

金元顺安优质精选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:金元顺安基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2024 年 03 月 30 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年03月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2023年01月01日起至2023年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	18
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	18
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	18
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	18
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	25
7.4 报表附注	27
§8 投资组合报告	64
8.1 期末基金资产组合情况	64
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	65
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	66
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	80
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	113
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	113
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	114
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	114
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	114

8.10	本基金投资股指期货的投资政策	114
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	114
8.12	投资组合报告附注	114
§9	基金份额持有人信息	115
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	116
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	116
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	117
§10	开放式基金份额变动	117
§11	重大事件揭示	118
11.1	基金份额持有人大会决议	118
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	118
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	118
11.4	基金投资策略的改变	118
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	118
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	118
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	118
11.8	其他重大事件	122
§12	影响投资者决策的其他重要信息	128
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	128
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	129
§13	备查文件目录	129
13.1	备查文件目录	129
13.2	存放地点	129
13.3	查阅方式	129

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	金元顺安优质精选灵活配置混合	
基金主代码	620007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年10月10日	
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,164,135,264.80份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金元顺安优质精选灵活配置混合A类	金元顺安优质精选灵活配置混合C类
下属分级基金的交易代码	620007	001375
报告期末下属分级基金的份额总额	774,588,965.57份	1,389,546,299.23份

注：

- 1、"金元比联保本混合型证券投资基金"（系本基金前身）合同生效日为2011年08月16日。自2017年10月10日起，本基金转型为混合型证券投资基金。故本报告中，本基金基金合同生效日为2017年10月10日。
- 2、本基金自2015年06月02日起，新增C类份额。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在在正确认识中国经济发展特点的基础上，透过投资于优质股票和票息优势的固定收益证券，并结合严格风险管理，为投资者带来稳定的当期收益与长期的资本增值。
投资策略	本基金的大类资产配置策略的关键在于自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析的有机结合。股票投资采取行业配置指导下的个股精选方法；债券投资组合以具票息优势的债券作为主要投资对象，并通过对债券的信用、久期和凸性等的灵活配置，进行

	相对积极主动的操作，力争获取超越债券基准的收益；权证投资主要考虑运用的策略包括：限量投资、趋势投资、优化组合策略、价差策略、双向权证策略等；资产支持证券投资主要分析资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+中国债券总指数收益率×45%
风险收益特征	本基金系混合型基金，其风险收益特征从长期平均及预期来看，低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金，属于中等风险、中等收益的证券投资基金品种。

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	金元顺安基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	封涌
	联系电话	021-68881801
	电子邮箱	service@jysa99.com
客户服务电话	400-666-0666	95599
传真	021-68881875	010-68121816
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	200120	100031
法定代表人	任开宇	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.jysa99.com
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
注册登记机构	金元顺安基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室

§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	
	金元顺安优质精选灵活配置混合A类	金元顺安优质精选灵活配置混合C类	金元顺安优质精选灵活配置混合A类	金元顺安优质精选灵活配置混合C类	金元顺安优质精选灵活配置混合A类	金元顺安优质精选灵活配置混合C类
本期已实现收益	53,445,319.59	90,085,760.35	-555,585.54	-6,501,115.37	3,316,276.26	50,891,790.67
本期利润	53,431,388.23	89,506,390.09	-1,050,133.00	-11,966,530.18	-179,740.14	5,987,413.60
加权平均基金份额本期利润	0.2685	0.2561	-0.2637	-0.2606	-0.0417	0.0806
本期加权平均净值利润率	15.56%	14.84%	-17.72%	-17.56%	-2.42%	4.71%

本期基金份额净值增长率	28.60%	29.06%	-15.79%	-15.88%	-3.02%	-3.05%
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	678,277,542.84	961,191,399.83	2,081,802.91	17,477,868.35	2,912,146.21	29,444,398.53
期末可供分配基金份额利润	0.8757	0.6917	0.4790	0.3807	0.7391	0.6413
期末基金资产净值	1,381,314,509.82	2,475,972,216.49	6,026,246.09	63,393,361.31	6,488,149.91	75,359,891.49
期末基金份额净值	1.7833	1.7819	1.3867	1.3807	1.6468	1.6413
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	53.87%	53.88%	19.65%	19.23%	42.09%	41.74%

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（为期末余额，不是当期发生数）；
- 3、表中的“期末”均指报告期最后一日，即12月31日；
- 4、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

金元顺安优质精选灵活配置混合A类

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	4.13%	0.83%	-3.51%	0.44%	7.64%	0.39%
过去六个月	8.90%	0.81%	-5.59%	0.46%	14.49%	0.35%

过去一年	28.60%	0.80%	-5.52%	0.46%	34.12%	0.34%
过去三年	5.02%	0.97%	-18.12%	0.61%	23.14%	0.36%
过去五年	96.18%	1.08%	12.50%	0.66%	83.68%	0.42%
自基金转型起至今	53.87%	1.04%	0.48%	0.66%	53.39%	0.38%

金元顺安优质精选灵活配置混合C类

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	4.11%	0.83%	-3.51%	0.44%	7.62%	0.39%
过去六个月	8.85%	0.81%	-5.59%	0.46%	14.44%	0.35%
过去一年	29.06%	0.80%	-5.52%	0.46%	34.58%	0.34%
过去三年	5.25%	0.97%	-18.12%	0.61%	23.37%	0.36%
过去五年	96.68%	1.07%	12.50%	0.66%	84.18%	0.41%
自基金转型起至今	53.88%	1.04%	0.48%	0.66%	53.40%	0.38%

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金元顺安优质精选灵活配置混合A类累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年10月10日-2023年12月31日)



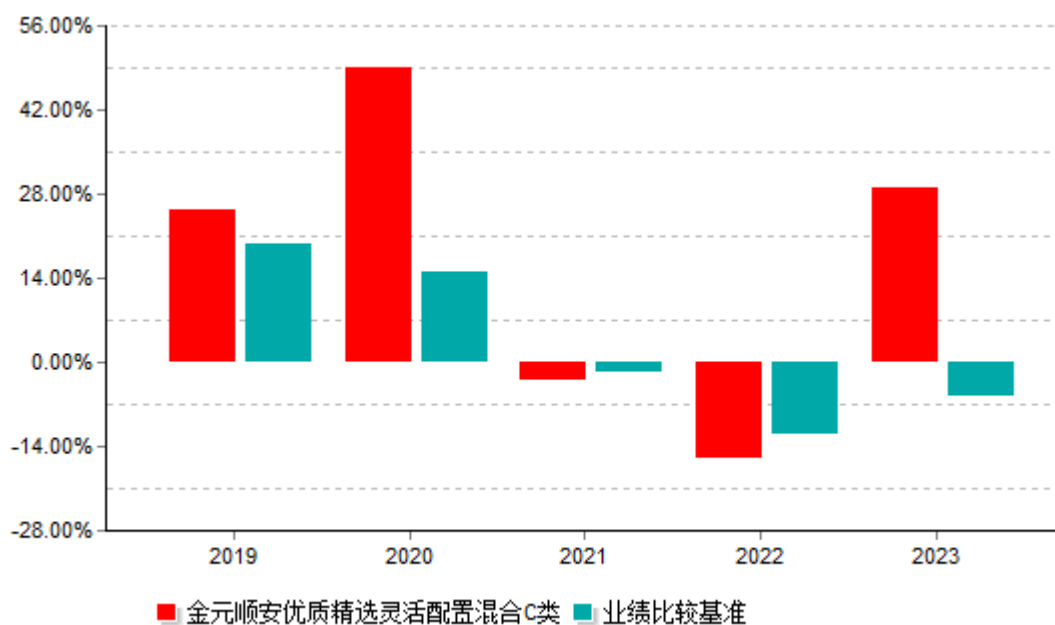
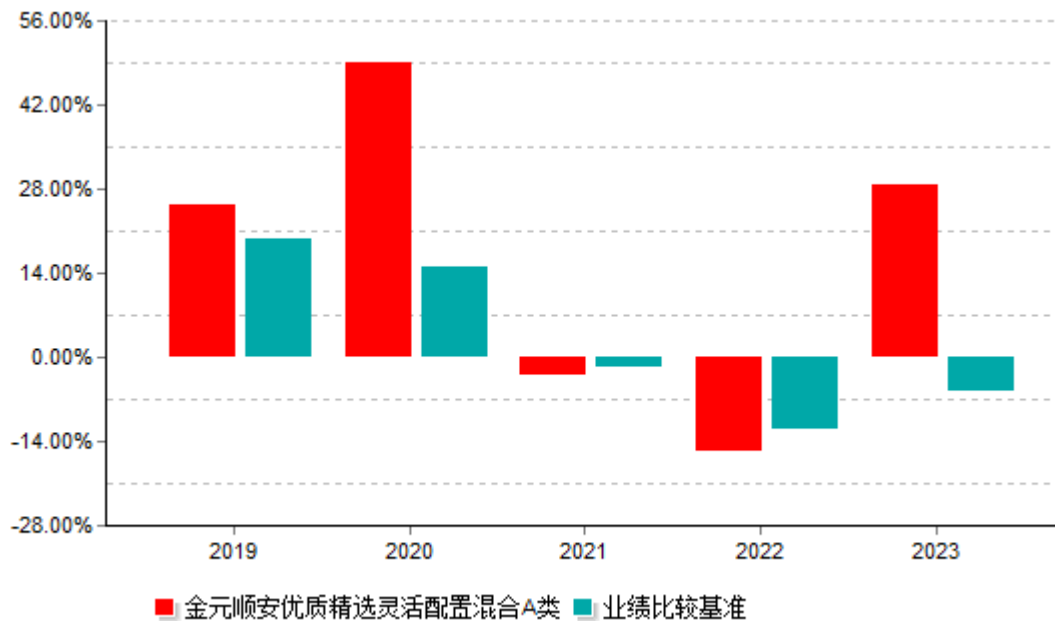
金元顺安优质精选灵活配置混合C类累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年10月10日-2023年12月31日)



注：

- 1、“金元比联保本混合型证券投资基金”（系本基金前身，以下简称“本基金”）合同生效日为2011年08月16日。自2017年10月10日起，本基金转型为混合型证券投资基金，业绩基准累计增长率以2017年10月09日指数为基准；
- 2、本基金投资组合中股票、存托凭证、权证的投资比例为基金资产的30%—80%；债券、货币市场工具等占基金资产的20%—70%，其中，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- 3、本基金业绩比较基准为“沪深300指数收益率×55%+中国债券总指数收益率×45%”。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行过利润分配。

§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

金元比联基金管理有限公司（以下简称“金元比联”、“公司”或“本基金管理人”，系金元顺安基金管理有限公司前身）成立于2006年11月，由金元证券股份有限公司（以下简称“金元证券”）与比利时联合资产管理公司（以下简称“比联资管”）共同发起设立的中外合资基金管理有限公司。公司总部设在上海陆家嘴，旗下设立北京分公司及子公司--上海金元百利资产管理有限公司。

2012年03月，经中国证监会核准，比联资管将所持有的金元比联49%股权转让于惠理基金管理香港有限公司（以下简称“惠理香港”），公司更名为金元惠理基金管理有限公司（以下简称“金元惠理”）。

2012年10月，经中国证监会核准，公司双方股东按持股比例向公司增资人民币9,500万元，公司注册资本增加至24,500万元。

2016年03月，经中国证监会核准，惠理香港将所持有的金元惠理49%股权转让于上海泉意金融信息服务有限公司（以下简称“泉意金融”），公司更名为金元顺安基金管理有限公司（以下简称“金元顺安”）。

2017年11月，经中国证监会核准，公司双方股东按持股比例向公司增资人民币9,500万元，公司注册资本增加至34,000万元。

2020年04月，公司股东泉意金融更名为“上海前易信息咨询服务有限公司”。

金元顺安始终坚持以“取信于市场、取信于社会”作为行为准则，遵循“诚实信用，勤勉尽责，以专业经营方式管理和运作基金财产和客户资产，在合法、合规的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，从而使公司稳步、健康发展”的投资理念。遵守法律、行政法规和中国证券监督管理委员会的规定，遵守社会公德、商业道德，诚实守信，遵循基金份额持有人利益优先、公平对待其管理的不同基金财产和客户资产的原则，接受政府和社会公众的监督，承担社会责任。

截止至2023年12月31日，本基金管理人管理金元顺安宝石动力混合型证券投资基金、金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安价值增长混合型证券投资基金、金元顺安消费主题混合型证券投资基金、金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安金元宝货币市场基金、金元顺安沅楹债券型证券投资基金、金元顺安金通宝货币市场基金、金元顺安桉盛债券型证券投资基金、金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安沅顺定期开放债券型发起式证券投资基金、金元顺安沅泰定期开放债券型发起式证券投资基金、金元顺安沅泉债券型证券投资基金、金元顺安泓丰纯债87个月定期开放债券型证券投资基金、金元顺医疗健康混合型证券投资基金、金元顺安行业精选混合型证券投资基金和金元顺安产业臻选混合型证券投资基金共19只开放式证券投资基金。

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		
周博洋	本基金基金经理	2018-01-26	-	11年	金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安沅楹债券型证券投资基金、金元顺安沅顺定期开放债券型发起式证券投资基金、金元顺安沅泉债券型证券投资基金和金元顺安产业臻选混合型证券投资基金的基金经理，兰卡斯特大学理学硕士。曾任上海新世纪资信评估投资服务有限公司助理分析师，上海证券有限责任公司项目经理。2014年8月加入金元顺安基金管理有限公司。11年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

注：

- 1、此处的任职日期、离任日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；
- 2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信

用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《金元顺安基金管理有限公司公平交易管理制度》，建立了科学完善的制度和流程，从事前、事中、事后等各个业务环节严格控制不同基金之间可能存在的利益输送，覆盖了全部开放式基金及特定客户资产管理组合；涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节。

在投资环节，本基金管理人建立了科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、业务流程和技术手段保证公平交易原则的贯彻。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。在交易环节，为确保交易的公平执行，本基金管理人交易管理实行集中交易，投资组合的投资决策过程和交易执行过程分开，各投资组合的所有证券买卖活动须通过交易部集中统一完成。在报告分析环节，本基金管理人每季度和每年对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异、对连续四个季度期间内、不同时间窗内（日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差进行分析，根据收益率差异和交易价差的大小，说明是否符合公平交易的原则，由投资组合经理、分管风险管理副总经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护。本报告期内，本基金管理人严格遵守公司投资交易业务流程及公平交易制度。公司投资交易行为监控体系由风险管理部、监察稽核部和交易部监督，确保公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，本基金管理人对旗下开放式基金与其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《金元顺安基金管理有限公司公平交易管理制度》及其他相关法律法规和公司内部规章制度，制定了《金元顺安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，涵盖了所有可投资证券的一级市场申购、二级市场交易所公开竞价交易、交易所大宗交易、银行间债券交易以及非公开发行业股票申购、以公司名义进行的一级市场债券交易等可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

本基金管理人采用定量分析和定性分析相结合的方式，建立并严格执行有效的异常交易日常监控制度，形成定期交易监控报告，按照报告路线实行及时报告的机制。本报告期内，未发现异常交易行为。

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

债券方面，2023年债市重点围绕疫后经济表现进行博弈，整体收益率震荡下行。具体来看，2023年一季度国内债市延续2022年末跌势，防疫政策放松后，市场对经济前景乐观，股强债弱表现明显，随后二季度各项经济金融数据表现不及预期，市场对复苏预期又有所修正，债市收益率一路下行，8月后，债市受地产政策放松和供给冲击影响市场有所调整，年末在中央经济会议定调坚持高质量发展之后又明显转强。全年通胀低位运行，货币政策整体维持稳健中性基调，同时兼顾内外平衡，资金面呈均衡状态。

股市方面，2023年地产周期下行叠加美联储加息周期扰动，市场风险偏好整体不高，呈现热点较多但轮动极快的特征。纵观全年市场表现不佳，仅一季度在疫情政策放开刺激下，市场预期经济复苏推动了股市阶段性的上行。全年沪深300下跌11.38%，创业板指下跌19.41%，中证500下跌7.42%，中证1000下跌6.28%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安优质精选灵活配置混合A类基金份额净值为1.7833元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为28.60%，同期业绩比较基准收益率为-5.52%；截至报告期末金元顺安优质精选灵活配置混合C类基金份额净值为1.7819元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为29.06%，同期业绩比较基准收益率为-5.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券方面，展望2024年仍然是对地产的修复力度做重点关注。通胀方面，预计CPI温和上涨、PPI低位回升，对债市影响不会太大。转型大背景下，国内货币政策预计仍将维持稳健中性的基调，流动性整体在均衡偏宽松状态。此外，美降息周期可能在年中开启，国内货币政策空间可能进一步打开。但需要注意低利率环境下，市场可能大幅走在政策之前，超买和超卖现象可能出现。

股市方面，尽管市场遭受极端流动性条件冲击，但国内货币政策整体稳健的取向不会发生变化，经过长期调整后市场各宽基指数估值也已经到了历史上极低的分位数水平，叠加年中可能出现的美联储开启降息，我们对后续权益市场的表现仍然保持乐观。后续我们仍将保持小盘成长的风格，更多布局在未来有较强产业趋势的方向。

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，本基金管理人持续将规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益作为工作的基点，进一步完善内部控制制度和流程体系，推动各项法规、内控体系和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过定期检查、报表揭示、专项检查、人员询问等方法，独立地开展公司的监察稽核工作，并就在监察稽核过程中发现的问题，及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，公司重点开展的监察稽核工作包括：

