

# 嘉合睿金混合型发起式证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:嘉合基金管理有限公司

基金托管人:渤海银行股份有限公司

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独立董事签字同意，并由董事长签发。

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

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

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

本报告中财务资料已经审计。毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2023年01月01日起至2023年12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
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 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
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	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	14
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	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
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	73
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	74
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	74
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	74

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	74
8.12 投资组合报告附注 .....	74
§9 基金份额持有人信息 .....	76
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	76
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	76
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	76
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	77
§10 开放式基金份额变动 .....	77
§11 重大事件揭示 .....	78
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	78
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	78
11.4 基金投资策略的改变 .....	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	78
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	79
11.8 其他重大事件 .....	80
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	82
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 .....	82
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	83
§13 备查文件目录 .....	83
13.1 备查文件目录 .....	83
13.2 存放地点 .....	83
13.3 查阅方式 .....	83

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金	
基金简称	嘉合睿金混合	
基金主代码	005090	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年03月13日	
基金管理人	嘉合基金管理有限公司	
基金托管人	渤海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	33,329,569.89份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C
下属分级基金的交易代码	005090	005091
报告期末下属分级基金的份额总额	10,271,531.62份	23,058,038.27份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金将秉持战略和战术资产配置理念，通过稳健管理的多策略投资系统，在控制市场风险、尽量降低净值波动风险并满足流动性的前提下，动态投资于股票、债券、现金及现金等价物等资产品种并运用股指期货等各种金融工具提高收益率。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。

### 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	嘉合基金管理有限公司	渤海银行股份有限公司
信息披露 姓名	崔为中	阮劲松

露负责人	联系电话	021-60168288	022-58316243
	电子邮箱	cuiweizhong@haoamc.com	js.ruan@cbhb.com.cn
客户服务电话		400-0603-299	4008888811/95541
传真		021-65015077	022-58314791
注册地址		上海市虹口区广纪路738号1幢329室	天津市河东区海河东路218号
办公地址		上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼	天津市河东区海河东路218号
邮政编码		200082	300012
法定代表人		魏超	王锦虹

## 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.haoamc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市南京西路1266号恒隆广场2期25楼
注册登记机构	嘉合基金管理有限公司	上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼

## §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	
	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C

本期已实现收益	-3,618,98 4.43	-9,595,4 61.06	-6,859,39 3.27	-10,851, 785.05	9,080,20 9.23	10,549,4 87.11
本期利润	-3,620,41 3.45	-10,264, 582.19	-5,942,69 8.48	-9,752,3 70.20	5,086,77 4.09	5,691,74 8.44
加权平均基金份额 本期利润	-0.3408	-0.4506	-0.2838	-0.2985	0.2960	0.2616
本期加权平均净值 利润率	-25.09%	-34.62%	-17.83%	-19.34%	15.16%	13.60%
本期基金份额净值 增长率	-32.73%	-33.26%	-19.37%	-20.02%	15.55%	14.62%
<b>3.1.2 期末数据和指 标</b>	2023年末		2022年末		2021年末	
期末可供分配利润	-386,979. 74	-1,769,0 16.84	7,533,15 7.90	9,222,85 7.43	12,410,8 14.58	15,423,7 93.16
期末可供分配基金 份额利润	-0.0377	-0.0767	0.4304	0.3835	0.7741	0.7297
期末基金资产净值	9,884,55 1.88	21,289,0 21.43	25,034,7 91.49	33,274,3 47.43	28,443,3 64.34	36,560,8 77.26
期末基金份额净值	0.9623	0.9233	1.4304	1.3835	1.7741	1.7297
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2023年末		2022年末		2021年末	
基金份额累计净值 增长率	22.75%	17.98%	82.47%	76.78%	126.31%	121.02%

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、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、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

嘉合睿金混合A

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	-17.99%	2.41%	-3.87%	0.48%	-14.12%	1.93%
过去六个月	-35.81%	1.94%	-6.09%	0.51%	-29.72%	1.43%
过去一年	-32.73%	1.71%	-6.00%	0.51%	-26.73%	1.20%
过去三年	-37.32%	1.64%	-18.60%	0.67%	-18.72%	0.97%
自基金合同生效起至今	22.75%	1.52%	-2.94%	0.71%	25.69%	0.81%

## 嘉合睿金混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-18.16%	2.40%	-3.87%	0.48%	-14.29%	1.92%
过去六个月	-36.07%	1.94%	-6.09%	0.51%	-29.98%	1.43%
过去一年	-33.26%	1.71%	-6.00%	0.51%	-27.26%	1.20%
过去三年	-38.82%	1.64%	-18.60%	0.67%	-20.22%	0.97%
自基金合同生效起至今	17.98%	1.52%	-2.94%	0.71%	20.92%	0.81%

### 3.2.2 自基金转型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



嘉合睿金混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年03月13日-2023年12月31日)



注：1、本基金于2019年3月13日由"嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金"转型而来。

2、截至本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

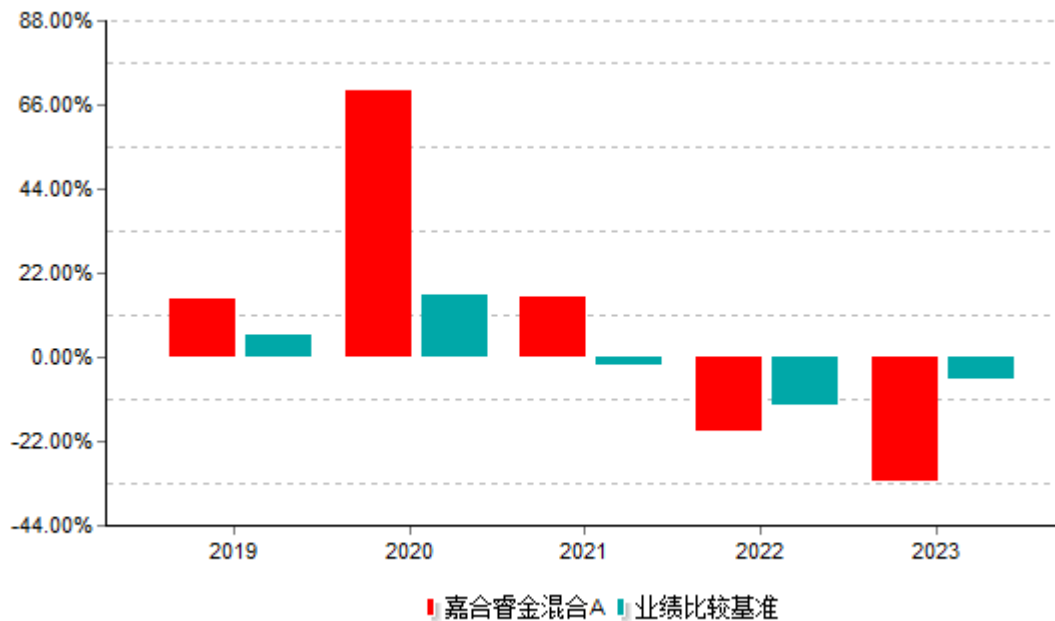
嘉合睿金混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年03月13日-2023年12月31日)



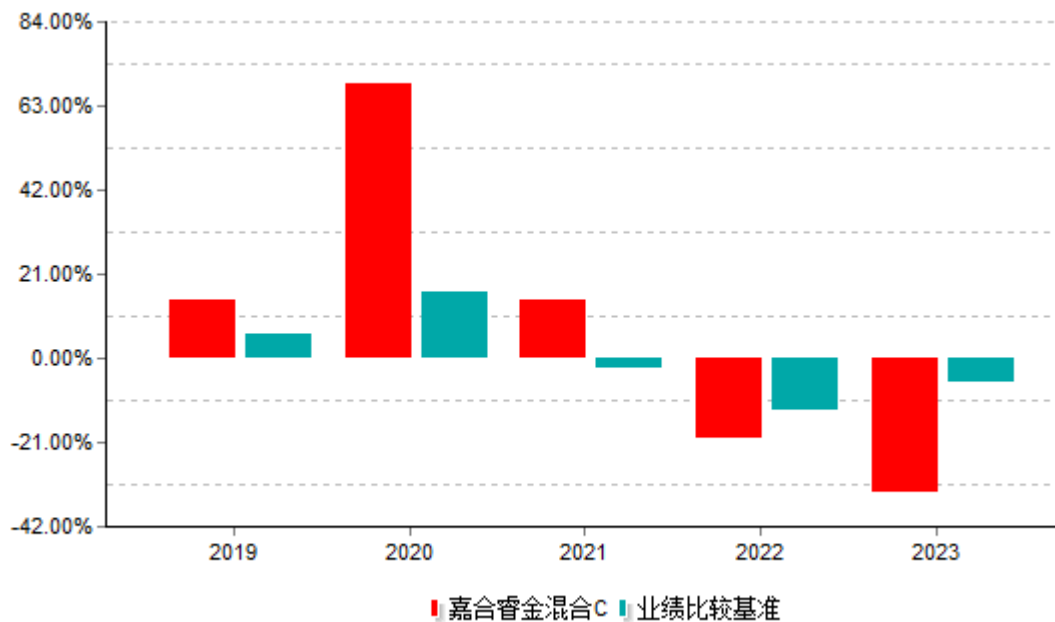
注：1、本基金于2019年3月13日由"嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金"转型而来。

