.95 | 2,236,777.95 |
| 转出第三层次 | - | 2,881,061.42 | 2,881,061.42 |
| 当期利得或损失总额 | - | 483,150.49 | 483,150.49 |
| 其中：计入损益的利得或损失 | - | 483,150.49 | 483,150.49 |
| 计入其他综合收益的利得或损失 | - | - | - |
| 期末余额 | - | 992,193.02 | 992,193.02 |
| 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 | - | 163,188.79 | 163,188.79 |
| 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 | - | 1,908,163.03 | 1,908,163.03 |
| 当期购买 | - | 1,177,428.60 | 1,177,428.60 |
| 当期出售/结算 | - | - | - |
| 转入第三层次 | - | - | - |
| 转出第三层次 | - | 1,673,328.10 | 1,673,328.10 |
| 当期利得或损失总额 | - | -258,937.53 | -258,937.53 |
| 其中：计入损益的利得或损失 | - | -258,937.53 | -258,937.53 |
| 计入其他综合收益的利得或损失 | - | - | - |

| | | | |
|--|---|--------------|--------------|
| 期末余额 | - | 1,153,326.00 | 1,153,326.00 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | - | -24,102.60 | -24,102.60 |

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2023 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末公允价值 | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 | | |
|--------|--------------|------------|---------|----------------|------------|
| | | | 名称 | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| 流通受限股票 | 992,193.02 | 平均价格亚式期权模型 | 预期年化波动率 | 18.55%-219.88% | 负相关 |
| 项目 | 上年度末公允价值 | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 | | |
| | | | 名称 | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| 流通受限股票 | 1,153,326.00 | 平均价格亚式期权模型 | 预期年化波动率 | 18.91%-247.56% | 负相关 |

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 206,467,193.02 | 52.52 |
| | 其中：股票 | 206,467,193.02 | 52.52 |
| 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 | 29,995,783.57 | 7.63 |
| | 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 | 154,635,400.49 | 39.33 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,031,727.51 | 0.52 |
| 9 | 合计 | 393,130,104.59 | 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 | 32,944,000.00 | 8.55 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 154,699,380.84 | 40.13 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 35,578.99 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 18,705,197.35 | 4.85 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 45,007.96 | 0.01 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,058.00 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 26,037.06 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 8,932.82 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |

| | | | |
|---|-----------|----------------|-------|
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 206,467,193.02 | 53.56 |

