

国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资  
基金  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告期自 2023 年 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 .....                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式 .....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料 .....                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....         | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现 .....                              | 7         |
| 3.3 其他指标 .....                                | 10        |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....                       | 10        |
| <b>§ 4 管理人报告</b> .....                        | <b>11</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....                        | 11        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                 | 12        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....             | 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 .....                 | 15        |
| 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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 .....        | 16        |
| 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....      | 16        |
| <b>§ 5 托管人报告</b> .....                        | <b>17</b> |
| 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的真实、准确和完整发表意见 .....      | 17        |
| <b>§ 6 审计报告</b> .....                         | <b>17</b> |
| 6.1 审计报告基本信息 .....                            | 17        |
| 6.2 审计报告的基本内容 .....                           | 17        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b> .....                       | <b>19</b> |
| 7.1 资产负债表 .....                               | 19        |
| 7.2 利润表 .....                                 | 21        |
| 7.3 净资产变动表 .....                              | 22        |
| 7.4 报表附注 .....                                | 24        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b> .....                       | <b>54</b> |

|  |           |
|--|-----------|
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                               | 54        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                         | 54        |
| 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 .....            | 55        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                          | 56        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                         | 60        |
| 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 .....           | 60        |
| 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 .....        | 61        |
| 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 .....        | 61        |
| 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 .....           | 61        |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                          | 61        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....                    | 61        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                                | 61        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                         | <b>62</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                        | 62        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....                     | 62        |
| 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 .....             | 62        |
| 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 ..... | 63        |
| 9.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                          | 63        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>                        | <b>63</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                           | <b>63</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                             | 63        |
| 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 .....             | 63        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....                  | 64        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                               | 64        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                        | 64        |
| 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 .....                | 64        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                       | 64        |
| 11.8 其他重大事件 .....                                  | 67        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>                   | <b>68</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 .....           | 68        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                          | 69        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b>                           | <b>69</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                                  | 69        |
| 13.2 存放地点 .....                                    | 69        |
| 13.3 查阅方式 .....                                    | 69        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                      |                |
|-----------------|----------------------|----------------|
| 基金名称            | 国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 |                |
| 基金简称            | 国金国鑫发起               |                |
| 基金主代码           | 762001               |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式               |                |
| 基金合同生效日         | 2012年8月28日           |                |
| 基金管理人           | 国金基金管理有限公司           |                |
| 基金托管人           | 中国光大银行股份有限公司         |                |
| 报告期末基金份额总额      | 97,660,424.13份       |                |
| 基金合同存续期         | 不定期                  |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 国金国鑫发起 A             | 国金国鑫发起 C       |
| 下属分级基金的交易代码     | 762001               | 009762         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 75,086,051.05份       | 22,574,373.08份 |

注：本基金为发起式基金。

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金通过合理的资产配置和积极的证券选择，追求在严格控制风险的前提下实现资本的长期稳健回报。   |
| 投资策略   | 本基金将根据对宏观经济周期和市场运行阶段的判断来确定投资组合中各大类资产的权重。在权益类资产投资方面，本基金将综合运用定量分析和定性分析手段，精选出具有内在价值和成长潜力的股票来构建股票投资组合。在固定收益类资产投资方面，本基金将深入研究分析宏观经济和利率趋势，选择流动性好，到期收益率与信用质量相对较高的债券品种进行投资。 |
| 业绩比较基准 | 金融机构人民币三年期定期存款基准利率（税后）   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，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          |      | 国金基金管理有限公司          | 中国光大银行股份有限公司                  |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 张静                  | 石立平                           |
|             | 联系电话 | 010-88005695        | 010-63639180                  |
|             | 电子邮箱 | zhangjing@gfund.com | shiliping@cebbank.com         |
| 客户服务电话      |      | 4000-2000-18        | 95595                         |
| 传真          |      | 010-88005666        | 010-63639132                  |
| 注册地址        |      | 北京市怀柔区府前街三号楼 3-6    | 北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心 |

|       |                               |                            |
|-------|-------------------------------|----------------------------|
| 办公地址  | 北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层 | 北京市西城区太平桥大街 25 号<br>中国光大中心 |
| 邮政编码  | 100020                        | 100033                     |
| 法定代表人 | 邵海波                           | 王江                         |

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                 | 办公地址                                |
|--------|--------------------|-------------------------------------|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室 |
| 注册登记机构 | 国金基金管理有限公司         | 北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 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         |               |
|---------------|--------------|--------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
|               | 国金国鑫发起 A     | 国金国鑫发起 C     | 国金国鑫发起 A      | 国金国鑫发起 C      | 国金国鑫发起 A       | 国金国鑫发起 C      |
| 本期已实现收益       | 5,111,665.46 | 4,586,819.26 | 20,384,147.10 | 14,498,217.77 | 122,099,587.87 | 22,394,867.21 |
| 本期利润          | 6,027,271.06 | 4,982,907.21 | 39,931,576.77 | 9,345,372.93  | 13,524,617.62  | 16,404,759.65 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0790      | 0.1466       | -0.5046       | -0.1360       | 0.0590         | 0.3700        |
| 本期加权平均净值利润率   | -6.57%       | 12.24%       | -36.35%       | -10.25%       | 3.12%          | 19.31%        |
| 本期基金份额净值增长率   | -6.87%       | -7.11%       | -23.87%       | -24.05%       | 5.02%          | 4.76%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2023 年末      |              | 2022 年末       |               | 2021 年末        |               |

|              |               |               |               |               |                |               |
|--------------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| 期末可供分配利润     | 7,965,299.90  | 2,194,531.08  | 14,841,063.23 | 10,798,727.27 | 125,620,301.70 | 27,462,475.86 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1061        | 0.0972        | 0.1877        | 0.1812        | 0.8927         | 0.9405        |
| 期末基金资产净值     | 83,051,350.95 | 24,768,904.16 | 93,927,145.83 | 70,403,238.93 | 273,906,518.62 | 56,662,211.52 |
| 期末基金份额净值     | 1.1061        | 1.0972        | 1.1877        | 1.1812        | 1.9465         | 1.9405        |
| 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  | 257.31%       | -8.36%        | 283.67%       | -1.41%        | 403.96%        | 29.81%        |

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. 期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果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（已实现部分相抵未实现部分）。

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

国金国鑫发起 A

| 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 | -6.13%   | 1.42%       | 0.71%      | 0.01%         | -6.84%  | 1.41% |
| 过去六个月 | -19.40%  | 1.42%       | 1.42%      | 0.01%         | -20.82% | 1.41% |
| 过去一年  | -6.87%   | 1.45%       | 2.83%      | 0.01%         | -9.70%  | 1.44% |
| 过去三年  | -25.54%  | 1.48%       | 8.72%      | 0.01%         | -34.26% | 1.47% |

|            |         |       |         |       |         |       |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去五年       | 60.58%  | 1.42% | 14.97%  | 0.01% | 45.61%  | 1.41% |
| 自基金合同生效起至今 | 257.31% | 1.24% | 109.25% | 0.43% | 148.06% | 0.81% |

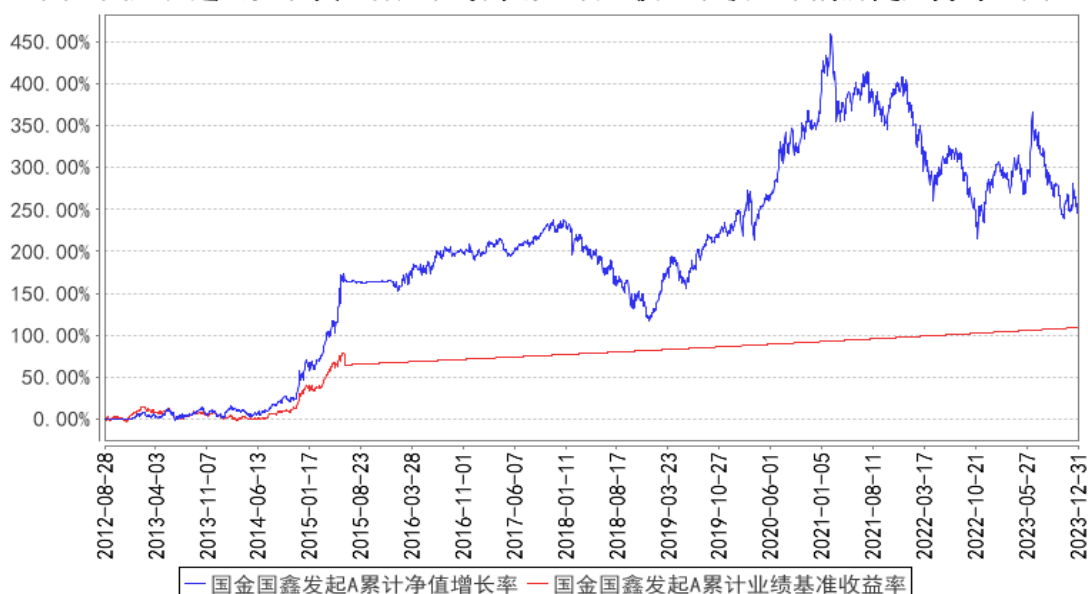
国金国鑫发起 C

| 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      | -6.19%   | 1.42%       | 0.71%      | 0.01%         | -6.90%  | 1.41% |
| 过去六个月      | -19.50%  | 1.42%       | 1.42%      | 0.01%         | -20.92% | 1.41% |
| 过去一年       | -7.11%   | 1.45%       | 2.83%      | 0.01%         | -9.94%  | 1.44% |
| 过去三年       | -26.10%  | 1.48%       | 8.72%      | 0.01%         | -34.82% | 1.47% |
| 自基金合同生效起至今 | -8.36%   | 1.46%       | 10.26%     | 0.01%         | -18.62% | 1.45% |

注：自 2015 年 6 月 22 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%”变更为“金融机构人民币三年期定期存款基准利率(税后)”。

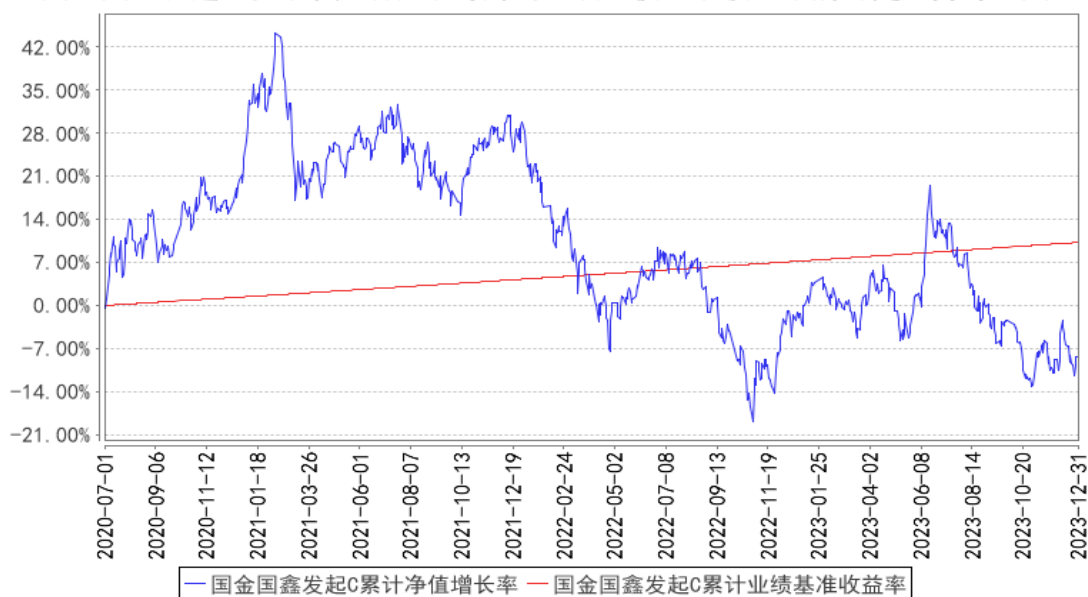
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国金国鑫发起A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