2、截至本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 自基金转型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：图中列示的2019年基金净值增长率按该年度本基金实际存续期计算。



注：图中列示的2019年基金净值增长率按该年度本基金实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

嘉合睿金混合A

单位：人民币元

年度	每10份基	现金形式发放	再投资形式发	年度利润分配	备注

	金份额分 红数	总额	放总额	合计	
2021年	4.500	8,659,131.70	329,403.00	8,988,534.70	-
合计	4.500	8,659,131.70	329,403.00	8,988,534.70	-

嘉合睿金混合C

单位：人民币元

年度	每10份基 金份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 合计	备注
2021年	4.500	9,848,166.19	111,160.48	9,959,326.67	-
合计	4.500	9,848,166.19	111,160.48	9,959,326.67	-

## §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

嘉合基金管理有限公司（以下简称“嘉合基金”或“公司”）是经中国证监会[2014]621号文许可，依法设立的全国性基金管理公司。2014年8月8日，嘉合基金正式公告成立于上海，经营范围包括基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。

嘉合基金股东为中航信托股份有限公司、上海慧弘实业集团有限公司、福建圣农控股集团有限公司、广东万和集团有限公司、山东通汇资本投资集团有限公司及北京智勇仁信投资咨询有限公司。主要股东为中航信托股份有限公司和上海慧弘实业集团有限公司，持股比例均为27.27%。

嘉合基金投研团队汇聚众多行业精英，团队成员不仅具有良好的教育背景，而且具备多年金融行业从业经历，积累了丰富的投资管理经验，从而以战略性的思维和国际化的眼光，敏锐把握市场变化。截至2023年12月31日，公司注册资本金为人民币3亿元。

截至2023年12月31日，嘉合基金旗下共管理25只公募基金，包括嘉合货币市场基金、嘉合磐石混合型证券投资基金、嘉合磐通债券型证券投资基金、嘉合睿金混合型发起式证券投资基金、嘉合磐稳纯债债券型证券投资基金、嘉合锦程价值精选混合型证券投资基金、嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金、嘉合磐泰短债债券型证券投资基金、嘉合磐昇纯债债券型证券投资基金、嘉合锦鹏添利混合型证券投资基金、嘉合同顺智选股票型证券投资基金、嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金、嘉合稳健增长灵活配置混合型证券投资基金、嘉合锦元回报混合型证券投资基金、嘉合中债-1-3年政策性

金融债指数证券投资基金、嘉合锦明混合型证券投资基金、嘉合磐固一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合磐立一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合锦鑫混合型证券投资基金、嘉合磐弘一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合磐恒债券型证券投资基金、嘉合磐益纯债债券型证券投资基金、嘉合胶东经济圈中高等级信用债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、嘉合锦荣混合型证券投资基金及嘉合磐辉纯债债券型证券投资基金。

#### 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		
李国林	权益投资部总监，嘉合锦鑫混合型证券投资基金、嘉合锦程价值精选混合型证券投资基金、嘉合锦明混合型证券投资基金、嘉合睿金混合型发起式证券投资基金、嘉合锦荣混合型证券投资基金的基金经理。	2021-05-28	-	26年	浙江工商大学经济学硕士，曾任上银基金管理有限公司专户投资部总监兼研究总监、上海凯石益正资产管理有限公司投资总监、凯石基金管理有限公司投资事业部总监，2018年加入嘉合基金管理有限公司。
陶棣澂	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金的基金经理。	2023-07-07	-	5年	美国马里兰大学帕克分校公共政策硕士，2018年10月加入嘉合基金管理有限公司。

注：1、李国林、陶棣澂的“任职日期”为公告确定的任职日期。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了《嘉合基金管理有限公司公平交易制度》，明确各部门的职责以及公平交易控制的内容、方法。

本基金管理人通过事前识别、事中控制、事后检查三个步骤来保证公平交易。事前识别的任务是制定制度和业务流程、设置系统控制项以强制执行公平交易和防范反向交易；事中控制的工作是确保公司授权、研究、投资、交易等行为控制在事前设定的范围之内，各项业务操作根据制度和业务流程进行；事后检查公司投资行为与事前设定的流程、限额等有无偏差，编制投资组合公平交易报告，分析事中控制的效果，并将评价结果报告公司管理层。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规和公司内部公平交易制度的规定，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

##### 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存在异常交易行为。

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

#### 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

回顾2023年，三大指数集体继续回调，市场结构分化明显，代表大盘的上证50、沪深300等出现明显下跌，而小盘股和微盘股则表现得相对强势，成为了资金炒作的目标。

2023年以来，ChatGPT横空出世，AI成为全球股市最火热的主题。“中字头”个股在面对市场环境诸多不确定性之下，阶段性成为资金追逐低估值、低波动、高股息和稳定现金流的确定性。由于经济弱复苏、需求与通胀不及预期影响，商贸零售、美容护理等产业表现不佳。受产业政策影响，医药生物等板块波动较大。新能源板块在供需矛盾突出的情况下，盈利能力不断下滑。在面对高景气行业减少、赚钱效应差、资金存量博

弈和外部风险持续扰动的市场，投资者在进行资产配置时，被迫进入到“哑铃型”的状态：一边是高弹性、或有边际变化的主题性机会乃至小盘股、微盘股；另一边是回归安全与底线思维，追求高股息、确定性强的红利资产。

基本面方面，国内经济修复的上行斜率相对平缓，政策调整尚未完全出现起色，估值进入历史偏底部区间，市场阶段性以长逻辑进行悲观定价。而对于海外主体而言，特别是美国市场，在全年消费和投资持续超预期的情况下，经济衰退的预期不断被证伪。美股表现强劲，在AI赛道的加持下，纳斯达克科技指数创下了近20年的最佳表现。

总体而言，今年场内缺乏新增资金的结果就是市场轮动不断加快，投资者的预期回报率不断下调，落袋为安的情绪浓重，股价波动愈发趋于主题化。此外，我们观察到市场时常会基于股票的筹码结构决定交易行为。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末嘉合睿金混合A基金份额净值为0.9623元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-32.73%，同期业绩比较基准收益率为-6.00%；截至报告期末嘉合睿金混合C基金份额净值为0.9233元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-33.26%，同期业绩比较基准收益率为-6.00%。

#### 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，短期海外虽然不会立即降息，但或也将不再加息，边际拐点或已然来临。中期，在新宏观局势下，未来的利率中枢将出现系统性上移，需要适应流动性新常态。当流动性不再泛滥时，资本的选择性就会愈发明显。

从行业选择的思路来看，预计2024年国内或将是一个经济温和复苏、盈利增速探底回升、内外流动性有所改善、新产业趋势方兴未艾的局面，可以选择积极布局具有产业链趋势的方向。

去年年底展望今年时，也曾类比过今年和2013年和2019年，但是最终因为前三季度经济复苏不及预期，盈利下行，外部流动性持续恶化，2023年前三季度演绎成为2012年和2018年。时至今日，经济和企业盈利继续下行以及美元流动性继续紧缩的概率已经大幅降低，站在2023年底看，仿佛站在2012年底和2018年底。巧合的是2013年对应了4G和移动互联网的科技创新趋势，2019年对应的5G和半导体自主可控的科技创新趋势。由此来看，2024年宏观环境和科技趋势，与2013和2019年或有高度相似的特征。因此，行业选择的思路或也可进行参考，在当前处在AI大浪潮之下，积极关注具有产业链趋势的相关方向，例如新质生产力中的算力和应用等板块。

#### 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，本基金管理人以保障基金份额持有人的利益为宗旨，为了保证公司合规运作、加强内部控制，防范经营风险，公司监察稽核人员按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，采用日常检查与专项检查、定期检查和不定期检查相结合的方式，对公司合规管理及内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核，对发现的问题进行提示和追踪落实，定期制作监察稽核报告，及时呈报公司领导层及上级监管部门。

