

东方红均衡优选两年定期开放混合型证券  
投资基金  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2024 年 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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 .....	12
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 .....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
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 .....	16
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	16
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 .....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	16
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	16
6.2 审计报告的基本内容 .....	17
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表 .....	19
7.2 利润表 .....	20
7.3 净资产变动表 .....	21
7.4 报表附注 .....	23
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>63</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	63
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	63

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 .....	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	69
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 .....	69
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 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	70
8.12 投资组合报告附注 .....	70
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>72</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	72
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	72
9.4 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 .....	72
9.5 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 .....	72
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>72</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>73</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	73
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 .....	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	73
11.4 基金投资策略的改变 .....	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	73
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 .....	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	73
11.8 其他重大事件 .....	74
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>76</b>
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 .....	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	76
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>76</b>
13.1 备查文件目录 .....	76
13.2 存放地点 .....	76
13.3 查阅方式 .....	76

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金
基金简称	东方红均衡优选定开混合
场内简称	东证均衡
基金主代码	169108
基金运作方式	契约型，定期开放式，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式
基金合同生效日	2020年3月13日
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	722,821,346.87份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金主要投资于固定收益类资产，本基金的投资策略将结合基金每两年开放一次，在封闭期封闭运作，在开放期内有大规模申购赎回的流动性需求的特点，做好流动性管理，在临近开放期和开放期内，更多的关注组合资产的流动性；在封闭期内，充分发挥封闭运作的优势，做一些长久期匹配。</p> <p>基于本基金每满两年开放一次，除开放期外封闭运作的特点，基金管理人在临近开放期和开放期内将重点关注基金资产的流动性和变现能力，分散投资，做好流动性管理以应对开放期投资者的赎回需求。</p>
业绩比较基准	中债综合指数收益率*80%+沪深300指数收益率*15%+恒生指数收益率*5%
风险收益特征	<p>本基金是一只混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金除了投资A股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

### 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	上海东方证券资产管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露 姓名	周陶	石立平

负责人	联系电话	021-53950806	010-63639180
	电子邮箱	service@dfham.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4009200808	95595
传真		021-63326381	010-63639132
注册地址		上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址		上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层-11 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		200010	100033
法定代表人		杨斌	王江

## 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.dfham.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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	21,297,373.19	-32,278,020.65	185,235,077.46
本期利润	14,193,227.32	-24,113,653.36	82,102,945.94
加权平均基金份额本期利润	0.0196	-0.0249	0.0414
本期加权平均净值利润率	1.92%	-2.42%	3.71%
本期基金份额净值增长率	1.95%	-0.31%	3.76%

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	4,078,366.26	-17,219,006.93	227,097,059.17
期末可供分配基金份额利润	0.0056	-0.0238	0.1146
期末基金资产净值	739,105,268.02	724,912,040.70	2,208,569,730.05
期末基金份额净值	1.0225	1.0029	1.1146
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	18.44%	16.17%	16.53%

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）。

### 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	-0.42%	0.24%	-0.60%	0.17%	0.18%	0.07%
过去六个月	-0.41%	0.24%	-1.44%	0.18%	1.03%	0.06%
过去一年	1.95%	0.25%	-0.71%	0.18%	2.66%	0.07%
过去三年	5.45%	0.26%	-3.88%	0.23%	9.33%	0.03%
自基金合同生效起至今	18.44%	0.28%	-0.35%	0.23%	18.79%	0.05%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率\*80%+沪深 300 指数收益率\*15%+恒生指数收益率\*5%

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，t 日收益率（benchmarkt）按下列公式

计算：

$$\text{benchmark}_t = 80\% \times [\text{t 日中债综合指数} / (\text{t-1 日中债综合指数}) - 1] + 15\% \times [\text{t 日沪深 300 指数} / (\text{t-1 日沪深 300 指数}) - 1] + 5\% \times [\text{t 日恒生指数} / (\text{t-1 日恒生指数}) - 1]$$

其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截至日；

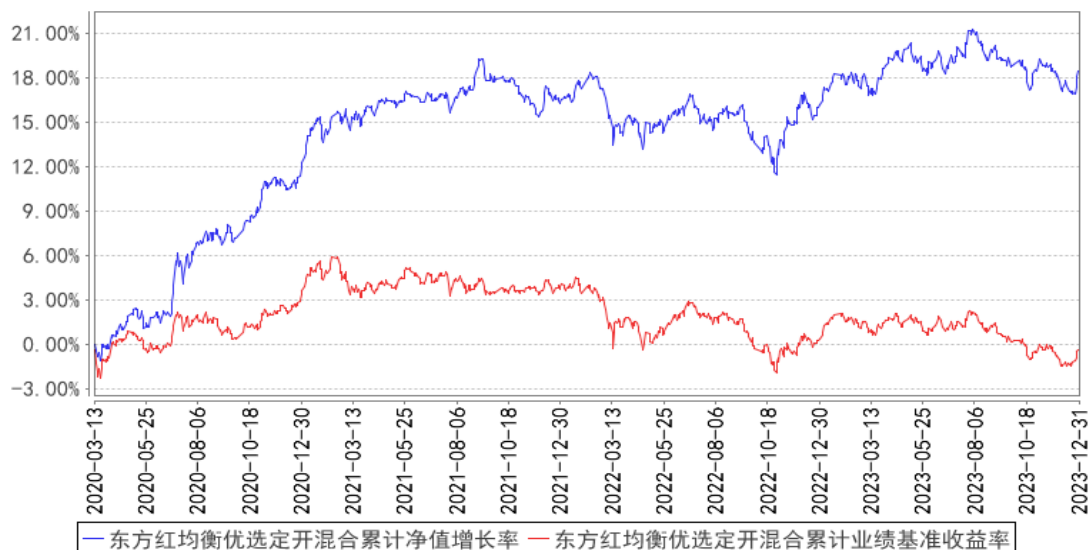
期间  $T$  日收益率（ $\text{benchmark}_T$ ）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$  表示  $t$  日至  $T$  日的  $(1 + \text{benchmark}_t)$  数学连乘。