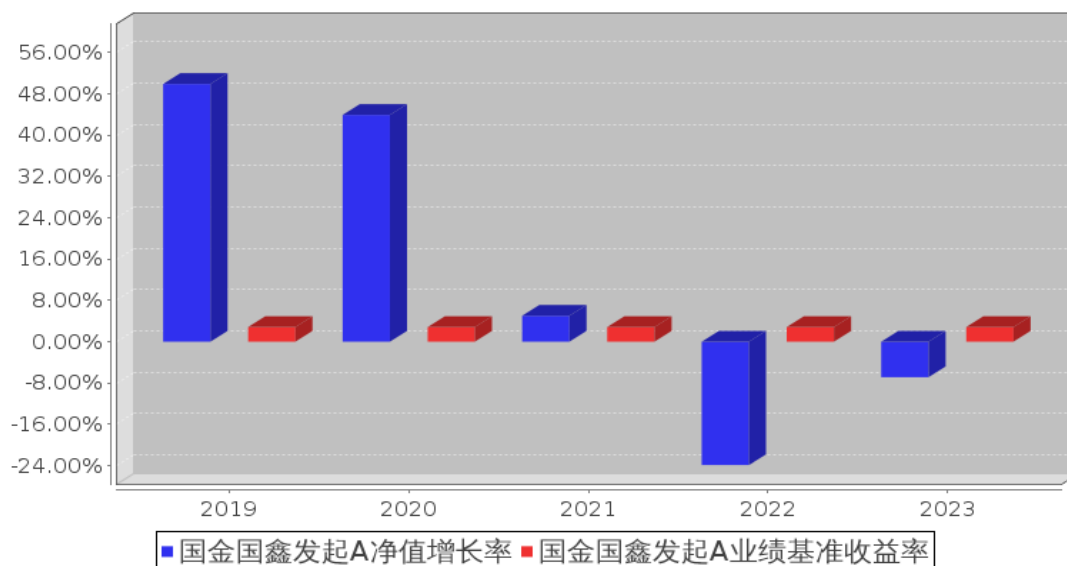
国金国鑫发起C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



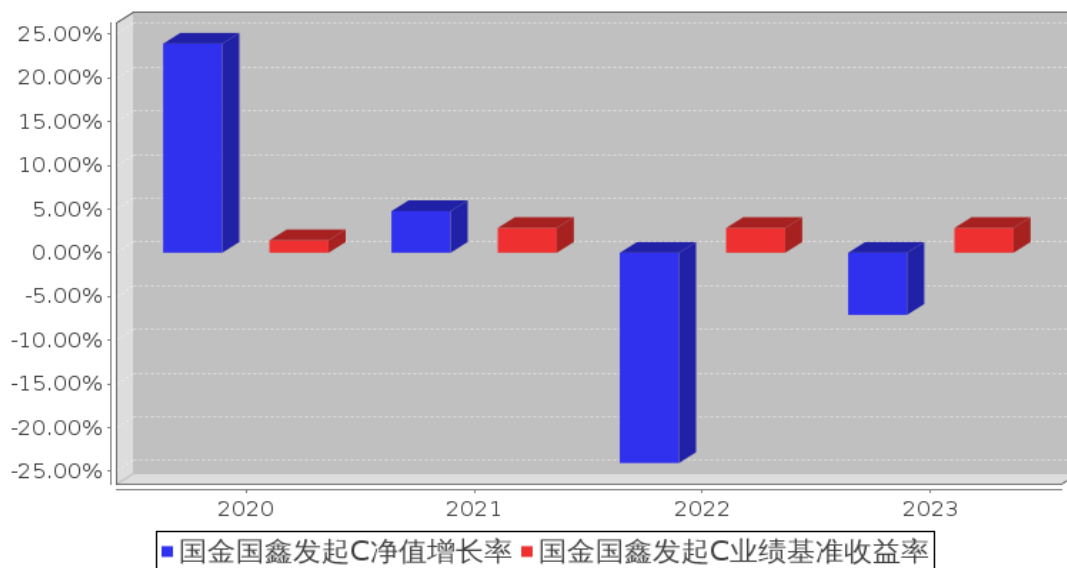
注：本基金 A 类份额基金合同生效日为 2012 年 8 月 28 日，图示日期为 2012 年 8 月 28 日至 2023 年 12 月 31 日；本基金 C 类份额基金合同生效日为 2020 年 7 月 1 日，图示日期为 2020 年 7 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金国鑫发起A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



国金国鑫发起C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 A 类份额基金合同生效日为 2012 年 8 月 28 日，C 类份额基金合同生效日为 2020 年 7 月 1 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

国金国鑫发起 A

| 年度     | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额      | 再投资形式发放总额    | 年度利润分配合计      | 备注 |
|--------|---------------|---------------|--------------|---------------|----|
| 2022 年 | 3.1320        | 12,904,255.73 | 9,751,549.41 | 22,655,805.14 | -  |
| 合计     | 3.1320        | 12,904,255.73 | 9,751,549.41 | 22,655,805.14 | -  |

国金国鑫发起 C

| 年度     | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额      | 再投资形式发放总额  | 年度利润分配合计      | 备注 |
|--------|---------------|---------------|------------|---------------|----|
| 2022 年 | 3.1190        | 38,797,619.61 | 546,637.96 | 39,344,257.57 | -  |
| 合计     | 3.1190        | 38,797,619.61 | 546,637.96 | 39,344,257.57 | -  |

## § 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

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。公司注册资本为3.6亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为51%、19.5%、19.5%、5%、1.5%、1.9%、1.6%。截至2023年12月31日，国金基金管理有限公司共管理28只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深300指数增强证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金惠丰39个月定期开放债券型证券投资基金、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金惠诚债券型证券投资基金、国金ESG持续增长混合型证券投资基金、国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金量化精选混合型证券投资基金、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金、国金中证1000指数增强型证券投资基金、国金中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、国金中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金、国金智享量化选股混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|----------|-----------------|------|--------|--|
|     |          | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 王小刚 | 本基金的基金经理 | 2022年12月28日     | -    | 7年     | 王小刚先生，哥伦比亚大学硕士。2016年9月至2018年3月在国金鼎兴投资有限公司投资管理部担任投资经理，2018年3月至2019年5月在国金证券股份有限公司担任管理培训生，2019年5月至2022年5月在国金证券股份有限公司上海证券自营分公司投资管理部担任投资经理， |

|    |          |                 |                 |      |  |
|----|----------|-----------------|-----------------|------|--|
|    |          |                 |                 |      | 2022 年 5 月至 2022 年 11 月在国金证券股份有限公司上海证券自营分公司投资管理部担任研究员。2022 年 11 月加入国金基金管理有限公司,担任主动权益投资部基金经理。   |
| 吕伟 | 本基金的基金经理 | 2022 年 9 月 17 日 | 2023 年 9 月 28 日 | 16 年 | 吕伟先生,中国社会科学院工商管理硕士。2007 年 9 月至 2021 年 7 月先后在益民基金管理有限公司集中交易部、发展研究部、公募基金部担任交易员、行业研究员、基金经理等职务。2021 年 7 月加入国金基金管理有限公司,现任主动权益投资部总经理兼权益投资总监。 |

注:(1)任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期,首任基金经理的任职日期按基金合同生效日填写;(2)证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

截至本报告期末,不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况,故本项不适用。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》和其他有关法律法规的规定,以及《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《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》及其他相关法律法规,制定了《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

该公平交易管理方法规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行(集中竞价及非集中竞价交易)、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

第一,明确公平交易的原则:(1)信息获取公平原则,不同投资组合经理可公平获得研究成果;(2)交易机会公平原则,不同投资组合经理可获得公平交易执行的机会。

第二，对公募基金和私募资产管理计划等不同类型业务，公司分别设立独立的投资人员；研究团队对所有的投资业务同时提供研究支持；设立独立的基金交易部，实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；设立独立的合规风控部，对研究、投资、交易业务的公平交易进行监控、分析、预警、报告等。

第三，通过岗位设置、制度约束、流程规范、技术手段相结合的方式，实现公平交易的控制，具体如下：（1）总经理、督察长、风险控制委员会负责指导建立公平交易制度，并对公平交易的执行情况进行审核。（2）产品开发：风险分析师根据相关法律法规、公司规章制度以及产品合同的风险控制指标，在投资交易系统中完成风控参数设置，确保做好公平交易的事前控制。（3）研究与投资：投资人员负责在各自的职责及权限范围内从事相应的投资决策行为，其中，投资组合经理需对有可能涉及非公平交易的行为作出合理解释。研究人员负责以客观的研究方法开展研究工作，并根据研究结果建立及维护全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库。研究结果通过策略会、行业及个股报告会、投研平台、邮件系统等共享机制统一开放给所有的投资组合经理，以确保各投资组合享有公平的信息获取机会。（4）交易执行：交易人员负责建立并执行公平的集中交易制度和交易分配制度，合规风控部利用投资交易系统等对交易执行进行实时监控，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（5）事后分析：合规风控部利用公平交易系统对不同投资组合之间的同向、反向交易及交易时机和价差进行事后分析。（6）报告备案：合规风控部根据实时监控及事后分析的结果撰写定期报告，并由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。（7）信息披露环节：信息披露部门在各投资组合的定期报告中，至少披露公司整体公平交易制度执行情况、公平交易执行情况及异常交易行为专项说明等事项。（8）反馈完善：根据事后分析报告及信息披露结果，公平交易各相关部门对相关环节予以不断完善，以确保公平交易的执行日臻完善。（9）监督检查：合规风控部监察稽核人员根据法规规定及公司公平交易制度规定，监督、检查、评价公司公平交易制度执行情况，并提出改进建议。会计师事务所在公司年度内部控制评价报告中对公司公平交易制度的执行情况做出专项评价。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面，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；在交易执行控制方面，通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；在行为监控和分析评估方面，通过 IT 系统和人工监控

等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

截至本报告期末，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况，故本项不适用。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 5 次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

### 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 年中国资本市场出现了显著分化。从经济基本面来看，2023 年一季度预期向好，经济快速修复；而后二季度随着修复脉冲释放，经济动能放缓；三季度稳增长政策陆续出台，叠加补库周期，经济有所好转；四季度地产销售投资的弱趋势愈发明显，经济再度逐月放缓。因此，整体经济的基本面在经历了开年的高预期后转向弱势，导致与宏观经济关联度更高的食品饮料、地产建材、美容护理等行业经历了大幅下跌。但另一方面，在大语言模型带动的科技革命预期下，以通信、传媒、计算机为代表的 TMT 行业收获了较大涨幅。