本基金管理人开展的主要工作包括：

(1) 加强合规宣导与培训，构建合规文化建设的长效机制

通过组织全体员工开展对法律法规、监管动态、最新案例等的学习，使员工从思想上提高合规理念，从实践中增强合规操作，确保其行为守法合规、严格自律、恪守诚实信用原则，以充分维护基金持有人的利益。

(2) 修订管理制度，完善各项业务流程

根据监管的最新法规政策要求，结合公司业务的发展，及时更新公司各项管理制度，不断加强内部流程控制，动态作出各项合规提示，防范合规风险。

(3) 认真开展基金信息披露工作

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的要求，不断规范完善信息披露流程，明确各条线的职责分工，及时履行信息披露工作，确保信息披露的真实性、准确性、及时性和完整性。

(4) 稳步做好各项法律合规管理工作

针对公司新产品、新业务，及时提供合规咨询，并进行合规审查和合规建议；认真审核公司及产品各项法律文件，严控法律风险；结合业务的风险点，定期/不定期开展合规检查工作，提出整改建议，提升公司合规管理水平。

(5) 积极履行反洗钱义务

根据中国人民银行及中国证监会的最新监管要求，完善公司反洗钱管理制度，优化反洗钱工作流程，并对反洗钱相关信息系统进行升级改造，加强客户身份识别工作，认真甄别分析可疑交易。

本基金管理人将一如既往地遵循诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产、不断提高投资管理工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设立估值委员会，委员会成员具有3年以上的基金及相关行业工作经验、专业技术技能，并且能够在估值委员会相关工作中保持独立性。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。

估值委员会下设估值工作小组。估值工作小组充分听取相关部门的建议，并和相关托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告以及估值政策和程序评估报告，以便估值委员会决策。

估值政策经估值委员会审阅同意，并经本公司总经理批准后实施。

基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

除了投资总监外，其他基金经理不是估值委员会和估值工作小组的成员，不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以向估值工作小组提供估值建议。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

对于在交易所上市的证券，采用交易所发布的行情信息来估值。对于固定收益品种，采用中国证券投资基金业协会核算估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准来估值。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资，若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的两类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本基金自2023年7月20日起至2023年12月31日基金资产净值低于人民币五千万元，已经连续六十个工作日以上。本基金管理人已按照法律法规和基金合同的要求向中国证监会报告并提交了解决方案。

## **§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**

本报告期内，渤海银行股份有限公司（以下称“本基金托管人”）在对嘉合睿金混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在任何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**

本报告期内，本基金托管人根据《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的



计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本基金托管人对本报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整，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	毕马威华振审字第2401744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	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的嘉合睿金混合型发起式证券投资基金(以下简称"该基金")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,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称"企业会计准则")及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称"

	<p>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，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>该基金管理人嘉合基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金2023年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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作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。在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。该基金管理人治理层负责监督该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

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(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。(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。(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该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该基金不能持续经营。(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。我们与该基金管理人治理层就计划的审计

	范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	叶凯韵	欧梦激
会计师事务所的地址	上海市南京西路1266号恒隆广场2期25楼	
审计报告日期	2024-03-28	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：嘉合睿金混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 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	3,130,702.49	11,427,008.19
结算备付金		-	-
存出保证金		436,528.80	1,103,195.44
交易性金融资产	7.4.7.2	27,763,106.30	47,024,080.67
其中：股票投资		27,763,106.30	47,024,080.67
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-593.43
应收清算款		-	-
应收股利		-	-

应收申购款		19,225.08	25,796.12
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		31,349,562.67	59,579,486.99
<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		-	-
应付赎回款		43,150.76	1,050,961.85
应付管理人报酬		34,430.36	60,985.42
应付托管费		2,869.19	5,082.13
应付销售服务费		15,530.11	23,255.48
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.5	80,008.94	130,063.19
负债合计		175,989.36	1,270,348.07
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.6	33,329,569.89	41,553,123.59
未分配利润	7.4.7.7	-2,155,996.58	16,756,015.33
净资产合计		31,173,573.31	58,309,138.92
负债和净资产总计		31,349,562.67	59,579,486.99

注：报告截止日2023年12月31日，嘉合睿金混合A份额净值0.9623元，基金份额总额10,271,531.62份，嘉合睿金混合C份额净值0.9233元，基金份额总额23,058,038.27份，总份额合计33,329,569.89份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉合睿金混合型发起式证券投资基金

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2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2 022年12月31日
一、营业总收入		-12,971,921.00	-14,059,708.99
1.利息收入		59,794.60	350,135.25
其中：存款利息收入	7.4.7.8	37,208.43	133,525.35
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		22,586.17	216,609.90
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		-12,454,500.39	-17,160,534.30
其中：股票投资收益	7.4.7.9	-12,888,918.57	-17,528,462.30
基金投资收益	7.4.7.10	-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	9,830.10
资产支持证券投资 收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	434,418.18	358,097.90
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.16	-670,550.15	2,016,109.64
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号	7.4.7.17	93,334.94	734,580.42

填列)			
<b>减：二、营业总支出</b>		913,074.64	1,635,359.69
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	532,246.94	1,002,296.81
2.托管费	7.4.10.2.2	44,353.83	83,524.65
3.销售服务费	7.4.10.2.3	238,073.87	401,538.23
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	7.4.7.19	98,400.00	148,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-13,884,995.64	-15,695,068.68
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-13,884,995.64	-15,695,068.68
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-13,884,995.64	-15,695,068.68

### 7.3 净资产变动表

会计主体：嘉合睿金混合型发起式证券投资基金

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	41,553,123.59	16,756,015.33	58,309,138.92
二、本期期初净资产	41,553,123.59	16,756,015.33	58,309,138.92

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,223,553.70	-18,912,011.91	-27,135,565.61
（一）、综合收益总额	-	-13,884,995.64	-13,884,995.64
（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）	-8,223,553.70	-5,027,016.27	-13,250,569.97
其中：1.基金申购款	15,188,004.33	4,830,944.95	20,018,949.28
2.基金赎回款	-23,411,558.03	-9,857,961.22	-33,269,519.25
（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	33,329,569.89	-2,155,996.58	31,173,573.31
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	37,169,633.86	27,834,607.74	65,004,241.60
二、本期期初净资产	37,169,633.86	27,834,607.74	65,004,241.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,383,489.73	-11,078,592.41	-6,695,102.68
（一）、综合收益	-	-15,695,068.68	-15,695,068.68



总额			
(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)	4,383,489.73	4,616,476.27	8,999,966.00
其中: 1.基金申购款	138,417,671.21	79,154,127.21	217,571,798.42
2.基金赎回款	-134,034,181.48	-74,537,650.94	-208,571,832.42
(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	41,553,123.59	16,756,015.33	58,309,138.92

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:

魏超

沈珂

蔡文婷

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

嘉合睿金混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予嘉合睿金定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]2544号)批准,由嘉合基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规以及《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2018年3月21日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集资金总额人民币200,134,019.23元。上述募集资金已由会计师事务所验证,并出具了验资报告。根据《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,自2019年3月13日,

本基金正式实施基金转型，基金名称由“嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金”变更为“嘉合睿金混合型发起式证券投资基金”，运作方式由“契约型开放式，以定期开放方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式”变更为“契约型开放式”，嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金份额变更为嘉合睿金混合型发起式证券投资基金份额。2019年3月13日，《嘉合睿金混合型发起式证券投资基金基金合同》生效，基金规模为10,961,277.90份基金份额。本基金的基金管理人为嘉合基金管理有限公司，基金托管人为渤海银行股份有限公司(以下简称“渤海银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《嘉合睿金混合型发起式证券投资基金基金合同》和《嘉合睿金混合型发起式证券投资基金招募说明书》(更新)的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市交易的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债等)、债券回购、同业存单、股指期货、资产支持证券、权证、货币市场工具、银行存款以及现金，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比例为50%-95%，持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较标准为沪深300指数收益率 $\times$ 60% + 中债综合全价指数收益率 $\times$ 40%。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2023年12月31日的财务状况、2023年度的经营成果和净资产变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自2023年1月1日起至2023年12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资和买入返售金融资产等。

本基金通常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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：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其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

##### (b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定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

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无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。

#### 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

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

#### (d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

#### 预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来12个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后12个月内（若金融工具的预计存续期少于12个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

#### 预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

#### 核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 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。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

##### 投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

##### 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、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。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的两类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同；本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证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》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”）在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明



#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015] 101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016] 36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016] 140号文《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》、财税[2017] 2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017] 56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023] 39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

b) 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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红

利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

d) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

## 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	3,130,702.49	11,427,008.19
等于：本金	3,129,842.09	11,424,273.18
加：应计利息	860.40	2,735.01
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	3,130,702.49	11,427,008.19