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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 | 000333 | 美的集团 | 620,000 | 33,870,600.00 | 8.79 |
| 2 | 002714 | 牧原股份 | 800,000 | 32,944,000.00 | 8.55 |
| 3 | 002327 | 富安娜 | 3,000,000 | 26,850,000.00 | 6.97 |
| 4 | 600887 | 伊利股份 | 800,000 | 21,400,000.00 | 5.55 |
| 5 | 603156 | 养元饮品 | 1,000,000 | 21,260,000.00 | 5.52 |
| 6 | 002311 | 海大集团 | 340,000 | 15,269,400.00 | 3.96 |
| 7 | 000951 | 中国重汽 | 1,000,000 | 13,360,000.00 | 3.47 |
| 8 | 603056 | 德邦股份 | 800,000 | 11,576,000.00 | 3.00 |
| 9 | 600132 | 重庆啤酒 | 120,000 | 7,974,000.00 | 2.07 |
| 10 | 603195 | 公牛集团 | 80,000 | 7,652,000.00 | 1.99 |
| 11 | 601333 | 广深铁路 | 2,750,000 | 7,122,500.00 | 1.85 |
| 12 | 600031 | 三一重工 | 450,000 | 6,196,500.00 | 1.61 |
| 13 | 301487 | 盟固利 | 867 | 35,512.32 | 0.01 |
| 14 | 301348 | 蓝箭电子 | 613 | 27,321.41 | 0.01 |
| 15 | 301526 | 国际复材 | 6,069 | 27,007.05 | 0.01 |
| 16 | 301421 | 波长光电 | 332 | 19,710.84 | 0.01 |
| 17 | 688627 | 精智达 | 222 | 19,473.84 | 0.01 |
| 18 | 301558 | 三态股份 | 1,390 | 18,626.00 | 0.00 |
| 19 | 688548 | 广钢气体 | 1,431 | 18,245.25 | 0.00 |
| 20 | 301488 | 豪恩汽电 | 262 | 18,101.58 | 0.00 |
| 21 | 688549 | 中巨芯 | 2,199 | 17,789.91 | 0.00 |
| 22 | 688582 | 芯动联科 | 454 | 17,556.18 | 0.00 |
| 23 | 301381 | 赛维时代 | 571 | 16,952.99 | 0.00 |
| 24 | 301172 | 君逸数码 | 438 | 16,714.08 | 0.00 |
| 25 | 301291 | 明阳电气 | 564 | 15,995.04 | 0.00 |
| 26 | 688652 | 京仪装备 | 305 | 15,936.25 | 0.00 |
| 27 | 688563 | 航材股份 | 255 | 15,424.95 | 0.00 |
| 28 | 688591 | 泰凌微 | 530 | 14,850.60 | 0.00 |
| 29 | 301510 | 固高科技 | 396 | 13,863.96 | 0.00 |
| 30 | 301509 | 金凯生科 | 217 | 13,503.91 | 0.00 |
| 31 | 688610 | 埃科光电 | 263 | 13,413.00 | 0.00 |
| 32 | 301507 | 民生健康 | 840 | 13,314.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 33 | 301362 | 民爆光电 | 336 | 12,942.72 | 0.00 |
| 34 | 603296 | 华勤技术 | 166 | 12,906.50 | 0.00 |
| 35 | 301210 | 金杨股份 | 281 | 12,779.88 | 0.00 |
| 36 | 301566 | 达利凯普 | 576 | 12,752.64 | 0.00 |
| 37 | 688702 | 盛科通信 | 258 | 12,430.44 | 0.00 |
| 38 | 301486 | 致尚科技 | 259 | 12,237.75 | 0.00 |
| 39 | 301498 | 乖宝宠物 | 310 | 12,031.10 | 0.00 |
| 40 | 301511 | 德福科技 | 528 | 11,969.76 | 0.00 |
| 41 | 601096 | 宏盛华源 | 2,886 | 11,717.16 | 0.00 |
| 42 | 301292 | 海科新源 | 583 | 11,281.05 | 0.00 |
| 43 | 301508 | 中机认检 | 419 | 11,178.92 | 0.00 |
| 44 | 301251 | 威尔高 | 321 | 11,103.39 | 0.00 |
| 45 | 688592 | 司南导航 | 216 | 10,914.48 | 0.00 |
| 46 | 301499 | 维科精密 | 371 | 10,733.03 | 0.00 |
| 47 | 301550 | 斯菱股份 | 240 | 10,456.80 | 0.00 |
| 48 | 301393 | 昊帆生物 | 175 | 10,389.75 | 0.00 |
| 49 | 688603 | 天承科技 | 140 | 10,379.60 | 0.00 |
| 50 | 688653 | 康希通信 | 648 | 10,361.52 | 0.00 |
| 51 | 301329 | 信音电子 | 458 | 10,181.34 | 0.00 |
| 52 | 301261 | 恒工精密 | 198 | 10,068.30 | 0.00 |
| 53 | 301528 | 多浦乐 | 145 | 9,991.95 | 0.00 |
| 54 | 688719 | 爱科赛博 | 165 | 9,916.50 | 0.00 |
| 55 | 688716 | 中研股份 | 267 | 9,716.13 | 0.00 |
| 56 | 301413 | 安培龙 | 164 | 9,543.16 | 0.00 |
| 57 | 301418 | 协昌科技 | 189 | 9,487.80 | 0.00 |
| 58 | 688602 | 康鹏科技 | 856 | 9,467.36 | 0.00 |
| 59 | 301516 | 中远通 | 604 | 9,368.04 | 0.00 |
| 60 | 301456 | 盘古智能 | 307 | 9,329.73 | 0.00 |
| 61 | 301272 | 英华特 | 173 | 9,234.74 | 0.00 |
| 62 | 301469 | 恒达新材 | 275 | 9,099.75 | 0.00 |
