

# 国泰君安君得诚混合型证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 03 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董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年03月15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。

本报告期自2023年01月01日起至2023年12月31日止。

## 1.2 目录

|                                 |           |
|---------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>              | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                        | 2         |
| 1.2 目录                          | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                 | <b>7</b>  |
| 2.1 基金基本情况                      | 7         |
| 2.2 基金产品说明                      | 7         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                 | 8         |
| 2.4 信息披露方式                      | 8         |
| 2.5 其他相关资料                      | 8         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                 | 8         |
| 3.2 基金净值表现                      | 9         |
| 3.3 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     | 13        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望     | 13        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况         | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明        | 14        |

|   |           |
|---|-----------|
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                 | 14        |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....       | 14        |
| <b>§ 5 托管人报告 .....</b>                        | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....                  | 15        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 .....                           | 15        |
| <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 .....                              | 21        |
| 7.4 报表附注 .....                                | 22        |
| <b>§ 8 投资组合报告 .....</b>                       | <b>45</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 46        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 46        |
| 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 .....       | 47        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                     | 48        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 53        |
| 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 .....      | 54        |
| 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 .....   | 54        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 ..... | 54        |
| 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 .....    | 54        |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 54        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 54        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 55        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>55</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 55        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 56        |
| 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 .....      | 56        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>                 | <b>56</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>56</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 56        |
| 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 .....      | 56        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 57        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 57        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 57        |
| 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 .....         | 57        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 57        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 58        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>59</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 .....    | 59        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 59        |

|                   |    |
|-------------------|----|
| § 13 备查文件目录 ..... | 60 |
| 13.1 备查文件目录 ..... | 60 |
| 13.2 存放地点 .....   | 60 |
| 13.3 查阅方式 .....   | 60 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金名称       | 国泰君安君得诚混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 国泰君安君得诚混合        |
| 基金主代码      | 952035           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2020 年 03 月 25 日 |
| 基金管理人      | 上海国泰君安证券资产管理有限公司 |
| 基金托管人      | 招商银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 215,698,072.42 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金利用基金管理人的研究优势，主要投资于具备持续增长能力的优秀企业，并通过宏观、市场和价值分析，捕捉价值型公司（价值公司）的投资机会。通过科学合理的资产配置和股票组合，力争实现基金资产的长期稳定增值。  |
| 投资策略   | <ol style="list-style-type: none"> <li>1、资产配置策略</li> <li>2、股票投资策略 <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 行业配置策略</li> <li>(2) 公司股票精选策略</li> </ol> </li> <li>3、组合调整策略</li> <li>4、股指期货、国债期货交易策略 <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 股指期货投资策略</li> <li>(2) 国债期货投资策略</li> </ol> </li> <li>5、债券的投资策略 <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 利率策略</li> <li>(2) 信用策略</li> <li>(3) 债券选择策略</li> <li>(4) 可转债的投资策略</li> </ol> </li> <li>6、资产支持证券等品种投资策略</li> <li>7、股票期权的投资策略</li> <li>8、港股投资策略</li> </ol> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×30%+恒生指数收益率×10%   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、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      |      | 上海国泰君安证券资产管理有限公司                  | 招商银行股份有限公司                  |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 吕巍                                | 张姗                          |
|         | 联系电话 | 021-38676022                      | 400-61-95555                |
|         | 电子邮箱 | zgxxpl@gtjas.com                  | zhangshan_1027@cmbchina.com |
| 客户服务电话  |      | 95521                             | 400-61-95555                |
| 传真      |      | 021-38871190                      | 0755-83195201               |
| 注册地址    |      | 上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室         | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦        |
| 办公地址    |      | 上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦        |
| 邮政编码    |      | 200120                            | 518040                      |
| 法定代表人   |      | 陶耿                                | 缪建民                         |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                   |
|---------------------|-----------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券日报》                            |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.gtjazg.com                    |
| 基金年度报告备置地点          | 上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层 |

## 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） | 上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 50 楼 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司     | 北京市西城区太平桥大街 17 号               |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2023 年         | 2022 年         | 2021 年          |
|---------------|----------------|----------------|-----------------|
| 本期已实现收益       | -45,277,965.16 | -71,493,178.6  | -96,520,142.04  |
| 本期利润          | -36,484,785.01 | -96,993,751.55 | -102,600,955.06 |
| 加权平均基金份额本期    | -0.1581        | -0.3631        | -0.2187         |



|                      |                |                |                |
|----------------------|----------------|----------------|----------------|
| 利润                   |                |                |                |
| 本期加权平均净值利润率          | -18.51%        | -35.93%        | -15.78%        |
| 本期基金份额净值增长率          | -18.38%        | -27.40%        | -17.10%        |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>2023 年末</b> | <b>2022 年末</b> | <b>2021 年末</b> |
| 期末可供分配利润             | -20,608,296.17 | 24,510,335.69  | 113,398,179.62 |
| 期末可供分配基金份额利润         | -0.0955        | 0.0992         | 0.3486         |
| 期末基金资产净值             | 157,375,070.03 | 220,745,089.22 | 400,510,849.84 |
| 期末基金份额净值             | 0.7296         | 0.8939         | 1.2312         |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | <b>2023 年末</b> | <b>2022 年末</b> | <b>2021 年末</b> |
| 基金份额累计净值增长率          | -27.04%        | -10.61%        | 23.12%         |

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | -7.94%   | 1.02%       | -4.21%     | 0.57%         | -3.73%  | 0.45% |
| 过去六个月      | -18.90%  | 1.06%       | -6.81%     | 0.61%         | -12.09% | 0.45% |
| 过去一年       | -18.38%  | 1.08%       | -6.79%     | 0.61%         | -11.59% | 0.47% |
| 过去三年       | -50.88%  | 1.34%       | -21.73%    | 0.78%         | -29.15% | 0.56% |
| 自基金合同生效起至今 | -27.04%  | 1.32%       | -0.30%     | 0.79%         | -26.74% | 0.53% |

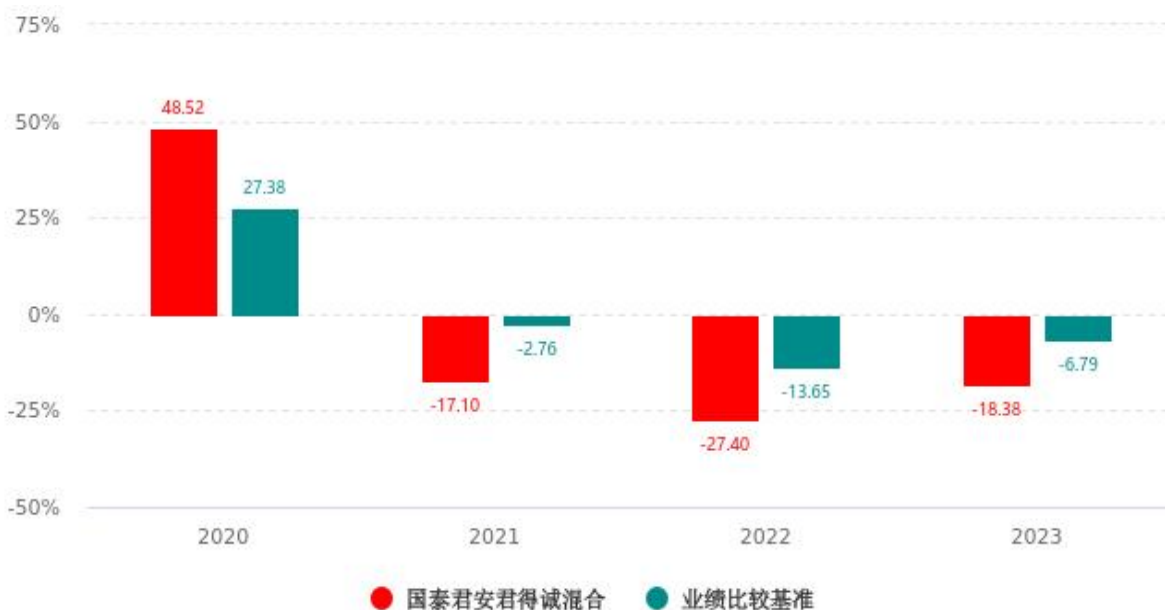
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰君安君得诚混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年03月25日-2023年12月31日)



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



注：本基金合同生效日为 2020 年 3 月 25 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海国泰君安证券资产管理有限公司正式成立于 2010 年 10 月 18 日，经中国证监会证监许可【2010】631 号文批准，是业内首批券商系资产管理公司。公司注册资本金 20 亿元，注册地上海。

