

东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:东兴基金管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年3月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为基金财务出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自2023年1月1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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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
§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	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	77
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	78
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	78
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	78
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	78
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	78

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	78
8.12 投资组合报告附注.....	79
§9 基金份额持有人信息.....	79
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	79
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	80
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.....	80
§10 开放式基金份额变动.....	80
§11 重大事件揭示.....	81
11.1 基金份额持有人大会决议.....	81
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.....	81
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	81
11.4 基金投资策略的改变.....	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	81
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.....	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	81
11.8 其他重大事件.....	82
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	84
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.....	84
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	84
§13 备查文件目录.....	85
13.1 备查文件目录.....	85
13.2 存放地点.....	85
13.3 查阅方式.....	85

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	东兴未来价值混合	
基金主代码	004695	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年07月26日	
基金管理人	东兴基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	144,593,928.91份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东兴未来价值混合A	东兴未来价值混合C
下属分级基金的交易代码	004695	007550
报告期末下属分级基金的份额总额	68,593,603.69份	76,000,325.22份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过"自上而下"的宏观分析和"自下而上"的个股选择相结合寻找具有优质成长特性的股票，力争在控制风险的基础上实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将通过对宏观经济周期和市场运行阶段的判断来确定投资组合中各大类资产的权重。在此基础上，结合对行业周期、公司发展前景、金融市场行为等分析，精选个股，完成股票组合的构建，并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合的构建。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×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高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高风险水平的投资品种。

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	东兴基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 姓名	李宛霖	龚小武

露负责人	联系电话	400-670-1800	021-52629999-212056
	电子邮箱	xxpl@dxamc.cn	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		400-670-1800	95561
传真		010-57307388	021-62159217
注册地址		北京市丰台区东管头1号院1号楼1-190室	福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦
办公地址		北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层	上海市浦东新区银城路167号4楼
邮政编码		100033	200120
法定代表人		牛南洁	吕家进

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	http://www.dxamc.cn
基金年度报告备置地点	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
注册登记机构	东兴基金管理有限公司	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15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	
	东兴未来价值混合A	东兴未来价值混合C	东兴未来价值混合A	东兴未来价值混合C	东兴未来价值混合A	东兴未来价值混合C
本期已实现收益	-1,308,741.41	494,628.91	183,509.48	-476.48	1,644,103.81	254,772.42
本期利润	1,172,139.75	1,367,451.23	-1,372,350.09	-106,437.15	-640,134.24	-124,556.27
加权平均基金份额本期利润	0.1456	0.0646	-0.2599	-1.1006	-0.0904	-0.1182

本期加权平均净值利润率	15.27%	6.90%	-24.97%	-96.94%	-7.10%	-9.05%
本期基金份额净值增长率	-2.87%	-2.90%	-20.95%	-20.66%	-7.26%	-7.35%
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	-3,789,771.49	-4,675,087.67	-140,934.15	-	1,262,154.14	112,992.35
期末可供分配基金份额利润	-0.0552	-0.0615	-0.0273	-	0.2305	0.2260
期末基金资产净值	64,803,832.20	71,778,906.90	5,012,077.83	-	6,737,623.13	612,992.35
期末基金份额净值	0.9448	0.9445	0.9727	0.9727	1.2305	1.2260
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	-5.52%	-5.55%	-2.73%	-2.73%	23.05%	22.60%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东兴未来价值混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.65%	0.61%	-3.90%	0.48%	5.55%	0.13%
过去六个月	-0.38%	0.66%	-6.15%	0.51%	5.77%	0.15%
过去一年	-2.87%	0.75%	-6.03%	0.51%	3.16%	0.24%
过去三年	-28.79%	1.03%	-19.85%	0.67%	-8.94%	0.36%
自基金合同生效起至今	-5.52%	1.01%	-2.91%	0.70%	-2.61%	0.31%

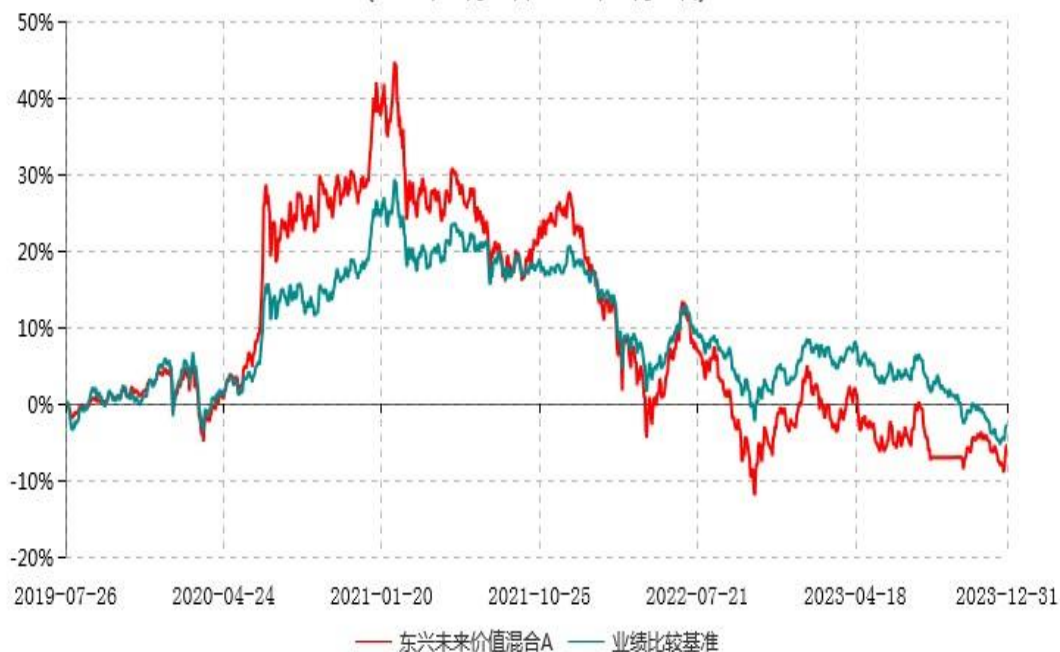
东兴未来价值混合C

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	1.62%	0.61%	-3.90%	0.48%	5.52%	0.13%
过去六个月	-0.41%	0.66%	-6.15%	0.51%	5.74%	0.15%
过去一年	-2.90%	0.75%	-6.03%	0.51%	3.13%	0.24%
过去三年	-28.62%	1.03%	-19.85%	0.67%	-8.77%	0.36%
自基金合同	-5.55%	1.01%	-2.91%	0.70%	-2.64%	0.31%

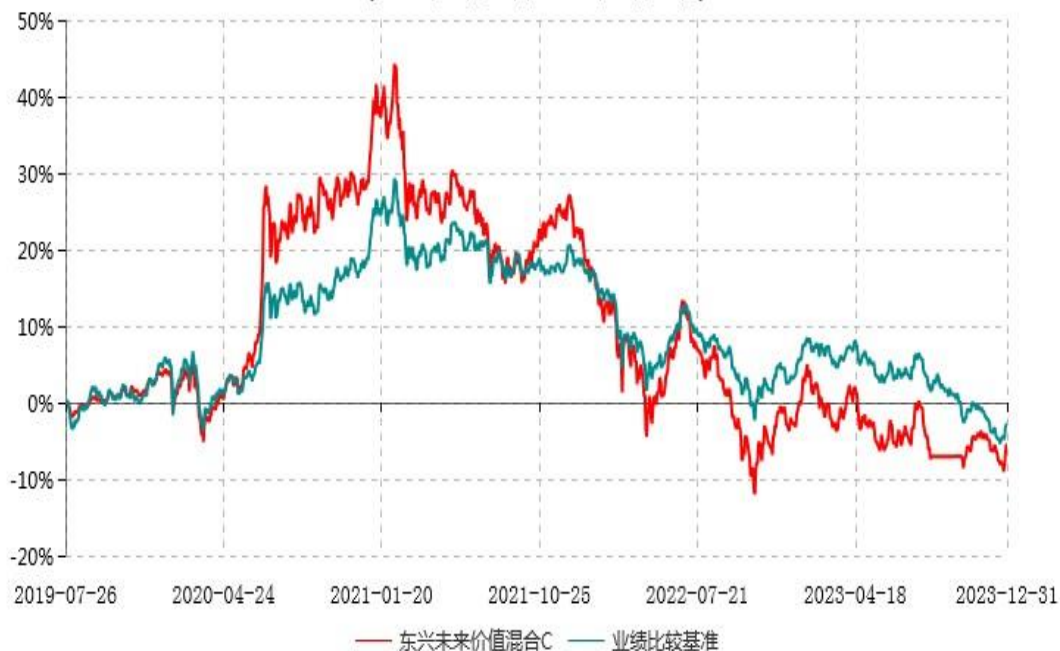
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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

东兴未来价值混合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07月26日-2023年12月31日)



东兴未来价值混合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07月26日-2023年12月31日)



注：1、本基金基金合同生效日为2019年7月26日，根据相关法律法规和基金合同，本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内；

2、建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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





注：本基金基金合同于2019年7月26日生效,自合同生效以来未满五年。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过往三年未进行利润分配。

§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

东兴基金管理有限公司（以下简称“东兴基金”）成立于2020年3月，注册地北京，注册资本2亿元。东兴证券股份有限公司（以下简称“东兴证券”）持有东兴基金100%股份，其控股股东为中国东方资产管理股份有限公司（以下简称“中国东方”），实际控制人为中国财政部。东兴基金系中国东方下属唯一公募基金业务经营主体，是中国东方金融服务平台的重要组成部分。

东兴基金前身为东兴证券基金业务部，先后在主动权益、固定收益、现金管理和指数类产品方面进行了大量布局，积累了丰富的投资运作经验：

特色指数类产品--在行业指数、量化增强方面进行深入研究设计，致力于打造特色精品指数类基金阵列；

主动管理类产品--以追求绝对收益为目标，贯彻自上而下和自下而上相结合的投研思路，坚持价值投资；

固定收益类产品--坚持守住价值、发现价值的原则，在严格把控信用风险的前提下，充分挖掘市场机会。

东兴基金拥有一支行业经验丰富、具备高度凝聚力、战斗力和专业性的优秀团队。公司大部分员工来自于基金、券商、投资、信评等各类金融机构，90%以上员工具有硕士及以上学历。公司承载中国东方的红色基因，践行诚信、创新、激情、专注、协作的企业文化，坚持以投资者利益为上的原则，致力为客户持续创造价值。

