

东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基  
金中基金（FOF）  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：上海东方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

送出日期：2024 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商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、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 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>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
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	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
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>58</b>
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59

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	60
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	61
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	63
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	63
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	63
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	63
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	63
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
8.12	本报告期投资基金情况	63
8.13	投资组合报告附注	71
<b>§ 9</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>71</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
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	72
9.4	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产 品情况	72
<b>§ 10</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>72</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>72</b>
11.1	基金份额持有人大会决议	72
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	72
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4	基金投资策略的改变	72
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	73
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	73
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.9	其他重大事件	79
<b>§ 12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>81</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	81
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	81
<b>§ 13</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>81</b>
13.1	备查文件目录	81
13.2	存放地点	81
13.3	查阅方式	82

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）
基金简称	东方红欣和平衡两年混合（FOF）
基金主代码	011587
基金运作方式	契约型开放式，但本基金对每份基金份额设置两年锁定持有期（红利再投除外）
基金合同生效日	2021 年 3 月 9 日
基金管理人	上海东方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	2,499,103,748.56 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以平衡的投资风格进行长期资产配置，通过构建与收益风险水平相匹配的基金组合，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金是一只平衡风险策略基金。在设定的投资范围及风险目标下，通过定量和定性的结合分析实现基金的资产配置。同时，根据宏观经济、资本市场的动量因素和事件驱动做出资产动态调整决策。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×35%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×10%+中国债券总指数收益率×55%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金中基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金及债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。 本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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		上海东方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	周陶	张姗
	联系电话	021-53950806	400-61-95555
	电子邮箱	service@dfham.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4009200808	400-61-95555
传真		021-63326381	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层-11 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码	200010	518040
法定代表人	杨斌	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	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
注册登记机构	上海东方证券资产管理有限公司	上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-69,141,930.59	3,428,468.53	60,521,118.21
本期利润	-37,892,263.51	-344,326,409.16	31,015,558.49
加权平均基金份额本期利润	-0.0123	-0.0859	0.0077
本期加权平均净值利润率	-1.31%	-9.13%	0.77%
本期基金份额净值增长率	-3.10%	-8.52%	0.77%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-266,953,842.25	-313,404,452.33	31,015,558.49
期末可供分配基金份额利润	-0.1068	-0.0782	0.0077
期末基金资产净值	2,232,149,906.31	3,693,985,072.74	4,037,304,387.15

期末基金份额净值	0.8932	0.9218	1.0077
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-10.68%	-7.82%	0.77%

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	-3.12%	0.50%	-2.54%	0.38%	-0.58%	0.12%
过去六个月	-5.66%	0.49%	-4.46%	0.39%	-1.20%	0.10%
过去一年	-3.10%	0.47%	-4.23%	0.39%	1.13%	0.08%
自基金合同生效起至今	-10.68%	0.47%	-13.19%	0.49%	2.51%	-0.02%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×35%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×10%+中国债券总指数收益率×55%

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，t 日收益率（benchmark<sub>t</sub>）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 35\% \times [\text{t 日沪深 300 指数} / (\text{t-1 日沪深 300 指数}) - 1] + 10\% \times [\text{t 日恒生指数 (经汇率估值调整)} / (\text{t-1 日恒生指数 (经汇率估值调整)}) - 1] + 55\% \times [\text{t 日中国债券总指数} / (\text{t-1 日中国债券总指数}) - 1];$$

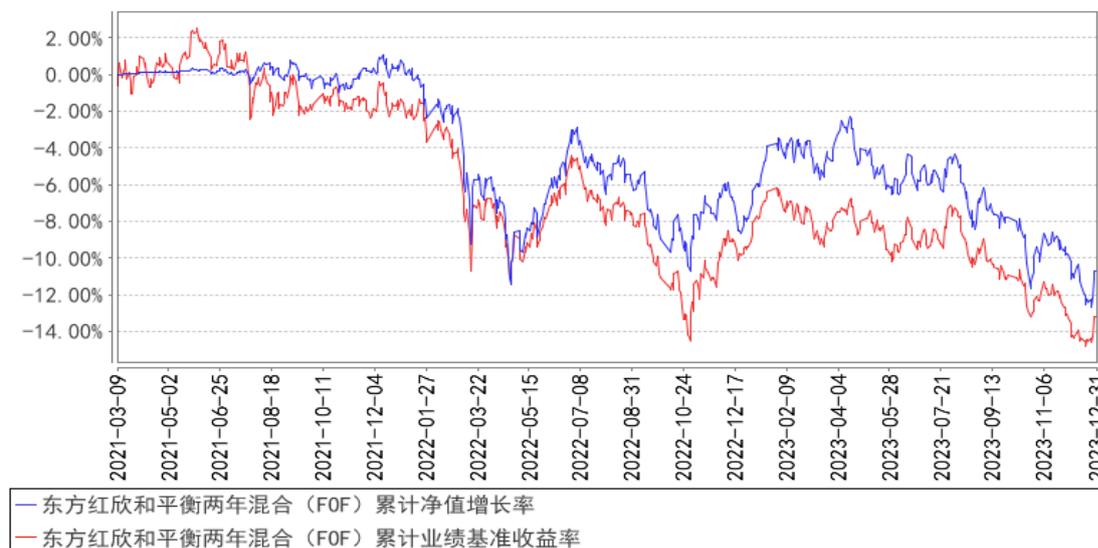
期间 T 日收益率（benchmark<sub>T</sub>）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod (1 + \text{benchmark}_t)] - 1, \text{ 其中 } t=1, 2, 3, \dots, T, T \text{ 表示时间截至日};$$

$\prod (1 + \text{benchmark}_t)$  表示  $(1 + \text{benchmark}_t)$  的数学连乘。

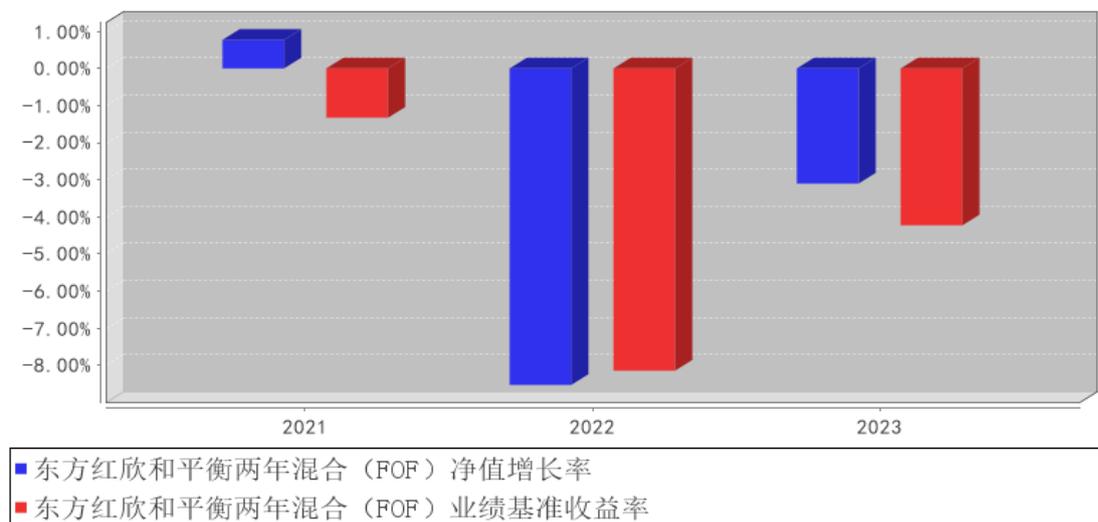
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方红欣和平衡两年混合（FOF）累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 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

