

泰康科技创新一年定期开放混合型  
证券投资基金  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现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。

本报告财务资料已经审计。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，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期为 2023 年 1 月 1 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 .....	6
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>7</b>
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 其他指标 .....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
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 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	15
<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 .....	16
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表 .....	18
7.2 利润表 .....	19
7.3 净资产变动表 .....	20
7.4 报表附注 .....	22
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>64</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	64

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	64
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 .....	65
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 .....	74
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 .....	74
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 .....	74
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 .....	74
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 .....	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	75
8.14 投资组合报告附注 .....	75
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>76</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	76
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	76
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	76
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>77</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>78</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	78
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 .....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	78
11.4 基金投资策略的改变 .....	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	78
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 .....	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	78
11.8 其他重大事件 .....	80
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>83</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 .....	83
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	83
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>84</b>
13.1 备查文件目录 .....	84
13.2 存放地点 .....	84
13.3 查阅方式 .....	84

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金
基金简称	泰康科技创新一年定开混合
基金主代码	009490
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020 年 9 月 10 日
基金管理人	泰康基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	168,500,955.64 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于科技创新主题相关行业和企业，通过精选股票和严格的风险控制，力争实现超过业绩比较基准的长期回报。
投资策略	<p>本基金在每个封闭运作期，通过基金管理人构建的权益投资决策分析体系（MVPCT 系统）定期评估宏观经济和投资环境，并对全球及国内经济发展进行评估和展望，在此基础上判断未来市场投资环境的变化以及市场发展的主要推动因素与变量，运用泰康量化资产配置模型，根据股票、债券、货币市场工具三种最主要大类资产的预期收益和风险，确定三者的最优配置比例并适时调整。</p> <p>本基金所界定的科技创新企业是指坚持面向世界科技前沿、面向经济主战场、面向国家重大需求，主要服务于符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的企业，重点关注新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保、生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业。本基金采用自上而下与自下而上相结合的方法，筛选符合主题要求的优质股票并构建投资组合，具体而言：根据科技创新主题相关各行业的特征，从行业发展周期、行业景气度、行业竞争格局、行业发展速度、行业发展趋势与市场空间、国家科技及产业政策影响程度等多维度评价各行业的投资价值，挑选出发展态势良好、具备技术深度或受益于国家科技及产业政策的重点配置行业；通过定量分析和定性分析，自下而上地精选具有业绩支撑、估值合理、符合科技创新主题的相关上市公司股票进行投资。根据基金流动性管理及策略性投资的需要，本基金将进行国债、金融债、企业债等固定收益证券以及可转换债券的投资。在风险可控的前提下，本基金将本着谨慎原则以套期保值为主要目的适度参与股指期货和国债期货投资。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*70%+恒生指数收益率*10%+中债新综合全价(总值)指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高

	<p>于债券型基金与货币市场基金。</p> <p>本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，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，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。</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		泰康基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈玮光	任航
	联系电话	010-89620366	010-66060069
	电子邮箱	tkfchenwg06@tkfunds.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4001895522	95599
传真		010-89620100	010-68121816
注册地址		北京市西城区复兴门内大街 156 号 3 层 1-10 内 302	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 3、5 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100033	100031
法定代表人		金志刚	谷澍

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.tkfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人办公地、基金托管人的住所

### 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)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	泰康基金管理有限公司	北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 3、5 层

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-23,796,314.39	-96,492,402.88	123,751,605.60
本期利润	-18,297,237.78	-106,668,330.98	88,623,595.31
加权平均基金份额本期利润	-0.0772	-0.4010	0.2773
本期加权平均净值利润率	-8.86%	-39.88%	22.99%
本期基金份额净值增长率	-7.91%	-31.11%	16.60%
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	-31,032,473.45	-28,438,807.92	77,233,421.82
期末可供分配基金份额利润	-0.1842	-0.1141	0.2859
期末基金资产净值	137,468,482.19	220,902,729.46	347,403,378.12
期末基金份额净值	0.8158	0.8859	1.2859
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	-18.42%	-11.41%	28.59%

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）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。

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

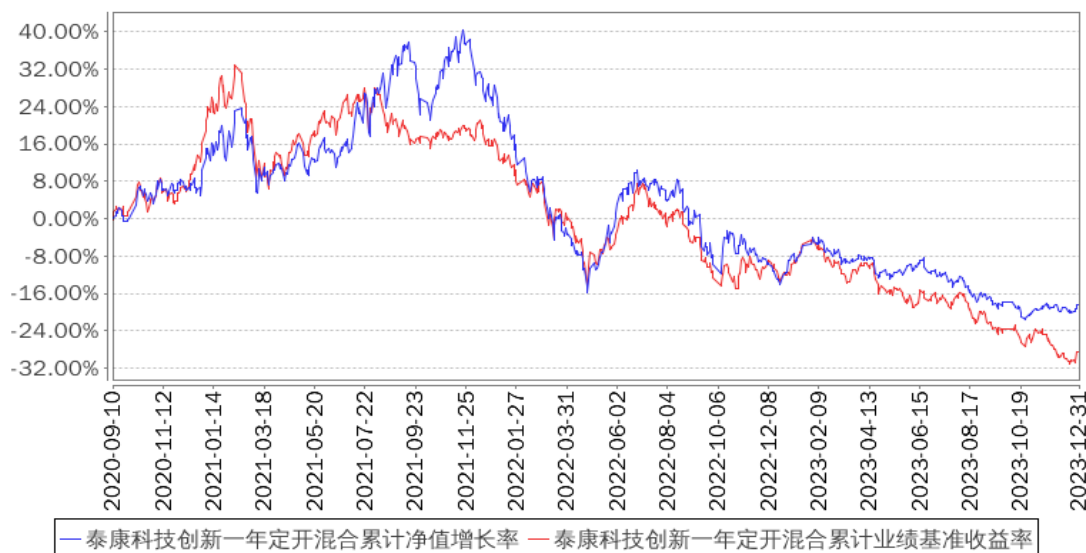
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.72%	0.53%	-6.31%	0.93%	5.59%	-0.40%
过去六个月	-8.14%	0.62%	-13.96%	0.89%	5.82%	-0.27%
过去一年	-7.91%	0.70%	-18.55%	0.89%	10.64%	-0.19%
过去三年	-26.02%	1.29%	-38.28%	1.18%	12.26%	0.11%
自基金合同生效起至今	-18.42%	1.27%	-28.36%	1.17%	9.94%	0.10%

### 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

泰康科技创新一年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



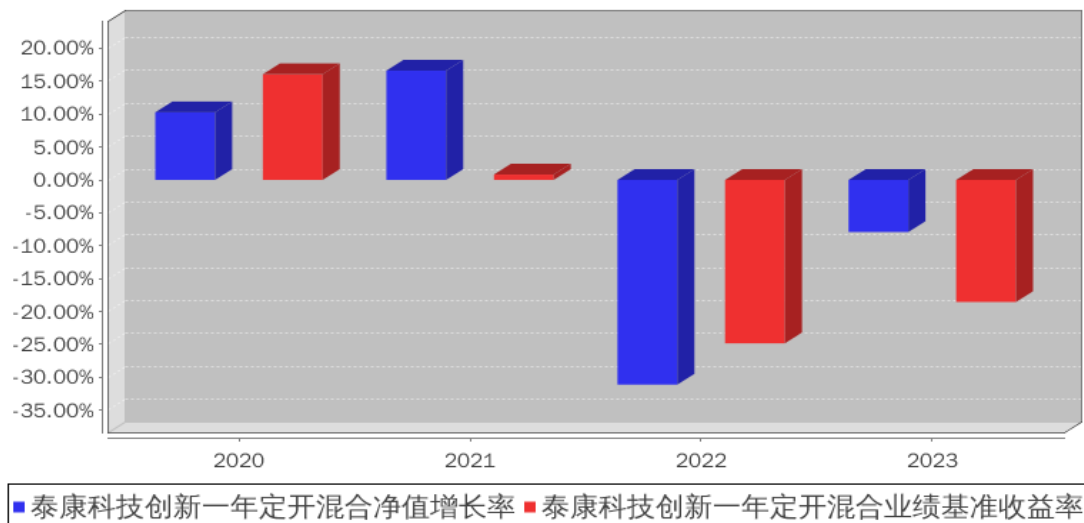
注：1、本基金基金合同于 2020 年 09 月 10 日生效。

2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。



### 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

泰康科技创新一年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：本基金成立于 2020 年 09 月 10 日，2020 年度净值增长率的计算期间为 2020 年 09 月 10 日至 2020 年 12 月 31 日。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 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