### 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

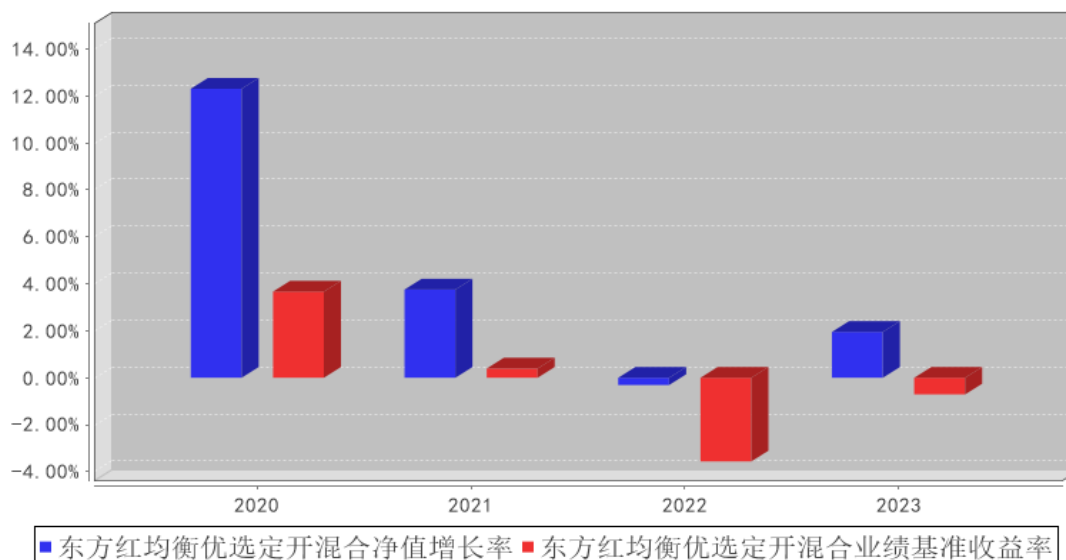
东方红均衡优选定开混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





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

东方红均衡优选定开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：本基金合同生效日期为 2020 年 03 月 13 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	1.1000	193,019,016.31	24,942,974.77	217,961,991.08	-
2021 年	0.5000	93,234,889.38	5,584,760.00	98,819,649.38	-
合计	1.6000	286,253,905.69	30,527,734.77	316,781,640.46	-

## § 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

本基金管理人上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金、

东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红启元三年持有期混合型证券投资基金、东方红聚利债券型证券投资基金、东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫裕两年定期开放信用债债券型证券投资基金、东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红恒阳五年定期开放混合型证券投资基金、东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红启东三年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和积极养老目标五年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红益丰纯债债券型证券投资基金、东方红智远三年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红明鉴优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红鑫安 39 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红招盈甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红启航三年持有期混合型证券投资基金、东方红多元策略混合型证券投资基金、东方红锦丰优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红远见价值混合型证券投资基金、东方

红启瑞三年持有期混合型证券投资基金、东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红启阳三年持有期混合型证券投资基金、东方红创新趋势混合型证券投资基金、东方红启华三年持有期混合型证券投资基金、东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金、东方红启盛三年持有期混合型证券投资基金、东方红启程三年持有期混合型证券投资基金、东方红新海混合型证券投资基金、东方红新源三年持有期混合型证券投资基金、东方红内需增长混合型证券投资基金、东方红安盈甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红锦和甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红智华三年持有期混合型证券投资基金、东方红启兴三年持有期混合型证券投资基金、东方红智选三年持有期混合型证券投资基金、东方红睿和三年定期开放混合型证券投资基金、东方红中证东方红利低波动指数证券投资基金、东方红锦弘甄选两年持有期混合型证券投资基金、东方红 ESG 可持续投资混合型证券投资基金、东方红锦融甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红医疗升级股票型发起式证券投资基金、东方红招瑞甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红短债债券型证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红民享甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、东方红中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、东方红锦惠甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红共赢甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红先进制造混合型证券投资基金、东方红颐安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红 30 天滚动持有纯债债券型证券投资基金、东方红欣和积极配置 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红 6 个月持有期债券型证券投资基金、东方红中证东方红优势成长指数发起式证券投资基金、东方红远见领航混合型发起式证券投资基金、东方红 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方红季鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金、东方红 90 天持有期纯债债券型证券投资基金、东方红中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金、东方红 60 天持有期纯债债券型证券投资基金，共计 101 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王佳骏	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2020 年 3 月 13 日	-	8 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2019 年 08 月至今任东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2020 年 01 月至今任东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2020 年 02 月至今任东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金基金

					经理、2020 年 03 月至今任东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2020 年 07 月至今任 东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2021 年 05 月至今任东方红锦和甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金基金经理、2022 年 03 月至今任东方红锦融甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金基金经理、2023 年 01 月至今任东方红锦惠甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金 基金经理。帝国理工学院金融学硕士。曾任国信证券股份有限公司助理分析师,上海东方证券资产管理有限公司投资支持高级经理。具备证券投资基金从业资格。
陈觉平	曾任本基金基金经理	2020 年 3 月 13 日	2023 年 12 月 23 日	-	-

注：1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指基金合同生效日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对此后非首任基金经理，基金经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会的相关规定。

#### 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

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 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，上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规关于公平交易的规定，公司建立了与公平交易相关的控制制度、流程以及信息披露程序等，保证公司在投资管理活动中公平对待各投资组合，防范不同投资组合之间进行利益输

送，并定期对同向交易、反向交易和异常交易行为进行监控和分析。交易部使用恒生交易系统内的公平交易模块进行交易执行和分配，风险管理部对公司各投资组合及组合之间的交易行为进行事后分析，校验公平交易执行情况。对于同向交易，风险管理部侧重于对公司管理的不同产品（包含了公募产品、私募产品）的整体收益率差异、投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内交易所竞价交易的所有交易记录，在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）的同向交易价差按两两组合进行显著性检验，并根据显著性检验结果，对符合异常交易筛选条件并超过规定阈值的交易记录，通过逐笔检查或抽样分析的方法，分析相应交易行为的公平性。对于反向交易，原则上禁止组合间的日内反向交易，完全按照有关指数构成比例进行投资的投资组合除外。如有投资策略或流动性等特殊需要的，需由投资经理提供投资依据，经投资决策委员会审慎审批后留档备查。报告期内未发现公司管理的投资组合间存在违反公平交易原则的交易行为。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