东方红欣和平衡两年混合（FOF）基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日期为 2021 年 03 月 09 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，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自基金合同生效以来未进行利润分配。

## § 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

本基金管理人上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金、东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红启元三年持有期混合型证券投资基金、东方红聚利债券型证券投资基金、东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫裕两年定期开放信用债债券型证券投资基金、东

方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红恒阳五年定期开放混合型证券投资基金、东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红启东三年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和积极养老目标五年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红益丰纯债债券型证券投资基金、东方红智远三年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红明鉴优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红鑫安 39 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红招盈甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红启航三年持有期混合型证券投资基金、东方红多元策略混合型证券投资基金、东方红锦丰优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红远见价值混合型证券投资基金、东方红启瑞三年持有期混合型证券投资基金、东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红启阳三年持有期混合型证券投资基金、东方红创新趋势混合型证券投资基金、东方红启华三年持有期混合型证券投资基金、东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金、东方红启盛三年持有期混合型证券投资基金、东方红启程三年持有期混合型证券投资基金、东方红新海混合型证券投资基金、东方红新源三年持有期混合型证券投资基金、东方红内需增长混合型证券投资基金、东方红安盈甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红锦和甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红智华三年持有期混合型证券投资基金、东方红启兴三年持有期混合型证券投资基金、东方红智选三年持有期混合型证券投资基金、东方红睿和三年定期开放混合型证券投资基金、东方红中证东方红红利低波动指数证券投资基金、东方红锦弘甄选两年持有期混合型证券投资基金、东方红 ESG 可持续投资混合型证券投资基金、东方红锦融甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红医疗升级股票型发起式证券投资基金、东方红招瑞甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红短债债券型证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红民享甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、东方红中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、东方红锦惠甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红共赢甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红先进制造混合型证券投资基金、东方红颐安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红 30 天滚动持有纯债债券型证券投资基金、东方红欣和积极配置 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红 6 个月持有期债券型证券投资基金、东方红中证东方红优势成长指数发起式证券投资基金、东方红远见领航混合型发起式证券投资基金、东方红 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方红季鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金、东方红 90 天持有期纯债债券型证券投资基金、东方红中债 0-3

年政策性金融债指数证券投资基金、东方红 60 天持有期纯债债券型证券投资基金，共计 101 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		
陈文扬	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2021 年 3 月 9 日	-	14 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2020 年 06 月至今任 东方红颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理、2020 年 06 月至今任东方红颐和积极养老目标五年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理、2020 年 06 月至今任东方红颐和稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理、2021 年 03 月至今任东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理、2022 年 09 月至今任东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理、2023 年 05 月至今任东方红颐安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。上海财经大学金融学硕士。曾任上海国利货币经纪有限公司利率衍生产品部经纪人，宁波银行股份有限公司金融市场部交易员，南京银行股份有限公司金融市场部高级投资经理，上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究员、投资主办人。具备证券投资基金从业资格。
邓炯鹏	上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、基金组合投资部总经理、基金经理	2021 年 3 月 9 日	-	20 年	上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、基金组合投资部总经理、基金经理，2021 年 03 月至今任东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理，2023 年 08 月至今任东方红欣和积极配置 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。广东商学院金融学学士。曾任招商银行广州分行零售银行部产品经理、招商银行财富管理部产品经理、投资类产品研发团队主管。具备证券投资基金从业资格。

注：1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指基金合同生效日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对此后非首任基金经理，基金经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会的相关规定。

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

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

### 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，上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规关于公平交易的规定，公司建立了与公平交易相关的控制制度、流程以及信息披露程序等，保证公司在投资管理活动中公平对待各投资组合，防范不同投资组合之间进行利益输送，并定期对同向交易、反向交易和异常交易行为进行监控和分析。交易部使用恒生交易系统中的公平交易模块进行交易执行和分配，风险管理部对公司各投资组合及组合之间的交易行为进行事后分析，校验公平交易执行情况。对于同向交易，风险管理部侧重于对公司管理的不同产品（包含了公募产品、私募产品）的整体收益率差异、投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内交易所竞价交易的所有交易记录，在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）的同向交易价差按两两组合进行显著性检验，并根据显著性检验结果，对符合异常交易筛选条件并超过规定阈值的交易记录，通过逐笔检查或抽样分析的方法，分析相应交易行为的公平性。对于反向交易，原则上禁止组合间的日内反向交易，完全按照有关指数构成比例进行投资的投资组合除外。如有投资策略或流动性等特殊需要的，需由投资经理提供投资依据，经投资决策委员会审慎审批后留档备查。报告期内未发现公司管理的投资组合间存在违反公平交易原则的交易行为。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等

规定。

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

本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

### 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

本基金自 2021 年 3 月 9 日运作以来，权益市场整体表现较为疲软。在经历 2022 年的大幅调整后，2023 年年初权益市场反弹后依然继续下行，各主要资产年度表现：沪深 300 指数下跌 11.38%、恒生指数下跌 13.82%、中证 500 指数下跌 7.42%、偏股混合基金指数亦下跌 13.52%、中长期纯债基金指数上涨 3.61%。

在本基金发行期里基金经理致投资者的一封信中，曾阐述了产品的定位和基金经理的初心：“东方红欣和平衡两年混合的目标持有人以我身边的人为蓝本：他（她）们知道炒股不如买基金，也有长期的闲钱可以投资，有一定风险承受能力，知道需要配置权益基金才能提高资产整体收益率，希望能通过长期投资获得稳健收益；但是，他们同样存在投资困惑，不知道买什么资产、什么基金经理比较靠谱、什么时候该多买一些或少买一些权益资产”。本基金创设为两年持有期产品、投资于权益类资产的比例占基金资产的 30%-80%，目标是以平衡的投资风格进行资产配置，追求资产净值的稳健增值，通过拉长投资期限、行稳致远的风格力争为客户带来实实在在的回报。

根据我们对资本市场的理解和产品定位的坚持，先力求在市场高位通过避免净值“挖坑”、再在估值低位把握有胜率的机会，争取给客户创造长期价值。本基金以中性的权益资产仓位、均衡偏价值的风格进入 2023 年，延续 2022 年三季度以来的乐观态度在年初进行加仓，并选择在资产价格相对高位进行一些止盈操作。随着下半年市场逐步释放风险，本基金缓步增加持仓，年末本基金权益资产仓位维持在 67%-68%左右，底仓持仓品种风格上依然保持均衡。全年产品跌幅处于同类产品较小的水平，2022、2023 年均持有者较好地控制了回撤。

在成立以来的两年多里，通过“高位低配、低位高配”的逆向投资能力和“均衡偏价值”的风格配置能力，前十大基金持仓中主动管理权益基金依然贡献出一定的超额收益，ETF、个股等战术仓位表现良好。未来在保持投研体系持续进化的基础上，基金经理认为仍需加强多资产研究，以争取在多资产配置方面为组合贡献更多收益。

