

国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金  
(LOF)  
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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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 .....	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
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 .....	15
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 .....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	15
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	15
6.2 审计报告的基本内容 .....	16
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表 .....	17
7.2 利润表 .....	19
7.3 净资产变动表 .....	20
7.4 报表附注 .....	22
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>51</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	51
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 .....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	58
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 .....	59
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 .....	59
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 .....	59
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 .....	59
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
8.12 投资组合报告附注 .....	59
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	61
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	61
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	61
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4 基金投资策略的改变 .....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
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 .....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8 其他重大事件 .....	63
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>65</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 .....	65
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
13.1 备查文件目录 .....	66
13.2 存放地点 .....	66
13.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	国金鑫新灵活配置（LOF）
场内简称	国金鑫新
基金主代码	501000
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月3日
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,122,605.84 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015年7月14日

注：无

### 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	一年期银行定期存款利率（税后）+3%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国金基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张静	潘琦
	联系电话	010-88005695	0755-22168257
	电子邮箱	zhangjing@gfund.com	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		4000-2000-18	95511-3
传真		010-88005666	0755-82080387
注册地址		北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		北京市朝阳区景辉街 31 号院 1	广东省深圳市福田区益田路

	号楼三星大厦 51 层	5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码	100020	518001
法定代表人	邵海波	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-829,240.30	-145,590.09	-80,870.95
本期利润	-825,930.02	-148,965.60	-120,450.40
加权平均基金份额本期利润	-0.0390	-0.0806	-0.0822
本期加权平均净值利润率	-4.87%	-9.60%	-8.71%
本期基金份额净值增长率	-1.85%	-10.41%	-8.79%
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	-436,828.46	-2,689,446.02	-155,587.56
期末可供分配基金份额利润	-0.2058	-0.1909	-0.0967

期末基金资产净值	1,685,777.38	11,395,274.27	1,454,009.51
期末基金份额净值	0.794	0.809	0.903
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	-20.60%	-19.10%	-9.70%

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

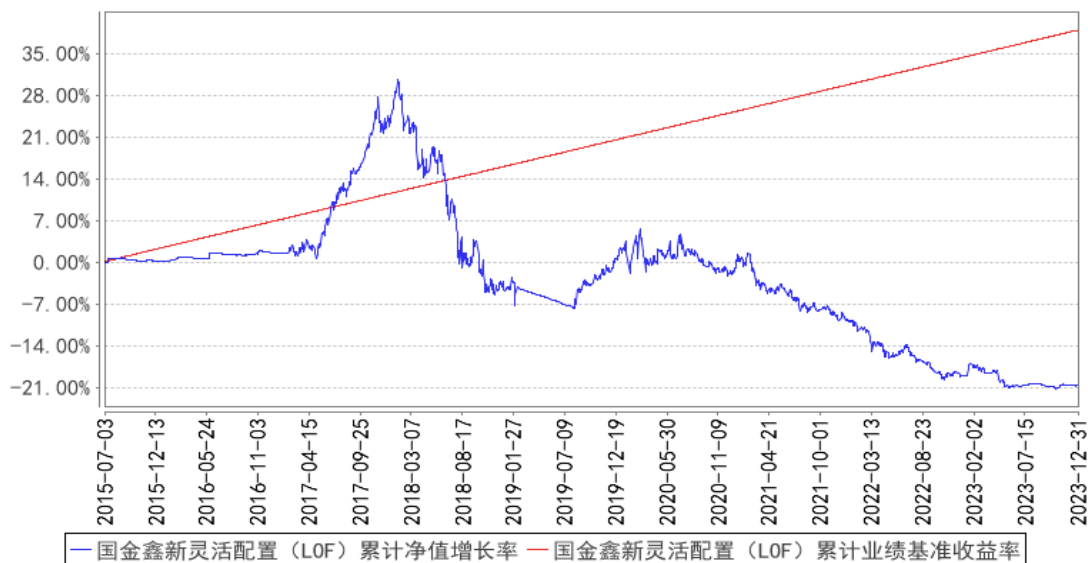
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.25%	0.08%	0.83%	0.01%	-0.58%	0.07%
过去六个月	0.25%	0.07%	1.68%	0.01%	-1.43%	0.06%
过去一年	-1.85%	0.20%	3.40%	0.01%	-5.25%	0.19%
过去三年	-19.80%	0.31%	10.93%	0.01%	-	30.73%
过去五年	-16.51%	0.42%	19.66%	0.01%	-	36.17%
自基金合同生效起至今	-20.60%	0.48%	38.92%	0.01%	-	59.52%