1、依据相关法律、法规和公司实际运作情况，修订和完善公司各项内部管理制度，为保障基金份额持有人的利益，保障公司的规范运作提供制度保障。

2、开展对公司各项业务的日常监察稽核工作，查找各项业务中的风险漏洞，保证公司各项业务的合规运作，重点加强了对于各业务环节的专项稽核。

3、加强对公司投资、交易、研究、会计估值、注册登记、市场营销等各项业务过程中的法律、合规及投资风险的防范与控制，在合法合规的基础上，充分保障基金份额持有人的利益。

4、开展反洗钱、反商业贿赂等各项工作，并通过开展法规培训等形式，提高员工的合规意识和风险责任意识。

通过上述工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生关联交易、内幕交易，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金份额持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

1、估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由分管运营的副总经理、基金事务部、投资研究部、交易部、风险管理部、监察稽核部等部门总监组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责：

（1）制定估值制度并在必要时修改；

- (2) 确保估值方法符合现行法规；
- (3) 批准证券估值的步骤和方法；
- (4) 对异常情况做出决策。

分管运营的副总经理担任估值工作小组的组长，分管运营的副总经理在基金事务部总监或者其他两个估值小组成员的建议下，可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组2/3或以上多数票通过。

2、基金事务部的职责分工

基金事务部负责日常证券资产估值。该部门和公司投资部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后，基金事务部定期将证券估值表向估值工作小组报告，至少每月一次。

基金事务部职责：

- (1) 获得独立、完整的证券价格信息；
- (2) 每日证券估值；
- (3) 检查价格波动并进行一般准确性评估；
- (4) 向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；
- (5) 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；
- (6) 对估值调整和人工估值进行记录；
- (7) 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金事务部总监认为必要时，可以提议召开估值工作小组会议。

3、投资研究部的职责分工

- (1) 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问询；
- (2) 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；
- (3) 评价并确认基金事务部提供的估值报告；
- (4) 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

4、交易部的职责分工

- (1) 对基金事务部的证券价格信息需求做出即时回应；
- (2) 通知基金事务部关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；
- (3) 评价并确认基金事务部提供的估值报告。

5、风险管理部、监察稽核部的职责分工

- (1) 监督证券的整个估值过程；
- (2) 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
- (3) 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
- (4) 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价值的风险；
- (5) 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯；
- (6) 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.7.2 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期内，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自2023年2月8日起至2023年6月5日（连续八十个工作日）出现基金资产净值低于五千万元的情形；

本报告期内，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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-金元顺安基金管理有限公司2023年1月1日至2023年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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

本托管人认为,金元顺安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本托管人认为，金元顺安基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2024)审字第70023677_B07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	金元顺安优质精选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	我们审计了金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括2023年12月31日的资产负债表，2023年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报

	<p>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。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资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：（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</p>

	<p>通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈露 李莉
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
审计报告日期	2024-03-28

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：金元顺安优质精选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	89,753,402.95	5,993,490.99
结算备付金		25,752,214.01	92,085.59
存出保证金		660,110.64	46,609.29
交易性金融资产	7.4.7.2	3,693,518,616.67	64,124,586.03
其中：股票投资		2,892,164,795.03	47,752,272.33
基金投资		-	-
债券投资		801,353,821.64	16,372,313.70
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	99,987,480.82	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		29,168,045.06	30,742.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		3,938,839,870.15	70,287,514.80
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 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	7.4.12.3	-	-

应付清算款		38,952,106.92	425,244.71
应付赎回款		36,013,786.43	7,420.35
应付管理人报酬		3,827,144.51	91,120.42
应付托管费		637,857.44	15,186.75
应付销售服务费		205,961.09	5,550.40
应付投资顾问费		-	-
应交税费		148,220.55	148,158.43
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,768,066.90	175,226.34
负债合计		81,553,143.84	867,907.40
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	2,092,583,266.21	49,859,936.14
未分配利润	7.4.7.8	1,764,703,460.10	19,559,671.26
净资产合计		3,857,286,726.31	69,419,607.40
负债和净资产总计		3,938,839,870.15	70,287,514.80

注：

报告截止日2023年12月31日，基金份额净值1.7824元，基金份额总额2,164,135,264.80份，其中A类基金份额净值1.7833元，份额总额774,588,965.57份；C类基金份额净值1.7819元，份额总额1,389,546,299.23份。

7.2 利润表

会计主体：金元顺安优质精选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	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
一、营业总收入		156,907,100.42	-11,470,932.80
1.利息收入		1,350,780.13	56,186.64
其中：存款利息收入	7.4.7.9	362,650.94	55,518.15
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		988,129.19	668.49
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		153,776,098.47	-5,570,799.88
其中：股票投资收益	7.4.7.10	150,634,965.30	-6,473,204.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	2,449,783.41	332,750.55
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	691,349.76	569,654.36
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	-593,301.62	-5,959,962.27
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	2,373,523.44	3,642.71
减：二、营业总支出		13,969,322.10	1,545,730.38
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	11,228,877.64	1,110,046.62
2.托管费	7.4.10.2.2	1,871,479.60	185,007.78
3.销售服务费	7.4.10.2.3	586,861.91	68,088.29
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		106,776.05	7,242.81
其中：卖出回购金融资产支出		106,776.05	7,242.81
6.信用减值损失	7.4.7.18	-	-

7.税金及附加		191.96	156.84
8.其他费用	7.4.7.19	175,134.94	175,188.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		142,937,778.32	-13,016,663.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		142,937,778.32	-13,016,663.18
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		142,937,778.32	-13,016,663.18

7.3 净资产变动表

会计主体：金元顺安优质精选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	49,859,936.14	19,559,671.26	69,419,607.40
二、本期期初净资产	49,859,936.14	19,559,671.26	69,419,607.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,042,723,330.07	1,745,143,788.84	3,787,867,118.91
（一）、综合收益总额	-	142,937,778.32	142,937,778.32
（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）	2,042,723,330.07	1,602,206,010.52	3,644,929,340.59

其中：1.基金申购款	2,838,129,676.82	2,192,665,198.97	5,030,794,875.79
2.基金赎回款	-795,406,346.75	-590,459,188.45	-1,385,865,535.20
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	2,092,583,266.21	1,764,703,460.10	3,857,286,726.31
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	49,491,496.66	32,356,544.74	81,848,041.40
二、本期期初净资产	49,491,496.66	32,356,544.74	81,848,041.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	368,439.48	-12,796,873.48	-12,428,434.00
（一）、综合收益总额	-	-13,016,663.18	-13,016,663.18
（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）	368,439.48	219,789.70	588,229.18
其中：1.基金申购款	948,183.39	604,248.62	1,552,432.01
2.基金赎回款	-579,743.91	-384,458.92	-964,202.83
（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	49,859,936.14	19,559,671.26	69,419,607.40

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：

邝晓星

任笑菲

季泽

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

金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），是由金元顺安保本混合型证券投资基金（以下简称“保本混合”）转型而来。保本混合(原名为金元比联保本混合型证券投资基金)，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2011]523号文《关于核准金元比联保本混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人金元比联基金管理有限公司（系金元顺安基金管理有限公司的前身）向社会公开发行募集，基金合同于2011年8月16日正式生效，首次设立募集规模为277,669,494.24份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构均为金元顺安基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经金元比联第二届董事会第七次会议及第二届股东会第五次会议审议通过，并由中国证监会证监许可[2012]276号文核准，金元比联基金管理有限公司已于2012年3月15日完成相关工商变更登记手续，并且变更公司名称为“金元惠理基金管理有限公司”。随后，报请中国证监会同意，将金元比联保本混合型证券投资基金更名为金元惠理保本混合型证券投资基金，并于2012年5月2日公告。

保本混合的第一个保本周期为三年，自基金合同生效之日（即2011年8月16日）起至三个公历年后对应日（即2014年8月15日）止。保本混合第一个保本周期期满后，在符合基金合同规定的保本基金存续的条件下，转入第二个保本周期，担保人变更为深圳

市高新投集团有限公司。保本混合在第一个保本周期到期日和第二个保本周期开始之间设置过渡期。过渡期自2014年8月18日（含）至2014年9月22日（含）。

2015年2月5日，经金元惠理基金管理有限公司股东金元证券股份有限公司及惠理基金管理香港有限公司以书面表决的方式达成更名决议。金元惠理基金管理有限公司于2015年3月6日完成相关工商变更登记手续，并且变更公司名称为“金元顺安基金管理有限公司”，并于2015年3月10日进行公告。经本基金管理人与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后，金元惠理保本混合型证券投资基金相应更名为金元顺安保本混合型证券投资基金，并于2015年7月15日进行公告。

2015年6月2日，经保本混合基金管理人与托管人协商一致，并报中国证监会备案后，根据申购、赎回费用收取的不同，对本基金进行份额分类，原有基金份额为A类份额，投资者在申购该类基金份额时收取申购费用；另外增设C类份额，投资者在申购时不收取申购费，且在2017年9月22日（第二个保本周期到期日）前，单笔申购该类基金份额的金额须高于200万元（含200万元）。

保本混合第二个保本周期为三年，自保本混合公告的保本周期起始日（即2014年9月23日）起至三年后对应日（即2017年9月23日（非工作日），顺延至下一个工作日即2017年9月25日）止。保本混合于2017年09月25日保本期到期，由于不符合保本基金存续条件，按照《金元顺安保本混合型证券投资基金基金合同》的规定，经向中国证监会备案，保本混合在保本期满后转型非保本的混合型基金，基金名称相应变更为“金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金”。保本混合第二次保本周期到期选择期间为2017年9月26日（含）至2017年10月9日（含），于2017年10月10日起始运作。

本基金在正确认识中国经济发展特点的基础上，透过投资于优质股票和票息优势的固定收益证券，并结合严格风险管理，为投资者带来稳定的当期收益与长期的资本增值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、可转换债券、短期融资券、资产支持证券、债券回购等）、货币市场工具、权证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，但需符合中国证监会的相关规定。如果法律法规或中国证监会以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围，但届时仍需遵循有效的投资比例限制。

本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×55%+中国债券总指数收益率×45%。

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”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2023年12月31日的财务状况以及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

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

1、金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

2、金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；

本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

2、不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用

可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

3、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

4、如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

1、存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

2、交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

3、股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

4、处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

5、买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

6、公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

7、其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配6次，若进行收益分配，则每次基金收益分配比例不低于该次收益分配基准日可供分配利润的10%。若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、基金收益分配方式分为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按除权日的基金份额净值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；

3、本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

4、基金收益分配后每一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；

5、基金当期收益应先弥补上期累计亏损后，才可进行收益分配；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不影响投资者利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；根据财政部、税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

7.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	89,753,402.95	5,993,490.99
等于：本金	89,739,043.14	5,992,716.50
加：应计利息	14,359.81	774.49
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	89,753,402.95	5,993,490.99

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		2,896,710,188.70	-	2,892,164,795.03	-4,545,393.67
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	792,160,191.00	8,115,941.64	801,353,821.64	1,077,689.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	792,160,191.00	8,115,941.64	801,353,821.64	1,077,689.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,688,870,379.70	8,115,941.64	3,693,518,616.67	-3,467,704.67
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		50,199,345.03	-	47,752,272.33	-2,447,072.70
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	16,711,784.07	87,859.98	16,372,313.70	-427,330.35
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	16,711,784.07	87,859.98	16,372,313.70	-427,330.35

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	66,911,129.10	87,859.98	64,124,586.03	-2,874,403.05

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	99,987,480.82	-
银行间市场	-	-
合计	99,987,480.82	-
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	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

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	9,851.47	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,638,215.43	40,226.34
其中：交易所市场	1,638,215.43	40,226.34
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
审计费用	40,000.00	55,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
合计	1,768,066.90	175,226.34

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 金元顺安优质精选灵活配置混合A类

金额单位：人民币元

项目 (金元顺安优质精选灵活配置 混合A类)	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	4,345,856.71	3,944,443.18
本期申购	918,290,495.24	833,464,434.71
本期赎回（以“-”号填列）	-148,047,386.38	-134,371,910.91
本期末	774,588,965.57	703,036,966.98

7.4.7.7.2 金元顺安优质精选灵活配置混合C类

金额单位：人民币元

项目 (金元顺安优质精选灵活配置 混合C类)	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	45,915,492.96	45,915,492.96
本期申购	2,004,665,242.11	2,004,665,242.11

本期赎回（以“-”号填列）	-661,034,435.84	-661,034,435.84
本期末	1,389,546,299.23	1,389,546,299.23

注：

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 金元顺安优质精选灵活配置混合A类

单位：人民币元

项目 (金元顺安优质精选灵活配置混合A类)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,341,045.98	-2,259,243.07	2,081,802.91
本期期初	4,341,045.98	-2,259,243.07	2,081,802.91
本期利润	53,443,464.36	-13,453.13	53,430,011.23
本期基金份额交易产生的变动数	1,064,985,089.69	-442,219,360.99	622,765,728.70
其中：基金申购款	1,271,970,021.26	-531,105,664.08	740,864,357.18
基金赎回款	-206,984,931.57	88,886,303.09	-118,098,628.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,122,769,600.03	-444,492,057.19	678,277,542.84

7.4.7.8.2 金元顺安优质精选灵活配置混合C类

单位：人民币元

项目 (金元顺安优质精选灵活配置混合C类)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	40,422,138.50	-22,944,270.15	17,477,868.35
本期期初	40,422,138.50	-22,944,270.15	17,477,868.35
本期利润	90,087,615.58	-579,848.49	89,507,767.09
本期基金份额交易产生的变动数	830,681,645.75	148,758,636.07	979,440,281.82
其中：基金申购款	1,278,078,167.10	173,722,674.69	1,451,800,841.79

基金赎回款	-447,396,521.35	-24,964,038.62	-472,360,559.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	961,191,399.83	125,234,517.43	1,086,425,917.26

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	280,984.87	50,541.07
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	78,877.94	4,406.39
其他	2,788.13	570.69
合计	362,650.94	55,518.15

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	2,447,846,959.37	319,055,823.29
减：卖出股票成本总额	2,291,938,376.63	324,698,293.73
减：交易费用	5,273,617.44	830,734.35
买卖股票差价收入	150,634,965.30	-6,473,204.79

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	3,343,768.73	309,047.40
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	-893,985.32	23,703.15
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	2,449,783.41	332,750.55

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	336,953,826.89	81,858,814.51
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	334,735,225.28	81,328,224.49
减：应计利息总额	3,098,753.19	504,218.63
减：交易费用	13,833.74	2,668.24
买卖债券差价收入	-893,985.32	23,703.15

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.15 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	691,349.76	569,654.36
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	691,349.76	569,654.36

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	-593,301.62	-5,959,962.27
——股票投资	-2,098,320.97	-5,062,602.15
——债券投资	1,505,019.35	-897,360.12
——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	-593,301.62	-5,959,962.27

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	2,368,865.06	3,641.24
转换费收入	4,658.38	1.47
合计	2,373,523.44	3,642.71

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
审计费用	40,000.00	55,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	17,934.94	2,988.04
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他费用	1,200.00	1,200.00
合计	175,134.94	175,188.04

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
金元顺安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
金元证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
上海前易信息咨询服务有限公司	基金管理人的股东
上海金元百利资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
金元证券	646,040,712.36	8.52%	-	-

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

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
金元证券	463,605,721.59	32.07%	-	-

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
金元证券	2,555,000,000.00	24.21%	-	-

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
金元证券	204,056.61	6.27%	120,559.64	7.36%
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
金元证券	-	-	-	-

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	11,228,877.64	1,110,046.62
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,599,294.02	43,592.44
应支付基金管理人的净管理费	7,629,583.62	1,066,454.18

注：

2023年8月7日前，本基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。经与本基金的基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自2023年8月7日起，基金管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H=E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$ ，

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。

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3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、休息日，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	1,871,479.60	185,007.78

注：

2023年8月7日前，本基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。经与本基金的基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自2023年8月7日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$ ，

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。

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，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	本期
------	----

服务费的各关联方名称	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		
	金元顺安优质精选灵活配置混合A类	金元顺安优质精选灵活配置混合C类	合计
金元顺安基金管理有限公司	0.00	98,039.37	98,039.37
金元证券股份有限公司	0.00	12,222.28	12,222.28
中国农业银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	110,261.65	110,261.65
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		
金元顺安优质精选灵活配置混合A类	金元顺安优质精选灵活配置混合C类	合计	
金元顺安基金管理有限公司	0.00	68,088.29	68,088.29
金元证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00
中国农业银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	68,088.29	68,088.29

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年费率为0.10%，按

前一日C类基金份额的基金资产净值的0.10%年费率计提。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销售服务费，

E为C类基金份额前一日基金资产净值。

销售服务费每日计提，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付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，经基金管理人代付给各销售机构，若遇法定节假日、休息日，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

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

7.4.10.4 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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

金元顺安优质精选灵活配置混合C类

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
金元证券	18,906,942.39	1.36%	0.00	0.00%

股份有限 公司				
------------	--	--	--	--

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01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业 银行股份 有限公司	89,753,402.95	280,984.87	5,993,490.99	50,541.07

注：

除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2023年度获得的利息收入为人民币78,877.94元（2022年度：人民币4,406.39元），2023年末结算备付金余额为人民币25,752,214.01元（2022年末：人民币92,085.59元）。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无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

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

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
6887	艾罗	2023-	5个	新股	55.66	55.66	16,147	898,7	898,7	-