在这里，感谢持有人对我们的信任。同时在未来的日子，我们会根据大类配置的观点和产品的适配性，进行一定的调仓，争取更好地为客户创造收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 0.8932 元，份额累计净值为 0.8932 元。本报告期基金份额净值增长率为-3.10%，同期业绩比较基准收益率为-4.23%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在沪深 300 指数连续三年调整后，叠加 2024 年春节前后市场的 V 型走势，我们认为应对 2024 年的市场表现需保持一定的乐观态度。当下的含权类基金产品发行清淡——可见“卖在人声鼎沸时，买在无人问津处”，实属知易行难。作为实战派的 FOF 基金经理，我们用实事求是的态度，去寻找底层坚硬的逻辑，以指导我们的投资。我们认为：（1）2 月份 LPR（五年期以上）下调 25BP，预示市场利率可能继续下降，这受资金的供需关系所决定。沉淀在无风险资产的庞大资金，会有一些边际变化、慢慢去承担一些波动以争取更高的收益回报；（2）对资产来说，下跌是风险的释放——越跌，潜在回报空间更大——前提是找到好的资产；（3）优质企业，代表的是经济中胜出的团队和组织，蕴含了实实在在、改善人类生活的商品和服务供应，是稀缺、有价值的。

经过三年的实战，我们坚定信心，继续在“变与不变”的方向寻找盈利机会。一方面，我们从稳定回报的维度，可以把股票看作是“期限、票息不固定”的债券。在过去的投资实践中，我们通过投资部分具有“较高分红、低估值、业务具有稳定性”的上市公司，收获了比债券利率更高的分红和一定的资本利得，此类风格的权益基金经理也为我们带来正回报。展望未来，考虑到市场对稳定回报资产的需求，这个思路依然具有可行性。另一方面，我们更要迭代投资框架，从未来成长的角度（科技创新、市场拓展、行业格局改善、人口变化等方向）去寻找价值投资机会。

我们用“核心（长期持有获得收益）+卫星（寻找战术机会获得波段收益）”策略，争取从风险资产仓位、资产配置、个基选择、战术交易等多维度为客户争取收益。当合适的权益资产出现合适的价格时，本基金将进一步加大权益资产配置力度，承担净值的波动而争取为客户带来长期良好收益。

FOF 投资上双重分工的特点，可以让基金经理更好的基于自上而下的思考来进行资产配置，让标的基金的基金经理挖掘个股阿尔法。我们将继续致力于通过发挥 FOF“多元资产、多元策略、多元管理人”的优势为客户创造良好的财富管理体验。

本基金在过去三年的市场波动中相对较好地控制了回撤，为未来市场机会的把握做好了准备。希望认可我们风格的客户继续长期合作，亦真诚希望需要退出的客户后续再投资顺利。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司日常监察稽核工作主要由合规稽核部和风险管理部根据职责分工开展，2023 年开展了如下主要工作：

在合规管理履职方面：（1）切实履行日常合规管理职责，包括合规审查、合规宣导、合规培训、合规报告、合规咨询、合规检查/稽核、监管沟通与配合；（2）强化落实员工执业行为管理，包括加强员工投资申报督导工作，对新任投资人员进行上岗前合规谈话，进一步完善即时通讯工具管控，进一步加强合规监测工作；（3）切实履行反洗钱管理职责；（4）稳步跟进各类法律事务；（5）深入开展合规专题研究。

在风险管理履职方面：（1）切实履行日常风险管理职责，做到事前、事中、事后风险管理，按时完成内外部各类定期风控报告及数据报送，并对公司风控指标进行持续监测；（2）结合监管要求和市场环境变化，继续加强投资内控体系建设；（3）持之以恒加强风控系统建设，保障产品及业务稳定运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

本基金管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性，对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。为了保障基金能真实、准确地反映投资品种的公允价值，本基金管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系，估值委员会成员的任命和调整由总经理办公会审议决定。运营部是估值委员会的日常办事机构。本基金管理人估值委员和估值人员均具有专业胜任能力和相关工作经验。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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	德师报(审)字(24)第 P00958 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	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金(FOF)全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金(FOF)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(基金净值)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企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金(FOF)2023 年 12 月 31 日的财务状况、2023 年度的经营成果和基金净值变动情况。
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

	<p>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,我们独立于东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金(FOF),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>上海东方证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金(FOF)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。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>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,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而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金(FOF)的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金(FOF)、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金(FOF)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,</p>

	<p>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) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金(FOF)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东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金(FOF)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>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	史曼   何淑婷
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼
审计报告日期	2024 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）

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	67,047,587.47	111,562,248.34
结算备付金		2,273,852.24	4,307,397.58
存出保证金		46,009.81	92,093.72
交易性金融资产	7.4.7.2	2,160,658,477.39	3,504,959,865.75
其中：股票投资		295,656,242.45	418,895,921.30
基金投资		1,809,829,903.98	2,984,042,656.78
债券投资		55,172,330.96	102,021,287.67
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-1,441.65	69,977,234.25
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		20,091,270.88	7,045,531.51
应收股利		232,977.61	1,008,524.83
应收申购款		701.58	8,132.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	6,801.71	49,464.94
资产总计		2,250,356,237.04	3,699,010,493.31
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	1,886,830.40
应付赎回款		16,593,962.85	-
应付管理人报酬		1,269,265.68	2,399,288.58
应付托管费		276,671.63	480,864.46
应付销售服务费		-	-
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	7.4.7.9	66,430.57	258,437.13
负债合计		18,206,330.73	5,025,420.57
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	2,499,103,748.56	4,007,389,525.07
未分配利润	7.4.7.12	-266,953,842.25	-313,404,452.33
净资产合计		2,232,149,906.31	3,693,985,072.74
负债和净资产总计		2,250,356,237.04	3,699,010,493.31

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8932 元，基金份额总额 2,499,103,748.56 份。

## 7.2 利润表

会计主体：东方红欣和平衡配置两年持有期混合型证券投资基金中基金（FOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-12,503,804.47	-310,062,976.25
1. 利息收入		479,647.37	882,904.99
其中：存款利息收入	7.4.7.13	356,636.73	433,851.67
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		123,010.64	449,053.32
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-44,318,191.09	36,701,300.76
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-20,817,582.56	-13,990.49
基金投资收益	7.4.7.15	-62,340,591.20	-16,170,422.37
债券投资收益	7.4.7.16	1,931,513.51	3,822,455.19
资产支持证券投资	7.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.18	-	-
衍生工具收益	7.4.7.19	-	-
股利收益	7.4.7.20	36,908,469.16	49,063,258.43
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	31,249,667.08	-347,754,877.69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.22	85,072.17	107,695.69
<b>减：二、营业总支出</b>		25,388,459.04	34,263,432.91
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	20,772,791.24	28,097,941.75
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,338,540.17	5,895,159.96
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	14,400.00

其中：卖出回购金融资产支出		-	14,400.00
6. 信用减值损失	7.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		25,698.83	-
8. 其他费用	7.4.7.25	251,428.80	255,931.20
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-37,892,263.51	-344,326,409.16
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-37,892,263.51	-344,326,409.16
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-37,892,263.51	-344,326,409.16

### 7.3 净资产变动表

会计主体：东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,007,389,525.07	-313,404,452.33	3,693,985,072.74
二、本期期初净资产	4,007,389,525.07	-313,404,452.33	3,693,985,072.74
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-1,508,285,776.51	46,450,610.08	-1,461,835,166.43
（一）、综合收益总额	-	-37,892,263.51	-37,892,263.51
（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）	-1,508,285,776.51	84,342,873.59	-1,423,942,902.92
其中：1. 基金申购款	7,458,725.14	-406,287.57	7,052,437.57
2. 基金赎回款	-1,515,744,501.65	84,749,161.16	-1,430,995,340.49
（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	2,499,103,748.56	-266,953,842.25	2,232,149,906.31