| 63 | 301525 | 儒竞科技 | 110 | 8,960.60 | 0.00 |
| 64 | 301519 | 舜禹股份 | 442 | 8,932.82 | 0.00 |
| 65 | 301518 | 长华化学 | 385 | 8,858.85 | 0.00 |
| 66 | 301568 | 思泰克 | 246 | 8,752.68 | 0.00 |
| 67 | 301500 | 飞南资源 | 413 | 8,627.57 | 0.00 |
| 68 | 688638 | 誉辰智能 | 141 | 8,414.88 | 0.00 |
| 69 | 301459 | 丰茂股份 | 208 | 8,286.72 | 0.00 |
| 70 | 688720 | 艾森股份 | 165 | 8,223.60 | 0.00 |
| 71 | 688573 | 信宇人 | 285 | 8,208.00 | 0.00 |
| 72 | 301489 | 思泉新材 | 128 | 8,206.08 | 0.00 |
| 73 | 688651 | 盛邦安全 | 178 | 8,196.90 | 0.00 |
| 74 | 301559 | 中集环科 | 447 | 8,153.28 | 0.00 |
| 75 | 301517 | 陕西华达 | 185 | 8,082.65 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 76 | 301371 | 敷尔佳 | 215 | 8,079.70 | 0.00 |
| 77 | 301578 | 辰奕智能 | 118 | 8,061.76 | 0.00 |
| 78 | 301520 | 万邦医药 | 150 | 7,911.00 | 0.00 |
| 79 | 688646 | 逸飞激光 | 219 | 7,899.33 | 0.00 |
| 80 | 688671 | 碧兴物联 | 226 | 7,751.80 | 0.00 |
| 81 | 688693 | 锆威特 | 178 | 7,726.98 | 0.00 |
| 82 | 688612 | 威迈斯 | 203 | 7,707.91 | 0.00 |
| 83 | 688657 | 浩辰软件 | 98 | 7,666.54 | 0.00 |
| 84 | 301533 | 威马农机 | 225 | 7,461.00 | 0.00 |
| 85 | 301548 | 崇德科技 | 125 | 7,373.75 | 0.00 |
| 86 | 301555 | 惠柏新材 | 224 | 7,266.56 | 0.00 |
| 87 | 301505 | 苏州规划 | 194 | 6,947.14 | 0.00 |
| 88 | 301529 | 福赛科技 | 182 | 6,894.16 | 0.00 |
| 89 | 601083 | 锦江航运 | 605 | 6,697.35 | 0.00 |
| 90 | 301515 | 港通医疗 | 230 | 6,502.10 | 0.00 |
| 91 | 688648 | 中邮科技 | 303 | 6,493.29 | 0.00 |
| 92 | 688450 | 光格科技 | 167 | 6,082.14 | 0.00 |
| 93 | 603004 | 鼎龙科技 | 195 | 6,082.05 | 0.00 |
| 94 | 603270 | 金帝股份 | 194 | 5,738.52 | 0.00 |
| 95 | 603119 | 浙江荣泰 | 204 | 4,869.48 | 0.00 |
| 96 | 001306 | 夏厦精密 | 64 | 4,823.04 | 0.00 |
| 97 | 001326 | 联域股份 | 99 | 4,815.36 | 0.00 |
| 98 | 603107 | 上海汽配 | 257 | 4,674.83 | 0.00 |
| 99 | 603275 | 众辰科技 | 116 | 4,605.20 | 0.00 |
| 100 | 603193 | 润本股份 | 261 | 4,348.26 | 0.00 |
| 101 | 001358 | 兴欣新材 | 87 | 3,841.92 | 0.00 |
| 102 | 001239 | 永达股份 | 189 | 3,764.88 | 0.00 |
| 103 | 603075 | 热威股份 | 158 | 3,682.98 | 0.00 |
| 104 | 603231 | 索宝蛋白 | 161 | 3,466.33 | 0.00 |
| 105 | 603273 | 天元智能 | 178 | 3,376.66 | 0.00 |
| 106 | 603276 | 恒兴新材 | 134 | 3,333.92 | 0.00 |
| 107 | 603373 | 安邦护卫 | 88 | 3,058.00 | 0.00 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 000333 | 美的集团 | 40,641,300.68 | 7.24 |
| 2 | 002714 | 牧原股份 | 33,437,795.98 | 5.96 |
| 3 | 601058 | 赛轮轮胎 | 27,079,937.69 | 4.82 |
| 4 | 600900 | 长江电力 | 21,052,403.00 | 3.75 |
| 5 | 002032 | 苏泊尔 | 20,598,806.00 | 3.67 |
| 6 | 000951 | 中国重汽 | 20,020,198.80 | 3.57 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 7 | 601633 | 长城汽车 | 17,196,595.00 | 3.06 |
| 8 | 000625 | 长安汽车 | 17,186,741.72 | 3.06 |
| 9 | 601333 | 广深铁路 | 16,084,696.00 | 2.87 |
| 10 | 002311 | 海大集团 | 15,717,875.65 | 2.80 |
| 11 | 603056 | 德邦股份 | 12,603,774.27 | 2.25 |
| 12 | 601238 | 广汽集团 | 11,118,940.00 | 1.98 |
| 13 | 002078 | 太阳纸业 | 9,493,062.00 | 1.69 |
| 14 | 300791 | 仙乐健康 | 9,354,286.17 | 1.67 |
| 15 | 601658 | 邮储银行 | 9,043,068.00 | 1.61 |
| 16 | 600132 | 重庆啤酒 | 8,004,836.00 | 1.43 |
| 17 | 603195 | 公牛集团 | 7,667,304.20 | 1.37 |
| 18 | 600031 | 三一重工 | 7,154,226.00 | 1.27 |
| 19 | 300628 | 亿联网络 | 5,894,549.00 | 1.05 |
| 20 | 300979 | 华利集团 | 5,725,737.00 | 1.02 |