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理国泰君安现金管家货币市场基金、国泰君安 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、国泰君安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金、国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金、国泰君安君得明混合型证券投资基金、国泰君安东久新经济产业园封闭式基础设施证券投资基金、国泰君安君得利短债债券型证券投资基金、国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、国泰君安 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安安弘六个月定期开放债券型证券投资基金、国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金等 48 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务  | 任本基金的基金经理（助理）期限 |            | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|---|-----------------|------------|--------|--|
|     |   | 任职日期            | 离任日期       |        |  |
| 王海军 | 国泰君安君得盛债券型证券投资基金基金经理，国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金经理，国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金经理。现任公募权益投资部基金经理。 | 2023-02-13      | -          | 15 年   | 王海军，厦门大学工商管理硕士，具备证券业、基金业从业资格。历任中国中投证券有限公司研究所分析师；富国基金管理有限公司权益研究部高级研究员、权益投资部高级基金经理；长安基金管理有限公司研究部总监、投决会成员、基金经理；2021 年 9 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司私募权益投资部担任投资经理，现任公募权益投资部基金经理。 |
| 郑伟  | 本基金基金经理（已于 2023 年 03 月 16 日离任）  | 2022-02-21      | 2023-03-16 | 13 年   | 郑伟，经济学硕士，毕业于复旦经济学院国际金融系。历任中信保诚基金研究员、基金经理、高级基金经理。2021 年 9   |

|     |                                |            |            |      |   |
|-----|--------------------------------|------------|------------|------|---|
|     |                                |            |            |      | 月至 2023 年 5 月就职于上海国泰君安证券资产管理有限公司公募权益投资部。从业时间超过 15 年，具备丰富的行业研究经验及管理基金经历。   |
| 葛瑾洁 | 本基金基金经理（已于 2023 年 03 月 16 日离任） | 2022-02-21 | 2023-03-16 | 10 年 | 葛瑾洁，复旦大学硕士。历任深圳华大基因研究院知识产权部专利顾问、华润元大基金管理有限公司投资管理部高级研究员、基金经理助理，鹏华基金管理有限公司研究部高级研究员、社保基金经理助理、投资经理。2021 年 11 月至 2023 年 4 月就职于上海国泰君安证券资产管理有限公司权益研究部。 |

注：1、上述“任职日期”和“离任日期”为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，其“任职日期”为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规、相关规定以及基金合同、招募说明书约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法违规行为及违反基金合同、招募说明书约定的行为，无侵害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《上海国泰君安证券资产管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保

公平对待所有的投资组合，切实防范利益输送行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外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% 的次数为 27 次。本基金与本公司管理的其他组合在不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)同向交易的交易价差未出现异常。

### 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 年分季度看，GDP 同比增速分别为 4.5%、6.3%、5.2%、5.1%，经济平稳增长。固定资产投资的增长速度为 3%，社会消费品零售总额实现同比 7.22%，比 2022 年的增长幅度大幅提高 7.5 个百分点，对经济的贡献度提高。从资本市场的走势分析来看，上半年经济复苏不及市场的预期，顺周期板块表现落后平均涨幅。整个 2023 年来看，主观投资策略在包括量化策略、中性策略等资金行为影响下几乎失去效用，很多公司的股价表现已经脱离了基本面的变化，虽然调整的时间没有可预期性，但也给主观投资策略带来了挑选优质成长股票的时间和机会。

2023 年整个年度里，虽然市场波动速度和强度都比较大，但本基金始终坚持低 PEG 选股策略，注重上市公司的现金流质量、估值性价比、盈利质量等指标，行业配置上采取价值和成长均衡策略，行业布局兼顾科技和经济复苏链条。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安君得诚混合基金份额净值为 0.7296 元，本报告期内，基金份额净值增长率为-18.38%，同期业绩比较基准收益率为-6.79%。

### 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，外部美联储降息预期变化、地缘冲突等对经济贸易的影响存在不确定性。国内货币环境预计不会发生很大变化，经济的进一步复苏存在可能性。从证券市场来看，消费行业和科技行业存在强者恒强的趋势，在这些行业里选择强势公司成为选择之一。

### 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，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合规运作角度出发，在合规文化建设、制度体系建设、合规审查及检查、反洗钱、员工执业行为规范等角度开展工作，不断深

化员工的合规意识，推动公司合规文化和内部风险控制机制的完善和优化。

内部监察工作重点包括以下几个方面：

1、合规文化建设。管理人通过内外部合规培训、合规考试、法规解读、法律法规库维护更新、监管会议精神传达等多种形式推动公司合规文化建设，不断提高全体员工合规意识，为公司业务健康发展提供良好的文化土壤。

2、制度体系建设和完善。管理人根据法律法规变化，结合行业新动态，围绕新业务需要，不断优化和健全公司制度体系，并注重相关制度体系的落实和执行。通过制度体系的建设和完善，不断提升了业务管理流程的健全性、规范性、精细化和可操作性，为公司业务规范运营和合规管理进一步夯实了制度基础。

3、合规审查和检查。根据法律法规、监管要求和公司制度规定，做好对公司新业务、新产品、新投资品种及其他创新业务的法律合规及风险控制支持，定期对产品销售、投资、研究及交易等相关业务活动的日常合规性进行检查，查漏补缺。合规检查工作促进了内部控制管理的完善，防范了合规风险的进一步发生。

4、员工执业与投资行为管理。根据法律法规和公司制度要求，管理人不断加强员工执业行为管理。管理人要求新员工入职时需提供和完善个人信息并完成相关投资的申报工作，对投资、交易人员的通讯工具实行交易时间段集中管理，并对监控摄像、电子邮件、电话录音和即时通讯工具聊天记录定期进行合规检查。通过一系列常态化的员工执业和投资行为管理，促进员工执业和投资行为持续符合监管要求。

5、反洗钱合规管理。本报告期内，管理人持续加强反洗钱合规管理，制定反洗钱工作方案，并在年度内推进落实。持续做好日常可疑交易监控排查、客户风险等级划分、修订反洗钱内部控制管理制度、跟进反洗钱系统改造、完成各类反洗钱工作报告、反洗钱金融机构分类评级自评工作等。

管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部合规风控工作的科学性和有效性，努力防范和控制各类风险，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 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，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同的约定进行收益分配。

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

本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

## § 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

托管人声明：招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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 70074144_B03 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 | 国泰君安君得诚混合型证券投资基金全体份额持有人  |
| 审计意见    | 我们审计了国泰君安君得诚混合型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。<br>我们认为，后附的国泰君安君得诚混合型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 |

|                 |  |
|-----------------|--|
|                 | 了国泰君安君得诚混合型证券投资基金 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。   |
| 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，我们独立于国泰君安君得诚混合型证券投资基金，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。  |
| 强调事项            | 无  |
| 其他事项            | 无  |
| 其他信息            | <p>国泰君安君得诚混合型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，管理层负责评估国泰君安君得诚混合型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>治理层负责监督国泰君安君得诚混合型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，就可能对导致对国泰君安君得诚混合型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泰君安君得诚混合型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  | 吕红艳   陈雯   |
| 会计师事务所的地址 | 上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 50 楼   |
| 审计报告日期    | 2024-03-26   |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国泰君安君得诚混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|----------------------|-----------------------|
| <b>资产：</b> |         |                      |                       |
| 货币资金       | 7.4.7.1 | 15,080,471.30        | 31,701,520.10         |
| 结算备付金      |         | 178,905.94           | 106,784.15            |
| 存出保证金      |         | 67,666.66            | 52,379.55             |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 143,781,566.15       | 189,460,164.23        |
| 其中：股票投资    |         | 143,781,566.15       | 189,460,164.23        |

|               |            |                             |                              |
|---------------|------------|-----------------------------|------------------------------|
| 基金投资          |            | -                           | 0                            |
| 债券投资          |            | -                           | 0                            |
| 资产支持证券投资      |            | -                           | 0                            |
| 贵金属投资         |            | -                           | 0                            |
| 其他投资          |            | -                           | 0                            |
| 衍生金融资产        |            | -                           | 0                            |
| 买入返售金融资产      | 7.4.7.3    | -                           | 0                            |
| 债权投资          |            | -                           | 0                            |
| 其中：债券投资       |            | -                           | 0                            |
| 资产支持证券投资      |            | -                           | 0                            |
| 其他投资          |            | -                           | 0                            |
| 应收清算款         |            | -                           | 0                            |
| 应收股利          |            | -                           | 0                            |
| 应收申购款         |            | 1,482.62                    | 2,201.13                     |
| 递延所得税资产       |            | -                           | 0                            |
| 其他资产          |            | -                           | -                            |
| 资产总计          |            | 159,110,092.67              | 221,323,049.16               |
| <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          |            | -                           | 0                            |
| 交易性金融负债       |            | -                           | 0                            |
| 衍生金融负债        |            | -                           | 0                            |

|             |         |                |                |
|-------------|---------|----------------|----------------|
| 卖出回购金融资产款   |         | -              | 0              |
| 应付清算款       |         | 484,267.31     | 0.01           |
| 应付赎回款       |         | 753,212.13     | 4,059.82       |
| 应付管理人报酬     |         | 162,727.51     | 230,212.55     |
| 应付托管费       |         | 27,121.25      | 47,960.93      |
| 应付销售服务费     |         | -              | 0              |
| 应付投资顾问费     |         | -              | 0              |
| 应交税费        |         | -              | 0              |
| 应付利润        |         | -              | 0              |
| 递延所得税负债     |         | -              | 0              |
| 其他负债        | 7.4.7.4 | 307,694.44     | 295,726.63     |
| 负债合计        |         | 1,735,022.64   | 577,959.94     |
| <b>净资产：</b> |         |                |                |
| 实收基金        | 7.4.7.5 | 166,404,364.81 | 190,520,009.20 |
| 未分配利润       | 7.4.7.6 | -9,029,294.78  | 30,225,080.02  |
| 净资产合计       |         | 157,375,070.03 | 220,745,089.22 |
| 负债和净资产总计    |         | 159,110,092.67 | 221,323,049.16 |