项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,006,288,828.66	31,015,558.49	4,037,304,387.15
二、本期期初净资产	4,006,288,828.66	31,015,558.49	4,037,304,387.15
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	1,100,696.41	-344,420,010.82	-343,319,314.41
(一)、综合收益总额	-	-344,326,409.16	-344,326,409.16
(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)	1,100,696.41	-93,601.66	1,007,094.75
其中:1. 基金申购款	1,100,696.41	-93,601.66	1,007,094.75
2. 基金赎回款	-	-	-
(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	4,007,389,525.07	-313,404,452.33	3,693,985,072.74

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：

张锋

汤琳

陈培

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

东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金(FOF)(以下简称“本基金”)系由基金管理人上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2021]328号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为

4,006,288,828.66 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(21)第 00117 号验资报告。基金合同于 2021 年 3 月 9 日正式生效。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金(FOF)招募说明书》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,包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金(含公开募集基础设施证券投资基金、QDII 基金、商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)和香港互认基金,下同),国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行的国家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债的纯债部分、可交换债、证券公司短期公司债券)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券以及经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:投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的比例不低于基金资产的 80%,其中,投资于股票、股票型基金、混合型基金等权益类资产的比例合计占基金资产的 30%-80%。计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一:1、基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产 60%的混合型基金;2、根据基金披露的定期报告,最近四个季度股票资产占基金资产的比例均不低于 60%的混合型基金。本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%。本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果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 $\times$ 35%+恒生指数收益率(经汇率估值调整) $\times$ 10%+中国债券总指数收益率 $\times$ 55%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表的编制符合企业会计准则以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况、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

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

根据本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，本基金将所持有的金融资产在初始确认时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以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分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。

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，且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，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件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。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

##### (2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 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。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期

损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，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的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1)对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，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)当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3)经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应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，确定公允价值。

#### 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，且目前可执行该种法定权利，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基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占净资产的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### （1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### （2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的金额确认，逐日确认债券利息并计入投资收益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息并计入投资收益。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息并记入投资收益。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息（若有）后的差额，确认资产支持证券投资收益。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

股利收入于除权（息）日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代

缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

#### (3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### (4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

### 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在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率在回购期内逐日计提。

### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 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 个月则可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金分红或将现金分红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；选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的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；

(4) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

### 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。

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

#### 7.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和基金投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引(试行)〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》的规定在估值日对非上市基金和上市基金进行估值。

(2)对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《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》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(3)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，根据《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》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(4)根据中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、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》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金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。

(2) 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，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	67,047,587.47	111,562,248.34
等于：本金	67,039,392.51	111,546,076.91
加：应计利息	8,194.96	16,171.43
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	67,047,587.47	111,562,248.34

##### 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	323,266,208.70	-	295,656,242.45	-27,609,966.25	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	54,564,219.00	766,890.96	55,172,330.96	-158,779.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	54,564,219.00	766,890.96	55,172,330.96	-158,779.00
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	2,128,071,929.06	-	1,809,829,903.98	-
其他	-	-	-	-
合计	2,505,902,356.76	766,890.96	2,160,658,477.39	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	524,994,266.65	-	418,895,921.30	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	100,044,000.00	2,021,287.67	102,021,287.67
	合计	100,044,000.00	2,021,287.67	102,021,287.67
资产支持证券	-	-	-	-
基金	3,255,160,748.84	-	2,984,042,656.78	-
其他	-	-	-	-
合计	3,880,199,015.49	2,021,287.67	3,504,959,865.75	-
				377,260,437.41

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-1,441.65	-
银行间市场	-	-
合计	-1,441.65	-
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	69,977,234.25	-
银行间市场	-	-
合计	69,977,234.25	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

#### 7.4.7.8 其他资产

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
应收利息	-	-
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
应收销售服务费返还	6,801.71	49,464.94
合计	6,801.71	49,464.94

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	6,430.57	68,437.13
其中：交易所市场	6,430.57	68,437.13
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	60,000.00	190,000.00
合计	66,430.57	258,437.13

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,007,389,525.07	4,007,389,525.07
本期申购	7,458,725.14	7,458,725.14
本期赎回（以“-”号填列）	-1,515,744,501.65	-1,515,744,501.65
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,499,103,748.56	2,499,103,748.56

注：申购含红利再投、转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	63,971,943.67	-377,376,396.00	-313,404,452.33
本期期初	63,971,943.67	-377,376,396.00	-313,404,452.33
本期利润	-69,141,930.59	31,249,667.08	-37,892,263.51
本期基金份额交易产生的变动数	-8,094,079.31	92,436,952.90	84,342,873.59
其中：基金申购款	27,886.27	-434,173.84	-406,287.57
基金赎回款	-8,121,965.58	92,871,126.74	84,749,161.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,264,066.23	-253,689,776.02	-266,953,842.25

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	330,638.44	380,249.60
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	24,081.54	51,706.33
其他	1,916.75	1,895.74
合计	356,636.73	433,851.67

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	-20,817,582.56	-13,990.49
股票投资收益——赎回 差价收入	-	-
股票投资收益——申购 差价收入	-	-
股票投资收益——证券 出借差价收入	-	-
合计	-20,817,582.56	-13,990.49

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
卖出股票成交总额	249,389,217.94	179,463,478.84
减：卖出股票成本 总额	269,686,335.74	178,769,855.60
减：交易费用	520,464.76	707,613.73
买卖股票差价收 入	-20,817,582.56	-13,990.49

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-证券出借差价收入。

#### 7.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
卖出/赎回基金成交总额	1,698,697,101.84	2,031,183,497.21
减：卖出/赎回基金成本总额	1,760,283,060.08	2,046,477,686.42
减：买卖基金差价收入应缴 纳增值税额	214,157.17	-
减：交易费用	540,475.79	876,233.16

基金投资收益	-62,340,591.20	-16,170,422.37
--------	----------------	----------------

#### 7.4.7.16 债券投资收益

##### 7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
债券投资收益——利息收入	2,207,788.51	3,699,238.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-276,275.00	123,216.25
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	1,931,513.51	3,822,455.19

##### 7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	359,253,180.00	312,381,684.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	352,976,275.00	304,741,242.10
减：应计利息总额	6,553,180.00	7,516,419.95
减：交易费用	-	806.40
买卖债券差价收入	-276,275.00	123,216.25

##### 7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-赎回差价收入。

##### 7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

#### 7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

#### 7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.18 贵金属投资收益

##### 7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-赎回差价收入。

##### 7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.19 衍生工具收益

##### 7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-其他投资收益。

#### 7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股票投资产生的股利收益	10,396,572.83	14,013,913.00
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	26,511,896.33	35,049,345.43
合计	36,908,469.16	49,063,258.43

#### 7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	31,249,667.08	-347,754,877.69
股票投资	78,488,379.10	-48,633,044.85
债券投资	-114,779.00	-98,224.80
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-47,123,933.02	-299,023,608.04
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	31,249,667.08	-347,754,877.69

#### 7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
销售服务费返还	85,072.17	107,695.69
合计	85,072.17	107,695.69

#### 7.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	384,868.69	729,286.61
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	20,181,926.24	26,539,091.28
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	3,704,992.50	4,993,709.57

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

#### 7.4.7.24 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
证券组合费	8,757.22	7,318.37
银行费用	25,471.58	21,412.83
账户维护费	37,200.00	37,200.00
合计	251,428.80	255,931.20

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	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 (%)
东方证券	213,937,608.36	70.67	307,031,161.76	83.68

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
东方证券	59,800,000.00	19.45	105,258,126.80	100.00