##### 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

本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

#### 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

债券方面，2023 年 10 年期国债收益率除了在 1 月份和 9、10 月份有过小幅上行外，全年呈现下行态势，从年初的 2.83%下行至年末的 2.55%附近，从曲线形态来看，呈现出两端走平，一方面超长债下行幅度更大，30 年国债全年下行超过 35BP，30 年-10 年的利差从年初的 37BP 下行至年末的 27BP 附近；另一方面短端债券受资金面阶段紧张的影响，下行幅度有限，1 年期国债全年仅下行不到 2BP，10 年-1 年的利差从年初的 70BP 压缩至年末的 50BP 以下。报告期内，组合全年配置以高等级信用债为主；在杠杆方面，组合在 1 季度和 10 月初均下降了杠杆水平，在 2 季度阶

段性适度增加杠杆，较为有效地避免了资金面波动；在久期方面，考虑到绝对利率水平处于较低位置，同时部分高分红股票的收益率更具吸引力，组合全年久期整体维持在中性偏下水平，仅阶段性地在 2 季度初略微增加了组合久期。

股票方面，2023 年 A 股呈现先扬后抑的走势，1 季度在宏观复苏、AI 产业热点涌现等环境下，A 股和港股表现较好，沪深 300 和恒生指数分别上涨 4.63%和 3.13%，随后随着经济数据边际走弱，市场持续回调，全年来看，沪深 300 下跌 11.4%，恒生指数下跌 13.8%。从结构来看，受益于 AI 的 TMT 和高分红占比较高的石油、煤炭、家电等行业涨幅居前，消费、地产、新能源等板块表现疲软。报告期内，组合的权益仓位变化不大，始终维持在产品定位的偏高区间，特别是在下半年，考虑到宏观政策边际转向积极和一些优质公司的估值回调至极具吸引力的位置，组合权益仓位较上半年略有增加。结构上，组合整体配置思路变化不大，有所变化的是一方面组合在上半年减持了一些短期涨幅较大，估值有所上行，同时波动放大的板块，集中在通信运营商、建筑、TMT 等，同时在下半年考虑到房地产行业销售持续低于预期以及整个行业发展模式的转变，组合降低了地产相关板块的配置；另一方面组合在上半年增加了银行、消费医疗、储能相关板块的配置，在下半年增加了创新药的配置比例。

#### 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 1.0225 元，份额累计净值为 1.1825 元。本报告期基金份额净值增长率为 1.95%，同期业绩比较基准收益率为-0.71%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券方面，2024 年开年以来，10 年国债收益率继续下行至 2.4%左右的历史低位，并且 30 年-10 年的利差进一步压缩至 20BP 以下，反映出市场对长期经济走势的预期调整。展望未来一段时间，一方面无论是促进经济增速和物价回升还是配合财政政策，货币政策均有望维持宽松；另一方面，随着中央财政的加码发力，经济增长预期若有边际转向，当前较低的利率水平所带来波动风险的可能性也在提升。因此，在投资策略上，组合将继续以高等级信用债为主要配置，保持较低杠杆和中性偏低的久期水平，同时密切关注未来经济基本面、货币流动性以及宏观政策的边际变化，适时调整组合久期和杠杆水平。

股票方面，2024 年年初以来权益市场已经历较大波动，目前大盘再度回到了 2023 年 12 月底的位置。站在当下，当前位置的权益市场具有较高的配置价值。从经济增长来看，虽然地产的新房销售仍然低迷，但是二手房销售已有明显复苏，同时工业企业的库存处在低位，随着宽松的货币政策和积极的财政政策逐渐发力，经济和物价有望延续复苏。从市场估值来看，虽然节后市场有所反弹，但很多优质公司的估值仍然处于极具性价比的位置。在投资策略上，组合仍将维持较

高的权益仓位水平，同时根据未来一段时间的宏观状态和资产估值水平来动态调整权益仓位；在结构上，组合将继续维持当前的配置结构，同时继续践行价值投资理念，围绕幸运的行业、优质的公司、合理的估值三个维度来精选个股，优化组合配置。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

在合规管理履职方面：（1）切实履行日常合规管理职责，包括合规审查、合规宣导、合规培训、合规报告、合规咨询、合规检查/稽核、监管沟通与配合；（2）强化落实员工执业行为管理，包括加强员工投资申报督导工作，对新任投资人员进行上岗前合规谈话，进一步完善即时通讯工具管控，进一步加强合规监测工作；（3）切实履行反洗钱管理职责；（4）稳步跟进各类法律事务；（5）深入开展合规专题研究。

在风险管理履职方面：（1）切实履行日常风险管理职责，做到事前、事中、事后风险管理，按时完成内外部各类定期风控报告及数据报送，并对公司风控指标进行持续监测；（2）结合监管要求和市场环境变化，继续加强投资内控体系建设；（3）持之以恒加强风控系统建设，保障产品及业务稳定运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

本基金管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性，对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。为了保障基金能真实、准确地反映投资品种的公允价值，本基金管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系，估值委员会成员的任命和调整由总经理办公会审议决定。运营部是估值委员会的日常办事机构。本基金管理人估值委员和估值人员均具有专业胜任能力和相关工作经验。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

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

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金 2023 年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 26175 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	东方红均衡优选两年定期开放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>我们审计了东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“东方红均衡优选定开混合基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了东方红均衡优选定开混合基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于东方红均衡优选定开混合基金,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	<p>东方红均衡优选定开混合基金的基金管理人上海东方证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括东方红均衡优选定开混合基金 2023 年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。</p> <p>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。</p> <p>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。基于我们已经执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,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>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>东方红均衡优选定开混合基金的基金管理人上海东方证券资产管理有限公司(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东方红均衡</p>



## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东方红均衡优选两年定期开放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
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	670,013.88	3,414,053.53
结算备付金		22,848,907.81	16,420,975.48
存出保证金		84,784.27	261,513.37
交易性金融资产	7.4.7.2	890,762,499.30	865,284,268.60
其中：股票投资		198,024,602.36	201,353,901.46
基金投资		-	-
债券投资		692,737,896.94	663,930,367.14
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		148,553.44	487,091.30
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		914,514,758.70	885,867,902.28
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		173,483,118.01	159,657,259.70
应付清算款		1,059,995.40	386,027.97
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		498,014.55	492,193.83
应付托管费		124,503.63	123,048.45
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		28,183.15	30,439.62
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	215,675.94	266,892.01
负债合计		175,409,490.68	160,955,861.58
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	722,821,346.87	722,821,346.87
未分配利润	7.4.7.12	16,283,921.15	2,090,693.83
净资产合计		739,105,268.02	724,912,040.70
负债和净资产总计		914,514,758.70	885,867,902.28