泰康基金管理有限公司（以下简称“泰康基金”）前身为泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）公募事业部，2015年4月，泰康资产公募基金管理业务资格正式获得监管机构批准，成为首家获得该业务资格的保险资产管理公司。2021年9月1日，泰康资产获得证监会批准设立子公司泰康基金，2021年10月12日，泰康基金完成工商注册。2022年11月18日，泰康资产旗下公募基金产品的基金管理人变更为泰康基金。

泰康基金注册地为北京，注册资本为1.2亿元人民币。截至2023年12月31日，泰康基金共管理77只证券投资基金，已形成包括货币、债券、偏债混合、偏股混合、主动权益、沪港深系列、主动量化及被动指数、FOF基金等不同类型、不同风险收益特征的产品系列，并在养老目标基金、宽基及细分行业主题ETF、双碳、科技、大健康等方面均进行了战略布局，为广大投资者提供了丰富多元的投资选择。

#### 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		
金宏伟	本基金基金经理	2020年9月10日	-	12年	金宏伟于2016年12月加入泰康公募，现任泰康基金股票基金经理。曾任中钢集团工程总包项目经理、工程师、国际商务师，新华基金管理有限公司行业研究员、中上游行业组长、中游及TMT行业组长、研究部总监助理、专户投资部投资经理等职务。2017年8月28日至2023年2月7日担任泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年8月28日至2019年5月9日担任泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020年7月2日至今担任泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020年7月24日至今担任泰康颐享混合型证券投资基金基金经理。2020年9月10日至今担任泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金经理。2021年12月7日至2024年1月5日担任泰康裕泰债券型证券投资基金基金经理。2022年6月1日至今担任泰康招享混合型证券投资

					资基金基金经理。2022 年 9 月 29 日至今担任泰康景气行业混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

## 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相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了公平交易制度和流程，并按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的相关规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源，保证各投资组合获得公平的交易机会。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。在投资管理活动中，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

本报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，2023 年是压力逐步呈现的一年，年初由于疫情放开有一定修复，但在此后房地产和消费等压力凸显。四季度通过增发特别国债等方式对冲了经济下行，但全年通胀偏低迷的情况延续。

权益市场方面，进入 2023 年，随着疫情高峰度过，经济运行恢复常态化，下半年经济发展趋弱，全年逆周期调节持续，信用政策持续宽松，货币整体合理充裕，财政政策刺激加码，国际环境变化较多，中美是有管控的竞争，在此背景下，2023 年全年市场先涨后跌，整体震荡下跌。从大盘和板块上来看，全年上证综指下跌 3.70%，沪深 300 下跌 11.38%，创业板指下跌 19.41%。板块间波动较大，其中，通信、传媒、计算机、电子等上涨较多，美容护理、商贸零售、房地产、电力设备等下跌较多。

权益投资方面，在 2023 年，基金在仓位上相机抉择，一季度较高仓位，二季度降低仓位，下半年整体保持较低仓位。在行业配置上，全年以通信、计算机、电网设备、传媒、汽车和生物医药等为主，适当配置其他优质个股，总的来说，上半年更偏高成长个股，下半年高成长个股和有一定业绩增长的高股息个股相结合。展望未来，站在中期的维度，中国终将转型到高质量发展的道路，股市有结构性机会，科技发展、政策支持、行业景气和低估值高分红是市场重点关注的方向。本基金投资坚持“自下而上为主、自上而下为辅”的策略，寻找估值、增速和公司及行业前景相匹配的个股进行配置。

固收投资方面，在本期，基金配置了部分科技创新相关企业低风险短债，增强基金收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.8158 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.91%；同期业绩比较基准增长率为-18.55%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，宏观经济实际增速可能震荡筑底，力保 GDP 目标实现，但名义 GDP 的压力或将持续较大，改善通胀预期和微观主体盈利的挑战较大。居民部门面临着资产负债表需要修复的约束，房地产和消费信心都需要提振。政策在 2024 年将继续扮演较为关键的角色。

权益市场历经过去几年及 2024 年初的调整，整体具备较高的性价比；但经济复苏，投资者信心，市场风险偏好等方面的修复还需要一段时间，我们将密切关注政策及经济景气度等方面的变化。

展望 2024 年，逆周期调节持续但不激进，货币相对宽松，经济继续低速增长，AI 为代表的科

技影响继续，海外市场和国际关系不确定性继续，24 年初市场经历了一波明显的回调，股市处于一个比较有投资价值的位置，综合起来，市场震荡上行概率较大，同时也体现为结构上的变化，仓位上相机而动，行业上重点关注生物医药、TMT、高端装备等行业和部分比如科技创新企业中低估值高分红个股，相对均衡策略。

固收投资方面，展望 2024 年，会根据权益市场和固收市场情况，在权益低配的时候，会适当配置科技创新相关企业的低风险短债。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：

本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，定期与不定期地对基金的投资、交易、产品、市场销售、信息技术等方面进行事前、事中或事后的监督检查。

同时，公司在产品开发、销售募集、投资交易、运营管理等业务环节，进行事前合规性审核，以有效防范业务风险；公司通过投资交易系统控制和人工审核控制相结合的方式，对基金投资交易情况进行监督，以确保基金投资满足监管法规、基金合同和公司制度的规定；公司设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；公司监察稽核人员日常对基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并定期向风险控制委员会报告。

#### 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，设有估值小组，并制定了相关制度及流程。估值小组设成员若干名，成员由各相关部门选派，包括运营管理部、风险控制部、各投资部门（包括固定收益投资部、权益投资部、量化投资部、FOF 及多资产配置部）、监察稽核部等。估值小组成员具有一定的工作经验及专业胜任能力。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间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。

与估值相关的机构包括上海、深圳、北京证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国基金业协会等。

本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管人复核确认。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本报告期本基金未进行利润分配。

#### 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

本报告期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基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 25506 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	泰康科技创新一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>我们审计了泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“泰康科技创新一年定开混合”)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,公允反映了泰康科技创新一年定开混合 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,我们独立于泰康科技创新一年定开混合,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>泰康科技创新一年定开混合的基金管理人泰康基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估泰康科技创新一年定开混合的持续经营能力,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泰康科技创新一年定开混合、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督泰康科技创新一年定开混合的</p>



	财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对泰康科技创新一年定开混合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泰康科技创新一年定开混合不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	赵钰	陈玉珊
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼	
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：泰康科技创新一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	16,699,772.72	3,702,819.40
结算备付金		1,777,709.18	8,786,436.15
存出保证金		187,721.44	291,220.25
交易性金融资产	7.4.7.2	128,734,259.43	206,789,343.70
其中：股票投资		109,261,498.67	206,520,403.09
基金投资		-	-
债券投资		19,472,760.76	268,940.61
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	-1,160.55	7,999,170.74
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		12,658,795.52	1,488,126.65
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		160,057,097.74	229,057,116.89
<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		-	-
应付清算款		21,884,985.49	7,414,113.82
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		138,588.49	282,607.87
应付托管费		23,098.09	47,101.31
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,720.02	0.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	540,223.46	410,563.74
负债合计		22,588,615.55	8,154,387.43
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	168,500,955.64	249,341,537.38
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-31,032,473.45	-28,438,807.92
净资产合计		137,468,482.19	220,902,729.46
负债和净资产总计		160,057,097.74	229,057,116.89

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8158 元，基金份额总额 168,500,955.64 份。

## 7.2 利润表

会计主体：泰康科技创新一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>		-14,681,407.11	-101,749,956.54
1. 利息收入		587,580.84	584,104.49
其中：存款利息收入	7.4.7.13	194,571.24	183,907.49
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		393,009.60	400,197.00
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-20,768,086.37	-92,158,133.15
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-23,494,954.08	-94,741,520.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	206,522.67	745,690.99
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-

衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	2,520,345.04	1,837,696.00
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	5,499,076.61	-10,175,928.10
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	21.81	0.22
<b>减：二、营业总支出</b>		3,615,830.67	4,918,374.44
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,916,600.29	4,019,691.51
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	486,099.97	669,948.53
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		6,271.93	-
其中：卖出回购金融资产支出		6,271.93	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		503.86	1.84
8. 其他费用	7.4.7.23	206,354.62	228,732.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-18,297,237.78	-106,668,330.98
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-18,297,237.78	-106,668,330.98
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-18,297,237.78	-106,668,330.98

### 7.3 净资产变动表

会计主体：泰康科技创新一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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	249,341,537.38	-	-28,438,807.92	220,902,729.46

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	249,341,537.38	-	-28,438,807.92	220,902,729.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-80,840,581.74	-	-2,593,665.53	-83,434,247.27
(一)、综合收益总额	-	-	-18,297,237.78	-18,297,237.78
(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)	-80,840,581.74	-	15,703,572.25	-65,137,009.49
其中：1. 基金申购款	565,108.92	-	-110,002.07	455,106.85
2. 基金赎回款	-81,405,690.66	-	15,813,574.32	-65,592,116.34
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	168,500,955.64	-	-31,032,473.45	137,468,482.19
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	270,169,956.30	-	77,233,421.82	347,403,378.12
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	270,169,956.30	-	77,233,421.82	347,403,378.12

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-20,828,418.92	-	105,672,229.74	-126,500,648.66
(一)、综合收益总额	-	-	106,668,330.98	-106,668,330.98
(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)	-20,828,418.92	-	996,101.24	-19,832,317.68
其中：1. 基金申购款	1,513,989.33	-	-68,563.34	1,445,425.99
2. 基金赎回款	-22,342,408.25	-	1,064,664.58	-21,277,743.67
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	249,341,537.38	-	-28,438,807.92	220,902,729.46

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：

金志刚

金志刚

李俊佑

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

泰康科技创新一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[2020]691号《关于准予泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》核准,由泰康资产管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康科技创新一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，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 354,216,950.91 元，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2000705 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 9 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 354,324,259.84 份基金份额，其中认购资金利息折合 107,308.93 份基金份额。本基金的基金管理人为泰康基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市交易的股票(包括中小板、创业板、科创板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(“港股通标的股票”)、股指期货、国债期货、债券资产(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、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、同业存单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。本基金可根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：在封闭期内，股票投资占基金资产比例为 60%-100%(开放期前一个月和后一个月以及开放期内不受该比例限制)，其中投资于本基金定义的科技创新主题证券不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；在开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；封闭期内不受前述 5%限制，但封闭期内每个交易日日终，在扣除股指期货合约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；前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成分指数收益率\*70%+中证港股通 TMT 主题投资指数收益率\*10%+中债新综合全价(总值)指数收益率\*20%。

本财务报表由本基金的基金管理人泰康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》、《泰康科技创新一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;对于以摊余成本计量的金融资产和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确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

以摊余成本计量的金融资产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

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

##### 1. 估值方法及关键假设

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。

##### 2. 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。

#### 7.4.5 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[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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。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。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	16,699,772.72	3,702,819.40
等于：本金	16,695,682.52	3,696,309.11
加：应计利息	4,090.20	6,510.29
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	16,699,772.72	3,702,819.40

## 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		107,042,245.17	-	109,261,498.67	2,219,253.50
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	255,000.00	119.61	291,482.61	36,363.00
	银行间市场	19,038,225.41	121,978.15	19,181,278.15	21,074.59
	合计	19,293,225.41	122,097.76	19,472,760.76	57,437.59
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		126,335,470.58	122,097.76	128,734,259.43	2,276,691.09
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		209,756,609.61	-	206,520,403.09	-3,236,206.52
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	255,000.00	119.61	268,940.61	13,821.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	255,000.00	119.61	268,940.61	13,821.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		210,011,609.61	119.61	206,789,343.70	-3,222,385.52

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

## 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

## 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。



## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-1,160.55	-
银行间市场	-	-
合计	-1,160.55	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,999,170.74	-
银行间市场	-	-
合计	7,999,170.74	-

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

无。

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	495,723.46	366,063.74
其中：交易所市场	495,375.96	366,063.74
银行间市场	347.50	-
应付利息	-	-
预提费用	44,500.00	44,500.00
合计	540,223.46	410,563.74

## 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	249,341,537.38	249,341,537.38
本期申购	565,108.92	565,108.92
本期赎回（以“-”号填列）	-81,405,690.66	-81,405,690.66
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	168,500,955.64	168,500,955.64

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 7.4.7.11 其他综合收益

无。

## 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,757,569.83	-38,196,377.75	-28,438,807.92
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	9,757,569.83	-38,196,377.75	-28,438,807.92
本期利润	-23,796,314.39	5,499,076.61	-18,297,237.78
本期基金份额交易产生的变动数	5,214,131.71	10,489,440.54	15,703,572.25
其中：基金申购款	-36,623.78	-73,378.29	-110,002.07
基金赎回款	5,250,755.49	10,562,818.83	15,813,574.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,824,612.85	-22,207,860.60	-31,032,473.45

#### 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	135,567.40	111,087.04
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	55,519.04	67,497.78
其他	3,484.80	5,322.67
合计	194,571.24	183,907.49

#### 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	-23,494,954.08	-94,741,520.14
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	-23,494,954.08	-94,741,520.14

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

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

卖出股票成交总额	1,607,614,453.36	2,197,457,337.13
减：卖出股票成本总额	1,626,824,444.85	2,288,168,088.52
减：交易费用	4,284,962.59	4,030,768.75
买卖股票差价收入	-23,494,954.08	-94,741,520.14

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 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	163,630.20	687.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	42,892.47	745,003.30
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	206,522.67	745,690.99

##### 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	42,640,336.95	2,395,357.48
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	42,199,985.20	1,649,700.00
减：应计利息总额	396,207.38	590.76
减：交易费用	1,251.90	63.42
买卖债券差价收入	42,892.47	745,003.30

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 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

无。

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 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

无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股票投资产生的股利 收益	2,520,345.04	1,837,696.00

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	2,520,345.04	1,837,696.00

#### 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	5,499,076.61	-10,175,928.10
股票投资	5,455,460.02	-10,189,749.10
债券投资	43,616.59	13,821.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价 值变动产生的预估增值税	-	-
合计	5,499,076.61	-10,175,928.10

#### 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	-	0.22
基金转换费收入	21.81	-
合计	21.81	0.22

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. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中：申购费补差收取具体情况，视每次转换时的两只基金的费率差异情况而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

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

	月 31 日	日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	21,954.62	28,732.56
债券帐户维护费	24,100.00	18,000.00
其他	300.00	22,000.00
合计	206,354.62	228,732.56

#### 7.4.7.24 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

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
泰康基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人控股股东
嘉兴昱泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴舜泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴祺泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴崇泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴宸泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,916,600.29	4,019,691.51
其中：应支付销售机构的客户维护费	360,400.67	528,843.06
应支付基金管理人的净管理费	2,556,199.62	3,490,848.45

注：自2023年1月1日至2023年8月20日，支付基金管理人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。

根据《关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年8月21日起，支付基金管理人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	486,099.97	669,948.53

注：自2023年1月1日至2023年8月20日，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

根据《关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年8月21日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。



**7.4.10.2.3 销售服务费**

无。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

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

无。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期及上年度可比期间,基金管理人未运用固有资金投资本基金份额。

**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**

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持有本基金份额。

**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
农业银行	16,699,772.72	135,567.40	3,702,819.40	111,087.04

注:本基金的银行存款由基金托管人保管,按银行约定利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况**

无。

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

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股锁定期流通受限	12.05	19.92	131	1,578.55	2,609.52	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股锁定期流通受限	53.63	75.36	41	2,198.83	3,089.76	-
001326	联域股份	2023年11月1日	6个月	新股锁定期流通受限	41.18	48.64	81	3,335.58	3,939.84	-
001358	欣欣新材	2023年12月14日	6个月	新股锁定期流通受限	41.00	44.16	42	1,722.00	1,854.72	-
001378	德冠新材	2023年10月23日	6个月	新股锁定期流通受限	31.68	31.27	134	4,245.12	4,190.18	-
300904	威力传动	2023年8月2日	6个月	新股锁定期流通受限	35.41	61.53	259	9,171.19	15,936.27	-
301172	君逸数码	2023年7月19日	6个月	新股锁定期流通受限	31.33	38.16	316	9,900.28	12,058.56	-
301202	朗	2023	6个月	新股	25.82	31.80	200	5,164.00	6,360.00	-