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	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（%）
东方证券	576,000,000.00	75.79	1,342,000,000.00	26.91

#### 7.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）
东方证券	420,494,572.81	35.88	934,691,733.86	53.12

#### 7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.6 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1月1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（%）
东方证券	159,290.94	71.29	3,959.47	61.57
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）

东方证券	230,051.24	84.19	50,461.14	73.73
------	------------	-------	-----------	-------

注：1. 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的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,772,791.24	28,097,941.75
其中：应支付销售机构的客户维护费	12,576,485.28	16,570,739.39
应支付基金管理人的净管理费	8,196,305.96	11,527,202.36

注：(1) 本基金投资于本基金管理人所管理的公开募集证券投资基金的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金管理人管理的公开募集证券投资基金的基金份额的资产净值后的余额(若为负数，则取0)的1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值扣除所持有本基金管理人管理的基金份额部分基金资产后的余额(若为负数，则取0)×1.00%÷当年天数。

(2) 实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,338,540.17	5,895,159.96

注：支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金托管人托管的基金份额部分基金资产后的余额(若为负数，则取0)×0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值扣除所持有本基金托管人托管的基金份额部分基金资产后的余额(若为负数，则取0)×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

注：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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金合同生效日（2021年3月9日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,003,950.00	10,003,950.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,003,950.00	10,003,950.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.4003%	0.2496%

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	67,047,587.47	330,638.44	111,562,248.34	380,249.60

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。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有基金管理人东证资管所管理的公开募集证券投资基金合计 758,634,271.68 元(2022 年 12 月 31 日:892,322,001.12 元)，占本基金资产净值的比例为 33.99% (2022 年 12 月 31 日: 24.16%)。

##### 7.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	32,775.10	129,672.00
当期持有基金产生的应支付销售 服务费（元）	85,066.15	107,679.41
当期持有基金产生的应支付管理 费（元）	6,640,235.25	7,152,921.35
当期持有基金产生的应支付托管 费（元）	1,325,628.02	1,485,876.88
当期持有基金产生的应支付交易 费用（元）	-	97.71

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金（ETF 除外），应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费（按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外）、销售服务等销售费用。交易本基金管理人管理的基金产生的申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的该类申购费为零，当期交易基金产生的该类赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。交易本基金管理人管理的基金产生的销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还。当期持有基金产生的应支付管理费、应支付托管费、应支付销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股锁定	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001326	联域股份	2023年11月1日	6个月	新股锁定	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股锁定	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股锁定	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股锁定	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股锁定	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301272	英华特	2023年7月6日	6个月	新股锁定	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新股锁定	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301348	蓝箭电子	2023年8月1日	6个月	新股锁定	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301362	民爆光	2023年7月27日	6个月	新股锁定	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-

	电	日									
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股锁定	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-	
301372	科净源	2023年8月3日	6个月	新股锁定	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-	
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股锁定	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-	
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-	
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股锁定	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-	
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股锁定	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-	
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股锁定	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-	
301469	恒达新材	2023年8月10日	6个月	新股锁定	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-	
301488	豪恩光电	2023年6月26日	6个月	新股锁定	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-	
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股锁定	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-	
301499	维科精	2023年7月13日	6个月	新股锁定	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-	

	密	日									
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股锁定	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-	
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股锁定	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-	
301509	金凯生科	2023年7月26日	6个月	新股锁定	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-	
301511	德福科技	2023年8月8日	6个月	新股锁定	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-	
301515	港通医疗	2023年7月13日	6个月	新股锁定	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-	
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股锁定	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-	
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股锁定	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-	
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股锁定	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-	
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股锁定	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-	
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股锁定	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-	
301526	国际复	2023年12月19日	6个月	新股锁定	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-	

	材	日								
301528	多浦乐	2023年8月17日	6个月	新股锁定	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股锁定	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	新股锁定	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	新股锁定	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股锁定	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股锁定	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股锁定	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股锁定	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-

注：1、根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的非公开发行股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

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

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上

市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：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

注：本基金本报告期末无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

本基金本报告期末无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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 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相应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。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责对合规管理和风险管理的总体目标、基本政策进行审议并提出意见；对合规管理和风险管理的机构设置及其职责进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见；对需董事会审议的合规报告和风险评估报告进行审议并提出意见等。在经营层面设立风险控制委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；根据董事会制定的风险管理原则制订相关风险控制政策，使公司整体业务发展战略与风险承受能力保持相当；督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；

督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，指导实施风险应对方案；审议公司投资授权有关的风险控制方案等。

#### 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，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	55,172,330.96	102,021,287.67
合计	55,172,330.96	102,021,287.67

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额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》且于基金开放日内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过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。

本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不持有其他基金中基金。本基金的基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金(ETF 联接基金除外)不超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金投资于一家公司发行的证券(不含本基金所投资的基金份额)市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券(不含本基金所投资的基金份额)不得超过该证券的 10%。于开放日内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在基金销售机构申购、赎回，部分基金资

产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。在本基金开放日，本基金投资于流通受限基金不高于本基金资产净值的 10%；本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

于开放日内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2023 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 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	67,047,587.47	-	-	-	-	-	67,047,587.47

结算备付金	2,273,852.24	-	-	-	-	-	2,273,852.24
存出保证金	46,009.81	-	-	-	-	-	46,009.81
交易性金融资产	-	-55,172,330.96	-	-	-2,105,486,146.43	-	2,160,658,477.39
买入返售金融资产	-1,441.65	-	-	-	-	-	-1,441.65
应收股利	-	-	-	-	232,977.61	-	232,977.61
应收申购款	-	-	-	-	701.58	-	701.58
应收清算款	-	-	-	-	20,091,270.88	-	20,091,270.88
其他资产	-	-	-	-	6,801.71	-	6,801.71
资产总计	69,366,007.87	-55,172,330.96	-	-	-2,125,817,898.21	-	2,250,356,237.04
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	16,593,962.85	-	16,593,962.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,269,265.68	-	1,269,265.68
应付托管费	-	-	-	-	276,671.63	-	276,671.63
其他负债	-	-	-	-	66,430.57	-	66,430.57
负债总计	-	-	-	-	18,206,330.73	-	18,206,330.73
利率敏感度缺口	69,366,007.87	-55,172,330.96	-	-	-2,107,611,567.48	-	2,232,149,906.31
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	111,562,248.34	-	-	-	-	-	111,562,248.34
结算备付金	4,307,397.58	-	-	-	-	-	4,307,397.58
存出保证金	92,093.72	-	-	-	-	-	92,093.72
交易性金融资产	102,021,287.67	-	-	-	-3,402,938,578.08	-	3,504,959,865.75
买入返售金融资产	69,977,234.25	-	-	-	-	-	69,977,234.25
应收股利	-	-	-	-	1,008,524.83	-	1,008,524.83
应收申购款	-	-	-	-	8,132.39	-	8,132.39
应收清算款	-	-	-	-	7,045,531.51	-	7,045,531.51
其他资产	-	-	-	-	49,464.94	-	49,464.94
资产总计	287,960,261.56	-	-	-	-3,411,050,231.75	-	3,699,010,493.31
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,399,288.58	-	2,399,288.58
应付托管费	-	-	-	-	480,864.46	-	480,864.46
应付清算款	-	-	-	-	1,886,830.40	-	1,886,830.40
其他负债	-	-	-	-	258,437.13	-	258,437.13
负债总计	-	-	-	-	5,025,420.57	-	5,025,420.57
利率敏感度	287,960,261.56	-	-	-	-3,406,024,811.18	-	3,693,985,072.74