注：本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率(税后)+3%。

### 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

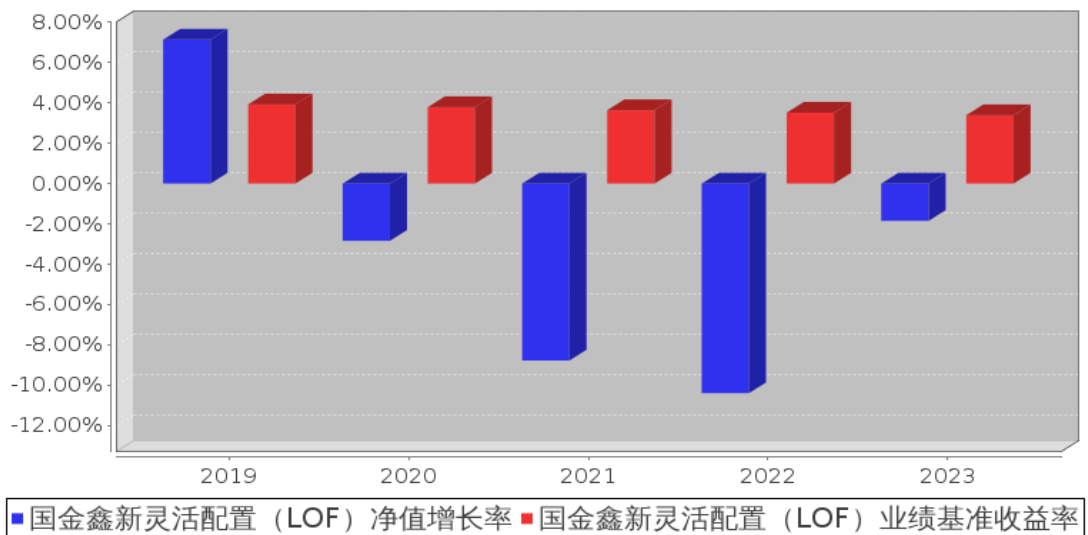
国金鑫新灵活配置（LOF）累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2015 年 7 月 3 日，图示日期为 2015 年 7 月 3 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

国金鑫新灵活配置（LOF）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：本基金的基金合同生效日为 2015 年 7 月 3 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

注：无

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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		
杜哲	本基金的基金经理	2023年1月11日	-	11年	杜哲先生，香港科技大学博士。2012年1月至2016年10月在安信证券股份有限公司资产管理部担任投资经理，2016年10月至2017年2月在东兴证券股份有限

					公司资产管理部担任投资主办，2017 年 3 月至 2018 年 10 月在嘉实基金管理有限公司配置策略组担任投资经理，2018 年 11 月至 2022 年 7 月在中国国际金融股份有限公司投资银行部、固定收益部担任投资经理，2022 年 7 月至 2022 年 9 月在中国国际金融股份有限公司担任固定收益部副总经理。2022 年 9 月加入国金基金管理有限公司，担任多资产投资部总经理。
宫雪	本基金的基金经理	2015 年 7 月 3 日	2023 年 1 月 19 日	14 年	宫雪女士，中国科学院博士。2008 年 7 月至 2011 年 12 月在博时基金管理有限公司股票投资部，任产业分析师；2012 年 2 月至 2023 年 1 月在国金基金管理有限公司，历任产品经理、行业分析师、产品与金融工程部副总经理、指数投资部副总经理、指数投资事业部总经理、量化投资事业部三部总经理兼产品中心代总经理、创新投资部总经理。

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合规守信情况的说明

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》《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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；研发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

报告期内，债市收益率呈现先上后下之后震荡的走势，股票市场也在年初冲高后震荡下行。截止到 2023 年 12 月 31 日，10 年国债收益率从 2022 年末的 2.84% 下行 28bp 至 2.56%，其中超长债、长债表现强劲，短端表现偏弱，利率曲线趋于平坦化；报告期内上证指数下跌 3.7%，Wind 全 A 下跌 5.19%，AI 和“中特估”等板块有阶段性表现。具体来看，全年债市主要交易逻辑围绕着经济修复实际情况与稳增长政策预期展开，股市除受上述因素影响外，也额外受到美联储加息、外资流出等事件影响。从债市表现来看，可以分为四个阶段。第一阶段（1 月-2 月），年初市场对于疫后经济复苏预期较强，10 年国债收益率创全年最高点 2.93%，Wind 全 A 也在此阶段创出年内高点。第二阶段（3 月-8 月），基本面弱现实不断得到印证，叠加央行超预期降息降准等宽货币举措，债市收益率一路下行至年内最低点 2.54%。第三阶段（8 月下旬-11 月），8 月下旬后稳增长政策开始发力，包括一线城市“认房不认贷”政策出台，特殊再融资债以及万亿国债增发导致资金面偏紧，10 年国债收益率回升至 2.70% 附近，短端上行更多利率曲线走平。第四阶段（12 月），政治局会议、中央经济工作会议落幕，未释放超预期的刺激政策，跨年资金大幅转松，10 年国债重新回到下行趋势。从股市表现来看，年初受疫后复苏预期影响表现较强，但随着疫后强修复预期证伪、消费动能不足、地产基建偏弱、美债利率坚挺及外资加速流出等因素影响，指数整体走弱，以结构性行情为主，科技股相对较为强势，高股息板块相对较为抗跌。

报告期内，为适应市场的走势及组合需要，本基金根据对大类资产的判断，有效控制住了权益仓位水平，努力控制权益仓位带来的波动风险，在利率债及偏债型和股债平衡型转债品种上做了适度配置。后续会重点跟进国内宏观基本面及流动性的变化、人民币汇率及海外形势的变化，留意不同策略间的相关性，根据对市场的判断做好大类资产配置，实施好风险预算管理，力争在控制回撤的情况下积极增厚收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金单位净值为 0.7940 元，累计单位净值为 0.7940 元；本报告期净值增长率为-1.85%，同期业绩比较基准增长率为 3.40%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，就国内而言，随着疫情影响的逐步消退，经济增速向潜在回归，经济增长将更为平稳。新旧动能转换，经济向高质量发展过程中，房地产对经济的负向拉动仍难言结束，叠加疫情以来的伤痕效应亦未完全修复，实体信贷扩张的意愿和能力有限，仍然需要逆周期政策发力以抑制经济下行-预期转弱的螺旋。