注：1、买入包括基金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。

2、买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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 | 000858 | 五粮液 | 40,928,164.00 | 7.29 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 36,601,619.00 | 6.52 |
| 3 | 002003 | 伟星股份 | 33,689,351.54 | 6.00 |
| 4 | 002142 | 宁波银行 | 32,763,030.00 | 5.84 |
| 5 | 002714 | 牧原股份 | 32,058,980.89 | 5.71 |
| 6 | 601058 | 赛轮轮胎 | 29,593,912.00 | 5.27 |
| 7 | 603565 | 中谷物流 | 26,931,297.30 | 4.80 |
| 8 | 002078 | 太阳纸业 | 26,708,233.66 | 4.76 |
| 9 | 601339 | 百隆东方 | 26,541,514.00 | 4.73 |
| 10 | 000625 | 长安汽车 | 25,468,664.00 | 4.54 |
| 11 | 603816 | 顾家家居 | 22,442,720.00 | 4.00 |
| 12 | 600900 | 长江电力 | 22,178,801.00 | 3.95 |
| 13 | 300308 | 中际旭创 | 21,194,771.00 | 3.78 |
| 14 | 002032 | 苏泊尔 | 19,301,044.08 | 3.44 |
| 15 | 300059 | 东方财富 | 17,363,241.14 | 3.09 |
| 16 | 605369 | 拱东医疗 | 17,194,994.00 | 3.06 |
| 17 | 000001 | 平安银行 | 16,822,897.00 | 3.00 |
| 18 | 601633 | 长城汽车 | 16,411,938.00 | 2.92 |
| 19 | 300979 | 华利集团 | 15,700,574.36 | 2.80 |
| 20 | 603583 | 捷昌驱动 | 13,862,134.00 | 2.47 |
| 21 | 603866 | 桃李面包 | 13,629,935.80 | 2.43 |
| 22 | 000568 | 泸州老窖 | 11,528,062.00 | 2.05 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 23 | 000661 | 长春高新 | 11,295,398.00 | 2.01 |
|----|--------|------|---------------|------|

注：1、卖出主要指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。

2、卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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 | 364,727,363.64 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 631,333,363.35 |

注：买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额，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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金可相应调整和更新相关投资策略。

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

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、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

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 79,057.75 |
| 2 | 应收清算款 | 917,502.52 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,035,167.24 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,031,727.51 |

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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，分项与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|----------------|---------------|----------------|---------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 (%) | 持有份额 | 占总份额比例 (%) |
| 41,302 | 5,157.22 | 109,467,577.85 | 51.39 | 103,535,954.10 | 48.61 |

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 | 3,766.01 | 0.0018 |

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 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产 品情况

| 基金经理姓名 | 产品类型 | 持有本人管理的产 品份额总量的数量区间（万份） |
|--------|----------|-------------------------|
| 杨思亮 | 公募基金 | 10~50 |
| | 私募资产管理计划 | 0 |
| | 合计 | 10~50 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2017年1月4日）基 金份额总额 | 2,000,000,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 314,844,787.38 |
| 本报告期基金总申购份额 | 64,498,666.43 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 166,339,921.86 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 213,003,531.95 |

§ 11 重大事件揭示**11.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

1、报告期内，本基金管理人重大人事变动情况如下：

宝盈基金管理有限公司股东中铁信托有限责任公司、中国对外经济贸易信托有限公司以股 东直接作出决定的方式通过宝盈基金管理有限公司独立董事变更事项，同意王汀汀辞去宝盈基 金管理有限公司独立董事职务，何茵担任宝盈基金管理有限公司独立董事职务。

