

国泰融安多策略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：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年三月二十九日

§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。

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

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

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

为更好地满足广大投资者的投资理财需求，降低投资者的理财成本，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，本基金管理人决定自 2023 年 7 月 24 日起，调低本基金的管理费率并对基金合同有关条款进行修订。具体可查阅本基金管理人于 2023 年 7 月 22 日发布的《国泰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》。

本报告的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

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

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	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	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§6 审计报告	17
6.1 审计意见	17
6.2 形成审计意见的基础	18
6.3 管理层对财务报表的责任	18
6.4 注册会计师的责任	18
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	57
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	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
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名的前五名权证投资明细	70
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	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
§9	基金份额持有人信息	71
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
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的情况	72
§10	开放式基金份额变动	72
§11	重大事件揭示	73
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	75
§12	影响投资者决策的其他重要信息	76
§13	备查文件目录	76
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	国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	国泰融安多策略灵活配置混合	
基金主代码	003516	
交易代码	003516	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 7 月 3 日	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	258,186,425.96 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰融安多策略灵活配置 混合 A	国泰融安多策略灵活配置 混合 C
下属分级基金的交易代码	003516	014960
报告期末下属分级基金的份额总额	254,492,436.61 份	3,693,989.35 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将灵活运用多种投资策略，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、债券投资策略；5、中小企业私募债投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、权证投资策略；8、股指期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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		国泰基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘国华	许俊
	联系电话	021-31081600转	010-66596688
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		(021)31089000, 400-888-8688	95566
传真		021-31081800	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦15-20层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200082	100818
法定代表人		邱军	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金年度报告备置地点	上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦15-20层及基金托管人住所或办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
注册登记机构	国泰基金管理有限公司	上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦15层-20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	
	国泰融安多 策略灵活配 置混合 A	国泰融安多 策略灵活配 置混合 C	国泰融安多 策略灵活配 置混合 A	国泰融安多 策略灵活配 置混合 C	国泰融安多 策略灵活配 置混合 A	国泰融安多策 略灵活配置混 合 C
本期已 实现收 益	-50,624,852 .59	-10,062,824 .01	-328,551,069. 10	-375,116.00	327,667,644. 28	-
本期利 润	-76,435,595 .02	-16,543,068 .76	-422,803,859. 07	-1,339,939.59	145,960,224. 00	-
加权平 均基金 份额本 期利润	-0.2526	-1.4935	-1.2523	-0.4388	0.3347	-
本期加 权平均 净值利 润率	-9.55%	-56.98%	-45.08%	-16.51%	9.74%	-
本期基 金份额 净值增 长率	-9.05%	-9.82%	-28.78%	-14.01%	12.24%	-
3.1.2 期末 数据和指 标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	国泰融安多策 略灵活配置混 合 A	国泰融安多策 略灵活配置混 合 C	国泰融安多策 略灵活配置混 合 A	国泰融安多策 略灵活配置混 合 C	国泰融安多策 略灵活配置混 合 A	国泰融安多策略 灵活配置混合 C
期末可	247,034,661	3,468,540.6	351,728,125.	6,695,532.75	895,235,010.	-

供分配利润	.23	4	26		74	
期末可供分配基金份额利润	0.9707	0.9390	1.1669	1.1545	2.0411	-
期末基金资产净值	596,345,449.46	8,541,592.07	776,616,780.06	14,871,107.26	1,586,619,718.46	-
期末基金份额净值	2.3433	2.3123	2.5765	2.5642	3.6175	-
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	国泰融安多策略灵活配置混合 A	国泰融安多策略灵活配置混合 C	国泰融安多策略灵活配置混合 A	国泰融安多策略灵活配置混合 C	国泰融安多策略灵活配置混合 A	国泰融安多策略灵活配置混合 C
基金份额累计净值增长率	134.33%	-22.46%	157.65%	-14.01%	261.75%	-

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

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

3.2 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

1. 国泰融安多策略灵活配置混合 A：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

		②		准差④		
过去三个月	-2.81%	0.85%	-2.88%	0.40%	0.07%	0.45%
过去六个月	-17.92%	0.96%	-4.44%	0.42%	-13.48%	0.54%
过去一年	-9.05%	1.01%	-3.41%	0.42%	-5.64%	0.59%
过去三年	-27.29%	1.38%	-12.38%	0.55%	-14.91%	0.83%
过去五年	155.65%	1.53%	21.05%	0.60%	134.60%	0.93%
自基金合同生效起至今	134.33%	1.51%	14.89%	0.60%	119.44%	0.91%

2. 国泰融安多策略灵活配置混合 C:

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	-2.96%	0.85%	-2.88%	0.40%	-0.08%	0.45%
过去六个月	-18.17%	0.96%	-4.44%	0.42%	-13.73%	0.54%
过去一年	-9.82%	1.01%	-3.41%	0.42%	-6.41%	0.59%
自新增 C 类份额起至今	-22.46%	1.13%	-9.36%	0.54%	-13.10%	0.59%

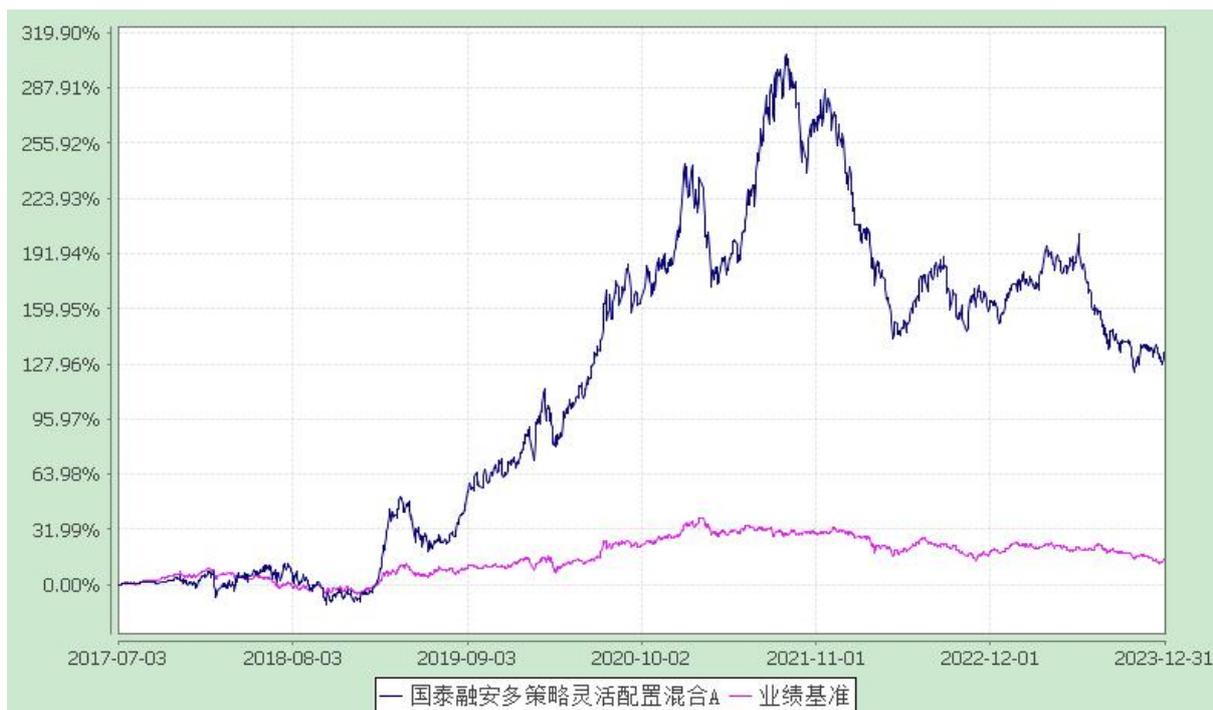
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

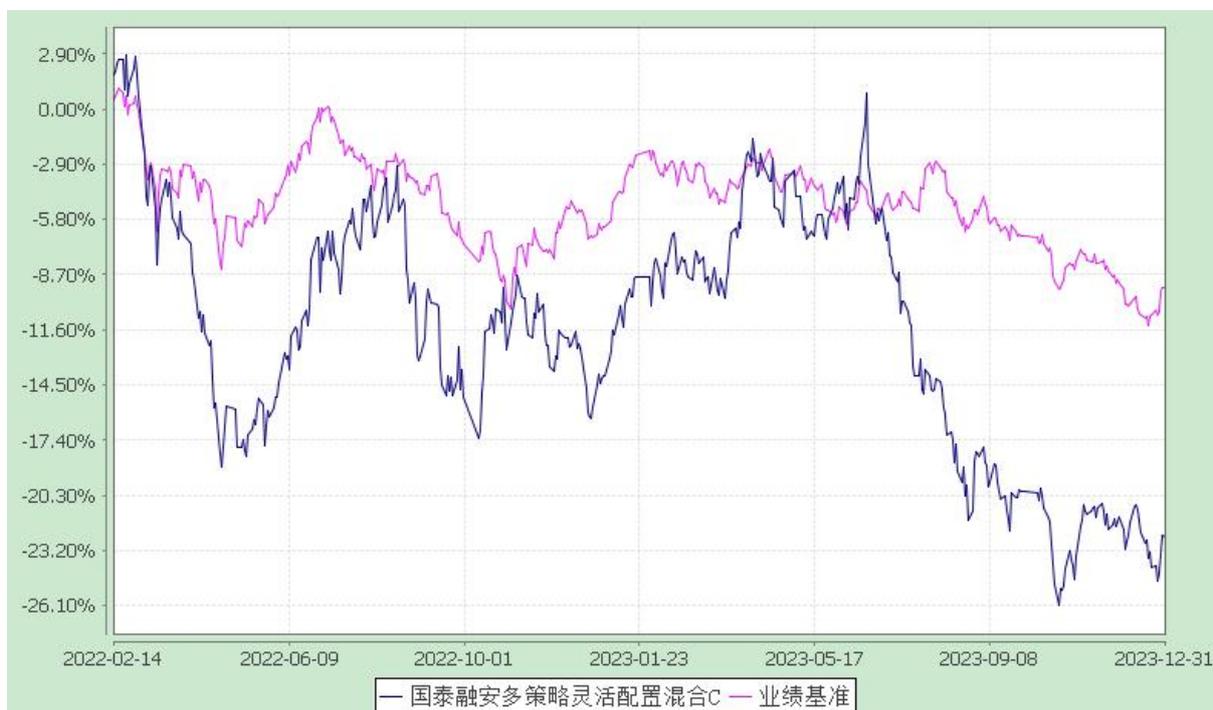
(2017 年 7 月 3 日至 2023 年 12 月 31 日)