截至2023年12月31日，本公司管理东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金、东兴安盈宝货币市场基金、东兴兴利债券型证券投资基金、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金、东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金、东兴兴瑞一年定期开放债券型证券投资基金、东兴兴财短债债券型证券投资基金、东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金、东兴中证消费50指数证券投资基金、东兴兴晟混合型证券投资基金、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金、东兴鑫享6个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资基金、东兴兴源债券型证券投资基金、东兴宸祥量化混合型证券投资基金、东兴连裕6个月滚动持有债券型证券投资基金、东兴连众一年持有期混合型证券投资基金共18只开放式基金。

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		
李晨辉先生	本基金基金经理	2019-08-30	2023-09-11	12年	毕业于中国科学院研究生院信号与信息处理专业，硕士研究生学历。2011年7月至2014年1月，任职东兴证券股份有限公司研究所行业研究员、高级行业研究员；2014年2月至2021年5月，任职东兴证券股份有限公司基金业务部高级研究员、基金经理助理、基金经理；2021年5月至今，任职东兴基金管理有限公司权益投资部基金经理。现任东兴兴晟混合型证券投资基金基金经理、东兴

					兴源债券型证券投资基金基金经理。
李兵伟先生	本基金基金经理	2023-09-11	-	13年	毕业于中央财经大学金融学专业，硕士研究生学历。2010年7月至2015年9月，任职信达证券金融工程研究员、投资主办人；2015年9月至2021年5月，任职东兴证券股份有限公司基金业务部；2021年5月至今，任职东兴基金管理有限公司权益投资部基金经理。现任东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴中证消费50指数证券投资基金基金经理、东兴兴晟混合型证券投资基金基金经理、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金基金经理、东兴宸祥量化混合型证券投资基金基金经理、东兴连众一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
张旭先生	本基金基金经理	2023-09-11	-	11年	毕业于对外经济贸易大学，硕士研究生学历。曾任职于东软集团、隆圣投资管理有限公司；2012年3月至2015年3月，任职银华基金管理有限公司特定资产管理部投资经理；2015年3月至2019年11月，任职中加基金管理有限公司投资研究部负责人。2019年11月加入东兴证券股份有限公司基金业务部，任职助理总经理、基金经理；2021年5月至2023年12月，任职东兴基金管理有限公司助理总经理、基金经理；2023年12月至今，任职东兴基金管理有限公司助理总经理、权益投资部总经理（兼）、基金经理。现任东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、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《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证券监督管理委员会和《东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《东兴基金管理有限公司公平交易管理办法》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统中的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，在参与申购之前，各基金经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量。在获配额度确定后，按照价格优先的原则对交易结果进行分配；如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配。债券一级市场申购分配不足最小单位的，可由基金经理协商分配，协商不一致则由分管投资的公司领导决定；对于银行间市场交易，应按照场外交易流程执行，由各基金经理给出询价区间，交易部根据询价区间在银行间市场上应该按照价格优先、时间优先的原则进行询价并完成交易，并留存询价交易记录备查。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

我们对本报告期内公司管理的不同投资组合在相同时间窗口下（日内、3日内和5日内）同向交易的价差进行了t分布假设检验，通过对检验结果进行分析，未发现旗下投资组合之间存在可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，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

2023年权益市场高开低走，全年主要宽基指数均下跌，小盘股相对跌幅较小。东兴未来价值四季度整体表现好于业绩基准及主要宽基指数，我们的选股组合整体继续表现出一定的超额。

无论从估值、政策还是企业盈利周期来看，权益市场都是一个较好的投资时点，但市场依旧低于大多数人的预期，背后的原因可能主要还是资金问题，简单来说就是供需失衡，权益市场缺乏持续的入市资金，市场反馈持续处于负循环自我加强过程中。

东兴未来价值的投资策略依旧侧重于组合的构建而非择时，底层的选股逻辑为主要用于基本面多因子模型，坦白而言，过去几个季度基于基本面的投资逻辑面临较大的压力，主要是特定市场环境下短期市场底层的驱动因素并非业绩驱动，在这种情况下，我们组合构建过程中的风险控制模块发挥了极大的作用，将我们的回撤控制在一个较低的水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023年1月1日起至2023年12月31日，本基金A类份额净值增长率为-2.87%，业绩比较基准收益率为-6.03%，高于业绩比较基准3.16%；本基金C类份额净值增长率为-2.90%，业绩比较基准收益率为-6.03%，高于业绩比较基准3.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2024年，积极财政政策将继续发力，结构性货币工具将围绕“三大工程”，制造业转型升级等领域精准支持。中央政府“加杠杆”下，基建投资仍将是经济增长重要压舱石。居民部门将继续修复资产负债表，消费延续缓慢复苏走势。但地产投资仍有下行压力，出口面临不确定性。总量经济增速保持稳定下，资本市场仍将面临战略机遇和风险挑战并存的环境。但A股经过三年周期的调整，主要宽基指数估值均已回落至历史较低水平，前期机构重仓行业筹码压力得到消化。同时，2024年是资本市场迈向金融强

国建设的起步年,预计资本市场改革将继续推进,相关配套制度也将进一步完善。整体看,权益市场在2024年表现有望好于2023年。

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,本基金管理人严格遵守相关法律法规,坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发,依照公司内部控制的整体要求,继续致力于内控机制的完善,加强内部风险的控制与防范,确保各项法规和管理制度的落实,保证基金合同得到严格履行。

本报告期内,本基金管理人进一步完善了公司的内控体系;对公司投研交易、市场营销、后台运营等业务开展了定期或专项稽核,检查业务开展的合规性和制度执行的有效性;采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作,加强对日常投资运作的管理和监控,督促投研交易业务的合规开展;针对新出台的法律法规和监管要求,积极组织多项法律法规和职业道德培训,不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养;全面参与新产品设计、新业务拓展工作;严格审查基金宣传推介材料,及时检查基金销售业务的合法合规情况;完成各项信息披露工作,保证所披露信息的真实性、准确性和完整性;监督客户投诉处理,重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,顺应"放松管制、加强监管"的监管形势,积极健全内部管理制度,不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,努力防范各种风险,切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值价格的最终决策。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定,结合本基金实际运作情况,本基金本报告期未进行利润分配。

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，受基金份额持有人赎回等影响，本基金存在基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情况及连续六十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形，本基金管理人已将此情况上报中国证监会并采取适当措施。截至本报告期末，本基金不存在基金资产净值低于五千万元的情况和基金持有人数量不满二百人的情形。

§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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、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	普华永道中天审字(2024)第27944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	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人

审计意见	<p>我们审计了东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"东兴未来价值混合基金")的财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表,2023年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。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在财务报表附注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")、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了东兴未来价值混合基金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。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于东兴未来价值混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>东兴未来价值混合基金的基金管理人东兴基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层对其他信息负责。其他信息包括东兴未来价值混合基金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。基于我们已经执行的工作,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监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,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,基金管理人管理层负责评估东兴未来</p>

	<p>价值混合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，除非基金管理人管理层计划清算东兴未来价值混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督东兴未来价值混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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。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：(一)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。(二)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。(三)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。(四)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，就可能对东兴未来价值混合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东兴未来价值混合基金不能持续经营。(五)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	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	闫琳、宋昊礼
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
审计报告日期	2024-03-27

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	5,228,432.72	381,321.75
结算备付金		952,263.18	32,037.35
存出保证金		19,084.05	149.25
交易性金融资产	7.4.7.2	121,901,875.07	4,184,399.60
其中：股票投资		114,398,774.79	4,184,399.60
基金投资		-	-
债券投资		7,503,100.28	-
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	6,002,167.38	419,902.44
应收清算款		-	20,218.40
应收股利		-	-
应收申购款		2,742,395.89	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		136,846,218.29	5,038,028.79
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末
		2023年12月31日	2022年12月31日
负债：			
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		-	9.36
应付管理人报酬		72,256.52	6,423.96
应付托管费		7,225.67	428.26
应付销售服务费		4,998.83	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		87.20	19.77
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	178,910.97	19,069.61
负债合计		263,479.19	25,950.96
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	144,593,928.91	5,153,011.98
未分配利润	7.4.7.8	-8,011,189.81	-140,934.15
净资产合计		136,582,739.10	5,012,077.83
负债和净资产总计		136,846,218.29	5,038,028.79

注：报告截止日2023年12月31日，东兴未来价值混合A基金份额净值0.9448元，基金份额总额68,593,603.69份，东兴未来价值混合C基金份额净值0.9445元，基金份额总额76,000,325.22份。

7.2 利润表

会计主体：东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至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		2,915,945.32	-1,369,397.81
1.利息收入		124,583.28	11,684.62
其中：存款利息收入	7.4.7.9	14,772.72	2,771.72
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收 入		109,810.56	8,912.90
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-605,651.71	280,114.73
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-809,069.26	192,269.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	105,376.63	-
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	98,040.92	87,845.38
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	3,353,703.48	-1,661,820.24
4.汇兑收益（损失以“-”号填 列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填 列）	7.4.7.17	43,310.27	623.08
减：二、营业总支出		376,354.34	109,389.43
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	275,373.92	84,399.03

2.托管费	7.4.10.2.2	27,102.49	5,626.52
3.销售服务费	7.4.10.2.3	19,482.96	116.78
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		395.36	32.10
8.其他费用	7.4.7.19	53,999.61	19,215.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,539,590.98	-1,478,787.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,539,590.98	-1,478,787.24
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,539,590.98	-1,478,787.24

7.3 净资产变动表

会计主体：东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,153,011.98	-140,934.15	5,012,077.83
二、本期期初净资产	5,153,011.98	-140,934.15	5,012,077.83
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	139,440,916.93	-7,870,255.66	131,570,661.27
(一)、综合收益总额	-	2,539,590.98	2,539,590.98
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少)	139,440,916.93	-10,409,846.64	129,031,070.29

以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	180,133,263.27	-13,033,606.15	167,099,657.12
2.基金赎回款	-40,692,346.34	2,623,759.51	-38,068,586.83
(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	144,593,928.91	-8,011,189.81	136,582,739.10
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	5,975,468.99	1,375,146.49	7,350,615.48
二、本期期初净资产	5,975,468.99	1,375,146.49	7,350,615.48
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-822,457.01	-1,516,080.64	-2,338,537.65
(一)、综合收益总额	-	-1,478,787.24	-1,478,787.24
(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)	-822,457.01	-37,293.40	-859,750.41
其中：1.基金申购款	212,613.18	9,137.40	221,750.58
2.基金赎回款	-1,035,070.19	-46,430.80	-1,081,500.99
(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	5,153,011.98	-140,934.15	5,012,077.83