2、报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金管理人的基金投资策略遵循本基金《基金合同》中规定的投资策略，未发生显著改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未发生改聘会计师事务所情况。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费 60,000.00 元，目前事务所已连续 7 年为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|--------|--------|----------------|------------------|------------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 中信建投证券 | 1 | 367,657,856.69 | 37.68 | 339,330.38 | 37.56 | - |
| 中金公司 | 1 | 300,294,035.34 | 30.78 | 278,072.16 | 30.78 | - |
| 申万宏源证券 | 2 | 275,885,448.53 | 28.28 | 256,707.01 | 28.42 | - |
| 国泰君安证券 | 1 | 20,268,855.88 | 2.08 | 18,673.88 | 2.07 | - |
| 第一创业证券 | 1 | 11,529,184.00 | 1.18 | 10,622.28 | 1.18 | - |
| 财达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、本基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序：

- (1) 经营行为规范，财务状况良好，内控制度健全，在业内有良好的信誉。
- (2) 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基金进行证券交易的需要。
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的信息服务；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。
- (4) 本基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，并与被选择的券商签订证券交易单元租用协议。

2、本基金本报告期交易单元变更情况：

- (1) 本报告期内未新租交易单元。
- (2) 本报告期内未退租交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|--------|---------------|-----------------|----------------|-------------------|------|-----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例(%) |
| 中信建投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 18,847,578.95 | 100.00 | 223,370,000.00 | 76.14 | - | - |
| 申万宏源证券 | - | - | 50,000,000.00 | 17.04 | - | - |
| 国泰君安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券 | - | - | 20,000,000.00 | 6.82 | - | - |
| 财达证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-11-06 |
| 2 | 宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-10-25 |
| 3 | 宝盈基金管理有限公司旗下 59 只基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报 | 2023-10-25 |
| 4 | 宝盈基金管理有限公司关于终止凤凰金信(海口)基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-09-06 |
| 5 | 宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-08-30 |
| 6 | 宝盈基金管理有限公司旗下 59 只基金 2023 年中期报告提示性公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报 | 2023-08-30 |
| 7 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加金元证券股份有限公司手续费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-08-30 |
| 8 | 宝盈基金管理有限公司关于终止杭州科地瑞富基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-08-28 |
| 9 | 宝盈基金管理有限公司关于终止浙江金观诚基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-08-28 |
| 10 | 宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-08-25 |
| 11 | 宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-08-25 |
| 12 | 宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资 | 本基金管理人网站, 中 | 2023-08-25 |

| | | | |
|----|---|---|------------|
| | 资基金基金产品资料概要（更新） | 国证监会基金电子披露网站 | |
| 13 | 宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-08-25 |
| 14 | 宝盈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 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-08-25 |
| 15 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金参与腾安基金赎回费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-08-25 |
| 16 | 宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金参与腾安基金赎回费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-08-22 |
| 17 | 宝盈基金管理有限公司关于新增银泰证券有限责任公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-08-21 |
| 18 | 宝盈基金管理有限公司关于新增上海陆享基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-08-17 |
| 19 | 宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-07-21 |
| 20 | 宝盈基金管理有限公司旗下 59 只基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报 | 2023-07-21 |
| 21 | 宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-04-21 |
| 22 | 宝盈基金管理有限公司旗下 59 只基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报 | 2023-04-21 |
| 23 | 宝盈基金管理有限公司关于新增中欧财富为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露 | 2023-04-21 |

| | | | |
|----|---|---|------------|
| | | 网站 | |
| 24 | 宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-03-30 |
| 25 | 宝盈基金管理有限公司旗下 56 只基金 2022 年年度报告提示性公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报 | 2023-03-30 |
| 26 | 宝盈基金管理有限公司关于新增华夏财富为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-03-03 |
| 27 | 宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站 | 2023-01-20 |
| 28 | 宝盈基金管理有限公司旗下 57 只基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告 | 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报 | 2023-01-20 |

§ 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|----------------|-------------------------|-------------------|------|-------------------|------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |
| 机构 | 1 | 20230310-20230530 | 52,529.00 2.60 | - | 52,529.00 2.60 | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况, 在极端情况下可能存在流动性等风险, 敬请投资人留意。 | | | | | | | |

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期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

中国证监会批准鸿阳证券投资基金设立的文件。

《鸿阳证券投资基金基金合同》。

《鸿阳证券投资基金托管协议》。

中国证监会准予鸿阳证券投资基金变更注册的文件；

《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈消费主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

法律意见书。

基金管理人业务资格批件、营业执照。

基金托管人业务资格批件、营业执照。

中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

基金管理人办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

基金托管人办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

13.3 查阅方式

上述备查文件文本分别存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日