## 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	26,894,587.95	-	27,763,106.30	868,518.35
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	26,894,587.95	-	27,763,106.30	868,518.35
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	45,485,012.17	-	47,024,080.67	1,539,068.50
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	45,485,012.17	-	47,024,080.67	1,539,068.50
----	---------------	---	---------------	--------------

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

### 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	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
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	-593.43	-
银行间市场	-	-
合计	-593.43	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 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	8.94	63.19
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-

其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	80,000.00	130,000.00
合计	80,008.94	130,063.19

#### 7.4.7.6 实收基金

##### 7.4.7.6.1 嘉合睿金混合A

金额单位：人民币元

项目 (嘉合睿金混合A)	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	17,501,633.59	17,501,633.59
本期申购	4,237,398.34	4,237,398.34
本期赎回（以“-”号填列）	-11,467,500.31	-11,467,500.31
本期末	10,271,531.62	10,271,531.62

##### 7.4.7.6.2 嘉合睿金混合C

金额单位：人民币元

项目 (嘉合睿金混合C)	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	24,051,490.00	24,051,490.00
本期申购	10,950,605.99	10,950,605.99
本期赎回（以“-”号填列）	-11,944,057.72	-11,944,057.72
本期末	23,058,038.27	23,058,038.27

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.7 未分配利润

##### 7.4.7.7.1 嘉合睿金混合A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

(嘉合睿金混合A)			
上年度末	8,121,879.43	-588,721.53	7,533,157.90
本期期初	8,121,879.43	-588,721.53	7,533,157.90
本期利润	-3,618,984.43	-1,429.02	-3,620,413.45
本期基金份额交易产生的变动数	-4,241,479.00	-58,245.19	-4,299,724.19
其中：基金申购款	1,516,073.77	-236,837.06	1,279,236.71
基金赎回款	-5,757,552.77	178,591.87	-5,578,960.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	261,416.00	-648,395.74	-386,979.74

#### 7.4.7.7.2 嘉合睿金混合C

单位：人民币元

项目 (嘉合睿金混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,912,492.00	-689,634.57	9,222,857.43
本期期初	9,912,492.00	-689,634.57	9,222,857.43
本期利润	-9,595,461.06	-669,121.13	-10,264,582.19
本期基金份额交易产生的变动数	-769,654.41	42,362.33	-727,292.08
其中：基金申购款	3,948,729.89	-397,021.65	3,551,708.24
基金赎回款	-4,718,384.30	439,383.98	-4,279,000.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-452,623.47	-1,316,393.37	-1,769,016.84

#### 7.4.7.8 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	30,862.52	94,723.06
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	-	7,533.20
其他	6,345.91	31,269.09
合计	37,208.43	133,525.35

注：其他为券商保证金利息收入。

#### 7.4.7.9 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	909,545,437.92	364,881,061.63
减：卖出股票成本总额	920,360,018.38	381,468,448.68
减：交易费用	2,074,338.11	941,075.25
买卖股票差价收入	-12,888,918.57	-17,528,462.30

#### 7.4.7.10 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 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
债券投资收益——利息收入	-	25.01
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	-	9,805.09
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	-	9,830.10

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	-	44,831.10
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	-	35,000.00
减：应计利息总额	-	25.01
减：交易费用	-	1.00
买卖债券差价收入	-	9,805.09

#### 7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益-赎回差价收入。

#### 7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。



**7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他衍生工具投资收益。

**7.4.7.15 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	434,418.18	358,097.90
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	434,418.18	358,097.90

**7.4.7.16 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	-670,550.15	2,016,109.64
——股票投资	-670,550.15	2,016,109.64
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——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	-670,550.15	2,016,109.64

**7.4.7.17 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	93,334.94	734,550.84
转换费收入	-	29.58
合计	93,334.94	734,580.42

注：1、赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减，并按持有期间的增加而递减计入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中赎回费部分按持有期间的增加而递减计入基金财产。

**7.4.7.18 信用减值损失**

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

**7.4.7.19 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	50,000.00
信息披露费	50,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
中债登	18,000.00	18,000.00
其他费用	400.00	-
合计	98,400.00	148,000.00

**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，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

本基金本报告不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。

关联方名称	与本基金的关系
嘉合基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
渤海银行股份有限公司	基金托管人
中航信托股份有限公司	基金管理人的股东
广东万和集团有限公司	基金管理人的股东
上海慧弘实业集团有限公司	基金管理人的股东
福建圣农控股集团有限公司	基金管理人的股东
北京智勇仁信投资咨询有限公司	基金管理人的股东
山东通汇资本投资集团有限公司	基金管理人的股东

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

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股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

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

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回购交易。

###### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 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20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至20 22年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	532,246.94	1,002,296.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	112,934.53	241,798.28
应支付基金管理人的净管理费	419,312.41	760,498.53

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

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。

#### 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	44,353.83	83,524.65

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的	本期 2023年01月01日至2023年12月31日

各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C	合计
嘉合基金管理有限公司	0.00	172,823.32	172,823.32
合计	0.00	172,823.32	172,823.32
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C	合计
嘉合基金管理有限公司	0.00	241,814.00	241,814.00
合计	0.00	241,814.00	241,814.00

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.80%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 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

嘉合睿金混合A

份额单位：份

关联方名	本期末	上年度末
------	-----	------

称	2023年12月31日		2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
福建圣农控股集团有限公司	0.00	0.00%	3,484,197.06	8.38%

#### 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
渤海银行股份有限公司	3,130,702.49	30,862.52	11,427,008.19	94,723.06

注：本基金通过“渤海银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2023年12月31日的相关余额为人民币0元。（2022年12月31日：人民币0元）

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均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均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 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

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及

创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

本基金本报告期末未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

#### **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2023年12月31日止，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金融资产款余额。

##### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末2023年12月31日止，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金融资产款余额。

#### **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**

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、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四层次的内部控制与风控体系，主要包括：（1）员工自律；（2）部门主管的检查监督；（3）督察长领导下的监察稽核部和风险管理部的检查、监督；（4）董事会领导下的风险管理委员会及总办会领导下的风险控制委员会的控制和指导。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会风险管理与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部及风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部及风险管理部向督察长负责，并向其汇报日常行政事务。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### **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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行渤海银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

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采用券款对付交割方式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**

本基金于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。

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

本基金于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。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金于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。

##### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券。

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

本基金于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。

##### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金于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。

#### **7.4.13.3 流动性风险**



流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；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，以保障基金持有人利益。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、权证等权益类工具，以及债券等固定收益类工具，其中权益类投资占有较大比例。本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，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管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不超过该证券的10%。本基金与由本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超过该上市公司可流通股票的15%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)，本基金与由本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，不超过该上市公司可流通股票的30%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的15%。

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。

本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性，因此利率风险在一定程度上存在。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	3,130,702.49	-	-	-	-	-	3,130,702.49
交易性金融资产	-	-	-	-	-	27,763,106.30	27,763,106.30
应收申购款	-	-	-	-	-	19,225.08	19,225.08
存出保证金	436,528.80	-	-	-	-	-	436,528.80
资产总计	3,567,231.29	-	-	-	-	27,782,331.38	31,349,562.67
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	43,150.76	43,150.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	34,430.36	34,430.36
应付托管费	-	-	-	-	-	2,869.19	2,869.19
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,530.11	15,530.11

## 嘉合睿金混合型发起式证券投资基金2023年年度报告

其他负债	-	-	-	-	-	80,008.94	80,008.94
负债总计	-	-	-	-	-	175,989.36	175,989.36
利率敏感度缺口	3,567,231.29	-	-	-	-	27,606,342.02	31,173,573.31
上年度末 2022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	11,427,008.19	-	-	-	-	-	11,427,008.19
存出保证金	1,103,195.44	-	-	-	-	-	1,103,195.44
交易性金融资产	-	-	-	-	-	47,024,080.67	47,024,080.67
买入返售金融资产	-593.43	-	-	-	-	-	-593.43
应收申购款	-	-	-	-	-	25,796.12	25,796.12
资产总计	12,529,610.20	-	-	-	-	47,049,876.79	59,579,486.99
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,050,961.85	1,050,961.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	60,985.42	60,985.42
应付托管费	-	-	-	-	-	5,082.13	5,082.13
应付销售服务费	-	-	-	-	-	23,255.48	23,255.48
其他负债	-	-	-	-	-	130,063.19	130,063.19
负债总计	-	-	-	-	-	1,270,348.07	1,270,348.07

利率敏感度缺口	12,529,610.20	-	-	-	-	45,779,528.72	58,309,138.92
---------	---------------	---	---	---	---	---------------	---------------

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末及上年度末，本基金未持有对利率敏感的金融资产与金融负债。因此，市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