17	能源	12-26	交易日	未上市				42.02	42.02	
3015 26	国际 复材	2023- 12-19	6个 月	新股 流通 受限	2.66	5.26	9,723	25,86 3.18	51,14 2.98	-
6885 49	中巨 芯	2023- 08-30	6个 月	新股 流通 受限	5.18	8.09	4,294	22,24 2.92	34,73 8.46	-
6887 02	盛科 通信	2023- 09-06	6个 月	新股 流通 受限	42.66	48.19	549	23,42 0.34	26,45 6.31	-
6886 52	京仪 装备	2023- 11-22	6个 月	新股 流通 受限	31.95	57.06	416	13,29 1.20	23,73 6.96	-
3015 59	中集 环科	2023- 09-26	6个 月	新股 流通 受限	24.22	18.25	1,165	28,21 6.30	21,26 1.25	-
6010 96	宏盛 华源	2023- 12-15	6个 月	新股 流通 受限	1.70	5.23	3,918	6,66 0.60	20,49 1.14	-
3015 58	三态 股份	2023- 09-21	6个 月	新股 流通 受限	7.33	13.67	1,458	10,68 7.14	19,93 0.86	-
6010 83	锦江 航运	2023- 11-28	6个 月	新股 流通 受限	11.25	11.85	1,263	14,20 8.75	14,96 6.55	-
3015 08	中机 认检	2023- 11-23	6个 月	新股 流通 受限	16.82	32.25	419	7,04 7.58	13,51 2.75	-
6886 53	康希 通信	2023- 11-10	6个 月	新股 流通 受限	10.50	18.86	648	6,80 4.00	12,22 1.28	-
3015	中远	2023-	6个	新股	6.87	20.06	604	4,14	12,11	-

16	通	12-01	月	流通受限				9.48	6.24	
688719	爱科赛博	2023-09-20	6个月	新股流通受限	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
301413	安培龙	2023-12-11	6个月	新股流通受限	33.25	70.25	164	5,453.00	11,521.00	-
301550	斯菱股份	2023-09-06	6个月	新股流通受限	37.56	43.58	260	9,765.60	11,330.80	-
301251	威尔高	2023-08-30	6个月	新股流通受限	28.88	34.64	321	9,270.48	11,119.44	-
301568	思泰克	2023-11-21	6个月	新股流通受限	23.23	43.26	246	5,714.58	10,641.96	-
688716	中研股份	2023-09-13	6个月	新股流通受限	29.66	36.38	267	7,919.22	9,713.46	-
301517	陕西华达	2023-10-09	6个月	新股流通受限	26.87	51.90	185	4,970.95	9,601.50	-
301500	飞南资源	2023-09-13	6个月	新股流通受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
688720	艾森股份	2023-11-29	6个月	新股流通受限	28.03	57.51	165	4,624.95	9,489.15	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6个月	新股流通受限	31.90	44.48	208	6,635.20	9,251.84	-
3015	惠柏	2023-	6个	新股	22.88	39.68	224	5,12	8,88	-

55	新材	10-24	月	流通受限				5.12	8.32	
301578	辰奕智能	2023-12-21	6个月	新股流通受限	48.94	74.43	118	5,774.92	8,782.74	-
301489	思泉新材	2023-10-16	6个月	新股流通受限	41.66	67.77	128	5,332.48	8,674.56	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6个月	新股流通受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301548	崇德科技	2023-09-11	6个月	新股流通受限	66.80	59.03	136	9,084.80	8,028.08	-
688648	中邮科技	2023-11-06	6个月	新股流通受限	15.18	24.91	303	4,599.54	7,547.73	-
301529	福赛科技	2023-08-31	6个月	新股流通受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6个月	新股流通受限	16.80	34.50	195	3,276.00	6,727.50	-
603107	上海汽配	2023-10-25	6个月	新股流通受限	14.23	21.96	292	4,155.16	6,412.32	-
603270	金帝股份	2023-08-25	6个月	新股流通受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
001306	夏厦精密	2023-11-09	6个月	新股流通受限	53.63	84.62	64	3,432.32	5,415.68	-
6031	润本	2023-	6个	新股	17.38	17.02	303	5,26	5,15	-

93	股份	10-09	月	流通受限				6.14	7.06	
0013 26	联域 股份	2023- 11-01	6个 月	新股 流通 受限	41.18	51.74	99	4,07 6.82	5,12 2.26	-
6030 75	热威 股份	2023- 09-01	6个 月	新股 流通 受限	23.10	23.32	182	4,20 4.20	4,24 4.24	-
0012 39	永达 股份	2023- 12-04	6个 月	新股 流通 受限	12.05	21.94	189	2,27 7.45	4,14 6.66	-
0013 58	兴欣 新材	2023- 12-14	6个 月	新股 流通 受限	41.00	46.28	87	3,56 7.00	4,02 6.36	-
6032 73	天元 智能	2023- 10-16	6个 月	新股 流通 受限	9.50	20.45	178	1,69 1.00	3,64 0.10	-
6032 31	索宝 蛋白	2023- 12-06	6个 月	新股 流通 受限	21.29	22.26	161	3,42 7.69	3,58 3.86	-
6033 73	安邦 护卫	2023- 12-13	6个 月	新股 流通 受限	19.10	40.47	88	1,68 0.80	3,56 1.36	-
6032 76	恒兴 新材	2023- 09-18	6个 月	新股 流通 受限	25.73	24.88	134	3,44 7.82	3,33 3.92	-

注：

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的债券、权证。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2023年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末2023年12月31日止，本基金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。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入公司各个业务层面的全面控制过程之中，并建立了三道防线：以各岗位职责为基础，形成第一道防线；通过相关岗位之间、相关部门之间相互监督制衡，形成第二道防线；由督察长、分管风险管理副总经理、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部对公司各机构、各部门、各岗位、各项业务进行监督、检查、评价，形成的第三道防线。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金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%。

本基金的货币资金均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，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

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	801,353,821.64	5,034,280.82
合计	801,353,821.64	5,034,280.82

注：未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债和超短期融资券。

7.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	7,154,944.54
AAA以下	-	4,183,088.34
未评级	-	-
合计	-	11,338,032.88

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。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资产的公允价值。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。生息负债主要为卖出回购金融资产款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	89,753,402.95	-	-	-	89,753,402.95
结算备付金	25,752,214.01	-	-	-	25,752,214.01
存出保证金	660,110.64	-	-	-	660,110.64
交易性金融资产	801,353,821.64	-	-	2,892,164,795.03	3,693,518,616.67
买入返售金融资产	99,987,480.82	-	-	-	99,987,480.82

金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金2023年年度报告

应收申购款	-	-	-	29,168,045.06	29,168,045.06
资产总计	1,017,507,030.06	-	-	2,921,332,840.09	3,938,839,870.15
负债					
应付清算款	-	-	-	38,952,106.92	38,952,106.92
应付赎回款	-	-	-	36,013,786.43	36,013,786.43
应付管理人报酬	-	-	-	3,827,144.51	3,827,144.51
应付托管费	-	-	-	637,857.44	637,857.44
应付销售服务费	-	-	-	205,961.09	205,961.09
应交税费	-	-	-	148,220.55	148,220.55
其他负债	-	-	-	1,768,066.90	1,768,066.90
负债总计	-	-	-	81,553,143.84	81,553,143.84
利率敏感度缺口	1,017,507,030.06	-	-	2,839,779,696.25	3,857,286,726.31
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,993,490.99	-	-	-	5,993,490.99
结算备付金	92,085.59	-	-	-	92,085.59
存出保	46,609.29	-	-	-	46,609.29

证金					
交易性金融资产	16,372,313.70	-	-	47,752,272.33	64,124,586.03
应收申购款	-	-	-	30,742.90	30,742.90
资产总计	22,504,499.57	-	-	47,783,015.23	70,287,514.80
负债					
应付清算款	-	-	-	425,244.71	425,244.71
应付赎回款	-	-	-	7,420.35	7,420.35
应付管理人报酬	-	-	-	91,120.42	91,120.42
应付托管费	-	-	-	15,186.75	15,186.75
应付销售服务费	-	-	-	5,550.40	5,550.40
应交税费	-	-	-	148,158.43	148,158.43
其他负债	-	-	-	175,226.34	175,226.34
负债总计	-	-	-	867,907.40	867,907.40
利率敏感度缺口	22,504,499.57	-	-	46,915,107.83	69,419,607.40

注：

表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.以中央国债登记结算有限责任公司公布的2023年12月31日及2022年12月3
----	---

	1日各债券的基点价值(BP价值)为主要计算依据；		
假设	2、债券持仓结构保持不变；		
假设	3、货币资金、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响；		
假设	4、该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
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
	基准利率增加一个基点	-36,758.49	-265.85
	基准利率减少一个基点	36,761.22	265.87

注：

上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。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。本基金的金融资产以公允价值计量，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	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,892,164,795.03	74.98	47,752,272.33	68.79
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	801,353,821.64	20.78	16,372,313.70	23.58
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	3,693,518,616.67	95.75	64,124,586.03	92.37

注：

本基金投资组合中股票、存托凭证、权证的投资比例为基金资产的30%-80%；债券、货币市场工具等占基金资产的20%-70%，其中，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金投资组合中股票投资的贝塔系数紧密相关；		
	2、以下分析中，除市场指标发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变；		
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
	沪深300指数上涨5%	103,524,698.69	2,115,936.29
	沪深300指数下跌5%	-103,524,698.69	-2,115,936.29

注：

本基金管理人运用资本-资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

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	2,890,793,251.32	59,090,305.21
第二层次	802,252,563.66	5,034,280.82
第三层次	472,801.69	-
合计	3,693,518,616.67	64,124,586.03

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日

	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	333,614.35	333,614.35
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	139,187.34	139,187.34
其中：计入损益的利得或损失	-	139,187.34	139,187.34
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	472,801.69	472,801.69
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	-	139,187.34	139,187.34
项目	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
债券投资	股票投资		
期初余额	-	1,682,426.97	1,682,426.97
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,682,426.97	1,682,426.97
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 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	472,801.69	平均价格亚式期权模型	波动率	22.2315%-153.1612%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.15.2 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。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于2024年3月28日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,892,164,795.03	73.43
	其中：股票	2,892,164,795.03	73.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	801,353,821.64	20.34
	其中：债券	801,353,821.64	20.34
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	99,987,480.82	2.54
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	115,505,616.96	2.93
8	其他各项资产	29,828,155.70	0.76
9	合计	3,938,839,870.15	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	15,466,295.72	0.40
B	采矿业	33,061,097.00	0.86
C	制造业	2,041,893,952.03	52.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	49,353,892.80	1.28
E	建筑业	123,603,758.65	3.20
F	批发和零售业	76,087,092.82	1.97
G	交通运输、仓储和邮政业	65,852,842.57	1.71
H	住宿和餐饮业	5,757,808.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	260,935,777.82	6.76
J	金融业	-	-

K	房地产业	30,742,433.00	0.80
L	租赁和商务服务业	19,207,207.46	0.50
M	科学研究和技术服务业	80,153,678.38	2.08
N	水利、环境和公共设施管理业	84,386,740.78	2.19
O	居民服务、修理和其他服务业	5,662,218.00	0.15
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	2,892,164,795.03	74.98

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	605178	时空科技	417,200	11,568,956.00	0.30
2	603356	华菱精工	679,600	9,942,548.00	0.26
3	688528	秦川物联	891,353	9,849,450.65	0.26
4	688216	气派科技	352,119	9,743,132.73	0.25
5	300046	台基股份	610,200	9,708,282.00	0.25
6	688570	天玛智控	354,905	9,656,965.05	0.25
7	002297	博云新材	1,201,900	9,579,143.00	0.25
8	688305	科德数控	124,469	9,515,655.05	0.25
9	300976	达瑞电子	178,751	9,514,915.73	0.25
10	688622	禾信仪器	264,400	9,505,180.00	0.25
11	688589	力合微	237,857	9,492,872.87	0.25
12	002149	西部材料	603,700	9,490,164.00	0.25

13	688206	概伦电子	434,242	9,466,475.60	0.25
14	301300	远翔新材	298,882	9,453,637.66	0.25
15	603580	艾艾精工	632,700	9,420,903.00	0.24
16	300787	海能实业	558,410	9,392,456.20	0.24
17	002943	宇晶股份	331,770	9,279,606.90	0.24
18	688655	迅捷兴	613,966	9,270,886.60	0.24
19	301336	趣睡科技	211,400	9,257,206.00	0.24
20	301233	盛帮股份	208,300	9,252,686.00	0.24
21	688011	新光光电	389,925	9,221,726.25	0.24
22	300546	雄帝科技	583,880	9,207,787.60	0.24
23	688669	聚石化学	490,282	9,187,884.68	0.24
24	300670	大烨智能	1,172,700	9,182,241.00	0.24
25	688251	井松智能	314,762	9,153,278.96	0.24
26	300610	晨化股份	811,732	9,148,219.64	0.24
27	001337	四川黄金	330,800	9,140,004.00	0.24
28	688638	誉辰智能	151,653	9,123,444.48	0.24
29	688171	纬德信息	404,824	9,108,540.00	0.24
30	300353	东土科技	940,601	9,105,017.68	0.24
31	300906	日月明	359,700	9,096,813.00	0.24
32	688227	品高股份	476,461	9,086,111.27	0.24
33	688357	建龙微纳	175,656	9,079,658.64	0.24
34	300243	瑞丰高材	927,800	9,064,606.00	0.23
35	301027	华蓝集团	724,219	9,059,979.69	0.23
36	603655	朗博科技	434,596	9,048,288.72	0.23
37	300743	天地数码	651,240	9,039,211.20	0.23
38	600235	民丰特纸	1,471,200	9,033,168.00	0.23
39	002469	三维化学	1,487,300	9,013,038.00	0.23
40	688201	信安世纪	457,274	8,999,152.32	0.23
41	002474	榕基软件	1,367,200	8,996,176.00	0.23
42	301237	和顺科技	295,131	8,992,641.57	0.23
43	688022	瀚川智能	409,817	8,991,384.98	0.23

44	688597	煜邦电力	987,357	8,984,948.70	0.23
45	688069	德林海	451,652	8,978,841.76	0.23
46	300689	澄天伟业	462,200	8,952,814.00	0.23
47	600756	浪潮软件	644,000	8,932,280.00	0.23
48	688565	力源科技	1,056,102	8,924,061.90	0.23
49	301023	江南奕帆	214,700	8,910,050.00	0.23
50	600505	西昌电力	1,048,400	8,900,916.00	0.23
51	301049	超越科技	384,000	8,893,440.00	0.23
52	300447	全信股份	613,100	8,889,950.00	0.23
53	300961	深水海纳	791,600	8,889,668.00	0.23
54	600101	明星电力	1,056,600	8,886,006.00	0.23
55	688557	兰剑智能	240,837	8,870,026.71	0.23
56	300177	中海达	1,233,500	8,868,865.00	0.23
57	688607	康众医疗	435,168	8,868,723.84	0.23
58	600193	创兴资源	1,714,404	8,863,468.68	0.23
59	300594	朗进科技	424,000	8,853,120.00	0.23
60	002620	瑞和股份	1,642,934	8,838,984.92	0.23
61	000619	海螺新材	1,277,300	8,838,916.00	0.23
62	001259	利仁科技	311,900	8,833,008.00	0.23
63	600319	亚星化学	1,527,098	8,826,626.44	0.23
64	300753	爱朋医疗	512,600	8,801,342.00	0.23
65	300585	奥联电子	524,800	8,795,648.00	0.23
66	688350	富淼科技	532,020	8,794,290.60	0.23
67	300955	嘉亨家化	397,700	8,793,147.00	0.23
68	688112	鼎阳科技	219,442	8,786,457.68	0.23
69	002090	金智科技	880,400	8,786,392.00	0.23
70	688038	中科通达	609,308	8,780,128.28	0.23
71	300435	中泰股份	610,000	8,771,800.00	0.23
72	688681	科汇股份	567,326	8,765,186.70	0.23
73	301378	通达海	179,350	8,755,867.00	0.23
74	603214	爱婴室	535,000	8,752,600.00	0.23

75	000573	粤宏远 A	2,585,100	8,737,638.00	0.23
76	002227	奥 特 迅	653,500	8,737,295.00	0.23
77	003029	吉大正元	442,900	8,729,559.00	0.23
78	603637	镇海股份	969,773	8,727,957.00	0.23
79	300845	捷安高科	482,800	8,724,196.00	0.23
80	002205	国统股份	805,207	8,720,391.81	0.23
81	600802	福建水泥	1,682,900	8,717,422.00	0.23
82	300385	雪浪环境	1,296,200	8,710,464.00	0.23
83	300152	新动力	2,979,600	8,700,432.00	0.23
84	300490	华自科技	748,200	8,686,602.00	0.23
85	002207	准油股份	1,242,800	8,674,744.00	0.22
86	603172	万丰股份	491,824	8,670,857.12	0.22
87	600268	国电南自	1,243,620	8,668,031.40	0.22
88	300468	四方精创	796,400	8,640,940.00	0.22
89	002298	中电兴发	1,499,400	8,636,544.00	0.22
90	300816	艾可蓝	348,900	8,607,363.00	0.22
91	688501	青达环保	514,420	8,606,246.60	0.22
92	300424	航新科技	655,800	8,590,980.00	0.22
93	688283	坤恒顺维	125,155	8,589,387.65	0.22
94	688129	东来技术	518,137	8,575,167.35	0.22
95	688178	万德斯	474,235	8,574,168.80	0.22
96	688329	艾隆科技	344,550	8,565,513.00	0.22
97	000590	启迪药业	955,600	8,562,176.00	0.22
98	301002	崧盛股份	412,700	8,559,398.00	0.22
99	300950	德固特	530,050	8,549,706.50	0.22
100	003011	海象新材	402,400	8,542,952.00	0.22
101	002492	恒基达鑫	1,424,200	8,530,958.00	0.22
102	300640	德艺文创	1,323,500	8,496,870.00	0.22
103	688592	司南导航	163,713	8,496,704.70	0.22
104	002119	康强电子	635,000	8,489,950.00	0.22
105	688367	工大高科	474,765	8,469,807.60	0.22