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:

牛南洁

郝洁

王广辉

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

东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")根据2017年5月10日中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《关于准予东兴量化新锐灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2017] 676号)的批复及《关于准予东兴量化新锐灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2019] 943号)的批复,自2019年7月1日起至2019年7月23日公开募集成立。本基金为混合型证券投资基金,首次设立募集不包括认购资金利息共募集209,982,041.96元人民币,业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)"德师报(验)字(19)第00365号"验资报告验证。经向中国证监会备案,《东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2019年7月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为210,091,082.68份,其中认购资金利息折合109,040.72份。本基金基金管理人为东兴基金管理有限公司(本基金原基金管理人为东兴证券股份有限公司,自2021年5月24日起变更为东兴基金管理有限公司),基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、股指期货、货币市场工具、同业存单、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部2006年2月15日颁布的《企业会计准则--基本准则》(财政部令第33号发布、财政部令第76号修订)、于2006年2月15日及其后颁布和修订的42项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号-年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号-年度报告和中期报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号-会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求,真实、完整地反映了本基金2023年12月31日的财务状况以及2023年1月1日至2023年12月31日的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。本期财务报表的实际编制期间为2023年1月1日至2023年12月31日。首期年度财务报表的编制期间从基金合同生效日起至相关年度的12月31日止,末期年度财务报表的编制期间从相关年度的1月1日起至基金合同终止日止。

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

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。在通常情况下,本基金所持有的金融资产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。

基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资等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在资

产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表以交易性金融资产列示。

基金持有的以摊余成本计量的、按照返售协议约定先买入再按固定价格返售的票据、证券等金融资产所融出的资金分类为买入返售金融资产。

基金采用买入并持有至到期策略的金融资产，即到期日固定、回收金额固定或可确定，且有明确意图和能力持有至到期的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产，在债权投资中核算。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以及以摊余成本计量的金融负债两类。基金持有的未划分为以摊余成本计量的金融负债通常以公允价值计量且其变动计入当期损益，列示为交易性金融负债。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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，期间取得的利息或现金股利，确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以成本进行后续计量，在摊销时产生的利得或损失，应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应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，应采

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

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

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

3、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，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应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

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行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

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

分类为以摊余成本计量的金融资产利息收入在持有期内，按金融资产的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由金融资产发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认金融资产利息收入。其中：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，逐日确认债券利息收入；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，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

（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和对应投资品种产生的交易费用的差额确认。

债券、资产支持证券、同业存单等固定收益类金融资产的投资收益分为：

① 持有期间的利息收入：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利息收入在持有期内，按金融资产的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由金融资产发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认金融资产投资收益。其中：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，逐日确认投资收益；

② 交易日按卖出金融资产交易日的成交总额扣除应结转的投资成本与应计利息(若有)和对应投资品种产生的交易费用后的差额确认投资收益。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本和对应投资品种产生的交易费用后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

（3）公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性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，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

（4）其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1)根据基金合同以及后续修订，基金管理费在2023年3月3日前按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提；自2023年3月3日起按前一日基金资产净值的1.00%的年费率逐日计提；

(2)根据基金合同，基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率逐日计提；

(3)根据基金合同，基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.10%的年费率计提；

(4)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费用；基金份额持有人大会费用、基金的证券、期货交易费用；基金的银行汇划费用；证券账户开户费用、银行账户维护费用、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

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，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

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；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成相应的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则登记机构将以投资者在各销售机构最后一次选择的分红方式为准；

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、同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对现有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、登记机构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 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及计量基础一致。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税【2004】78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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4月23日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008年9月18日发布的《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】70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》、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《财政部、国家税务总局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》及其他相关税务法规和实务操作、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【2023】39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，主要税项列示如下：

1.于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。自2018年1月1日起，在基金运营过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2.对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。

3.对基金取得的股票股息、红利收入，自2015年9月8日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，

其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4.对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5.对于基金从事A股买卖，自2008年09月19日起，由出让方按0.1%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日起证券交易印花税实施减半征收。

6.基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	5,228,432.72	381,321.75
等于：本金	5,226,502.32	381,280.15
加：应计利息	1,930.40	41.60
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	5,228,432.72	381,321.75

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		111,696,887.80	-	114,398,774.79	2,701,886.99
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,402,527.79	102,120.28	7,503,100.28	-1,547.79
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,402,527.79	102,120.28	7,503,100.28	-1,547.79
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		119,099,415.59	102,120.28	121,901,875.07	2,700,339.20
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		4,837,763.88	-	4,184,399.60	-653,364.28
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		4,837,763.88	-	4,184,399.60	-653,364.28

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末，本基金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	6,002,167.38	-
银行间市场	-	-
合计	6,002,167.38	-
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	419,902.44	-
银行间市场	-	-
合计	419,902.44	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

7.4.7.6 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	-	0.03
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	127,246.36	69.58
其中：交易所市场	127,246.36	69.58
银行间市场	-	-
应付利息	-	-

预提费用	51,664.61	19,000.00
合计	178,910.97	19,069.61

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和账户维护费。

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 东兴未来价值混合A

金额单位：人民币元

项目 (东兴未来价值混合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	5,153,011.98	5,153,011.98
本期申购	64,284,851.17	64,284,851.17
本期赎回（以“-”号填列）	-844,259.46	-844,259.46
本期末	68,593,603.69	68,593,603.69

7.4.7.7.2 东兴未来价值混合C

金额单位：人民币元

项目 (东兴未来价值混合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	-	-
本期申购	115,848,412.10	115,848,412.10
本期赎回（以“-”号填列）	-39,848,086.88	-39,848,086.88
本期末	76,000,325.22	76,000,325.22

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 东兴未来价值混合A

单位：人民币元

项目 (东兴未来价值混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,897,568.23	-3,038,502.38	-140,934.15
本期期初	2,897,568.23	-3,038,502.38	-140,934.15

本期利润	-1,308,741.41	2,480,881.16	1,172,139.75
本期基金份额交易产生的变动数	25,676,028.88	-30,497,005.97	-4,820,977.09
其中：基金申购款	26,044,515.10	-30,899,915.80	-4,855,400.70
基金赎回款	-368,486.22	402,909.83	34,423.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,264,855.70	-31,054,627.19	-3,789,771.49

7.4.7.8.2 东兴未来价值混合C

单位：人民币元

项目 (东兴未来价值混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	494,628.91	872,822.32	1,367,451.23
本期基金份额交易产生的变动数	-5,169,716.58	-419,152.97	-5,588,869.55
其中：基金申购款	-7,835,669.25	-342,536.20	-8,178,205.45
基金赎回款	2,665,952.67	-76,616.77	2,589,335.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,675,087.67	453,669.35	-4,221,418.32

7.4.7.9 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	11,335.98	2,090.61
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	3,386.21	674.91
其他	50.53	6.20

合计	14,772.72	2,771.72
----	-----------	----------

注：其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.10 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	57,287,999.07	1,032,395.00
减：卖出股票成本总额	57,921,708.74	837,687.60
减：交易费用	175,359.59	2,438.05
买卖股票差价收入	-809,069.26	192,269.35

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	129,299.85	-
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	-23,923.22	-
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	105,376.63	-

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年01月01日至2023年12月 31日	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	67,029,469.83	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	65,882,239.21	-
减：应计利息总额	1,170,553.84	-
减：交易费用	600.00	-
买卖债券差价收入	-23,923.22	-

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

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	98,040.92	87,845.38
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	98,040.92	87,845.38

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	3,353,703.48	-1,661,820.24
——股票投资	3,355,251.27	-1,661,820.24
——债券投资	-1,547.79	-
——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	3,353,703.48	-1,661,820.24

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	43,306.35	623.08
转换费收入	3.92	-
合计	43,310.27	623.08

7.4.7.18 信用减值损失

本报告期及上年度可比期间，本基金无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年01月01日至2023年 12月31日	2022年01月01日至2022年 12月31日
审计费用	19,000.00	19,000.00
信息披露费	28,164.61	-
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	835.00	215.00
账户维护费	6,000.00	-
合计	53,999.61	19,215.00

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

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生改变。

关联方名称	与本基金的关系
中国东方资产管理股份有限公司	基金管理人的实际控制人
东兴证券股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金销售机构
东兴基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
大连银行股份有限公司	与基金管理人同一实际控制人的关联方、基金销售机构

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
-------	-------------------------------	------------------------------------

	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	48,352,337.26	21.77%	1,757,019.00	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	13,704,813.00	69.93%	-	-

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	351,051,000.00	87.86%	88,540,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东兴证券股份有限公司	35,520.85	27.25%	32,414.83	25.47%
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东兴证券股份有限公司	1,258.49	100.00%	69.58	100.00%

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	275,373.92	84,399.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	71,241.97	42,200.61
应支付基金管理人的净管理费	204,131.95	42,198.42

注：1、根据基金合同以及后续修订，基金管理费在2023年3月3日前按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

自2023年3月3日起按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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

2、基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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	27,102.49	5,626.52

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

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023年01月01日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东兴未来价值混合A	东兴未来价值混合C	合计
东兴基金管理有限公司	0.00	12,052.80	12,052.80
合计	0.00	12,052.80	12,052.80
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		
	东兴未来价值混合A	东兴未来价值混合C	合计
兴业银行股份有限公司	0.00	116.82	116.82
合计	0.00	116.82	116.82

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.10%的年费率计提。C类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的C类基金份额基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期和上年度可比期间，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**

本基金本年度及上年度可比期间，未发生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。

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

本基金本年度及上年度可比期间，未发生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。

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**

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2023年01月01日至2023年12月31日		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
兴业银行股份有限公司	5,228,432.72	11,335.98	381,321.75	2,090.61

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金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

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项的说明。

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

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

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

本基金本报告期末未持有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有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

本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由风险控制委员会、投资决策委员会、风险管理部门组成的风险管理组织体系，该体系通过分工合作的制度对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券；本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的百分之十，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发行的证券，不超过该证券的百分之十。

除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金在交易所进行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，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业市场进行交易，在交易前均会对交易对手进行信用评估，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

本基金本报告期末持有债券为国债，未包含在按短期信用评级列示的债券投资中。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末持有债券为国债，未包含在按长期信用评级列示的债券投资中。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受

限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注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，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。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。

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告所称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，风险管理的目标是确保基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。基金管理人在报告期内综合考虑投资标的流动性、投资策略、投资限制、销售渠道、潜在投资者类型与风险偏好、投资者结构等因素，综合进行流动性风险管理。