	威股份	年6月28日		锁定期流通受限						
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股锁定期流通受限	57.88	45.48	159	9,202.92	7,231.32	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股锁定期流通受限	28.88	34.59	202	5,833.76	6,987.18	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股锁定期流通受限	36.90	50.85	144	5,313.60	7,322.40	-
301272	英华特	2023年7月6日	6个月	新股锁定期流通受限	51.39	53.38	139	7,143.21	7,419.82	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股锁定期流通受限	38.13	28.36	299	11,400.87	8,479.64	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股锁定期流通受限	19.99	19.35	412	8,235.88	7,972.20	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新股锁定期流通受限	21.00	22.23	301	6,321.00	6,691.23	-
301348	蓝箭电子	2023年8月1日	6个月	新股锁定期流通受限	18.08	44.57	414	7,485.12	18,451.98	-

301362	民爆光电	2023年7月27日	6个月	新股锁定期流通受限	51.05	38.52	205	10,465.25	7,896.60	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股锁定期流通受限	55.68	37.58	117	6,514.56	4,396.86	-
301381	赛维时代	2023年7月5日	6个月	新股锁定期流通受限	20.45	29.69	426	8,711.70	12,647.94	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股锁定期流通受限	67.68	59.37	101	6,835.68	5,996.37	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股锁定期流通受限	26.68	18.69	338	9,017.84	6,317.22	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股锁定期流通受限	33.25	58.19	110	3,657.50	6,400.90	-
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股锁定期流通受限	51.88	50.20	117	6,069.96	5,873.40	-
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股锁定期流通受限	29.38	59.37	236	6,933.68	14,011.32	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股锁定期流通受限	37.96	30.39	196	7,440.16	5,956.44	-

				限						
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股锁定期流通受限	31.90	39.84	109	3,477.10	4,342.56	-
301468	博盈特焊	2023年7月12日	6个月	新股锁定期流通受限	47.58	30.22	229	10,895.82	6,920.38	-
301469	恒达新材	2023年8月10日	6个月	新股锁定期流通受限	36.58	33.09	204	7,462.32	6,750.36	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定期流通受限	57.66	47.25	158	9,110.28	7,465.50	-
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	新股锁定期流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股锁定期流通受限	39.78	69.09	199	7,916.22	13,748.91	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股锁定期流通受限	41.66	64.11	108	4,499.28	6,923.88	-
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月	新股锁定期流通受限	39.99	38.81	192	7,678.08	7,451.52	-
301499	维科精	2023年7月13日	6个月	新股锁定期流	19.50	28.93	361	7,039.50	10,443.73	-

	密	日		通受限						
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股锁定期流通受限	23.97	20.89	237	5,680.89	4,950.93	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股锁定期流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股锁定期流通受限	10.00	15.85	468	4,680.00	7,417.80	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股锁定期流通受限	16.82	26.68	204	3,431.28	5,442.72	-
301509	金凯生科	2023年7月26日	6个月	新股锁定期流通受限	56.56	62.23	137	7,748.72	8,525.51	-
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新股锁定期流通受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301511	德福科技	2023年8月8日	6个月	新股锁定期流通受限	28.00	22.67	290	8,120.00	6,574.30	-
301515	港通医疗	2023年7月13日	6个月	新股锁定期流通受限	31.16	28.27	175	5,453.00	4,947.25	-
301516	中远	2023年12	6个月	新股锁定	6.87	15.51	446	3,064.02	6,917.46	-

	通	月1日		期流通受限						
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股锁定期流通受限	26.87	43.69	143	3,842.41	6,247.67	-
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股锁定期流通受限	25.75	23.01	287	7,390.25	6,603.87	-
301519	舜禹股份	2023年7月19日	6个月	新股锁定期流通受限	20.93	20.21	296	6,195.28	5,982.16	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股锁定期流通受限	67.88	52.74	83	5,634.04	4,377.42	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股锁定期流通受限	99.57	81.46	58	5,775.06	4,724.68	-
301528	多浦乐	2023年8月17日	6个月	新股锁定期流通受限	71.80	68.91	89	6,390.20	6,132.99	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股锁定期流通受限	36.60	37.88	140	5,124.00	5,303.20	-
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	新股锁定期流通受限	29.50	33.16	222	6,549.00	7,361.52	-
301548	崇	2023	6个月	新股	66.80	58.99	72	4,809.60	4,247.28	-

	德科技	年9月11日		锁定期流通受限						
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股锁定期流通受限	37.56	43.57	142	5,333.52	6,186.94	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股锁定期流通受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股锁定期流通受限	24.22	18.24	241	5,837.02	4,395.84	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股锁定期流通受限	23.23	35.58	174	4,042.02	6,190.92	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股锁定期流通受限	58.08	57.81	44	2,555.52	2,543.64	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股锁定期流通受限	14.23	18.19	144	2,049.12	2,619.36	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股锁定期流通受限	15.32	23.87	119	1,823.08	2,840.53	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股锁定期流通受限	17.38	16.66	146	2,537.48	2,432.36	-



603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股锁定期流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股锁定期流通受限	25.73	24.88	95	2,444.35	2,363.60	-
603296	华勤技术	2023年8月1日	6个月	新股锁定期流通受限	80.80	77.75	95	7,676.00	7,386.25	-
688450	光格科技	2023年7月17日	6个月	新股锁定期流通受限	53.09	36.42	106	5,627.54	3,860.52	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股锁定期流通受限	9.87	12.75	850	8,389.50	10,837.50	-
688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	新股锁定期流通受限	78.99	60.49	164	12,954.36	9,920.36	-
688573	信宇人	2023年8月9日	6个月	新股锁定期流通受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定期流通受限	26.74	38.67	256	6,845.44	9,899.52	-
688592	司南导航	2023年8月7日	6个月	新股锁定期流通受限	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-

				限						
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股锁定 期流通受 限	8.66	11.06	524	4,537.84	5,795.44	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定 期流通受 限	55.00	74.14	122	6,710.00	9,045.08	-
688610	埃科光电	2023年7月10日	6个月	新股锁定 期流通受 限	73.33	51.00	164	12,026.12	8,364.00	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股锁定 期流通受 限	47.29	37.97	122	5,769.38	4,632.34	-
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	新股锁定 期流通受 限	46.77	87.72	130	6,080.10	11,403.60	-
688638	誉辰智能	2023年7月4日	6个月	新股锁定 期流通受 限	83.90	59.68	102	8,557.80	6,087.36	-
688646	逸飞激光	2023年7月21日	6个月	新股锁定 期流通受 限	46.80	36.07	135	6,318.00	4,869.45	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股锁定 期流通受 限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688653	康希通	2023年11月10日	6个月	新股锁定 期流	10.50	15.99	480	5,040.00	7,675.20	-

	信	日		通受限						
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股锁定期流通受限	103.40	78.23	52	5,376.80	4,067.96	-
688671	碧兴物联	2023年8月2日	6个月	新股锁定期流通受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新股锁定期流通受限	40.83	43.41	128	5,226.24	5,556.48	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股锁定期流通受限	69.98	60.10	88	6,158.24	5,288.80	-

注：1、截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的债券。

2、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。

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

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

5、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。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精选优质投资标的，在有效控制风险前提下保持一定流动性，力求超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

为加强公募基金管理的内部控制，促进诚信、合法、有效经营的内部控制环境，保障基金持有人利益，基金管理人遵照国家有关法律法规，遵循合法合规性原则、全面性原则、审慎性原则和适时性原则，制定了系统完善的内部控制制度。内部控制的主要内容包括投资管理业务控制、市场营销与过户登记业务控制、信息披露控制、监察稽核控制等。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行股份有限公司，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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该

方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约可能性很小；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	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	9,025,362.30	0.00
合计	9,025,362.30	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