##### 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	27,763,106.30	89.06	47,024,080.67	80.65
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	27,763,106.30	89.06	47,024,080.67	80.65

#### 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
	业绩比较基准上升5%	1,705,307.97	3,058,209.83
	业绩比较基准下降5%	-1,705,307.97	-3,058,209.83

#### 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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下:

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到的输入值;

第三层次输入值: 相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 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	上年度末
---------------	-----	------

	2023年12月31日	2022年12月31日
第一层次	27,763,106.30	47,024,080.67
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	27,763,106.30	47,024,080.67

#### 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。

#### 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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2022年12月31日：无)。

#### 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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2023年12月31日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## §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	27,763,106.30	88.56
	其中：股票	27,763,106.30	88.56
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	3,130,702.49	9.99
8	其他各项资产	455,753.88	1.45
9	合计	31,349,562.67	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

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	601,120.00	1.93
C	制造业	11,789,883.30	37.82
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	7,802,504.00	25.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,777,568.00	5.70
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,792,031.00	18.58
S	综合	-	-
	合计	27,763,106.30	89.06

### 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投资股票。

### 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	300364	中文在线	71,400	1,837,122.00	5.89
2	301052	果麦文化	40,800	1,786,224.00	5.73
3	300502	新易盛	36,200	1,785,384.00	5.73
4	300280	紫天科技	41,600	1,777,568.00	5.70
5	300418	昆仑万维	40,800	1,525,920.00	4.89
6	300624	万兴科技	16,100	1,523,060.00	4.89
7	301236	软通动力	25,100	1,159,620.00	3.72
8	601595	上海电影	42,500	1,097,775.00	3.52
9	300494	盛天网络	69,200	1,094,052.00	3.51
10	300031	宝通科技	59,000	1,093,860.00	3.51

11	301011	华立科技	46,500	1,088,100.00	3.49
12	600114	东睦股份	69,800	1,081,202.00	3.47
13	300251	光线传媒	131,400	1,070,910.00	3.44
14	688776	国光电气	10,899	1,061,453.61	3.40
15	300951	博硕科技	14,600	945,788.00	3.03
16	688523	航天环宇	34,864	935,052.48	3.00
17	688328	深科达	20,420	915,837.00	2.94
18	301313	凡拓数创	23,600	851,016.00	2.73
19	688543	国科军工	13,420	750,178.00	2.41
20	002895	川恒股份	36,700	697,300.00	2.24
21	688375	国博电子	8,730	694,296.90	2.23
22	600486	扬农化工	10,200	643,824.00	2.07
23	300629	新劲刚	28,200	609,966.00	1.96
24	603993	洛阳钼业	115,600	601,120.00	1.93
25	688123	聚辰股份	9,497	581,501.31	1.87
26	300366	创意信息	42,300	554,976.00	1.78

#### 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	300418	昆仑万维	18,539,619.50	31.80
2	300624	万兴科技	18,357,918.00	31.48
3	300364	中文在线	17,990,201.00	30.85
4	300502	新易盛	16,627,126.26	28.52
5	300280	紫天科技	14,682,030.00	25.18
6	688041	海光信息	14,466,238.07	24.81
7	301052	果麦文化	13,469,903.00	23.10
8	300494	盛天网络	11,474,507.80	19.68

9	300308	中际旭创	10,675,975.00	18.31
10	603000	人民网	10,623,453.00	18.22
11	688590	新致软件	10,021,700.31	17.19
12	600941	中国移动	9,766,864.00	16.75
13	603019	中科曙光	8,899,394.00	15.26
14	300394	天孚通信	8,484,233.71	14.55
15	300528	幸福蓝海	8,293,217.00	14.22
16	002230	科大讯飞	7,709,219.00	13.22
17	300002	神州泰岳	7,642,068.00	13.11
18	000063	中兴通讯	7,594,303.00	13.02
19	601900	南方传媒	7,498,974.00	12.86
20	300803	指南针	7,431,354.00	12.74
21	688390	固德威	7,042,384.30	12.08
22	601858	中国科传	6,962,794.00	11.94
23	300229	拓尔思	6,885,302.00	11.81
24	300654	世纪天鸿	6,663,202.00	11.43
25	002555	三七互娱	6,639,400.00	11.39
26	300031	宝通科技	6,495,587.00	11.14
27	300570	太辰光	6,263,391.00	10.74
28	301308	江波龙	6,142,432.00	10.53
29	601595	上海电影	6,060,981.00	10.39
30	300212	易华录	6,049,801.00	10.38
31	301171	易点天下	5,998,214.00	10.29
32	688318	财富趋势	5,910,117.71	10.14
33	688256	寒武纪	5,886,203.48	10.09
34	600114	东睦股份	5,824,723.30	9.99
35	688110	东芯股份	5,807,800.91	9.96
36	300788	中信出版	5,806,139.00	9.96
37	300274	阳光电源	5,447,043.00	9.34
38	300033	同花顺	5,247,929.00	9.00
39	603662	柯力传感	5,218,432.30	8.95

40	300551	古鳌科技	5,159,757.00	8.85
41	600633	浙数文化	4,956,563.16	8.50
42	601728	中国电信	4,721,678.00	8.10
43	300951	博硕科技	4,692,930.00	8.05
44	301262	海看股份	4,570,988.00	7.84
45	688333	铂力特	4,527,958.30	7.77
46	300475	香农芯创	4,421,139.92	7.58
47	600763	通策医疗	4,412,292.00	7.57
48	603985	恒润股份	4,378,488.00	7.51
49	301169	零点有数	4,263,591.35	7.31
50	301316	慧博云通	4,250,283.00	7.29
51	300660	江苏雷利	4,156,578.80	7.13
52	688160	步科股份	3,980,777.07	6.83
53	300620	光库科技	3,943,679.69	6.76
54	002929	润建股份	3,899,858.00	6.69
55	300426	唐德影视	3,854,226.00	6.61
56	600028	中国石化	3,830,105.00	6.57
57	601801	皖新传媒	3,800,026.00	6.52
58	688166	博瑞医药	3,797,843.59	6.51
59	002517	恺英网络	3,783,585.00	6.49
60	688088	虹软科技	3,780,527.46	6.48
61	603888	新华网	3,726,529.00	6.39
62	688123	聚辰股份	3,707,058.89	6.36
63	300688	创业黑马	3,689,317.00	6.33
64	300612	宣亚国际	3,673,614.00	6.30
65	002415	海康威视	3,672,068.00	6.30
66	002174	游族网络	3,663,935.50	6.28
67	000503	国新健康	3,649,946.00	6.26
68	688095	福昕软件	3,631,793.92	6.23
69	300081	恒信东方	3,610,999.02	6.19
70	002995	天地在线	3,580,296.40	6.14

71	300133	华策影视	3,579,366.00	6.14
72	002878	元隆雅图	3,555,441.00	6.10
73	300785	值得买	3,511,543.00	6.02
74	688525	佰维存储	3,508,386.05	6.02
75	688169	石头科技	3,508,124.95	6.02
76	300459	汤姆猫	3,480,262.00	5.97
77	600519	贵州茅台	3,407,647.00	5.84
78	603496	恒为科技	3,406,790.00	5.84
79	688167	炬光科技	3,398,125.12	5.83
80	603533	掌阅科技	3,368,957.00	5.78
81	300366	创意信息	3,346,612.00	5.74
82	600030	中信证券	3,311,108.50	5.68
83	600602	云赛智联	3,262,219.78	5.59
84	301011	华立科技	3,246,581.00	5.57
85	300130	新国都	3,245,860.00	5.57
86	000403	派林生物	3,242,349.00	5.56
87	001309	德明利	3,238,326.00	5.55
88	300826	测绘股份	3,200,980.25	5.49
89	601939	建设银行	3,130,006.00	5.37
90	002291	遥望科技	3,122,238.96	5.35
91	300634	彩讯股份	3,087,871.00	5.30
92	688063	派能科技	3,078,852.46	5.28
93	002919	名臣健康	3,041,529.00	5.22
94	300413	芒果超媒	2,965,651.00	5.09
95	300503	昊志机电	2,918,429.00	5.01
96	002460	赣锋锂业	2,891,543.00	4.96
97	601398	工商银行	2,840,494.00	4.87
98	600150	中国船舶	2,783,854.00	4.77
99	300762	上海瀚讯	2,721,051.00	4.67
100	000661	长春高新	2,708,330.00	4.64
101	301313	凡拓数创	2,700,909.00	4.63