基金管理人坚持按照“组合管理、分散投资”的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制进行投资管理，通过灵活配置的二级市场投资策略、分散化的投资原则、严格的投资比例限制等投资安排，使基金组合资产的流动性安排与基金申赎安排相匹配，报告期内未发生流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

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	5,226,502.32	-	-	-	-	1,930.40	5,228,432.72
结算备付金	951,792.05	-	-	-	-	471.13	952,263.18
存出保证金	19,074.70	-	-	-	-	9.35	19,084.05
交易性金融资产	-	-	7,400,980.00	-	-	114,500,895.07	121,901,875.07
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	-	2,167.38	6,002,167.38
应收申购款	-	-	-	-	-	2,742,395.89	2,742,395.89
资产总计	12,197,369.07	-	7,400,980.00	-	-	117,247,869.22	136,846,218.29
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	72,256.52	72,256.52
应付托管费	-	-	-	-	-	7,225.67	7,225.67
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,998.83	4,998.83
应交税费	-	-	-	-	-	87.20	87.20
其他负债	-	-	-	-	-	178,910.97	178,910.97
负债总计	-	-	-	-	-	263,479.19	263,479.19
利率敏感度缺口	12,197,369.07	-	7,400,980.00	-	-	116,984,390.03	136,582,739.10
上年度末 2022年12月31日							
资产							
货币资金	381,280.15	-	-	-	-	41.60	381,321.75
结算备付金	32,021.51	-	-	-	-	15.84	32,037.35
存出保证金	149.25	-	-	-	-	-	149.25
交易性金融资产	-	-	-	-	-	4,184,399.60	4,184,399.60
买入返售金融资产	420,000.00	-	-	-	-	-97.56	419,902.44
应收清算款	-	-	-	-	-	20,218.40	20,218.40
资产总计	833,450.91	-	-	-	-	4,204,577.88	5,038,028.79
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	9.36	9.36
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,423.96	6,423.96
应付托管费	-	-	-	-	-	428.26	428.26
应交税费	-	-	-	-	-	19.77	19.77

其他负债	-	-	-	-	-	19,069.61	19,069.61
负债总计	-	-	-	-	-	25,950.96	25,950.96
利率敏感度缺口	833,450.91	-	-	-	-	4,178,626.92	5,012,077.83

注：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予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，市场利率上升或下降25个基点，对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险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市场价格风险，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。

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	114,398,774.79	83.76	4,184,399.60	83.49
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	7,503,100.28	5.49	-	-
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	121,901,875.07	89.25	4,184,399.60	83.49

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	6,807,907.38	383,236.44
	业绩比较基准变动-5%	-6,807,907.38	-383,236.44

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	114,398,774.79	4,184,399.60
第二层次	7,503,100.28	-
第三层次	-	-
合计	121,901,875.07	4,184,399.60

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期内不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期内不存在持有非持续以公允价值计量的金融工具的情况。

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货币资金、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收申购款和其他应付款项，其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本报告报出日，本基金无需要披露的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	114,398,774.79	83.60
	其中：股票	114,398,774.79	83.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,503,100.28	5.48
	其中：债券	7,503,100.28	5.48
	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	6,002,167.38	4.39
	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	6,180,695.90	4.52
8	其他各项资产	2,761,479.94	2.02
9	合计	136,846,218.29	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	6,020,680.00	4.41
C	制造业	79,290,924.34	58.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,585,181.00	1.89
E	建筑业	1,345,020.00	0.98
F	批发和零售业	883,795.00	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	544,684.00	0.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,022,327.80	5.87
J	金融业	7,454,053.00	5.46
K	房地产业	2,017,930.00	1.48
L	租赁和商务服务业	1,095,382.00	0.80
M	科学研究和技术服务业	4,282,790.65	3.14
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	856,007.00	0.63
S	综合	-	-
	合计	114,398,774.79	83.76

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	600941	中国移动	26,900	2,676,012.00	1.96
2	601388	怡球资源	727,000	1,904,740.00	1.39
3	600918	中泰证券	250,700	1,719,802.00	1.26
4	000932	华菱钢铁	295,000	1,519,250.00	1.11

5	603926	铁流股份	120,600	1,508,706.00	1.10
6	301235	华康医疗	58,300	1,494,229.00	1.09
7	000737	北方铜业	255,900	1,484,220.00	1.09
8	300246	宝莱特	141,900	1,461,570.00	1.07
9	301208	中亦科技	36,500	1,424,960.00	1.04
10	000166	申万宏源	314,900	1,398,156.00	1.02
11	002732	燕塘乳业	72,100	1,384,320.00	1.01
12	300687	赛意信息	59,800	1,302,444.00	0.95
13	600060	海信视像	62,100	1,297,890.00	0.95
14	601857	中国石油	183,300	1,294,098.00	0.95
15	300897	山科智能	37,700	1,289,340.00	0.94
16	688092	爱科科技	41,911	1,289,182.36	0.94
17	605288	凯迪股份	26,700	1,258,104.00	0.92
18	300073	当升科技	32,900	1,256,780.00	0.92
19	002155	湖南黄金	110,700	1,233,198.00	0.90
20	600642	申能股份	189,100	1,214,022.00	0.89
21	603611	诺力股份	62,400	1,181,232.00	0.86
22	600028	中国石化	203,000	1,132,740.00	0.83
23	002275	桂林三金	76,200	1,104,138.00	0.81
24	301096	百诚医药	16,900	1,100,190.00	0.81
25	603579	荣泰健康	52,100	1,085,243.00	0.79
26	002968	新大正	86,600	1,083,366.00	0.79
27	300870	欧陆通	24,300	1,075,761.00	0.79
28	688819	天能股份	38,208	1,066,767.36	0.78
29	603309	维力医疗	74,700	1,062,981.00	0.78
30	688138	清溢光电	45,655	1,032,716.10	0.76
31	301102	兆讯传媒	53,900	1,031,646.00	0.76
32	600066	宇通客车	76,100	1,008,325.00	0.74
33	300452	山河药辅	70,600	1,005,344.00	0.74
34	300218	安利股份	72,700	985,085.00	0.72
35	600985	淮北矿业	57,000	947,910.00	0.69

36	601077	渝农商行	228,700	933,096.00	0.68
37	603676	卫信康	89,000	928,270.00	0.68
38	688687	凯因科技	26,487	923,336.82	0.68
39	688510	航亚科技	52,208	919,904.96	0.67
40	688401	路维光电	29,888	918,159.36	0.67
41	600480	凌云股份	100,500	915,555.00	0.67
42	300389	艾比森	52,500	910,350.00	0.67
43	000733	振华科技	15,300	900,252.00	0.66
44	600285	羚锐制药	51,500	881,165.00	0.65
45	002873	新天药业	70,300	875,938.00	0.64
46	000858	五粮液	6,200	869,922.00	0.64
47	688239	航宇科技	18,168	867,885.36	0.64
48	300543	朗科智能	79,400	867,048.00	0.63
49	688018	乐鑫科技	8,355	860,147.25	0.63
50	600312	平高电气	66,300	841,347.00	0.62
51	600482	中国动力	46,400	835,664.00	0.61
52	301319	唯特偶	14,300	835,263.00	0.61
53	002829	星网宇达	30,400	822,016.00	0.60
54	601958	金钼股份	86,000	812,700.00	0.60
55	688501	青达环保	48,292	807,925.16	0.59
56	603238	诺邦股份	58,700	807,125.00	0.59
57	601098	中南传媒	77,600	789,192.00	0.58
58	300971	博亚精工	31,300	779,370.00	0.57
59	000739	普洛药业	50,200	772,578.00	0.57
60	000100	TCL科技	178,500	767,550.00	0.56
61	301219	腾远钴业	19,400	763,778.00	0.56
62	603365	水星家纺	52,900	760,702.00	0.56
63	600998	九州通	108,100	757,781.00	0.55
64	603507	振江股份	27,800	720,298.00	0.53
65	603089	正裕工业	62,600	718,648.00	0.53
66	002880	卫光生物	20,400	716,652.00	0.52

67	002130	沃尔核材	94,800	715,740.00	0.52
68	300618	寒锐钴业	25,300	715,737.00	0.52
69	605167	利柏特	72,700	689,923.00	0.51
70	603198	迎驾贡酒	10,400	689,416.00	0.50
71	600325	华发股份	94,700	682,787.00	0.50
72	300219	鸿利智汇	78,700	662,654.00	0.49
73	002060	粤水电	128,500	630,935.00	0.46
74	002913	奥士康	20,400	625,260.00	0.46
75	600566	济川药业	19,800	622,314.00	0.46
76	002422	科伦药业	21,000	610,050.00	0.45
77	002156	通富微电	26,300	608,056.00	0.45
78	003036	泰坦股份	49,000	607,600.00	0.44
79	301087	可孚医疗	15,800	598,820.00	0.44
80	600577	精达股份	139,700	578,358.00	0.42
81	688601	力芯微	10,902	571,155.78	0.42
82	603589	口子窖	12,300	557,190.00	0.41
83	688621	阳光诺和	7,813	544,956.75	0.40
84	002056	横店东磁	39,800	538,892.00	0.39
85	002479	富春环保	110,900	528,993.00	0.39
86	000997	新大陆	26,600	521,626.00	0.38
87	001218	丽臣实业	23,600	509,996.00	0.37
88	603228	景旺电子	22,400	505,344.00	0.37
89	300138	晨光生物	37,500	503,625.00	0.37
90	601577	长沙银行	73,800	503,316.00	0.37
91	600019	宝钢股份	82,600	489,818.00	0.36
92	300122	智飞生物	8,000	488,880.00	0.36
93	688618	三旺通信	8,325	487,845.00	0.36
94	688599	天合光能	16,768	478,391.04	0.35
95	600938	中国海油	22,700	476,019.00	0.35
96	688550	瑞联新材	11,975	475,168.00	0.35
97	000690	宝新能源	106,100	470,023.00	0.34