1、国泰融安多策略灵活配置混合 A



注：本基金自2017年7月3日合同生效日起，在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

2、国泰融安多策略灵活配置混合 C

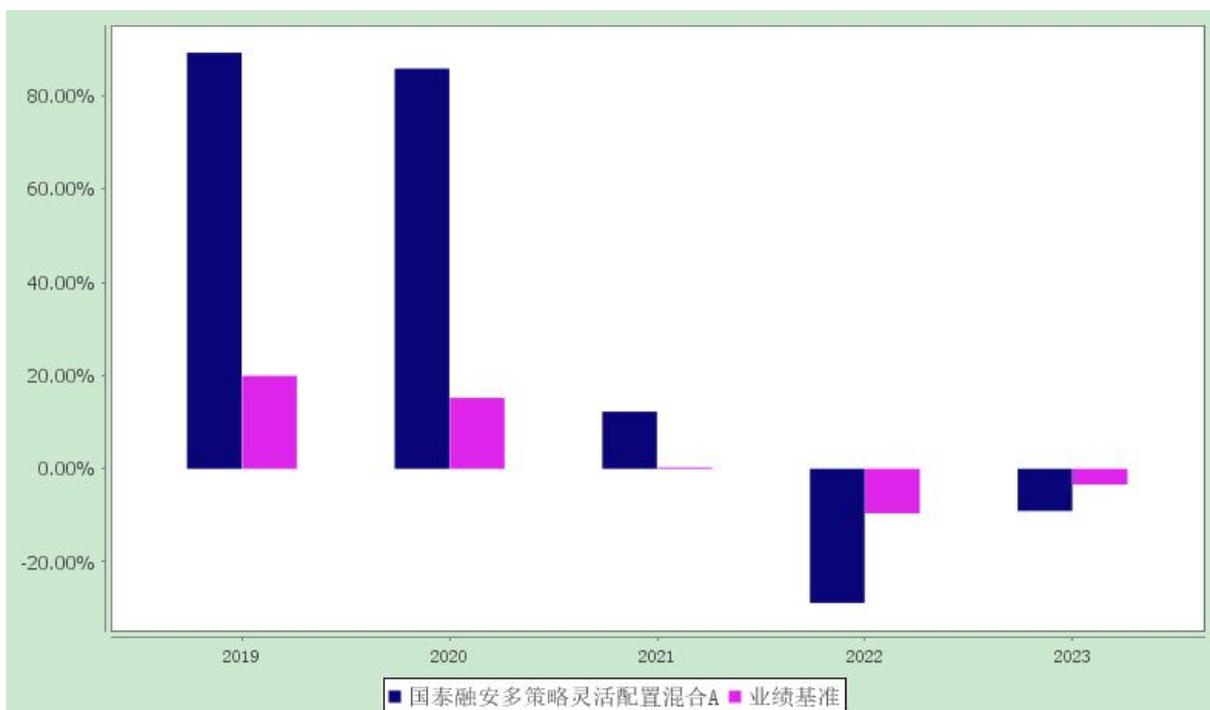


注：本基金自2017年7月3日合同生效日起，在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。自2022年2月14日起，本基金增加C类份额并分别设置对应的基金代码。

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

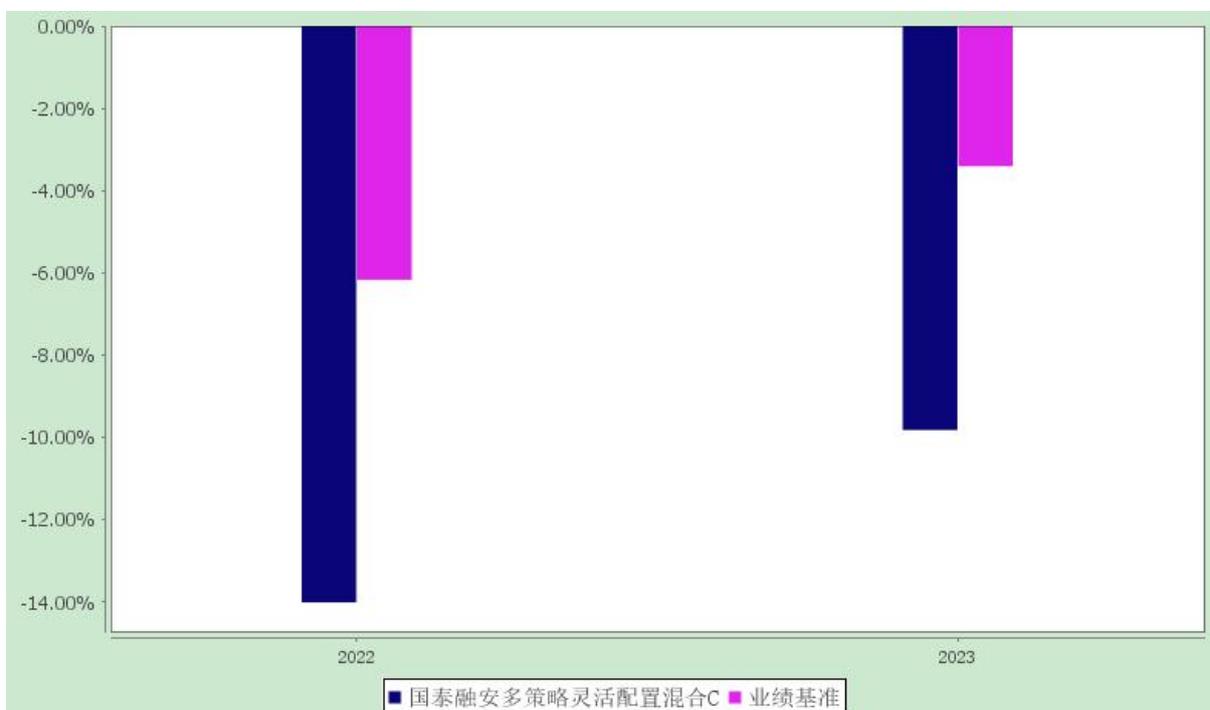
国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金
过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、国泰融安多策略灵活配置混合 A



注：基金的过往业绩不代表未来表现。

2、国泰融安多策略灵活配置混合 C



注：1、自 2022 年 2 月 14 日起，本基金增加 C 类份额并分别设置对应的基金代码。

2、2022 年计算期间为 2022 年 2 月 14 日至 2022 年 12 月 31 日，未按整个自然年度进行折算，

基金的过往业绩不代表未来表现。

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

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 260 只开放式证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
林小聪	国泰融安多策略灵活配置混合、国泰事件驱动混合、国泰景气优选混合的基金经理	2020-03-25	-	14 年	硕士研究生。2010 年 4 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2017 年 6 月起任国泰事件驱动策略混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 3 月起兼任国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 11 月起兼任国泰景气优选混合型证券投资基金的基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，制定了《公平交易管理制度》，制度规范了公司各部门相关岗位职责，适用于公司所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，旨在规范交易行为，严禁利益输送，保证公平交易，保护投资者合法权益。

（一）公司投资和研发部门不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

（二）公司制定投资授权机制，明确各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各投资组合经理的投资权限，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

（三）公司对各投资组合信息进行有效的保密管理，不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息相互隔离。

（四）公司实行集中交易制度，严格隔离投资管理职能与交易执行职能，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。并在交易执行中对公平交易进行实时监控。

（五）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。

（六）公司相关部门定期对管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异、不同时间窗下同向交易和反向交易的交易价差等进行分析，并评估是否符合公平交易原则。

（七）公司相关部门建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，对交易过程进行定期

检查，并将检查结果定期向公司风险管理委员会汇报。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

（一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合间同向交易记录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值都在 1%数量级及以下，且大多数溢价率均值都可以通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

（二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 ≥ 30 ），溢价率均值普遍在 1%数量级及以下。为稳妥起见，对于溢价率均值过大的基金或组合配对，我们也进行了模拟溢价金额计算。

（三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，基金经理也对价差作出了解释，公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，A 股市场呈现震荡走势，行业表现较为分化。其中，深证成指上涨 0.10%，上证指数上涨 3.65%，科创 50 上涨 4.71%，创业板指下跌 5.61%。分行业来看，通信、传媒、计算机涨幅居前，房地产、农业、建材跌幅居前。

2023 年三季度，市场整体震荡下行。其中，上证指数下跌 2.86%，深成指下跌 8.32%，创业板指下跌 9.53%，科创 50 下跌 11.67%。分行业来看，煤炭、非银金融、石油石化涨幅居前，传媒、计

算机、电力设备及新能源跌幅居前。

2023 年四季度，市场整体延续了震荡下行的走势，板块表现差异较大。分别来看，上证指数下跌 1.10%，深成指下跌 3.52%，创业板指下跌 4.79%，科创 50 下跌 3.55%。分行业来看，煤炭、电子、农业涨幅居前，房地产、建材、电力设备新能源跌幅居前。