#### 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	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00

合计	0.00	0.00
----	------	------

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

#### 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	291,482.61	268,940.61
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	10,155,915.85	0.00
合计	10,447,398.46	268,940.61

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

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	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

#### 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约定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期内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，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金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上市公司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。在本基金开放日，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，本基金主动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。于 2023 年 12 月 31 日，本基金确认的净赎回申请未超过 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、债券投资及买入返售金融资产等。

##### 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	16,699,772.72	-	-	-	16,699,772.72
结算备付金	1,777,709.18	-	-	-	1,777,709.18
存出保证金	187,721.44	-	-	-	187,721.44
交易性金融资产	19,181,278.15	291,482.61	-	-109,261,498.67	128,734,259.43
买入返售金融资产	-1,160.55	-	-	-	-1,160.55
应收清算款	-	-	-	12,658,795.52	12,658,795.52
资产总计	37,845,320.94	291,482.61	-	-121,920,294.19	160,057,097.74
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	138,588.49	138,588.49
应付托管费	-	-	-	23,098.09	23,098.09



应付清算款	-	-	-	21,884,985.49	21,884,985.49
应交税费	-	-	-	1,720.02	1,720.02
其他负债	-	-	-	540,223.46	540,223.46
负债总计	-	-	-	22,588,615.55	22,588,615.55
利率敏感度缺口	37,845,320.94	291,482.61	-	99,331,678.64	137,468,482.19
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	3,702,819.40	-	-	-	3,702,819.40
结算备付金	8,786,436.15	-	-	-	8,786,436.15
存出保证金	291,220.25	-	-	-	291,220.25
交易性金融资产	-	268,940.61	-	-206,520,403.09	206,789,343.70
买入返售金融资产	7,999,170.74	-	-	-	7,999,170.74
应收清算款	-	-	-	1,488,126.65	1,488,126.65
资产总计	20,779,646.54	268,940.61	-	-208,008,529.74	229,057,116.89
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	282,607.87	282,607.87
应付托管费	-	-	-	47,101.31	47,101.31
应付清算款	-	-	-	7,414,113.82	7,414,113.82
应交税费	-	-	-	0.69	0.69
其他负债	-	-	-	410,563.74	410,563.74
负债总计	-	-	-	8,154,387.43	8,154,387.43
利率敏感度缺口	20,779,646.54	268,940.61	-	-199,854,142.31	220,902,729.46

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	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
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）
	市场利率上调 0.25%	-23,134.92	-2,946.92
市场利率下调 0.25%	23,192.84	2,986.60	

#### 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。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有以港币计价的资产折合人民币 2,288,468.52 元，无以外币计价的负债，资产负债表外汇风险敞口净额 2,288,468.52 元（于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有以港币计价的资产折合人民币 15,266,313.67 元，无以外币计价的负债，资产负债表外汇风险敞口净额 15,266,313.67 元）。

假设其他变量不变，仅外币汇率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的股票公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响。若港币相对人民币升值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为 22,884.69 元；若港币相对人民币贬值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为-22,884.69 元（于 2022 年 12 月 31 日，若港币相对人民币升值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为 152,663.14 元；若港币相对人民币贬值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为-152,663.14 元）。

#### 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	-	2,288,468.52	-	2,288,468.52
资产合计	-	2,288,468.52	-	2,288,468.52
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	-	2,288,468.52	-	2,288,468.52
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	-	15,266,313.67	-	15,266,313.67
资产合计	-	15,266,313.67	-	15,266,313.67
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	15,266,313.67	-	15,266,313.67

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅外币汇率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的股票公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
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）
	市场汇率上升1%	22,884.69	152,663.14
	市场汇率下降1%	-22,884.69	-152,663.14

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金采用定性分析与定量分析相结合的分析框架，自上而下灵活配置大类资产，自下而上精选投资标的，在控制风险的前提下集中资金进行优质证券的投资管理，同时进行高效的流动性管理，力争利用主动组合管理获得超过业绩比较基准的收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金在封闭期内，股票投资占基金资产比例为60%-100%（开放期前一个月以及开放期内不受该比例限制），其中投资于本基金定义的科技创新主题证券不低于非现金基金资产的80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%；在开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日期在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；封闭期内不受前述5%限制，但封闭期内每个交易日日终，在扣除股指期货合约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；前述不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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	109,261,498.67	79.48	206,520,403.09	93.49
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	109,261,498.67	79.48	206,520,403.09	93.49

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的权益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）	
		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）
	业绩比较基准中的权益指数上涨5%	4,186,992.29	9,927,749.13
业绩比较基准中的权益指数下跌5%	-4,186,992.29	-9,927,749.13	

#### 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	108,667,006.14	206,019,074.69
第二层次	19,472,760.76	268,940.61
第三层次	594,492.53	501,328.40
合计	128,734,259.43	206,789,343.70

##### 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；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；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	-	501,328.40	501,328.40
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,614,511.59	1,614,511.59

转出第三层次	-	1,095,094.29	1,095,094.29
当期利得或损失总额	-	-426,253.17	-426,253.17
其中：计入损益的利得或损失	-	-426,253.17	-426,253.17
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	594,492.53	594,492.53
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	-	91,000.55	91,000.55
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,989,314.77	1,989,314.77
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	609,879.37	609,879.37
转出第三层次	-	1,880,184.32	1,880,184.32
当期利得或损失总额	-	-217,681.42	-217,681.42
其中：计入损益的利得或损失	-	-217,681.42	-217,681.42
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	501,328.40	501,328.40
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	-	-108,550.97	-108,550.97

注：本基金持有的第三层次的交易性金融资产（若有）均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。本基金从第三层次转出的交易性金融资产（若有）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	采用的估值	不可观察输入值
----	-------	-------	---------

	价值	技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
锁定期股票	594,492.53	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	14.62%-219.88%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
锁定期股票	501,328.40	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	21.27%-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

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，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	109,261,498.67	68.26
	其中：股票	109,261,498.67	68.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,472,760.76	12.17
	其中：债券	19,472,760.76	12.17
	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	-1,160.55	-0.00
	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	18,477,481.90	11.54
8	其他各项资产	12,846,516.96	8.03
9	合计	160,057,097.74	100.00

注：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 2,288,468.52 元，占期末资产净值比例为 1.66%。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	53,791,609.88	39.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,165,751.62	5.21
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	12,647.94	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,625,951.27	32.46
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-



L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	16,767.28	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	5,982.16	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	1,354,320.00	0.99
S	综合	-	-
	合计	106,973,030.15	77.82

### 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（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	1,196,525.00	0.87
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	1,091,943.52	0.79
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	2,288,468.52	1.66

注：以上行业分类标准来源于财汇。

### 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	002270	华明装备	948,375	13,391,055.00	9.74
2	601728	中国电信	2,365,100	12,795,191.00	9.31
3	002063	远光软件	1,683,820	10,406,007.60	7.57
4	600900	长江电力	305,943	7,140,709.62	5.19
5	002179	中航光电	170,203	6,637,917.00	4.83
6	600285	羚锐制药	282,624	4,835,696.64	3.52
7	600941	中国移动	47,100	4,685,508.00	3.41
8	600050	中国联通	939,600	4,115,448.00	2.99
9	000400	许继电气	161,100	3,537,756.00	2.57
10	600406	国电南瑞	156,200	3,486,384.00	2.54
11	603191	望变电气	222,100	3,449,213.00	2.51
12	301171	易点天下	161,800	3,198,786.00	2.33
13	002465	海格通信	220,000	2,827,000.00	2.06