106	002829	星网宇达	313,220	8,469,468.80	0.22
107	300617	安靠智电	278,200	8,446,152.00	0.22
108	600617	国新能源	2,183,800	8,429,468.00	0.22
109	300590	移为通信	701,800	8,428,618.00	0.22
110	002361	神剑股份	2,143,000	8,421,990.00	0.22
111	688659	元琛科技	675,498	8,409,950.10	0.22
112	603657	春光科技	522,600	8,408,634.00	0.22
113	688360	德马科技	418,787	8,405,055.09	0.22
114	002842	翔鹭钨业	963,300	8,399,976.00	0.22
115	688215	瑞晟智能	233,357	8,389,184.15	0.22
116	603183	建研院	1,796,300	8,388,721.00	0.22
117	000605	渤海股份	1,308,680	8,388,638.80	0.22
118	605003	众望布艺	423,808	8,365,969.92	0.22
119	603810	丰山集团	623,900	8,341,543.00	0.22
120	301125	腾亚精工	440,700	8,338,044.00	0.22
121	002105	信隆健康	1,286,100	8,333,928.00	0.22
122	688299	长阳科技	597,153	8,330,284.35	0.22
123	000929	兰州黄河	849,400	8,324,120.00	0.22
124	300907	康平科技	375,000	8,321,250.00	0.22
125	300647	超频三	1,295,200	8,315,184.00	0.22
126	688485	九州一轨	594,544	8,311,725.12	0.22
127	300329	海伦钢琴	1,115,245	8,308,575.25	0.22
128	300838	浙江力诺	507,500	8,302,700.00	0.22
129	600429	三元股份	1,861,500	8,302,290.00	0.22
130	301040	中环海陆	437,584	8,300,968.48	0.22
131	000554	泰山石油	1,437,700	8,295,529.00	0.22
132	300995	奇德新材	389,769	8,290,386.63	0.21
133	688455	科捷智能	650,902	8,272,964.42	0.21
134	688420	美腾科技	319,891	8,265,983.44	0.21
135	301228	实朴检测	498,400	8,263,472.00	0.21
136	603138	海量数据	464,200	8,262,760.00	0.21

137	300278	华昌达	2,161,408	8,256,578.56	0.21
138	600736	苏州高新	1,731,900	8,243,844.00	0.21
139	688013	天臣医疗	390,612	8,241,913.20	0.21
140	300008	天海防务	2,069,500	8,236,610.00	0.21
141	688395	正弦电气	358,142	8,233,684.58	0.21
142	301055	张小泉	570,200	8,222,284.00	0.21
143	001336	楚环科技	285,900	8,211,048.00	0.21
144	001211	双枪科技	339,400	8,199,904.00	0.21
145	300234	开尔新材	1,573,425	8,197,544.25	0.21
146	688163	赛伦生物	409,904	8,193,980.96	0.21
147	301248	杰创智能	465,208	8,192,312.88	0.21
148	300658	延江股份	1,208,300	8,180,191.00	0.21
149	301196	唯科科技	237,931	8,180,067.78	0.21
150	000561	烽火电子	973,700	8,179,080.00	0.21
151	301079	邵阳液压	471,600	8,158,680.00	0.21
152	301081	严牌股份	734,749	8,155,713.90	0.21
153	301118	恒光股份	333,760	8,153,756.80	0.21
154	002278	神开股份	1,387,900	8,146,973.00	0.21
155	688081	兴图新科	473,166	8,143,186.86	0.21
156	301057	汇隆新材	484,700	8,142,960.00	0.21
157	603059	倍加洁	360,900	8,141,904.00	0.21
158	301010	晶雪节能	435,000	8,130,150.00	0.21
159	300464	星徽股份	1,349,500	8,123,990.00	0.21
160	603616	韩建河山	1,448,200	8,095,438.00	0.21
161	300804	广康生化	262,300	8,094,578.00	0.21
162	300927	江天化学	479,740	8,083,619.00	0.21
163	003037	三和管桩	722,600	8,078,668.00	0.21
164	300523	辰安科技	397,800	8,075,340.00	0.21
165	002778	中晟高科	537,500	8,073,250.00	0.21
166	688517	金冠电气	511,271	8,072,969.09	0.21
167	603261	立航科技	236,600	8,070,426.00	0.21

168	003001	中岩大地	446,155	8,062,020.85	0.21
169	300281	金明精机	1,339,100	8,021,209.00	0.21
170	300649	杭州园林	478,500	8,014,875.00	0.21
171	688021	奥福环保	383,558	7,997,184.30	0.21
172	688489	三未信安	169,772	7,982,679.44	0.21
173	300876	蒙泰高新	318,850	7,977,627.00	0.21
174	301065	本立科技	350,520	7,974,330.00	0.21
175	301167	建研设计	470,754	7,965,157.68	0.21
176	300703	创源股份	708,300	7,961,292.00	0.21
177	688355	明志科技	399,667	7,953,373.30	0.21
178	603960	克来机电	534,400	7,946,528.00	0.21
179	605155	西大门	513,085	7,942,555.80	0.21
180	002455	百川股份	1,070,100	7,940,142.00	0.21
181	301163	宏德股份	292,700	7,932,170.00	0.21
182	603041	美思德	589,080	7,929,016.80	0.21
183	301198	喜悦智行	652,900	7,926,206.00	0.21
184	300825	阿尔特	576,200	7,922,750.00	0.21
185	301209	联合化学	317,200	7,917,312.00	0.21
186	300018	中元股份	1,295,700	7,916,727.00	0.21
187	301003	江苏博云	316,900	7,909,824.00	0.21
188	603073	彩蝶实业	393,882	7,905,211.74	0.20
189	002114	罗平锌电	1,055,800	7,897,384.00	0.20
190	603507	振江股份	304,700	7,894,777.00	0.20
191	300947	德必集团	503,090	7,893,482.10	0.20
192	002140	东华科技	927,200	7,881,200.00	0.20
193	601002	晋亿实业	1,627,900	7,879,036.00	0.20
194	300935	盈建科	286,560	7,854,609.60	0.20
195	605287	德才股份	461,360	7,829,279.20	0.20
196	603856	东宏股份	669,990	7,818,783.30	0.20
197	600939	重庆建工	2,379,700	7,805,416.00	0.20
198	000679	大连友谊	1,413,200	7,800,864.00	0.20

199	300886	华业香料	314,800	7,797,596.00	0.20
200	605298	必得科技	499,150	7,781,748.50	0.20
201	688296	和达科技	432,441	7,770,964.77	0.20
202	300892	品渥食品	313,831	7,761,040.63	0.20
203	300605	恒锋信息	518,200	7,757,454.00	0.20
204	002696	百洋股份	1,170,800	7,750,696.00	0.20
205	002246	北化股份	945,100	7,740,369.00	0.20
206	688512	慧智微	396,409	7,726,011.41	0.20
207	002963	豪尔赛	498,400	7,725,200.00	0.20
208	300970	华绿生物	447,022	7,715,599.72	0.20
209	600855	航天长峰	719,400	7,711,968.00	0.20
210	300164	通源石油	1,616,500	7,710,705.00	0.20
211	688090	瑞松科技	237,998	7,708,755.22	0.20
212	601789	宁波建工	1,861,800	7,707,852.00	0.20
213	300040	九洲集团	1,376,000	7,705,600.00	0.20
214	301012	扬电科技	381,460	7,705,492.00	0.20
215	301197	工大科雅	409,870	7,701,457.30	0.20
216	301295	美硕科技	231,809	7,693,740.71	0.20
217	301161	唯万密封	380,300	7,689,666.00	0.20
218	301068	大地海洋	252,863	7,687,035.20	0.20
219	688393	安必平	307,657	7,682,195.29	0.20
220	300619	金银河	138,000	7,679,700.00	0.20
221	002857	三晖电气	465,300	7,677,450.00	0.20
222	300929	华骐环保	629,960	7,666,613.20	0.20
223	300690	双一科技	408,550	7,664,398.00	0.20
224	688125	安达智能	194,281	7,664,385.45	0.20
225	603955	大千生态	521,500	7,660,835.00	0.20
226	688682	霍莱沃	160,352	7,650,393.92	0.20
227	603150	万朗磁塑	263,000	7,640,150.00	0.20
228	000823	超声电子	797,067	7,627,931.19	0.20
229	300865	大宏立	339,300	7,617,285.00	0.20

230	002969	嘉美包装	1,845,400	7,603,048.00	0.20
231	301195	北路智控	187,249	7,598,564.42	0.20
232	301158	德石股份	471,900	7,592,871.00	0.20
233	300810	中科海讯	372,000	7,588,800.00	0.20
234	300076	GQY视讯	1,384,800	7,561,008.00	0.20
235	300721	怡达股份	506,000	7,554,580.00	0.20
236	300360	炬华科技	553,000	7,553,980.00	0.20
237	688130	晶华微	184,624	7,541,890.40	0.20
238	002629	仁智股份	1,912,600	7,535,644.00	0.20
239	300334	津膜科技	973,400	7,534,116.00	0.20
240	000948	南天信息	498,900	7,518,423.00	0.19
241	600243	青海华鼎	1,568,800	7,483,176.00	0.19
242	603330	天洋新材	986,000	7,473,880.00	0.19
243	003023	彩虹集团	367,980	7,455,274.80	0.19
244	002144	宏达高科	641,400	7,453,068.00	0.19
245	002935	天奥电子	407,800	7,438,272.00	0.19
246	002871	伟隆股份	665,215	7,437,103.70	0.19
247	605180	华生科技	530,676	7,429,464.00	0.19
248	300521	爱司凯	536,400	7,429,140.00	0.19
249	688058	宝兰德	156,830	7,403,944.30	0.19
250	301314	科瑞思	169,460	7,395,234.40	0.19
251	688096	京源环保	787,959	7,383,175.83	0.19
252	301075	多瑞医药	276,800	7,382,256.00	0.19
253	601226	华电重工	1,121,802	7,381,457.16	0.19
254	688217	睿昂基因	206,286	7,380,913.08	0.19
255	002398	垒知集团	1,545,800	7,373,466.00	0.19
256	300889	爱克股份	437,146	7,344,052.80	0.19
257	002860	星帅尔	566,400	7,334,880.00	0.19
258	002809	红墙股份	672,400	7,315,712.00	0.19
259	688288	鸿泉物联	307,655	7,309,882.80	0.19
260	000886	海南高速	1,780,990	7,302,059.00	0.19

261	688186	广大特材	404,946	7,297,126.92	0.19
262	300126	锐奇股份	1,015,400	7,260,110.00	0.19
263	300877	金春股份	419,300	7,258,083.00	0.19
264	603045	福达合金	458,400	7,238,136.00	0.19
265	688667	菱电电控	88,096	7,227,395.84	0.19
266	300240	飞力达	1,071,723	7,223,413.02	0.19
267	300992	泰福泵业	333,898	7,205,518.84	0.19
268	603161	科华控股	448,900	7,173,422.00	0.19
269	600448	华纺股份	2,173,000	7,170,900.00	0.19
270	300331	苏大维格	286,700	7,161,766.00	0.19
271	688369	致远互联	206,640	7,151,810.40	0.19
272	003008	开普检测	255,100	7,119,841.00	0.18
273	301429	森泰股份	348,300	7,119,252.00	0.18
274	688372	伟测科技	90,777	7,116,916.80	0.18
275	002383	合众思壮	948,700	7,105,763.00	0.18
276	603171	税友股份	200,600	7,097,228.00	0.18
277	300665	飞鹿股份	817,600	7,064,064.00	0.18
278	600539	狮头股份	984,400	7,058,148.00	0.18
279	603182	嘉华股份	477,500	7,052,675.00	0.18
280	603272	联翔股份	417,400	7,045,712.00	0.18
281	000507	珠海港	1,336,600	7,030,516.00	0.18
282	301226	祥明智能	307,720	7,025,247.60	0.18
283	603159	上海亚虹	428,340	7,024,776.00	0.18
284	300923	研奥股份	286,300	7,020,076.00	0.18
285	688255	凯尔达	286,706	7,009,961.70	0.18
286	300819	聚杰微纤	450,700	7,008,385.00	0.18
287	603508	思维列控	445,900	7,000,630.00	0.18
288	002820	桂发祥	612,800	6,998,176.00	0.18
289	000985	大庆华科	431,900	6,988,142.00	0.18
290	600356	恒丰纸业	873,384	6,969,604.32	0.18
291	688218	江苏北人	350,659	6,967,594.33	0.18

292	001282	三联锻造	192,532	6,963,882.44	0.18
293	000638	万方发展	1,031,000	6,928,320.00	0.18
294	301338	凯格精机	168,800	6,920,800.00	0.18
295	000755	山西路桥	1,507,300	6,918,507.00	0.18
296	603822	嘉澳环保	248,100	6,899,661.00	0.18
297	688056	莱伯泰科	204,998	6,869,482.98	0.18
298	603639	海利尔	437,500	6,868,750.00	0.18
299	300510	金冠股份	1,150,100	6,866,097.00	0.18
300	300948	冠中生态	474,700	6,840,427.00	0.18
301	600834	申通地铁	823,500	6,777,405.00	0.18
302	601008	连云港	1,670,400	6,765,120.00	0.18
303	300579	数字认证	260,700	6,741,702.00	0.17
304	002826	易明医药	567,600	6,737,412.00	0.17
305	300141	和顺电气	627,550	6,551,622.00	0.17
306	002066	瑞泰科技	584,500	6,493,795.00	0.17
307	301105	鸿铭股份	172,300	6,483,649.00	0.17
308	300971	博亚精工	259,632	6,464,836.80	0.17
309	600533	栖霞建设	2,204,400	6,458,892.00	0.17
310	300635	中达安	512,900	6,452,282.00	0.17
311	300675	建科院	425,200	6,441,780.00	0.17
312	600433	冠豪高新	1,860,700	6,438,022.00	0.17
313	003003	天元股份	559,100	6,424,059.00	0.17
314	000632	三木集团	1,397,400	6,386,118.00	0.17
315	301359	东南电子	239,500	6,373,095.00	0.17
316	002780	三夫户外	508,865	6,365,901.15	0.17
317	300897	山科智能	185,100	6,330,420.00	0.16
318	688067	爱威科技	265,069	6,311,292.89	0.16
319	300980	祥源新材	269,003	6,310,810.38	0.16
320	300807	天迈科技	200,450	6,310,166.00	0.16
321	603716	塞力医疗	566,400	6,281,376.00	0.16
322	688273	麦澜德	188,322	6,273,005.82	0.16

323	600082	海泰发展	1,812,800	6,254,160.00	0.16
324	603316	诚邦股份	925,200	6,235,848.00	0.16
325	301388	欣灵电气	255,600	6,234,084.00	0.16
326	300931	通用电梯	735,300	6,205,932.00	0.16
327	300717	华信新材	369,200	6,198,868.00	0.16
328	603011	合锻智能	812,800	6,112,256.00	0.16
329	300534	陇神戎发	617,600	6,095,712.00	0.16
330	300956	英力股份	326,906	6,090,258.78	0.16
331	002040	南京港	852,000	6,074,760.00	0.16
332	000856	冀东装备	631,200	6,040,584.00	0.16
333	301011	华立科技	257,930	6,035,562.00	0.16
334	002883	中设股份	483,600	5,938,608.00	0.15
335	003017	大洋生物	236,868	5,760,629.76	0.15
336	601007	金陵饭店	712,600	5,757,808.00	0.15
337	603131	上海沪工	386,740	5,708,282.40	0.15
338	002715	登云股份	350,500	5,688,615.00	0.15
339	300736	百邦科技	443,400	5,662,218.00	0.15
340	300163	先锋新材	1,462,900	5,617,536.00	0.15
341	600693	东百集团	1,381,300	5,539,013.00	0.14
342	000821	京山轻机	336,100	5,340,629.00	0.14
343	301199	迈赫股份	201,800	5,297,250.00	0.14
344	300321	同大股份	271,700	5,257,395.00	0.14
345	603137	恒尚节能	267,400	5,246,388.00	0.14
346	301077	星华新材	256,800	5,220,744.00	0.14
347	688776	国光电气	53,137	5,175,012.43	0.13
348	600793	宜宾纸业	427,746	4,970,408.52	0.13
349	001296	长江材料	211,030	4,965,535.90	0.13
350	301326	捷邦科技	122,654	4,919,651.94	0.13
351	000993	闽东电力	480,800	4,904,160.00	0.13
352	603813	原尚股份	302,100	4,878,915.00	0.13
353	600156	华升股份	986,600	4,854,072.00	0.13