我管理的基金组合主要布局了消费、数字经济与人工智能、医药等投资方向，在上半年取得了一定收益，但是在下半年组合净值出现了较大幅度的回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类本报告期内的净值增长率为-9.05%，同期业绩比较基准收益率为-3.41%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-9.82%，同期业绩比较基准收益率为-3.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我认为 2024 年 A 股市场具备投资机会。沪深 300 指数的市净率已经在历史极低分位的位置，估值低虽然并不构成上涨的理由，但毫无疑问是一种重要的保护。美联储进入加息末期的迹象明显，中国货币环境保持宽松，这对于风险资产来说是难得的好阶段。国内经济基本面开始出现改善的迹象，同时政策层面也很值得期待。央行 1 月 24 日宣布于 2 月 5 日下调金融机构存款准备金率 0.5 个百分点，监管层也强调“建设以投资者为本的资本市场”，预计后续政策还会继续着力增效，围绕释放内需、信心修复等陆续出台系列政策。

基于以上的判断，我会积极寻找投资机会，围绕着业绩高增长与超预期的选股思路，具体来说包括如下方向：1、数字经济与人工智能。数字经济的战略地位已经被提升到前所未有的高度，相关的商业模式逐步在探索和清晰。以 OpenAI 为代表的生成式人工智能，有望推动新一轮的全球产业革命，产业变化日新月异。无论是机器人也好，自动驾驶也好，本质上都是人工智能的外延方向。目前阶段的数字经济与人工智能，无论是从产业发展的角度，还是从 A 股投资的角度，都非常类似于 2020 年年初的新能源车。2、消费。一方面消费会是稳经济的发力点之一，另一方面基于国内巨大的内需市场，只要能把握住某一细分市场的机会，无论是细分品类、细分人群还是细分价位，就足以成就一个高速增长的消费品公司。并且无论在何种环境下，消费者对于更高性价比的商品或服务的追求从未发生改变。3、医药：2018 年至今集采带来行业整体估值下行，但其中不乏高增长或高性价比的医药公司。反腐风暴从行业经营角度来讲是正本清源，从股票投资的角度来讲，可能会带来最后一击之后否极泰来的投资机会。

我的投资框架是始终如一的寻找业绩高增长与超预期，在这个底层逻辑之上同时对市场永存敬畏之心，希望既能坚持自我、又能不断进化。希望投资者能多一分耐心，作为组合管理者我一定会

尽心竭力，争取回报给投资者一份满意的答卷。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从合规运作、维护基金份额持有人合法利益的角度出发，完善内部控制制度和流程，加强日常监察力度，推动内控体系和制度措施的落实；在对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、报表揭示、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本期内重点开展的监察稽核工作包括：

1、全面开展对公司各项业务的稽核监察，对公司内控缺失、薄弱环节和风险隐患做到及时发现，提前防范，确保投资管理、基金销售和后台运营等业务领域的稳健合规运作。

2、根据基金监管法律法规的相关要求及业务发展变化，优化公司内控和风险管理，更新完善内控制度和业务流程，推动全员全过程风险管理和风险控制责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。

3、注重对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规培训、业务学习等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。

今后本基金管理人将继续以“诚信勤勉为投资人服务”为宗旨，不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性，在完善内部控制体系、有效防范风险的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，争取以更好的收益回报基金份额持有人。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

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

无。

§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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2024)第 22741 号

国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

（一）我们审计的内容

我们审计了国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“国泰融安多策略基金”)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。

(二) 我们的意见

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，公允反映了国泰融安多策略基金 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。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国泰融安多策略基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层对财务报表的责任

国泰融安多策略基金的基金管理人国泰基金管理有限公司(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。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估国泰融安多策略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国泰融安多策略基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督国泰融安多策略基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师的责任

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。

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：

(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。

(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。

(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。

(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，就可能对导致对国泰融安多策略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国泰融安多策略基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

张炯 张晓阳

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2024 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰融安多策略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	104,520,018.27	180,758,131.64
结算备付金		6,755,044.86	2,849,665.59

存出保证金		365,850.58	292,733.86
交易性金融资产	7.4.7.2	516,690,161.65	666,686,319.22
其中：股票投资		484,693,400.07	624,054,822.29
基金投资		-	-
债券投资		31,996,761.58	42,631,496.93
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		220,534.85	319,854.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		628,551,610.21	850,906,704.58
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		20,923,147.63	55,351,794.41
应付赎回款		1,200,546.37	521,052.01
应付管理人报酬		634,092.27	1,017,712.60
应付托管费		79,261.55	101,771.25
应付销售服务费		11,451.15	7,616.99
应付投资顾问费		-	-
应交税费		30.87	8.41
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	816,038.84	2,418,861.59
负债合计		23,664,568.68	59,418,817.26
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	258,186,425.96	307,222,294.66
未分配利润	7.4.7.8	346,700,615.57	484,265,592.66
净资产合计		604,887,041.53	791,487,887.32
负债和净资产总计		628,551,610.21	850,906,704.58

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 258,186,425.96 份，其中 A 类基金份额净值 2.3433 元，份额总额 254,492,436.61 份；C 类基金份额净值 2.3123 元，份

额总额 3,693,989.35 份。

7.2 利润表

会计主体：国泰融安多策略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		-79,741,500.16	-408,158,358.77
1.利息收入		612,333.86	459,912.45
其中：存款利息收入	7.4.7.9	612,333.86	459,912.45
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-48,726,922.76	-314,296,787.84
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-56,936,949.18	-320,559,112.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	1,890,582.47	883,728.53
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	6,319,443.95	5,378,596.26
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-32,290,987.18	-95,217,613.56
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	664,075.92	896,130.18
减：二、营业总支出		13,237,163.62	15,985,439.89
1. 管理人报酬		11,601,692.50	14,279,380.40
2. 托管费		1,247,481.97	1,427,938.00
3. 销售服务费		171,138.64	42,388.11
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		19.68	3.15
8. 其他费用	7.4.7.16	216,830.83	235,730.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-92,978,663.78	-424,143,798.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-92,978,663.78	-424,143,798.66
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-92,978,663.78	-424,143,798.66

7.3 净资产变动表

会计主体：国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	307,222,294.66	484,265,592.66	791,487,887.32
二、本期期初净资产	307,222,294.66	484,265,592.66	791,487,887.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-49,035,868.70	-137,564,977.09	-186,600,845.79
（一）、综合收益总额	-	-92,978,663.78	-92,978,663.78
（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）	-49,035,868.70	-44,586,313.31	-93,622,182.01
其中：1.基金申购款	154,435,635.00	276,125,148.46	430,560,783.46
2.基金赎回款	-203,471,503.70	-320,711,461.77	-524,182,965.47
（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	258,186,425.96	346,700,615.57	604,887,041.53
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	438,599,243.13	1,148,020,475.33	1,586,619,718.46
二、本期期初净资产	438,599,243.13	1,148,020,475.33	1,586,619,718.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-131,376,948.47	-663,754,882.67	-795,131,831.14
（一）、综合收益总额	-	-424,143,798.66	-424,143,798.66
（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）	-131,376,948.47	-239,611,084.01	-370,988,032.48
其中：1.基金申购款	97,400,046.41	179,269,001.09	276,669,047.50
2.基金赎回款	-228,776,994.88	-418,880,085.10	-647,657,079.98
（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	307,222,294.66	484,265,592.66	791,487,887.32

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：

基金管理人负责人：周向勇 主管会计工作负责人：倪莹 会计机构负责人：吴洪涛

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国泰融安多策略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”)证监许可[2016]2257 号文《关于准予国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 209,787,829.28 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(2017)第 666 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 7 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 209,788,601.88 份基金份额,其中认购资金利息折合 772.60 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据基金管理人国泰基金管理有限公司于 2022 年 2 月 11 日发布的《国泰基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金增加 C 类基金份额、降低基金费率并修改基金合同的公告》的规定,经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,自 2022 年 2 月 14 日起对本基金增加 C 类基金份额并相应修改法律文件。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费(原基金份额自动转入 A 类基金份额);C 类基金份额在投资者申购时不收取申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码,分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择申购的基金份额类别,但不同类别基金份额之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰融安多策略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核准上市的股票、存托凭证),债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 0%-95%;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,持有的现金或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、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 X50%+中证综合债指数收益率 X50%。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰融安多策略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业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产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、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的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(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的

证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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。

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,

债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

(4) 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	104,520,018.27	180,758,131.64
等于：本金	104,507,594.19	180,750,290.43
加：应计利息	12,424.08	7,841.21
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
合计	104,520,018.27	180,758,131.64

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		527,742,222.57	-	484,693,400.07	-43,048,822.50
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	31,339,999.00	218,187.52	31,996,761.58	438,575.06
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	31,339,999.00	218,187.52	31,996,761.58	438,575.06
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		559,082,221.57	218,187.52	516,690,161.65	-42,610,247.44
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		634,431,413.11	-	624,054,822.29	-10,376,590.82
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	42,143,250.00	430,916.37	42,631,496.93	57,330.56
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	42,143,250.00	430,916.37	42,631,496.93	57,330.56
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-

合计	676,574,663.11	430,916.37	666,686,319.22	-10,319,260.26
----	----------------	------------	----------------	----------------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	909.00	921.77
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	613,129.84	2,197,939.82
其中：交易所市场	613,129.84	2,197,939.82
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	202,000.00	220,000.00
合计	816,038.84	2,418,861.59

7.4.7.7 实收基金

国泰融安多策略灵活配置混合 A

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	301,422,846.22	301,422,846.22
本期申购	104,278,712.12	104,278,712.12
本期赎回（以“-”号填列）	-151,209,121.73	-151,209,121.73
本期末	254,492,436.61	254,492,436.61