14	000922	佳电股份	266,700	2,739,009.00	1.99
15	002583	海能达	456,200	2,714,390.00	1.97
16	000682	东方电子	303,700	2,444,785.00	1.78
17	688401	路维光电	45,069	1,384,519.68	1.01
18	688631	莱斯信息	39,135	1,379,508.75	1.00
19	301117	佳缘科技	25,300	1,379,103.00	1.00
20	301548	崇德科技	22,490	1,373,762.90	1.00
21	300432	富临精工	130,500	1,370,250.00	1.00
22	000338	潍柴动力	100,200	1,367,730.00	0.99
23	600458	时代新材	148,300	1,365,843.00	0.99
24	001330	博纳影业	188,100	1,354,320.00	0.99
25	603707	健友股份	87,600	1,314,000.00	0.96
26	600129	太极集团	28,000	1,300,880.00	0.95
27	688019	安集科技	7,853	1,254,595.28	0.91
28	300039	上海凯宝	182,200	1,211,630.00	0.88
29	01797	东方甄选	47,500	1,196,525.00	0.87
30	002475	立讯精密	32,800	1,129,960.00	0.82
31	00388	香港交易所	4,496	1,091,943.52	0.79
32	300017	网宿科技	91,300	716,705.00	0.52
33	301487	盟固利	867	35,512.32	0.03
34	600886	国投电力	1,900	25,042.00	0.02
35	301348	蓝箭电子	414	18,451.98	0.01
36	300904	威力传动	259	15,936.27	0.01
37	301421	波长光电	236	14,011.32	0.01
38	301510	固高科技	396	13,863.96	0.01
39	301488	豪恩汽电	199	13,748.91	0.01
40	688489	三未信安	290	13,635.80	0.01
41	301381	赛维时代	426	12,647.94	0.01
42	301172	君逸数码	316	12,058.56	0.01
43	688627	精智达	130	11,403.60	0.01
44	688592	司南导航	216	10,914.48	0.01
45	688548	广钢气体	850	10,837.50	0.01
46	301499	维科精密	361	10,443.73	0.01
47	688563	航材股份	164	9,920.36	0.01
48	688582	芯动联科	256	9,899.52	0.01
49	688603	天承科技	122	9,045.08	0.01
50	301191	菲菱科思	98	9,035.60	0.01
51	301509	金凯生科	137	8,525.51	0.01
52	301291	明阳电气	299	8,479.64	0.01
53	688610	埃科光电	164	8,364.00	0.01
54	688573	信宇人	285	8,208.00	0.01
55	301292	海科新源	412	7,972.20	0.01
56	301362	民爆光电	205	7,896.60	0.01

57	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.01
58	688653	康希通信	480	7,675.20	0.01
59	301486	致尚科技	158	7,465.50	0.01
60	301498	乖宝宠物	192	7,451.52	0.01
61	301272	英华特	139	7,419.82	0.01
62	301507	民生健康	468	7,417.80	0.01
63	603296	华勤技术	95	7,386.25	0.01
64	301533	威马农机	222	7,361.52	0.01
65	301261	恒工精密	144	7,322.40	0.01
66	301397	溯联股份	162	7,319.16	0.01
67	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.01
68	301210	金杨股份	159	7,231.32	0.01
69	301295	美硕科技	215	7,135.85	0.01
70	301251	威尔高	202	6,987.18	0.01
71	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.01
72	301489	思泉新材	108	6,923.88	0.01
73	301468	博盈特焊	229	6,920.38	0.01
74	301516	中远通	446	6,917.46	0.01
75	301469	恒达新材	204	6,750.36	0.00
76	301329	信音电子	301	6,691.23	0.00
77	301518	长华化学	287	6,603.87	0.00
78	301511	德福科技	290	6,574.30	0.00
79	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
80	301413	安培龙	110	6,400.90	0.00
81	301202	朗威股份	200	6,360.00	0.00
82	301395	仁信新材	338	6,317.22	0.00
83	301517	陕西华达	143	6,247.67	0.00
84	301568	思泰克	174	6,190.92	0.00
85	301550	斯菱股份	142	6,186.94	0.00
86	301528	多浦乐	89	6,132.99	0.00
87	688638	誉辰智能	102	6,087.36	0.00
88	301393	昊帆生物	101	5,996.37	0.00
89	301519	舜禹股份	296	5,982.16	0.00
90	301456	盘古智能	196	5,956.44	0.00
91	301418	协昌科技	117	5,873.40	0.00
92	688602	康鹏科技	524	5,795.44	0.00
93	688693	锆威特	128	5,556.48	0.00
94	301508	中机认检	204	5,442.72	0.00
95	301529	福赛科技	140	5,303.20	0.00
96	688719	爱科赛博	88	5,288.80	0.00
97	688429	时创能源	249	5,276.31	0.00
98	001311	多利科技	100	4,951.00	0.00
99	301500	飞南资源	237	4,950.93	0.00

100	301515	港通医疗	175	4,947.25	0.00
101	688646	逸飞激光	135	4,869.45	0.00
102	301525	儒竞科技	58	4,724.68	0.00
103	688612	威迈斯	122	4,632.34	0.00
104	301371	敷尔佳	117	4,396.86	0.00
105	301559	中集环科	241	4,395.84	0.00
106	301520	万邦医药	83	4,377.42	0.00
107	301459	丰茂股份	109	4,342.56	0.00
108	001378	德冠新材	134	4,190.18	0.00
109	688657	浩辰软件	52	4,067.96	0.00
110	001326	联域股份	81	3,939.84	0.00
111	688450	光格科技	106	3,860.52	0.00
112	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
113	001306	夏厦精密	41	3,089.76	0.00
114	603119	浙江荣泰	119	2,840.53	0.00
115	603107	上海汽配	144	2,619.36	0.00
116	001239	永达股份	131	2,609.52	0.00
117	603062	麦加芯彩	44	2,543.64	0.00
118	603193	润本股份	146	2,432.36	0.00
119	603927	中科软	80	2,398.40	0.00
120	603276	恒兴新材	95	2,363.60	0.00
121	001358	兴欣新材	42	1,854.72	0.00
122	688212	澳华内镜	3	186.09	0.00
123	600989	宝丰能源	6	88.62	0.00
124	600277	亿利洁能	20	52.60	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	600900	长江电力	73,260,502.01	33.16
2	002063	远光软件	47,010,498.64	21.28
3	600886	国投电力	38,822,298.75	17.57
4	300750	宁德时代	38,283,478.00	17.33
5	600519	贵州茅台	35,427,448.80	16.04
6	300130	新国都	33,125,056.17	15.00
7	002594	比亚迪	31,963,766.00	14.47
8	01024	快手-W	30,950,367.45	14.01
9	601728	中国电信	30,245,186.57	13.69
10	603081	大丰实业	26,817,515.00	12.14
11	002270	华明装备	26,687,006.49	12.08

12	000400	许继电气	24,937,129.81	11.29
13	601318	中国平安	22,080,019.00	10.00
14	000682	东方电子	20,439,553.64	9.25
15	00388	香港交易所	19,319,211.46	8.75
16	300251	光线传媒	16,768,683.00	7.59
17	600406	国电南瑞	16,746,253.80	7.58
18	600941	中国移动	16,735,563.00	7.58
19	002727	一心堂	15,287,550.51	6.92
20	600011	华能国际	14,647,138.00	6.63
21	603636	南威软件	14,463,923.66	6.55
22	300396	迪瑞医疗	13,673,435.35	6.19
23	000977	浪潮信息	13,461,796.00	6.09
24	600845	宝信软件	13,394,035.46	6.06
25	688489	三未信安	13,311,534.48	6.03
26	000402	金融街	13,265,494.00	6.01
27	002011	盾安环境	13,149,962.10	5.95
28	601398	工商银行	12,491,831.00	5.65
29	300291	百纳千成	12,306,183.00	5.57
30	600027	华电国际	11,997,548.00	5.43
31	000338	潍柴动力	11,774,040.00	5.33
32	600674	川投能源	11,676,756.34	5.29
33	01797	东方甄选	11,580,544.10	5.24
34	000568	泸州老窖	11,332,251.98	5.13
35	603309	维力医疗	11,157,391.00	5.05
36	002219	新里程	11,107,381.00	5.03
37	00700	腾讯控股	11,057,561.54	5.01
38	002352	顺丰控股	10,750,714.00	4.87
39	603676	卫信康	10,419,705.08	4.72
40	603338	浙江鼎力	10,400,071.00	4.71
41	000002	万科 A	10,368,369.00	4.69
42	002607	中公教育	10,297,376.00	4.66
43	002410	广联达	9,978,835.00	4.52
44	688663	新风光	9,938,779.72	4.50
45	600131	国网信通	9,802,127.00	4.44
46	601601	中国太保	9,394,753.00	4.25
47	688121	卓然股份	8,976,508.29	4.06
48	600973	宝胜股份	8,927,426.36	4.04
49	688111	金山办公	8,731,011.72	3.95
50	600839	四川长虹	8,630,541.00	3.91
51	601628	中国人寿	8,343,444.00	3.78
52	002179	中航光电	8,261,860.04	3.74
53	002531	天顺风能	8,230,521.83	3.73
54	000560	我爱我家	8,204,432.00	3.71