354	301396	宏景科技	140,217	4,718,302.05	0.12
355	001202	炬申股份	267,200	4,694,704.00	0.12
356	300535	达威股份	263,470	4,613,359.70	0.12
357	300417	南华仪器	364,900	4,579,495.00	0.12
358	600883	博闻科技	534,300	4,541,550.00	0.12
359	301085	亚康股份	78,498	4,506,570.18	0.12
360	688110	东芯股份	125,591	4,324,098.13	0.11
361	301113	雅艺科技	133,600	4,311,272.00	0.11
362	002876	三利谱	116,400	4,280,028.00	0.11
363	002760	凤形股份	194,200	4,256,864.00	0.11
364	300061	旗天科技	725,600	4,252,016.00	0.11
365	600561	江西长运	646,900	4,153,098.00	0.11
366	300387	富邦股份	492,400	4,106,616.00	0.11
367	600202	哈空调	645,700	4,029,168.00	0.10
368	002295	精艺股份	484,900	3,961,633.00	0.10
369	300826	测绘股份	213,410	3,856,318.70	0.10
370	688229	博睿数据	80,161	3,853,339.27	0.10
371	688456	有研粉材	136,692	3,850,613.64	0.10
372	000702	正虹科技	611,100	3,831,597.00	0.10
373	301053	远信工业	136,800	3,811,248.00	0.10
374	300626	华瑞股份	344,000	3,732,400.00	0.10
375	301001	凯淳股份	145,200	3,708,408.00	0.10
376	002899	英派斯	210,100	3,477,155.00	0.09
377	688004	博汇科技	117,278	3,444,454.86	0.09
378	002023	海特高新	376,300	3,424,330.00	0.09
379	300984	金沃股份	116,200	3,248,952.00	0.08
380	603828	柯利达	837,400	3,198,868.00	0.08
381	603320	迪贝电气	189,200	3,010,172.00	0.08
382	002357	富临运业	369,600	2,790,480.00	0.07
383	688766	普冉股份	27,411	2,685,729.78	0.07
384	605255	天普股份	91,700	1,609,335.00	0.04

385	603860	中公高科	43,200	1,341,360.00	0.03
386	603080	新疆火炬	64,400	1,072,904.00	0.03
387	688717	艾罗能源	16,147	898,742.02	0.02
388	688678	福立旺	22,407	412,512.87	0.01
389	301526	国际复材	9,723	51,142.98	0.00
390	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
391	688702	盛科通信	549	26,456.31	0.00
392	688652	京仪装备	416	23,736.96	0.00
393	301559	中集环科	1,165	21,261.25	0.00
394	601096	宏盛华源	3,918	20,491.14	0.00
395	301558	三态股份	1,458	19,930.86	0.00
396	601083	锦江航运	1,263	14,966.55	0.00
397	301508	中机认检	419	13,512.75	0.00
398	688653	康希通信	648	12,221.28	0.00
399	301516	中远通	604	12,116.24	0.00
400	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
401	301413	安培龙	164	11,521.00	0.00
402	301550	斯菱股份	260	11,330.80	0.00
403	301251	威尔高	321	11,119.44	0.00
404	301568	思泰克	246	10,641.96	0.00
405	688716	中研股份	267	9,713.46	0.00
406	301517	陕西华达	185	9,601.50	0.00
407	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
408	688720	艾森股份	165	9,489.15	0.00
409	301459	丰茂股份	208	9,251.84	0.00
410	301555	惠柏新材	224	8,888.32	0.00
411	301578	辰奕智能	118	8,782.74	0.00
412	301489	思泉新材	128	8,674.56	0.00
413	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
414	301548	崇德科技	136	8,028.08	0.00
415	688648	中邮科技	303	7,547.73	0.00

416	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
417	603004	鼎龙科技	195	6,727.50	0.00
418	603107	上海汽配	292	6,412.32	0.00
419	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
420	001306	夏厦精密	64	5,415.68	0.00
421	603193	润本股份	303	5,157.06	0.00
422	001326	联域股份	99	5,122.26	0.00
423	603075	热威股份	182	4,244.24	0.00
424	001239	永达股份	189	4,146.66	0.00
425	001358	兴欣新材	87	4,026.36	0.00
426	603273	天元智能	178	3,640.10	0.00
427	603231	索宝蛋白	161	3,583.86	0.00
428	603373	安邦护卫	88	3,561.36	0.00
429	603276	恒兴新材	134	3,333.92	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	002963	豪尔赛	18,803,470.00	27.09
2	000554	泰山石油	18,094,526.00	26.07
3	300240	飞力达	17,893,781.00	25.78
4	002826	易明医药	17,620,574.00	25.38
5	300605	恒锋信息	17,042,186.05	24.55
6	301081	严牌股份	16,890,460.54	24.33
7	688659	元琛科技	16,776,830.66	24.17
8	301049	超越科技	16,239,583.68	23.39
9	603656	泰禾智能	16,197,634.20	23.33
10	600202	哈空调	16,083,936.00	23.17

11	000632	三木集团	15,891,256.00	22.89
12	688217	睿昂基因	15,653,303.04	22.55
13	002205	国统股份	15,618,030.12	22.50
14	300906	日月明	15,536,942.00	22.38
15	300980	祥源新材	15,515,327.01	22.35
16	001231	农心科技	15,511,413.00	22.34
17	603161	科华控股	15,465,166.00	22.28
18	301055	张小泉	15,267,487.00	21.99
19	688251	井松智能	15,203,620.06	21.90
20	003004	声迅股份	15,196,562.00	21.89
21	688090	瑞松科技	14,987,935.35	21.59
22	000985	大庆华科	14,493,733.00	20.88
23	603150	万朗磁塑	14,485,321.17	20.87
24	688685	迈信林	14,392,012.76	20.73
25	601226	华电重工	14,372,478.96	20.70
26	301228	实朴检测	14,230,369.00	20.50
27	301067	显盈科技	14,183,520.40	20.43
28	688021	奥福环保	14,177,317.24	20.42
29	300594	朗进科技	14,170,559.00	20.41
30	688171	纬德信息	14,121,679.21	20.34
31	000590	启迪药业	14,059,598.00	20.25
32	688069	德林海	13,960,399.01	20.11
33	300955	嘉亨家化	13,850,980.80	19.95
34	002780	三夫户外	13,847,280.45	19.95
35	300935	盈建科	13,810,923.80	19.89
36	600243	青海华鼎	13,806,029.00	19.89
37	603172	万丰股份	13,797,786.64	19.88
38	688038	中科通达	13,732,398.10	19.78
39	688218	江苏北人	13,713,788.81	19.75
40	002809	红墙股份	13,700,759.10	19.74
41	300976	达瑞电子	13,609,983.55	19.61

42	605155	西大门	13,536,393.45	19.50
43	002231	奥维通信	13,520,398.00	19.48
44	600083	博信股份	13,501,489.00	19.45
45	603696	安记食品	13,497,252.00	19.44
46	301209	联合化学	13,464,027.00	19.40
47	002691	冀凯股份	13,441,159.47	19.36
48	301233	盛帮股份	13,411,779.96	19.32
49	688129	东来技术	13,396,007.15	19.30
50	002278	神开股份	13,295,745.00	19.15
51	605180	华生科技	13,276,897.84	19.13
52	600692	亚通股份	13,231,337.00	19.06
53	002696	百洋股份	13,228,886.00	19.06
54	605178	时空科技	13,220,581.00	19.04
55	300886	华业香料	13,164,628.00	18.96
56	300234	开尔新材	13,146,974.25	18.94
57	003023	彩虹集团	13,132,346.40	18.92
58	300961	深水海纳	13,060,782.00	18.81
59	003008	开普检测	13,034,691.00	18.78
60	300892	品渥食品	12,983,138.16	18.70
61	300554	三超新材	12,896,410.00	18.58
62	300819	聚杰微纤	12,895,371.50	18.58
63	603073	彩蝶实业	12,844,183.10	18.50
64	603580	艾艾精工	12,831,599.00	18.48
65	600520	文一科技	12,717,463.30	18.32
66	688372	伟测科技	12,707,280.22	18.31
67	605298	必得科技	12,702,988.50	18.30
68	300126	锐奇股份	12,689,239.00	18.28
69	300141	和顺电气	12,660,959.00	18.24
70	688013	天臣医疗	12,599,582.96	18.15
71	001296	长江材料	12,567,407.70	18.10
72	301023	江南奕帆	12,563,454.00	18.10

73	002492	恒基达鑫	12,544,521.00	18.07
74	301027	华蓝集团	12,520,028.88	18.04
75	301065	本立科技	12,504,692.50	18.01
76	300385	雪浪环境	12,419,512.00	17.89
77	002820	桂发祥	12,376,841.00	17.83
78	300907	康平科技	12,367,017.00	17.81
79	002778	中晟高科	12,361,792.80	17.81
80	688215	瑞晟智能	12,341,027.79	17.78
81	300927	江天化学	12,318,359.20	17.74
82	300675	建科院	12,298,144.00	17.72
83	688557	兰剑智能	12,222,353.65	17.61
84	300816	艾可蓝	12,189,679.00	17.56
85	003017	大洋生物	12,162,653.15	17.52
86	688669	聚石化学	12,140,418.63	17.49
87	688163	赛伦生物	12,073,292.70	17.39
88	300534	陇神戎发	12,072,311.00	17.39
89	688115	思林杰	12,025,135.43	17.32
90	300015	爱尔眼科	12,017,573.55	17.31
91	002591	恒大高新	11,890,655.00	17.13
92	300076	GQY视讯	11,878,830.00	17.11
93	688395	正弦电气	11,815,227.48	17.02
94	300845	捷安高科	11,810,525.00	17.01
95	000856	冀东装备	11,782,094.00	16.97
96	300929	华骐环保	11,726,011.60	16.89
97	300956	英力股份	11,700,471.60	16.85
98	300243	瑞丰高材	11,697,544.00	16.85
99	603903	中持股份	11,692,204.88	16.84
100	688329	艾隆科技	11,632,732.72	16.76
101	301105	鸿铭股份	11,557,899.00	16.65
102	688369	致远互联	11,540,794.04	16.62
103	600793	宜宾纸业	11,491,172.74	16.55

104	300743	天地数码	11,437,677.31	16.48
105	301167	建研设计	11,429,051.26	16.46
106	688501	青达环保	11,392,869.24	16.41
107	300995	奇德新材	11,385,415.16	16.40
108	300334	津膜科技	11,369,030.00	16.38
109	600097	开创国际	11,316,919.18	16.30
110	688393	安必平	11,249,323.82	16.20
111	603045	福达合金	11,144,106.00	16.05
112	300635	中达安	11,119,099.00	16.02
113	300652	雷迪克	11,106,976.00	16.00
114	603182	嘉华股份	11,081,682.00	15.96
115	605255	天普股份	11,077,900.00	15.96
116	603090	宏盛股份	11,063,504.30	15.94
117	001202	炬申股份	11,012,372.23	15.86
118	301008	宏昌科技	10,937,669.20	15.76
119	603316	诚邦股份	10,835,225.00	15.61
120	301131	聚赛龙	10,784,121.00	15.53
121	300717	华信新材	10,746,523.88	15.48
122	603856	东宏股份	10,740,969.10	15.47
123	300521	爱司凯	10,720,812.00	15.44
124	688597	煜邦电力	10,718,177.65	15.44
125	603079	圣达生物	10,689,712.80	15.40
126	688622	禾信仪器	10,680,358.59	15.39
127	603272	联翔股份	10,620,014.00	15.30
128	003003	天元股份	10,593,529.00	15.26
129	603813	原尚股份	10,571,308.00	15.23
130	300947	德必集团	10,569,956.00	15.23
131	603183	建研院	10,558,385.60	15.21
132	301040	中环海陆	10,528,778.76	15.17
133	003001	中岩大地	10,479,294.45	15.10
134	300810	中科海讯	10,475,030.00	15.09

135	688067	爱威科技	10,457,382.00	15.06
136	301057	汇隆新材	10,449,452.00	15.05
137	300992	泰福泵业	10,418,684.16	15.01
138	300321	同大股份	10,402,606.00	14.99
139	300865	大宏立	10,372,063.00	14.94
140	301237	和顺科技	10,320,741.45	14.87
141	301300	远翔新材	10,306,053.72	14.85
142	688589	力合微	10,297,137.28	14.83
143	300753	爱朋医疗	10,267,773.00	14.79
144	688367	工大高科	10,265,831.34	14.79
145	000679	大连友谊	10,263,255.00	14.78
146	600883	博闻科技	10,260,871.00	14.78
147	300889	爱克股份	10,244,329.33	14.76
148	688259	创耀科技	10,207,016.51	14.70
149	002943	宇晶股份	10,180,847.80	14.67
150	688206	概伦电子	10,153,024.87	14.63
151	300059	东方财富	10,131,525.00	14.59
152	600834	申通地铁	10,128,914.00	14.59
153	002058	威尔泰	10,111,574.00	14.57
154	301197	工大科雅	10,109,252.20	14.56
155	300949	奥雅股份	10,067,378.00	14.50
156	688528	秦川物联	10,050,800.71	14.48
157	688186	广大特材	10,042,071.71	14.47
158	603238	诺邦股份	9,999,462.50	14.40
159	001211	双枪科技	9,984,959.00	14.38
160	688216	气派科技	9,966,351.87	14.36
161	600232	金鹰股份	9,945,226.03	14.33
162	600547	山东黄金	9,939,948.04	14.32
163	688058	宝兰德	9,874,615.31	14.22
164	688201	信安世纪	9,866,252.37	14.21
165	300546	雄帝科技	9,851,247.40	14.19

166	300046	台基股份	9,801,475.00	14.12
167	300242	佳云科技	9,790,558.00	14.10
168	300462	华铭智能	9,786,245.00	14.10
169	300670	大烨智能	9,783,947.00	14.09
170	000605	渤海股份	9,781,973.40	14.09
171	003011	海象新材	9,766,003.40	14.07
172	001336	楚环科技	9,752,829.00	14.05
173	003029	吉大正元	9,743,878.00	14.04
174	300703	创源股份	9,733,128.00	14.02
175	603955	大千生态	9,726,622.00	14.01
176	300018	中元股份	9,718,350.00	14.00
177	688227	品高股份	9,715,500.46	14.00
178	603080	新疆火炬	9,713,475.00	13.99
179	688570	天玛智控	9,711,727.68	13.99
180	600281	华阳新材	9,705,867.75	13.98
181	002828	贝肯能源	9,699,080.00	13.97
182	603507	振江股份	9,698,027.00	13.97
183	002149	西部材料	9,693,343.00	13.96
184	600505	西昌电力	9,679,301.00	13.94
185	603616	韩建河山	9,674,500.00	13.94
186	688022	瀚川智能	9,673,672.57	13.94
187	300353	东土科技	9,661,670.21	13.92
188	688592	司南导航	9,658,923.06	13.91
189	603595	东尼电子	9,650,612.00	13.90
190	002890	弘宇股份	9,646,132.60	13.90
191	000573	粤宏远 A	9,641,182.00	13.89
192	600802	福建水泥	9,624,183.20	13.86
193	002474	榕基软件	9,615,170.00	13.85
194	300658	延江股份	9,592,763.40	13.82
195	300897	山科智能	9,591,851.00	13.82
196	600444	国机通用	9,565,740.00	13.78

197	300787	海能实业	9,549,561.40	13.76
198	002297	博云新材	9,547,305.00	13.75
199	301349	信德新材	9,476,749.00	13.65
200	600101	明星电力	9,435,236.00	13.59
201	301336	趣睡科技	9,432,818.00	13.59
202	688081	兴图新科	9,429,777.79	13.58
203	600355	精伦电子	9,404,288.00	13.55
204	600756	浪潮软件	9,399,620.76	13.54
205	001337	四川黄金	9,397,498.00	13.54
206	300948	冠中生态	9,372,052.00	13.50
207	603810	丰山集团	9,339,101.00	13.45
208	301001	凯淳股份	9,320,656.00	13.43
209	603356	华菱精工	9,316,015.00	13.42
210	301378	通达海	9,307,900.00	13.41
211	688638	誉辰智能	9,302,352.65	13.40
212	300689	澄天伟业	9,273,116.00	13.36
213	300610	晨化股份	9,255,308.16	13.33
214	603041	美思德	9,239,161.00	13.31
215	603655	朗博科技	9,234,543.84	13.30
216	002298	中电兴发	9,216,814.00	13.28
217	300447	全信股份	9,216,053.00	13.28
218	301011	华立科技	9,143,269.00	13.17
219	688305	科德数控	9,130,162.05	13.15
220	300971	博亚精工	9,127,657.64	13.15
221	301010	晶雪节能	9,126,763.00	13.15
222	688357	建龙微纳	9,123,947.23	13.14
223	600193	创兴资源	9,109,015.16	13.12
224	300177	中海达	9,102,466.00	13.11
225	301359	东南电子	9,095,005.00	13.10
226	001259	利仁科技	9,079,626.00	13.08
227	002207	准油股份	9,051,850.00	13.04

228	002469	三维化学	9,051,744.00	13.04
229	603499	翔港科技	9,048,970.84	13.04
230	688350	富淼科技	9,033,414.35	13.01
231	688655	迅捷兴	9,023,617.62	13.00
232	688011	新光光电	9,016,156.34	12.99
233	688178	万德斯	9,002,858.32	12.97
234	600489	中金黄金	8,998,875.38	12.96
235	002090	金智科技	8,993,972.00	12.96
236	002876	三利谱	8,991,781.00	12.95
237	688485	九州一轨	8,981,933.35	12.94
238	688296	和达科技	8,973,025.05	12.93
239	300074	华平股份	8,970,836.00	12.92
240	688565	力源科技	8,945,287.24	12.89
241	603329	上海雅仕	8,943,277.00	12.88
242	688420	美腾科技	8,938,098.67	12.88
243	300876	蒙泰高新	8,922,925.50	12.85
244	301079	邵阳液压	8,882,378.00	12.80
245	688360	德马科技	8,871,666.70	12.78
246	000755	山西路桥	8,864,439.00	12.77
247	002829	星网宇达	8,855,965.40	12.76
248	688229	博睿数据	8,843,429.07	12.74
249	300468	四方精创	8,833,207.00	12.72
250	600429	三元股份	8,832,233.00	12.72
251	688607	康众医疗	8,828,772.56	12.72
252	300164	通源石油	8,813,730.00	12.70
253	301248	杰创智能	8,812,189.96	12.69
254	300490	华自科技	8,803,717.00	12.68
255	300950	德固特	8,795,610.79	12.67
256	600617	国新能源	8,792,883.00	12.67
257	603657	春光科技	8,773,320.00	12.64
258	688416	恒烁股份	8,771,209.39	12.64