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

国泰融安多策略灵活配置混合 C

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	5,799,448.44	5,799,448.44
本期申购	50,156,922.88	50,156,922.88
本期赎回（以“-”号填列）	-52,262,381.97	-52,262,381.97
本期末	3,693,989.35	3,693,989.35

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

国泰融安多策略灵活配置混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	351,728,125.26	123,465,808.58	475,193,933.84
本期期初	351,728,125.26	123,465,808.58	475,193,933.84
本期利润	-50,624,852.59	-25,810,742.43	-76,435,595.02
本期基金份额交易产生的变动数	-54,068,611.44	-2,836,714.53	-56,905,325.97
其中：基金申购款	127,670,677.64	57,070,585.54	184,741,263.18
基金赎回款	-181,739,289.08	-59,907,300.07	-241,646,589.15
本期已分配利润	-	-	-

本期末	247,034,661.23	94,818,351.62	341,853,012.85
-----	----------------	---------------	----------------

国泰融安多策略灵活配置混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,695,532.75	2,376,126.07	9,071,658.82
本期期初	6,695,532.75	2,376,126.07	9,071,658.82
本期利润	-10,062,824.01	-6,480,244.75	-16,543,068.76
本期基金份额交易产生的变动数	6,835,831.90	5,483,180.76	12,319,012.66
其中：基金申购款	67,317,432.89	24,066,452.39	91,383,885.28
基金赎回款	-60,481,600.99	-18,583,271.63	-79,064,872.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,468,540.64	1,379,062.08	4,847,602.72

7.4.7.9 存款利息收入

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
活期存款利息收入	528,298.18	377,636.10
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	78,695.51	75,226.03
其他	5,340.17	7,050.32
合计	612,333.86	459,912.45

7.4.7.10 股票投资收益

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

		月 31 日
卖出股票成交总额	4,216,250,799.43	6,695,843,481.35
减：卖出股票成本总额	4,262,141,041.88	6,998,287,001.55
减：交易费用	11,046,706.73	18,115,592.43
买卖股票差价收入	-56,936,949.18	-320,559,112.63

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

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
债券投资收益——利息收入	548,284.80	1,010,370.89
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,342,297.67	-126,642.36
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	1,890,582.47	883,728.53

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	45,125,321.90	50,938,763.21
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	42,902,250.00	49,758,791.20
减：应计利息总额	880,640.44	1,306,608.55
减：交易费用	133.79	5.82
买卖债券差价收入	1,342,297.67	-126,642.36

7.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.13 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	6,319,443.95	5,378,596.26
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	6,319,443.95	5,378,596.26

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1.交易性金融资产	-32,290,987.18	-95,217,613.56
——股票投资	-32,672,231.68	-95,218,324.58
——债券投资	381,244.50	711.02
——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	-32,290,987.18	-95,217,613.56

7.4.7.15 其他收入

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
基金赎回费收入	654,921.28	872,736.72
转换费收入	9,154.64	23,393.46
合计	664,075.92	896,130.18

注：（1）本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产；

（2）本基金的转换费由转出基金赎回费和转入基金申购补差费构成，其中不低于转出基金赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.16 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	82,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	14,830.83	15,730.23
合计	216,830.83	235,730.23

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
国泰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
国泰全球投资管理有限公司	基金管理人的控股子公司
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)	基金管理人的股东
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
中国建银投资有限责任公司(“中国建投”)	基金管理人的控股股东
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

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	11,601,692.50	14,279,380.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,912,976.53	5,017,799.02
应支付基金管理人的净管理费	7,688,715.97	9,261,581.38

注：1.自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 23 日，支付基金管理人国泰基金管理有限公司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 X 1.50% / 当年天数。

2. 根据《国泰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 7 月 24 日起，支付基金管理人国泰基金管理有限公司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 X 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	1,247,481.97	1,427,938.00

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%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 X 0.15% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰融安多策略灵活配置混 合 A	国泰融安多策略灵活配置混 合 C	合计
国泰基金管理有限公司	-	155,026.95	155,026.95
合计	-	155,026.95	155,026.95
获得销售服务费的各 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		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰融安多策略灵活配置混 合 A	国泰融安多策略灵活配置混 合 C	合计
国泰基金管理有限公司	-	103.52	103.52
合计	-	103.52	103.52

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国泰基金管理有限公司，再由国泰基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。C类基金份额约定的销售服务费年费率为0.60%。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金资产净值 X 0.60% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均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 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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	
	国泰融安多策略灵 活配置混合A	国泰融安多策略灵活 配置混合C	国泰融安多策略灵 活配置混合A	国泰融安多策略灵活 配置混合C
期初持有的基	-	38,349.44	-	-

金份额				
期间申购/买入 总份额	-	-	-	38,349.44
期间因拆分变 动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/ 卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基 金份额	-	38,349.44	-	38,349.44
期末持有的基 金份额占基金 总份额比例	-	0.01%	-	0.01%

7.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	104,520,018.27	528,298.18	180,758,131.64	377,636.10

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688563	航材股份	2023-07-12	6 个月以上	新股锁定流通受限	78.99	60.49	810.00	63,981.90	48,996.90	-
301526	国际复材	2023-12-19	6 个月以上	新股锁定流通受限	2.66	4.45	9,288.00	24,706.08	41,331.60	-
688548	广钢气体	2023-08-08	6 个月以上	新股锁定流通受限	9.87	12.75	2,843.00	28,060.41	36,248.25	-
688549	中巨芯	2023-08-30	6 个月以上	新股锁定流通受限	5.18	8.09	4,294.00	22,242.92	34,738.46	-
603296	华勤技术	2023-08-01	6 个月以上	新股锁定流通受限	80.80	77.75	395.00	31,916.00	30,711.25	-
688652	京仪装备	2023-11-22	6 个月以上	新股锁定流通受限	31.95	52.25	416.00	13,291.20	21,736.00	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	6 个月以上	新股锁定流通受限	55.68	37.58	564.00	31,403.52	21,195.12	-
301558	三态股份	2023-09-21	6 个月以上	新股锁定流通受限	7.33	13.40	1,458.00	10,687.14	19,537.20	-
68862	精智	2023-0	6 个月	新股	46.77	87.72	222.00	10,382	19,473	-

7	达	7-11	以上	锁定 流通 受限				.94	.84	
30090 4	威力 传动	2023-0 8-02	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	35.41	61.53	304.00	10,764 .64	18,705 .12	-
30148 8	豪恩 汽电	2023-0 6-26	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	39.78	69.09	262.00	10,422 .36	18,101 .58	-
30150 9	金凯 生科	2023-0 7-26	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	56.56	62.23	266.00	15,044 .96	16,553 .18	-
68861 2	威迈 斯	2023-0 7-19	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	47.29	37.97	422.00	19,956 .38	16,023 .34	-
30152 5	儒竞 科技	2023-0 8-23	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	99.57	81.46	195.00	19,416 .15	15,884 .70	-
30139 3	昊帆 生物	2023-0 7-05	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	67.68	59.37	260.00	17,596 .80	15,436 .20	-
30151 0	固高 科技	2023-0 8-04	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	12.00	35.01	396.00	4,752. 00	13,863 .96	-
30150 7	民生 健康	2023-0 8-24	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	10.00	15.85	851.00	8,510. 00	13,488 .35	-
30156 6	达利 凯普	2023-1 2-22	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	8.90	22.14	576.00	5,126. 40	12,752 .64	-
68860 2	康鹏 科技	2023-0 7-13	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	8.66	11.06	1,066. 00	9,231. 56	11,789 .96	-
68871 9	爱科 赛博	2023-0 9-20	6 个月 以上	新股 锁定	69.98	60.10	194.00	13,576 .12	11,659 .40	-

				流通受限							
601083	锦江航运	2023-1-28	6 个月以上	新股锁定流通受限	11.25	11.07	1,015.00	11,418.75	11,236.05	-	
301508	中机认检	2023-1-23	6 个月以上	新股锁定流通受限	16.82	26.68	419.00	7,047.58	11,178.92	-	
301251	威尔高	2023-08-30	6 个月以上	新股锁定流通受限	28.88	34.59	321.00	9,270.48	11,103.39	-	
688653	康希通信	2023-1-10	6 个月以上	新股锁定流通受限	10.50	15.99	648.00	6,804.00	10,361.52	-	
301528	多浦乐	2023-08-17	6 个月以上	新股锁定流通受限	71.80	68.91	148.00	10,626.40	10,198.68	-	
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月以上	新股锁定流通受限	36.90	50.85	198.00	7,306.20	10,068.30	-	
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月以上	新股锁定流通受限	25.82	31.80	306.00	7,900.92	9,730.80	-	
688716	中研股份	2023-09-13	6 个月以上	新股锁定流通受限	29.66	36.39	267.00	7,919.22	9,716.13	-	
301413	安培龙	2023-12-11	6 个月以上	新股锁定流通受限	33.25	58.19	164.00	5,453.00	9,543.16	-	
301500	飞南资源	2023-09-13	6 个月以上	新股锁定流通受限	23.97	20.89	455.00	10,906.35	9,504.95	-	
301516	中远通	2023-12-01	6 个月以上	新股锁定流通受限	6.87	15.51	604.00	4,149.48	9,368.04	-	

				受限						
301519	舜禹股份	2023-07-19	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	20.93	20.21	442.00	9,251.06	8,932.82	-
301568	思泰克	2023-11-21	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	23.23	35.58	246.00	5,714.58	8,752.68	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	31.90	39.84	208.00	6,635.20	8,286.72	-
688720	艾森股份	2023-11-29	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	28.03	49.84	165.00	4,624.95	8,223.60	-
301517	陕西华达	2023-10-09	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	26.87	43.69	185.00	4,970.95	8,082.65	-
301578	辰奕智能	2023-12-21	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	48.94	68.32	118.00	5,774.92	8,061.76	-
301548	崇德科技	2023-09-11	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	66.80	58.99	136.00	9,084.80	8,022.64	-
301529	福赛科技	2023-08-31	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	36.60	37.88	182.00	6,661.20	6,894.16	-
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	58.08	57.81	114.00	6,621.12	6,590.34	-
688648	中邮科技	2023-11-06	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	15.18	21.43	303.00	4,599.54	6,493.29	-
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	16.80	31.19	195.00	3,276.00	6,082.05	-