本基金在报告期内的仓位水平总体平稳，但是随着基本面和市场风格的变化对行业布局进行了一定调整。年初面对较为乐观的宏观经济预期，本基金选择了相对均衡的行业布局。而大语言模型出现后，随着 AI 技术革命的预期逐渐明确，本基金对算力、应用、大模型厂商等产业链环节进行深入研究，并在算力环节重点布局。

总体而言，本基金始终坚持自上而下对行业进行比较配置，自下而上深入研究公司的基本面和预期差。站在当下的时间点，传统行业虽然有长期增速中枢下移的风险，但是估值和预期已经较大程度地体现了风险，如果相信经济本身不会出现硬着陆的系统性风险，那么很多行业从长期视角来看已经出现了布局的吸引力。另一方面，虽然 AI 技术革命的落地时间可能会比资本市场的部分预期更长，但是其未来的发展方向和空间已经日趋明朗，包括 AGI（通用人工智能）、自动驾驶、机器人等都是值得深度关注的方向。在变革性的技术突破即将到来的前夜，关注重点依然会更侧重于科技成长行业。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额单位净值为 1.1061 元，累计单位净值为 2.9460 元；本报告期 A 类份额净值增长率为-6.87%，同期业绩比较基准增长率为 2.83%。

本基金 C 类份额单位净值为 1.0972 元，累计单位净值为 1.8436 元；本报告期 C 类份额净值增长率为-7.11%，同期业绩比较基准增长率为 2.83%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

放眼未来，中国经济复苏的前景依旧值得看好，但是可能短期内的力度依旧相对偏弱。随着新旧经济动能的转换，从地产投资到居民消费等传统的经济驱动因素都需要时间来消化压力。虽然当前的市场情绪和信心已经接近冰点，但是我们相信放眼未来，整体经济的转好和消费的复苏依旧是大概率事件。

随着地产周期进入拐点，整体中国的信贷周期和资产结构不可避免会受到影响，从居民债务到地方政府债务都会需要寻找新的合理比例。虽然这个过程可能会需要较长的时间，但是在经历了过去的快速调整后，也许也会有阶段性的缓和期。另一方面，在这个过程中带来的低利率环境对证券市场也是相对利好的，证券市场中存在的大量优质资产反而会进一步凸显配置价值。

从行业角度来看，虽然 AI 技术革命的落地时间仍然存在不确定性，但是其未来的发展方向和空间已经日趋明朗，包括 AGI（通用人工智能）、自动驾驶、通用机器人等都是值得深度关注的方向。从成长空间的预期差角度，AI 投资带动的算力需求仍然是当前市场较值得投资的方向，也是确定性较强的选择。2024 年是 AI 智能时代落地的开始，我们会看见更强的模型、应用和端侧硬件产品。自动驾驶方面，预计 2024 年会看见国内能满足城市 NOA 条件的车辆达到百万级别。通用机器人方面，特斯拉大概率也会在 2024 年首先开始在工厂内进行规模化推广。因此，站在当前的时间点，科技创新无疑是不容忽视的投资重点。

#### 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，本基金管理人从合法、合规、保障基金持有人利益出发，由督察长领导独立于各业务部门的合规风控部对基金投资运作、公司经营管理及员工行为的合法、合规性等进行了监察稽核，通过实时监控、定期检查、专项稽核、日常不定期抽查等方式，及时发现情况、提出整改意见、督促有关业务部门整改并跟踪改进落实情况，并按照相关要求定期制作监察稽核报告报公司管理层、董事会以及监管部门。

本报告期内本基金管理人内部监察稽核的重点包括：

(1) 进一步完善制度建设。本基金管理人根据公司实际业务情况不断细化制度流程，及时拟定了相关管理制度，并对原有制度体系进行了持续的更新和完善，本基金管理人制订的规章制度涵盖公司主要业务范围。

(2) 强化合规教育和培训。本基金管理人及时传达与基金相关的法律法规，将相关规定不断贯彻到相关制度及具体执行过程中，同时以组织公司内部培训、聘请外部律师提供法律专业培训

等多种形式，提高全体员工的合规守法意识。

(3) 有计划地开展监察稽核工作。本报告期内，本基金管理人根据年度监察稽核工作计划、通过日常监察与专项稽核相结合的方式，开展各项监察稽核工作，包括对基金销售、宣传材料、合同、反洗钱工作、基金投资运作、交易（包括公平交易）等方面进行稽核，对于稽核中发现的问题会通过监察稽核报告的形式，及时将潜在风险通报部门负责人、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。通过日常监察与专项稽核的方式，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，强化内部控制流程，提高了业务部门及人员的风险意识水平，从而较好地预防风险。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人按照相关法律法规及基金合同关于估值的约定，严格执行内部估值控制程序，对基金所持有的投资品种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成，可根据需要邀请产品托管行代表、公司独立董事、会计师事务所代表等外部人员参加。公司运营总监为公司基金估值委员会主席。运营支持部根据估值委员会的估值意见进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对，运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值工作小组成员，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，估值政策和估值方案最终由估值委员会决定，基金经理不具有表决权。本基金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金未进行利润分配，不存在应分配而未分配的情况。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无

#### 4.10 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，本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。



## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                              |
|------------|------------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                            |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                      |
| 审计报告编号     | 安永华明(2024)审字第 70015670_A04 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 | 国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人 |

|                 |  |
|-----------------|--|
| 审计意见            | <p>我们审计了国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。</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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>   |
| 强调事项            | 无  |
| 其他事项            | 无  |
| 其他信息            | <p>国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>  |
| 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>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）   |
| 注册会计师的姓名  | 蒋燕华   马剑英  |
| 会计师事务所的地址 | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室  |
| 审计报告日期    | 2024 年 03 月 29 日   |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

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<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                         |                          |
| 货币资金       | 7.4.7.1 | 10,440,742.11           | 10,801,789.42            |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 结算备付金         |            | 242,535.26                 | 59,800.49                   |
| 存出保证金         |            | 102,293.88                 | 122,058.27                  |
| 交易性金融资产       | 7.4.7.2    | 97,786,936.26              | 154,060,083.76              |
| 其中：股票投资       |            | 97,786,936.26              | 152,338,254.36              |
| 基金投资          |            | -                          | -                           |
| 债券投资          |            | -                          | 1,721,829.40                |
| 资产支持证券投资      |            | -                          | -                           |
| 贵金属投资         |            | -                          | -                           |
| 其他投资          |            | -                          | -                           |
| 衍生金融资产        | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产      | 7.4.7.4    | -                          | -                           |
| 债权投资          | 7.4.7.5    | -                          | -                           |
| 其中：债券投资       |            | -                          | -                           |
| 资产支持证券投资      |            | -                          | -                           |
| 其他投资          |            | -                          | -                           |
| 其他债权投资        | 7.4.7.6    | -                          | -                           |
| 其他权益工具投资      | 7.4.7.7    | -                          | -                           |
| 应收清算款         |            | 3,579,137.49               | -                           |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | 200,558.01                 | 139,122.13                  |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 7.4.7.8    | -                          | -                           |
| 资产总计          |            | 112,352,203.01             | 165,182,854.07              |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>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         |            | 3,767,002.72               | -                           |
| 应付赎回款         |            | 199,505.76                 | 178,652.66                  |
| 应付管理人报酬       |            | 110,974.28                 | 207,858.47                  |
| 应付托管费         |            | 18,495.69                  | 34,643.09                   |
| 应付销售服务费       |            | 5,377.99                   | 15,173.23                   |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | 15.00                      | 15.00                       |
| 应付利润          |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                          | -                           |
| 其他负债          | 7.4.7.9    | 430,576.46                 | 416,126.86                  |
| 负债合计          |            | 4,531,947.90               | 852,469.31                  |
| <b>净资产：</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金          | 7.4.7.10   | 97,660,424.13              | 138,690,594.26              |
| 其他综合收益        | 7.4.7.11   | -                          | -                           |

|          |          |                |                |
|----------|----------|----------------|----------------|
| 未分配利润    | 7.4.7.12 | 10,159,830.98  | 25,639,790.50  |
| 净资产合计    |          | 107,820,255.11 | 164,330,384.76 |
| 负债和净资产总计 |          | 112,352,203.01 | 165,182,854.07 |

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，国金国鑫发起 A 基金份额净值 1.1061 元，基金份额总额 75,086,051.05 份；国金国鑫发起 C 基金份额净值 1.0972 元，基金份额总额 22,574,373.08 份。国金国鑫发起份额总额合计为 97,660,424.13 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

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<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022<br>年 12 月 31 日 |
|------------------------|----------|---|--|
| <b>一、营业总收入</b>         |          | 1,423,184.71                              | -45,334,595.78                                 |
| 1. 利息收入                |          | 127,873.86                                | 232,859.21                                     |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.13 | 127,873.86                                | 167,140.72                                     |
| 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             |          | -   | 65,718.49                                      |
| 其他利息收入                 |          | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |          | 11,955,187.37                             | -31,227,234.46                                 |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.14 | 10,863,093.02                             | -32,438,775.63                                 |
| 基金投资收益                 |          | -   | -  |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.15 | 11,031.60                                 | 91,963.81                                      |
| 资产支持证券投资               | 7.4.7.16 | -   | -  |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.17 | -   | -  |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.18 | -   | -  |
| 股利收益                   | 7.4.7.19 | 1,081,062.75                              | 1,119,577.36                                   |
| 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 | -10,742,848.57                            | -14,394,584.83                                 |
| 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   | 82,972.05     | 54,364.30      |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 2,467,548.56  | 3,942,353.92   |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 1,864,442.29  | 3,016,638.41   |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -             | -              |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 310,740.46    | 502,773.19     |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 103,165.81    | 223,742.32     |
| 4. 投资顾问费                   |            | -             | -              |
| 5. 利息支出                    |            | -             | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -             | -              |
| 6. 信用减值损失                  | 7.4.7.22   | -             | -              |
| 7. 税金及附加                   |            | -             | -              |
| 8. 其他费用                    | 7.4.7.23   | 189,200.00    | 199,200.00     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -1,044,363.85 | -49,276,949.70 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -1,044,363.85 | -49,276,949.70 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -             | -              |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | -1,044,363.85 | -49,276,949.70 |