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7296 元，基金份额总额 215,698,072.42 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国泰君安君得诚混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|----|-----|---------------------------------------|--|
|----|-----|---------------------------------------|--|

|                        |            |                |                |
|------------------------|------------|----------------|----------------|
| <b>一、营业总收入</b>         |            | -33,464,469.95 | -92,860,444.06 |
| 1. 利息收入                |            | 92,112.80      | 218,640.68     |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.7    | 92,112.80      | 194,070.13     |
| 债券利息收入                 |            | -              | 0              |
| 资产支持证券利息收入             |            | -              | 0              |
| 买入返售金融资产收入             |            | -              | 24,570.55      |
| 其他利息收入                 |            | -              | 0              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -42,352,839.83 | -67,588,413.15 |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.8    | -44,240,648.75 | -68,174,474.02 |
| 基金投资收益                 |            | -              | -              |
| 债券投资收益                 |            | -              | -              |
| 资产支持证券投资收益             |            | -              | -              |
| 贵金属投资收益                |            | -              | -              |
| 衍生工具收益                 |            | -              | 0              |
| 股利收益                   | 7.4.7.9    | 1,887,808.92   | 586,060.87     |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益  |            | -              | 0              |
| 其他投资收益                 |            | -              | 0              |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.10   | 8,793,180.15   | -25,500,572.95 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -              | -              |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.11   | 3,076.93       | 9,901.36       |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |            | 3,020,315.06   | 4,133,307.49   |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 2,374,323.63   | 3,255,527.67   |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 456,287.70     | 678,234.97     |
| 3. 销售服务费               |            | -              | 0              |

|                            |          |                |                |
|----------------------------|----------|----------------|----------------|
| 4. 投资顾问费                   |          | -              | 0              |
| 5. 利息支出                    |          | -              | 0              |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -              | 0              |
| 6. 信用减值损失                  |          | -              | 0              |
| 7. 税金及附加                   |          | -              | 0              |
| 8. 其他费用                    | 7.4.7.12 | 189,703.73     | 199,544.85     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | -36,484,785.01 | -96,993,751.55 |
| 减：所得税费用                    |          | -              | 0              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | -36,484,785.01 | -96,993,751.55 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | -              | -              |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | -36,484,785.01 | -96,993,751.55 |

### 7.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安君得诚混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 |                |                |
|--|---------------------------------------|----------------|----------------|
|  | 实收基金                                  | 未分配利润          | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产                                | 190,520,009.2                         | 30,225,080.02  | 220,745,089.22 |
| 二、本期期初净资产                                | 190,520,009.2                         | 30,225,080.02  | 220,745,089.22 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -24,115,644.39                        | -39,254,374.80 | -63,370,019.19 |
| （一）、综合收益总额                               | -                                     | -36,484,785.01 | -36,484,785.01 |
| （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）      | -24,115,644.39                        | -2,769,589.79  | -26,885,234.18 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 4,935,569.94                          | 592,633.56     | 5,528,203.50   |
| 2. 基金赎回款                                 | -29,051,214.33                        | -3,362,223.35  | -32,413,437.68 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                                     | -              | -              |

| 四、本期期末净资产                                | 166,404,364.81                             | -9,029,294.78   | 157,375,070.03  |
|--|--|-----------------|-----------------|
| 项 目                                      | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日 |                 |                 |
|  | 实收基金                                       | 未分配利润           | 净资产合计           |
| 一、上期期末净资产                                | 250,955,433.11                             | 149,555,416.73  | 400,510,849.84  |
| 加：会计政策变更                                 | -  | 0               | 0               |
| 前期差错更正                                   | -  | -               | -               |
| 其他                                       | -  | -               | -               |
| 二、本期期初净资产                                | 250,955,433.11                             | 149,555,416.73  | 400,510,849.84  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -60,435,423.91                             | -119,330,336.71 | -179,765,760.62 |
| (一)、综合收益总额                               | -  | -96,993,751.55  | -96,993,751.55  |
| (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)      | -60,435,423.91                             | -22,336,585.16  | -82,772,009.07  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 2,675,076.03                               | 836,183.55      | 3,511,259.58    |
| 2. 基金赎回款                                 | -63,110,499.94                             | -23,172,768.71  | -86,283,268.65  |
| (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) | 0  | 0               | 0               |
| 四、本期期末净资产                                | 190,520,009.2                              | 30,225,080.02   | 220,745,089.22  |

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：

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| 陶耿       | 庄严        | 茹建江     |
| 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

国泰君安君得诚混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划变更而来。国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划由国泰君安君得稳一号集合资产管理计划变更而来。本基金的基金合同于 2022 年 2 月 14 日正式生效。本基金为契约型开放式。

国泰君安君得稳一号集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，自 2013 年 2 月 19 日起开始募集，于 2013 年 2 月 21 日结束募集工作，并于 2013 年 2 月 27 日成立。2013 年 5 月 31 日，国泰君安君得稳一号集合资产管理计划取得《关于上海国泰君安证券资产管理有限公司发起设立国泰君安君得稳一号集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函〔2013〕941 号）。

根据《基金法》、《运作办法》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等法律法规的规定及《国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划资产管理合同》的约定，国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划变更为国泰君安君得诚混合型证券投资基金，即本基金，并相应修改《国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划资产管理合同》等法律文

件，2021 年 11 月 8 日，本基金经中国证监会《关于准予国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划变更注册的批复》（证监许可〔2021〕3516 号文）注册。

经中国证监会批准，《国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金合同》自基金管理人公布的生效之日起生效，原《国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、股指期货、国债期货、股票期权、债券（含国债、金融债、可转换债券、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债、可交换债券、可分离交易债券的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具等，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）。

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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产比例为 50%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×30%+恒生指数收益率×10%。

#### 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 3 号《半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 日的财务状况以及自 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日止期间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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》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 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为自 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 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

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、其他金融负债。

##### 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，所有公允价值变动计入当期损益；

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。

#### 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内含票面利率或合同利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，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），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) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### 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。

其他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

(1) 本基金每一份额享有同等分配权；

(2) 期末可供分配收益为截至可供分配收益计算日，未分配收益与未分配收益中已实现收益的孰低数；

(3) 本计划收益分配方式分为 2 种：现金分红与红利再投资，红利再投资增加的份额计入基金份额总规模，投资人可选择现金红利或将现金红利转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本计划默认的收益分配方式是现金分红；

- (4) 选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利登记日的份额净值转成相应的份额。投资人在不同销售机构处可以选择不同的分红方式；
- (5) 当期收益应先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
- (6) 基金收益分配后，收益分配基准日的份额净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于面值，收益分配基准日即当期期末可供分配利润计算截止日；
- (7) 法律、法规或中国证监会另有规定的从其规定。

#### 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，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

本报告期末发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 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

基金目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

##### 7.4.6.1 增值税

根据财政部和国家税务总局 2017 年 6 月 30 日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，通知自 2018 年 1 月 1 日起施行。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。

##### 7.4.6.2 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%；根据财税 2023 第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，对证券（股票）交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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。

##### 7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育费附加的单位外）及地方教育费附加。

##### 7.4.6.4 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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

##### 7.4.6.5 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 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------|-----------------------|
| 活期存款           | 15,080,471.30        | 31,701,520.10         |
| 等于：本金          | 15,078,980.95        | 31,698,122.24         |
| 加：应计利息         | 1,490.35             | 3,397.86              |
| 减：坏账准备         | -                    | -                     |
| 定期存款           | -                    | 0                     |
| 等于：本金          | -                    | 0                     |
| 加：应计利息         | -                    | 0                     |
| 减：坏账准备         | -                    | 0                     |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                    | 0                     |
| 存款期限 1-3 个月    | -                    | 0                     |
| 存款期限 3 个月以上    | -                    | 0                     |
| 其他存款           | -                    | 0                     |
| 等于：本金          | -                    | 0                     |
| 加：应计利息         | -                    | 0                     |
| 减：坏账准备         | -                    | -                     |
| 合计             | 15,080,471.30        | 31,701,520.10         |

##### 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            | 154,112,579.44       | -    | 143,781,566.15 | -10,331,013.29 |
| 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            |       | 154,112,579.44        | -    | 143,781,566.15 | -10,331,013.29 |
| 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            |       | 208,584,357.67        | -    | 189,460,164.23 | -19,124,193.44 |
| 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        |       | 0                     | 0    | -              | 0              |
| 基金            |       | 0                     | -    | 0              | 0              |
| 其他            |       | 0                     | 0    | -              | 0              |
| 合计            |       | 208,584,357.67        | 0    | 189,460,164.23 | -19,124,193.44 |