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0225 元，基金份额总额 722,821,346.87 份。

## 7.2 利润表

会计主体：东方红均衡优选两年定期开放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
<b>一、营业总收入</b>		27,819,953.87	-10,192,401.28
1. 利息收入		412,480.84	2,889,514.08
其中：存款利息收入	7.4.7.13	412,480.84	576,938.17
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		-	2,312,575.91
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		34,511,618.90	-21,345,136.53
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-326,437.10	-7,392,989.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	30,380,665.94	-18,545,028.10
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
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	4,457,390.06	4,592,881.34
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
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	-7,104,145.87	8,164,367.29
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	-	98,853.88
<b>减：二、营业总支出</b>		13,626,726.55	13,921,252.08
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,927,308.42	8,126,494.39
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,481,827.19	2,031,623.64
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		5,930,688.19	3,428,735.88
其中：卖出回购金融资产支出		5,930,688.19	3,428,735.88
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		58,003.08	74,764.30
8. 其他费用	7.4.7.23	228,899.67	259,633.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		14,193,227.32	-24,113,653.36
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		14,193,227.32	-24,113,653.36
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		14,193,227.32	-24,113,653.36

### 7.3 净资产变动表

会计主体：东方红均衡优选两年定期开放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	722,821,346.87	2,090,693.83	724,912,040.70
二、本期期初净资产	722,821,346.87	2,090,693.83	724,912,040.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	14,193,227.32	14,193,227.32

列)			
(一)、综合收益总额	-	14,193,227.32	14,193,227.32
(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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	722,821,346.87	16,283,921.15	739,105,268.02
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	1,981,472,670.88	227,097,059.17	2,208,569,730.05
二、本期期初净资产	1,981,472,670.88	227,097,059.17	2,208,569,730.05
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-1,258,651,324.01	-225,006,365.34	-1,483,657,689.35
(一)、综合收益总额	-	-24,113,653.36	-24,113,653.36
(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)	-1,258,651,324.01	17,069,279.10	-1,241,582,044.91
其中:1.基金申购款	48,069,584.28	145,847.08	48,215,431.36
2.基金赎回款	-1,306,720,908.29	16,923,432.02	-1,289,797,476.27
(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)	-	-217,961,991.08	-217,961,991.08
四、本期期末净资产	722,821,346.87	2,090,693.83	724,912,040.70

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>张锋</u>	<u>汤琳</u>	<u>陈培</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

东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2944号《关于准予东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》核准,由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,975,864,420.80元。业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0185号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》于2020年3月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,976,392,846.04份基金份额,其中认购资金利息折合528,425.24份基金份额。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金的第一个封闭期的起始之日为基金合同生效日,结束之日为基金合同生效日所对应的第二年年度的对应日前的倒数第一个工作日。第二个封闭期的起始之日为第一个开放期结束之日次日,结束之日为第二个封闭期起始之日所对应的第二年年度的对应日前的倒数第一个工作日,依次类推。本基金自封闭期结束之后的第一个工作日起(即每个开放期首日为每个封闭期起始之日的第二年年度的对应日的对日,包括该工作日)进入开放期,期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期原则上不少于5个工作日且最长不超过20个工作日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票及存托凭证(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行的国家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债券、公开发行的次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债的纯债部分、可交换债、证券公司短期公司债券)、债券回购、银行存款(包括

协议存款、通知存款、定期存款等)、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货以及经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,本基金的基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资组合中股票资产(含存托凭证)投资比例为基金资产的 0%-30%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%);本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%;开放期每个交易日日终,在扣除股指期货和国债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投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期内,本基金不受上述 5%的限制,但每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率 $\times$ 80%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 15%+恒生指数收益率 $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人上海东方证券资产管理有限公司于 2024 年 3 月 28 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》、《东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。



### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

#### (1) 金融资产

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

#### 债务工具

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

#### 以摊余成本计量：

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

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

#### 权益工具

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

#### (2) 金融负债

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

#### (3) 衍生金融工具

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

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逐日确认。

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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

#### 7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的

交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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[2014]81号《财政部国家税务

总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	670,013.88	3,414,053.53
等于：本金	669,535.01	3,412,036.51
加：应计利息	478.87	2,017.02
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	670,013.88	3,414,053.53

##### 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	212,921,867.17	-	198,024,602.36	- 14,897,264.81	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	504,351,728.44	6,199,756.83	512,181,437.43	1,629,952.16
	银行间市场	176,724,013.28	2,613,959.51	180,556,459.51	1,218,486.72
	合计	681,075,741.72	8,813,716.34	692,737,896.94	2,848,438.88



资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	893,997,608.89	8,813,716.34	890,762,499.30	12,048,825.93	
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	205,984,681.44	-	201,353,901.46	-4,630,779.98	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	345,523,460.39	5,079,235.75	349,651,499.05	-951,197.09
	银行间市场	308,751,702.99	4,889,868.09	314,278,868.09	637,297.01
	合计	654,275,163.38	9,969,103.84	663,930,367.14	-313,900.08
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	860,259,844.82	9,969,103.84	865,284,268.60	-4,944,680.06	

#### 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

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

#### 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

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

##### 7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

##### 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	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	25,675.94	46,892.01
其中：交易所市场	23,528.94	44,627.31
银行间市场	2,147.00	2,264.70
应付利息	-	-
预提费用	190,000.00	220,000.00
合计	215,675.94	266,892.01

##### 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	722,821,346.87	722,821,346.87
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	722,821,346.87	722,821,346.87

##### 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

##### 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	-17,219,006.93	19,309,700.76	2,090,693.83
本期期初	-17,219,006.93	19,309,700.76	2,090,693.83
本期利润	21,297,373.19	-7,104,145.87	14,193,227.32

本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,078,366.26	12,205,554.89	16,283,921.15

#### 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	52,127.58	207,783.30
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	359,464.99	366,472.94
其他	888.27	2,681.93
合计	412,480.84	576,938.17

#### 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	-326,437.10	-7,392,989.77
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	-326,437.10	-7,392,989.77

##### 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	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	129,238,432.85	295,770,075.18
减：卖出股票成本总额	129,236,417.29	302,326,093.32
减：交易费用	328,452.66	836,971.63
买卖股票差价收入	-326,437.10	-7,392,989.77

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-证券出借差价收入。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 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	22,713,272.73	28,048,859.72
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	7,667,393.21	-46,593,887.82
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	30,380,665.94	-18,545,028.10