102	603108	润达医疗	2,665,779.00	4.57
103	605168	三人行	2,615,966.00	4.49
104	300299	富春股份	2,606,387.00	4.47
105	601059	信达证券	2,556,286.75	4.38
106	300454	深信服	2,488,471.00	4.27
107	300052	中青宝	2,469,661.00	4.24
108	301528	多浦乐	2,440,057.84	4.18
109	300499	高澜股份	2,439,946.00	4.18
110	601099	太平洋	2,429,611.00	4.17
111	300779	惠城环保	2,428,747.00	4.17
112	300007	汉威科技	2,385,179.00	4.09
113	688066	航天宏图	2,376,291.08	4.08
114	300260	新莱应材	2,354,186.00	4.04
115	688595	芯海科技	2,347,668.26	4.03
116	002605	姚记科技	2,344,258.00	4.02
117	601688	华泰证券	2,302,087.00	3.95
118	688521	芯原股份	2,297,196.85	3.94
119	002558	巨人网络	2,261,735.00	3.88
120	688141	杰华特	2,235,139.23	3.83
121	688523	航天环宇	2,215,812.88	3.80
122	600200	江苏吴中	2,208,026.00	3.79
123	000676	智度股份	2,184,450.00	3.75
124	300844	山水比德	2,174,769.00	3.73
125	300226	上海钢联	2,166,752.00	3.72
126	601360	三六零	2,157,964.00	3.70
127	600938	中国海油	2,105,295.00	3.61
128	688195	腾景科技	2,102,069.60	3.61
129	688328	深科达	2,100,716.84	3.60
130	300438	鹏辉能源	2,082,857.00	3.57
131	300457	赢合科技	2,071,705.00	3.55
132	600418	江淮汽车	2,060,029.00	3.53

133	300820	英杰电气	2,037,618.00	3.49
134	688484	南芯科技	2,035,321.90	3.49
135	600009	上海机场	2,002,953.00	3.44
136	002261	拓维信息	1,991,233.00	3.41
137	300337	银邦股份	1,990,472.00	3.41
138	301085	亚康股份	1,986,108.94	3.41
139	002371	北方华创	1,985,076.00	3.40
140	603444	吉比特	1,965,657.00	3.37
141	300049	福瑞股份	1,961,782.00	3.36
142	688433	华曙高科	1,956,272.09	3.36
143	601136	首创证券	1,948,225.00	3.34
144	688535	华海诚科	1,944,440.64	3.33
145	603220	中贝通信	1,918,178.00	3.29
146	002518	科士达	1,898,245.00	3.26
147	000021	深科技	1,862,787.00	3.19
148	600203	福日电子	1,848,016.00	3.17
149	000625	长安汽车	1,847,559.00	3.17
150	688418	震有科技	1,846,125.73	3.17
151	601899	紫金矿业	1,843,414.00	3.16
152	002881	美格智能	1,837,879.00	3.15
153	002821	凯莱英	1,824,377.00	3.13
154	601012	隆基绿能	1,815,001.40	3.11
155	601166	兴业银行	1,812,000.00	3.11
156	300496	中科创达	1,793,321.00	3.08
157	002908	德生科技	1,787,170.00	3.06
158	600906	财达证券	1,772,471.00	3.04
159	300725	药石科技	1,763,239.00	3.02
160	688072	拓荆科技	1,718,645.76	2.95
161	688385	复旦微电	1,699,040.73	2.91
162	002654	万润科技	1,684,361.00	2.89
163	002572	索菲亚	1,662,669.00	2.85

164	688362	甬矽电子	1,637,405.01	2.81
165	688543	国科军工	1,630,922.20	2.80
166	688213	思特威	1,618,631.49	2.78
167	601995	中金公司	1,599,763.00	2.74
168	000977	浪潮信息	1,576,543.00	2.70
169	688498	源杰科技	1,541,682.99	2.64
170	300576	容大感光	1,537,643.22	2.64
171	605117	德业股份	1,530,421.00	2.62
172	688375	国博电子	1,508,925.28	2.59
173	601689	拓普集团	1,505,948.00	2.58
174	002472	双环传动	1,500,060.37	2.57
175	600707	彩虹股份	1,472,187.00	2.52
176	300602	飞荣达	1,464,216.00	2.51
177	600895	张江高科	1,459,264.00	2.50
178	000514	渝开发	1,446,538.00	2.48
179	001223	欧克科技	1,444,129.00	2.48
180	688010	福光股份	1,436,022.41	2.46
181	000001	平安银行	1,432,325.00	2.46
182	688502	茂莱光学	1,431,764.05	2.46
183	603486	科沃斯	1,420,693.00	2.44
184	603859	能科科技	1,411,250.00	2.42
185	601288	农业银行	1,404,820.00	2.41
186	300373	扬杰科技	1,400,752.00	2.40
187	688327	云从科技	1,398,182.45	2.40
188	000568	泸州老窖	1,394,917.00	2.39
189	688227	品高股份	1,393,616.05	2.39
190	002400	省广集团	1,387,056.00	2.38
191	688798	艾为电子	1,383,646.53	2.37
192	601988	中国银行	1,381,500.00	2.37
193	300782	卓胜微	1,360,165.00	2.33
194	688313	仕佳光子	1,356,219.13	2.33



195	300682	朗新集团	1,354,480.00	2.32
196	300258	精锻科技	1,335,750.00	2.29
197	603728	鸣志电器	1,333,060.00	2.29
198	603667	五洲新春	1,332,408.00	2.29
199	300693	盛弘股份	1,329,720.00	2.28
200	601328	交通银行	1,308,000.00	2.24
201	002317	众生药业	1,305,070.00	2.24
202	688266	泽璟制药	1,284,482.15	2.20
203	002292	奥飞娱乐	1,280,692.00	2.20
204	300207	欣旺达	1,272,901.00	2.18
205	600276	恒瑞医药	1,268,802.00	2.18
206	000936	华西股份	1,249,235.00	2.14
207	605577	龙版传媒	1,249,185.00	2.14
208	300014	亿纬锂能	1,244,395.00	2.13
209	300770	新媒股份	1,242,508.48	2.13
210	002955	鸿合科技	1,242,130.00	2.13
211	300061	旗天科技	1,237,739.00	2.12
212	002222	福晶科技	1,220,538.00	2.09
213	002179	中航光电	1,219,671.00	2.09
214	300136	信维通信	1,214,610.00	2.08
215	002195	岩山科技	1,205,604.00	2.07
216	688670	金迪克	1,201,141.98	2.06
217	000656	金科股份	1,199,736.00	2.06
218	603081	大丰实业	1,192,866.00	2.05
219	688766	普冉股份	1,189,281.80	2.04
220	300585	奥联电子	1,185,539.00	2.03
221	688371	菲沃泰	1,178,509.20	2.02
222	300101	振芯科技	1,178,080.00	2.02
223	300559	佳发教育	1,170,401.00	2.01
224	688111	金山办公	1,168,228.41	2.00

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

2、基金持有的股票的分类为交易型金融资产的，本项的"累计买入金额"按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300418	昆仑万维	17,089,047.30	29.31
2	300364	中文在线	17,008,697.50	29.17
3	300624	万兴科技	16,585,912.00	28.44
4	688041	海光信息	15,401,019.25	26.41
5	300502	新易盛	15,133,026.32	25.95
6	300280	紫天科技	13,029,937.00	22.35
7	301052	果麦文化	11,564,736.00	19.83
8	603000	人民网	10,557,814.00	18.11
9	300494	盛天网络	10,520,068.20	18.04
10	300308	中际旭创	10,387,806.00	17.82
11	600941	中国移动	10,035,064.32	17.21
12	688590	新致软件	9,836,020.25	16.87
13	603019	中科曙光	8,812,055.60	15.11
14	002230	科大讯飞	8,539,535.00	14.65
15	300394	天孚通信	8,321,045.00	14.27
16	000063	中兴通讯	8,047,992.00	13.80
17	300528	幸福蓝海	7,868,784.00	13.49
18	300274	阳光电源	7,642,102.12	13.11
19	600519	贵州茅台	7,613,259.00	13.06
20	300002	神州泰岳	7,610,621.00	13.05
21	601900	南方传媒	7,346,489.00	12.60
22	300803	指南针	7,312,218.97	12.54