### 7.3 净资产变动表

会计主体：国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

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<br>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            | 138,690,594.26              | -      | 25,639,790.50  | 164,330,384.76 |
| 加：会计政策变更             | -                           | -      | -              | -              |
| 前期差错更正               | -                           | -      | -              | -              |
| 其他                   | -                           | -      | -              | -              |
| 二、本期期初净资产            | 138,690,594.26              | -      | 25,639,790.50  | 164,330,384.76 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -41,030,170.13              | -      | -15,479,959.52 | -56,510,129.65 |
| (一)、综合收益             | -                           | -      | -1,044,363.85  | -1,044,363.85  |

|  |                                  |        |                |                 |
|--|----------------------------------|--------|----------------|-----------------|
| 总额                                       |                                  |        |                |                 |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)  | -41,030,170.13                   | -      | -14,435,595.67 | -55,465,765.80  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 41,290,461.32                    | -      | 9,149,729.70   | 50,440,191.02   |
| 2. 基金赎回款                                 | -82,320,631.45                   | -      | -23,585,325.37 | -105,905,956.82 |
| (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                                | 97,660,424.13                    | -      | 10,159,830.98  | 107,820,255.11  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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                                | 169,919,319.02                   | -      | 160,649,411.12 | 330,568,730.14  |
| 加：会计政策变更                                 | -                                | -      | -              | -               |
| 前期差错更正                                   | -                                | -      | -              | -               |
| 其他                                       | -                                | -      | -              | -               |
| 二、本期期初净资产                                | 169,919,319.02                   | -      | 160,649,411.12 | 330,568,730.14  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -31,228,724.76                   | -      | 135,009,620.62 | -166,238,345.38 |
| (一)、综合收益总额                               | -                                | -      | -49,276,949.70 | -49,276,949.70  |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)  | -31,228,724.76                   | -      | -23,732,608.21 | -54,961,332.97  |

|  |                     |   |                |                 |
|--|---------------------|---|----------------|-----------------|
| 其中：1. 基金申购款                              | 133,909,231.69      | - | 63,429,125.86  | 197,338,357.55  |
| 2. 基金赎回款                                 | -<br>165,137,956.45 | - | -87,161,734.07 | -252,299,690.52 |
| (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） | -                   | - | -62,000,062.71 | -62,000,062.71  |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                   | - | -              | -               |
| 四、本期期末净资产                                | 138,690,594.26      | - | 25,639,790.50  | 164,330,384.76  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

|            |            |            |
|------------|------------|------------|
| <u>邰海波</u> | <u>聂武鹏</u> | <u>于晓莲</u> |
| 基金管理人负责人   | 主管会计工作负责人  | 会计机构负责人    |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金（原名称为“国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金”以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]953号文的核准，由国金基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于2012年8月28日生效。2015年9月23日，本基金名称由“国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金”变更为“国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金”。本基金为契约型开放式，存续期限不定。首次募集规模为178,532,819.63份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板股票、创业板股票，以及其它经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、债券（含中小企业私募债、中期票据）、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）、资产支持证券、银行存款、货币市场工具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）。本基金股票投资占基金资产的比例为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，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：金融机构人民币三年期定期存款基准利率（税后）。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

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

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

###### (2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应

采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按

协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式有现金分红和红利再投资两种。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

无

#### 7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

#### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增

值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

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

#### 7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运

用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 10,440,742.11           | 10,801,789.42            |
| 等于：本金          | 10,438,473.43           | 10,799,387.47            |
| 加：应计利息         | 2,268.68                | 2,401.95                 |
| 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     | 10,440,742.11 | 10,801,789.42 |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023年12月31日  |              |                |               |         |
|---------------|---------------------|--------------|----------------|---------------|---------|
|               | 成本                  | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动        |         |
| 股票            | 99,115,045.02       | -            | 97,786,936.26  | -1,328,108.76 |         |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                   | -            | -              | -             |         |
| 债券            | 交易所市场               | -            | -              | -             |         |
|               | 银行间市场               | -            | -              | -             |         |
|               | 合计                  | -            | -              | -             |         |
| 资产支持证券        | -                   | -            | -              | -             |         |
| 基金            | -                   | -            | -              | -             |         |
| 其他            | -                   | -            | -              | -             |         |
| 合计            | 99,115,045.02       | -            | 97,786,936.26  | -1,328,108.76 |         |
| 项目            | 上年度末<br>2022年12月31日 |              |                |               |         |
|               | 成本                  | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动        |         |
| 股票            | 142,923,395.55      | -            | 152,338,254.36 | 9,414,858.81  |         |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                   | -            | -              | -             |         |
| 债券            | 交易所市场               | 1,699,269.00 | 22,679.40      | 1,721,829.40  | -119.00 |
|               | 银行间市场               | -            | -              | -             | -       |
|               | 合计                  | 1,699,269.00 | 22,679.40      | 1,721,829.40  | -119.00 |
| 资产支持证券        | -                   | -            | -              | -             |         |
| 基金            | -                   | -            | -              | -             |         |
| 其他            | -                   | -            | -              | -             |         |
| 合计            | 144,622,664.55      | 22,679.40    | 154,060,083.76 | 9,414,739.81  |         |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无

## 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：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

注：无

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：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

注：无

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：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

注：无

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无

## 7.4.7.8 其他资产

注：无

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023年12月31日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | 29.23              | 75.24               |

|           |            |            |
|-----------|------------|------------|
| 应付证券出借违约金 | -          | -          |
| 应付交易费用    | 256,047.23 | 231,551.62 |
| 其中：交易所市场  | 256,047.23 | 231,551.62 |
| 银行间市场     | -          | -          |
| 应付利息      | -          | -          |
| 预提费用      | 174,500.00 | 184,500.00 |
| 合计        | 430,576.46 | 416,126.86 |

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 国金国鑫发起 A

| 项目            | 本期<br>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          | 79,086,082.60                          | 79,086,082.60  |
| 本期申购          | 8,667,914.66                           | 8,667,914.66   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -12,667,946.21                         | -12,667,946.21 |
| 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           | 75,086,051.05                          | 75,086,051.05  |

##### 国金国鑫发起 C

| 项目            | 本期<br>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          | 59,604,511.66                          | 59,604,511.66  |
| 本期申购          | 32,622,546.66                          | 32,622,546.66  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -69,652,685.24                         | -69,652,685.24 |
| 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           | 22,574,373.08                          | 22,574,373.08  |

注：若本基金有分红及转换业务，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

注：无

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 国金国鑫发起 A

| 项目   | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | 24,028,369.62 | -9,187,306.39 | 14,841,063.23 |

|                |               |                |               |
|----------------|---------------|----------------|---------------|
| 加：会计政策变更       | -             | -              | -             |
| 前期差错更正         | -             | -              | -             |
| 其他             | -             | -              | -             |
| 本期期初           | 24,028,369.62 | -9,187,306.39  | 14,841,063.23 |
| 本期利润           | 5,111,665.46  | -11,138,936.52 | -6,027,271.06 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,580,264.47 | 731,772.20     | -848,492.27   |
| 其中：基金申购款       | 3,577,556.22  | -1,493,131.37  | 2,084,424.85  |
| 基金赎回款          | -5,157,820.69 | 2,224,903.57   | -2,932,917.12 |
| 本期已分配利润        | -             | -              | -             |
| 本期末            | 27,559,770.61 | -19,594,470.71 | 7,965,299.90  |

## 国金国鑫发起 C

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | 34,842,491.41  | -24,043,764.14 | 10,798,727.27  |
| 加：会计政策变更       | -              | -              | -              |
| 前期差错更正         | -              | -              | -              |
| 其他             | -              | -              | -              |
| 本期期初           | 34,842,491.41  | -24,043,764.14 | 10,798,727.27  |
| 本期利润           | 4,586,819.26   | 396,087.95     | 4,982,907.21   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -24,881,867.23 | 11,294,763.83  | -13,587,103.40 |
| 其中：基金申购款       | 23,571,827.69  | -16,506,522.84 | 7,065,304.85   |
| 基金赎回款          | -48,453,694.92 | 27,801,286.67  | -20,652,408.25 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 14,547,443.44  | -12,352,912.36 | 2,194,531.08   |

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 118,202.76                  | 147,262.13                       |
| 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 | 8,053.32                    | 16,744.24                        |
| 其他        | 1,617.78                    | 3,134.35                         |
| 合计        | 127,873.86                  | 167,140.72                       |

## 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<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |
|----|-----------------------------|----------------------------------|
|    |                             |                                  |

|                      |               |                |
|----------------------|---------------|----------------|
| 股票投资收益——买卖<br>股票差价收入 | 10,863,093.02 | -32,438,775.63 |
| 股票投资收益——赎回<br>差价收入   | -             | -              |
| 股票投资收益——申购<br>差价收入   | -             | -              |
| 股票投资收益——证券<br>出借差价收入 | -             | -              |
| 合计                   | 10,863,093.02 | -32,438,775.63 |

#### 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<br>2023年1月1日至2023年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年<br>12月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出股票成交总额       | 857,302,269.88                  | 710,592,012.79                       |
| 减：卖出股票成本<br>总额 | 844,340,475.55                  | 741,193,730.86                       |
| 减：交易费用         | 2,098,701.31                    | 1,837,057.56                         |
| 买卖股票差价收<br>入   | 10,863,093.02                   | -32,438,775.63                       |

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：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<br>2023年1月1日至2023年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月<br>31日 |
|--|---------------------------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——利<br>息收入                         | 10,300.60                       | 71,514.23                            |
| 债券投资收益——买<br>卖债券（债转股及债<br>券到期兑付）差价收<br>入 | 731.00                          | 20,449.58                            |
| 债券投资收益——赎<br>回差价收入                       | -                               | -                                    |
| 债券投资收益——申                                | -                               | -                                    |

|       |           |           |
|-------|-----------|-----------|
| 购差价收入 |           |           |
| 合计    | 11,031.60 | 91,963.81 |

#### 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<br>2023年1月1日至2023年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月<br>31日 |
|------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,732,980.00                    | 10,798,967.39                        |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,699,269.00                    | 10,695,399.00                        |
| 减：应计利息总额               | 32,980.00                       | 83,106.39                            |
| 减：交易费用                 | -                               | 12.42                                |
| 买卖债券差价收入               | 731.00                          | 20,449.58                            |

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：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

注：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

注：无

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：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

注：无

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：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

注：无

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目                | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12<br>月31日 |
|-------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益       | 1,081,062.75                    | 1,119,577.36                         |
| 其中：证券出借权益<br>补偿收入 | -                               | -                                    |
| 基金投资产生的股利<br>收益   | -                               | -                                    |
| 合计                | 1,081,062.75                    | 1,119,577.36                         |

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2023年1月1日至2023年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022<br>年12月31日 |
|----------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | -10,742,848.57                  | -14,394,584.83                       |
| 股票投资                       | -10,742,967.57                  | -14,394,465.83                       |
| 债券投资                       | 119.00                          | -119.00                              |
| 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<br>值变动产生的预估增值税 | -                               | -                                    |
| 合计                         | -10,742,848.57                  | -14,394,584.83                       |

## 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 82,350.98                   | 53,868.29                        |
| 基金转换费收入 | 621.07                      | 473.21                           |
| 转出费收入   | -                           | 22.80                            |
| 合计      | 82,972.05                   | 54,364.30                        |

## 7.4.7.22 信用减值损失

注：无

## 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |
|----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 审计费用     | 50,000.00                   | 60,000.00                        |
| 信息披露费    | 120,000.00                  | 120,000.00                       |
| 证券出借违约金  | -                           | -                                |
| 账户维护费    | 18,000.00                   | 18,000.00                        |
| 上交所查询服务费 | 1,200.00                    | 1,200.00                         |
| 合计       | 189,200.00                  | 199,200.00                       |