缺口							
----	--	--	--	--	--	--	--

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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）
	1. 市场利率下降25个基点	43,485.40	9,079.12
2. 市场利率上升25个基点	-43,416.96	-9,077.51	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	93,912,990.00	-	93,912,990.00
资产合计	-	93,912,990.00	-	93,912,990.00
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	93,912,990.00	-	93,912,990.00
项目	上年度末			

	2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	117,010,280.00	-	117,010,280.00
资产合计	-	117,010,280.00	-	117,010,280.00
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	117,010,280.00	-	117,010,280.00

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外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）
	1、港币相对人民币 升值 5%	4,695,649.50	5,850,514.00
	2、港币相对人民币 贬值 5%	-4,695,649.50	-5,850,514.00

#### 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或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，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其他价格风险管理。

##### 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	295,656,242.45	13.25	418,895,921.30	11.34
交易性金融资产—基金投资	1,809,829,903.98	81.08	2,984,042,656.78	80.78
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	2,105,486,146.43	94.33	3,402,938,578.08	92.12

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	65,220,096.19	88,102,874.97
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-65,220,096.19	-88,102,874.97

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，股票市场指数（沪深 300）价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

#### 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	2,104,983,811.00	3,400,936,967.41
第二层次	55,172,330.96	102,021,287.67
第三层次	502,335.43	2,001,610.67
合计	2,160,658,477.39	3,504,959,865.75

### 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、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

#### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2,001,610.67	2,001,610.67
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,257,381.48	1,257,381.48
转出第三层次	-	3,133,235.22	3,133,235.22
当期利得或损失总额	-	376,578.50	376,578.50
其中：计入损益的利得或损失	-	376,578.50	376,578.50
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

期末余额	-	502,335.43	502,335.43
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	-	41,032.89	41,032.89
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	3,052,181.94	3,052,181.94
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	3,824,190.16	3,824,190.16
转出第三层次	-	4,727,156.27	4,727,156.27
当期利得或损失总额	-	-147,605.16	-147,605.16
其中：计入损益的利得或损失	-	-147,605.16	-147,605.16
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,001,610.67	2,001,610.67
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	-	-250,761.69	-250,761.69

注：于2023年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2023年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	502,335.43	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.1969-2.1752	负相关
项目	上年度末公允	采用的估	不可观察输入值		

	价值	值技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	2,001,610.67	平均价格 亚式期权 模型	股票在剩余限售 期内的股价的预 期年化波动率	0.1891- 2.4756	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

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 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，其公允价值和账面价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	295,656,242.45	13.14
	其中：股票	295,656,242.45	13.14
2	基金投资	1,809,829,903.98	80.42
3	固定收益投资	55,172,330.96	2.45
	其中：债券	55,172,330.96	2.45
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-1,441.65	-0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	69,321,439.71	3.08
8	其他各项资产	20,377,761.59	0.91
9	合计	2,250,356,237.04	100.00

注：1、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 93,912,990.00 元人民币，占期末基金资产净值比例 4.21%。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	16,181,721.00	0.72
C	制造业	123,780,371.70	5.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,920,856.00	0.71
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	45,823,670.00	2.05
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	26,564.46	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	10,069.29	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	201,743,252.45	9.04

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	7,068,000.00	0.32
15 原材料	-	-
20 工业	19,295,400.00	0.86
25 可选消费	-	-
30 主要消费	-	-
35 医药卫生	-	-
40 金融	26,063,910.00	1.17
45 信息技术	-	-
50 通信服务	41,485,680.00	1.86
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	93,912,990.00	4.21

注：以上分类采用中证行业分类标准。

### 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	002595	豪迈科技	1,868,745	55,632,538.65	2.49
2	002221	东华能源	4,448,900	45,823,670.00	2.05
3	00941	中国移动	706,500	41,485,680.00	1.86
4	002841	视源股份	894,642	40,938,817.92	1.83
5	00998	中信银行	7,827,000	26,063,910.00	1.17
6	600028	中国石化	2,899,950	16,181,721.00	0.72
7	000591	太阳能	2,853,200	15,920,856.00	0.71
8	600060	海信视像	598,600	12,510,740.00	0.56
9	01186	中国铁建	2,605,000	10,941,000.00	0.49
10	03969	中国通号	3,540,000	8,354,400.00	0.37
11	00883	中国海洋石油	600,000	7,068,000.00	0.32
12	600019	宝钢股份	784,800	4,653,864.00	0.21
13	688425	铁建重工	619,697	2,460,197.09	0.11
14	002078	太阳纸业	195,097	2,374,330.49	0.11
15	688798	艾为电子	31,029	2,141,931.87	0.10
16	600764	中国海防	75,000	1,871,250.00	0.08
17	600875	东方电气	50,000	731,000.00	0.03
18	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
19	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
20	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
21	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
22	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
23	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
24	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
25	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
26	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
27	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
28	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
29	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
30	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
31	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
32	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
33	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
34	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
35	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
36	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
37	301372	科净源	231	10,069.29	0.00

38	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
39	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
40	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
41	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
42	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
43	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
44	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
45	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
46	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
47	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
48	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
49	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
50	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
51	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
52	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
53	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
54	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
55	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
56	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
57	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600028	中国石化	21,676,690.50	0.59
2	000591	太阳能	14,905,414.00	0.40
3	00883	中国海洋石油	7,743,532.41	0.21
4	688425	铁建重工	3,150,969.00	0.09
5	002595	豪迈科技	2,026,561.00	0.05
6	600764	中国海防	1,972,748.00	0.05
7	688249	晶合集成	1,470,454.26	0.04
8	688343	云天励飞	1,096,287.12	0.03
9	600875	东方电气	812,000.00	0.02
10	688469	芯联集成	785,185.86	0.02
11	002281	光迅科技	718,500.00	0.02
12	301358	湖南裕能	480,772.02	0.01
13	688484	南芯科技	402,739.29	0.01
14	688146	中船特气	365,151.15	0.01
15	00998	中信银行	326,975.36	0.01

16	301559	中集环科	318,347.68	0.01
17	301371	敷尔佳	313,868.16	0.01
18	301511	德福科技	274,764.00	0.01
19	301525	儒竞科技	264,856.20	0.01
20	301526	国际复材	258,618.50	0.01

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（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	00941	中国移动	43,665,208.21	1.18
2	600028	中国石化	41,997,164.00	1.14
3	601658	邮储银行	35,467,662.00	0.96
4	000538	云南白药	25,247,655.20	0.68
5	300482	万孚生物	16,914,865.37	0.46
6	000792	盐湖股份	8,805,485.00	0.24
7	600276	恒瑞医药	7,554,646.00	0.20
8	600060	海信视像	6,936,539.00	0.19
9	600019	宝钢股份	6,254,932.00	0.17
10	000001	平安银行	5,906,490.00	0.16
11	688139	海尔生物	4,520,933.66	0.12
12	000002	万科 A	2,700,627.00	0.07
13	688343	云天励飞	2,540,999.33	0.07
14	00728	中国电信	2,381,974.73	0.06
15	688798	艾为电子	2,284,807.88	0.06
16	00998	中信银行	2,266,605.45	0.06
17	03969	中国通号	2,199,296.33	0.06
18	002221	东华能源	2,117,737.00	0.06
19	002595	豪迈科技	2,100,706.00	0.06
20	00883	中国海洋石油	1,929,946.42	0.05

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（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	67,958,277.79
卖出股票收入（成交）总额	249,389,217.94