259	301198	喜悦智行	8,770,559.00	12.63
260	002594	比亚迪	8,753,238.00	12.61
261	600268	国电南自	8,752,990.00	12.61
262	300585	奥联电子	8,749,866.00	12.60
263	300417	南华仪器	8,743,936.00	12.60
264	603214	爱婴室	8,735,714.00	12.58
265	300387	富邦股份	8,735,057.00	12.58
266	300647	超频三	8,733,804.00	12.58
267	300008	天海防务	8,718,900.00	12.56
268	000993	闽东电力	8,718,023.00	12.56
269	301163	宏德股份	8,702,426.00	12.54
270	002883	中设股份	8,691,288.00	12.52
271	603637	镇海股份	8,674,642.45	12.50
272	300152	新动力	8,665,326.00	12.48
273	002361	神剑股份	8,656,779.00	12.47
274	300435	中泰股份	8,640,238.00	12.45
275	688489	三未信安	8,637,038.87	12.44
276	300329	海伦钢琴	8,633,696.80	12.44
277	002119	康强电子	8,628,154.00	12.43
278	002629	仁智股份	8,620,609.00	12.42
279	300838	浙江力诺	8,618,882.00	12.42
280	002620	瑞和股份	8,615,671.50	12.41
281	002935	天奥电子	8,604,480.00	12.39
282	301012	扬电科技	8,598,421.82	12.39
283	300405	科隆股份	8,591,507.70	12.38
284	300912	凯龙高科	8,578,368.00	12.36
285	688455	科捷智能	8,564,995.52	12.34
286	300424	航新科技	8,559,722.24	12.33
287	300278	华昌达	8,551,797.96	12.32
288	600082	海泰发展	8,548,168.00	12.31
289	688681	科汇股份	8,540,171.05	12.30

290	300649	杭州园林	8,539,880.00	12.30
291	688456	有研粉材	8,530,396.67	12.29
292	688288	鸿泉物联	8,529,455.26	12.29
293	603679	华体科技	8,522,578.00	12.28
294	300804	广康生化	8,512,775.00	12.26
295	600235	民丰特纸	8,512,267.00	12.26
296	600736	苏州高新	8,507,919.00	12.26
297	000929	兰州黄河	8,481,970.00	12.22
298	603138	海量数据	8,477,241.00	12.21
299	603716	塞力医疗	8,472,022.00	12.20
300	605287	德才股份	8,454,778.00	12.18
301	301326	捷邦科技	8,447,370.84	12.17
302	300851	交大思诺	8,444,662.00	12.16
303	002227	奥特迅	8,437,885.00	12.15
304	688299	长阳科技	8,434,513.28	12.15
305	600156	华升股份	8,432,956.00	12.15
306	300523	辰安科技	8,429,112.00	12.14
307	301266	宇邦新材	8,414,919.00	12.12
308	300617	安靠智电	8,410,212.00	12.12
309	000561	烽火电子	8,409,073.00	12.11
310	301125	腾亚精工	8,405,028.00	12.11
311	300807	天迈科技	8,401,617.00	12.10
312	600678	四川金顶	8,389,383.00	12.09
313	003037	三和管桩	8,384,035.00	12.08
314	300241	瑞丰光电	8,372,141.00	12.06
315	300464	星徽股份	8,365,809.00	12.05
316	300707	威唐工业	8,355,449.82	12.04
317	688112	鼎阳科技	8,351,805.41	12.03
318	301259	艾布鲁	8,321,803.45	11.99
319	300590	移为通信	8,313,030.00	11.98
320	002857	三晖电气	8,303,509.00	11.96

321	002475	立讯精密	8,283,307.00	11.93
322	605003	众望布艺	8,276,527.62	11.92
323	002842	翔鹭钨业	8,265,022.00	11.91
324	300640	德艺文创	8,241,778.00	11.87
325	603059	倍加洁	8,229,738.00	11.86
326	000619	海螺新材	8,205,631.00	11.82
327	301338	凯格精机	8,192,458.00	11.80
328	300923	研奥股份	8,184,405.00	11.79
329	000886	海南高速	8,182,516.90	11.79
330	301196	唯科科技	8,174,020.74	11.77
331	300750	宁德时代	8,169,307.00	11.77
332	600855	航天长峰	8,159,104.00	11.75
333	600939	重庆建工	8,147,688.00	11.74
334	603960	克来机电	8,147,516.00	11.74
335	301002	崧盛股份	8,132,940.50	11.72
336	603126	中材节能	8,107,808.98	11.68
337	300125	聆达股份	8,100,535.00	11.67
338	002105	信隆健康	8,091,431.00	11.66
339	300022	吉峰科技	8,086,530.00	11.65
340	300970	华绿生物	8,081,215.34	11.64
341	000948	南天信息	8,060,518.54	11.61
342	300665	飞鹿股份	8,060,167.00	11.61
343	600455	博通股份	8,048,635.00	11.59
344	002140	东华科技	8,027,074.00	11.56
345	603261	立航科技	8,017,423.00	11.55
346	600319	亚星化学	8,011,509.62	11.54
347	002420	毅昌科技	7,992,953.00	11.51
348	300825	阿尔特	7,985,775.00	11.50
349	603320	迪贝电气	7,984,670.00	11.50
350	301396	宏景科技	7,974,574.39	11.49
351	002246	北化股份	7,968,748.00	11.48

352	600697	欧亚集团	7,968,505.39	11.48
353	601789	宁波建工	7,961,080.00	11.47
354	600476	湘邮科技	7,950,629.00	11.45
355	300883	龙利得	7,945,071.00	11.44
356	688682	霍莱沃	7,920,291.04	11.41
357	300163	先锋新材	7,908,146.00	11.39
358	301158	德石股份	7,903,579.00	11.39
359	001260	坤泰股份	7,902,549.28	11.38
360	600538	国发股份	7,899,441.00	11.38
361	688577	浙海德曼	7,883,687.61	11.36
362	301075	多瑞医药	7,880,255.00	11.35
363	301118	恒光股份	7,869,097.00	11.34
364	301032	新柴股份	7,840,377.00	11.29
365	600119	长江投资	7,821,988.00	11.27
366	300360	炬华科技	7,817,906.00	11.26
367	601002	晋亿实业	7,808,251.00	11.25
368	002398	垒知集团	7,772,085.00	11.20
369	000638	万方发展	7,770,711.00	11.19
370	688096	京源环保	7,747,495.69	11.16
371	300040	九洲集团	7,723,674.00	11.13
372	688517	金冠电气	7,723,389.20	11.13
373	603330	天洋新材	7,711,837.00	11.11
374	688667	菱电电控	7,708,256.62	11.10
375	603822	嘉澳环保	7,707,955.00	11.10
376	688355	明志科技	7,707,165.78	11.10
377	002806	华锋股份	7,703,138.50	11.10
378	301195	北路智控	7,698,078.76	11.09
379	300619	金银河	7,688,975.00	11.08
380	300694	蠡湖股份	7,686,351.00	11.07
381	300877	金春股份	7,683,544.00	11.07
382	300061	旗天科技	7,683,346.00	11.07

383	600128	苏豪弘业	7,682,101.63	11.07
384	301295	美硕科技	7,676,271.80	11.06
385	002455	百川股份	7,675,442.00	11.06
386	301003	江苏博云	7,670,178.00	11.05
387	300826	测绘股份	7,668,129.50	11.05
388	603332	苏州龙杰	7,641,768.16	11.01
389	002969	嘉美包装	7,637,445.00	11.00
390	000823	超声电子	7,634,302.14	11.00
391	605258	协和电子	7,627,598.00	10.99
392	300920	润阳科技	7,619,087.00	10.98
393	603789	星光农机	7,617,822.29	10.97
394	600336	澳柯玛	7,602,865.00	10.95
395	688130	晶华微	7,583,401.06	10.92
396	002682	龙洲股份	7,567,973.36	10.90
397	688283	坤恒顺维	7,560,877.60	10.89
398	600107	美尔雅	7,517,655.00	10.83
399	300626	华瑞股份	7,516,362.00	10.83
400	301161	唯万密封	7,507,470.00	10.81
401	000702	正虹科技	7,499,432.00	10.80
402	688111	金山办公	7,479,889.97	10.77
403	002871	伟隆股份	7,446,455.05	10.73
404	300281	金明精机	7,434,776.00	10.71
405	002247	聚力文化	7,432,783.00	10.71
406	603036	如通股份	7,432,461.00	10.71
407	301314	科瑞思	7,427,326.70	10.70
408	603860	中公高科	7,400,983.00	10.66
409	603988	中电电机	7,396,145.40	10.65
410	300721	怡达股份	7,348,794.00	10.59
411	000507	珠海港	7,340,830.00	10.57
412	301068	大地海洋	7,334,021.83	10.56
413	301231	荣信文化	7,331,318.86	10.56

414	688512	慧智微	7,328,157.10	10.56
415	600506	统一股份	7,309,604.00	10.53
416	688125	安达智能	7,294,562.55	10.51
417	002860	星帅尔	7,294,276.00	10.51
418	002144	宏达高科	7,283,293.00	10.49
419	300637	扬帆新材	7,250,090.70	10.44
420	600218	全柴动力	7,238,927.00	10.43
421	603639	海利尔	7,236,047.00	10.42
422	600421	华嵘控股	7,203,739.00	10.38
423	001255	博菲电气	7,189,389.04	10.36
424	300579	数字认证	7,186,618.00	10.35
425	688616	西力科技	7,166,184.87	10.32
426	002114	罗平锌电	7,154,271.00	10.31
427	300828	锐新科技	7,153,644.00	10.30
428	300690	双一科技	7,153,363.00	10.30
429	301429	森泰股份	7,146,572.00	10.29
430	600539	狮头股份	7,136,564.00	10.28
431	301226	祥明智能	7,119,698.60	10.26
432	002383	合众思壮	7,098,104.00	10.22
433	603508	思维列控	7,064,312.00	10.18
434	601008	连云港	7,025,550.00	10.12
435	600448	华纺股份	7,006,631.00	10.09
436	600561	江西长运	7,004,979.00	10.09
437	600099	林海股份	6,990,858.20	10.07
438	603159	上海亚虹	6,988,256.20	10.07
439	300331	苏大维格	6,955,601.00	10.02
440	603029	天鹅股份	6,927,825.30	9.98
441	000757	浩物股份	6,921,950.00	9.97
442	300449	汉邦高科	6,912,501.00	9.96
443	002715	登云股份	6,895,858.00	9.93
444	603321	梅轮电梯	6,877,326.00	9.91

445	600356	恒丰纸业	6,847,851.72	9.86
446	001282	三联锻造	6,831,900.51	9.84
447	002921	联诚精密	6,811,959.00	9.81
448	300535	达威股份	6,806,533.48	9.80
449	688056	莱伯泰科	6,796,472.68	9.79
450	000821	京山轻机	6,791,797.34	9.78
451	603171	税友股份	6,782,154.00	9.77
452	688255	凯尔达	6,770,100.50	9.75
453	300510	金冠股份	6,753,975.00	9.73
454	600533	栖霞建设	6,697,093.00	9.65
455	300984	金沃股份	6,690,945.00	9.64
456	603011	合锻智能	6,617,665.00	9.53
457	002066	瑞泰科技	6,569,351.00	9.46
458	600433	冠豪高新	6,560,366.00	9.45
459	688297	中无人机	6,550,837.98	9.44
460	301298	东利机械	6,537,282.00	9.42
461	002862	实丰文化	6,500,464.00	9.36
462	688448	磁谷科技	6,493,978.91	9.35
463	688273	麦澜德	6,414,450.64	9.24
464	688700	东威科技	6,390,666.54	9.21
465	600276	恒瑞医药	6,351,332.00	9.15
466	301113	雅艺科技	6,280,657.00	9.05
467	300931	通用电梯	6,187,698.00	8.91
468	002760	凤形股份	6,082,158.00	8.76
469	301388	欣灵电气	6,075,608.00	8.75
470	002494	华斯股份	6,055,694.00	8.72
471	002040	南京港	6,051,811.00	8.72
472	300736	百邦科技	5,988,048.00	8.63
473	600148	长春一东	5,968,335.00	8.60
474	300210	森远股份	5,862,286.00	8.44
475	003042	中农联合	5,823,792.00	8.39

476	600593	大连圣亚	5,817,068.00	8.38
477	000409	云鼎科技	5,816,604.00	8.38
478	601007	金陵饭店	5,768,771.70	8.31
479	002802	洪汇新材	5,730,433.78	8.25
480	600693	东百集团	5,713,431.00	8.23
481	603131	上海沪工	5,644,022.60	8.13
482	603286	日盈电子	5,634,775.00	8.12
483	002748	世龙实业	5,628,471.00	8.11
484	688379	华光新材	5,475,244.93	7.89
485	002295	精艺股份	5,327,126.00	7.67
486	603048	浙江黎明	5,313,765.00	7.65
487	300333	兆日科技	5,282,671.00	7.61
488	002719	麦趣尔	5,233,057.00	7.54
489	300270	中威电子	5,212,992.00	7.51
490	301077	星华新材	5,180,540.00	7.46
491	000933	神火股份	5,177,096.00	7.46
492	301199	迈赫股份	5,134,202.00	7.40
493	301036	双乐股份	5,131,442.76	7.39
494	301085	亚康股份	5,079,908.76	7.32
495	300991	创益通	5,047,682.00	7.27
496	600405	动力源	5,047,254.38	7.27
497	002899	英派斯	5,025,177.00	7.24
498	300218	安利股份	4,975,044.00	7.17
499	603137	恒尚节能	4,964,996.61	7.15
500	300781	因赛集团	4,940,057.00	7.12
501	688776	国光电气	4,888,841.37	7.04
502	002357	富临运业	4,884,874.00	7.04
503	603488	展鹏科技	4,884,456.20	7.04
504	002861	瀛通通讯	4,861,567.00	7.00
505	300588	熙菱信息	4,834,914.00	6.96
506	603201	常润股份	4,822,216.00	6.95

507	002241	歌尔股份	4,764,508.00	6.86
508	301042	安联锐视	4,746,142.00	6.84
509	300731	科创新源	4,717,937.00	6.80
510	300668	杰恩设计	4,706,057.00	6.78
511	300296	利亚德	4,659,194.00	6.71
512	688521	芯原股份	4,604,619.59	6.63
513	301130	西点药业	4,533,948.00	6.53
514	001268	联合精密	4,512,049.22	6.50
515	301156	美农生物	4,466,744.00	6.43
516	603089	正裕工业	4,439,776.00	6.40
517	688786	悦安新材	4,394,207.13	6.33
518	002787	华源控股	4,317,748.00	6.22
519	301234	五洲医疗	4,296,097.00	6.19
520	300050	世纪鼎利	4,228,168.00	6.09
521	603700	宁水集团	4,197,015.76	6.05
522	688110	东芯股份	4,098,342.64	5.90
523	301053	远信工业	4,067,453.00	5.86
524	300106	西部牧业	4,007,948.00	5.77
525	603828	柯利达	3,993,628.00	5.75
526	301037	保立佳	3,963,407.00	5.71
527	688004	博汇科技	3,948,829.51	5.69
528	603926	铁流股份	3,939,810.00	5.68
529	688560	明冠新材	3,917,250.20	5.64
530	300458	全志科技	3,845,898.00	5.54
531	003021	兆威机电	3,801,982.00	5.48
532	002012	凯恩股份	3,749,826.00	5.40
533	301107	瑜欣电子	3,714,736.00	5.35
534	300223	北京君正	3,706,494.00	5.34
535	000975	银泰黄金	3,655,758.00	5.27
536	603038	华立股份	3,642,316.00	5.25
537	300562	乐心医疗	3,595,699.00	5.18

538	300875	捷强装备	3,559,912.80	5.13
539	600272	开开实业	3,554,388.00	5.12
540	601899	紫金矿业	3,545,292.00	5.11
541	000725	京东方 A	3,520,126.00	5.07
542	600887	伊利股份	3,510,470.00	5.06
543	603721	中广天择	3,461,595.00	4.99
544	002981	朝阳科技	3,459,701.00	4.98
545	002817	黄山胶囊	3,435,983.52	4.95
546	300410	正业科技	3,434,269.00	4.95
547	002023	海特高新	3,403,795.00	4.90
548	605033	美邦股份	3,377,350.00	4.87
549	300885	海昌新材	3,370,028.00	4.85
550	000807	云铝股份	3,348,322.00	4.82
551	002199	东晶电子	3,234,044.00	4.66
552	002971	和远气体	3,073,073.00	4.43
553	300977	深圳瑞捷	3,049,849.00	4.39
554	301022	海泰科	3,025,623.20	4.36
555	300823	建科机械	2,887,822.00	4.16
556	001209	洪兴股份	2,877,195.20	4.14
557	300563	神宇股份	2,864,669.00	4.13
558	001201	东瑞股份	2,817,136.20	4.06
559	001226	拓山重工	2,773,162.00	3.99
560	300295	三六五网	2,753,546.96	3.97
561	002885	京泉华	2,731,454.00	3.93
562	301073	君亭酒店	2,730,203.00	3.93
563	002559	亚威股份	2,715,499.00	3.91
564	301192	泰祥股份	2,699,988.00	3.89
565	002767	先锋电子	2,692,614.00	3.88
566	300611	美力科技	2,669,315.00	3.85
567	002931	锋龙股份	2,664,432.00	3.84
568	688001	华兴源创	2,621,322.93	3.78