政策方面，中央经济工作会议定调“高质量发展是硬道理”，政策不会走强刺激的老路。货币政策总基调仍然要维持宽松，推动降低实际利率水平是当务之急。再结合美联储加息周期结束，外部环境的掣肘也大幅缓释，2 月降准率先开启，紧接着 5 年 LPR 大幅调降，央行有望继续引导广谱利率下行。流动性方面，四季度货币政策执行报告再提“引导市场利率围绕政策利率波动”，也提到要保证政府债券顺利发行，预计资金利率中枢仍将围绕政策利率波动，后续政府债发行对流动性的冲击将较去年四季度更为缓和。

债市策略方面，当前经济基本面处于经济引擎切换周期中，总需求偏弱，通胀处于低位实际利率偏高决定了货币政策仍然会保持宽松的基调。降准落地降息可期，债市利多仍未出尽，再叠加近期央行对流动性较为呵护，均推动债市行情继续演绎。从全年视角看，债市走势根本上取决于经济基本面，降准降息只是影响节奏，随着广谱利率下行，预计 10 年国债收益率仍将震荡下行，利率曲线或仍将维持平坦，久期策略占优。信用债方面，资产荒格局延续，配置力量较强，信用债后续随着利率下行仍将获取资本利得。

股市策略方面，考虑到宏观基本面仍然处于弱修复格局，宽基指数出现趋势性行情的概率可能较低，大概率以结构性行情为主。与 23 年不同的是，24 年美联储可能进入降息周期，对权益市场估值和国内货币政策的影响可能边际减弱，从而或对权益市场形成边际利好。板块方面，国家战略引领的科技发展及产业升级、受益于广谱利率下行的高股息板块等可能有相对较好的表现。

#### 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的情况。本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。本基金管理人已经按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》向中国证监会报告并提出解决方案。

## § 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

## § 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)专字第70015670_A01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	国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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。我们认为，后附的国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的财务报表在所有重大方面按照财务报表附注 7.4.2 所述编制基础编制。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF），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。
强调事项	我们提醒财务报表使用者关注财务报表附注 7.4.2 对编制基础的说明。国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）管理层编制财务报表是为了向基金份额持有人、中国证券监督管理委员会及其派出机构披露及报送。因此，财务报表不适用于其他用途。本段内容不影响已发表的审计意见。
其他事项	我们的报告仅供国金基金管理有限公司、基金份额持有人、中国证券监督管理委员会及其派出机构使用，而不应为除国金基金管理有限公司、基金份额持有人、中国证券监督管理委员会及其派出机构以外的其他方使用。
其他信息	国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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。 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。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，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。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照财务报表附注 7.4.2 所述编制基础编制财务报表（包括确定该编制基础对于在具体情况下编制财务报表是可以接受的），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。 治理层负责监督国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计



	<p>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>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3月29日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	35,505.63	10,388,153.19
结算备付金		210,361.06	4,921.56
存出保证金		17,132.94	124.85
交易性金融资产	7.4.7.2	1,390,108.12	4,285,481.23
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,390,108.12	4,285,481.23
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	99,958.23	1,250,000.00
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		50,037.79	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	1,273.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		1,803,103.77	15,929,954.31
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		60,296.41	4,472,090.82
应付赎回款		1,361.57	-
应付管理人报酬		2,693.44	3,051.35
应付托管费		224.46	254.27
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.73	0.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	52,749.78	59,283.43
负债合计		117,326.39	4,534,680.04
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	2,122,605.84	14,084,720.29
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-436,828.46	-2,689,446.02
净资产合计		1,685,777.38	11,395,274.27
负债和净资产总计		1,803,103.77	15,929,954.31

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.794 元，基金份额总额 2,122,605.84 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-491,752.60	-42,484.71
1. 利息收入		55,583.12	1,738.90
其中：存款利息收入	7.4.7.13	14,039.77	1,076.19
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		41,543.35	662.71
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-734,919.17	-41,194.20
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-1,102,634.08	-71,401.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	342,318.11	19,125.37
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	25,396.80	11,082.07
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	3,310.28	-3,375.51
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	184,273.17	346.10
<b>减：二、营业总支出</b>		334,177.42	106,480.89
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	206,006.04	17,797.73
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	17,167.25	1,483.15
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		23,403.85	-

其中：卖出回购金融资产支出		23,403.85	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		100.28	0.01
8. 其他费用	7.4.7.23	87,500.00	87,200.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-825,930.02	-148,965.60
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-825,930.02	-148,965.60
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-825,930.02	-148,965.60

### 7.3 净资产变动表

会计主体：国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	14,084,720.29	-	-2,689,446.02	11,395,274.27
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	14,084,720.29	-	-2,689,446.02	11,395,274.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-11,962,114.45	-	2,252,617.56	-9,709,496.89
（一）、综合收益总额	-	-	-825,930.02	-825,930.02
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-11,962,114.45	-	3,078,547.58	-8,883,566.87
其中：1. 基金申购款	114,452,157.85	-	-22,935,582.31	91,516,575.54
2. 基金赎回	-	-	26,014,129.89	-100,400,142.41

回款	126,414,272.30			
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,122,605.84	-	-436,828.46	1,685,777.38
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,609,597.07	-	-155,587.56	1,454,009.51
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,609,597.07	-	-155,587.56	1,454,009.51
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	12,475,123.22	-	-2,533,858.46	9,941,264.76
(一)、综合收益总额	-	-	-148,965.60	-148,965.60
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	12,475,123.22	-	-2,384,892.86	10,090,230.36
其中：1.基金申购款	12,626,953.20	-	-2,404,496.90	10,222,456.30
2.基金赎回款	-151,829.98	-	19,604.04	-132,225.94
(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)	-	-	-	-