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，不考虑相关交易费用。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	55,172,330.96	2.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	55,172,330.96	2.47

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019703	23 国债 10	544,000	55,172,330.96	2.47

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

注：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

注：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

注：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

根据本基金合同，本基金不参与股指期货投资。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货投资。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货投资。

## 8.12 本报告期投资基金情况

### 8.12.1 投资政策及风险说明

本基金将根据基金产品特征，综合定量和定性两个维度优选拟投资基金标的。首先，对全市

场基金进行筛选，构建基础基金池，再通过对基础基金池中基金管理人和基金经理的调研情况进行进一步筛选，构建精选基金池，最后结合市场情况和基金风格构建投资组合，努力获取基金经理优秀管理能力所产生的超额收益。

### 8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	002650	东方红稳添利纯债 A	契约型开放式	163,372,858.75	177,847,694.04	7.97	是
2	001564	东方红京东大数据混合 A	契约型开放式	57,786,064.54	143,887,300.70	6.45	是
3	510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	交易型开放式 (ETF)	26,123,100.00	91,404,726.90	4.09	否
4	006567	中泰星元灵活配置混合 A	契约型开放式	35,957,197.43	80,637,610.96	3.61	否
5	001202	东方红领先精选混合 A	契约型开放式	55,035,917.86	77,765,751.94	3.48	是
6	161834	银华鑫锐灵活配置混合 (LOF) A	上市契约型开放式 (LOF)	39,818,718.35	59,887,352.40	2.68	否
7	005057	东方红货币 B	契约型开放式	59,885,755.53	59,885,755.53	2.68	是

8	169101	东方红睿丰混合(LOF)	上市契约型开放式(LOF)	37,369,698.92	46,338,426.66	2.08	是
9	159920	恒生ETF(QDII)	交易型开放式(ETF)	45,364,588.00	45,228,494.24	2.03	否
10	007549	中泰开阳价值优选混合A	契约型开放式	26,278,020.39	44,499,199.73	1.99	否
11	008294	朱雀企业优胜股票A	契约型开放式	36,506,666.89	44,421,312.27	1.99	否
12	501054	东方红睿泽三年定开混合A	上市契约型开放式(LOF)	44,127,317.00	41,876,823.83	1.88	是
13	009670	东方红益丰纯债债券A	契约型开放式	38,515,940.69	41,100,360.31	1.84	是
14	512880	国泰中证全指证券公司ETF	交易型开放式(ETF)	45,296,990.00	40,857,884.98	1.83	否
15	005974	东方红配置精选混合A	契约型开放式	29,180,162.60	40,645,048.49	1.82	是
16	007497	中庚价值灵动灵活配置混合	契约型开放式	18,658,617.25	39,785,769.56	1.78	否
17	005498	银华积极成长混合A	契约型开放式	25,082,434.88	39,284,109.51	1.76	否

18	001324	华宝新价值混合	契约型开放式	24,750,478.13	38,873,100.95	1.74	否
19	003669	东方红益鑫纯债债券 C	契约型开放式	35,630,500.03	37,166,174.58	1.67	是
20	009035	浦银安盛中债 1-3 年国开债指数 A	契约型开放式	35,390,987.92	36,364,240.09	1.63	否
21	012243	东方红内需增长混合 B	契约型开放式	14,019,330.68	34,386,614.29	1.54	是
22	001712	东方红优势精选混合	契约型开放式	20,419,581.01	26,280,000.76	1.18	是
23	004496	前海开源多元策略混合 A	契约型开放式	11,757,282.23	24,959,534.45	1.12	否
24	169105	东方红睿华沪港深混合 (LOF) A	上市契约型开放式 (LOF)	21,222,466.99	24,898,198.27	1.12	是
25	000339	长城医疗保健混合 A	契约型开放式	8,757,695.03	24,551,322.25	1.10	否
26	166002	中欧新蓝筹混合 A	契约型开放式	13,589,548.45	22,712,212.32	1.02	否
27	003432	中信保诚至瑞混合 A	契约型开放式	14,330,171.43	20,589,590.31	0.92	否
28	013465	博时智选量化多因子股票 A	契约型开放式	23,751,614.27	20,081,989.87	0.90	否

29	005652	国富天颐混合 A	契约型开放式	18,520,195.22	19,892,541.69	0.89	否
30	007130	中庚小盘价值股票	契约型开放式	8,748,851.66	19,833,646.71	0.89	否
31	009560	上银中债 1-3 年国开行债券指数	契约型开放式	18,023,312.83	19,106,513.93	0.86	否
32	200012	长城中小盘成长混合 A	契约型开放式	10,505,324.82	18,459,956.77	0.83	否
33	310358	申万菱信新经济混合	契约型开放式	18,943,214.51	17,274,317.31	0.77	否
34	511990	华宝添益	交易型开放式 (ETF)	172,672.00	17,268,581.38	0.77	否
35	002057	中银新机遇混合 A	契约型开放式	14,551,877.55	16,661,899.79	0.75	否
36	110023	易方达医疗保健行业混合 A	契约型开放式	4,631,420.56	15,686,621.44	0.70	否
37	206009	鹏华新兴产业混合	契约型开放式	5,497,251.24	14,787,605.84	0.66	否
38	005062	博时中证 500 指数增强 A	契约型开放式	12,397,098.93	14,524,441.11	0.65	否
39	004119	广发创新驱动混合	契约型开放式	9,273,047.34	14,345,404.23	0.64	否
40	260112	景顺长城	契约	6,493,445.40	14,025,842.06	0.63	否

		能源基建混合 A	型开放式				
41	020019	国泰双利债券 A	契约型开放式	8,790,704.74	13,493,731.78	0.60	否
42	017613	兴银合丰债券 C	契约型开放式	11,182,381.55	12,009,877.78	0.54	否
43	519915	富国消费主题混合 A	契约型开放式	5,022,356.48	11,742,269.45	0.53	否
44	005457	景顺长城量化小盘股票	契约型开放式	9,511,109.17	11,468,495.44	0.51	否
45	006113	汇添富创新医药混合	契约型开放式	6,315,557.16	10,060,051.00	0.45	否
46	511880	银华日利货币 A	契约型开放式	100,000.00	10,009,400.00	0.45	否
47	001605	国富沪港深成长精选股票 A	契约型开放式	7,311,883.00	9,767,213.31	0.44	否
48	515790	华泰柏瑞中证光伏产业 ETF	交易型开放式 (ETF)	10,500,000.00	9,345,000.00	0.42	否
49	005802	汇添富智能制造股票 A	契约型开放式	8,637,269.06	9,057,040.34	0.41	否
50	512170	华宝中证医疗 ETF	交易型开放式 (ETF)	20,000,000.00	7,820,000.00	0.35	否
51	360005	光大保德信红利混	契约型开	3,911,206.73	7,222,434.35	0.32	否

		合 A	放式				
52	008704	广发高股息优享混合 A	契约型开放式	7,433,648.06	6,997,292.92	0.31	否
53	513060	博时恒生医疗保健(QDII-ETF)	交易型开放式(ETF)	15,000,000.00	6,840,000.00	0.31	否
54	002472	光大保德信先进服务业混合 A	契约型开放式	4,959,391.43	6,839,992.66	0.31	否
55	501049	东方红睿玺三年定开混合 A	上市契约型开放式(LOF)	7,777,132.00	6,556,122.28	0.29	是
56	006593	博道中证500增强 A	契约型开放式	4,308,242.49	6,539,481.28	0.29	否
57	005821	万家新机遇龙头企业混合 A	契约型开放式	3,667,742.65	6,259,736.38	0.28	否
58	512290	国泰中证生物医药ETF	交易型开放式(ETF)	4,903,900.00	5,600,253.80	0.25	否
59	588080	易方达上证科创板50ETF	交易型开放式(ETF)	6,000,000.00	5,232,000.00	0.23	否
60	512000	华宝中证全指证券公司ETF	交易型开放式(ETF)	5,000,000.00	4,320,000.00	0.19	否