## 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称               | 与本基金的关系               |
|---------------------|-----------------------|
| 国金基金管理有限公司          | 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构 |
| 国金证券股份有限公司          | 基金管理人股东、基金代销机构        |
| 广东宝丽华新能源股份有限公司      | 基金管理人股东               |
| 苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司  | 基金管理人股东               |
| 涌金投资控股有限公司          | 基金管理人股东               |
| 苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙） | 基金管理人股东               |



|                     |                  |
|---------------------|------------------|
| 苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙） | 基金管理人股东          |
| 苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙） | 基金管理人股东          |
| 上海国金理益财富基金销售有限公司    | 基金管理人的子公司、基金代销机构 |
| 北京千石创富资本管理有限公司      | 基金管理人的子公司        |
| 中国光大银行股份有限公司        | 基金托管人、基金代销机构     |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称          | 本期<br>2023年1月1日至2023年<br>12月31日 |                             | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |                         |
|----------------|---------------------------------|-----------------------------|----------------------------------|-------------------------|
|                | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额<br>的比例<br>(%) | 成交金额                             | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 国金证券股份有限<br>公司 | 185,622,266.77                  | 11.20                       | 331,361,857.33                   | 24.75                   |

##### 7.4.10.1.2 债券交易

注：无

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无

##### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称          | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日      |                    |              |                         |
|----------------|----------------------------------|--------------------|--------------|-------------------------|
|                | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例<br>(%) |
| 国金证券股份有<br>限公司 | 135,746.13                       | 11.15              | -            | -                       |
| 关联方名称          | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |                    |              |                         |

|            | 当期佣金       | 占当期佣金总量的比例 (%) | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣金总额的比例 (%) |
|------------|------------|----------------|-----------|------------------|
| 国金证券股份有限公司 | 242,325.60 | 23.84          | 77,633.21 | 33.53            |

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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<br>2023年1月1日至2023年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022<br>年12月31日 |
|------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 1,864,442.29                    | 3,016,638.41                         |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 566,412.61                      | 672,056.48                           |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 1,298,029.68                    | 2,344,581.93                         |

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

3. 2023 年 8 月 7 日前，本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2023 年 8 月 7 日起，本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2023年1月1日至2023年 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022 |
|----|-----------------------|---------------------------|
|    |                       |                           |

|                | 12 月 31 日  | 年 12 月 31 日 |
|----------------|------------|-------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 310,740.46 | 502,773.19  |

注：1. 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2. 2023 年 8 月 7 日前，本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2023 年 8 月 7 日起，本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。

#### 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<br>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                            |            |            |
|                | 国金国鑫发起 A                                    | 国金国鑫发起 C   | 合计         |
| 国金基金管理有限公司     | -   | 51,127.48  | 51,127.48  |
| 国金证券股份有限公司     | -   | 0.15       | 0.15       |
| 合计             | -   | 51,127.63  | 51,127.63  |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>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                            |            |            |
|                | 国金国鑫发起 A                                    | 国金国鑫发起 C   | 合计         |
| 国金基金管理有限公司     | -   | 175,504.57 | 175,504.57 |
| 合计             | -   | 175,504.57 | 175,504.57 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：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

注：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

注：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

注：无

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称             | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月<br>31日 |            | 上年度可比期间<br>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     |
| 中国光大银行股份有限公司-活期存款 | 10,440,742.11                   | 118,202.76 | 10,801,789.42                    | 147,262.13 |

注：本基金的上述存款按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期内及上年度可比期间均未参与关联方承销期内承销的证券。

#### 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

注：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 |
| 301210               | 金杨股份 | 2023年6月21日 | 6个月 | 新股流通受限 | 57.88 | 45.48  | 94       | 5,440.72 | 4,275.12 | -  |
| 301261               | 恒工精密 | 2023年6月29日 | 6个月 | 新股流通受限 | 36.90 | 50.85  | 85       | 3,136.50 | 4,322.25 | -  |
| 301371               | 敷尔佳  | 2023年7月24日 | 6个月 | 新股流通受限 | 55.68 | 37.58  | 61       | 3,396.48 | 2,292.38 | -  |
| 301393               | 昊帆生物 | 2023年7月5日  | 6个月 | 新股流通受限 | 67.68 | 59.37  | 41       | 2,774.88 | 2,434.17 | -  |
| 301469               | 恒达新材 | 2023年8月10日 | 6个月 | 新股流通受限 | 36.58 | 33.09  | 79       | 2,889.82 | 2,614.11 | -  |
| 301498               | 乖宝宠物 | 2023年8月9日  | 6个月 | 新股流通受限 | 39.99 | 38.81  | 74       | 2,959.26 | 2,871.94 | -  |
| 301499               | 维科精密 | 2023年7月13日 | 6个月 | 新股流通受限 | 19.50 | 28.93  | 135      | 2,632.50 | 3,905.55 | -  |
| 301509               | 金凯生科 | 2023年7月26日 | 6个月 | 新股流通受限 | 56.56 | 62.23  | 57       | 3,223.92 | 3,547.11 | -  |
| 301510               | 固    | 2023       | 6个月 | 新股     | 12.00 | 35.01  | 204      | 2,448.00 | 7,142.04 | -  |

|        |      |           |     |        |       |       |    |          |          |   |
|--------|------|-----------|-----|--------|-------|-------|----|----------|----------|---|
|        | 高科技  | 年8月4日     |     | 流通受限   |       |       |    |          |          |   |
| 301511 | 德福科技 | 2023年8月8日 | 6个月 | 新股流通受限 | 28.00 | 22.67 | 94 | 2,632.00 | 2,130.98 | - |

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：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

注：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

注：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

本基金管理人的风险管理政策是通过事前充分到位的防范、事中实时有效的过程控制、事后完备可追踪的检查和反馈，将风险管理贯穿于投研运作的整个流程，从而使基金投资风险可测、可控、可承担，有效防范和化解投研业务的市场风险、信用风险、流动性风险及操作风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险控制制度的有效执行。董事会下设风险管理委员会，并制定《风险管理委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险控制委员会，负责对公司经营及投资组合运作中的风险进行识别、评估和防控，负责对投资组合风险评估报告中提出的重大问题进行讨论和决定应对措施。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、

议事规则等事宜。

本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险管理的一线部门，公司各部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，根据公司制度规定的各项作业流程和规范，加强对风险的控制。

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，基金经理是本基金风险管理的第一责任人。

合规风控部监察稽核团队负责对风险控制制度的建立和落实情况进行监督，在职权范围内独立履行检查、评价、报告、建议职能；合规风控部风险管理团队独立于投资研究体系，负责落实具体的风险管理政策，对投资进行事前、事中及事后的风险管理。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人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。

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

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

##### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，本基金的基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，最大限度保护基金份额持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持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。



## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2023 年 12 月<br>31 日  | 1 个月以内        | 1-3 个月 | 3 个月-1 年     | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计             |
|-----------------------------|---------------|--------|--------------|-------|-------|----------------|----------------|
| 资产                          |               |        |              |       |       |                |                |
| 货币资金                        | 10,440,742.11 | -      | -            | -     | -     | -              | 10,440,742.11  |
| 结算备付金                       | 242,535.26    | -      | -            | -     | -     | -              | 242,535.26     |
| 存出保证金                       | 102,293.88    | -      | -            | -     | -     | -              | 102,293.88     |
| 交易性金融资产                     | -             | -      | -            | -     | -     | 97,786,936.26  | 97,786,936.26  |
| 应收清算款                       | -             | -      | -            | -     | -     | 3,579,137.49   | 3,579,137.49   |
| 应收申购款                       | -             | -      | -            | -     | -     | 200,558.01     | 200,558.01     |
| 资产总计                        | 10,785,571.25 | -      | -            | -     | -     | 101,566,631.76 | 112,352,203.01 |
| 负债                          |               |        |              |       |       |                |                |
| 应付清算款                       | -             | -      | -            | -     | -     | 3,767,002.72   | 3,767,002.72   |
| 应付赎回款                       | -             | -      | -            | -     | -     | 199,505.76     | 199,505.76     |
| 应付管理人报酬                     | -             | -      | -            | -     | -     | 110,974.28     | 110,974.28     |
| 应付托管费                       | -             | -      | -            | -     | -     | 18,495.69      | 18,495.69      |
| 应付销售服务费                     | -             | -      | -            | -     | -     | 5,377.99       | 5,377.99       |
| 应交税费                        | -             | -      | -            | -     | -     | 15.00          | 15.00          |
| 其他负债                        | -             | -      | -            | -     | -     | 430,576.46     | 430,576.46     |
| 负债总计                        | -             | -      | -            | -     | -     | 4,531,947.90   | 4,531,947.90   |
| 利率敏感度缺口                     | 10,785,571.25 | -      | -            | -     | -     | 97,034,683.86  | 107,820,255.11 |
| 上年度末<br>2022 年 12 月<br>31 日 | 1 个月以内        | 1-3 个月 | 3 个月-1 年     | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计             |
| 资产                          |               |        |              |       |       |                |                |
| 货币资金                        | 10,801,789.42 | -      | -            | -     | -     | -              | 10,801,789.42  |
| 结算备付金                       | 59,800.49     | -      | -            | -     | -     | -              | 59,800.49      |
| 存出保证金                       | 122,058.27    | -      | -            | -     | -     | -              | 122,058.27     |
| 交易性金融资产                     | -             | -      | 1,721,829.40 | -     | -     | 152,338,254.36 | 154,060,083.76 |
| 应收申购款                       | -             | -      | -            | -     | -     | 139,122.13     | 139,122.13     |
| 资产总计                        | 10,983,648.18 | -      | 1,721,829.40 | -     | -     | 152,477,376.49 | 165,182,854.07 |
| 负债                          |               |        |              |       |       |                |                |
| 应付赎回款                       | -             | -      | -            | -     | -     | 178,652.66     | 178,652.66     |
| 应付管理人报酬                     | -             | -      | -            | -     | -     | 207,858.47     | 207,858.47     |
| 应付托管费                       | -             | -      | -            | -     | -     | 34,643.09      | 34,643.09      |
| 应付销售服务                      | -             | -      | -            | -     | -     | 15,173.23      | 15,173.23      |

|         |               |   |               |   |   |                 |                |
|---------|---------------|---|---------------|---|---|-----------------|----------------|
| 费       |               |   |               |   |   |                 |                |
| 应交税费    |               | - | -             | - | - | 15.00           | 15.00          |
| 其他负债    |               | - | -             | - | - | 416,126.86      | 416,126.86     |
| 负债总计    |               | - | -             | - | - | 852,469.31      | 852,469.31     |
| 利率敏感度缺口 | 10,983,648.18 |   | -1,721,829.40 |   |   | -151,624,907.18 | 164,330,384.76 |

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日、行权日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指基金所持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。本基金主要投资于交易所上市或银行间同业市场交易的证券等，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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的风险及潜在价格风险进行度量和测试，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<br>2023年12月31日 |                  | 上年度末<br>2022年12月31日 |                  |
|---------------|--------------------|------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值               | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 97,786,936.26      | 90.69            | 152,338,254.36      | 92.70            |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                  | -                | -                   | -                |
| 交易性金融资产—债券投资  | -                  | -                | 1,721,829.40        | 1.05             |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                  | -                | -                   | -                |

|                  |               |       |                |       |
|------------------|---------------|-------|----------------|-------|
| 衍生金融资产<br>— 权证投资 | -             | -     | -              | -     |
| 其他               | -             | -     | -              | -     |
| 合计               | 97,786,936.26 | 90.69 | 154,060,083.76 | 93.75 |