##### 7.4.7.15.2 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	637,505,211.22	2,646,560,232.35
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	615,435,555.76	2,644,192,411.31
减：应计利息总额	14,392,850.68	48,942,165.83
减：交易费用	9,411.57	19,543.03

买卖债券差价收入	7,667,393.21	-46,593,887.82
----------	--------------	----------------

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-赎回差价收入。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-赎回差价收入。

##### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-其他投资收益。

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	4,457,390.06	4,592,881.34
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	4,457,390.06	4,592,881.34

#### 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	-7,104,145.87	8,164,367.29
股票投资	-10,266,484.83	-34,575,742.31
债券投资	3,162,338.96	42,740,109.60
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	-7,104,145.87	8,164,367.29

#### 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	-	98,852.21
基金转换费收入	-	1.67
合计	-	98,853.88

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 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
----	--	---

审计费用	70,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
证券组合费	2,449.67	2,583.87
账户维护费	36,450.00	37,050.00
合计	228,899.67	259,633.87

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”）	基金管理人、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“光大银行”）	基金托管人、基金销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
上海东证期货有限公司（“东证期货”）	受东方证券控制的公司、基金销售机构

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 (%)
东方证券	151,346,704.74	61.54	91,402,202.37	19.63

###### 7.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	213,289,707.03	50.05	150,334,996.51	7.48

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

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	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
东方证券	36,999,257,000.00	69.87	6,945,200,000.00	15.51

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 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 (%)
东方证券	111,825.54	67.11	10,601.47	45.06
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 (%)
东方证券	66,811.03	19.57	20,521.30	45.98

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，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。

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	上年度可比期间 2022年1月1日至2022
----	-----------------------	---------------------------



	12 月 31 日	年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,927,308.42	8,126,494.39
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,500,758.50	3,430,210.96
应支付基金管理人的净管理费	3,426,549.92	4,696,283.43

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 的年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和销售机构对账确认的金额为准。

#### 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	1,481,827.19	2,031,623.64

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。

#### 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

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

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费

率的证券出借业务的情况。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 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

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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
光大银行	670,013.88	52,127.58	3,414,053.53	207,783.30

注：本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管，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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于东证期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按协议利率计息，存出保证金不计息。于2023年12月31日，本基金存放于东证期货的结算备付金余额（不含应计利息）为1,025.75元，存出保证金余额为0元（2022年12月31日：结算备付金1,010.30元，存出保证金余额0元）。于报告期内，本基金存放于东证期货的结算备付金利息收入为15.45元（2022年同期：8.58元）。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证	成功	受限	流	认购	期末	数量	期末	期末估值总	备注

代码	券名称	认购日	期	通受限类型	价格	估值单价	(单位:股)	成本总额	额	
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股锁定	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001326	联域股份	2023年11月1日	6个月	新股锁定	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	新股锁定	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股锁定	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股锁定	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股锁定	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301272	英华特	2023年7月6日	6个月	新股锁定	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新股锁定	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	新股锁定	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301362	民爆光	2023年7月27日	6个月	新股锁	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-

	电	日		定						
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股锁定	55.68	37.58	489	27,227.52	18,376.62	-
301372	科净源	2023年8月3日	6个月	新股锁定	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股锁定	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股锁定	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	新股锁定	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	新股锁定	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
301469	恒达新材	2023年8月10日	6个月	新股锁定	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301488	豪恩光电	2023年6月26日	6个月	新股锁定	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	新股锁定	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301499	维科精	2023年7月13日	6个月	新股锁	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-

	密	日		定						
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股锁定	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股锁定	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	新股锁定	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-
301511	德福科技	2023年8月8日	6个月	新股锁定	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-
301515	港通医疗	2023年7月13日	6个月	新股锁定	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股锁定	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股锁定	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股锁定	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股锁定	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股锁定	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301526	国际复	2023年12月19日	6个月	新股锁	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-

	材	日		定						
301528	多浦乐	2023年8月17日	6个月	新股锁定	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股锁定	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	新股锁定	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	新股锁定	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股锁定	24.22	18.24	1,236	29,935.92	22,544.64	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股锁定	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股锁定	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	新股锁定	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	新股锁定	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股锁定	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	鼎龙科	2023年12月20日	6个月	新股锁	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-

	技	日		定							
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股锁定	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-	
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股锁定	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-	
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股锁定	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-	
603275	众辰科技	2023年8月16日	6个月	新股锁定	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-	
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股锁定	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-	
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股锁定	9.87	12.75	3,666	36,183.42	46,741.50	-	
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月	新股锁定	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-	
688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	新股锁定	78.99	60.49	660	52,133.40	39,923.40	-	
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-	
688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月	新股锁定	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-	
688602	康鹏科	2023年7月13日	6个月	新股锁	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-	

	技	日		定						
688610	埃科光电	2023年7月10日	6个月	新股锁定	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	新股锁定	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	新股锁定	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股锁定	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股锁定	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股锁定	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧兴物联	2023年8月2日	6个月	新股锁定	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新股锁定	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	新股锁定	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股锁定	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688717	艾罗能	2023年12月26日	6个月	新股未	55.66	55.66	11,303	629,124.98	629,124.98	-



	源	日		上市且锁定						
688717	艾罗能源	2023年12月26日	1个月内(含)	新股未上市	55.66	55.66	4,844	269,617.04	269,617.04	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股锁定	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股锁定	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
118046	诺泰转债	2023年12月18日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	330	33,000.00	33,002.46	-

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

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 173,483,118.01 元，于 2024 年 01 月 02 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责对合规管理和风险管理的总体目标、基本政策进行审议并提出意见；对合规管理和风险管理的机构设置及其职责进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见；对需董事会审议的合规报告和风险评估报告进行审议并提出意见等。在经营层面设立风险控制委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；根据董事会制定的风险管理原则制订相关风险控制政策，使公司整体业务发展战略与风险承受能力保持相当；督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，指导实施风险应对方案；审议公司投资授权有关的风险控制方案等。

##### 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行光大银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	10,052,673.97
A-1 以下	-	-
未评级	-	111,842,041.00
合计	-	121,894,714.97

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	49,800,996.85
合计	-	49,800,996.85

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	498,115,090.68	337,674,190.71
AAA 以下	30,363,016.66	41,597,049.69
未评级	164,259,789.60	112,963,414.92
合计	692,737,896.94	492,234,655.32