填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	14,084,720.29	-	-2,689,446.02	11,395,274.27

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>邵海波</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

国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原名称为“国金通用鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”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”）[2015]928 号文《关于核准国金通用鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）募集的批复》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 2015 年 7 月 3 日生效。2015 年 9 月 23 日，本基金名称由“国金通用鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”变更为“国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。首次募集规模为 204,137,143.70 份基金份额，其中场外募集份额为 46,061,573.70 份，场内募集份额为 158,075,570.00 份。本基金基金管理人为国金基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

本基金的投资范围是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%-95%；投资于债券、债券回购、货币市场工具、银行存款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不低于基金资产的 5%；中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于 20%；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以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金在建立相关

业务流程和风险控制制度，经托管人同意并履行适当程序后可参与融资融券业务，参与融资融券业务需符合《基金参与融资融券及转融通证券出借业务指引》及其它相关法律法规规定。在不违反法律法规且对投资者利益无实质性影响、不改变本基金的风险收益特征、投资目标、投资策略的前提下；在管理人具备相应条件且与托管人协商一致后，本基金可投资沪港通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票，上述事项无需召开基金份额持有人大会，但需履行相应程序，并遵守相关规定。如法律法规或监管机构在基金合同生效以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围、投资比例规定。

本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）+3%。

国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会以通讯方式召开，会议审议通过了《关于终止国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》。基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，会议决议生效日为 2024 年 3 月 12 日。根据《关于终止国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》，本基金自 2024 年 3 月 13 日起进入清算程序。有关清算进程的详细情况参见本基金的相关公告。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及财务报表 7.4.4 所述的重要会计政策和会计估计编制。本基金管理人编制本财务报表是为了向基金份额持有人、中国证监会及其派出机构披露及报送。因此，本财务报表不适用于其他用途。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表按照 7.4.2 所述的编制基础编制。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 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) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

(8) 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

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

#### 7.4.4.13 分部报告

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。

#### 7.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财

税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	35,505.63	10,388,153.19
等于：本金	35,501.48	10,387,647.01
加：应计利息	4.15	506.18
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	35,505.63	10,388,153.19

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,380,760.61	7,955.12	1,390,108.12	1,392.39
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,380,760.61	7,955.12	1,390,108.12	1,392.39
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,380,760.61	7,955.12	1,390,108.12	1,392.39	

项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	4,256,247.89	31,151.23	4,285,481.23	-1,917.89
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	4,256,247.89	31,151.23	4,285,481.23	-1,917.89
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	4,256,247.89	31,151.23	4,285,481.23	-1,917.89	

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	99,958.23	-
银行间市场	-	-
合计	99,958.23	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,250,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,250,000.00	-

##### 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,749.78	283.43
其中：交易所市场	2,749.78	283.43
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	50,000.00	59,000.00
合计	52,749.78	59,283.43

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	14,084,720.29	14,084,720.29
本期申购	114,452,157.85	114,452,157.85
本期赎回 (以“-”号填列)	-126,414,272.30	-126,414,272.30
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	2,122,605.84	2,122,605.84

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,832,702.77	-4,522,148.79	-2,689,446.02
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,832,702.77	-4,522,148.79	-2,689,446.02
本期利润	-829,240.30	3,310.28	-825,930.02
本期基金份额交易产生的变动数	-762,398.44	3,840,946.02	3,078,547.58
其中：基金申购款	13,774,293.58	-36,709,875.89	-22,935,582.31
基金赎回款	-14,536,692.02	40,550,821.91	26,014,129.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	241,064.03	-677,892.49	-436,828.46

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	5,074.49	719.31
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	7,024.46	79.81
其他	1,940.82	277.07
合计	14,039.77	1,076.19

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	-1,102,634.08	-71,401.64
股票投资收益——赎回 差价收入	-	-
股票投资收益——申购 差价收入	-	-
股票投资收益——证券 出借差价收入	-	-
合计	-1,102,634.08	-71,401.64

## 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
卖出股票成交总 额	86,863,876.42	406,410.17
减：卖出股票成本 总额	87,739,750.33	477,033.83
减：交易费用	226,760.17	777.98
买卖股票差价收 入	-1,102,634.08	-71,401.64

## 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 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
债券投资收益——利 息收入	301,120.89	21,931.85
债券投资收益——买 卖债券（债转股及债	41,197.22	-2,806.48

券到期兑付) 差价收入		
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	342,318.11	19,125.37

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	289,668,414.39	1,668,171.17
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	286,288,405.23	1,636,036.00
减：应计利息总额	3,331,957.56	34,809.46
减：交易费用	6,854.38	132.19
买卖债券差价收入	41,197.22	-2,806.48

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	25,396.80	11,082.07
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	25,396.80	11,082.07

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	3,310.28	-3,375.51
股票投资	-	-3,484.62
债券投资	3,310.28	109.11
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-

其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	3,310.28	-3,375.51

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	184,273.17	346.10
合计	184,273.17	346.10

#### 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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
账户维护费	36,000.00	36,000.00
上清所查询服务费	1,500.00	1,200.00
合计	87,500.00	87,200.00

#### 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

国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会以通讯方式召开，会议审议通过了《关于终止国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》。基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，会议决议生效日为2024年3月12日。根据《关于终止国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》，本基金自

2024 年 3 月 13 日起进入清算程序。有关清算进程的详细情况参见本基金的相关公告。

截至财务报表批准日，除以上情况外，本基金无其他需要说明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
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
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
平安银行股份有限公司	基金托管人