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |   |                             |                        |
|----|---|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 假定沪深 300 指数（000300.SH）变化 5%，其他变量不变；                             |                             |                        |
|    | Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和沪深 300 指数数据回归得出，反映了基金和沪深 300 指数的相关性。 |                             |                        |
| 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） |
|    | +5%   | 5,186,539.48                | 8,462,463.45           |
|    | -5%   | -5,186,539.48               | -8,462,463.45          |

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

#### 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<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 97,751,400.61           | 152,338,254.36           |
| 第二层次          | -                       | 1,721,829.40             |

|      |               |                |
|------|---------------|----------------|
| 第三层次 | 35,535.65     | -              |
| 合计   | 97,786,936.26 | 154,060,083.76 |

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>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                                       | -                                | -            | -            |
| 当期购买                                       | -                                | 31,534.08    | 31,534.08    |
| 当期出售/结算                                    | -                                | -            | -            |
| 转入第三层次                                     | -                                | -            | -            |
| 转出第三层次                                     | -                                | -            | -            |
| 当期利得或损失总额                                  | -                                | 4,001.57     | 4,001.57     |
| 其中：计入损益的利得或损失                              | -                                | 4,001.57     | 4,001.57     |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | -                                | -            | -            |
| 期末余额                                       | -                                | 35,535.65    | 35,535.65    |
| 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 | -                                | 4,001.57     | 4,001.57     |
| 项目   | 上年度可比期间<br>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                                       | -                                | 7,379,625.89 | 7,379,625.89 |

|  |   |              |              |
|--|---|--------------|--------------|
| 当期购买                                       | - | -            | -            |
| 当期出售/结算                                    | - | -            | -            |
| 转入第三层次                                     | - | -            | -            |
| 转出第三层次                                     | - | 7,379,625.89 | 7,379,625.89 |
| 当期利得或损失总额                                  | - | -            | -            |
| 其中：计入损益的利得或损失                              | - | -            | -            |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | - | -            | -            |
| 期末余额                                       | - | -            | -            |
| 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 | - | -            | -            |

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

单位：人民币元

| 项目   | 本期末公允价值   | 采用的估值技术    | 不可观察输入值 |               |            |
|------|-----------|------------|---------|---------------|------------|
|      |           |            | 名称      | 范围/加权平均值      | 与公允价值之间的关系 |
| 限售股票 | 35,535.65 | 平均价格亚式期权模型 | 预期年化波动率 | 0.2023-0.3746 | 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 |
| -    | -         | -          | -       | -             | -          |

**7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

**7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

**7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

7.4.15.1 承诺事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.15.3 财务报表的批准

注：本财务报表已于 2024 年 3 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 97,786,936.26  | 87.04         |
|    | 其中：股票             | 97,786,936.26  | 87.04         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | -              | -             |
|    | 其中：债券             | -              | -             |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -              | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 10,683,277.37  | 9.51          |
| 8  | 其他各项资产            | 3,881,989.38   | 3.46          |
| 9  | 合计                | 112,352,203.01 | 100.00        |

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -             |
| B  | 采矿业              | -             | -             |
| C  | 制造业              | 69,086,746.94 | 64.08         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -             |
| E  | 建筑业              | -             | -             |
| F  | 批发和零售业           | 2,718,206.24  | 2.52          |
| 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  | 11,520,860.08 | 10.69         |
| J  | 金融业              | 10,065,707.00 | 9.34          |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| K | 房地产业          | -             | -     |
| L | 租赁和商务服务业      | 3,290,210.00  | 3.05  |
| M | 科学研究和技术服务业    | 1,105,206.00  | 1.03  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | -             | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -             | -     |
| S | 综合            | -             | -     |
|   | 合计            | 97,786,936.26 | 90.69 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无

### 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<br>(股) | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|-----------|--------------|------------------|
| 1  | 300308 | 中际旭创 | 87,400    | 9,868,334.00 | 9.15             |
| 2  | 002463 | 沪电股份 | 336,200   | 7,436,744.00 | 6.90             |
| 3  | 601689 | 拓普集团 | 99,300    | 7,298,550.00 | 6.77             |
| 4  | 300394 | 天孚通信 | 79,224    | 7,250,580.48 | 6.72             |
| 5  | 002920 | 德赛西威 | 51,000    | 6,605,010.00 | 6.13             |
| 6  | 601138 | 工业富联 | 427,700   | 6,466,824.00 | 6.00             |
| 7  | 603596 | 伯特利  | 72,500    | 5,024,250.00 | 4.66             |
| 8  | 300033 | 同花顺  | 28,900    | 4,533,543.00 | 4.20             |
| 9  | 002599 | 盛通股份 | 649,400   | 4,331,498.00 | 4.02             |
| 10 | 688256 | 寒武纪  | 31,593    | 4,263,791.28 | 3.95             |
| 11 | 300502 | 新易盛  | 84,400    | 4,162,608.00 | 3.86             |
| 12 | 600845 | 宝信软件 | 75,276    | 3,673,468.80 | 3.41             |
| 13 | 300559 | 佳发教育 | 231,200   | 3,583,600.00 | 3.32             |
| 14 | 300280 | 紫天科技 | 77,000    | 3,290,210.00 | 3.05             |
| 15 | 603108 | 润达医疗 | 133,400   | 2,714,690.00 | 2.52             |
| 16 | 600030 | 中信证券 | 112,800   | 2,297,736.00 | 2.13             |
| 17 | 601989 | 中国重工 | 537,300   | 2,219,049.00 | 2.06             |
| 18 | 601211 | 国泰君安 | 148,100   | 2,203,728.00 | 2.04             |
| 19 | 300232 | 洲明科技 | 127,200   | 1,119,360.00 | 1.04             |
| 20 | 600150 | 中国船舶 | 37,700    | 1,109,888.00 | 1.03             |
| 21 | 601965 | 中国汽研 | 50,100    | 1,105,206.00 | 1.03             |
| 22 | 688333 | 铂力特  | 9,399     | 1,089,344.10 | 1.01             |
| 23 | 688019 | 安集科技 | 6,743     | 1,077,261.68 | 1.00             |
| 24 | 002475 | 立讯精密 | 31,200    | 1,074,840.00 | 1.00             |
| 25 | 688041 | 海光信息 | 14,640    | 1,039,147.20 | 0.96             |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 26 | 600837 | 海通证券 | 110,000 | 1,030,700.00 | 0.96 |
| 27 | 688733 | 壹石通  | 32,224  | 943,196.48   | 0.87 |
| 28 | 688300 | 联瑞新材 | 17,653  | 934,726.35   | 0.87 |
| 29 | 301510 | 固高科技 | 204     | 7,142.04     | 0.01 |
| 30 | 301261 | 恒工精密 | 85      | 4,322.25     | 0.00 |
| 31 | 301210 | 金杨股份 | 94      | 4,275.12     | 0.00 |
| 32 | 301499 | 维科精密 | 135     | 3,905.55     | 0.00 |
| 33 | 301509 | 金凯生科 | 57      | 3,547.11     | 0.00 |
| 34 | 301376 | 致欧科技 | 147     | 3,516.24     | 0.00 |
| 35 | 301498 | 乖宝宠物 | 74      | 2,871.94     | 0.00 |
| 36 | 301469 | 恒达新材 | 79      | 2,614.11     | 0.00 |
| 37 | 301393 | 昊帆生物 | 41      | 2,434.17     | 0.00 |
| 38 | 301371 | 敷尔佳  | 61      | 2,292.38     | 0.00 |
| 39 | 301511 | 德福科技 | 94      | 2,130.98     | 0.00 |

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 300502 | 新易盛  | 24,114,808.00 | 14.67          |
| 2  | 300308 | 中际旭创 | 18,434,048.00 | 11.22          |
| 3  | 300394 | 天孚通信 | 17,119,724.12 | 10.42          |
| 4  | 600030 | 中信证券 | 16,520,506.25 | 10.05          |
| 5  | 002920 | 德赛西威 | 15,463,497.00 | 9.41           |
| 6  | 300499 | 高澜股份 | 15,225,819.33 | 9.27           |
| 7  | 002463 | 沪电股份 | 14,555,178.67 | 8.86           |
| 8  | 600845 | 宝信软件 | 13,901,685.39 | 8.46           |
| 9  | 601138 | 工业富联 | 13,558,992.00 | 8.25           |
| 10 | 603019 | 中科曙光 | 13,353,855.00 | 8.13           |
| 11 | 300058 | 蓝色光标 | 13,143,725.33 | 8.00           |
| 12 | 002230 | 科大讯飞 | 12,927,686.48 | 7.87           |
| 13 | 600256 | 广汇能源 | 12,635,966.00 | 7.69           |
| 14 | 300059 | 东方财富 | 12,512,713.32 | 7.61           |
| 15 | 600887 | 伊利股份 | 11,866,112.00 | 7.22           |
| 16 | 601689 | 拓普集团 | 10,858,590.00 | 6.61           |
| 17 | 000063 | 中兴通讯 | 10,729,111.00 | 6.53           |
| 18 | 601600 | 中国铝业 | 10,490,975.00 | 6.38           |
| 19 | 688256 | 寒武纪  | 10,170,397.00 | 6.19           |
| 20 | 300662 | 科锐国际 | 9,858,584.00  | 6.00           |
| 21 | 003031 | 中瓷电子 | 9,794,382.58  | 5.96           |
| 22 | 300496 | 中科创达 | 9,651,161.00  | 5.87           |
| 23 | 002436 | 兴森科技 | 9,628,226.48  | 5.86           |
| 24 | 000938 | 紫光股份 | 9,383,145.80  | 5.71           |