301456	盘古智能	2023-07-06	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	37.96	30.39	185.00	7,022.60	5,622.15	-
603107	上海汽配	2023-10-25	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	14.23	18.19	292.00	4,155.16	5,311.48	-
603193	润本股份	2023-10-09	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	17.38	16.66	303.00	5,266.14	5,047.98	-
001306	夏厦精密	2023-11-09	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	53.63	75.36	64.00	3,432.32	4,823.04	-
603075	热威股份	2023-09-01	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	23.10	23.31	182.00	4,204.20	4,242.42	-
001358	兴欣新材	2023-12-14	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	41.00	44.16	87.00	3,567.00	3,841.92	-
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	21.29	21.53	161.00	3,427.69	3,466.33	-
603276	恒兴新材	2023-09-18	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	25.73	24.88	134.00	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023-12-13	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	19.10	34.75	88.00	1,680.80	3,058.00	-
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
11804	诺泰	2023-1	1-6 个	配债	100.00	100.01	510.00	51,000	51,003	-

6	转债	2-15	月 (含)	未上 市				.00	.80	
---	----	------	----------	---------	--	--	--	-----	-----	--

注：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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

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

本基金为灵活配置混合型基金，是证券投资基金中较高预期风险和较高预期收益的产品。基金的预期风险与预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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“在严格控制风险的前提下，谋求基金资产长期稳健增值”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别

的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、信息披露等方面专业人员。

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，本基金持有信用类债券比例为 0.30%(2022 年 12 月 31 日：0.16%)。

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%。

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

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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、债券投资、存出保证金及结算备付金等。

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	104,520,018.27	-	-	-	104,520,018.27
结算备付金	6,755,044.86	-	-	-	6,755,044.86
存出保证金	365,850.58	-	-	-	365,850.58
交易性金融资产	30,156,986.30	1,359,970.78	479,804.50	484,693,400.07	516,690,161.65
应收申购款	-	-	-	220,534.85	220,534.85
资产总计	141,797,900.01	1,359,970.78	479,804.50	484,913,934.92	628,551,610.21
负债					
应付清算款	-	-	-	20,923,147.63	20,923,147.63
应付赎回款	-	-	-	1,200,546.37	1,200,546.37
应付管理人报酬	-	-	-	634,092.27	634,092.27
应付托管费	-	-	-	79,261.55	79,261.55
应付销售服务费	-	-	-	11,451.15	11,451.15
应交税费	-	-	-	30.87	30.87
其他负债	-	-	-	816,038.84	816,038.84
负债总计	-	-	-	23,664,568.68	23,664,568.68
利率敏感度缺口	141,797,900.01	1,359,970.78	479,804.50	461,249,366.24	604,887,041.5

					3
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	180,758,131.64	-	-	-	180,758,131.64
结算备付金	2,849,665.59	-	-	-	2,849,665.59
存出保证金	292,733.86	-	-	-	292,733.86
交易性金融资产	41,362,765.29	99,263.92	1,169,467.72	624,054,822.29	666,686,319.22
应收申购款	3,137.43	-	-	316,716.84	319,854.27
资产总计	225,266,433.81	99,263.92	1,169,467.72	624,371,539.13	850,906,704.58
负债					
应付清算款	-	-	-	55,351,794.41	55,351,794.41
应付赎回款	-	-	-	521,052.01	521,052.01
应付管理人报酬	-	-	-	1,017,712.60	1,017,712.60
应付托管费	-	-	-	101,771.25	101,771.25
应付销售服务费	-	-	-	7,616.99	7,616.99
应交税费	-	-	-	8.41	8.41
其他负债	-	-	-	2,418,861.59	2,418,861.59
负债总计	-	-	-	59,418,817.26	59,418,817.26
利率敏感度缺口	225,266,433.81	99,263.92	1,169,467.72	564,952,721.87	791,487,887.32

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，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 5.29%（2022 年 12 月 31 日：5.39%），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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。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，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，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	484,693,400.07	80.13	624,054,822.29	78.85
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	-	-	-	-
合计	484,693,400.07	80.13	624,054,822.29	78.85

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量不变		
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	上年度末

		2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 45,003,927.86	增加约 52,525,080.55
	业绩比较基准下降 5%	减少约 45,003,927.86	减少约 52,525,080.55

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	485,808,764.61	622,765,070.04
第二层次	30,207,990.10	41,911,895.25
第三层次	673,406.94	2,009,353.93
合计	516,690,161.65	666,686,319.22

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	-	2,009,353.93	2,009,353.93
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,393,099.61	1,393,099.61

转出第三层次	-	3,398,752.38	3,398,752.38
当期利得或损失总额	-	669,705.78	669,705.78
其中：计入损益的利得或损失	-	669,705.78	669,705.78
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	673,406.94	673,406.94
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	-	110,117.03	110,117.03
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	-	3,855,041.75	3,855,041.75
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,689,051.06	2,689,051.06
转出第三层次	-	4,105,533.40	4,105,533.40
当期利得或损失总额	-	-429,205.48	-429,205.48
其中：计入损益的利得或损失	-	-429,205.48	-429,205.48
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	2,009,353.93	2,009,353.93
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	-	285,630.28	285,630.28

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	采用的估值技术	不可观察输入值
----	--------	---------	---------

	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	673,406.94	平均价格亚式期权模型	预期波动率	20.23%-217.52%	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	2,009,353.93	平均价格亚式期权模型	预期波动率	23.19%-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	484,693,400.07	77.11
	其中: 股票	484,693,400.07	77.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	31,996,761.58	5.09
	其中: 债券	31,996,761.58	5.09
	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	111,275,063.13	17.70
8	其他各项资产	586,385.43	0.09
9	合计	628,551,610.21	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,412,555.00	0.73
B	采矿业	2,210,529.45	0.37
C	制造业	349,842,956.85	57.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,578,831.99	1.42
E	建筑业	2,505,210.28	0.41
F	批发和零售业	3,341,863.89	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	4,478,973.33	0.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	73,566,694.42	12.16
J	金融业	3,743,600.00	0.62
K	房地产业	1,519,614.00	0.25
L	租赁和商务服务业	836,293.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	23,530,663.85	3.89
N	水利、环境和公共设施管理业	3,965,986.56	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,159,627.45	0.36
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	484,693,400.07	80.13

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	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	688111	金山办公	116,517	36,842,675.40	6.09
2	002568	百润股份	1,449,185	35,664,442.85	5.90
3	002332	仙琚制药	1,226,500	15,662,405.00	2.59
4	300705	九典制药	469,217	15,592,080.91	2.58
5	688333	铂力特	113,930	13,204,487.00	2.18
6	301162	国能日新	216,700	11,242,396.00	1.86
7	002558	巨人网络	981,972	10,939,168.08	1.81
8	605116	奥锐特	407,400	10,519,068.00	1.74
9	605499	东鹏饮料	54,400	9,928,544.00	1.64
10	688513	苑东生物	142,914	9,115,054.92	1.51
11	603859	能科科技	179,700	6,780,081.00	1.12
12	300298	三诺生物	201,500	6,125,600.00	1.01
13	600422	昆药集团	286,600	5,978,476.00	0.99
14	600699	均胜电子	316,900	5,691,524.00	0.94
15	600600	青岛啤酒	75,260	5,625,685.00	0.93
16	688131	皓元医药	99,500	5,179,970.00	0.86
17	300627	华测导航	166,812	5,174,508.24	0.86
18	603707	健友股份	339,400	5,091,000.00	0.84
19	688302	海创药业	88,377	4,601,790.39	0.76
20	688553	汇宇制药	298,243	4,512,416.59	0.75
21	688105	诺唯赞	137,700	4,409,154.00	0.73
22	300782	卓胜微	30,300	4,272,300.00	0.71
23	688270	臻镭科技	60,734	4,152,990.92	0.69
24	688326	经纬恒润	35,061	4,068,829.05	0.67
25	300657	弘信电子	198,300	3,845,037.00	0.64
26	600054	黄山旅游	349,952	3,807,477.76	0.63
27	603501	韦尔股份	33,400	3,564,114.00	0.59
28	301068	大地海洋	116,200	3,532,480.00	0.58
29	300636	同和药业	332,200	3,501,388.00	0.58
30	688283	坤恒顺维	48,407	3,322,172.41	0.55
31	600803	新奥股份	194,700	3,274,854.00	0.54
32	000596	古井贡酒	14,000	3,259,200.00	0.54
33	301122	采纳股份	95,300	3,226,858.00	0.53
34	300620	光库科技	66,300	3,003,390.00	0.50
35	000966	长源电力	661,400	2,930,002.00	0.48
36	603650	彤程新材	87,000	2,897,100.00	0.48
37	603919	金徽酒	116,900	2,878,078.00	0.48
38	300568	星源材质	183,900	2,835,738.00	0.47
39	002886	沃特股份	138,200	2,831,718.00	0.47
40	688667	菱电电控	33,949	2,785,175.96	0.46
41	601156	东航物流	187,900	2,777,162.00	0.46
42	603722	阿科力	51,400	2,770,460.00	0.46
43	688226	威腾电气	144,412	2,714,945.60	0.45
44	300666	江丰电子	45,700	2,677,106.00	0.44