#### 7.4.7.3 买入返售金融资产

##### 7.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末以及上年度末均无各项买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4 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 | -                    | 0                     |
| 应付赎回费       | 6.65                 | 0.68                  |
| 应付证券出借违约金   | -                    | 0                     |
| 应付交易费用      | 148,387.79           | 16,425.95             |
| 其中：交易所市场    | 148,387.79           | 16,425.95             |
| 银行间市场       | -                    | 0                     |
| 应付利息        | -                    | 0                     |
| 预提信息披露费     | 120,000.00           | 240,000.00            |
| 预提审计费       | 30,000.00            | 30,000.00             |
| 预提账户维护费     | 9,300.00             | 9,300.00              |
| 合计          | 307,694.44           | 295,726.63            |

#### 7.4.7.5 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 246,957,675.27                        | 190,520,009.20 |
| 本期申购          | 6,397,497.09                          | 4,935,569.94   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -37,657,099.94                        | -29,051,214.33 |
| 本期末           | 215,698,072.42                        | 166,404,364.81 |

注：申购含红利再投、份额转换入、份额升降级等原因导致的份额调增，赎回含份额转换出、份额升降级等原因导致的份额调减。

#### 7.4.7.6 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           | 24,510,335.69  | 5,714,744.33  | 30,225,080.02  |
| 本期期初           | 24,510,335.69  | 5,714,744.33  | 30,225,080.02  |
| 本期利润           | -45,277,965.16 | 8,793,180.15  | -36,484,785.01 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 159,333.30     | -2,928,923.09 | -2,769,589.79  |
| 其中：基金申购款       | 226,850.19     | 365,783.37    | 592,633.56     |
| 基金赎回款          | -67,516.89     | -3,294,706.46 | -3,362,223.35  |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | -20,608,296.17 | 11,579,001.39 | -9,029,294.78  |

#### 7.4.7.7 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------------------------------------|--|
| 活期存款利息收入  | 76,063.41                             | 169,296.90                                 |
| 定期存款利息收入  | -                                     | 0  |
| 其他存款利息收入  | -                                     | 0  |
| 结算备付金利息收入 | 14,747.76                             | 24,610.63                                  |
| 其他        | 1,301.63                              | 162.60                                     |
| 合计        | 92,112.80                             | 194,070.13                                 |

#### 7.4.7.8 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 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------------------------------------|--|
| 卖出股票成交总额   | 1,025,201,400.07                      | 975,190,084.72                             |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,066,794,420.35                      | 1,040,808,267.69                           |
| 减：交易费用     | 2,647,628.47                          | 2,556,291.05                               |
| 买卖股票差价收入   | -44,240,648.75                        | -68,174,474.02                             |

#### 7.4.7.9 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------------------------------------|--|
| 股票投资产生的股利收益   | 1,887,808.92                          | 586,060.87                                 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                                     | 0  |
| 基金投资产生的股利收益   | -                                     | 0  |
| 合计            | 1,887,808.92                          | 586,060.87                                 |

#### 7.4.7.10 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|------------------------|---------------------------------------|--|
| 1. 交易性金融资产             | 8,793,180.15                          | -25,500,572.95                             |
| ——股票投资                 | 8,793,180.15                          | -25,500,572.95                             |
| ——债券投资                 | -                                     | 0  |
| ——资产支持证券投资             | -                                     | 0  |
| ——基金投资                 | -                                     | 0  |
| ——贵金属投资                | -                                     | 0  |
| ——其他                   | -                                     | -  |
| 2. 衍生工具                | -                                     | 0  |
| ——权证投资                 | -                                     | 0  |
| 3. 其他                  | -                                     | 0  |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                                     | 0  |
| 合计                     | 8,793,180.15                          | -25,500,572.95                             |

#### 7.4.7.11 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|----|---------------------------------------|--|
|----|---------------------------------------|--|

|         |          |          |
|---------|----------|----------|
| 基金赎回费收入 | 3,076.93 | 9,901.36 |
| 合计      | 3,076.93 | 9,901.36 |

#### 7.4.7.12 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|---------|---------------------------------------|--|
| 审计费用    | 30,000.00                             | 30,000.00                                  |
| 信息披露费   | 120,000.00                            | 120,000.00                                 |
| 证券出借违约金 | -                                     | 0  |
| 银行汇划费   | 2,503.73                              | 3,044.85                                   |
| 账户维护费   | 37,200.00                             | 45,300                                     |
| 其他费用    | -                                     | 1,200                                      |
| 合计      | 189,703.73                            | 199,544.85                                 |

#### 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，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

##### 7.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                          | 与本基金的关系       |
|--------------------------------|---------------|
| 上海国泰君安证券资产管理有限公司(以下简称“国泰君安资管”) | 基金管理人         |
| 招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)         | 基金托管人、代销机构    |
| 国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君安证券”)     | 基金管理人的股东、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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 |              | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日 |              |
|--------------|---------------------------------------|--------------|--|--------------|
|              | 成交金额                                  | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额                                       | 占当期股票成交总额的比例 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 2,037,524,042.19                      | 100.00%      | 1,890,336,802.09                           | 100.00%      |

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 |                | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日 |                |
|--------------|---------------------------------------|----------------|--|----------------|
|              | 成交金额                                  | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额                                       | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | -                                     | -              | 246,000,000.00                             | 100.00%        |

7.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日      |            |            |              |
|--------------|--|------------|------------|--------------|
|              | 当期佣金                                       | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1,488,685.65                               | 100.00%    | 148,387.79 | 100.00%      |
| 关联方名称        | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 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 |
|--------------|--------------|------------|-----------|--------------|
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1,382,078.78 | 100.00%    | 16,425.95 | 100.00%      |

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、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

#### 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 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|------------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 2,374,323.63                          | 3,255,527.67                               |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 1,180,853.11                          | 1,588,125.66                               |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 1,193,470.52                          | 1,667,402.01                               |

注：支付基金管理人国泰君安资管的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值\*1.20%/当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|----------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 456,287.70                            | 678,234.97                                 |

注：本基金托管费率由 0.25% 下调至 0.20%，自 2023 年 7 月 24 日起执行新的托管费率。

2023 年 7 月 24 日之前，支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值\*0.25%/当年天数。

2023 年 7 月 24 日（含）之后，支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值\*0.20%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                               | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|----------------------------------|---------------------------------------|--|
| 基金合同生效日（2020 年 03 月 25 日）持有的基金份额 | 6,645,809.39                          | 6,645,809.39                               |
| 报告期初持有的基金份额                      | 0.00                                  | 34,628,172.01                              |
| 报告期间申购/买入总份额                     | -                                     | 0  |
| 报告期间因拆分变动份额                      | -                                     | -  |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                   | -                                     | 34,628,172.01                              |
| 报告期末持有的基金份额                      | 0.00                                  | 0.00                                       |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例              | 0.00%                                 | 0.00%                                      |

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

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行，本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

##### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 |           | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 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    |
| 招商银行股份有限公司 | 15,080,471.30                         | 76,063.41 | 31,701,520.1                               | 169,296.9 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

##### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

##### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须做说明的其他关联方交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了由董事会（含内部控制委员会）、经营管理层（含风险控制委员会、首席风险官）、风险管理部门，以及业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2022 年 12 月 31 日：本基金未持有信用类债券)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动

性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金、结算备付金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2023年12月<br>31日 | 1年以内          | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计             |
|------------------------|---------------|------|------|----------------|----------------|
| 资产                     |               |      |      |                |                |
| 货币资金                   | 15,080,471.30 | -    | -    | -              | 15,080,471.30  |
| 结算备付金                  | 178,905.94    | -    | -    | -              | 178,905.94     |
| 存出保证金                  | 67,666.66     | -    | -    | -              | 67,666.66      |
| 交易性金融资产                | -             | -    | -    | 143,781,566.15 | 143,781,566.15 |
| 应收申购款                  | -             | -    | -    | 1,482.62       | 1,482.62       |
| 资产总计                   | 15,327,043.90 | -    | -    | 143,783,048.77 | 159,110,092.67 |
| 负债                     |               |      |      |                |                |
| 应付清算款                  | -             | -    | -    | 484,267.31     | 484,267.31     |
| 应付赎回款                  | -             | -    | -    | 753,212.13     | 753,212.13     |
| 应付管理人报酬                | -             | -    | -    | 162,727.51     | 162,727.51     |
| 应付托管费                  | -             | -    | -    | 27,121.25      | 27,121.25      |