569	688766	普冉股份	2,609,530.69	3.76
570	688092	爱科科技	2,603,039.94	3.75
571	300162	雷曼光电	2,580,193.00	3.72
572	603726	朗迪集团	2,509,504.00	3.61
573	002136	安纳达	2,480,540.00	3.57
574	688109	品茗科技	2,436,234.19	3.51
575	002856	美芝股份	2,424,529.00	3.49
576	300746	汉嘉设计	2,385,003.00	3.44
577	301018	申菱环境	2,384,418.00	3.43
578	002495	佳隆股份	2,282,864.00	3.29
579	688118	普元信息	2,244,396.69	3.23
580	300097	智云股份	2,180,535.00	3.14
581	301128	强瑞技术	2,167,982.00	3.12
582	603269	海鸥股份	2,152,849.00	3.10
583	688097	博众精工	2,115,429.69	3.05
584	603189	网达软件	2,107,815.00	3.04
585	002846	英联股份	2,034,526.00	2.93
586	301178	天亿马	2,003,596.00	2.89
587	301288	清研环境	1,985,712.00	2.86
588	000571	新大洲A	1,895,782.00	2.73
589	600794	保税科技	1,843,797.00	2.66
590	002364	中恒电气	1,748,800.00	2.52
591	002443	金洲管道	1,730,888.00	2.49
592	603536	惠发食品	1,721,099.00	2.48
593	300836	佰奥智能	1,696,060.00	2.44
594	300899	上海凯鑫	1,644,089.00	2.37
595	300780	德恩精工	1,601,375.00	2.31
596	002830	名雕股份	1,552,460.00	2.24
597	001366	播恩集团	1,487,614.00	2.14
598	002284	亚太股份	1,456,099.00	2.10
599	688292	浩瀚深度	1,444,867.83	2.08

600	688039	当虹科技	1,437,177.92	2.07
601	300644	南京聚隆	1,400,707.00	2.02

注：

本项的"买入金额"按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603656	泰禾智能	17,998,007.48	25.93
2	003004	声迅股份	16,588,429.00	23.90
3	300554	三超新材	15,978,037.12	23.02
4	301067	显盈科技	15,796,431.15	22.75
5	688685	迈信林	15,664,875.77	22.57
6	600692	亚通股份	15,457,617.39	22.27
7	001231	农心科技	15,392,750.00	22.17
8	600083	博信股份	15,392,428.00	22.17
9	603696	安记食品	15,183,664.00	21.87
10	600520	文一科技	14,660,493.00	21.12
11	002691	冀凯股份	14,506,539.78	20.90
12	002591	恒大高新	14,414,597.00	20.76
13	002231	奥维通信	13,564,210.00	19.54
14	603903	中持股份	13,229,989.36	19.06
15	603090	宏盛股份	13,145,543.27	18.94
16	600202	哈空调	13,030,673.00	18.77
17	002058	威尔泰	12,610,817.20	18.17
18	600097	开创国际	12,547,203.46	18.07
19	002963	豪尔赛	12,502,173.00	18.01
20	688115	思林杰	12,408,474.23	17.87
21	600444	国机通用	12,024,378.00	17.32

22	301131	聚赛龙	11,905,561.42	17.15
23	300242	佳云科技	11,859,742.00	17.08
24	301008	宏昌科技	11,607,170.20	16.72
25	603499	翔港科技	11,432,744.13	16.47
26	002826	易明医药	11,381,308.00	16.39
27	300652	雷迪克	11,363,840.00	16.37
28	600281	华阳新材	11,227,994.05	16.17
29	300240	飞力达	11,136,764.86	16.04
30	300015	爱尔眼科	11,040,665.00	15.90
31	300462	华铭智能	10,946,501.00	15.77
32	300949	奥雅股份	10,889,423.00	15.69
33	600678	四川金顶	10,836,195.00	15.61
34	600232	金鹰股份	10,815,745.99	15.58
35	603079	圣达生物	10,732,217.90	15.46
36	600355	精伦电子	10,601,310.00	15.27
37	002828	贝肯能源	10,596,042.70	15.26
38	002890	弘宇股份	10,560,944.60	15.21
39	605255	天普股份	10,542,327.00	15.19
40	603238	诺邦股份	10,520,637.50	15.16
41	603329	上海雅仕	10,469,672.00	15.08
42	688259	创耀科技	10,384,825.11	14.96
43	300241	瑞丰光电	10,363,688.00	14.93
44	000554	泰山石油	10,344,793.00	14.90
45	000632	三木集团	10,314,944.00	14.86
46	600697	欧亚集团	10,147,784.28	14.62
47	600547	山东黄金	9,842,751.79	14.18
48	300980	祥源新材	9,814,220.00	14.14
49	603595	东尼电子	9,741,812.00	14.03
50	300074	华平股份	9,692,764.00	13.96
51	300605	恒锋信息	9,641,837.00	13.89
52	600455	博通股份	9,637,999.00	13.88

53	603080	新疆火炬	9,559,825.50	13.77
54	300707	威唐工业	9,501,021.26	13.69
55	600476	湘邮科技	9,413,333.00	13.56
56	600128	苏豪弘业	9,309,800.76	13.41
57	300883	龙利得	9,294,883.00	13.39
58	300059	东方财富	9,283,526.00	13.37
59	600506	统一股份	9,239,649.00	13.31
60	301259	艾布鲁	9,219,480.70	13.28
61	688416	恒烁股份	9,215,627.25	13.28
62	603789	星光农机	9,163,489.50	13.20
63	300851	交大思诺	9,145,607.00	13.17
64	300405	科隆股份	9,143,026.80	13.17
65	301349	信德新材	9,125,479.52	13.15
66	301081	严牌股份	9,110,780.16	13.12
67	600489	中金黄金	9,096,104.63	13.10
68	688577	浙海德曼	8,945,677.43	12.89
69	600107	美尔雅	8,905,452.00	12.83
70	600218	全柴动力	8,902,505.53	12.82
71	603679	华体科技	8,881,260.00	12.79
72	002420	毅昌科技	8,877,628.00	12.79
73	002806	华锋股份	8,876,691.50	12.79
74	301032	新柴股份	8,837,973.00	12.73
75	301231	荣信文化	8,830,226.93	12.72
76	300022	吉峰科技	8,788,987.00	12.66
77	300694	蠡湖股份	8,675,707.00	12.50
78	300828	锐新科技	8,637,070.50	12.44
79	300912	凯龙高科	8,625,555.50	12.43
80	002682	龙洲股份	8,588,768.68	12.37
81	600099	林海股份	8,570,602.55	12.35
82	688217	睿昂基因	8,548,435.41	12.31
83	001296	长江材料	8,537,622.90	12.30

84	600119	长江投资	8,512,484.00	12.26
85	603161	科华控股	8,501,437.00	12.25
86	600421	华嵘控股	8,483,439.00	12.22
87	603988	中电电机	8,470,008.00	12.20
88	001260	坤泰股份	8,385,155.65	12.08
89	300637	扬帆新材	8,348,055.61	12.03
90	002862	实丰文化	8,327,316.00	12.00
91	600336	澳柯玛	8,308,414.00	11.97
92	301266	宇邦新材	8,308,292.00	11.97
93	603126	中材节能	8,251,761.56	11.89
94	603036	如通股份	8,244,736.04	11.88
95	688659	元琛科技	8,224,987.95	11.85
96	000985	大庆华科	8,216,416.00	11.84
97	300920	润阳科技	8,167,267.00	11.77
98	600538	国发股份	8,164,020.00	11.76
99	688448	磁谷科技	8,135,542.76	11.72
100	002475	立讯精密	8,007,402.00	11.53
101	603332	苏州龙杰	8,005,615.24	11.53
102	002594	比亚迪	7,944,525.00	11.44
103	605258	协和电子	7,860,335.00	11.32
104	603150	万朗磁塑	7,833,233.55	11.28
105	000757	浩物股份	7,832,528.30	11.28
106	601226	华电重工	7,820,006.97	11.26
107	301049	超越科技	7,807,398.00	11.25
108	603029	天鹅股份	7,794,872.00	11.23
109	002247	聚力文化	7,762,982.00	11.18
110	688090	瑞松科技	7,760,983.41	11.18
111	002205	国统股份	7,678,355.00	11.06
112	002921	联诚精密	7,618,397.00	10.97
113	688111	金山办公	7,545,705.64	10.87
114	600243	青海华鼎	7,495,853.00	10.80

115	603321	梅轮电梯	7,431,954.00	10.71
116	688616	西力科技	7,409,035.02	10.67
117	001255	博菲电气	7,402,689.80	10.66
118	002780	三夫户外	7,274,187.00	10.48
119	603860	中公高科	7,256,413.00	10.45
120	003017	大洋生物	7,222,348.00	10.40
121	000409	云鼎科技	7,191,580.00	10.36
122	300449	汉邦高科	7,187,443.00	10.35
123	300125	聆达股份	7,176,282.00	10.34
124	300750	宁德时代	7,083,424.84	10.20
125	301055	张小泉	6,994,093.00	10.08
126	688218	江苏北人	6,989,456.02	10.07
127	300534	陇神戎发	6,816,209.00	9.82
128	600793	宜宾纸业	6,744,666.60	9.72
129	001202	炬申股份	6,744,652.78	9.72
130	600148	长春一东	6,743,173.00	9.71
131	300141	和顺电气	6,719,275.00	9.68
132	301298	东利机械	6,689,265.00	9.64
133	002494	华斯股份	6,674,067.00	9.61
134	003008	开普检测	6,520,936.00	9.39
135	000856	冀东装备	6,509,914.00	9.38
136	003042	中农联合	6,400,296.10	9.22
137	300906	日月明	6,368,917.00	9.17
138	300819	聚杰微纤	6,362,741.50	9.17
139	300956	英力股份	6,340,684.62	9.13
140	605180	华生科技	6,325,841.72	9.11
141	603286	日盈电子	6,244,423.80	9.00
142	002696	百洋股份	6,194,255.00	8.92
143	300210	森远股份	6,158,845.00	8.87
144	600276	恒瑞医药	6,151,296.80	8.86
145	600883	博闻科技	6,113,696.00	8.81

146	603488	展鹏科技	6,104,055.20	8.79
147	002820	桂发祥	6,098,714.00	8.79
148	300892	品渥食品	6,068,159.00	8.74
149	600593	大连圣亚	6,044,740.00	8.71
150	603813	原尚股份	5,988,674.00	8.63
151	002802	洪汇新材	5,963,464.68	8.59
152	300781	因赛集团	5,962,925.00	8.59
153	300333	兆日科技	5,916,819.00	8.52
154	688251	井松智能	5,916,611.48	8.52
155	688297	中无人机	5,904,684.68	8.51
156	300991	创益通	5,860,921.00	8.44
157	300126	锐奇股份	5,835,432.00	8.41
158	688129	东来技术	5,831,317.50	8.40
159	603320	迪贝电气	5,816,665.00	8.38
160	301228	实朴检测	5,807,183.43	8.37
161	688379	华光新材	5,801,036.80	8.36
162	300886	华业香料	5,799,777.40	8.35
163	300675	建科院	5,799,202.24	8.35
164	603172	万丰股份	5,781,541.24	8.33
165	002809	红墙股份	5,777,870.70	8.32
166	605155	西大门	5,776,138.00	8.32
167	301036	双乐股份	5,759,158.68	8.30
168	002876	三利谱	5,735,737.00	8.26
169	603048	浙江黎明	5,731,000.00	8.26
170	300321	同大股份	5,688,023.00	8.19
171	688229	博睿数据	5,597,624.15	8.06
172	300050	世纪鼎利	5,578,779.00	8.04
173	002748	世龙实业	5,573,507.00	8.03
174	600405	动力源	5,568,079.00	8.02
175	300270	中威电子	5,536,670.00	7.98
176	688700	东威科技	5,533,487.31	7.97

177	301209	联合化学	5,497,942.00	7.92
178	300935	盈建科	5,462,559.40	7.87
179	300218	安利股份	5,422,165.00	7.81
180	300668	杰恩设计	5,417,613.00	7.80
181	300387	富邦股份	5,415,979.00	7.80
182	000590	启迪药业	5,410,565.00	7.79
183	000933	神火股份	5,402,010.00	7.78
184	003023	彩虹集团	5,382,283.00	7.75
185	001268	联合精密	5,319,717.30	7.66
186	603201	常润股份	5,294,732.80	7.63
187	002278	神开股份	5,272,065.00	7.59
188	301001	凯淳股份	5,271,012.00	7.59
189	002719	麦趣尔	5,260,952.00	7.58
190	300106	西部牧业	5,257,734.00	7.57
191	300588	熙菱信息	5,244,877.00	7.56
192	300955	嘉亨家化	5,184,590.72	7.47
193	300976	达瑞电子	5,176,570.60	7.46
194	603073	彩蝶实业	5,170,001.00	7.45
195	603089	正裕工业	5,136,140.00	7.40
196	301042	安联锐视	5,133,142.00	7.39
197	605298	必得科技	5,113,766.00	7.37
198	688038	中科通达	5,106,076.88	7.36
199	301105	鸿铭股份	5,080,971.00	7.32
200	300234	开尔新材	5,016,435.24	7.23
201	301156	美农生物	4,932,265.80	7.11
202	002778	中晟高科	4,927,289.80	7.10
203	301065	本立科技	4,892,710.00	7.05
204	688069	德林海	4,889,914.08	7.04
205	300731	科创新源	4,862,665.00	7.00
206	002241	歌尔股份	4,848,817.00	6.98
207	300594	朗进科技	4,840,836.00	6.97

208	002787	华源控股	4,836,284.00	6.97
209	603316	诚邦股份	4,809,483.00	6.93
210	300417	南华仪器	4,740,413.30	6.83
211	688171	纬德信息	4,624,228.44	6.66
212	300961	深水海纳	4,613,280.00	6.65
213	688372	伟测科技	4,583,642.89	6.60
214	003003	天元股份	4,572,461.00	6.59
215	300626	华瑞股份	4,544,718.00	6.55
216	300076	GQY视讯	4,541,012.00	6.54
217	688521	芯原股份	4,538,849.65	6.54
218	688786	悦安新材	4,470,769.07	6.44
219	688021	奥福环保	4,458,900.29	6.42
220	301130	西点药业	4,445,576.00	6.40
221	688067	爱威科技	4,442,337.53	6.40
222	688456	有研粉材	4,428,901.76	6.38
223	301233	盛帮股份	4,390,598.04	6.32
224	600272	开开实业	4,370,630.00	6.30
225	002861	瀛通通讯	4,342,488.60	6.26
226	300929	华骐环保	4,338,570.60	6.25
227	301037	保立佳	4,336,750.98	6.25
228	605178	时空科技	4,333,701.00	6.24
229	000993	闽东电力	4,311,833.00	6.21
230	300927	江天化学	4,302,711.00	6.20
231	300717	华信新材	4,280,251.00	6.17
232	300907	康平科技	4,273,801.00	6.16
233	603038	华立股份	4,269,673.00	6.15
234	300385	雪浪环境	4,269,534.00	6.15
235	300296	利亚德	4,266,980.00	6.15
236	003021	兆威机电	4,232,653.00	6.10
237	300635	中达安	4,172,356.00	6.01
238	301234	五洲医疗	4,165,893.00	6.00

239	300885	海昌新材	4,164,398.44	6.00
240	000975	银泰黄金	4,142,909.00	5.97
241	603700	宁水集团	4,131,697.44	5.95
242	600156	华升股份	4,115,511.00	5.93
243	002492	恒基达鑫	4,059,615.50	5.85
244	603926	铁流股份	4,057,162.00	5.84
245	300334	津膜科技	4,030,145.00	5.81
246	603182	嘉华股份	4,006,136.41	5.77
247	688557	兰剑智能	4,003,055.35	5.77
248	603580	艾艾精工	3,991,764.00	5.75
249	301396	宏景科技	3,972,799.00	5.72
250	300826	测绘股份	3,949,422.60	5.69
251	300984	金沃股份	3,934,645.00	5.67
252	603045	福达合金	3,933,792.00	5.67
253	688393	安必平	3,907,741.67	5.63
254	301107	瑜欣电子	3,891,589.00	5.61
255	000702	正虹科技	3,891,277.00	5.61
256	688215	瑞晟智能	3,883,450.02	5.59
257	301326	捷邦科技	3,766,576.00	5.43
258	301011	华立科技	3,761,676.90	5.42
259	603272	联翔股份	3,720,188.41	5.36
260	300458	全志科技	3,713,952.00	5.35
261	002012	凯恩股份	3,671,070.00	5.29
262	603721	中广天择	3,626,303.00	5.22
263	300992	泰福泵业	3,598,507.00	5.18
264	300889	爱克股份	3,595,862.00	5.18
265	688560	明冠新材	3,592,346.58	5.17
266	002981	朝阳科技	3,585,435.00	5.16
267	600834	申通地铁	3,538,167.00	5.10
268	601899	紫金矿业	3,521,653.00	5.07
269	688013	天臣医疗	3,512,708.63	5.06