45	688680	海优新材	40,334	2,647,927.10	0.44
46	601089	福元医药	141,049	2,431,684.76	0.40
47	600460	士兰微	105,300	2,403,999.00	0.40
48	300982	苏文电能	72,800	2,390,752.00	0.40
49	600079	人福医药	95,600	2,376,616.00	0.39
50	002812	恩捷股份	41,600	2,363,712.00	0.39
51	002755	奥赛康	217,700	2,355,514.00	0.39
52	002940	昂利康	107,200	2,327,312.00	0.38
53	000543	皖能电力	363,600	2,276,136.00	0.38
54	601965	中国汽研	102,200	2,254,532.00	0.37
55	603596	伯特利	31,200	2,162,160.00	0.36
56	688271	联影医疗	15,685	2,149,001.85	0.36
57	688046	药康生物	103,484	2,085,202.60	0.34
58	601100	恒立液压	37,200	2,034,096.00	0.34
59	600547	山东黄金	86,400	1,975,968.00	0.33
60	300394	天孚通信	20,900	1,912,768.00	0.32
61	301263	泰恩康	116,228	1,898,003.24	0.31
62	002472	双环传动	72,400	1,883,848.00	0.31
63	688114	华大智造	21,264	1,829,129.28	0.30
64	301031	中熔电气	13,800	1,804,488.00	0.30
65	301268	铭利达	60,200	1,795,766.00	0.30
66	688515	裕太微	18,173	1,795,674.13	0.30
67	001201	东瑞股份	74,300	1,793,602.00	0.30
68	688707	振华新材	87,387	1,791,433.50	0.30
69	600986	浙文互联	322,900	1,763,034.00	0.29
70	300687	赛意信息	80,600	1,755,468.00	0.29
71	688160	步科股份	29,272	1,703,044.96	0.28
72	002317	众生药业	103,300	1,657,965.00	0.27
73	600975	新五丰	155,500	1,624,975.00	0.27
74	300129	泰胜风能	149,900	1,614,423.00	0.27
75	603538	美诺华	83,400	1,594,608.00	0.26
76	603296	华勤技术	19,450	1,553,015.20	0.26
77	002352	顺丰控股	38,400	1,551,360.00	0.26
78	600223	福瑞达	157,800	1,519,614.00	0.25
79	301191	菲菱科思	16,300	1,502,860.00	0.25
80	603633	徕木股份	156,710	1,501,281.80	0.25
81	688020	方邦股份	30,954	1,500,649.92	0.25
82	301168	通灵股份	32,500	1,500,200.00	0.25
83	688247	宣泰医药	131,813	1,447,306.74	0.24
84	603198	迎驾贡酒	21,300	1,411,977.00	0.23
85	002475	立讯精密	40,800	1,405,560.00	0.23
86	688719	爱科赛博	21,447	1,376,527.06	0.23
87	688382	益方生物	90,417	1,368,913.38	0.23
88	300354	东华测试	27,500	1,365,925.00	0.23

89	002022	科华生物	119,500	1,359,910.00	0.22
90	688292	浩瀚深度	49,116	1,351,672.32	0.22
91	603063	禾望电气	53,400	1,335,000.00	0.22
92	688351	微电生理	51,615	1,323,924.75	0.22
93	688019	安集科技	8,269	1,321,055.44	0.22
94	688165	埃夫特	114,974	1,317,602.04	0.22
95	603589	口子窖	29,000	1,313,700.00	0.22
96	301097	天益医疗	24,749	1,302,539.87	0.22
97	002432	九安医疗	34,300	1,292,081.00	0.21
98	688375	国博电子	16,215	1,289,578.95	0.21
99	301033	迈普医学	28,800	1,253,952.00	0.21
100	688293	奥浦迈	22,500	1,241,325.00	0.21
101	301509	金凯生科	19,657	1,240,900.92	0.21
102	002100	天康生物	141,000	1,236,570.00	0.20
103	603882	金域医学	19,400	1,213,858.00	0.20
104	300602	飞荣达	67,000	1,210,690.00	0.20
105	601628	中国人寿	42,600	1,207,710.00	0.20
106	688331	荣昌生物	19,426	1,205,577.56	0.20
107	601601	中国太保	50,500	1,200,890.00	0.20
108	000810	创维数字	76,100	1,195,531.00	0.20
109	301367	怡和嘉业	9,800	1,193,150.00	0.20
110	002456	欧菲光	136,400	1,188,044.00	0.20
111	688698	伟创电气	32,207	1,170,080.31	0.19
112	688472	阿特斯	92,519	1,168,514.97	0.19
113	688198	佰仁医疗	9,368	1,166,597.04	0.19
114	688205	德科立	23,377	1,156,693.96	0.19
115	688173	希荻微	64,746	1,138,882.14	0.19
116	688012	中微公司	7,384	1,134,182.40	0.19
117	688507	索辰科技	8,235	1,126,136.25	0.19
118	603229	奥翔药业	82,500	1,089,825.00	0.18
119	300761	立华股份	47,400	993,978.00	0.16
120	688372	伟测科技	11,889	932,097.60	0.15
121	688249	晶合集成	53,556	923,841.00	0.15
122	301520	万邦医药	16,500	912,450.00	0.15
123	603638	艾迪精密	55,500	901,875.00	0.15
124	688301	奕瑞科技	2,769	900,644.94	0.15
125	688716	中研股份	22,413	884,483.13	0.15
126	688522	纳睿雷达	15,856	879,849.44	0.15
127	300660	江苏雷利	28,700	868,462.00	0.14
128	688435	英方软件	17,469	838,861.38	0.14
129	300280	紫天科技	19,500	833,235.00	0.14
130	688543	国科军工	14,895	832,630.50	0.14
131	603093	南华期货	65,000	780,000.00	0.13
132	300315	掌趣科技	150,300	774,045.00	0.13

133	301188	力诺特玻	41,800	747,802.00	0.12
134	603918	金桥信息	39,800	744,260.00	0.12
135	688581	安杰思	5,583	696,814.23	0.12
136	688279	峰岬科技	5,495	693,029.40	0.11
137	688017	绿的谐波	4,479	687,526.50	0.11
138	000333	美的集团	12,500	682,875.00	0.11
139	002487	大金重工	25,000	665,500.00	0.11
140	600587	新华医疗	25,800	665,382.00	0.11
141	688652	京仪装备	11,040	661,832.00	0.11
142	300433	蓝思科技	49,100	648,120.00	0.11
143	688137	近岸蛋白	11,656	646,674.88	0.11
144	002223	鱼跃医疗	18,700	646,646.00	0.11
145	002567	唐人神	85,900	644,250.00	0.11
146	002675	东诚药业	35,100	643,383.00	0.11
147	301239	普瑞眼科	7,371	633,906.00	0.10
148	002520	日发精机	96,300	633,654.00	0.10
149	688197	首药控股	11,398	629,055.62	0.10
150	002156	通富微电	27,100	626,552.00	0.10
151	688533	上声电子	16,398	625,091.76	0.10
152	688195	腾景科技	17,248	620,755.52	0.10
153	688025	杰普特	6,690	619,159.50	0.10
154	600535	天士力	36,100	614,422.00	0.10
155	002557	洽洽食品	17,600	612,832.00	0.10
156	003020	立方制药	21,700	610,855.00	0.10
157	000756	新华制药	29,900	609,362.00	0.10
158	301498	乖宝宠物	15,200	605,112.00	0.10
159	300502	新易盛	12,200	601,704.00	0.10
160	603160	汇顶科技	8,700	601,170.00	0.10
161	688612	威迈斯	15,433	600,701.79	0.10
162	605266	健之佳	10,100	599,940.00	0.10
163	688052	纳芯微	3,593	599,492.05	0.10
164	688180	君实生物	14,297	598,043.51	0.10
165	301155	海力风电	10,100	597,415.00	0.10
166	600062	华润双鹤	32,100	597,060.00	0.10
167	002154	报喜鸟	103,300	586,744.00	0.10
168	600276	恒瑞医药	12,900	583,467.00	0.10
169	688316	青云科技	11,249	582,585.71	0.10
170	603317	天味食品	43,300	575,457.00	0.10
171	688193	仁度生物	12,604	568,692.48	0.09
172	300037	新宙邦	11,800	558,140.00	0.09
173	688076	诺泰生物	12,398	557,290.10	0.09
174	688276	百克生物	10,163	557,034.03	0.09
175	600906	财达证券	74,000	555,000.00	0.09
176	301255	通力科技	13,000	546,130.00	0.09