55	300026	红日药业	7,987,488.03	3.62
56	000739	普洛药业	7,428,579.00	3.36
57	002737	葵花药业	7,213,857.00	3.27
58	603191	望变电气	7,139,032.00	3.23
59	002658	雪迪龙	7,076,042.00	3.20
60	300634	彩讯股份	6,943,775.40	3.14
61	300682	朗新集团	6,849,543.77	3.10
62	002970	锐明技术	6,823,461.00	3.09
63	688023	安恒信息	6,689,123.03	3.03
64	603368	柳药集团	6,597,316.40	2.99
65	300773	拉卡拉	6,597,157.00	2.99
66	301391	卡莱特	6,556,915.08	2.97
67	300687	赛意信息	6,482,652.00	2.93
68	600030	中信证券	6,470,260.00	2.93
69	688147	微导纳米	6,421,349.19	2.91
70	002276	万马股份	6,398,612.00	2.90
71	600550	保变电气	6,239,060.84	2.82
72	600498	烽火通信	6,234,012.30	2.82
73	002475	立讯精密	6,215,038.00	2.81
74	000997	新大陆	6,076,241.00	2.75
75	001311	多利科技	5,928,481.13	2.68
76	002949	华阳国际	5,916,567.00	2.68
77	002606	大连电瓷	5,901,619.00	2.67
78	300003	乐普医疗	5,817,507.61	2.63
79	600765	中航重机	5,708,412.38	2.58
80	002180	纳思达	5,470,882.00	2.48
81	601179	中国西电	5,470,834.00	2.48
82	002597	金禾实业	5,366,503.00	2.43
83	600399	抚顺特钢	5,321,324.00	2.41
84	600970	中材国际	5,180,950.64	2.35
85	300382	斯莱克	5,168,977.00	2.34
86	601689	拓普集团	5,067,180.00	2.29
87	003025	思进智能	5,041,153.12	2.28
88	600872	中炬高新	4,925,646.00	2.23
89	600761	安徽合力	4,761,617.20	2.16
90	600809	山西汾酒	4,758,890.00	2.15
91	600285	羚锐制药	4,754,272.60	2.15
92	688168	安博通	4,724,326.63	2.14
93	601528	瑞丰银行	4,722,114.00	2.14
94	600486	扬农化工	4,701,552.00	2.13
95	000065	北方国际	4,530,090.00	2.05
96	600383	金地集团	4,515,117.00	2.04
97	002850	科达利	4,502,407.00	2.04

98	300498	温氏股份	4,501,165.00	2.04
99	002468	申通快递	4,487,183.00	2.03
100	300095	华伍股份	4,471,744.00	2.02
101	00268	金蝶国际	4,429,159.01	2.01
102	688170	德龙激光	4,425,798.69	2.00

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	67,369,009.55	30.50
2	002063	远光软件	51,587,595.16	23.35
3	600886	国投电力	39,909,755.14	18.07
4	600519	贵州茅台	38,719,207.97	17.53
5	300750	宁德时代	37,095,233.00	16.79
6	300130	新国都	34,645,044.55	15.68
7	002594	比亚迪	31,774,199.90	14.38
8	01024	快手-W	27,123,434.45	12.28
9	603081	大丰实业	26,594,771.26	12.04
10	600973	宝胜股份	26,278,533.38	11.90
11	601318	中国平安	25,631,550.00	11.60
12	000400	许继电气	22,540,349.25	10.20
13	002531	天顺风能	21,226,774.80	9.61
14	00388	香港交易所	21,029,199.41	9.52
15	688489	三未信安	20,557,820.08	9.31
16	00700	腾讯控股	18,558,168.60	8.40
17	002270	华明装备	17,929,876.70	8.12
18	002011	盾安环境	17,703,676.58	8.01
19	300443	金雷股份	16,662,786.02	7.54
20	000682	东方电子	16,157,023.15	7.31
21	300251	光线传媒	15,856,714.00	7.18
22	601728	中国电信	15,815,296.00	7.16
23	000568	泸州老窖	15,786,312.00	7.15
24	300396	迪瑞医疗	14,925,175.00	6.76
25	603636	南威软件	14,534,187.00	6.58
26	000739	普洛药业	14,365,065.90	6.50
27	002727	一心堂	14,191,601.44	6.42
28	000977	浪潮信息	14,009,036.00	6.34
29	600845	宝信软件	13,932,789.08	6.31
30	600406	国电南瑞	13,712,659.16	6.21

31	600011	华能国际	13,608,727.00	6.16
32	300291	百纳千成	12,802,308.00	5.80
33	000402	金融街	12,797,635.00	5.79
34	600941	中国移动	12,601,923.00	5.70
35	601398	工商银行	12,345,819.00	5.59
36	000338	潍柴动力	11,861,218.00	5.37
37	600674	川投能源	11,545,952.77	5.23
38	002607	中公教育	11,287,617.00	5.11
39	600131	国网信通	10,998,355.00	4.98
40	601628	中国人寿	10,749,191.71	4.87
41	300095	华伍股份	10,532,962.00	4.77
42	600027	华电国际	10,248,314.88	4.64
43	603676	卫信康	10,212,797.02	4.62
44	300003	乐普医疗	9,856,063.00	4.46
45	000002	万科A	9,727,610.50	4.40
46	603338	浙江鼎力	9,698,873.00	4.39
47	002352	顺丰控股	9,672,206.36	4.38
48	002219	新里程	9,482,912.00	4.29
49	601601	中国太保	9,435,039.00	4.27
50	603309	维力医疗	9,102,206.88	4.12
51	688663	新风光	9,093,802.92	4.12
52	600839	四川长虹	8,594,297.00	3.89
53	01797	东方甄选	8,445,706.05	3.82
54	000560	我爱我家	8,336,245.00	3.77
55	688111	金山办公	8,292,867.81	3.75
56	600233	圆通速递	8,232,007.25	3.73
57	002276	万马股份	8,172,067.52	3.70
58	688147	微导纳米	8,135,707.62	3.68
59	300760	迈瑞医疗	8,091,134.00	3.66
60	000999	华润三九	7,634,388.89	3.46
61	002410	广联达	7,594,466.00	3.44
62	300498	温氏股份	7,586,190.00	3.43
63	300773	拉卡拉	7,454,949.00	3.37
64	688121	卓然股份	7,349,974.48	3.33
65	600030	中信证券	7,212,796.25	3.27
66	300026	红日药业	7,164,234.53	3.24
67	002737	葵花药业	7,141,476.45	3.23
68	002658	雪迪龙	7,125,885.00	3.23
69	601939	建设银行	7,099,634.00	3.21
70	002468	申通快递	6,983,382.00	3.16
71	603985	恒润股份	6,938,800.10	3.14
72	600498	烽火通信	6,666,483.00	3.02
73	688023	安恒信息	6,621,377.44	3.00



74	301391	卡莱特	6,564,700.68	2.97
75	002970	锐明技术	6,326,630.00	2.86
76	000028	国药一致	6,171,924.00	2.79
77	300682	朗新集团	6,132,860.00	2.78
78	002949	华阳国际	5,918,451.00	2.68
79	001311	多利科技	5,851,890.25	2.65
80	603368	柳药集团	5,828,861.00	2.64
81	300687	赛意信息	5,799,695.00	2.63
82	300634	彩讯股份	5,789,594.00	2.62
83	000997	新大陆	5,713,348.00	2.59
84	002606	大连电瓷	5,705,934.00	2.58
85	600550	保变电气	5,514,228.00	2.50
86	600970	中材国际	5,485,282.24	2.48
87	002180	纳思达	5,392,380.00	2.44
88	600765	中航重机	5,361,769.00	2.43
89	601179	中国西电	5,299,860.00	2.40
90	300893	松原股份	5,277,074.00	2.39
91	300861	美畅股份	5,115,669.25	2.32
92	03690	美团-W	5,096,227.54	2.31
93	601528	瑞丰银行	5,027,244.79	2.28
94	002597	金禾实业	5,022,881.00	2.27
95	002475	立讯精密	5,015,023.00	2.27
96	600872	中炬高新	4,999,096.00	2.26
97	600298	安琪酵母	4,967,642.80	2.25
98	601689	拓普集团	4,898,796.00	2.22
99	301117	佳缘科技	4,893,542.82	2.22
100	300382	斯莱克	4,859,208.10	2.20
101	300416	苏试试验	4,842,314.00	2.19
102	688168	安博通	4,805,501.22	2.18
103	000065	北方国际	4,712,443.00	2.13
104	600399	抚顺特钢	4,708,912.00	2.13
105	600435	北方导航	4,451,882.00	2.02
106	600761	安徽合力	4,446,389.00	2.01