23	002555	三七互娱	7,100,978.00	12.18
24	601858	中国科传	6,917,690.00	11.86
25	688390	固德威	6,497,992.59	11.14
26	300229	拓尔思	6,450,233.38	11.06
27	300654	世纪天鸿	6,165,632.00	10.57
28	301171	易点天下	6,149,582.16	10.55
29	301308	江波龙	6,010,555.62	10.31
30	002594	比亚迪	5,937,726.00	10.18
31	300438	鹏辉能源	5,936,847.00	10.18
32	300212	易华录	5,894,551.00	10.11
33	002821	凯莱英	5,838,691.16	10.01
34	300788	中信出版	5,838,202.00	10.01
35	688256	寒武纪	5,835,883.40	10.01
36	688318	财富趋势	5,798,120.46	9.94
37	300570	太辰光	5,774,849.00	9.90
38	688110	东芯股份	5,349,672.39	9.17
39	300031	宝通科技	5,264,557.00	9.03
40	300551	古鳌科技	5,079,623.00	8.71
41	601595	上海电影	5,024,502.00	8.62
42	600114	东睦股份	4,821,750.58	8.27
43	600633	浙数文化	4,746,583.00	8.14
44	603662	柯力传感	4,716,695.00	8.09
45	300033	同花顺	4,602,806.00	7.89
46	601728	中国电信	4,561,839.00	7.82
47	300660	江苏雷利	4,475,452.00	7.68
48	603985	恒润股份	4,461,671.88	7.65
49	301262	海看股份	4,451,308.16	7.63
50	600028	中国石化	4,371,185.00	7.50
51	301316	慧博云通	4,370,888.09	7.50
52	300363	博腾股份	4,363,395.00	7.48
53	300475	香农芯创	4,335,958.00	7.44

54	000661	长春高新	4,325,391.00	7.42
55	688333	铂力特	4,300,923.11	7.38
56	301169	零点有数	4,266,463.36	7.32
57	688088	虹软科技	4,196,529.53	7.20
58	600763	通策医疗	4,013,173.00	6.88
59	300951	博硕科技	3,952,904.50	6.78
60	300620	光库科技	3,951,425.00	6.78
61	002929	润建股份	3,949,670.00	6.77
62	688166	博瑞医药	3,886,568.67	6.67
63	603589	口子窖	3,764,021.00	6.46
64	002335	科华数据	3,763,367.00	6.45
65	688169	石头科技	3,762,831.91	6.45
66	601801	皖新传媒	3,739,951.00	6.41
67	000503	国新健康	3,739,298.00	6.41
68	002415	海康威视	3,736,185.00	6.41
69	300426	唐德影视	3,667,986.00	6.29
70	002460	赣锋锂业	3,661,676.80	6.28
71	002517	恺英网络	3,652,690.00	6.26
72	002878	元隆雅图	3,615,386.00	6.20
73	688160	步科股份	3,615,020.98	6.20
74	603888	新华网	3,614,920.00	6.20
75	300693	盛弘股份	3,545,014.00	6.08
76	300688	创业黑马	3,509,359.00	6.02
77	300612	宣亚国际	3,499,643.00	6.00
78	688525	佰维存储	3,485,830.42	5.98
79	300133	华策影视	3,464,648.00	5.94
80	300785	值得买	3,453,345.50	5.92
81	300459	汤姆猫	3,417,651.00	5.86
82	688095	福昕软件	3,415,489.97	5.86
83	002174	游族网络	3,403,950.83	5.84
84	300081	恒信东方	3,383,296.00	5.80

85	603496	恒为科技	3,366,314.00	5.77
86	600030	中信证券	3,338,326.55	5.73
87	688167	炬光科技	3,331,375.91	5.71
88	300130	新国都	3,281,377.00	5.63
89	000403	派林生物	3,267,737.00	5.60
90	002995	天地在线	3,238,593.00	5.55
91	001309	德明利	3,224,327.00	5.53
92	300826	测绘股份	3,208,504.00	5.50
93	603533	掌阅科技	3,195,106.00	5.48
94	600602	云赛智联	3,116,239.00	5.34
95	688123	聚辰股份	3,106,249.43	5.33
96	601398	工商银行	3,027,764.00	5.19
97	002919	名臣健康	2,998,214.00	5.14
98	002291	遥望科技	2,988,226.00	5.12
99	601939	建设银行	2,982,659.00	5.12
100	002371	北方华创	2,957,401.00	5.07
101	300634	彩讯股份	2,943,049.00	5.05
102	688063	派能科技	2,933,527.21	5.03
103	300503	昊志机电	2,799,334.00	4.80
104	300413	芒果超媒	2,698,165.00	4.63
105	601059	信达证券	2,693,491.75	4.62
106	300762	上海瀚讯	2,652,494.00	4.55
107	300366	创意信息	2,568,827.00	4.41
108	600150	中国船舶	2,552,241.00	4.38
109	002511	中顺洁柔	2,497,228.00	4.28
110	603108	润达医疗	2,490,778.00	4.27
111	688595	芯海科技	2,478,563.46	4.25
112	605168	三人行	2,472,971.96	4.24
113	300454	深信服	2,432,784.00	4.17
114	688066	航天宏图	2,396,237.43	4.11
115	002605	姚记科技	2,395,151.00	4.11

116	300260	新莱应材	2,381,662.00	4.08
117	300499	高澜股份	2,362,007.00	4.05
118	300779	惠城环保	2,318,120.00	3.98
119	688521	芯原股份	2,306,100.64	3.95
120	301528	多浦乐	2,291,863.28	3.93
121	300299	富春股份	2,291,281.00	3.93
122	300052	中青宝	2,273,320.00	3.90
123	601688	华泰证券	2,258,767.00	3.87
124	601099	太平洋	2,246,660.00	3.85
125	300007	汉威科技	2,227,528.00	3.82
126	601360	三六零	2,218,973.00	3.81
127	301011	华立科技	2,187,251.10	3.75
128	000676	智度股份	2,155,935.00	3.70
129	002558	巨人网络	2,144,707.00	3.68
130	600200	江苏吴中	2,114,706.00	3.63
131	688141	杰华特	2,112,254.47	3.62
132	002261	拓维信息	2,105,234.00	3.61
133	300844	山水比德	2,082,926.00	3.57
134	300226	上海钢联	2,078,723.40	3.57
135	600418	江淮汽车	2,057,838.00	3.53
136	300820	英杰电气	2,033,398.00	3.49
137	603220	中贝通信	2,012,588.62	3.45
138	688484	南芯科技	1,991,167.51	3.41
139	688535	华海诚科	1,989,866.03	3.41
140	600009	上海机场	1,988,853.00	3.41
141	603444	吉比特	1,982,746.00	3.40
142	600938	中国海油	1,977,973.00	3.39
143	301313	凡拓数创	1,975,967.00	3.39
144	688195	腾景科技	1,949,587.74	3.34
145	300049	福瑞股份	1,910,258.00	3.28
146	601136	首创证券	1,903,111.00	3.26

147	600203	福日电子	1,886,600.00	3.24
148	300496	中科创达	1,862,288.00	3.19
149	688418	震有科技	1,836,795.34	3.15
150	601899	紫金矿业	1,823,210.00	3.13
151	688433	华曙高科	1,818,489.62	3.12
152	601012	隆基绿能	1,810,554.00	3.11
153	002881	美格智能	1,803,583.00	3.09
154	301085	亚康股份	1,802,788.58	3.09
155	601166	兴业银行	1,796,900.00	3.08
156	002908	德生科技	1,787,257.00	3.07
157	002518	科士达	1,776,125.00	3.05
158	000021	深科技	1,766,996.00	3.03
159	300337	银邦股份	1,765,907.00	3.03
160	600702	舍得酒业	1,762,771.00	3.02
161	000625	长安汽车	1,751,736.00	3.00
162	002572	索菲亚	1,711,814.00	2.94
163	603859	能科科技	1,704,835.00	2.92
164	002654	万润科技	1,688,969.00	2.90
165	688213	思特威	1,678,056.99	2.88
166	600906	财达证券	1,654,394.00	2.84
167	300457	赢合科技	1,652,431.00	2.83
168	601995	中金公司	1,648,613.13	2.83
169	603486	科沃斯	1,643,925.00	2.82
170	688072	拓荆科技	1,640,763.80	2.81
171	600863	内蒙华电	1,626,255.00	2.79
172	300725	药石科技	1,626,182.00	2.79
173	688362	甬矽电子	1,614,929.69	2.77
174	688385	复旦微电	1,533,342.12	2.63
175	000651	格力电器	1,513,540.00	2.60
176	000001	平安银行	1,452,602.00	2.49
177	688313	仕佳光子	1,449,631.60	2.49