177	603888	新华网	21,500	541,585.00	0.09
178	688192	迪哲医药	11,159	533,958.15	0.09
179	688601	力芯微	10,072	527,672.08	0.09
180	002038	双鹭药业	51,100	520,709.00	0.09
181	002508	老板电器	23,100	503,118.00	0.08
182	688563	航材股份	8,092	494,655.30	0.08
183	688469	芯联集成	97,079	487,336.58	0.08
184	300406	九强生物	25,100	479,410.00	0.08
185	002896	中大力德	13,100	476,185.00	0.08
186	603606	东方电缆	10,200	436,050.00	0.07
187	688029	南微医学	4,456	431,340.80	0.07
188	300679	电连技术	10,200	423,300.00	0.07
189	688589	力合微	10,418	415,782.38	0.07
190	688207	格灵深瞳	18,747	392,937.12	0.06
191	688579	山大地纬	29,890	379,603.00	0.06
192	688548	广钢气体	28,423	370,323.05	0.06
193	688549	中巨芯	42,933	358,533.28	0.06
194	688519	南亚新材	13,794	355,333.44	0.06
195	688213	思特威	6,126	340,360.56	0.06
196	002387	维信诺	30,100	337,421.00	0.06
197	002338	奥普光电	8,900	299,485.00	0.05
198	002821	凯莱英	2,500	290,250.00	0.05
199	688318	财富趋势	2,298	290,237.40	0.05
200	688371	菲沃泰	16,203	285,334.83	0.05
201	301391	卡莱特	2,470	282,765.60	0.05
202	688016	心脉医疗	1,430	278,320.90	0.05
203	603197	保隆科技	4,922	277,600.80	0.05
204	301267	华夏眼科	8,597	275,877.73	0.05
205	000530	冰山冷热	50,800	271,272.00	0.04
206	688484	南芯科技	6,729	268,150.65	0.04
207	688235	百济神州	1,856	258,058.24	0.04
208	002605	姚记科技	11,500	255,530.00	0.04
209	688432	有研硅	20,044	247,543.40	0.04
210	688147	微导纳米	6,293	245,364.07	0.04
211	605186	健麾信息	5,800	242,092.00	0.04
212	688570	天玛智控	8,837	240,454.77	0.04
213	688182	灿勤科技	13,181	234,358.18	0.04
214	301216	万凯新材	16,162	228,369.06	0.04
215	605337	李子园	16,017	225,679.53	0.04
216	688552	航天南湖	9,556	224,470.44	0.04
217	603297	永新光学	2,200	218,570.00	0.04
218	603173	福斯达	9,688	218,173.76	0.04
219	301371	敷尔佳	5,637	215,034.45	0.04
220	601061	中信金属	27,695	213,528.45	0.04

221	688230	芯导科技	5,085	212,756.40	0.04
222	688443	智翔金泰	5,245	209,537.75	0.03
223	688478	晶升股份	4,013	208,676.00	0.03
224	601058	赛轮轮胎	16,400	192,700.00	0.03
225	600809	山西汾酒	800	184,584.00	0.03
226	603171	税友股份	5,200	183,976.00	0.03
227	688535	华海诚科	1,965	182,312.70	0.03
228	301377	鼎泰高科	7,695	181,986.75	0.03
229	688562	航天软件	7,254	174,096.00	0.03
230	600519	贵州茅台	100	172,600.00	0.03
231	688458	美芯晟	2,206	169,773.76	0.03
232	601899	紫金矿业	13,100	163,226.00	0.03
233	301345	涛涛车业	2,652	161,506.80	0.03
234	301393	昊帆生物	2,669	160,000.29	0.03
235	688629	华丰科技	7,073	154,898.70	0.03
236	603711	香飘飘	8,300	142,262.00	0.02
237	301510	固高科技	3,957	142,024.35	0.02
238	688593	新相微	9,584	141,076.48	0.02
239	002906	华阳集团	4,000	141,000.00	0.02
240	688512	慧智微	7,209	140,503.41	0.02
241	688687	凯因科技	4,030	140,485.80	0.02
242	301507	民生健康	8,509	139,845.35	0.02
243	301439	泓淋电力	9,486	138,685.32	0.02
244	301332	德尔玛	11,211	136,998.42	0.02
245	301379	天山电子	4,481	132,592.79	0.02
246	688653	康希通信	6,478	127,078.12	0.02
247	601021	春秋航空	2,500	125,500.00	0.02
248	688620	安凯微	10,157	120,055.74	0.02
249	688320	禾川科技	2,834	116,194.00	0.02
250	301251	威尔高	3,207	114,566.49	0.02
251	688728	格科微	5,485	112,277.95	0.02
252	301568	思泰克	2,456	109,572.88	0.02
253	301318	维海德	3,078	108,991.98	0.02
254	301528	多浦乐	1,478	107,940.38	0.02
255	603105	芯能科技	9,300	107,694.00	0.02
256	688252	天德钰	5,201	103,811.96	0.02
257	688184	帕瓦股份	5,230	101,775.80	0.02
258	688251	井松智能	3,392	98,639.36	0.02
259	301500	飞南资源	4,550	98,243.60	0.02
260	301202	朗威股份	3,060	98,216.82	0.02
261	301220	亚香股份	2,849	94,159.45	0.02
262	301519	舜禹股份	4,414	90,914.90	0.02
263	301428	世纪恒通	2,289	88,469.85	0.01
264	601133	柏诚股份	6,632	87,343.44	0.01

265	301092	争光股份	3,230	85,530.40	0.01
266	301323	新莱福	2,277	84,226.23	0.01
267	301265	华新环保	8,181	83,855.25	0.01
268	301135	瑞德智能	3,376	83,792.32	0.01
269	301548	崇德科技	1,351	82,246.99	0.01
270	688479	友车科技	3,318	77,375.76	0.01
271	688448	磁谷科技	1,985	77,077.55	0.01
272	603168	莎普爱思	5,700	76,437.00	0.01
273	688307	中润光学	2,455	76,350.50	0.01
274	688203	海正生材	5,761	75,008.22	0.01
275	688429	时创能源	3,452	73,147.88	0.01
276	301529	福赛科技	1,816	72,009.06	0.01
277	301197	工大科雅	3,791	71,232.89	0.01
278	301337	亚华电子	2,318	70,953.98	0.01
279	603062	麦加芯彩	1,132	70,154.26	0.01
280	603004	鼎龙科技	1,948	69,190.05	0.01
281	301269	华大九天	632	66,897.20	0.01
282	603107	上海汽配	2,920	66,438.76	0.01
283	688502	茂莱光学	303	65,747.97	0.01
284	001331	胜通能源	3,759	65,632.14	0.01
285	300762	上海瀚讯	4,300	64,844.00	0.01
286	002993	奥海科技	1,700	64,770.00	0.01
287	002078	太阳纸业	5,300	64,501.00	0.01
288	688420	美腾科技	2,408	62,222.72	0.01
289	688361	中科飞测	831	61,851.33	0.01
290	301421	波长光电	900	56,187.00	0.01
291	603193	润本股份	3,022	54,479.40	0.01
292	688485	九州一轨	3,580	50,048.40	0.01
293	600925	苏能股份	8,960	49,369.60	0.01
294	301095	广立微	613	45,809.49	0.01
295	301526	国际复材	9,288	41,331.60	0.01
296	603276	恒兴新材	1,336	34,970.56	0.01
297	001286	陕西能源	3,767	32,207.85	0.01
298	001311	多利科技	649	32,131.99	0.01
299	603281	江瀚新材	1,208	31,758.32	0.01
300	603137	恒尚节能	1,382	27,114.84	0.00
301	301207	华兰疫苗	854	23,741.20	0.00
302	001337	四川黄金	795	21,965.85	0.00
303	301293	三博脑科	333	20,785.86	0.00
304	301358	湖南裕能	596	20,234.20	0.00
305	001338	永顺泰	1,649	19,886.94	0.00
306	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
307	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
308	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00

309	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
310	301187	欧圣电气	876	17,441.16	0.00
311	301363	美好医疗	445	16,376.00	0.00
312	301525	儒竞科技	195	15,884.70	0.00
313	301103	何氏眼科	507	15,199.86	0.00
314	603235	天新药业	572	13,750.88	0.00
315	603162	海通发展	774	13,715.28	0.00
316	688433	华曙高科	418	13,062.50	0.00
317	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
318	301100	风光股份	599	12,147.72	0.00
319	603282	亚光股份	457	11,808.88	0.00
320	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
321	601083	锦江航运	1,015	11,236.05	0.00
322	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
323	301282	金禄电子	434	10,845.66	0.00
324	301199	迈赫股份	402	10,552.50	0.00
325	301306	西测测试	255	10,095.45	0.00
326	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
327	301222	浙江恒威	332	9,870.36	0.00
328	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
329	001333	光华股份	426	9,431.64	0.00
330	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
331	001368	通达创智	351	8,806.59	0.00
332	001230	劲旅环境	375	8,797.50	0.00
333	301203	国泰环保	225	8,748.00	0.00
334	301270	汉仪股份	210	8,347.50	0.00
335	301316	慧博云通	359	8,343.16	0.00
336	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
337	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
338	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
339	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
340	603150	万朗磁塑	250	7,262.50	0.00
341	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
342	301456	盘古智能	185	5,622.15	0.00
343	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
344	301036	双乐股份	205	4,544.85	0.00
345	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
346	001328	登康口腔	145	4,104.95	0.00
347	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
348	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
349	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
350	001367	海森药业	55	2,417.80	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	002558	巨人网络	52,452,668.88	6.63
2	300394	天孚通信	50,539,650.64	6.39
3	600570	恒生电子	42,462,526.79	5.36
4	688036	传音控股	41,486,606.27	5.24
5	688111	金山办公	37,972,707.13	4.80
6	300031	宝通科技	37,575,397.00	4.75
7	603893	瑞芯微	35,560,128.84	4.49
8	002555	三七互娱	33,791,263.16	4.27
9	601336	新华保险	33,176,842.70	4.19
10	301162	国能日新	31,812,087.44	4.02
11	300705	九典制药	30,991,166.96	3.92
12	002568	百润股份	30,498,967.18	3.85
13	000988	华工科技	29,281,829.00	3.70
14	300308	中际旭创	28,697,695.00	3.63
15	300494	盛天网络	28,368,218.53	3.58
16	300418	昆仑万维	26,839,101.08	3.39
17	600415	小商品城	26,338,044.15	3.33
18	603444	吉比特	26,234,732.00	3.31
19	300558	贝达药业	25,470,961.00	3.22
20	300627	华测导航	25,186,264.50	3.18
21	601138	工业富联	25,161,932.00	3.18
22	688326	经纬恒润	23,846,334.20	3.01
23	002230	科大讯飞	23,653,887.00	2.99
24	300002	神州泰岳	22,987,159.94	2.90
25	688256	寒武纪	22,690,459.26	2.87
26	002472	双环传动	22,624,092.26	2.86
27	002624	完美世界	21,800,150.73	2.75
28	603197	保隆科技	21,706,511.97	2.74
29	300033	同花顺	21,226,899.00	2.68
30	600600	青岛啤酒	21,084,512.00	2.66
31	002332	仙琚制药	20,949,494.00	2.65
32	688235	百济神州	20,854,536.38	2.63
33	688475	萤石网络	20,775,128.89	2.62
34	000333	美的集团	20,624,463.00	2.61
35	000977	浪潮信息	20,326,103.55	2.57
36	002605	姚记科技	20,298,314.00	2.56