|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 25 | 601567 | 三星医疗 | 9,341,959.00 | 5.68 |
| 26 | 688008 | 澜起科技 | 9,268,393.38 | 5.64 |
| 27 | 300593 | 新雷能  | 8,917,913.00 | 5.43 |
| 28 | 002517 | 恺英网络 | 8,897,769.00 | 5.41 |
| 29 | 300003 | 乐普医疗 | 8,638,120.00 | 5.26 |
| 30 | 002599 | 盛通股份 | 8,049,529.00 | 4.90 |
| 31 | 300274 | 阳光电源 | 7,881,766.00 | 4.80 |
| 32 | 601360 | 三六零  | 7,414,055.00 | 4.51 |
| 33 | 600600 | 青岛啤酒 | 7,204,836.73 | 4.38 |
| 34 | 002049 | 紫光国微 | 7,195,692.00 | 4.38 |
| 35 | 000568 | 泸州老窖 | 6,877,683.00 | 4.19 |
| 36 | 300188 | 美亚柏科 | 6,820,821.00 | 4.15 |
| 37 | 002555 | 三七互娱 | 6,783,604.00 | 4.13 |
| 38 | 688561 | 奇安信  | 6,534,913.60 | 3.98 |
| 39 | 688261 | 东微半导 | 6,519,810.04 | 3.97 |
| 40 | 600882 | 妙可蓝多 | 6,453,065.16 | 3.93 |
| 41 | 688670 | 金迪克  | 6,451,895.72 | 3.93 |
| 42 | 603444 | 吉比特  | 6,023,995.00 | 3.67 |
| 43 | 688160 | 步科股份 | 5,880,605.05 | 3.58 |
| 44 | 688036 | 传音控股 | 5,810,454.18 | 3.54 |
| 45 | 300033 | 同花顺  | 5,703,799.00 | 3.47 |
| 46 | 603596 | 伯特利  | 5,501,429.36 | 3.35 |
| 47 | 002472 | 双环传动 | 5,405,256.00 | 3.29 |
| 48 | 002837 | 英维克  | 5,308,799.00 | 3.23 |
| 49 | 300604 | 长川科技 | 5,231,917.64 | 3.18 |
| 50 | 000977 | 浪潮信息 | 5,206,522.61 | 3.17 |
| 51 | 300454 | 深信服  | 5,073,829.00 | 3.09 |
| 52 | 601658 | 邮储银行 | 4,971,896.00 | 3.03 |
| 53 | 603859 | 能科科技 | 4,883,144.00 | 2.97 |
| 54 | 300559 | 佳发教育 | 4,865,807.00 | 2.96 |
| 55 | 688516 | 奥特维  | 4,845,156.35 | 2.95 |
| 56 | 300373 | 扬杰科技 | 4,838,015.00 | 2.94 |
| 57 | 688636 | 智明达  | 4,820,027.69 | 2.93 |
| 58 | 688111 | 金山办公 | 4,817,255.89 | 2.93 |
| 59 | 688333 | 铂力特  | 4,800,391.09 | 2.92 |
| 60 | 300620 | 光库科技 | 4,616,043.32 | 2.81 |
| 61 | 300494 | 盛天网络 | 4,605,963.00 | 2.80 |
| 62 | 600036 | 招商银行 | 4,484,947.00 | 2.73 |
| 63 | 603658 | 安图生物 | 4,458,288.00 | 2.71 |
| 64 | 300957 | 贝泰妮  | 4,456,386.00 | 2.71 |
| 65 | 688029 | 南微医学 | 4,452,990.08 | 2.71 |
| 66 | 600223 | 福瑞达  | 4,448,916.00 | 2.71 |
| 67 | 300170 | 汉得信息 | 4,423,557.00 | 2.69 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 68 | 600522 | 中天科技 | 4,333,891.00 | 2.64 |
| 69 | 300474 | 景嘉微  | 4,303,828.50 | 2.62 |
| 70 | 605168 | 三人行  | 4,281,114.20 | 2.61 |
| 71 | 300280 | 紫天科技 | 4,273,561.00 | 2.60 |
| 72 | 000988 | 华工科技 | 4,207,465.00 | 2.56 |
| 73 | 300896 | 爱美客  | 4,102,894.00 | 2.50 |
| 74 | 688017 | 绿的谐波 | 3,986,995.36 | 2.43 |
| 75 | 002531 | 天顺风能 | 3,981,236.00 | 2.42 |
| 76 | 300476 | 胜宏科技 | 3,858,706.00 | 2.35 |
| 77 | 002532 | 天山铝业 | 3,741,064.00 | 2.28 |
| 78 | 000933 | 神火股份 | 3,735,268.00 | 2.27 |
| 79 | 300699 | 光威复材 | 3,620,749.00 | 2.20 |
| 80 | 300748 | 金力永磁 | 3,567,539.20 | 2.17 |
| 81 | 601211 | 国泰君安 | 3,471,182.00 | 2.11 |
| 82 | 002847 | 盐津铺子 | 3,405,139.00 | 2.07 |
| 83 | 002475 | 立讯精密 | 3,385,949.00 | 2.06 |
| 84 | 603517 | 绝味食品 | 3,380,085.00 | 2.06 |
| 85 | 300034 | 钢研高纳 | 3,343,191.00 | 2.03 |
| 86 | 688776 | 国光电气 | 3,335,130.16 | 2.03 |
| 87 | 601877 | 正泰电器 | 3,329,570.00 | 2.03 |
| 88 | 600498 | 烽火通信 | 3,294,027.00 | 2.00 |

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 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  | 000568 | 泸州老窖 | 23,312,412.90 | 14.19          |
| 2  | 300502 | 新易盛  | 22,319,469.00 | 13.58          |
| 3  | 000858 | 五粮液  | 19,506,853.00 | 11.87          |
| 4  | 603019 | 中科曙光 | 16,009,897.13 | 9.74           |
| 5  | 300058 | 蓝色光标 | 15,527,247.00 | 9.45           |
| 6  | 601888 | 中国中免 | 15,432,590.39 | 9.39           |
| 7  | 300499 | 高澜股份 | 14,817,548.76 | 9.02           |
| 8  | 600519 | 贵州茅台 | 14,716,678.00 | 8.96           |
| 9  | 600809 | 山西汾酒 | 14,026,524.11 | 8.54           |
| 10 | 300308 | 中际旭创 | 13,943,649.00 | 8.49           |
| 11 | 002230 | 科大讯飞 | 13,863,355.15 | 8.44           |
| 12 | 600030 | 中信证券 | 13,335,564.55 | 8.12           |
| 13 | 300394 | 天孚通信 | 13,255,286.08 | 8.07           |
| 14 | 300015 | 爱尔眼科 | 12,859,239.44 | 7.83           |
| 15 | 300059 | 东方财富 | 12,431,515.00 | 7.56           |
| 16 | 000799 | 酒鬼酒  | 12,242,145.29 | 7.45           |
| 17 | 600887 | 伊利股份 | 11,576,683.28 | 7.04           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 18 | 600256 | 广汇能源 | 11,397,849.00 | 6.94 |
| 19 | 601360 | 三六零  | 11,248,679.18 | 6.85 |
| 20 | 000063 | 中兴通讯 | 10,966,451.00 | 6.67 |
| 21 | 603259 | 药明康德 | 10,906,277.00 | 6.64 |
| 22 | 601567 | 三星医疗 | 10,541,846.00 | 6.42 |
| 23 | 600845 | 宝信软件 | 10,199,774.96 | 6.21 |
| 24 | 002304 | 洋河股份 | 9,911,562.10  | 6.03 |
| 25 | 300662 | 科锐国际 | 9,781,149.16  | 5.95 |
| 26 | 688008 | 澜起科技 | 9,647,631.87  | 5.87 |
| 27 | 003031 | 中瓷电子 | 9,549,803.24  | 5.81 |
| 28 | 002436 | 兴森科技 | 9,310,580.20  | 5.67 |
| 29 | 601600 | 中国铝业 | 9,256,105.70  | 5.63 |
| 30 | 000938 | 紫光股份 | 9,074,094.72  | 5.52 |
| 31 | 002517 | 恺英网络 | 8,840,591.00  | 5.38 |
| 32 | 300496 | 中科创达 | 8,798,674.00  | 5.35 |
| 33 | 002463 | 沪电股份 | 8,450,819.85  | 5.14 |
| 34 | 603369 | 今世缘  | 8,217,235.55  | 5.00 |
| 35 | 300003 | 乐普医疗 | 7,889,688.27  | 4.80 |
| 36 | 300274 | 阳光电源 | 7,832,858.30  | 4.77 |
| 37 | 002555 | 三七互娱 | 7,329,186.00  | 4.46 |
| 38 | 688160 | 步科股份 | 7,293,547.07  | 4.44 |
| 39 | 603444 | 吉比特  | 7,281,061.00  | 4.43 |
| 40 | 688670 | 金迪克  | 7,110,548.22  | 4.33 |
| 41 | 002920 | 德赛西威 | 6,966,008.00  | 4.24 |
| 42 | 688261 | 东微半导 | 6,845,430.38  | 4.17 |
| 43 | 300188 | 美亚柏科 | 6,823,520.71  | 4.15 |
| 44 | 300620 | 光库科技 | 6,771,588.31  | 4.12 |
| 45 | 600600 | 青岛啤酒 | 6,766,594.58  | 4.12 |
| 46 | 601138 | 工业富联 | 6,718,426.00  | 4.09 |
| 47 | 002049 | 紫光国微 | 6,687,768.00  | 4.07 |
| 48 | 300593 | 新雷能  | 6,643,352.46  | 4.04 |
| 49 | 688036 | 传音控股 | 6,357,232.93  | 3.87 |
| 50 | 688561 | 奇安信  | 5,904,029.48  | 3.59 |
| 51 | 300896 | 爱美客  | 5,786,787.00  | 3.52 |
| 52 | 600882 | 妙可蓝多 | 5,428,802.00  | 3.30 |
| 53 | 688256 | 寒武纪  | 5,351,200.32  | 3.26 |
| 54 | 000977 | 浪潮信息 | 5,258,816.67  | 3.20 |
| 55 | 002472 | 双环传动 | 5,249,764.74  | 3.19 |
| 56 | 300604 | 长川科技 | 5,147,081.00  | 3.13 |
| 57 | 300373 | 扬杰科技 | 5,056,904.00  | 3.08 |
| 58 | 603859 | 能科科技 | 5,034,262.00  | 3.06 |
| 59 | 600436 | 片仔癀  | 4,901,052.06  | 2.98 |
| 60 | 000988 | 华工科技 | 4,893,292.00  | 2.98 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 61 | 601658 | 邮储银行 | 4,658,075.00 | 2.83 |
| 62 | 300454 | 深信服  | 4,651,126.00 | 2.83 |
| 63 | 002837 | 英维克  | 4,624,223.83 | 2.81 |
| 64 | 300170 | 汉得信息 | 4,617,806.00 | 2.81 |
| 65 | 600522 | 中天科技 | 4,516,735.00 | 2.75 |
| 66 | 688111 | 金山办公 | 4,418,340.99 | 2.69 |
| 67 | 688333 | 铂力特  | 4,309,406.26 | 2.62 |
| 68 | 300957 | 贝泰妮  | 4,281,880.00 | 2.61 |
| 69 | 600223 | 福瑞达  | 4,268,641.00 | 2.60 |
| 70 | 688029 | 南微医学 | 4,251,918.64 | 2.59 |
| 71 | 603658 | 安图生物 | 4,220,848.00 | 2.57 |
| 72 | 600036 | 招商银行 | 4,215,103.00 | 2.57 |
| 73 | 688516 | 奥特维  | 4,171,092.24 | 2.54 |
| 74 | 002531 | 天顺风能 | 4,138,237.00 | 2.52 |
| 75 | 300474 | 景嘉微  | 4,090,330.00 | 2.49 |
| 76 | 300476 | 胜宏科技 | 4,077,432.00 | 2.48 |
| 77 | 601689 | 拓普集团 | 4,070,807.88 | 2.48 |
| 78 | 300494 | 盛天网络 | 4,068,767.00 | 2.48 |
| 79 | 605168 | 三人行  | 3,993,333.00 | 2.43 |
| 80 | 688017 | 绿的谐波 | 3,907,440.47 | 2.38 |
| 81 | 688636 | 智明达  | 3,853,429.22 | 2.34 |
| 82 | 000887 | 中鼎股份 | 3,538,676.00 | 2.15 |
| 83 | 600132 | 重庆啤酒 | 3,516,636.00 | 2.14 |
| 84 | 300699 | 光威复材 | 3,435,516.40 | 2.09 |
| 85 | 300748 | 金力永磁 | 3,410,048.12 | 2.08 |
| 86 | 002599 | 盛通股份 | 3,309,457.00 | 2.01 |
| 87 | 300146 | 汤臣倍健 | 3,292,730.00 | 2.00 |