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日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于开放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，除卖出回购金融资产款余额中有 173,483,118.01 元将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 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》且于基金开放期内按照《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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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%。于开放期内，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，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

投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金和存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 3 年 12 月 31	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
---	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

日							
资产							
货币资金	670,013.88	-	-	-	-	-	670,013.88
结算备付金	22,848,907.81	-	-	-	-	-	22,848,907.81
存出保证金	84,784.27	-	-	-	-	-	84,784.27
交易性金融资产	-	51,089,600.00	111,846,103.98	430,326,171.43	99,476,021.53	198,024,602.36	890,762,499.30
应收清算款	-	-	-	-	-	148,553.44	148,553.44
资产总计	23,603,705.96	51,089,600.00	111,846,103.98	430,326,171.43	99,476,021.53	198,173,155.80	914,514,758.70
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	498,014.55	498,014.55
应付托	-	-	-	-	-	124,503.63	124,503.63

管费							
应付清算款	-	-	-	-	-	1,059,995.40	1,059,995.40
卖出回购金融资产款	173,483,118.01	-	-	-	-	-	173,483,118.01
应交税费	-	-	-	-	-	28,183.15	28,183.15
其他负债	-	-	-	-	-	215,675.94	215,675.94
负债总计	173,483,118.01	-	-	-	-	1,926,372.67	175,409,490.68
利率敏感度缺口	149,879,412.05	51,089,600.00	111,846,103.98	430,326,171.43	99,476,021.53	196,246,783.13	739,105,268.02
上年度末 2022年12月31	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

日							
资产							
货币资金	3,414,053.53	-	-	-	-	-	3,414,053.53
结算备付金	16,420,975.48	-	-	-	-	-	16,420,975.48
存出保证金	261,513.37	-	-	-	-	-	261,513.37
交易性金融资产	31,076,604.29	127,678,667.12	175,793,642.87	264,938,349.47	64,443,103.39	201,353,901.46	865,284,268.60
应收清算款	-	-	-	-	-	487,091.30	487,091.30
资产总计	51,173,146.67	127,678,667.12	175,793,642.87	264,938,349.47	64,443,103.39	201,840,992.76	885,867,902.28
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	492,193.83	492,193.83
应付托	-	-	-	-	-	123,048.45	123,048.45



管费							
应付清算款	-	-	-	-	-	386,027.97	386,027.97
卖出回购金融资产款	159,657,259.70	-	-	-	-	-	159,657,259.70
应交税费	-	-	-	-	-	30,439.62	30,439.62
其他负债	-	-	-	-	-	266,892.01	266,892.01
负债总计	159,657,259.70	-	-	-	-	1,298,601.88	160,955,861.58
利率敏感度缺口	108,484,113.03	127,678,667.12	175,793,642.87	264,938,349.47	64,443,103.39	200,542,390.88	724,912,040.70

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）

	日)	31 日 )
1. 市场利率下降 25 个基点	4,407,895.08	3,436,491.85
2. 市场利率上升 25 个基点	-4,334,240.70	-3,376,568.38

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	26,776,013.27	-	26,776,013.27
资产合计	-	26,776,013.27	-	26,776,013.27
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	26,776,013.27	-	26,776,013.27
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资 产	-	32,024,315.89	-	32,024,315.89
资产合计	-	32,024,315.89	-	32,024,315.89

以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	32,024,315.89	-	32,024,315.89

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外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、港币相对人民币升值5%	1,338,800.66	1,601,215.79
	2、港币相对人民币贬值5%	-1,338,800.66	-1,601,215.79

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行其他价格风险管理。

##### 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	198,024,602.36	26.79	201,353,901.46	27.78
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	198,024,602.36	26.79	201,353,901.46	27.78

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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. 沪深 300 指数上升 5%	9,286,545.92	11,202,205.54
2. 沪深 300 指数下降 5%	-9,286,545.92	-11,202,205.54	

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，股票市场指数（沪深 300）价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

#### 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	321,574,662.38	283,506,524.43
第二层次	568,302,784.95	579,933,927.02
第三层次	885,051.97	1,843,817.15

合计	890,762,499.30	865,284,268.60
----	----------------	----------------

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年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	-	1,843,817.15	1,843,817.15
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,243,947.98	2,243,947.98
转出第三层次	-	3,570,039.87	3,570,039.87
当期利得或损失总额	-	367,326.71	367,326.71
其中：计入损益的利得或损失	-	367,326.71	367,326.71
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	885,051.97	885,051.97
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	-	91,692.80	91,692.80
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	-	5,017,297.12	5,017,297.12

当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	3,280,263.79	3,280,263.79
转出第三层次	-	6,642,489.61	6,642,489.61
当期利得或损失总额	-	188,745.85	188,745.85
其中：计入损益的利得或损失	-	188,745.85	188,745.85
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,843,817.15	1,843,817.15
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	-	277,321.24	277,321.24

注：1. 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。

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

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	885,051.97	平均价格亚式期权模型	该流通受限股票在剩余限售期内的股价预期年化波动率	0.1855~2.1775	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	1,843,817.15	平均价格亚式期权模型	该流通受限股票在剩余限售期内的股价预期年化波动率	0.1891~2.4756	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	198,024,602.36	21.65
	其中：股票	198,024,602.36	21.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	692,737,896.94	75.75
	其中：债券	692,737,896.94	75.75
	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	23,518,921.69	2.57
8	其他各项资产	233,337.71	0.03
9	合计	914,514,758.70	100.00

注：1、本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 26,776,013.27 元人民币，占期末基金资产净值比例 3.62%。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	2,006,000.00	0.27
B	采矿业	2,945,544.00	0.40
C	制造业	109,649,548.58	14.84

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,438,740.00	0.87
E	建筑业	9,206,578.00	1.25
F	批发和零售业	5,856,578.00	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	13,981.41	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,225,215.85	0.44
J	金融业	28,170,139.50	3.81
K	房地产业	3,699,630.00	0.50
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	26,564.46	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	10,069.29	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	171,248,589.09	23.17

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	5,419,214.00	0.73
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	5,390,964.76	0.73
30 主要消费	-	-
35 医药卫生	2,903,108.35	0.39
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 通信服务	13,062,726.16	1.77
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	26,776,013.27	3.62

注：以上分类采用中证行业分类标准。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300122	智飞生物	200,000	12,222,000.00	1.65
2	002475	立讯精密	349,000	12,023,050.00	1.63
3	002493	荣盛石化	1,028,100	10,640,835.00	1.44