178	605117	德业股份	1,449,306.00	2.49
179	688498	源杰科技	1,448,515.38	2.48
180	601689	拓普集团	1,428,376.00	2.45
181	600895	张江高科	1,421,836.00	2.44
182	300373	扬杰科技	1,417,432.00	2.43
183	603667	五洲新春	1,417,376.00	2.43
184	300682	朗新集团	1,414,310.00	2.43
185	000977	浪潮信息	1,412,838.00	2.42
186	688010	福光股份	1,396,321.20	2.39
187	300602	飞荣达	1,388,852.00	2.38
188	688227	品高股份	1,386,745.33	2.38
189	688798	艾为电子	1,386,649.07	2.38
190	600707	彩虹股份	1,383,153.00	2.37
191	002292	奥飞娱乐	1,377,954.00	2.36
192	688111	金山办公	1,373,121.06	2.35
193	300782	卓胜微	1,367,462.00	2.35
194	300258	精锻科技	1,366,816.00	2.34
195	601288	农业银行	1,362,676.00	2.34
196	002472	双环传动	1,360,706.00	2.33
197	000568	泸州老窖	1,360,114.00	2.33
198	688328	深科达	1,358,257.04	2.33
199	601328	交通银行	1,343,185.00	2.30
200	001223	欧克科技	1,334,315.00	2.29
201	300576	容大感光	1,326,444.00	2.27
202	601988	中国银行	1,320,599.00	2.26
203	002195	岩山科技	1,319,579.00	2.26
204	000858	五粮液	1,308,271.00	2.24
205	603728	鸣志电器	1,300,674.00	2.23
206	688327	云从科技	1,298,811.05	2.23
207	600276	恒瑞医药	1,292,240.00	2.22
208	300207	欣旺达	1,285,634.00	2.20



209	300585	奥联电子	1,278,435.00	2.19
210	688266	泽璟制药	1,255,840.63	2.15
211	000514	渝开发	1,252,679.00	2.15
212	300061	旗天科技	1,239,579.00	2.13
213	000936	华西股份	1,238,083.00	2.12
214	002317	众生药业	1,221,544.00	2.09
215	300014	亿纬锂能	1,210,739.00	2.08
216	688502	茂莱光学	1,206,291.10	2.07
217	000656	金科股份	1,191,912.00	2.04
218	300559	佳发教育	1,185,732.00	2.03
219	002955	鸿合科技	1,176,652.00	2.02
220	688523	航天环宇	1,176,037.36	2.02
221	300136	信维通信	1,173,947.00	2.01
222	688686	奥普特	1,166,632.70	2.00

注：1、卖出包括基金二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票的分类为交易型金融资产的，本项的"累计卖出金额"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	901,769,594.16
卖出股票收入（成交）总额	909,545,437.92

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

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

#### 8.5 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

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 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中，包含“紫天科技”。福建紫天传媒科技股份有限公司（以下简称“紫天科技”）于2023年11月13日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）出具的《立案告知书》（编号：证监立案字 0262023013号），并于2023年12月28日收到中国证监会福建监管局为下发的《行政处罚事先告知书》（闽证监函〔2023〕508号）。中国证监会福建监管局认为福州市安常投资中心（有限合伙）（以下简称“安常投资”）持有3,350万股“紫天科技”，占紫天科技总股本20.67%，是紫天科技的控股股东，2023年3月31日，安常投资持有的3,350万股“紫天科技”全部被南京市中级人民法院冻结（其中3,310万股为首轮冻结）。2023年4月3日，紫天科技和安常投资知悉前述安常投资所持3,310万股“紫天科技”（占紫天科技总股本的20.42%）被冻结情况。根据《证券法》第七十八条第一款、第八十条第一款和第二款第十二项以及《上市公司信息披露管理办法》（证监会令第182号，以下简称《信息披露管理办法》）第二十二第二款第八项的规定，紫天科技应当及时披露安常投资所持公司股份冻结情况。但因安常投资未及时将知悉的有关情况书面告知紫天科技，且迟至2023年4月17日才首次向紫天科技发送《告知函》告知前述股份冻结事项，导致紫天科技未及时披露前

述股份冻结情况。紫天科技迟至2023年4月19日才发布《关于控股股东股份被司法冻结的公告》《关于对深圳证券交易所关注函回复的公告》对上述事项进行公开披露。中国证监会认为，紫天科技上述行为，违反《证券法》第七十八条第一款、第八十条第一款和第二款第十二项，以及《信息披露管理办法》第二十二条第二款第八项的规定，涉嫌构成《证券法》第一百九十七条第一款所述行为，并根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，拟对紫天科技给予警告，并处以50万元罚款。

注：本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

**8.12.2 本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库之外的股票。**

### 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	436,528.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	19,225.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	455,753.88

### 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未存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
嘉合睿金混合A	913	11,250.31	2,930,012.95	28.53%	7,341,518.67	71.47%
嘉合睿金混合C	1,043	22,107.42	479,294.48	2.08%	22,578,743.79	97.92%
合计	1,956	17,039.66	3,409,307.43	10.23%	29,920,262.46	89.77%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、C级比例分母为各自级别的份额，对合计数比例的分母采用基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉合睿金混合A	18,843.74	0.18%
	嘉合睿金混合C	115,987.41	0.50%
	合计	134,831.15	0.40%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资	嘉合睿金混合A	0~10

和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉合睿金混合C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉合睿金混合A	0~10
	嘉合睿金混合C	0
	合计	0~10

注：1、本基金本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金A份额总量在0~10万份(含)之间，持有本基金C份额总量在10~50万份(含)之间。

2、本基金本报告期末，本基金的基金经理持有本基金A份额总量在0~10万份(含)之间。

#### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	10,447,761.18	31.35%	自基金合同生效之日起不少于3年
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	0.00	0.00%	10,447,761.18	31.35%	-

#### §10 开放式基金份额变动

单位：份

	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C
基金合同生效日(2019年03月13日)基金份额总额	10,452,941.18	508,336.72
本报告期期初基金份额总额	17,501,633.59	24,051,490.00

本报告期基金总申购份额	4,237,398.34	10,950,605.99
减：本报告期基金总赎回份额	11,467,500.31	11,944,057.72
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,271,531.62	23,058,038.27

注：总申购份额含转换入份额，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

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人发生以下重大人事变动：

1、自2023年3月6日起，金川先生代任公司董事长职务，周健男先生不再担任公司董事长职务；

2、自2023年9月4日起，金川先生担任公司董事长职务；

3、自2023年9月4日起，魏超先生担任公司总经理职务，金川先生不再担任公司总经理职务。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

自2023年10月23日起，郭德维先生任渤海银行股份有限公司托管业务部总经理。

### 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，无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内无对基金托管业务产生重大影响的重大诉讼和仲裁事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生重大变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内应支付给会计师事务所的审计费用为人民币30000元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及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

本报告期内托管人高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华西证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	1,811,073,331.20	100.00%	1,433,642.80	100.00%	-

注：1、本基金本报告期无新增券商交易单元。

2、本基金的基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易席位供旗下基金买卖证券专用，本着安全、高效、低成本，能够为基金提供高质量增值研究服务的原则，对证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

#### 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权证成交总	成交金额	占当期基金成交总

		额的比例		交总额的 比例		额的比例		额的比例
华西证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	254,082,000.0 0	100.00%	-	-	-	-

### 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	嘉合基金管理有限公司旗下部分基金2022年第四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》、基金管理人网站	2023-01-20
2	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金2022年第四季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-20
3	嘉合基金管理有限公司关于高级管理人员（董事长）变更的公告	《证券日报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-07
4	嘉合基金管理有限公司旗下部分基金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》、基金管理人网站	2023-03-31
5	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金2022年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
6	嘉合基金管理有限公司旗下基金2023年第一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》、基金管理人网站	2023-04-24
7	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金2023年第一季度报	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-24



	告		
8	嘉合基金管理有限公司关于终止旗下基金在江西正融基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-25
9	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	《证券日报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-08
10	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-11
11	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-11
12	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新)(2023年第1号)	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-11
13	嘉合基金管理有限公司旗下部分基金2023年第二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》、基金管理人网站	2023-07-21
14	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金2023年第2季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-21
15	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-29
16	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-29
17	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新)(2023年第2号)	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-29

18	嘉合基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子以退费名义诈骗的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-29
19	嘉合基金管理有限公司旗下部分基金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》、基金管理人网站	2023-08-31
20	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金2023年中期报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-31
21	嘉合基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-09-05
22	嘉合基金管理有限公司关于终止旗下基金在凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-09-12
23	嘉合基金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》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-10-25
24	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金2023年第3季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	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

投资	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	持有基金份额比	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

者类别	号	例达到或者超过20%的时间区间					
个人	1	20230101 - 20231231	16,488,784.93	0.00	0.00	16,488,784.93	49.47%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 一、中国证监会准予嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 二、《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 三、《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 四、中国证监会准予嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金变更注册的文件
- 五、《嘉合睿金混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 六、《嘉合睿金混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 七、相关法律意见书
- 八、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 九、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 十、中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得文件复印件。投资者也可以直接登录基金管理人的网站（[www.haoamc.com](http://www.haoamc.com)）进行查阅。

嘉合基金管理有限公司  
二〇二四年三月二十九日