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

注：无

###### 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

注：无

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	206,006.04	17,797.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	26,934.25	3,238.09
应支付基金管理人的净管理费	179,071.79	14,559.64

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	17,167.25	1,483.15

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司-活期存款	35,505.63	5,074.49	10,388,153.19	719.31

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

注：无

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	267,366.68	2,744,687.67
AAA 以下	214,760.59	523,280.68
未评级	-	-
合计	482,127.27	3,267,968.35

注：表中所列示的债券投资为除短期融资券、超短期融资券及其他按短期信用评级列示的债券投资、国债、政策性金融债、央行票据以外的债券投资。

##### 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	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

末 202 3年 12 月 31 日							
资产							
货币 资金	35,505.63	-	-	-	-	-	35,505.63
结算 备付 金	210,361.06	-	-	-	-	-	210,361.06
存出 保证 金	17,132.94	-	-	-	-	-	17,132.94
交易 性金 融资 产	21,161.12	-	555,606.34	688,670.16	124,670.50	-	1,390,108.12
买入 返售 金融 资产	99,958.23	-	-	-	-	-	99,958.23
应收 清算 款	-	-	-	-	-	50,037.79	50,037.79
资产	384,118.98	-	555,606.34	688,670.16	124,670.50	50,037.79	1,803,103.77

总计							
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	60,296.41	60,296.41
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,361.57	1,361.57
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,693.44	2,693.44
应付托管费	-	-	-	-	-	224.46	224.46
应交税费	-	-	-	-	-	0.73	0.73
其他负债	-	-	-	-	-	52,749.78	52,749.78
负债总计	-	-	-	-	-	117,326.39	117,326.39
利率敏感度缺口	384,118.98	-	555,606.34	688,670.16	124,670.50	-67,288.60	1,685,777.38

上 年 度 末 202 2年 12 月 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	10,388,153.19	-	-	-	-	-	10,388,153.19
结 算 备 付 金	4,921.56	-	-	-	-	-	4,921.56
存 出 保 证 金	124.85	-	-	-	-	-	124.85
交 易 性 金 融 资 产	-	732,278.63	1,332,843.70	1,543,357.53	677,001.37	-	4,285,481.23
买 入 返 售 金 融 资 产	1,250,000.00	-	-	-	-	-	1,250,000.00
应 收 申 购	998.50	-	-	-	-	274.98	1,273.48

款							
资产总计	11,644,198.10	732,278.63	1,332,843.70	1,543,357.53	677,001.37	274.98	15,929,954.31
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	4,472,090.82	4,472,090.82
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,051.35	3,051.35
应付托管费	-	-	-	-	-	254.27	254.27
应交税费	-	-	-	-	-	0.17	0.17
其他负债	-	-	-	-	-	59,283.43	59,283.43
负债总计	-	-	-	-	-	4,534,680.04	4,534,680.04
利率敏感度缺口	11,644,198.10	732,278.63	1,332,843.70	1,543,357.53	677,001.37	4,534,405.06	11,395,274.27

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

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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）
	+25 个基点	-8,312.02	-23,459.28
-25 个基点	8,385.49	23,748.85	

#### 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

注：无

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本报告期末及上年度末，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	482,127.27	3,267,968.35
第二层次	907,980.85	1,017,512.88
第三层次	-	-
合计	1,390,108.12	4,285,481.23

#### 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

注：无

##### 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

注：无

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,390,108.12	77.10
	其中：债券	1,390,108.12	77.10
	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	99,958.23	5.54
	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	245,866.69	13.64
8	其他各项资产	67,170.73	3.73
9	合计	1,803,103.77	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**

注：无

**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

注：无

## 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	600918	中泰证券	2,461,800.00	21.60
2	601398	工商银行	1,948,230.00	17.10
3	600600	青岛啤酒	1,699,069.00	14.91
4	688522	纳睿雷达	1,162,238.68	10.20
5	601888	中国中免	1,139,670.00	10.00
6	300474	景嘉微	1,116,947.00	9.80
7	002151	北斗星通	1,082,806.00	9.50
8	601939	建设银行	937,100.00	8.22
9	002534	西子洁能	900,759.00	7.90
10	300750	宁德时代	893,947.00	7.84
11	601995	中金公司	866,956.00	7.61
12	601668	中国建筑	830,600.00	7.29
13	600705	中航产融	797,700.00	7.00
14	600570	恒生电子	776,200.00	6.81
15	003031	中瓷电子	761,580.00	6.68
16	600000	浦发银行	753,500.00	6.61
17	300114	中航电测	740,856.00	6.50
18	300363	博腾股份	736,265.00	6.46
19	600460	士兰微	714,540.00	6.27
20	601117	中国化学	699,341.00	6.14
21	300630	普利制药	693,000.00	6.08
22	002841	视源股份	687,957.00	6.04
23	002938	鹏鼎控股	684,620.00	6.01
24	002821	凯莱英	672,689.60	5.90
25	300251	光线传媒	651,276.00	5.72
26	001289	龙源电力	650,538.00	5.71
27	688608	恒玄科技	650,000.00	5.70
28	601899	紫金矿业	640,300.00	5.62
29	300122	智飞生物	638,129.00	5.60
30	300058	蓝色光标	628,412.00	5.51
31	600893	航发动力	623,346.00	5.47
32	002415	海康威视	613,090.00	5.38
33	601186	中国铁建	601,100.00	5.27
34	002304	洋河股份	591,389.00	5.19
35	002493	荣盛石化	584,400.00	5.13