|                             |               |       |       |                |                |
|-----------------------------|---------------|-------|-------|----------------|----------------|
| 其他负债                        | -             | -     | -     | 307,694.44     | 307,694.44     |
| 负债总计                        | -             | -     | -     | 1,735,022.64   | 1,735,022.64   |
| 利率敏感度缺口                     | 15,327,043.90 | -     | -     | 142,048,026.13 | 157,375,070.03 |
| 上年度末<br>2022 年 12 月<br>31 日 | 1 年以内         | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计             |
| 资产                          |               |       |       |                |                |
| 货币资金                        | 31,701,520.10 | 0     | 0     | -              | 31,701,520.10  |
| 结算备付金                       | 106,784.15    | -     | -     | 0              | 106,784.15     |
| 存出保证金                       | 52,379.55     | -     | -     | 0              | 52,379.55      |
| 交易性金融资产                     | 0             | 0     | 0     | 189,460,164.23 | 189,460,164.23 |
| 应收申购款                       | 0             | -     | -     | 2,201.13       | 2,201.13       |
| 资产总计                        | 31,860,683.80 | -     | -     | 189,462,365.36 | 221,323,049.16 |
| 负债                          |               |       |       |                |                |
| 应付清算款                       | -             | -     | -     | 0.01           | 0.01           |
| 应付赎回款                       | -             | -     | -     | 4,059.82       | 4,059.82       |
| 应付管理人报酬                     | -             | -     | -     | 230,212.55     | 230,212.55     |
| 应付托管费                       | -             | -     | -     | 47,960.93      | 47,960.93      |
| 其他负债                        | -             | -     | -     | 295,726.63     | 295,726.63     |
| 负债总计                        | -             | -     | -     | 577,959.94     | 577,959.94     |
| 利率敏感度缺口                     | 31,860,683.80 | -     | -     | 188,884,405.42 | 220,745,089.22 |

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例 0.00% (2022 年 12 月 31 日:0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 |
|----|----------------------|
|----|----------------------|

|               | 美元折合人民币               | 港币折合人民币 | 其他币种折合人民币 | 合计    |
|---------------|-----------------------|---------|-----------|-------|
| 以外币计价的资产      |                       |         |           |       |
| 资产合计          | -                     | -       | -         | -     |
| 以外币计价的负债      |                       |         |           |       |
| 负债合计          | -                     | -       | -         | -     |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                     | -       | -         | -     |
|               | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |         |           |       |
| 项目            | 美元折合人民币               | 港币折合人民币 | 其他币种折合人民币 | 合计    |
| 以外币计价的资产      |                       |         |           |       |
| 交易性金融资产       | -                     | 31.62   | -         | 31.62 |
| 资产合计          | -                     | 31.62   | -         | 31.62 |
| 以外币计价的负债      |                       |         |           |       |
| 应付证券清算款       | -                     | 0.01    | -         | 0.01  |
| 负债合计          | -                     | 0.01    | -         | 0.01  |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                     | 31.61   | -         | 31.61 |

#### 7.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

| 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 |
|              |           | 港币相对人民币贬值 1%                | -                     |
| 港币相对人民币升值 1% | -         | 0.32                        |                       |

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末 2023 年 12 月 31 日 |               | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|----------------------|---------------|-----------------------|---------------|
|               | 公允价值                 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值                  | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 143,781,566.15       | 91.36         | 189,460,164.23        | 85.83         |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                    | -             | -                     | -             |
| 交易性金融资产—债券投资  | -                    | -             | -                     | -             |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                    | -             | -                     | -             |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                    | -             | -                     | -             |
| 其他            | -                    | -             | -                     | -             |
| 合计            | 143,781,566.15       | 91.36         | 189,460,164.23        | 85.83         |

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准（附注 7.4.1）以外的其他市场变量保持不变 |                             |                       |
|----|--------------------------------|-----------------------------|-----------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动                      | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                       |
|    |                                | 本期末 2023 年 12 月 31 日        | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|    | 业绩比较基准（附注 7.4.1）上升 5%          | 9,369,498.67                | 11,984,298.91         |
|    | 业绩比较基准（附注 7.4.1）下降 5%          | -9,369,498.67               | -11,984,298.91        |

#### 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          | 143,781,566.15       | 189,444,133.43        |
| 第二层次          | -                    | 0                     |
| 第三层次          | -                    | 16,030.80             |
| 合计            | 143,781,566.15       | 189,460,164.23        |

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

| 项目   | 本期 2023 年 01 月 01 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                                       | -  | 16,030.80   | 16,030.80   |
| 当期购买                                       | -  | -           | -           |
| 当期出售/结算                                    | -  | -           | -           |
| 转入第三层次                                     | -  | -           | -           |
| 转出第三层次                                     | -  | 23,254.02   | 23,254.02   |
| 当期利得或损失总额                                  | -  | 7,223.22    | 7,223.22    |
| 其中：计入损益的利得或损失                              | -  | 7,223.22    | 7,223.22    |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | -  | -           | -           |
| 期末余额                                       | -  | 0.00        | 0.00        |
| 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 | -  | 0.00        | 0.00        |
| 项目   | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 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                                       | -  | 273,722.37  | 273,722.37  |
| 当期购买                                       | -  | 92,547.69   | 92,547.69   |
| 当期出售/结算                                    | -  | -           | -           |
| 转入第三层次                                     | -  | -           | -           |
| 转出第三层次                                     | -  | 195,082.65  | 195,082.65  |
| 当期利得或损失总额                                  | -  | -155,156.61 | -155,156.61 |
| 其中：计入损益的利得或损失                              | -  | -155,156.61 | -155,156.61 |
| 计入其他综合                                     | -  | -           | -           |

|  |   |           |           |
|--|---|-----------|-----------|
| 收益的利得或损失                                   |   |           |           |
| 期末余额                                       | - | 16,030.80 | 16,030.80 |
| 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 | - | -7,223.22 | -7,223.22 |

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 |
| -                 | -         | -          | -       | -           | -          |
| 项目                | 上年度末公允价值  | 采用的估值技术    | 不可观察输入值 |             |            |
|                   |           |            | 名称      | 范围/加权平均值    | 与公允价值之间的关系 |
| 流动性折扣估值处于限售期的股票投资 | 16,030.80 | 平均价格亚式期权模型 | 预期年化波动率 | 3.19%-3.54% | 负相关        |

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 143,781,566.15 | 90.37         |
|    | 其中：股票             | 143,781,566.15 | 90.37         |
| 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      | 15,259,377.24  | 9.59          |
| 8  | 其他各项资产            | 69,149.28      | 0.04          |
| 9  | 合计                | 159,110,092.67 | 100.00        |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 0.00 元，占期末净值的比例为 0.00%；通过转融通证券出借业务的证券公允价值为 0.00 元，占资产净值的比例为 0.00%。

## 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

| 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              | 138,995,796.15 | 88.32         |
| 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           | -              | -             |
| 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  | -              | -             |
| J  | 金融业              | -              | -             |
| K  | 房地产业             | -              | -             |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -             |
| 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       | 4,785,770.00   | 3.04  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -              | -     |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 143,781,566.15 | 91.36 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 数量（股）   | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 603309 | 维力医疗   | 522,700 | 7,438,021.00 | 4.73         |
| 2  | 688016 | 心脉医疗   | 37,227  | 7,245,491.01 | 4.60         |
| 3  | 600587 | 新华医疗   | 279,900 | 7,218,621.00 | 4.59         |
| 4  | 002847 | 盐津铺子   | 97,700  | 6,788,196.00 | 4.31         |
| 5  | 601882 | 海天精工   | 256,500 | 6,707,475.00 | 4.26         |
| 6  | 688697 | 纽威数控装备 | 335,618 | 6,319,686.94 | 4.02         |
| 7  | 300856 | 科思股份   | 96,300  | 5,992,749.00 | 3.81         |
| 8  | 300122 | 智飞生物   | 92,600  | 5,658,786.00 | 3.60         |
| 9  | 603027 | 千禾味业   | 337,596 | 5,458,927.32 | 3.47         |
| 10 | 002991 | 甘源食品   | 75,700  | 5,409,522.00 | 3.44         |
| 11 | 300396 | 迪瑞医疗   | 182,700 | 5,380,515.00 | 3.42         |
| 12 | 688389 | 深圳普门科技 | 236,911 | 5,332,866.61 | 3.39         |
| 13 | 300896 | 爱美客    | 17,900  | 5,268,507.00 | 3.35         |
| 14 | 001215 | 千味央厨   | 99,615  | 5,260,668.15 | 3.34         |
| 15 | 300181 | 佐力药业   | 484,800 | 5,167,968.00 | 3.28         |
| 16 | 300406 | 九强生物   | 267,300 | 5,105,430.00 | 3.24         |
| 17 | 003000 | 劲仔食品   | 407,700 | 4,982,094.00 | 3.17         |
| 18 | 600809 | 山西汾酒   | 21,400  | 4,937,622.00 | 3.14         |
| 19 | 603369 | 今世缘    | 99,600  | 4,855,500.00 | 3.09         |
| 20 | 603057 | 上海紫燕食品 | 224,300 | 4,840,394.00 | 3.08         |
| 21 | 000568 | 泸州老窖   | 26,681  | 4,787,105.02 | 3.04         |
| 22 | 600763 | 通策医疗   | 62,600  | 4,785,770.00 | 3.04         |
| 23 | 603317 | 天味食品   | 359,965 | 4,783,934.85 | 3.04         |
| 24 | 688580 | 伟思医疗   | 73,751  | 4,714,901.43 | 3.00         |
| 25 | 688358 | 祥生医疗科技 | 124,769 | 4,713,772.82 | 3.00         |

|    |        |      |        |              |      |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
| 26 | 603198 | 迎驾贡酒 | 69,800 | 4,627,042.00 | 2.94 |
|----|--------|------|--------|--------------|------|