270	301022	海泰科	3,506,367.68	5.05
271	600887	伊利股份	3,499,707.00	5.04
272	300562	乐心医疗	3,493,868.40	5.03
273	300947	德必集团	3,450,788.00	4.97
274	688395	正弦电气	3,447,680.16	4.97
275	000725	京东方 A	3,433,487.00	4.95
276	300875	捷强装备	3,415,944.00	4.92
277	002817	黄山胶囊	3,411,716.20	4.91
278	301023	江南奕帆	3,401,925.00	4.90
279	300410	正业科技	3,399,041.00	4.90
280	002199	东晶电子	3,384,159.00	4.87
281	002136	安纳达	3,365,245.00	4.85
282	688669	聚石化学	3,356,814.13	4.84
283	300521	爱司凯	3,352,755.00	4.83
284	301027	华蓝集团	3,338,429.00	4.81
285	605033	美邦股份	3,310,782.20	4.77
286	300897	山科智能	3,271,065.00	4.71
287	002971	和远气体	3,218,427.00	4.64
288	300995	奇德新材	3,186,547.00	4.59
289	301167	建研设计	3,151,352.20	4.54
290	600561	江西长运	3,140,130.00	4.52
291	300223	北京君正	3,132,065.00	4.51
292	301192	泰祥股份	3,120,527.00	4.50
293	688369	致远互联	3,090,733.70	4.45
294	001201	东瑞股份	3,077,022.00	4.43
295	001226	拓山重工	3,042,512.00	4.38
296	300865	大宏立	3,016,540.00	4.35
297	688163	赛伦生物	3,013,986.43	4.34
298	300243	瑞丰高材	3,008,198.00	4.33
299	002883	中设股份	3,001,493.00	4.32
300	002856	美芝股份	2,983,572.00	4.30

301	300823	建科机械	2,969,001.00	4.28
302	002559	亚威股份	2,961,096.00	4.27
303	603856	东宏股份	2,935,990.30	4.23
304	001209	洪兴股份	2,896,139.00	4.17
305	300977	深圳瑞捷	2,888,493.00	4.16
306	000807	云铝股份	2,854,087.00	4.11
307	300611	美力科技	2,844,635.00	4.10
308	300816	艾可蓝	2,839,219.50	4.09
309	300810	中科海讯	2,837,117.00	4.09
310	300563	神宇股份	2,826,567.00	4.07
311	300061	旗天科技	2,817,104.00	4.06
312	301359	东南电子	2,797,252.00	4.03
313	300295	三六五网	2,794,710.62	4.03
314	002885	京泉华	2,787,561.00	4.02
315	688001	华兴源创	2,777,987.76	4.00
316	301073	君亭酒店	2,774,287.00	4.00
317	300162	雷曼光电	2,771,857.00	3.99
318	688092	爱科科技	2,762,064.77	3.98
319	600082	海泰发展	2,744,169.00	3.95
320	688118	普元信息	2,678,389.36	3.86
321	300971	博亚精工	2,667,103.00	3.84
322	002767	先锋电子	2,661,476.00	3.83
323	300746	汉嘉设计	2,640,149.00	3.80
324	300535	达威股份	2,633,412.28	3.79
325	003001	中岩大地	2,623,515.00	3.78
326	603726	朗迪集团	2,616,252.00	3.77
327	301288	清研环境	2,605,585.00	3.75
328	688597	煜邦电力	2,564,008.08	3.69
329	000679	大连友谊	2,556,011.00	3.68
330	300703	创源股份	2,517,805.00	3.63
331	002931	锋龙股份	2,502,679.00	3.61

332	300097	智云股份	2,489,009.00	3.59
333	603536	惠发食品	2,464,457.00	3.55
334	603189	网达软件	2,462,002.00	3.55
335	301018	申菱环境	2,458,571.00	3.54
336	002495	佳隆股份	2,428,090.00	3.50
337	688501	青达环保	2,369,154.47	3.41
338	688109	品茗科技	2,343,750.26	3.38
339	300845	捷安高科	2,332,433.00	3.36
340	603269	海鸥股份	2,314,456.00	3.33
341	001211	双枪科技	2,303,884.00	3.32
342	300163	先锋新材	2,293,174.00	3.30
343	002357	富临运业	2,285,631.00	3.29
344	688329	艾隆科技	2,275,606.36	3.28
345	001336	楚环科技	2,235,164.00	3.22
346	002284	亚太股份	2,217,870.00	3.19
347	688097	博众精工	2,205,419.09	3.18
348	300807	天迈科技	2,192,022.00	3.16
349	688186	广大特材	2,176,105.90	3.13
350	002364	中恒电气	2,148,803.00	3.10
351	301128	强瑞技术	2,141,854.00	3.09
352	300743	天地数码	2,108,501.00	3.04
353	688622	禾信仪器	2,085,308.81	3.00
354	002846	英联股份	2,085,008.00	3.00
355	603183	建研院	2,071,224.40	2.98
356	301178	天亿马	2,048,271.40	2.95
357	603041	美思德	2,007,326.00	2.89
358	600794	保税科技	1,991,269.00	2.87
359	300948	冠中生态	1,971,633.00	2.84
360	688039	当虹科技	1,936,016.67	2.79
361	301113	雅艺科技	1,905,660.00	2.75
362	603716	塞力医疗	1,897,336.00	2.73

363	688058	宝兰德	1,883,917.33	2.71
364	603507	振江股份	1,883,432.00	2.71
365	002125	湘潭电化	1,876,162.00	2.70
366	002443	金洲管道	1,870,145.00	2.69
367	300018	中元股份	1,864,571.00	2.69
368	301197	工大科雅	1,861,252.00	2.68
369	688367	工大高科	1,854,702.71	2.67
370	001366	播恩集团	1,848,780.00	2.66
371	000571	新大洲A	1,846,102.00	2.66
372	000755	山西路桥	1,821,056.00	2.62
373	300899	上海凯鑫	1,816,911.00	2.62
374	002899	英派斯	1,802,619.00	2.60
375	301057	汇隆新材	1,785,016.00	2.57
376	300836	佰奥智能	1,783,089.00	2.57
377	002760	凤形股份	1,769,849.00	2.55
378	300753	爱朋医疗	1,766,848.00	2.55
379	301040	中环海陆	1,759,993.00	2.54
380	688081	兴图新科	1,725,568.55	2.49
381	300378	鼎捷软件	1,723,738.00	2.48
382	000605	渤海股份	1,697,003.40	2.44
383	000821	京山轻机	1,695,084.00	2.44
384	300217	东方电热	1,685,688.00	2.43
385	600505	西昌电力	1,642,636.00	2.37
386	688167	炬光科技	1,632,311.62	2.35
387	300780	德恩精工	1,621,722.00	2.34
388	002295	精艺股份	1,589,072.00	2.29
389	002830	名雕股份	1,542,845.00	2.22
390	688296	和达科技	1,522,858.17	2.19
391	002917	金奥博	1,486,112.00	2.14
392	688292	浩瀚深度	1,481,359.89	2.13
393	300789	唐源电气	1,427,745.20	2.06

注：

本项的"卖出金额"按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,138,449,220.30
卖出股票收入（成交）总额	2,447,846,959.37

注：

本项的"买入股票的成本"、"卖出股票的收入"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	801,353,821.64	20.78
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	801,353,821.64	20.78

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	019709	23国债16	3,922,000	394,252,334.24	10.22

2	019703	23国债10	3,626,000	367,747,926.58	9.53
3	019727	23国债24	391,000	39,353,560.82	1.02
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投资资产支持证券。

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投资贵金属。

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投资权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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

1、时空科技（605178.SH）

2023年12月28日，北京证监局对北京新时空科技股份有限公司、王新才采取出具警示函的行政监管措施。公司于2023年9月9日发布会计差错更正公告，因应收账款坏账准备计提错误，对2023年半年度报告相关财务数据进更正，导致2023年半年度报告信息披露不准确。上述会计差错更正后，公司2023年半年报中，调减归属于上市公司股东的总资产、净资产、净利润均为1224.41万元，分别占更正后金额绝对值的0.56%、0.71%、16.57%。上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》(证监会令第182号)第三条、第四条的相关规定。公司财务总监王新才负有主要责任。

本基金管理人做出说明如下：

(1) 投资决策程序：通过对公司的基本面进行分析，认为基本面发展势头良好，所处行业目前均系国家发展或符合产业趋势的细分子行业，业绩表现符合预期，后续业务持续发展尚有一定的潜力；

(2) 上述为公司会计差错问题，2023年半年度相关财务数据已经进行更正，经过分析，我们认为该事项对公司影响可控，与公司的经营发展无关，因此继续持有该公司股票。

8.12.2 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	660,110.64
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	29,168,045.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,828,155.70

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不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
金元顺安优质精选灵活配置混合A类	87,001	8,903.22	285,565,921.76	36.87%	489,023,043.81	63.13%
金元顺安优质精选灵活配置混合C类	93,197	14,909.77	407,850,660.96	29.35%	981,695,638.27	70.65%
合计	180,198	12,009.76	693,416,582.72	32.04%	1,470,718,682.08	67.96%

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	金元顺安优质精选灵活配置混合A类	1,186,943.81	0.15%
	金元顺安优质精选灵活	611,279.28	0.04%

	配置混合C类		
	合计	1,798,223.09	0.08%

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	金元顺安优质精选灵活配置混合A类	10~50
	金元顺安优质精选灵活配置混合C类	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	金元顺安优质精选灵活配置混合A类	0~10
	金元顺安优质精选灵活配置混合C类	10~50
	合计	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	金元顺安优质精选灵活配置混合A类	金元顺安优质精选灵活配置混合C类
基金合同生效日(2017年10月10日)基金份额总额	13,578,025.96	139,576,798.54
本报告期期初基金份额总额	4,345,856.71	45,915,492.96
本报告期基金总申购份额	918,290,495.24	2,004,665,242.11
减：本报告期基金总赎回份额	148,047,386.38	661,034,435.84
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	774,588,965.57	1,389,546,299.23

注：

"金元比联保本混合型证券投资基金"（系本基金前身）合同生效日为2011年8月16日。自2017年10月10日起，本基金转型为非保本的混合型证券投资基金。故本报告中，本基金基金合同生效日为2017年10月10日。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未举行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

1、基金管理人的重大人事变动

(1) 本基金管理人于2023年05月04日公告，符刃先生不再担任金元顺安基金管理有限公司副总经理、首席信息官；

(2) 本基金管理人于2023年08月18日公告，增聘陈渝鹏先生担任金元顺安基金管理有限公司首席信息官；

(3) 本基金管理人于2023年12月22日公告，增聘罗寅先生担任金元顺安基金管理有限公司副总经理。

2、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的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

本报告期内，未发生改聘会计师事务所的情况。

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

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	167,986,509.64	2.22%	133,843.90	4.12%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	728,912,784.86	9.61%	252,134.99	7.75%	-
金元证券	1	646,040,712.36	8.52%	204,056.61	6.27%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中天国富	1	3,324,216,441.85	43.84%	1,536,696.61	47.25%	-
安信证券	2	641,850,404.84	8.47%	215,592.88	6.63%	-
长江证券	2	134,350,490.16	1.77%	96,909.61	2.98%	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北	2	1,047,110,377.55	13.81%	372,407.42	11.45%	-

证券						
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	547,281,667.34	7.22%	183,836.75	5.65%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	344,312,986.58	4.54%	256,822.76	7.90%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金国际	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

注：

1、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序：

（1）选择标准。

1) 公司具有较强的研究实力，能够出具高质量的各种研究报告。研究及投资建议质量较高、报告出具及时、能及时地交流和对需求做出反应，有较广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

2) 公司资信状况较好，无重大不良记录。

3) 公司经营规范，能满足基金运作的合法、合规需求。

4) 能够对持有人提供较高质量的服务。能够向持有人提供咨询、查询等服务；可以向投资人提供及时、主动的信息以及其它增值服务，无被持有人投诉的记录。

（2）选择流程。

公司投研和市场部门定期对券商服务质量根据选择标准进行量化评比，并根据评比的结果选择交易单元。

2、截至本报告期末2023年12月31日止，本基金新租用德邦证券股份有限公司1个上海交易单元、1个深圳交易单元，东北证券股份有限公司1个上海交易单元、1个深圳交易单元，江海证券有限公司1个深圳交易单元，浙商证券股份有限公司1个上海交易单元，中天国富证券有限公司1个深圳交易单元；退租恒泰证券股份有限公司1个上海交易单元、1个深圳交易单元，申港证券股份有限公司1个上海交易单元、1个深圳交易单元。

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
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	49,807,422.43	3.45%	12,500,000.00	0.12%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	12,294,582.66	0.85%	-	-	-	-	-	-
金元证券	463,605,72	32.07%	2,555,000,00	24.21%	-	-	-	-

	1.59		0.00					
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中天国富	117,200,86 2.54	8.11%	-	-	-	-	-	-
安信证券	214,447,88 6.57	14.84%	1,755,000,00 0.00	16.63%	-	-	-	-
长江证券	2,175,880.6 9	0.15%	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	344,943,24 4.00	23.86%	1,755,395,00 0.00	16.63%	-	-	-	-
东方财富证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	107,110,01 8.46	7.41%	2,535,000,00 0.00	24.02%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	133,849,15 7.00	9.26%	1,940,000,00 0.00	18.38%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	金元顺安基金管理有限公司 旗下证券投资基金2022年第 四季度报告	规定披露媒介	2023-01-20
2	金元顺安基金管理有限公司 旗下部分基金新增上海华夏	规定披露媒介	2023-02-10

	财富投资管理有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告		
3	金元顺安基金管理有限公司关于金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金C类基金份额净值计算与披露方法的说明	规定披露媒介	2023-02-10
4	关于金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金在部分代销机构开展赎回费率优惠活动的公告	规定披露媒介	2023-02-22
5	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加中泰证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-02-28
6	关于金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金在部分代销机构开展赎回费率优惠活动的公告	规定披露媒介	2023-03-15
7	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加东北证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-03-17
8	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金2022年度报告	规定披露媒介	2023-03-31
9	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金2023年第一季度报告	规定披露媒介	2023-04-22
10	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加德邦证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-06-06

11	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加麦高证券有限责任公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-06-29
12	金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金C类份额恢复转换转入、转换转出、定期定额投资公告	规定披露媒介	2023-06-30
13	金元顺安基金管理有限公司关于调整金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金最低申购金额、最低追加金额、最低定期定额投资金额、最低赎回份额、最低转换份额及账户最低保留份额的公告	规定披露媒介	2023-07-05
14	金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）公告	规定披露媒介	2023-07-12
15	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加恒泰证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-07-17
16	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金2023年第二季度报告	规定披露媒介	2023-07-20
17	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加博时财富基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-07-21
18	金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期	规定披露媒介	2023-07-24

	定额投资) 公告		
19	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加江海证券有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-07-28
20	金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购(含转换转入、定期定额投资)公告	规定披露媒介	2023-07-31
21	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加广发证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-08-03
22	金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议	规定披露媒介	2023-08-05
23	金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同	规定披露媒介	2023-08-05
24	金元顺安基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	规定披露媒介	2023-08-05
25	金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新[2023年08月09日更新]	规定披露媒介	2023-08-09
26	金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新[2023年08月09日更新]	规定披露媒介	2023-08-09
27	金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书[2023年08月09日	规定披露媒介	2023-08-09

	更新]		
28	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加国融证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-08-14
29	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-08-17
30	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加东方证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-08-21
31	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金2023年中期报告	规定披露媒介	2023-08-31
32	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加华泰证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-09-04
33	金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）公告	规定披露媒介	2023-09-05
34	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加交通银行股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-09-07
35	金元顺安基金管理有限公司关于金元顺安沅泉债券型证券投资基金增设C类基金份额并修改基金合同、托管协议的公告	规定披露媒介	2023-09-11

36	金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加招商银行股份有限公司（招赢通平台）为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-09-14
37	金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）公告	规定披露媒介	2023-10-10
38	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增上海证券有限责任公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-10-11
39	金元顺安基金管理有限公司关于金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金A类基金份额在交通银行恢复原申购费率的公告	规定披露媒介	2023-10-18
40	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金2023年第三季度报告	规定披露媒介	2023-10-25
41	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加海通证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-11-03
42	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加中信银行股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-11-10
43	金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新[2023年11月11日更新]	规定披露媒介	2023-11-11

44	金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新[2023年11月11日更新]	规定披露媒介	2023-11-11
45	金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书[2023年11月11日更新]	规定披露媒介	2023-11-11
46	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加北京新浪仓石基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-12-08

§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01月01日 - 2023年02月07日	45,915,492.96	0.00	45,915,492.96	0.00	0.00%
	2	2023年02月08日 - 2023年02月27日	0.00	6,476,007.75	6,476,007.75	0.00	0.00%
	3	2023年07月03日 - 2023年07月16日	0.00	58,905,069.82	31,082,007.25	27,823,062.57	1.29%
	4	2023年03月02日 - 2023年03月09日	0.00	4,014,891.70	4,014,891.70	0.00	0.00%
	5	2023年06月20日 - 2023年06月26日	0.00	9,439,561.62	9,439,561.62	0.00	0.00%
产品特有风险							
持有份额比例较高的投资者(“高比例投资者”)大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回,中小投资者可能面							

临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。

基金净值大幅波动的风险

高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。

基金规模较小导致的风险

高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

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

- 1、中国证监会准予金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金基金招募说明书》；
- 4、《金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

金元顺安基金管理有限公司

中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间至办公地点进行查询，或登录本基金管理人网站 www.jysa99.com 查阅。投资者对本报告书存有疑问，可咨询本基金管理人金元顺安基金管理有限公司，本公司客服电话400-666-0666、021-68881898。

金元顺安基金管理有限公司

二〇二四年三月三十日