36	000002	万 科 A	579,160.00	5.08
37	000157	中联重科	568,900.00	4.99
38	600015	华夏银行	556,000.00	4.88
39	600848	上海临港	551,610.00	4.84
40	601998	中信银行	546,000.00	4.79
41	002929	润建股份	528,662.00	4.64
42	688777	中控技术	527,718.48	4.63
43	688349	三一重能	515,864.09	4.53
44	300499	高澜股份	506,305.00	4.44
45	600309	万华化学	499,633.00	4.38
46	603068	博通集成	498,855.00	4.38
47	300303	聚飞光电	494,400.00	4.34
48	600938	中国海油	478,420.00	4.20
49	601658	邮储银行	470,200.00	4.13
50	002371	北方华创	461,850.00	4.05
51	000651	格力电器	461,048.00	4.05
52	600905	三峡能源	450,400.00	3.95
53	688297	中无人机	444,251.21	3.90
54	002595	豪迈科技	443,198.00	3.89
55	300253	卫宁健康	440,262.00	3.86
56	603288	海天味业	434,955.00	3.82
57	300726	宏达电子	432,239.00	3.79
58	603858	步长制药	425,853.00	3.74
59	300979	华利集团	416,588.00	3.66
60	002837	英维克	413,900.00	3.63
61	600380	健康元	410,769.00	3.60
62	603233	大参林	408,715.00	3.59
63	601800	中国交建	408,710.00	3.59
64	601868	中国能建	403,500.00	3.54
65	603087	甘李药业	393,286.00	3.45
66	688981	中芯国际	387,352.15	3.40
67	003035	南网能源	381,500.00	3.35
68	600030	中信证券	375,726.00	3.30
69	600585	海螺水泥	375,632.00	3.30
70	000933	神火股份	370,400.00	3.25
71	002643	万润股份	367,000.00	3.22
72	600859	王府井	365,275.00	3.21
73	601333	广深铁路	364,500.00	3.20
74	600362	江西铜业	362,744.00	3.18
75	600016	民生银行	361,000.00	3.17
76	688166	博瑞医药	360,645.62	3.16
77	000617	中油资本	356,400.00	3.13
78	300618	寒锐钴业	350,481.00	3.08

79	600637	东方明珠	348,400.00	3.06
80	300529	健帆生物	347,046.00	3.05
81	603259	药明康德	346,365.00	3.04
82	601988	中国银行	344,000.00	3.02
83	601600	中国铝业	343,550.00	3.01
84	601390	中国中铁	341,900.00	3.00
85	300223	北京君正	340,167.00	2.99
86	601916	浙商银行	338,400.00	2.97
87	000089	深圳机场	337,100.00	2.96
88	600703	三安光电	336,981.00	2.96
89	603185	弘元绿能	336,925.00	2.96
90	600196	复星医药	334,870.00	2.94
91	688041	海光信息	333,554.64	2.93
92	000630	铜陵有色	328,000.00	2.88
93	300070	碧水源	324,000.00	2.84
94	600977	中国电影	319,365.00	2.80
95	603993	洛阳钼业	317,500.00	2.79
96	688083	中望软件	316,744.57	2.78
97	601985	中国核电	314,020.00	2.76
98	002317	众生药业	313,951.00	2.76
99	688392	骄成超声	312,810.00	2.75
100	600535	天士力	312,797.00	2.74
101	600435	北方导航	312,600.00	2.74
102	688167	炬光科技	309,030.00	2.71
103	000983	山西焦煤	308,100.00	2.70
104	002597	金禾实业	307,881.00	2.70
105	603982	泉峰汽车	304,186.00	2.67
106	300772	运达股份	298,800.00	2.62
107	688036	传音控股	293,061.53	2.57
108	000977	浪潮信息	291,305.00	2.56
109	003816	中国广核	290,000.00	2.54
110	300082	奥克股份	289,800.00	2.54
111	688561	奇安信	286,716.37	2.52
112	688385	复旦微电	284,987.70	2.50
113	600118	中国卫星	282,508.00	2.48
114	688158	优刻得	282,086.15	2.48
115	000848	承德露露	281,700.00	2.47
116	600021	上海电力	280,200.00	2.46
117	603638	艾迪精密	280,050.00	2.46
118	600050	中国联通	276,500.00	2.43
119	002916	深南电路	276,450.00	2.43
120	600132	重庆啤酒	276,071.00	2.42
121	002948	青岛银行	275,200.00	2.42

122	002939	长城证券	274,100.00	2.41
123	603501	韦尔股份	273,260.00	2.40
124	300782	卓胜微	272,930.00	2.40
125	300229	拓尔思	268,800.00	2.36
126	300741	华宝股份	268,600.00	2.36
127	000898	鞍钢股份	267,200.00	2.34
128	002928	华夏航空	257,000.00	2.26
129	301071	力量钻石	254,965.80	2.24
130	601611	中国核建	247,950.00	2.18
131	000785	居然之家	246,600.00	2.16
132	601816	京沪高铁	243,600.00	2.14
133	300684	中石科技	242,847.00	2.13
134	002007	华兰生物	235,000.00	2.06
135	300708	聚灿光电	231,089.00	2.03