## 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  | 688017 | 绿的谐波    | 20,418,759.78 | 9.25           |
| 2  | 600809 | 山西汾酒    | 18,380,197.60 | 8.33           |
| 3  | 000568 | 泸州老窖    | 17,830,136.74 | 8.08           |
| 4  | 688308 | 欧科亿数控刀具 | 17,357,172.51 | 7.86           |
| 5  | 603057 | 上海紫燕食品  | 16,905,757.84 | 7.66           |
| 6  | 601186 | 中国铁建    | 16,724,267.25 | 7.58           |
| 7  | 688059 | 株洲华锐精密  | 14,985,104.45 | 6.79           |
| 8  | 01579  | 颐海国际    | 13,891,384.82 | 6.29           |
| 9  | 000921 | 海信家电    | 13,080,711.00 | 5.93           |
| 10 | 688558 | 国盛智科股份  | 13,036,033.36 | 5.91           |
| 11 | 003000 | 劲仔食品    | 12,576,059.00 | 5.70           |
| 12 | 002050 | 三花智控    | 12,574,953.00 | 5.70           |
| 13 | 603868 | 飞科电器    | 11,922,829.00 | 5.40           |
| 14 | 688697 | 纽威数控装备  | 11,538,792.38 | 5.23           |
| 15 | 600587 | 新华医疗    | 11,511,870.00 | 5.22           |
| 16 | 300707 | 威唐工业    | 11,392,570.00 | 5.16           |
| 17 | 300308 | 中际旭创    | 11,135,871.00 | 5.04           |
| 18 | 000951 | 中国重汽    | 10,738,657.98 | 4.86           |
| 19 | 603501 | 韦尔股份    | 10,618,172.25 | 4.81           |
| 20 | 601882 | 海天精工    | 10,578,386.00 | 4.79           |
| 21 | 603027 | 千禾味业    | 10,359,035.72 | 4.69           |
| 22 | 300856 | 科思股份    | 10,208,009.00 | 4.62           |
| 23 | 002459 | 晶澳科技    | 10,065,991.60 | 4.56           |
| 24 | 002737 | 葵花药业    | 9,979,466.00  | 4.52           |
| 25 | 600612 | 老凤祥     | 9,890,263.00  | 4.48           |
| 26 | 002959 | 小熊电器    | 9,652,202.00  | 4.37           |
| 27 | 600060 | 海信视像    | 9,369,613.00  | 4.24           |
| 28 | 002847 | 盐津铺子    | 9,190,784.00  | 4.16           |
| 29 | 603915 | 国茂股份    | 8,996,790.00  | 4.08           |
| 30 | 300740 | 水羊股份    | 8,558,325.25  | 3.88           |
| 31 | 300595 | 欧普康视    | 8,344,879.00  | 3.78           |
| 32 | 002035 | 华帝股份    | 8,306,765.00  | 3.76           |
| 33 | 06862  | 海底捞     | 8,222,363.84  | 3.72           |
| 34 | 002568 | 百润股份    | 8,075,622.60  | 3.66           |



|    |        |        |              |      |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 35 | 00520  | 呷哺呷哺   | 8,062,596.00 | 3.65 |
| 36 | 603486 | 科沃斯    | 7,901,501.00 | 3.58 |
| 37 | 603309 | 维力医疗   | 7,799,213.00 | 3.53 |
| 38 | 000799 | 酒鬼酒    | 7,755,580.00 | 3.51 |
| 39 | 000651 | 格力电器   | 7,721,126.00 | 3.50 |
| 40 | 688016 | 心脉医疗   | 7,651,042.78 | 3.47 |
| 41 | 002472 | 双环传动   | 7,386,238.00 | 3.35 |
| 42 | 603529 | 爱玛科技   | 7,377,335.00 | 3.34 |
| 43 | 000938 | 紫光股份   | 7,289,280.00 | 3.30 |
| 44 | 603369 | 今世缘    | 7,275,209.00 | 3.30 |
| 45 | 605336 | 帅丰电器   | 7,232,580.60 | 3.28 |
| 46 | 300124 | 汇川技术   | 7,215,240.00 | 3.27 |
| 47 | 603019 | 中科曙光   | 7,210,163.45 | 3.27 |
| 48 | 300911 | 亿田智能   | 7,144,198.87 | 3.24 |
| 49 | 00558  | 力劲科技   | 7,108,067.34 | 3.22 |
| 50 | 002979 | 雷赛智能   | 6,968,522.16 | 3.16 |
| 51 | 600298 | 安琪酵母   | 6,940,664.68 | 3.14 |
| 52 | 688169 | 石头科技   | 6,908,588.90 | 3.13 |
| 53 | 000338 | 潍柴动力   | 6,701,610.00 | 3.04 |
| 54 | 002946 | 新乳业    | 6,693,717.00 | 3.03 |
| 55 | 000988 | 华工科技   | 6,675,185.00 | 3.02 |
| 56 | 601390 | 中国中铁   | 6,565,391.81 | 2.97 |
| 57 | 603517 | 绝味食品   | 6,545,254.00 | 2.97 |
| 58 | 603129 | 春风动力   | 6,421,041.25 | 2.91 |
| 59 | 600984 | 建设机械   | 6,291,306.00 | 2.85 |
| 60 | 601939 | 建设银行   | 6,219,890.69 | 2.82 |
| 61 | 688596 | 正帆科技   | 6,112,917.41 | 2.77 |
| 62 | 300763 | 锦浪科技   | 6,106,491.00 | 2.77 |
| 63 | 601689 | 拓普集团   | 6,042,252.00 | 2.74 |
| 64 | 03690  | 美团-W   | 6,009,626.56 | 2.72 |
| 65 | 688598 | 金博碳素股份 | 5,996,925.67 | 2.72 |
| 66 | 300601 | 康泰生物   | 5,996,437.00 | 2.72 |
| 67 | 002991 | 甘源食品   | 5,988,287.00 | 2.71 |
| 68 | 600763 | 通策医疗   | 5,955,865.00 | 2.70 |
| 69 | 600988 | 赤峰黄金   | 5,875,769.50 | 2.66 |
| 70 | 600176 | 中国巨石   | 5,817,425.00 | 2.64 |
| 71 | 600557 | 康缘药业   | 5,763,516.00 | 2.61 |
| 72 | 605339 | 南侨食品   | 5,611,117.00 | 2.54 |
| 73 | 001215 | 千味央厨   | 5,581,855.00 | 2.53 |
| 74 | 688305 | 科德数控   | 5,580,280.90 | 2.53 |
| 75 | 605300 | 佳禾食品   | 5,568,582.00 | 2.52 |
| 76 | 603901 | 永创智能   | 5,434,362.30 | 2.46 |
| 77 | 688358 | 祥生医疗科技 | 5,422,467.09 | 2.46 |