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 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 | 800,532,125.02 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 857,302,269.88 |

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无

#### 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

注：无

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

注：无

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

注：无

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：无

**8.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金在报告期内未进行股指期货投资。

**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**

报告期内本基金未进行国债期货投资。

**8.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金报告期内未参与国债期货投资。

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，富士康工业互联网股份有限公司于 2023 年 01 月 20 日受到中国台湾经济部给予人民币 223 万元的行政处罚。

除上述情况外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本报告期，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 | 102,293.88   |
| 2  | 应收清算款 | 3,579,137.49 |
| 3  | 应收股利  | -            |
| 4  | 应收利息  | -            |
| 5  | 应收申购款 | 200,558.01   |
| 6  | 其他应收款 | -            |
| 7  | 待摊费用  | -            |
| 8  | 其他    | -            |
| 9  | 合计    | 3,881,989.38 |

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

## 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

## §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<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>额比例<br>(%) | 持有份额          | 占总<br>份额<br>比例<br>(%) |
| 国金国鑫<br>发起 A | 8,767        | 8,564.62      | 6,585,655.01 | 8.77              | 68,500,396.04 | 91.23                 |
| 国金国鑫<br>发起 C | 12,145       | 1,858.74      | 100,781.64   | 0.45              | 22,473,591.44 | 99.55                 |
| 合计           | 20,912       | 4,670.07      | 6,686,436.65 | 6.85              | 90,973,987.48 | 93.15                 |

## 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<br>(%) |
|--------------------------------------|----------|--------------|-----------------|
| 基金管<br>理人所<br>有从业<br>人员持<br>有本基<br>金 | 国金国鑫发起 A | 1,366,022.09 | 1.8193          |
|                                      | 国金国鑫发起 C | 23,606.17    | 0.1046          |
|                                      | 合计       | 1,389,628.26 | 1.4229          |

## 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   | 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<br>员、基金投资和研<br>究部门负责人持有本开<br>放式基金 | 国金国鑫发起 A | 10~50              |
|  | 国金国鑫发起 C | 0                  |
|  | 合计       | 10~50              |

|                     |          |        |
|---------------------|----------|--------|
| 本基金基金经理持有<br>本开放式基金 | 国金国鑫发起 A | 50~100 |
|                     | 国金国鑫发起 C | 0      |
|                     | 合计       | 50~100 |

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

注：无

#### 9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

注：本基金成立后有 11,001,640.59 份额为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 3 年，自 2012 年 8 月 28 日起至 2015 年 8 月 27 日止。承诺持有期限到期后，发起份额已全部赎回。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 国金国鑫发起 A       | 国金国鑫发起 C      |
|--|----------------|---------------|
| 基金合同生效日<br>(2012 年 8 月 28<br>日) 基金份额总额 | 178,532,819.63 | -             |
| 本报告期期初基金<br>份额总额                       | 79,086,082.60  | 59,604,511.66 |
| 本报告期基金总申<br>购份额                        | 8,667,914.66   | 32,622,546.66 |
| 减：本报告期基金<br>总赎回份额                      | 12,667,946.21  | 69,652,685.24 |
| 本报告期基金拆分<br>变动份额                       | -              | -             |
| 本报告期期末基金<br>份额总额                       | 75,086,051.05  | 22,574,373.08 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，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

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

原督察长张丽女士自 2023 年 6 月 14 日起由于个人原因离任基金管理人督察长职务，自 2023 年 6 月 14 日至 2023 年 7 月 24 日由公司总经理邵海波先生代任督察长职务，张静女士自 2023 年 7 月 24 日起担任基金管理人督察长职务。

除上述人事调整以外，本报告期内基金管理人无其他重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费用为 50,000.00 元，该会计师事务所自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称       | 交易单元数量 | 股票交易           |                  | 应支付该券商的佣金  |                | 备注 |
|------------|--------|----------------|------------------|------------|----------------|----|
|            |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 国信证券       | 1      | 799,519,792.68 | 48.25            | 587,625.67 | 48.25          | -  |
| 东方财富证券     | 1      | 295,030,562.60 | 17.81            | 215,921.98 | 17.73          | -  |
| 平安证券       | 1      | 223,303,398.03 | 13.48            | 165,416.06 | 13.58          | -  |
| 国金证券股份有限公司 | 2      | 185,622,266.77 | 11.20            | 135,746.13 | 11.15          | -  |
| 恒泰证券       | 1      | 45,293,354.04  | 2.73             | 33,123.18  | 2.72           | -  |
| 天风证券       | 1      | 39,406,764.55  | 2.38             | 28,818.34  | 2.37           | -  |
| 银河证券       | 1      | 37,758,315.    | 2.28             | 28,164.02  | 2.31           | -  |



|            |   |                   |      |           |      |   |
|------------|---|-------------------|------|-----------|------|---|
|            |   | 48                |      |           |      |   |
| 申万宏源<br>证券 | 1 | 31,047,454.<br>19 | 1.87 | 23,157.73 | 1.90 | - |
| 东方证券       | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 东兴证券       | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 方正证券       | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 光大证券       | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 国融证券       | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 国盛证券       | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 国信证券       | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 国元证券       | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 华安证券       | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 华金证券       | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 招商证券       | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 中山证券       | 2 | -                 | -    | -         | -    | - |

注：1. 本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定要求，本基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

(1) 基金专用交易席位的选择标准如下：

- ① 经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；
- ② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- ③ 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易需要；
- ④ 具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；
- ⑤ 交易佣金收取标准合理。

(2) 基金专用交易席位的选择程序如下：

- ① 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- ② 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

2. 本报告期新增华安证券、中山证券各一个交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |                 | 债券回购交易 |                   | 权证交易 |              |
|------|------|-----------------|--------|-------------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
|      |      |                 |        |                   |      |              |

|                        |   |   |   |   |   | (%) |
|------------------------|---|---|---|---|---|-----|
| 国信证<br>券               | - | - | - | - | - | -   |
| 东方财<br>富证券             | - | - | - | - | - | -   |
| 平安证<br>券               | - | - | - | - | - | -   |
| 国金证<br>券股份<br>有限公<br>司 | - | - | - | - | - | -   |
| 恒泰证<br>券               | - | - | - | - | - | -   |
| 天风证<br>券               | - | - | - | - | - | -   |
| 银河证<br>券               | - | - | - | - | - | -   |
| 申万宏<br>源证券             | - | - | - | - | - | -   |
| 东方证<br>券               | - | - | - | - | - | -   |
| 东兴证<br>券               | - | - | - | - | - | -   |
| 方正证<br>券               | - | - | - | - | - | -   |
| 光大证<br>券               | - | - | - | - | - | -   |
| 国融证<br>券               | - | - | - | - | - | -   |
| 国盛证<br>券               | - | - | - | - | - | -   |
| 国信证<br>券               | - | - | - | - | - | -   |
| 国元证<br>券               | - | - | - | - | - | -   |
| 华安证<br>券               | - | - | - | - | - | -   |
| 华金证<br>券               | - | - | - | - | - | -   |
| 招商证<br>券               | - | - | - | - | - | -   |
| 中山证<br>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  | 《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 2022 年第 4 季度报告》           | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2023 年 01 月 19 日 |
| 2  | 《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）》                 | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2023 年 02 月 24 日 |
| 3  | 《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金（国金国鑫发起 A 份额）基金产品资料概要（更新）》 | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2023 年 02 月 24 日 |
| 4  | 《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金（国金国鑫发起 C 份额）基金产品资料概要（更新）》 | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2023 年 02 月 24 日 |
| 5  | 《国金基金管理有限公司关于旗下基金开展网上直销平台费率优惠活动的公告》             | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2023 年 03 月 10 日 |
| 6  | 《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 2022 年年度报告》               | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2023 年 03 月 30 日 |
| 7  | 《国金基金管理有限公司关于公司系统升级的公告》                         | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2023 年 03 月 31 日 |
| 8  | 《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告》           | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2023 年 04 月 21 日 |
| 9  | 《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》                          | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2023 年 06 月 16 日 |
| 10 | 《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年第 2 季度报告》           | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2023 年 07 月 21 日 |
| 11 | 《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》                          | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2023 年 07 月 25 日 |
| 12 | 《国金基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率及托管费率并修订基金合同等法律文件的公告》  | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2023 年 08 月 04 日 |
| 13 | 《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》                      | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2023 年 08 月 04 日 |
| 14 | 《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》                      | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2023 年 08 月 04 日 |
| 15 | 《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）》                 | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2023 年 08 月 09 日 |
| 16 | 《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金（国金国鑫发起 A 份额）基金产品资料概要更新》   | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2023 年 08 月 09 日 |
| 17 | 《国金国鑫灵活配置混合型发起式                                 | 指定披露媒体和本基金            | 2023 年 08 月 09 日 |

|    |   |                   |                  |
|----|---|-------------------|------------------|
|    | 证券投资基金（国金国鑫发起 C 份额）基金产品资料概要更新》                | 基金管理人网站           |                  |
| 18 | 《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年中期报告》             | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2023 年 08 月 30 日 |
| 19 | 《国金基金管理有限公司关于凤凰金信（海口）基金销售有限公司投资者基金份额转托管的公告》   | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2023 年 09 月 13 日 |
| 20 | 《国金基金管理有限公司关于公司系统升级的公告》                       | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2023 年 09 月 26 日 |
| 21 | 《关于国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更的公告》             | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2023 年 09 月 28 日 |
| 22 | 《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金（国金国鑫发起 A 份额）基金产品资料概要更新》 | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2023 年 09 月 28 日 |
| 23 | 《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金（国金国鑫发起 C 份额）基金产品资料概要更新》 | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2023 年 09 月 28 日 |
| 24 | 《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）》               | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2023 年 09 月 28 日 |
| 25 | 《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年第 3 季度报告》         | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2023 年 10 月 25 日 |
| 26 | 《国金基金管理有限公司关于公司系统维护的公告》                       | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2023 年 11 月 22 日 |
| 27 | 《国金基金管理有限公司关于旗下基金网上直销平台费率优惠活动结束的公告》           | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2023 年 12 月 12 日 |
| 28 | 《国金基金管理有限公司关于公司系统维护的公告》                       | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2023 年 12 月 28 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              | 2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 19 日 | 33,001,122.04 | -    | 33,001,122.04 | -          | -        |
| 产品特有风险 |                |                                |               |      |               |            |          |

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额占比达到或超过 20% 的情形，由此可能导致的特有风险包括：产品流动性风险、巨额赎回风险以及净值波动风险等。本基金管理人将持续加强投资者集中度管理，审慎确认大额申购与大额赎回，同时进一步完善流动性风险管控机制，加强对基金份额持有人利益的保护。

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同；
- 3、国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议；
- 4、国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日