61	159949	华安创业板 50ETF	交易型开放式 (ETF)	5,000,000.00	3,935,000.00	0.18	否
62	003751	万家瑞隆混合 A	契约型开放式	1,893,320.58	3,579,322.56	0.16	否
63	510330	华夏沪深 300ETF	交易型开放式 (ETF)	1,000,000.00	3,506,000.00	0.16	否
64	516970	广发中证 基建工程 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,500,000.00	1,477,500.00	0.07	否
65	159865	国泰中证 畜牧养殖 ETF	交易型开放式 (ETF)	2,000,000.00	1,334,000.00	0.06	否
66	588000	华夏上证 科创板 50 成份 ETF	交易型开放式 (ETF)	551,300.00	494,516.10	0.02	否
67	515210	国泰中证 钢铁 ETF	交易型开放式 (ETF)	200,000.00	238,400.00	0.01	否
68	511850	招商财富 宝货币 ETFE	交易型开放式 (ETF)	8.00	800.10	0.00	否

### 8.12.3 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

注：本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

### 8.13 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

#### 8.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 8.13.3 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	46,009.81
2	应收清算款	20,091,270.88
3	应收股利	232,977.61
4	应收利息	-
5	应收申购款	701.58
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	-
8	应收销售服务费返还	6,801.71
9	其他	-
10	合计	20,377,761.59

#### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

#### 8.13.6 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，投资组合报告中市值占净值比例的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

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（%）

29,502	84,709.64	72,604,596.02	2.91	2,426,499,152.54	97.09
--------	-----------	---------------	------	------------------	-------

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	5,826,238.72	0.23

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

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

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年3月9日） 基金份额总额	4,006,288,828.66
本报告期期初基金份额总额	4,007,389,525.07
本报告期基金总申购份额	7,458,725.14
减：本报告期基金总赎回份额	1,515,744,501.65
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,499,103,748.56

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内没有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

报告期内，杨海同志自 2023 年 7 月 7 日起担任管理人副总经理。

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

报告期内未发生基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

### 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金本报告期持有的基金未发生重大影响事件。

### 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自本基金基金合同生效日（2021 年）起为本基金提供审计服务至今。本基金本报告期应支付给该事务所审计报酬为 60,000.00 元人民币。

### 11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.8.1 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 (%)	
东方证券	5	213,937,608.36	70.67	159,290.94	71.29	-
开源证券	1	32,383,855.31	10.70	23,358.87	10.45	-
安信证券	1	25,320,890.09	8.36	18,265.23	8.18	-
国信证券	1	7,700,061.17	2.54	5,587.04	2.50	-
广发证券	2	7,088,195.28	2.34	5,112.57	2.29	-
汇丰前海	2	4,382,171.07	1.45	3,160.83	1.41	-
华创证券	2	4,097,528.52	1.35	3,015.53	1.35	-
国金证券	2	3,747,911.97	1.24	2,704.06	1.21	-
长江证券	2	3,108,971.35	1.03	2,242.51	1.00	-
财通证券	2	478,415.09	0.16	345.08	0.15	-

中信证券	2	477,000.00	0.16	343.83	0.15	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

## 2、交易单元的选择标准和程序

### （1）选择标准

券商财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行为；具有较强的研究服务能力；交易佣金收费合理。

### （2）选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、本基金本报告期内租用的券商交易单元变更情况：新增财通证券交易单元 2 个，新增摩根大通证券交易单元 2 个。

### 11.8.2 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	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
东方证券	59,800,000.00	19.45	576,000,000.00	75.79	-	-	420,494,572.81	35.88
开源证券	55,809,756.00	18.15	18,000,000.00	2.37	-	-	95,514,949.90	8.15
安信证券	32,691,825.00	10.63	-	-	-	-	79,611,483.31	6.79
国信证券	-	-	-	-	-	-	45,286,550.00	3.86
广发证券	62,671,854.00	20.38	-	-	-	-	26,261,989.00	2.24
汇丰前海	-	-	10,000,000.00	1.32	-	-	372,604,718.81	31.79

华创 证券	-	-	156,000,000.00	20.53	-	-	42,574,550.00	3.63
国金 证券	41,958,840.00	13.65	-	-	-	-	30,077,070.00	2.57
长江 证券	-	-	-	-	-	-	23,100,200.00	1.97
财通 证券	-	-	-	-	-	-	20,159,000.00	1.72
中信 证券	-	-	-	-	-	-	4,865,500.00	0.42
东方 财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛 中国 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-	11,550,646.51	0.99	
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证	-	-	-	-	-	-	-	-	-

券									
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	54,564,219.00	17.74	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

### 11.9 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	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2023 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 1 月 4 日
2	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 1 月 20 日
3	上海东方证券资产管理有限公司关于部分基金增加代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 2 月 15 日
4	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）开放日常赎回业务的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 1 日
5	关于东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）在网上直销平台开通定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 3 日
6	上海东方证券资产管理有限公司关于部分基金增加国金证券股份有限公司为代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 16 日
7	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下基金增加上海万得基金销售有限公司为代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 16 日
8	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 24 日
9	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书（更新）（2023 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 24 日
10	上海东方证券资产管理有限公司关于部分基金增加浙江泰隆商业银行股份有限公司为代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 28 日
11	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 31 日
12	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金新增 2023 年港股通交易日后调整申购、赎回等业务安排的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 4 日
13	上海东方证券资产管理有限公司关于部分基金增加上海长量基金销售有限公司为代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 12 日
14	上海东方证券资产管理有限公司关	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 14 日

	于旗下基金增加北京雪球基金销售有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告		
15	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 21 日
16	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在珠海盈米基金销售有限公司开通定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 5 月 15 日
17	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海好买基金销售有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 5 月 15 日
18	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加北京度小满基金销售有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 5 月 15 日
19	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海利得基金销售有限公司为代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 5 月 22 日
20	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海攀赢基金销售有限公司为代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 6 月 20 日
21	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同	中国证监会规定媒介	2023 年 7 月 5 日
22	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议	中国证监会规定媒介	2023 年 7 月 5 日
23	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金可投资于公开募集基础设施证券投资基金并修订基金合同、托管协议的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 7 月 5 日
24	上海东方证券资产管理有限公司关于部分基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 7 月 6 日
25	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2023 年 7 月 11 日
26	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书（更新）（2023 年第 2 号）	中国证监会规定媒介	2023 年 7 月 11 日
27	上海东方证券资产管理有限公司关	中国证监会规定媒介	2023 年 7 月 17 日

	于旗下部分基金非港股通交易日开放安排的公告		
28	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）2023 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 7 月 21 日
29	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）2023 年中期报告	中国证监会规定媒介	2023 年 8 月 31 日
30	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日开放安排的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 9 月 1 日
31	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日开放安排的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 9 月 8 日
32	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）2023 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 10 月 25 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未发生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

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）的文件；
- 2、《东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；
- 4、东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、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的办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：  
[www.dfham.com](http://www.dfham.com)。

上海东方证券资产管理有限公司

2024 年 3 月 29 日