|     |        |        |              |      |
|-----|--------|--------|--------------|------|
| 78  | 688050 | 爱博诺德医疗 | 5,391,372.35 | 2.44 |
| 79  | 300181 | 佐力药业   | 5,383,118.00 | 2.44 |
| 80  | 002064 | 华峰化学   | 5,370,269.00 | 2.43 |
| 81  | 300896 | 爱美客    | 5,345,446.00 | 2.42 |
| 82  | 300122 | 智飞生物   | 5,328,512.50 | 2.41 |
| 83  | 600600 | 青岛啤酒   | 5,280,067.00 | 2.39 |
| 84  | 300973 | 立高食品   | 5,266,400.00 | 2.39 |
| 85  | 603317 | 天味食品   | 5,260,684.65 | 2.38 |
| 86  | 605337 | 李子园    | 5,217,214.48 | 2.36 |
| 87  | 000837 | 秦川机床   | 5,168,915.00 | 2.34 |
| 88  | 688408 | 中信博新能源 | 5,162,981.55 | 2.34 |
| 89  | 688580 | 伟思医疗   | 5,117,522.61 | 2.32 |
| 90  | 603198 | 迎驾贡酒   | 5,088,749.00 | 2.31 |
| 91  | 300558 | 贝达药业   | 5,077,973.00 | 2.30 |
| 92  | 00388  | 香港交易所  | 5,058,197.61 | 2.29 |
| 93  | 601966 | 玲珑轮胎   | 5,042,389.00 | 2.28 |
| 94  | 300406 | 九强生物   | 5,023,819.00 | 2.28 |
| 95  | 688133 | 泰坦股份   | 5,012,227.92 | 2.27 |
| 96  | 688677 | 青岛海泰新光 | 4,991,289.19 | 2.26 |
| 97  | 688389 | 深圳普门科技 | 4,975,221.72 | 2.25 |
| 98  | 300161 | 华中数控   | 4,900,212.00 | 2.22 |
| 99  | 600309 | 万华化学   | 4,878,433.00 | 2.21 |
| 100 | 601100 | 恒立液压   | 4,870,254.79 | 2.21 |
| 101 | 002601 | 龙佰集团   | 4,832,815.00 | 2.19 |
| 102 | 600031 | 三一重工   | 4,831,680.00 | 2.19 |
| 103 | 002230 | 科大讯飞   | 4,790,637.00 | 2.17 |
| 104 | 002043 | 兔宝宝    | 4,790,231.00 | 2.17 |
| 105 | 300861 | 美畅股份   | 4,744,513.00 | 2.15 |
| 106 | 603638 | 艾迪精密   | 4,729,755.00 | 2.14 |
| 107 | 300396 | 迪瑞医疗   | 4,729,378.00 | 2.14 |
| 108 | 300059 | 东方财富   | 4,714,007.00 | 2.14 |
| 109 | 603801 | 志邦家居   | 4,676,368.00 | 2.12 |
| 110 | 601138 | 工业富联   | 4,648,117.00 | 2.11 |
| 111 | 001269 | 欧晶科技   | 4,622,145.00 | 2.09 |
| 112 | 688356 | 键凯科技   | 4,542,773.18 | 2.06 |
| 113 | 603806 | 福斯特    | 4,494,511.02 | 2.04 |
| 114 | 000157 | 中联重科   | 4,491,526.00 | 2.03 |
| 115 | 688223 | 晶科能源   | 4,466,607.61 | 2.02 |
| 116 | 688048 | 长光华芯   | 4,444,856.28 | 2.01 |
| 117 | 300577 | 开润股份   | 4,443,937.00 | 2.01 |

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

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  | 688017 | 绿的谐波    | 19,715,796.44 | 8.93           |
| 2  | 300308 | 中际旭创    | 19,501,152.00 | 8.83           |
| 3  | 688596 | 正帆科技    | 17,716,966.24 | 8.03           |
| 4  | 601186 | 中国铁建    | 16,154,315.45 | 7.32           |
| 5  | 300316 | 晶盛机电    | 14,135,047.12 | 6.40           |
| 6  | 000921 | 海信家电    | 13,449,823.00 | 6.09           |
| 7  | 002050 | 三花智控    | 13,233,418.00 | 5.99           |
| 8  | 688308 | 欧科亿数控刀具 | 13,211,876.66 | 5.99           |
| 9  | 002459 | 晶澳科技    | 13,167,929.00 | 5.97           |
| 10 | 002129 | TCL 中环  | 12,706,566.61 | 5.76           |
| 11 | 01579  | 颐海国际    | 12,361,371.00 | 5.60           |
| 12 | 000568 | 泸州老窖    | 12,262,733.00 | 5.56           |
| 13 | 688059 | 株洲华锐精密  | 12,088,614.64 | 5.48           |
| 14 | 600809 | 山西汾酒    | 11,213,540.00 | 5.08           |
| 15 | 603868 | 飞科电器    | 10,831,246.54 | 4.91           |
| 16 | 300707 | 威唐工业    | 10,801,674.00 | 4.89           |
| 17 | 688558 | 国盛智科股份  | 10,668,184.47 | 4.83           |
| 18 | 603057 | 上海紫燕食品  | 10,610,729.53 | 4.81           |
| 19 | 600060 | 海信视像    | 10,580,869.00 | 4.79           |
| 20 | 002011 | 盾安环境    | 10,548,677.00 | 4.78           |
| 21 | 300014 | 亿纬锂能    | 10,219,195.16 | 4.63           |
| 22 | 603501 | 韦尔股份    | 10,103,397.20 | 4.58           |
| 23 | 300750 | 宁德时代    | 10,069,986.00 | 4.56           |
| 24 | 000951 | 中国重汽    | 9,930,140.00  | 4.50           |
| 25 | 603019 | 中科曙光    | 9,832,013.00  | 4.45           |
| 26 | 002737 | 葵花药业    | 9,737,414.96  | 4.41           |
| 27 | 600612 | 老凤祥     | 9,316,318.00  | 4.22           |
| 28 | 002959 | 小熊电器    | 9,229,741.00  | 4.18           |
| 29 | 300331 | 苏大维格    | 9,210,380.00  | 4.17           |
| 30 | 000988 | 华工科技    | 9,181,635.00  | 4.16           |
| 31 | 300740 | 水羊股份    | 8,414,220.00  | 3.81           |
| 32 | 603806 | 福斯特     | 8,206,109.20  | 3.72           |
| 33 | 300595 | 欧普康视    | 8,060,188.00  | 3.65           |
| 34 | 000049 | 德赛电池    | 7,848,711.00  | 3.56           |
| 35 | 603529 | 爱玛科技    | 7,742,159.44  | 3.51           |
| 36 | 06862  | 海底捞     | 7,717,708.00  | 3.50           |
| 37 | 002035 | 华帝股份    | 7,690,034.00  | 3.48           |
| 38 | 300724 | 捷佳伟创    | 7,567,587.20  | 3.43           |
| 39 | 000938 | 紫光股份    | 7,527,273.08  | 3.41           |

|    |        |              |              |      |
|----|--------|--------------|--------------|------|
| 40 | 688599 | 天合光能         | 7,512,454.44 | 3.40 |
| 41 | 300124 | 汇川技术         | 7,313,443.00 | 3.31 |
| 42 | 603915 | 国茂股份         | 7,278,942.00 | 3.30 |
| 43 | 603486 | 科沃斯          | 7,237,568.00 | 3.28 |
| 44 | 002741 | 光华科技         | 7,064,257.00 | 3.20 |
| 45 | 000651 | 格力电器         | 6,977,527.00 | 3.16 |
| 46 | 605376 | 博迁新材         | 6,858,510.00 | 3.11 |
| 47 | 688169 | 石头科技         | 6,660,390.68 | 3.02 |
| 48 | 002472 | 双环传动         | 6,652,753.68 | 3.01 |
| 49 | 000338 | 潍柴动力         | 6,603,743.00 | 2.99 |
| 50 | 300916 | 朗特智能         | 6,567,728.00 | 2.98 |
| 51 | 003000 | 劲仔食品         | 6,547,193.00 | 2.97 |
| 52 | 000799 | 酒鬼酒          | 6,535,674.00 | 2.96 |
| 53 | 600298 | 安琪酵母         | 6,456,269.00 | 2.92 |
| 54 | 605336 | 帅丰电器         | 6,386,041.60 | 2.89 |
| 55 | 601390 | 中国中铁         | 6,317,770.00 | 2.86 |
| 56 | 00558  | 力劲科技         | 6,311,376.12 | 2.86 |
| 57 | 03690  | 美团-W         | 6,282,222.64 | 2.85 |
| 58 | 002568 | 百润股份         | 6,209,445.00 | 2.81 |
| 59 | 002635 | 安洁科技         | 6,195,837.00 | 2.81 |
| 60 | 603191 | 望变电气         | 6,125,685.00 | 2.78 |
| 61 | 300601 | 康泰生物         | 6,082,311.00 | 2.76 |
| 62 | 002979 | 雷赛智能         | 6,003,954.12 | 2.72 |
| 63 | 00520  | 呷哺呷哺         | 5,977,864.04 | 2.71 |
| 64 | 300115 | 长盈精密         | 5,970,354.00 | 2.70 |
| 65 | 603517 | 绝味食品         | 5,790,441.38 | 2.62 |
| 66 | 600984 | 建设机械         | 5,745,212.80 | 2.60 |
| 67 | 603129 | 春风动力         | 5,714,260.94 | 2.59 |
| 68 | 601939 | 建设银行         | 5,708,536.00 | 2.59 |
| 69 | 600176 | 中国巨石         | 5,634,925.34 | 2.55 |
| 70 | 688598 | 金博碳素股份       | 5,618,611.77 | 2.55 |
| 71 | 688050 | 爱博诺德医疗       | 5,602,655.29 | 2.54 |
| 72 | 300763 | 锦浪科技         | 5,516,425.00 | 2.50 |
| 73 | 002946 | 新乳业          | 5,447,821.00 | 2.47 |
| 74 | 600988 | 赤峰黄金         | 5,412,923.15 | 2.45 |
| 75 | 601012 | 隆基绿能         | 5,357,067.80 | 2.43 |
| 76 | 601689 | 拓普集团         | 5,352,084.00 | 2.42 |
| 77 | 601877 | 正泰电器         | 5,314,467.00 | 2.41 |
| 78 | 688190 | 云路先进材料<br>股份 | 5,271,445.25 | 2.39 |
| 79 | 002230 | 科大讯飞         | 5,188,957.00 | 2.35 |
| 80 | 00388  | 香港交易所        | 5,177,454.87 | 2.35 |
| 81 | 605300 | 佳禾食品         | 5,136,550.00 | 2.33 |