98	603059	倍加洁	20,800	469,248.00	0.34
99	603102	百合股份	12,000	465,360.00	0.34
100	300922	天秦装备	26,400	450,648.00	0.33
101	603755	日辰股份	16,500	438,570.00	0.32
102	301222	浙江恒威	14,700	437,031.00	0.32
103	300568	星源材质	28,300	436,386.00	0.32
104	002879	长缆科技	26,100	418,122.00	0.31
105	300829	金丹科技	19,400	405,072.00	0.30
106	600727	鲁北化工	60,800	400,064.00	0.29
107	002085	万丰奥威	80,000	395,200.00	0.29
108	601555	东吴证券	53,700	392,547.00	0.29
109	600517	国网英大	81,300	387,801.00	0.28
110	603583	捷昌驱动	19,000	380,570.00	0.28
111	002580	圣阳股份	43,100	373,677.00	0.27
112	300433	蓝思科技	28,000	369,600.00	0.27
113	600061	国投资本	53,000	357,220.00	0.26
114	002478	常宝股份	63,500	346,075.00	0.25
115	000768	中航西飞	15,200	340,024.00	0.25
116	002594	比亚迪	1,700	336,600.00	0.25
117	688283	坤恒顺维	4,819	330,727.97	0.24
118	603156	养元饮品	15,400	327,404.00	0.24
119	601688	华泰证券	22,400	312,480.00	0.23
120	000960	锡业股份	20,800	297,856.00	0.22
121	605377	华旺科技	15,500	295,895.00	0.22
122	600685	中船防务	11,500	293,825.00	0.22
123	603456	九洲药业	11,500	278,415.00	0.20
124	003038	鑫铂股份	8,100	278,235.00	0.20
125	301215	中汽股份	44,300	273,331.00	0.20
126	601311	骆驼股份	33,800	270,738.00	0.20
127	688503	聚和材料	4,946	265,105.60	0.19
128	601318	中国平安	6,500	261,950.00	0.19

129	000513	丽珠集团	7,100	248,571.00	0.18
130	603320	迪贝电气	15,500	246,605.00	0.18
131	601390	中国中铁	43,300	245,944.00	0.18
132	300395	菲利华	6,500	237,640.00	0.17
133	002237	恒邦股份	21,900	236,082.00	0.17
134	688002	睿创微纳	5,336	235,957.92	0.17
135	688589	力合微	5,837	232,954.67	0.17
136	300743	天地数码	16,700	231,796.00	0.17
137	600012	皖通高速	20,200	222,604.00	0.16
138	300319	麦捷科技	22,500	216,900.00	0.16
139	002423	中粮资本	32,300	215,764.00	0.16
140	600098	广州发展	39,400	211,578.00	0.15
141	300900	广联航空	8,500	209,780.00	0.15
142	601138	工业富联	13,600	205,632.00	0.15
143	600897	厦门空港	15,600	194,844.00	0.14
144	600967	内蒙一机	23,000	189,980.00	0.14
145	301207	华兰疫苗	6,300	175,140.00	0.13
146	605287	德才股份	10,100	171,397.00	0.13
147	600901	江苏金租	35,400	171,336.00	0.13
148	600284	浦东建设	26,700	168,210.00	0.12
149	600582	天地科技	30,700	167,008.00	0.12
150	600409	三友化工	30,400	166,896.00	0.12
151	000682	东方电子	20,000	161,000.00	0.12
152	002179	中航光电	4,100	159,900.00	0.12
153	300589	江龙船艇	11,000	152,680.00	0.11
154	603045	福达合金	9,500	150,005.00	0.11
155	002993	奥海科技	3,900	148,590.00	0.11
156	000651	格力电器	4,400	141,548.00	0.10
157	300407	凯发电气	14,800	139,712.00	0.10
158	300232	洲明科技	15,800	139,040.00	0.10
159	002648	卫星化学	9,300	137,175.00	0.10

160	000728	国元证券	20,000	136,600.00	0.10
161	600456	宝钛股份	4,200	131,838.00	0.10
162	300627	华测导航	4,200	130,284.00	0.10
163	002203	海亮股份	11,300	125,995.00	0.09
164	301195	北路智控	3,100	125,798.00	0.09
165	688106	金宏气体	5,161	124,328.49	0.09
166	600637	东方明珠	16,500	124,080.00	0.09
167	300636	同和药业	11,700	123,318.00	0.09
168	300118	东方日升	6,700	118,255.00	0.09
169	600559	老白干酒	5,200	117,260.00	0.09
170	300866	安克创新	1,300	115,180.00	0.08
171	301107	瑜欣电子	3,500	112,315.00	0.08
172	601229	上海银行	18,700	111,639.00	0.08
173	300314	戴维医疗	7,300	110,522.00	0.08
174	605123	派克新材	1,200	109,440.00	0.08
175	300564	筑博设计	8,000	107,680.00	0.08
176	603218	日月股份	8,700	107,619.00	0.08
177	600741	华域汽车	6,600	107,448.00	0.08
178	000922	佳电股份	10,400	106,808.00	0.08
179	688682	霍莱沃	2,234	106,584.14	0.08
180	000661	长春高新	700	102,060.00	0.07
181	600483	福能股份	11,900	98,413.00	0.07
182	301185	鸥玛软件	4,800	97,728.00	0.07
183	301037	保立佳	4,600	91,678.00	0.07
184	600007	中国国贸	4,600	89,148.00	0.07
185	603690	至纯科技	3,400	87,380.00	0.06
186	000338	潍柴动力	6,300	85,995.00	0.06
187	601169	北京银行	18,500	83,805.00	0.06
188	601665	齐鲁银行	21,400	83,674.00	0.06
189	301003	江苏博云	3,200	79,872.00	0.06
190	300908	仲景食品	1,900	78,413.00	0.06

191	301076	新瀚新材	2,300	78,016.00	0.06
192	600059	古越龙山	8,300	77,190.00	0.06
193	300852	四会富仕	2,000	77,080.00	0.06
194	600497	驰宏锌锗	14,500	73,225.00	0.05
195	002053	云南能投	7,600	73,112.00	0.05
196	600390	五矿资本	15,300	71,604.00	0.05
197	600602	云赛智联	6,100	70,577.00	0.05
198	301302	华如科技	2,800	70,308.00	0.05
199	300017	网宿科技	8,900	69,865.00	0.05
200	688772	珠海冠宇	3,153	69,397.53	0.05
201	601186	中国铁建	9,100	69,251.00	0.05
202	600266	城建发展	14,300	69,212.00	0.05
203	002600	领益智造	10,200	68,952.00	0.05
204	002695	煌上煌	6,500	68,055.00	0.05
205	600750	江中药业	3,100	64,728.00	0.05
206	600298	安琪酵母	1,800	63,324.00	0.05
207	600461	洪城环境	6,800	62,152.00	0.05
208	002773	康弘药业	3,300	60,852.00	0.04
209	300130	新国都	2,500	60,500.00	0.04
210	601579	会稽山	5,600	60,144.00	0.04
211	300791	仙乐健康	1,700	58,922.00	0.04
212	603681	永冠新材	3,900	58,890.00	0.04
213	000915	华特达因	2,000	57,920.00	0.04
214	000926	福星股份	13,800	57,546.00	0.04
215	301283	聚胶股份	1,700	55,896.00	0.04
216	601825	沪农商行	9,700	55,678.00	0.04
217	603093	南华期货	4,600	55,200.00	0.04
218	000507	珠海港	10,400	54,704.00	0.04
219	688395	正弦电气	2,352	54,072.48	0.04
220	603096	新经典	2,700	53,136.00	0.04
221	002171	楚江新材	7,100	53,108.00	0.04

222	002025	航天电器	1,100	52,822.00	0.04
223	002946	新乳业	4,600	52,808.00	0.04
224	002271	东方雨虹	2,700	51,840.00	0.04
225	002956	西麦食品	3,600	51,588.00	0.04
226	600380	健康元	4,100	50,963.00	0.04
227	002438	江苏神通	4,200	50,190.00	0.04
228	002017	东信和平	4,800	49,968.00	0.04
229	600267	海正药业	5,300	49,608.00	0.04
230	000933	神火股份	2,800	47,040.00	0.03
231	688251	井松智能	1,609	46,789.72	0.03
232	002429	兆驰股份	8,100	45,198.00	0.03
233	601211	国泰君安	3,000	44,640.00	0.03
234	600929	雪天盐业	6,900	44,505.00	0.03
235	002519	银河电子	7,200	44,424.00	0.03
236	688100	威胜信息	1,517	43,871.64	0.03
237	603259	药明康德	600	43,656.00	0.03
238	603300	华铁应急	6,700	42,880.00	0.03
239	003011	海象新材	1,900	40,337.00	0.03
240	600928	西安银行	12,100	40,293.00	0.03
241	688312	燕麦科技	1,941	40,081.65	0.03
242	002605	姚记科技	1,800	39,996.00	0.03
243	300955	嘉亨家化	1,800	39,798.00	0.03
244	600976	健民集团	600	39,150.00	0.03
245	603527	众源新材	3,600	38,916.00	0.03
246	600369	西南证券	9,500	38,855.00	0.03
247	000951	中国重汽	2,900	38,744.00	0.03
248	603215	比依股份	2,200	38,060.00	0.03
249	603368	柳药集团	2,000	37,840.00	0.03
250	688391	钜泉科技	759	37,646.40	0.03
251	600219	南山铝业	12,700	37,338.00	0.03
252	002643	万润股份	2,221	36,846.39	0.03

253	300406	九强生物	1,900	36,290.00	0.03
254	000568	泸州老窖	200	35,884.00	0.03
255	603506	南都物业	3,300	35,871.00	0.03
256	605266	健之佳	600	35,640.00	0.03
257	000404	长虹华意	6,000	35,340.00	0.03
258	000521	长虹美菱	6,200	34,906.00	0.03
259	605088	冠盛股份	1,500	34,500.00	0.03
260	601618	中国中冶	11,200	34,272.00	0.03
261	600583	海油工程	5,700	33,858.00	0.02
262	600104	上汽集团	2,500	33,825.00	0.02
263	605116	奥锐特	1,300	33,566.00	0.02
264	688257	新锐股份	1,340	33,553.60	0.02
265	002409	雅克科技	600	33,438.00	0.02
266	600377	宁沪高速	3,200	32,800.00	0.02
267	600282	南钢股份	8,800	32,560.00	0.02
268	688559	海目星	884	31,558.80	0.02
269	600875	东方电气	2,100	30,702.00	0.02
270	688389	普门科技	1,354	30,478.54	0.02
271	688335	复洁环保	2,363	30,317.29	0.02
272	688315	诺禾致源	1,235	28,824.90	0.02
273	601766	中国中车	5,200	27,352.00	0.02
274	002111	威海广泰	3,000	27,180.00	0.02
275	002367	康力电梯	3,600	27,072.00	0.02
276	000935	四川双马	1,500	26,880.00	0.02
277	688579	山大地纬	2,114	26,847.80	0.02
278	002032	苏泊尔	500	26,505.00	0.02
279	002540	亚太科技	4,000	26,440.00	0.02
280	000885	城发环境	2,300	26,082.00	0.02
281	300697	电工合金	2,000	25,840.00	0.02
282	600557	康缘药业	1,200	24,624.00	0.02
283	000725	京东方 A	6,200	24,180.00	0.02