注：（1）卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

（2）“卖出金额”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。

#### 8.4.3 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	1,524,110,080.41
卖出股票收入（成交）总额	1,607,614,453.36

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

（2）“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	-	-
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	9,025,362.30	6.57
6	中期票据	10,155,915.85	7.39
7	可转债（可交换债）	291,482.61	0.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	19,472,760.76	14.17

## 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	102101385	21 南电 MTN003	100,000	10,155,915.85	7.39
2	012384238	23 中兴通讯 SCP098	90,000	9,025,362.30	6.57
3	132026	G 三峡 EB2	2,550	291,482.61	0.21

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 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

本报告期内本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	187,721.44
2	应收清算款	12,658,795.52
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	12,846,516.96

### 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	132026	G 三峡 EB2	291,482.61	0.21

### 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

- 1、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。
- 2、报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

## § 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 (%)
4,119	40,908.22	59,834,849.20	35.51	108,666,106.44	64.49

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	221,645.95	0.1315

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年9月10日） 基金份额总额	354,324,259.84
本报告期期初基金份额总额	249,341,537.38
本报告期基金总申购份额	565,108.92
减：本报告期基金总赎回份额	81,405,690.66
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	168,500,955.64

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2023年3月15日，泰康基金管理有限公司成立上海分公司，金志刚担任上海分公司负责人。2023年4月19日，泰康基金管理有限公司成立深圳分公司，金志刚担任深圳分公司负责人。2023年12月3日，金志刚不再担任上海分公司负责人及深圳分公司负责人，并聘任吴辉担任上海分公司负责人，代胜伟担任深圳分公司负责人。

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

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 40,000.00 元；截至 2023 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供审计服务不满 4 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华创证券	2	1,395,603.1	44.72	1,134,830.4	44.91	-

		91.86		3		
国泰君安 证券	2	717,556,280 .77	22.99	578,143.12	22.88	-
招商证券	3	340,471,462 .55	10.91	276,700.61	10.95	-
华泰证券	2	312,727,105 .64	10.02	251,708.78	9.96	-
天风证券	2	235,853,555 .07	7.56	190,089.45	7.52	-
东吴证券	2	118,565,466 .10	3.80	95,677.15	3.79	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易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

交易单元租用券商选择的首要标准为符合监管机构相关规定，包括但不限于满足以下条件：

- (1) 经营行为规范，近一年内无重大违规行为，未受监管机构重大处罚；
- (2) 财务状况和经营状况良好；
- (3) 内部管理规范，具备健全的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能提供质量较高的市场研究报告，并能根据基金投资需求提供专门的研究报告；
- (5) 能及时提供准确的信息资讯服务；
- (6) 满足基金运作的保密要求；
- (7) 符合中国证监会规定的其他条件。

本基金管理人依据以上标准，定期或者不定期对候选券商研究实力和服务质量进行评估，确定租用交易单元的券商，基金管理人与被选择的券商签订相关协议并通知托管行。

3、本报告期内本基金减少租用 31 个交易单元，中信证券上海、深圳、北京证券交易所交易单元各 1 个，中金公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，招商证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，长江证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，兴业证券上海、深圳证券交

易所交易单元各 1 个，天风证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，申万宏源证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，国泰君安证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，广发证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，光大证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东兴证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东吴证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东方证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，安信证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，方正证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个。

### 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(%)
华创证券	109,902.00	4.96	1,854,019,000.00	45.94	-	-
国泰君安证券	2,104,823.00	95.04	1,039,000,000.00	25.75	-	-
招商证券	-	-	421,300,000.00	10.44	-	-
华泰证券	-	-	144,000,000.00	3.57	-	-
天风证券	-	-	380,000,000.00	9.42	-	-
东吴证券	-	-	197,000,000.00	4.88	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 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	泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金 2022 年第四季度报告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 01 月 19 日
2	泰康基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 03 月 17 日
3	泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金 2022 年年度报告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 03 月 30 日
4	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增国金证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 04 月 17 日
5	泰康基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 04 月 21 日
6	泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金 2023 年第一季度报告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 04 月 21 日
7	泰康基金管理有限公司关于旗下部分基金产品风险等级调整的公告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 06 月 28 日
8	泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金 2023 年第二季度报告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 07 月 20 日
9	泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金合同更新	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 08 月 19 日
10	泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金托管协议更新	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 08 月 19 日
11	泰康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	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 08 月 19 日
12	泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 08 月 23 日
13	泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金更新招募说明书（2023 年第 1 次更新）	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 08 月 23 日
14	泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金 2023 年中期报告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 08 月 30 日
15	泰康基金管理有限公司关于终止凤	《证券时报》；中国证	2023 年 09 月 08 日

	鳳金信（海口）基金销售有限公司 办理旗下基金相关销售业务的公告	监会基金电子披露网站 及基金管理人网站	
16	泰康科技创新一年定期开放混合型 证券投资基金 2023 年第三季度报告	《证券时报》；中国证 监会基金电子披露网站 及基金管理人网站	2023 年 10 月 24 日
17	泰康科技创新一年定期开放混合型 证券投资基金开放申购、赎回及转 换业务公告	《证券时报》；中国证 监会基金电子披露网站 及基金管理人网站	2023 年 10 月 30 日
18	关于泰康基金管理有限公司旗下部 分开放式基金参加上海万得基金销 售有限公司转换费率优惠活动的公 告	《证券时报》；中国证 监会基金电子披露网站 及基金管理人网站	2023 年 11 月 08 日
19	关于泰康基金管理有限公司旗下部 分开放式基金参加平安银行股份有 限公司转换费率优惠活动的公告	《证券时报》；中国证 监会基金电子披露网站 及基金管理人网站	2023 年 11 月 27 日
20	关于泰康基金管理有限公司旗下部 分开放式基金参加嘉实财富管理有 限公司转换费率优惠活动的公告	《证券时报》；中国证 监会基金电子披露网站 及基金管理人网站	2023 年 11 月 29 日
21	泰康科技创新一年定期开放混合型 证券投资基金基金产品资料概要更 新	《证券时报》；中国证 监会基金电子披露网站 及基金管理人网站	2023 年 12 月 08 日
22	泰康科技创新一年定期开放混合型 证券投资基金更新招募说明书(2023 年第 2 次更新)	《证券时报》；中国证 监会基金电子披露网站 及基金管理人网站	2023 年 12 月 08 日
23	泰康基金管理有限公司关于深圳分 公司负责人变更的公告	《证券时报》；中国证 监会基金电子披露网站 及基金管理人网站	2023 年 12 月 15 日
24	泰康基金管理有限公司关于上海分 公司负责人及注册地址变更的公告	《证券时报》；中国证 监会基金电子披露网站 及基金管理人网站	2023 年 12 月 16 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

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	20230101-20231108	52,655,975.75	0.00	26,327,987.88	26,327,987.87	15.62
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或者超过 20%时，基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险，以及当管理人确认大额申购与大额赎回时，可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。

### 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

- (一) 中国证监会准予泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金注册的文件；
- (二) 《泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》；
- (四) 《泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- (五) 《泰康科技创新一年定期开放混合型证券投资基金产品资料概要》。

### 13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《证券时报》）或登录基金管理人网站（<http://www.tkfunds.com.cn>）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查阅。

泰康基金管理有限公司

2024年3月29日