4	601186	中国铁建	1,209,800	9,206,578.00	1.25
5	601658	邮储银行	1,969,700	8,568,195.00	1.16
6	600887	伊利股份	314,056	8,400,998.00	1.14
7	00700	腾讯控股	29,232	7,777,647.16	1.05
8	601318	中国平安	171,500	6,911,450.00	0.94
9	600011	华能国际	836,200	6,438,740.00	0.87
10	00883	中国海洋石油	460,000	5,419,214.00	0.73
11	00941	中国移动	90,000	5,285,079.00	0.72
12	600426	华鲁恒升	180,000	4,966,200.00	0.67
13	02020	安踏体育	69,800	4,791,504.76	0.65
14	603939	益丰药房	118,000	4,724,720.00	0.64
15	603605	珀莱雅	45,972	4,569,616.80	0.62
16	600030	中信证券	214,600	4,371,402.00	0.59
17	002966	苏州银行	643,900	4,159,594.00	0.56
18	600048	保利发展	373,700	3,699,630.00	0.50
19	600276	恒瑞医药	70,500	3,188,715.00	0.43
20	301101	明月镜片	75,700	3,168,802.00	0.43
21	002078	太阳纸业	260,000	3,164,200.00	0.43
22	688301	奕瑞科技	9,363	3,045,409.38	0.41
23	300661	圣邦股份	33,340	2,967,593.40	0.40
24	601899	紫金矿业	236,400	2,945,544.00	0.40
25	002154	报喜鸟	491,600	2,792,288.00	0.38
26	002311	海大集团	60,000	2,694,600.00	0.36
27	601966	玲珑轮胎	140,000	2,692,200.00	0.36
28	688630	芯碁微装	30,539	2,607,114.43	0.35
29	300274	阳光电源	28,200	2,470,038.00	0.33
30	300033	同花顺	14,000	2,196,180.00	0.30
31	002916	深南电路	30,300	2,150,997.00	0.29
32	002436	兴森科技	140,000	2,062,200.00	0.28
33	300498	温氏股份	100,000	2,006,000.00	0.27
34	300750	宁德时代	12,140	1,981,976.40	0.27
35	601528	瑞丰银行	396,630	1,963,318.50	0.27
36	002832	比音勒芬	61,600	1,952,720.00	0.26
37	688111	金山办公	6,149	1,944,313.80	0.26
38	600183	生益科技	100,000	1,831,000.00	0.25
39	688187	时代电气	45,340	1,647,202.20	0.22
40	603290	斯达半导	8,900	1,610,900.00	0.22
41	688008	澜起科技	25,945	1,524,528.20	0.21
42	600176	中国巨石	150,000	1,474,500.00	0.20
43	688059	华锐精密	18,200	1,432,522.00	0.19
44	002557	洽洽食品	39,200	1,364,944.00	0.18
45	01801	信达生物	30,500	1,181,597.45	0.16
46	000963	华东医药	27,300	1,131,858.00	0.15

47	688273	麦澜德	31,756	1,057,792.36	0.14
48	002153	石基信息	104,000	1,012,960.00	0.14
49	688278	特宝生物	19,239	1,007,161.65	0.14
50	688443	智翔金泰	23,407	935,109.65	0.13
51	688717	艾罗能源	16,147	898,742.02	0.12
52	688800	瑞可达	21,000	843,780.00	0.11
53	06600	赛生药业	65,500	826,256.30	0.11
54	688076	诺泰生物	16,279	731,741.05	0.10
55	688050	爱博医疗	4,249	730,997.96	0.10
56	605555	德昌股份	30,500	696,925.00	0.09
57	688336	三生国健	30,532	687,275.32	0.09
58	09926	康方生物	16,000	672,777.60	0.09
59	002568	百润股份	24,900	612,789.00	0.08
60	01368	特步国际	150,000	599,460.00	0.08
61	688052	纳芯微	1,400	233,590.00	0.03
62	02162	康诺亚-B	5,000	222,477.00	0.03
63	688548	广钢气体	3,666	46,741.50	0.01
64	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.01
65	688563	航材股份	660	39,923.40	0.01
66	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
67	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
68	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
69	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
70	301559	中集环科	1,236	22,544.64	0.00
71	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
72	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
73	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
74	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
75	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
76	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
77	301371	敷尔佳	489	18,376.62	0.00
78	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
79	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
80	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
81	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
82	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
83	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
84	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
85	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
86	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
87	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
88	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
89	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00

90	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
91	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
92	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
93	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
94	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
95	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
96	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
97	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
98	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
99	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
100	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
101	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
102	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
103	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
104	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
105	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
106	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
107	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
108	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
109	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
110	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
111	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
112	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
113	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
114	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
115	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
116	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
117	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
118	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
119	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
120	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
121	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
122	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
123	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
124	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
125	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
126	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
127	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
128	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00

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

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601900	南方传媒	20,108,235.53	2.77
2	00883	中国海洋石油	5,655,187.31	0.78
3	002493	荣盛石化	5,529,167.00	0.76
4	300122	智飞生物	4,797,851.50	0.66
5	600011	华能国际	3,343,015.00	0.46
6	600276	恒瑞医药	3,184,603.40	0.44
7	603939	益丰药房	3,142,289.00	0.43
8	00700	腾讯控股	2,964,208.18	0.41
9	300274	阳光电源	2,918,183.00	0.40
10	300750	宁德时代	2,917,841.00	0.40
11	600325	华发股份	2,910,210.00	0.40
12	09922	九毛九	2,824,626.64	0.39
13	300033	同花顺	2,768,164.00	0.38
14	603605	珀莱雅	2,616,293.00	0.36
15	601528	瑞丰银行	2,224,179.00	0.31
16	002966	苏州银行	2,200,960.00	0.30
17	601186	中国铁建	2,196,315.00	0.30
18	002154	报喜鸟	2,079,199.00	0.29
19	688630	芯碁微装	1,981,312.10	0.27
20	688301	奕瑞科技	1,868,960.35	0.26

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

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601900	南方传媒	20,352,792.14	2.81
2	000002	万科 A	7,176,144.00	0.99
3	600938	中国海油	6,176,586.25	0.85
3	00883	中国海洋石油	182,701.20	0.03
4	03690	美团-W	5,727,071.55	0.79
5	00941	中国移动	5,616,672.98	0.77
6	002142	宁波银行	5,383,850.50	0.74
7	002807	江阴银行	2,795,000.00	0.39
8	002223	鱼跃医疗	2,701,762.00	0.37