284	603508	思维列控	1,500	23,550.00	0.02
285	300987	川网传媒	1,300	23,036.00	0.02
286	600459	贵研铂业	1,600	22,976.00	0.02
287	605009	豪悦护理	600	22,902.00	0.02
288	600958	东方证券	2,600	22,620.00	0.02
289	601375	中原证券	5,800	22,214.00	0.02
290	002461	珠江啤酒	2,800	22,120.00	0.02
291	000333	美的集团	400	21,852.00	0.02
292	002809	红墙股份	2,000	21,760.00	0.02
293	002749	国光股份	1,800	21,564.00	0.02
294	600372	中航机载	1,600	21,088.00	0.02
295	688314	康拓医疗	639	21,029.49	0.02
296	600765	中航重机	1,100	21,021.00	0.02
297	002027	分众传媒	3,300	20,856.00	0.02
298	601952	苏垦农发	2,000	20,480.00	0.01
299	002236	大华股份	1,100	20,295.00	0.01
300	600572	康恩贝	4,000	20,200.00	0.01
301	600216	浙江医药	1,800	19,314.00	0.01
302	000589	贵州轮胎	3,100	18,972.00	0.01
303	688508	芯朋微	374	18,404.54	0.01
304	002276	万马股份	1,800	18,396.00	0.01
305	603661	恒林股份	400	17,828.00	0.01
306	000400	许继电气	800	17,568.00	0.01
307	002807	江阴银行	4,900	17,395.00	0.01
308	002990	盛视科技	500	17,265.00	0.01
309	600271	航天信息	1,600	17,024.00	0.01
310	600489	中金黄金	1,700	16,932.00	0.01
311	600999	招商证券	1,200	16,368.00	0.01
312	688121	卓然股份	807	16,325.61	0.01
313	002815	崇达技术	1,700	16,286.00	0.01
314	605166	聚合顺	1,600	15,872.00	0.01

315	601218	吉鑫科技	3,900	15,600.00	0.01
316	603165	荣晟环保	1,300	15,574.00	0.01
317	000625	长安汽车	900	15,147.00	0.01
318	300872	天阳科技	1,100	15,048.00	0.01
319	601669	中国电建	3,000	14,670.00	0.01
320	600879	航天电子	1,800	13,878.00	0.01
321	601000	唐山港	3,900	13,650.00	0.01
322	601607	上海医药	800	13,384.00	0.01
323	688087	英科再生	554	13,340.32	0.01
324	688456	有研粉材	464	13,070.88	0.01
325	688006	杭可科技	549	12,890.52	0.01
326	688278	特宝生物	236	12,354.60	0.01
327	000869	张裕A	500	12,070.00	0.01
328	002507	涪陵榨菜	800	11,432.00	0.01
329	300621	维业股份	900	10,341.00	0.01
330	300994	久祺股份	700	10,290.00	0.01
331	002824	和胜股份	500	10,285.00	0.01
332	603799	华友钴业	300	9,879.00	0.01
333	000156	华数传媒	1,300	9,581.00	0.01
334	601811	新华文轩	300	4,098.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600941	中国移动	3,059,530.00	61.04
2	000932	华菱钢铁	2,071,859.00	41.34
3	601388	怡球资源	1,815,315.00	36.22
4	605288	凯迪股份	1,720,666.00	34.33

5	600918	中泰证券	1,686,528.00	33.65
6	000166	申万宏源	1,650,555.00	32.93
7	002275	桂林三金	1,495,858.00	29.85
8	600480	凌云股份	1,463,965.00	29.21
9	300246	宝莱特	1,440,407.00	28.74
10	301235	华康医疗	1,436,150.00	28.65
11	301208	中亦科技	1,425,979.00	28.45
12	000737	北方铜业	1,417,882.00	28.29
13	002732	燕塘乳业	1,408,413.00	28.10
14	601857	中国石油	1,405,903.00	28.05
15	600482	中国动力	1,396,830.00	27.87
16	603926	铁流股份	1,395,915.00	27.85
17	600060	海信视像	1,331,550.00	26.57
18	300687	赛意信息	1,302,680.00	25.99
19	000858	五粮液	1,299,129.00	25.92
20	603611	诺力股份	1,245,480.00	24.85
21	300897	山科智能	1,244,515.00	24.83
22	688092	爱科科技	1,238,348.61	24.71
23	300073	当升科技	1,225,660.00	24.45
24	002155	湖南黄金	1,201,958.00	23.98
25	600642	申能股份	1,135,842.00	22.66
26	603579	荣泰健康	1,133,405.00	22.61
27	301096	百诚医药	1,117,804.00	22.30
28	688819	天能股份	1,115,836.37	22.26
29	600028	中国石化	1,098,017.00	21.91
30	002968	新大正	1,052,779.00	21.00
31	301102	兆讯传媒	1,038,151.00	20.71
32	300870	欧陆通	1,024,678.00	20.44
33	300452	山河药辅	1,003,272.00	20.02
34	603309	维力医疗	999,767.00	19.95
35	600066	宇通客车	991,352.00	19.78

36	688138	清溢光电	977,546.65	19.50
37	000739	普洛药业	975,024.00	19.45
38	601169	北京银行	960,330.00	19.16
39	600985	淮北矿业	955,486.00	19.06
40	300218	安利股份	948,249.00	18.92
41	601077	渝农商行	946,219.00	18.88
42	688239	航宇科技	944,145.07	18.84
43	688510	航亚科技	936,721.84	18.69
44	002478	常宝股份	912,603.00	18.21
45	688401	路维光电	904,839.42	18.05
46	603676	卫信康	898,640.00	17.93
47	605287	德才股份	883,793.00	17.63
48	000733	振华科技	870,989.00	17.38
49	600098	广州发展	861,490.00	17.19
50	600285	羚锐制药	852,601.00	17.01
51	301219	腾远钴业	836,510.00	16.69
52	002873	新天药业	831,001.00	16.58
53	688589	力合微	830,090.24	16.56
54	002130	沃尔核材	825,884.00	16.48
55	688018	乐鑫科技	825,832.22	16.48
56	300389	艾比森	822,888.00	16.42
57	300543	朗科智能	816,030.00	16.28
58	603096	新经典	815,936.00	16.28
59	603589	口子窖	811,273.00	16.19
60	002829	星网宇达	806,461.00	16.09
61	002085	万丰奥威	797,083.00	15.90
62	603238	诺邦股份	797,045.00	15.90
63	688687	凯因科技	795,444.02	15.87
64	601098	中南传媒	795,160.00	15.86
65	601958	金钼股份	788,276.00	15.73
66	301319	唯特偶	780,919.30	15.58

67	600566	济川药业	774,167.00	15.45
68	688501	青达环保	768,598.86	15.33
69	600312	平高电气	768,268.00	15.33
70	600998	九州通	763,060.00	15.22
71	002271	东方雨虹	758,244.00	15.13
72	300971	博亚精工	752,100.00	15.01
73	603365	水星家纺	741,606.00	14.80
74	002156	通富微电	738,362.00	14.73
75	688395	正弦电气	737,623.49	14.72
76	002880	卫光生物	729,948.00	14.56
77	601311	骆驼股份	727,525.00	14.52
78	000100	TCL科技	721,348.00	14.39
79	000513	丽珠集团	720,536.00	14.38
80	300743	天地数码	711,143.00	14.19
81	300618	寒锐钴业	708,925.00	14.14
82	603507	振江股份	703,815.00	14.04
83	603089	正裕工业	691,884.00	13.80
84	002237	恒邦股份	687,795.00	13.72
85	600928	西安银行	677,933.00	13.53
86	301222	浙江恒威	677,266.00	13.51
87	688599	天合光能	675,263.89	13.47
88	600325	华发股份	674,304.00	13.45
89	600557	康缘药业	670,150.00	13.37
90	603198	迎驾贡酒	670,135.00	13.37
91	605123	派克新材	670,097.00	13.37
92	600267	海正药业	663,331.00	13.23
93	603228	景旺电子	657,025.00	13.11
94	300433	蓝思科技	644,851.00	12.87
95	301195	北路智控	640,765.00	12.78
96	688002	睿创微纳	637,358.26	12.72
97	600369	西南证券	633,639.00	12.64

98	688772	珠海冠宇	633,161.49	12.63
99	300636	同和药业	630,401.00	12.58
100	300407	凯发电气	629,848.00	12.57
101	300118	东方日升	628,538.00	12.54
102	002913	奥士康	619,386.00	12.36
103	300219	鸿利智汇	618,693.00	12.34
104	300627	华测导航	618,090.00	12.33
105	002060	粤水电	615,656.00	12.28
106	601825	沪农商行	613,695.00	12.24
107	601390	中国中铁	613,245.00	12.24
108	003036	泰坦股份	609,756.00	12.17
109	003038	鑫铂股份	609,633.00	12.16
110	002422	科伦药业	609,283.00	12.16
111	605167	利柏特	607,649.00	12.12
112	000915	华特达因	605,262.00	12.08
113	000926	福星股份	604,563.00	12.06
114	605088	冠盛股份	602,121.00	12.01
115	603102	百合股份	601,251.00	12.00
116	688601	力芯微	598,976.50	11.95
117	002600	领益智造	597,030.00	11.91
118	688100	威胜信息	593,518.92	11.84
119	603259	药明康德	592,000.00	11.81
120	301107	瑜欣电子	583,718.00	11.65
121	301087	可孚医疗	578,340.00	11.54
122	688391	钜泉科技	568,008.43	11.33
123	301185	鸥玛软件	566,245.00	11.30
124	300232	洲明科技	563,519.00	11.24
125	600104	上汽集团	562,958.00	11.23
126	601688	华泰证券	562,851.00	11.23
127	601555	东吴证券	562,471.00	11.22
128	002605	姚记科技	559,995.00	11.17