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	600918	中泰证券	2,484,200.00	21.80
2	601398	工商银行	2,003,340.00	17.58
3	600600	青岛啤酒	1,583,929.00	13.90
4	300474	景嘉微	1,136,588.00	9.97
5	601888	中国中免	1,094,190.00	9.60
6	688522	纳睿雷达	1,092,292.15	9.59
7	002151	北斗星通	1,063,603.00	9.33
8	601939	建设银行	964,300.00	8.46
9	601995	中金公司	884,737.00	7.76
10	601668	中国建筑	878,700.00	7.71
11	300750	宁德时代	867,893.00	7.62
12	002534	西子洁能	832,373.00	7.30
13	300363	博腾股份	796,172.00	6.99
14	600570	恒生电子	781,184.00	6.86
15	600705	中航产融	773,400.00	6.79
16	600000	浦发银行	763,076.00	6.70
17	300114	中航电测	720,210.00	6.32
18	003031	中瓷电子	709,585.00	6.23
19	601117	中国化学	704,666.00	6.18
20	002841	视源股份	699,849.00	6.14
21	600460	士兰微	693,104.00	6.08
22	300058	蓝色光标	661,944.00	5.81
23	002821	凯莱英	656,225.00	5.76
24	001289	龙源电力	648,957.00	5.69

25	002938	鹏鼎控股	645,986.00	5.67
26	300630	普利制药	640,188.00	5.62
27	600893	航发动力	634,350.00	5.57
28	601186	中国铁建	626,200.00	5.50
29	002415	海康威视	611,712.00	5.37
30	300122	智飞生物	606,652.00	5.32
31	002493	荣盛石化	597,200.00	5.24
32	300251	光线传媒	594,063.00	5.21
33	601899	紫金矿业	582,900.00	5.12
34	688608	恒玄科技	579,128.42	5.08
35	000002	万 科 A	577,510.00	5.07
36	000157	中联重科	575,000.00	5.05
37	601998	中信银行	569,000.00	4.99
38	600015	华夏银行	566,000.00	4.97
39	002304	洋河股份	562,145.00	4.93
40	600848	上海临港	559,330.00	4.91
41	688777	中控技术	549,844.00	4.83
42	002929	润建股份	529,208.00	4.64
43	688349	三一重能	516,488.04	4.53
44	600938	中国海油	500,020.00	4.39
45	600309	万华化学	495,423.00	4.35
46	002371	北方华创	491,715.00	4.32
47	300303	聚飞光电	484,300.00	4.25
48	300499	高澜股份	483,921.00	4.25
49	603068	博通集成	476,782.00	4.18
50	601658	邮储银行	475,400.00	4.17
51	300726	宏达电子	474,340.00	4.16
52	000651	格力电器	457,634.00	4.02
53	002595	豪迈科技	450,820.00	3.96
54	600905	三峡能源	448,800.00	3.94
55	688297	中无人机	421,328.42	3.70
56	603288	海天味业	417,900.00	3.67
57	601868	中国能建	407,500.00	3.58
58	603233	大参林	403,515.00	3.54
59	688981	中芯国际	398,880.97	3.50
60	601800	中国交建	396,780.00	3.48
61	600380	健康元	391,650.00	3.44
62	603087	甘李药业	386,550.00	3.39
63	603858	步长制药	384,250.00	3.37
64	300253	卫宁健康	382,226.00	3.35
65	600030	中信证券	376,296.00	3.30
66	600585	海螺水泥	375,525.00	3.30
67	002837	英维克	373,580.00	3.28



68	601333	广深铁路	372,000.00	3.26
69	300979	华利集团	367,707.00	3.23
70	601988	中国银行	366,000.00	3.21
71	000617	中油资本	364,500.00	3.20
72	003035	南网能源	363,500.00	3.19
73	688041	海光信息	360,754.54	3.17
74	600016	民生银行	360,000.00	3.16
75	688166	博瑞医药	357,647.65	3.14
76	600859	王府井	356,812.00	3.13
77	600362	江西铜业	353,820.00	3.10
78	688036	传音控股	350,310.00	3.07
79	002643	万润股份	347,850.00	3.05
80	300223	北京君正	346,610.00	3.04
81	601600	中国铝业	346,250.00	3.04
82	000630	铜陵有色	345,000.00	3.03
83	601916	浙商银行	342,900.00	3.01
84	300529	健帆生物	339,210.00	2.98
85	603185	弘元绿能	337,660.00	2.96
86	600196	复星医药	337,300.00	2.96
87	000089	深圳机场	337,197.00	2.96
88	300618	寒锐钴业	335,360.00	2.94
89	601985	中国核电	333,168.00	2.92
90	601390	中国中铁	330,490.00	2.90
91	600637	东方明珠	327,600.00	2.87
92	300070	碧水源	327,000.00	2.87
93	000933	神火股份	326,000.00	2.86
94	603259	药明康德	325,905.00	2.86
95	600435	北方导航	321,900.00	2.82
96	688392	骄成超声	317,313.00	2.78
97	600703	三安光电	314,410.00	2.76
98	002317	众生药业	312,900.00	2.75
99	688167	炬光科技	311,898.78	2.74
100	002597	金禾实业	306,428.00	2.69
101	000983	山西焦煤	304,900.00	2.68
102	600535	天士力	302,102.00	2.65
103	688083	中望软件	302,049.20	2.65
104	688385	复旦微电	300,056.01	2.63
105	688561	奇安信	299,501.73	2.63
106	002916	深南电路	297,990.00	2.62
107	300082	奥克股份	297,600.00	2.61
108	600977	中国电影	294,413.00	2.58
109	603993	洛阳钼业	294,100.00	2.58
110	603982	泉峰汽车	293,854.00	2.58