|     |        |        |              |      |
|-----|--------|--------|--------------|------|
| 82  | 603901 | 永创智能   | 5,125,618.74 | 2.32 |
| 83  | 300911 | 亿田智能   | 5,124,210.60 | 2.32 |
| 84  | 300558 | 贝达药业   | 5,101,109.00 | 2.31 |
| 85  | 603348 | 文灿股份   | 5,045,465.00 | 2.29 |
| 86  | 300973 | 立高食品   | 4,978,986.00 | 2.26 |
| 87  | 603259 | 药明康德   | 4,950,534.00 | 2.24 |
| 88  | 605339 | 南侨食品   | 4,913,077.00 | 2.23 |
| 89  | 688305 | 科德数控   | 4,878,098.82 | 2.21 |
| 90  | 000837 | 秦川机床   | 4,870,247.00 | 2.21 |
| 91  | 601717 | 郑煤机    | 4,865,949.00 | 2.20 |
| 92  | 002484 | 江海股份   | 4,857,471.20 | 2.20 |
| 93  | 601966 | 玲珑轮胎   | 4,814,979.00 | 2.18 |
| 94  | 300337 | 银邦股份   | 4,806,832.60 | 2.18 |
| 95  | 688408 | 中信博新能源 | 4,772,947.62 | 2.16 |
| 96  | 002064 | 华峰化学   | 4,766,955.00 | 2.16 |
| 97  | 001269 | 欧晶科技   | 4,745,780.90 | 2.15 |
| 98  | 300161 | 华中数控   | 4,709,827.00 | 2.13 |
| 99  | 600557 | 康缘药业   | 4,706,796.00 | 2.13 |
| 100 | 688677 | 青岛海泰新光 | 4,671,115.01 | 2.12 |
| 101 | 002335 | 科华数据   | 4,608,827.00 | 2.09 |
| 102 | 600600 | 青岛啤酒   | 4,587,387.00 | 2.08 |
| 103 | 300861 | 美畅股份   | 4,586,420.00 | 2.08 |
| 104 | 605337 | 李子园    | 4,565,539.92 | 2.07 |
| 105 | 300759 | 康龙化成   | 4,522,096.00 | 2.05 |
| 106 | 002436 | 兴森科技   | 4,499,391.00 | 2.04 |
| 107 | 603638 | 艾迪精密   | 4,490,503.60 | 2.03 |
| 108 | 600031 | 三一重工   | 4,485,109.00 | 2.03 |
| 109 | 688048 | 长光华芯   | 4,434,233.18 | 2.01 |
| 110 | 300577 | 开润股份   | 4,427,485.00 | 2.01 |
| 111 | 603105 | 芯能科技   | 4,426,517.00 | 2.01 |

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,012,322,642.12 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,025,201,400.07 |

注：买入股票成本（成交）总额和卖出股票收入（成交）总额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

在股指期货投资上，本基金以套期保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率，并利用股指期货流动性较好的特点对冲基金的流动性风险，如大额申购赎回等。

## 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

在风险可控的前提下，本基金将本着谨慎原则适度参与国债期货投资。本基金参与国债期货交易以套期保值为主要目的，运用国债期货对冲风险。本基金将根据对债券现货市场和期货市场的分析，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，发挥国债期货杠杆效应和流动性较好的特点，灵活运用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲收益率曲线平坦、陡峭等形态变化的风险、对冲关键期限利率波动的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金持有的前十名证券发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额        |
|----|-------|-----------|
| 1  | 存出保证金 | 67,666.66 |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 1,482.62  |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | -         |
| 8  | 其他    | -         |
| 9  | 合计    | 69,149.28 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构        |        |                |        |
|--------------|---------------|--------------|--------|----------------|--------|
|              |               | 机构投资者        |        | 个人投资者          |        |
|              |               | 持有份额         | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例 |
| 3,995        | 53,992.01     | 4,039,180.22 | 1.87%  | 211,658,892.20 | 98.13% |

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                   | 持有份额总数（份）  | 占基金总份额比例 |
|----------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有<br>本基金 | 676,640.45 | 0.3137%  |

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | -                 |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                              |                |
|------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2020年03月25日）基金份额总额   | 33,122,666.91  |
| 本报告期期初基金份额总额                 | 246,957,675.27 |
| 本报告期基金总申购份额                  | 6,397,497.09   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                | 37,657,099.94  |
| 本报告期基金拆分变动份额（份<br>额减少以“-”填列） | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                 | 215,698,072.42 |

注：基金总申购份额含红利再投资及转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

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

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：



2023 年 4 月 8 日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于完成公司法定代表人变更登记的公告》，公司法定代表人变更为陶耿先生，相关工商变更手续已于 2023 年 4 月 6 日在上海市场监督管理局办理完毕。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 30,000.00 元人民币。其为本基金提供审计服务的连续年限为自 2020 年 03 月 25 日（基金合同生效日）至本报告期末。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期无涉及管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期无涉及托管人及其高级管理人员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 |    |
| 国泰君  | 2      | 2,037,524,042.19 | 100.00%      | 1,488,685.65 | 100.00%    | -  |

|                   |  |  |  |  |  |  |
|-------------------|--|--|--|--|--|--|
| 安证券<br>股份有<br>限公司 |  |  |  |  |  |  |
|-------------------|--|--|--|--|--|--|

## 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                       | 法定披露方式                             | 法定披露日期     |
|----|--|------------------------------------|------------|
| 1  | 国泰君安君得诚混合型证券投资基金 2022 年第四季度报告              | 证监会指定网站、公司官网                       | 2023-01-20 |
| 2  | 上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2022 年 4 季度报告提示性公告    | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报              | 2023-01-20 |
| 3  | 国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金经理变更公告                   | 证券日报、证监会指定网站、公司官网                  | 2023-02-13 |
| 4  | 国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金产品资料概要更新                 | 证监会指定网站、公司官网                       | 2023-02-13 |
| 5  | 国泰君安君得诚混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2023 年第 1 号)     | 证监会指定网站、公司官网                       | 2023-02-13 |
| 6  | 国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金产品资料概要更新                 | 证监会指定网站、公司官网                       | 2023-03-16 |
| 7  | 国泰君安君得诚混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2023 年第 2 号)     | 证监会指定网站、公司官网                       | 2023-03-16 |
| 8  | 国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金经理变更公告                   | 证券日报、证监会指定网站、公司官网                  | 2023-03-16 |
| 9  | 国泰君安君得诚混合型证券投资基金 2022 年年度报告                | 证监会指定网站、公司官网                       | 2023-03-31 |
| 10 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告       | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报              | 2023-03-31 |
| 11 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司关于完成公司法定代表人变更登记的公告         | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网 | 2023-04-08 |
| 12 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下产品参与直销 APP 费率优惠活动的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网 | 2023-04-17 |
| 13 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年 1 季度报告提示性公告    | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报              | 2023-04-22 |
| 14 | 国泰君安君得诚混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告            | 证监会指定网站、公司官网                       | 2023-04-23 |
| 15 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司                           | 上海证券报、中国证券报、证券                     | 2023-07-21 |

|    |  |                       |            |
|----|--|-----------------------|------------|
|    | 限公司旗下基金 2023 年 2 季度报告提示性公告               | 时报、证券日报               |            |
| 16 | 国泰君安君得诚混合型证券投资基金 2023 年第二季度报告            | 证监会指定网站、公司官网          | 2023-07-21 |
| 17 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告   | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报 | 2023-07-22 |
| 18 | 国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金合同                     | 证监会指定网站、公司官网          | 2023-07-22 |
| 19 | 国泰君安君得诚混合型证券投资基金托管协议                     | 证监会指定网站、公司官网          | 2023-07-22 |
| 20 | 国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金产品资料概要更新               | 证监会指定网站、公司官网          | 2023-07-25 |
| 21 | 国泰君安君得诚混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2023 年第 3 号)   | 证监会指定网站、公司官网          | 2023-07-25 |
| 22 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下公募基金的公告    | 证监会指定网站、公司官网          | 2023-08-21 |
| 23 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下公募基金的公告    | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报 | 2023-08-22 |
| 24 | 国泰君安君得诚混合型证券投资基金 2023 年中期报告              | 证监会指定网站、公司官网          | 2023-08-31 |
| 25 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告     | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报 | 2023-08-31 |
| 26 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报 | 2023-10-25 |
| 27 | 国泰君安君得诚混合型证券投资基金 2023 年第三季度报告            | 证监会指定网站、公司官网          | 2023-10-25 |

## § 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

在本报告截止日至报告批准送出日之间，基金管理人根据法律法规及《基金合同》等法律文件

的相关规定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2023 年 7 月 24 日起，调低本基金的托管费率并相应修订法律文件。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划变更注册的批复；
- 2、《国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安君得诚混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安君得诚混合型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、法律意见书；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站  
<http://www.gtjazg.com>。

### 13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

上海国泰君安证券资产管理有限公司  
二〇二四年三月二十九日