129	000507	珠海港	554,633.00	11.07
130	600577	精达股份	551,695.00	11.01
131	600582	天地科技	539,550.00	10.76
132	600637	东方明珠	537,721.00	10.73
133	603368	柳药集团	537,669.00	10.73
134	300866	安克创新	534,838.00	10.67
135	002171	楚江新材	529,592.00	10.57
136	600897	厦门空港	520,489.00	10.38
137	601618	中国中冶	517,935.00	10.33
138	688335	复洁环保	517,399.93	10.32
139	002479	富春环保	514,093.00	10.26
140	603527	众源新材	511,505.00	10.21
141	603215	比依股份	508,566.00	10.15
142	603093	南华期货	507,929.00	10.13
143	000997	新大陆	507,480.00	10.13
144	688621	阳光诺和	503,572.78	10.05
145	002056	横店东磁	501,210.00	10.00
146	601229	上海银行	500,027.00	9.98
147	601211	国泰君安	499,273.00	9.96
148	001218	丽臣实业	498,833.00	9.95
149	300908	仲景食品	494,665.00	9.87
150	600019	宝钢股份	494,358.00	9.86
151	601577	长沙银行	486,694.00	9.71
152	300138	晨光生物	479,063.00	9.56
153	603059	倍加洁	479,004.00	9.56
154	003011	海象新材	472,701.00	9.43
155	002956	西麦食品	467,316.00	9.32
156	300122	智飞生物	466,882.00	9.32
157	688257	新锐股份	466,806.05	9.31
158	601579	会稽山	463,790.00	9.25
159	000690	宝新能源	462,232.00	9.22

160	600938	中国海油	453,240.00	9.04
161	688550	瑞联新材	449,328.08	8.96
162	688618	三旺通信	445,820.63	8.89
163	300922	天秦装备	441,564.00	8.81
164	603755	日辰股份	435,289.00	8.68
165	002773	康弘药业	428,969.00	8.56
166	301003	江苏博云	426,535.00	8.51
167	688121	卓然股份	422,269.90	8.43
168	002438	江苏神通	416,967.00	8.32
169	688559	海目星	413,671.67	8.25
170	300314	戴维医疗	411,834.00	8.22
171	688389	普门科技	408,255.39	8.15
172	002879	长缆科技	408,193.00	8.14
173	601318	中国平安	408,136.00	8.14
174	300568	星源材质	402,256.00	8.03
175	605116	奥锐特	401,490.00	8.01
176	002276	万马股份	399,557.00	7.97
177	000951	中国重汽	396,229.00	7.91
178	301302	华如科技	394,013.00	7.86
179	300829	金丹科技	386,555.00	7.71
180	600517	国网英大	380,810.00	7.60
181	603045	福达合金	380,135.00	7.58
182	600727	鲁北化工	379,860.00	7.58
183	002519	银河电子	375,432.00	7.49
184	603583	捷昌驱动	370,759.00	7.40
185	002643	万润股份	368,486.95	7.35
186	600901	江苏金租	367,605.00	7.33
187	000404	长虹华意	359,840.00	7.18
188	002993	奥海科技	357,048.00	7.12
189	603508	思维列控	356,547.00	7.11
190	600061	国投资本	353,778.00	7.06

191	002580	圣阳股份	351,748.00	7.02
192	688579	山大地纬	347,521.85	6.93
193	600282	南钢股份	346,925.00	6.92
194	600958	东方证券	345,358.00	6.89
195	600377	宁沪高速	339,983.00	6.78
196	688508	芯朋微	339,078.11	6.77
197	002025	航天电器	338,438.00	6.75
198	600459	贵研铂业	335,895.00	6.70
199	002749	国光股份	335,471.00	6.69
200	000768	中航西飞	327,755.00	6.54
201	002594	比亚迪	325,261.00	6.49
202	603156	养元饮品	320,484.00	6.39
203	600765	中航重机	319,508.00	6.37
204	000568	泸州老窖	309,667.00	6.18
205	600483	福能股份	303,076.00	6.05
206	688283	坤恒顺维	290,696.83	5.80
207	605377	华旺科技	288,758.00	5.76
208	603456	九洲药业	288,355.00	5.75
209	600685	中船防务	287,878.00	5.74
210	600489	中金黄金	287,538.00	5.74
211	300017	网宿科技	284,830.00	5.68
212	603300	华铁应急	283,674.00	5.66
213	002409	雅克科技	283,438.00	5.66
214	000960	锡业股份	283,011.00	5.65
215	300130	新国都	275,097.00	5.49
216	002540	亚太科技	274,124.00	5.47
217	300589	江龙船艇	273,166.00	5.45
218	601186	中国铁建	269,359.00	5.37
219	301215	中汽股份	269,188.00	5.37
220	603165	荣晟环保	263,818.00	5.26
221	002111	威海广泰	253,357.00	5.05

222	601811	新华文轩	250,422.00	5.00
223	301283	聚胶股份	247,107.00	4.93
224	688503	聚和材料	245,847.81	4.91
225	603320	迪贝电气	242,963.00	4.85
226	300395	菲利华	234,993.00	4.69
227	000725	京东方 A	232,851.00	4.65
228	000885	城发环境	232,040.00	4.63
229	002461	珠江啤酒	231,810.00	4.63
230	603690	至纯科技	227,713.00	4.54
231	600875	东方电气	227,387.00	4.54
232	600012	皖通高速	223,717.00	4.46
233	002027	分众传媒	223,261.00	4.45
234	000521	长虹美菱	219,644.00	4.38
235	000935	四川双马	212,806.00	4.25
236	002423	中粮资本	211,859.00	4.23
237	300319	麦捷科技	211,354.00	4.22
238	301076	新瀚新材	210,432.00	4.20
239	300900	广联航空	200,310.00	4.00
240	600999	招商证券	197,009.00	3.93
241	600967	内蒙一机	196,147.00	3.91
242	002236	大华股份	193,336.00	3.86
243	000589	贵州轮胎	191,367.00	3.82
244	002017	东信和平	190,115.00	3.79
245	601138	工业富联	189,976.00	3.79
246	601218	吉鑫科技	189,359.00	3.78
247	688087	英科再生	188,990.14	3.77
248	002809	红墙股份	183,954.00	3.67
249	601607	上海医药	178,378.00	3.56
250	601669	中国电建	172,725.00	3.45
251	301207	华兰疫苗	171,206.00	3.42
252	002815	崇达技术	169,466.00	3.38

253	600284	浦东建设	164,002.00	3.27
254	300406	九强生物	161,010.00	3.21
255	600409	三友化工	160,369.00	3.20
256	601000	唐山港	158,159.00	3.16
257	600372	中航机载	156,560.00	3.12
258	000682	东方电子	153,200.00	3.06
259	603799	华友钴业	152,253.00	3.04
260	002179	中航光电	151,271.00	3.02
261	688278	特宝生物	143,649.38	2.87
262	600456	宝钛股份	143,418.00	2.86
263	000651	格力电器	139,485.00	2.78
264	000728	国元证券	137,661.00	2.75
265	002648	卫星化学	137,414.00	2.74
266	000400	许继电气	132,317.00	2.64
267	002203	海亮股份	126,673.00	2.53
268	688106	金宏气体	118,035.27	2.36
269	600741	华域汽车	115,872.00	2.31
270	600559	老白干酒	112,885.00	2.25
271	000661	长春高新	111,024.00	2.22
272	300564	筑博设计	105,867.00	2.11
273	603218	日月股份	101,836.00	2.03
274	688682	霍莱沃	101,471.09	2.02
275	000922	佳电股份	100,610.00	2.01

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

2、“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	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金
---	------	------	----------	-------

号				资产净值比例(%)
1	603096	新经典	902,076.00	18.00
2	601169	北京银行	863,029.00	17.22
3	605287	德才股份	768,809.00	15.34
4	688395	正弦电气	733,023.66	14.63
5	600557	康缘药业	722,303.00	14.41
6	600104	上汽集团	661,562.00	13.20
7	002600	领益智造	652,720.00	13.02
8	688772	珠海冠宇	640,443.05	12.78
9	603259	药明康德	632,152.00	12.61
10	600928	西安银行	621,688.00	12.40
11	600098	广州发展	621,162.00	12.39
12	605288	凯迪股份	612,882.00	12.23
13	600482	中国动力	611,414.00	12.20
14	600480	凌云股份	607,006.00	12.11
15	600267	海正药业	599,206.00	11.96
16	605123	派克新材	590,272.00	11.78
17	000915	华特达因	587,242.00	11.72
18	688391	钜泉科技	580,047.71	11.57
19	688589	力合微	566,858.98	11.31
20	300627	华测导航	563,493.00	11.24
21	002605	姚记科技	556,342.00	11.10
22	605088	冠盛股份	551,290.00	11.00
23	300636	同和药业	546,782.00	10.91
24	600369	西南证券	543,829.00	10.85
25	000932	华菱钢铁	539,577.00	10.77
26	601825	沪农商行	532,885.00	10.63
27	000507	珠海港	527,048.00	10.52
28	300118	东方日升	522,024.00	10.42
29	002271	东方雨虹	518,812.00	10.35

30	688100	威胜信息	515,452.72	10.28
31	300407	凯发电气	510,369.00	10.18
32	603527	众源新材	508,963.00	10.15
33	000926	福星股份	508,473.00	10.14
34	002478	常宝股份	502,742.00	10.03
35	300743	天地数码	497,944.00	9.93
36	601211	国泰君安	494,263.00	9.86
37	688335	复洁环保	482,798.12	9.63
38	000513	丽珠集团	472,093.00	9.42
39	688121	卓然股份	471,546.08	9.41
40	002956	西麦食品	469,131.00	9.36
41	603368	柳药集团	466,056.00	9.30
42	601618	中国中冶	463,862.00	9.25
43	600637	东方明珠	461,272.00	9.20
44	002171	楚江新材	455,293.00	9.08
45	600941	中国移动	454,661.00	9.07
46	603215	比依股份	453,766.00	9.05
47	300232	洲明科技	453,360.00	9.05
48	301185	鸥玛软件	451,207.00	9.00
49	301195	北路智控	450,382.00	8.99
50	002773	康弘药业	446,171.00	8.90
51	601311	骆驼股份	437,750.00	8.73
52	003011	海象新材	431,516.00	8.61
53	601688	华泰证券	429,345.00	8.57
54	603093	南华期货	420,546.00	8.39
55	301107	瑜欣电子	414,355.00	8.27
56	000858	五粮液	414,218.00	8.26
57	002519	银河电子	409,937.00	8.18
58	002438	江苏神通	399,945.00	7.98
59	300908	仲景食品	399,771.00	7.98
60	002237	恒邦股份	397,801.00	7.94