111	688158	优刻得	291,482.76	2.56
112	003816	中国广核	291,000.00	2.55
113	300772	运达股份	283,600.00	2.49
114	300782	卓胜微	279,577.00	2.45
115	600050	中国联通	278,000.00	2.44
116	000977	浪潮信息	277,950.00	2.44
117	002948	青岛银行	276,800.00	2.43
118	600021	上海电力	276,250.00	2.42
119	600132	重庆啤酒	275,682.00	2.42
120	002939	长城证券	274,429.00	2.41
121	603501	韦尔股份	271,023.00	2.38
122	000898	鞍钢股份	269,900.00	2.37
123	600118	中国卫星	268,561.00	2.36
124	301071	力量钻石	264,767.00	2.32
125	603638	艾迪精密	264,757.00	2.32
126	000848	承德露露	260,200.00	2.28
127	002928	华夏航空	255,200.00	2.24
128	601611	中国核建	252,800.00	2.22
129	000785	居然之家	249,900.00	2.19
130	002007	华兰生物	245,825.00	2.16
131	300741	华宝股份	244,186.00	2.14
132	300229	拓尔思	243,650.00	2.14
133	601816	京沪高铁	241,280.00	2.12
134	688058	宝兰德	238,221.95	2.09
135	300684	中石科技	229,173.00	2.01

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	87,739,750.33
卖出股票收入（成交）总额	86,863,876.42

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	907,980.85	53.86
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	482,127.27	28.60
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,390,108.12	82.46

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019678	22 国债 13	4,000	404,699.18	24.01
2	019728	23 国债 25	4,000	402,351.01	23.87
3	113516	苏农转债	1,390	150,907.16	8.95
4	113052	兴业转债	1,400	142,675.34	8.46
5	019705	23 国债 12	1,000	100,930.66	5.99

## 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

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，无锡农村商业银行股份有限公司于 2023 年 09 月 25 日受到国家金融监督管理总局无锡监管分局给予罚款 50 万元的行政处罚决定；重庆银行股份有限公司于 2023 年 11 月 09 日受到国家金融监督管理总局给予罚款 150 万元的行政处罚决定。

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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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	17,132.94
2	应收清算款	50,037.79
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	67,170.73

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113516	苏农转债	150,907.16	8.95
2	113052	兴业转债	142,675.34	8.46
3	113056	重银转债	81,839.19	4.85
4	113024	核建转债	32,081.19	1.90
5	110043	无锡转债	21,161.12	1.26
6	113669	景23转债	11,939.88	0.71
7	113569	科达转债	11,251.97	0.67
8	113049	长汽转债	10,770.96	0.64
9	123108	乐普转2	7,700.50	0.46

### 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

持有人户数	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
376	5,645.23	-	-	2,122,605.84	100.00

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	丛章利	546,606.00	32.02
2	穆怀发	197,754.00	11.58
3	张卫东	180,000.00	10.54
4	彭志红	121,079.00	7.09
5	刘克川	55,780.00	3.27
6	尹华	46,723.00	2.74
7	余淑英	39,400.00	2.31
8	诸君鲁	26,700.00	1.56
9	乡炳基	24,206.00	1.42
10	杨秀英	22,214.00	1.30

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	13,568.49	0.6392

## 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

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

注：无

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年7月3日）基金份额总额	204,137,143.70
本报告期期初基金份额总额	14,084,720.29
本报告期基金总申购份额	114,452,157.85
减：本报告期基金总赎回份额	126,414,272.30
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,122,605.84

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

本基金投资策略未发生变化。

### 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	101,010,442.35	57.85	73,917.04	57.85	-
方正证券	1	73,593,184.	42.15	53,858.37	42.15	-

		40			
--	--	----	--	--	--

注：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。

### 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(%)
国信证券	401,542,674.95	91.01	677,338,000.00	100.00	-	-
方正证券	39,666,429.38	8.99	-	-	-	-

### 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	《关于国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理变更的公告》	指定披露媒体和本基金管理人网站	2023年01月12日
2	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金管理人网站	2023年01月13日
3	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要》	指定披露媒体和本基金管理人网站	2023年01月13日

	（更新）》		
4	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2022 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 01 月 19 日
5	《关于国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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 01 月 19 日
6	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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 01 月 20 日
7	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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 01 月 20 日
8	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2022 年第三季度报告更正公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 02 月 11 日
9	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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 02 月 24 日
10	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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 02 月 24 日
11	《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 基金管理人网站	2023 年 03 月 10 日
12	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2022 年年度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 03 月 30 日
13	《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 03 月 31 日
14	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2023 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 04 月 21 日
15	《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 基金管理人网站	2023 年 06 月 16 日
16	《国金基金管理有限公司关于旗下基金在直销柜台开展费率优惠活动的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 07 月 14 日
17	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2023 年第 2 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 07 月 21 日
18	《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 基金管理人网站	2023 年 07 月 25 日
19	《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	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 08 月 04 日



	告》		
20	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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
21	《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
22	《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
23	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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
24	《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
25	《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
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 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 3 月 28 日； 2023 年 5 月 30 日-2023 年 6 月 29 日； 2023 年 7 月 25 日- 2023 年 12 月 7 日	6,180,160 .71	-	6,180,160 .71	-	-
	2	2023 年 3 月 29 日-2023 年 5 月 29 日	-	18,426,289.93	18,426,289.93	-	-
	3	2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 22 日	4,941,904 .82	-	4,941,904 .82	-	-

	4	2023年3月24日-2023年3月28日；2023年7月18日-2023年8月9日	-	19,985,736.20	19,985,736.20	-	-
	5	2023年3月24日-2023年6月29日；2023年7月18日-2023年7月25日	-	12,268,711.66	12,268,711.66	-	-
个人	1	2023年12月8日-2023年12月31日	93,340.00	618,602.00	165,336.00	546,606.00	25.75
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、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同；
- 3、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议；
- 4、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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