9	600030	中信证券	2,197,623.93	0.30
10	600325	华发股份	2,192,671.00	0.30
11	300760	迈瑞医疗	2,035,534.61	0.28
12	600176	中国巨石	2,009,045.94	0.28
13	00700	腾讯控股	1,937,289.00	0.27
14	09922	九毛九	1,908,875.37	0.26
15	002153	石基信息	1,772,335.56	0.24
16	600426	华鲁恒升	1,523,533.50	0.21
17	01368	特步国际	1,503,561.96	0.21
18	601398	工商银行	1,502,832.00	0.21
19	600900	长江电力	1,492,863.00	0.21
20	300033	同花顺	1,460,426.00	0.20

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

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	136,173,603.02
卖出股票收入（成交）总额	129,238,432.85

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	40,350,205.53	5.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	124,549,647.78	16.85
	其中：政策性金融债	53,263,961.75	7.21
4	企业债券	305,305,700.27	41.31
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	97,165,486.89	13.15
7	可转债（可交换债）	125,366,856.47	16.96
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	692,737,896.94	93.73

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	210210	21 国开 10	500,000	53,263,961.75	7.21

2	148012	22 深投 05	400,000	40,338,169.86	5.46
3	110059	浦发转债	340,000	36,606,402.74	4.95
4	102000529	20 京国资 MTN003	300,000	31,012,859.02	4.20
5	149406	21 盐港 01	300,000	30,723,698.63	4.16

### 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

注：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

注：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

注：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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益。

### 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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末进行国债期货投资。

### 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本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 8.12.2 基金投资的前十名股票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未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	84,784.27

2	应收清算款	148,553.44
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	233,337.71

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110059	浦发转债	36,606,402.74	4.95
2	113042	上银转债	29,729,995.89	4.02
3	113065	齐鲁转债	16,054,229.04	2.17
4	113052	兴业转债	15,286,643.84	2.07
5	113021	中信转债	11,225,515.07	1.52
6	123178	花园转债	1,703,368.77	0.23
7	113606	荣泰转债	1,656,256.85	0.22
8	123132	回盛转债	1,219,493.08	0.16
9	127083	山路转债	1,042,840.55	0.14
10	123133	佩蒂转债	1,021,157.26	0.14
11	123113	仙乐转债	756,723.01	0.10
12	118013	道通转债	725,105.18	0.10
13	123190	道氏转 02	723,078.14	0.10
14	128119	龙大转债	567,127.40	0.08
15	128142	新乳转债	546,030.14	0.07
16	123064	万孚转债	532,421.26	0.07
17	127016	鲁泰转债	447,121.28	0.06
18	127024	盈峰转债	427,002.74	0.06
19	113609	永安转债	355,364.79	0.05
20	127073	天赐转债	350,998.77	0.05
21	123107	温氏转债	316,448.29	0.04
22	113650	博 22 转债	315,724.93	0.04
23	123157	科蓝转债	314,996.78	0.04
24	110093	神马转债	288,493.90	0.04
25	123115	捷捷转债	270,959.25	0.04
26	113045	环旭转债	227,256.93	0.03
27	110064	建工转债	221,928.33	0.03
28	111001	山玻转债	221,676.71	0.03
29	118032	建龙转债	213,513.21	0.03
30	118035	国力转债	185,255.22	0.03
31	123184	天阳转债	179,785.11	0.02
32	118034	晶能转债	154,428.33	0.02

33	113667	春 23 转债	132,630.68	0.02
34	110085	通 22 转债	108,422.66	0.01

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

### 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，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
6,387	113,170.71	200,015.00	0.03	722,621,331.87	99.97

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

注：本基金本报告期末未上市交易。

### 9.3 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	37,418.44	0.01

### 9.4 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

### 9.5 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

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2020 年 3 月 13 日) 基金份额总额	1,976,392,846.04
-------------------------------------	------------------



本报告期期初基金份额总额	722,821,346.87
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	722,821,346.87

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内没有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

报告期内，杨海同志自 2023 年 7 月 7 日起担任管理人副总经理。

本报告期内，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

报告期内未发生基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自本基金基金合同生效日（2020 年）起为本基金提供审计服务至今。本基金本报告期应支付给该事务所审计报酬为 70,000.00 元人民币。

### 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

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

东方证券	3	151,346,704.74	61.54	111,825.54	67.11	-
光大证券	1	62,789,635.46	25.53	31,624.00	18.98	-
申万宏源	1	19,015,704.85	7.73	13,716.14	8.23	-
海通证券	2	12,775,242.62	5.19	9,472.75	5.68	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准

券商财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行为；具有较强的研究服务能力；交易佣金收费合理。

(2) 选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、本基金本报告期租用券商交易单元无变更。

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 (%)
东方证券	213,289,707.03	50.05	36,999,257,000.00	69.87	-	-
光大证券	145,443,888.12	34.13	6,757,650,000.00	12.76	-	-
申万宏源	46,398,967.54	10.89	1,694,400,000.00	3.20	-	-
海通证券	21,001,471.34	4.93	7,504,010,000.00	14.17	-	-

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	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2023 年非港股通交	中国证监会规定媒介	2023 年 1 月 4 日

	易日暂停申购、赎回等业务的公告		
2	东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 1 月 20 日
3	东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 3 日
4	东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金招募说明书（2023 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 3 日
5	东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 31 日
6	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金新增 2023 年港股通交易日后调整申购、赎回等业务安排的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 4 日
7	东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 21 日
8	上海东方证券资产管理有限公司关于部分基金增加代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 6 月 12 日
9	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海攀赢基金销售有限公司为代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 6 月 20 日
10	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日开放安排的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 7 月 17 日
11	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富基金销售有限公司为代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 7 月 20 日
12	东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 7 月 21 日
13	东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会规定媒介	2023 年 8 月 31 日
14	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日开放安排的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 9 月 1 日
15	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日开放安排的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 9 月 8 日

16	东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 10 月 25 日
17	关于东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 12 月 23 日
18	东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金招募说明书（2023 年第 2 号）	中国证监会规定媒介	2023 年 12 月 25 日
19	东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2023 年 12 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

注：本基金本报告期内未发生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

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：  
www.dfham.com。

上海东方证券资产管理有限公司

2024 年 3 月 29 日