61	688002	睿创微纳	396,112.94	7.90
62	300866	安克创新	391,447.00	7.81
63	002275	桂林三金	390,032.00	7.78
64	600582	天地科技	387,488.00	7.73
65	601229	上海银行	386,802.00	7.72
66	688257	新锐股份	385,973.63	7.70
67	000951	中国重汽	376,597.00	7.51
68	002236	大华股份	373,554.00	7.45
69	002276	万马股份	371,966.00	7.42
70	601579	会稽山	367,510.00	7.33
71	300314	戴维医疗	366,158.00	7.31
72	688389	普门科技	365,562.65	7.29
73	605116	奥锐特	362,159.00	7.23
74	688579	山大地纬	360,257.35	7.19
75	002085	万丰奥威	359,414.00	7.17
76	601390	中国中铁	356,884.00	7.12
77	600519	贵州茅台	356,457.00	7.11
78	600036	招商银行	347,133.00	6.93
79	688508	芯朋微	342,463.46	6.83
80	600958	东方证券	340,398.00	6.79
81	600377	宁沪高速	329,122.00	6.57
82	600897	厦门空港	328,268.00	6.55
83	300750	宁德时代	328,134.00	6.55
84	003038	鑫铂股份	327,153.00	6.53
85	002749	国光股份	326,164.00	6.51
86	600887	伊利股份	324,825.00	6.48
87	600765	中航重机	322,894.00	6.44
88	600459	贵研铂业	320,583.00	6.40
89	301302	华如科技	317,373.00	6.33
90	688559	海目星	316,721.12	6.32
91	301003	江苏博云	314,500.00	6.27

92	002643	万润股份	312,387.00	6.23
93	600282	南钢股份	309,222.00	6.17
94	603508	思维列控	301,516.00	6.02
95	002409	雅克科技	300,048.00	5.99
96	000404	长虹华意	295,671.00	5.90
97	000166	申万宏源	291,136.00	5.81
98	002540	亚太科技	284,995.00	5.69
99	300433	蓝思科技	265,443.00	5.30
100	603300	华铁应急	262,355.00	5.23
101	600489	中金黄金	256,635.00	5.12
102	002111	威海广泰	252,724.00	5.04
103	301076	新瀚新材	251,390.00	5.02
104	603589	口子窖	246,646.00	4.92
105	601811	新华文轩	240,743.00	4.80
106	301222	浙江恒威	240,399.00	4.80
107	002025	航天电器	239,326.00	4.77
108	300017	网宿科技	231,703.00	4.62
109	301283	聚胶股份	228,235.00	4.55
110	300130	新国都	221,749.00	4.42
111	000568	泸州老窖	221,284.00	4.42
112	000885	城发环境	220,258.00	4.39
113	603899	晨光股份	214,204.00	4.27
114	603045	福达合金	213,409.00	4.26
115	002461	珠江啤酒	212,767.00	4.25
116	300782	卓胜微	208,210.00	4.15
117	603165	荣晟环保	205,535.00	4.10
118	000935	四川双马	201,800.00	4.03
119	688087	英科再生	200,237.94	4.00
120	600483	福能股份	199,763.00	3.99
121	000725	京东方A	197,372.00	3.94
122	002027	分众传媒	196,599.00	3.92

123	600901	江苏金租	193,480.00	3.86
124	601218	吉鑫科技	190,677.00	3.80
125	601186	中国铁建	190,410.00	3.80
126	002993	奥海科技	189,833.00	3.79
127	600875	东方电气	183,112.00	3.65
128	002809	红墙股份	177,917.00	3.55
129	002130	沃尔核材	174,896.00	3.49
130	600999	招商证券	170,866.00	3.41
131	688599	天合光能	167,876.78	3.35
132	688278	特宝生物	164,812.20	3.29
133	000521	长虹美菱	162,458.00	3.24
134	300014	亿纬锂能	160,886.00	3.21
135	002815	崇达技术	159,780.00	3.19
136	601012	隆基绿能	158,797.00	3.17
137	000589	贵州轮胎	155,265.00	3.10
138	000739	普洛药业	153,630.00	3.07
139	601818	光大银行	153,375.00	3.06
140	601000	唐山港	151,203.00	3.02
141	601607	上海医药	147,521.00	2.94
142	603799	华友钴业	146,850.00	2.93
143	601669	中国电建	144,394.00	2.88
144	601318	中国平安	143,778.00	2.87
145	002156	通富微电	143,659.00	2.87
146	600566	济川药业	139,782.00	2.79
147	603228	景旺电子	137,793.00	2.75
148	603986	兆易创新	136,328.00	2.72
149	300589	江龙船艇	135,355.00	2.70
150	000400	许继电气	131,104.00	2.62
151	600372	中航机载	130,972.00	2.61
152	300406	九强生物	130,692.00	2.61
153	000333	美的集团	129,270.00	2.58

154	301219	腾远钴业	128,841.00	2.57
155	601555	东吴证券	126,559.00	2.53
156	300759	康龙化成	124,588.00	2.49
157	002017	东信和平	124,387.00	2.48
158	601857	中国石油	123,589.00	2.47
159	603690	至纯科技	118,249.00	2.36
160	688012	中微公司	117,872.00	2.35
161	688239	航宇科技	115,900.53	2.31
162	603102	百合股份	110,799.00	2.21
163	603611	诺力股份	110,049.00	2.20
164	688981	中芯国际	101,275.95	2.02

注：1、卖出主要指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、“卖出金额”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。

8.4.3 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	164,780,832.66
卖出股票收入（成交）总额	57,287,999.07

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指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”、“卖出股票收入”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

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	7,503,100.28	5.49
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	7,503,100.28	5.49

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	66,000	6,693,701.92	4.90
2	019678	22国债13	8,000	809,398.36	0.59
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	19,084.05
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,742,395.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,761,479.94

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
东兴未来 价值混合A	345	198,822.04	0.00	0.00%	68,593,603.69	100.00%
东兴未来 价值混合C	349	217,765.97	26,901,969.22	35.40%	49,098,356.00	64.60%
合计	694	208,348.60	26,901,969.22	18.61%	117,691,959.69	81.39%

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	东兴未来价值混合A	322.59	0.00%
	东兴未来价值混合C	53,407.39	0.07%
	合计	53,729.98	0.04%

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、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	东兴未来价值混合A	0
	东兴未来价值混合C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	东兴未来价值混合A	0~10
	东兴未来价值混合C	0
	合计	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	东兴未来价值混合A	东兴未来价值混合C
基金合同生效日(2019年07月26 日)基金份额总额	200,090,407.68	10,000,675.00
本报告期期初基金份额总额	5,153,011.98	-
本报告期基金总申购份额	64,284,851.17	115,848,412.10
减：本报告期基金总赎回份额	844,259.46	39,848,086.88

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	68,593,603.69	76,000,325.22

§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

本基金管理人总经理王青于2023年8月2日离任，同日起由董事长牛南洁代任总经理。

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未更换会计师事务所。本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用19,000.00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，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备
------	-----	------	-----------	---

	元数量	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	注
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	2	173,716,494.47	78.23%	94,831.53	72.75%	-
东兴证券股份有限公司	2	48,352,337.26	21.77%	35,520.85	27.25%	-

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易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

券商选择标准：财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强的证券公司。其中财务状况良好、经营行为规范以最近一年证券公司分类评介在C类或C类以上，且近一年内无重大违法违规事件为主要判断依据。研究实力较强以公司的评价意见为主要判断依据。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

3、本基金本报告期内未新增交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	5,892,970.00	30.07%	48,500,000.00	12.14%	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	13,704,813.00	69.93%	351,051,000.00	87.86%	-	-	-	-

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	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金2022年第4季度报告	指定网站	2023-01-20
2	关于增加中证金牛（北京）基金销售有限公司	指定报刊、指定网站	2023-01-30

	公司为东兴基金管理有限公司公开募集证券投资基金的销售机构的公告		
3	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议	指定网站	2023-03-02
4	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同	指定网站	2023-03-02
5	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金降低管理费并修订基金合同及托管协议的公告	指定报刊、指定网站	2023-03-02
6	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）(2023年第1号)	指定网站	2023-03-04
7	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	指定网站	2023-03-04
8	关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为东兴基金管理有限公司公开募集证券投资基金的销售机构的公告	指定报刊、指定网站	2023-03-15
9	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金2022年年度报告	指定网站	2023-03-31
10	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金2023年第一季度报告	指定网站	2023-04-21
11	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	指定网站	2023-05-24
12	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）(2023年第2号)	指定网站	2023-05-24
13	关于增加麦高证券有限公司为东兴基金管理有限公司公开募集证券投资基金的销售机构的公告	指定报刊、指定网站	2023-05-25
14	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金2023年第二季度报告	指定网站	2023-07-21
15	东兴基金管理有限公司高级管理人员变更公告	指定报刊、指定网站	2023-08-04
16	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金2023年中期报告	指定网站	2023-08-31
17	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	指定报刊、指定网站	2023-09-11
18	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	指定网站	2023-09-13

19	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）(2023年第4号)	指定网站	2023-09-13
20	关于调整东兴未来价值灵活配置混合C类基金份额首笔申购的最低金额、每笔追加申购的最低金额、每笔转换转入的最低金额及每笔定期定额投资的最低金额的公告	指定报刊、指定网站	2023-09-27
21	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）(2023年第3号)	指定网站	2023-09-28
22	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金2023年第3季度报告	指定网站	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023年8月28日-2023年12月25日	-	26,901,969.22	-	26,901,969.22	18.61%
	2	2023年8月28日-2023年10月16日	-	26,901,969.22	26,901,969.22	-	0.00%
个人	1	2023年12月22日-2023年12月31日	-	54,134,906.89	-	54,134,906.89	37.44%

产品特有风险

1、本基金为混合型基金，基金资产主要投资于股票市场与债券市场，因此股市、债市的变化将影响到基金业绩表现。本基金股票投资占基金资产的比例为0-95%，在灵活调整资产配置比例时，不能完全抵御市场整体下跌风险，基金净值表现因此可能受到影响。本基金管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。此外，由于本基金还可以投资其他品种，这些品种的价格也可能因市场中的各类变化而出现一定幅度的波动，产生特定的风险，并影响到整体基金的投资收益。

2、本基金可投资股指期货，股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，指数微小的变动就可能使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

3、本基金可投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券，基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，但由于资产支持证券具有一定的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿还风险等风险，可能导致包括基金净值波动在内的各项风险。

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、中国证监会核准东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- 二、《东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 三、《东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 四、《东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 五、中国证监会颁发的经营证券期货业务许可证、营业执照、公司章程

13.2 存放地点

北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层

13.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.dxamc.cn）查阅。

东兴基金管理有限公司
二〇二四年三月二十九日