37	002803	吉宏股份	20,216,323.32	2.55
38	601333	广深铁路	19,973,127.00	2.52
39	600373	中文传媒	19,807,688.24	2.50
40	605499	东鹏饮料	19,603,003.00	2.48
41	600977	中国电影	19,377,589.20	2.45
42	688018	乐鑫科技	19,183,645.62	2.42
43	000063	中兴通讯	18,811,693.00	2.38
44	300620	光库科技	18,230,253.44	2.30
45	688302	海创药业	17,938,101.35	2.27
46	300226	上海钢联	17,804,464.48	2.25
47	600446	金证股份	16,932,980.00	2.14
48	000625	长安汽车	16,780,158.29	2.12
49	603259	药明康德	16,542,282.00	2.09
50	605186	健麾信息	16,527,544.00	2.09
51	600216	浙江医药	16,492,947.09	2.08
52	688521	芯原股份	16,487,818.24	2.08
53	300580	贝斯特	16,384,572.98	2.07
54	601318	中国平安	16,228,238.00	2.05
55	300454	深信服	16,196,800.00	2.05
56	300058	蓝色光标	16,158,247.82	2.04
57	300533	冰川网络	16,111,816.50	2.04
58	600325	华发股份	16,024,429.00	2.02
59	603258	电魂网络	15,986,023.00	2.02

注：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	688111	金山办公	61,054,343.70	7.71
2	300394	天孚通信	44,605,640.80	5.64
3	600570	恒生电子	41,263,447.96	5.21
4	300705	九典制药	40,492,991.60	5.12
5	688036	传音控股	40,221,002.02	5.08
6	300031	宝通科技	36,096,487.61	4.56
7	002555	三七互娱	33,562,599.00	4.24
8	002558	巨人网络	33,194,721.82	4.19
9	600415	小商品城	32,862,262.60	4.15
10	000988	华工科技	31,963,453.11	4.04
11	601336	新华保险	31,764,060.76	4.01
12	603893	瑞芯微	30,793,194.84	3.89

13	300308	中际旭创	29,757,181.24	3.76
14	300418	昆仑万维	28,946,080.59	3.66
15	600600	青岛啤酒	25,804,737.00	3.26
16	002230	科大讯飞	25,414,927.70	3.21
17	600131	国网信通	24,758,320.84	3.13
18	300494	盛天网络	24,725,849.20	3.12
19	603345	安井食品	24,506,489.44	3.10
20	600079	人福医药	24,247,751.00	3.06
21	300002	神州泰岳	21,881,056.90	2.76
22	600977	中国电影	21,799,388.56	2.75
23	000977	浪潮信息	21,780,685.91	2.75
24	603197	保隆科技	21,516,104.23	2.72
25	002605	姚记科技	21,497,293.33	2.72
26	688475	萤石网络	21,357,850.96	2.70
27	002472	双环传动	21,245,106.00	2.68
28	300033	同花顺	21,131,605.00	2.67
29	002803	吉宏股份	21,114,815.40	2.67
30	600373	中文传媒	21,103,926.00	2.67
31	688080	映翰通	21,096,987.78	2.67
32	301162	国能日新	20,894,435.36	2.64
33	688256	寒武纪	20,773,885.85	2.62
34	601333	广深铁路	20,759,649.00	2.62
35	603444	吉比特	20,718,537.00	2.62
36	601138	工业富联	19,945,803.00	2.52
37	300558	贝达药业	19,676,074.00	2.49
38	301268	铭利达	19,569,605.95	2.47
39	002174	游族网络	19,507,257.43	2.46
40	000063	中兴通讯	18,909,158.79	2.39
41	000625	长安汽车	18,737,015.20	2.37
42	688235	百济神州	18,698,296.67	2.36
43	600446	金证股份	18,554,882.00	2.34
44	000333	美的集团	18,489,201.90	2.34
45	300627	华测导航	18,416,049.60	2.33
46	300533	冰川网络	18,297,609.25	2.31
47	002624	完美世界	18,015,874.76	2.28
48	300058	蓝色光标	17,478,732.25	2.21
49	603259	药明康德	17,154,538.00	2.17
50	300620	光库科技	17,124,311.28	2.16
51	688513	苑东生物	17,062,777.01	2.16
52	605186	健麾信息	16,928,002.00	2.14
53	301205	联特科技	16,810,049.00	2.12
54	300896	爱美客	16,778,212.00	2.12
55	300454	深信服	16,625,249.00	2.10
56	600138	中青旅	16,602,948.00	2.10

57	688018	乐鑫科技	16,431,787.65	2.08
58	688326	经纬恒润	16,375,879.44	2.07
59	002422	科伦药业	16,309,049.27	2.06
60	600325	华发股份	16,207,016.00	2.05
61	300226	上海钢联	16,109,935.41	2.04
62	300502	新易盛	15,908,244.40	2.01
63	300580	贝斯特	15,855,282.75	2.00

注：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

买入股票的成本（成交）总额	4,155,451,851.34
卖出股票的收入（成交）总额	4,216,250,799.43

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	30,156,986.30	4.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,839,775.28	0.30
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	31,996,761.58	5.29

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	019709	23 国债 16	300,000	30,156,986.30	4.99
2	113664	大元转债	5,490	702,256.13	0.12
3	123158	宙邦转债	4,324	559,942.01	0.09
4	113673	岱美转债	2,350	289,919.05	0.05
5	111014	李子转债	1,210	138,881.65	0.02

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名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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

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	365,850.58
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	220,534.85

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	586,385.43

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	113664	大元转债	702,256.13	0.12
2	123158	宙邦转债	559,942.01	0.09
3	111014	李子转债	138,881.65	0.02
4	110082	宏发转债	97,772.64	0.02

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情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国泰融安多策略灵活配置混合 A	60,699	4,192.70	144,250.02	0.06%	254,348,186.59	99.94%
国泰融安多策略灵活配置混合 C	377	9,798.38	38,349.44	1.04%	3,655,639.91	98.96%
合计	61,076	4,227.30	182,599.46	0.07%	258,003,826.50	99.93%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
----	------	-----------	----------

基金管理人所有从业人员持有本基金	国泰融安多策略灵活配置混合 A	373,078.07	0.15%
	国泰融安多策略灵活配置混合 C	41.27	0.00%
	合计	373,119.34	0.14%

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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国泰融安多策略灵活配置混合 A	10~50
	国泰融安多策略灵活配置混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰融安多策略灵活配置混合 A	10~50
	国泰融安多策略灵活配置混合 C	0
	合计	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰融安多策略灵活配置混合 A	国泰融安多策略灵活配置混合 C
基金合同生效日（2017年7月3日）基金份额总额	209,788,601.88	-
本报告期期初基金份额总额	301,422,846.22	5,799,448.44
本报告期基金总申购份额	104,278,712.12	50,156,922.88
减：本报告期基金总赎回份额	151,209,121.73	52,262,381.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	254,492,436.61	3,693,989.35

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金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

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2023 年 7 月 19 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第八届董事会第二十二次会议审议通过，李辉先生不再担任本基金管理人副总经理。

2023 年 9 月 8 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第八届董事会第二十三次会议审议通过，张畔先生不再担任本基金管理人副总经理。

2023 年 9 月 28 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司关于董事长变更及总经理代为履行董事长职务的公告》，经本基金管理人第八届董事会第二十四次会议审议通过，邱军女士不再担任本基金管理人董事长，总经理周向勇先生代为履行董事长职务。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为 82,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人及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

本报告期内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	
华创证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中信建投	4	2,060,732,128.72	24.66%	1,728,321.45	26.41%	-
长江证券	1	881,266,307.84	10.55%	645,606.58	9.86%	-
光大证券	1	801,876,330.62	9.60%	587,288.94	8.97%	-
中航证券	2	792,996,898.68	9.49%	574,013.32	8.77%	-
中信证券	1	743,104,637.93	8.89%	693,608.03	10.60%	-
华金证券	1	694,519,247.31	8.31%	501,824.19	7.67%	-
东方证券	1	573,229,309.26	6.86%	419,204.99	6.41%	-
中金公司	2	405,441,330.91	4.85%	296,851.24	4.54%	-
华西证券	3	384,318,928.02	4.60%	282,575.66	4.32%	-
广发证券	2	327,074,258.25	3.91%	236,880.00	3.62%	-
申万宏源证券	2	245,460,484.08	2.94%	228,596.62	3.49%	-
东吴证券	1	187,956,527.09	2.25%	136,154.24	2.08%	-
东方财富证券	2	134,069,682.43	1.60%	96,705.25	1.48%	-
银河证券	1	64,111,493.11	0.77%	60,643.38	0.93%	-
国投证券	1	60,856,714.81	0.73%	56,675.57	0.87%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资质雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

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		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
华创证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中信建投	29,984,009.97	89.96%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	83,835.72	0.25%	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	3,261,846.18	9.79%	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-

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	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2023-07-19
2	国泰基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2023-07-22
3	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2023-09-08
4	国泰基金管理有限公司关于董事长变更及总经理代为履行董事长职务的公告	《中国证券报》	2023-09-28

§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	2023年03月31日至2023年07月26日	17,455,922.91	116,513,706.88	133,969,629.79	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复
- 2、国泰国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 3、国泰国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

13.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦15-20层。

基金托管人住所。

13.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇二四年三月二十九日