

新华鑫科技 3 个月滚动持有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：新华基金管理股份有限公司
基金托管人：华夏银行股份有限公司
报告送出日期：二〇二四年三月三十日

§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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 29 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。

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 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
§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.....	6
§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.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告	17
6.1 审计意见.....	17
6.2 形成审计意见的基础.....	17
6.3 其他信息.....	18
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任.....	18
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任.....	18
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	21
7.3 净资产变动表.....	22
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况.....	56
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	57
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.....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	70
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	71
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	71
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	71
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	71
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
8.12	本报告期投资基金情况	71
8.13	投资组合报告附注	71
§9	基金份额持有人信息	72
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
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的情况	73
§10	开放式基金份额变动	74
§11	重大事件揭示	74
11.1	基金份额持有人大会决议	74
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	74
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
11.4	基金投资策略的改变	75
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	75
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	75
11.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	75
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
11.16	其他重大事件	77
12	影响投资者决策的其他重要信息	80
§13	备查文件目录	80
13.1	备查文件目录	80
13.2	存放地点	81
13.3	查阅方式	81

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合	
基金主代码	012200	
交易代码	012200	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 5 月 26 日	
基金管理人	新华基金管理股份有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	166,767,206.30 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	012200	012201
报告期末下属分级基金的份额总额	123,501,643.17 份	43,265,563.13 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过合理的资产配置，精选科技主题的优质企业进行投资，在控制基金资产净值下行风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略等。
业绩比较基准	中证科技 100 指数收益率×60%+中债综合指数（总财富）收益率×30%+恒生指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险水平低于股票型基金，高于

	债券型基金和货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--	----------------------------------------------------------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新华基金管理股份有限公司	华夏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	朱绍纲
	联系电话	010-68779688	010-85238309
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	zhzsg@hxb.com.cn
客户服务电话		4008198866	95577
传真		010-68779528	010-85238680
注册地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市东城区建国门内大街22 号
办公地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市东城区建国门内大街22 号
邮政编码		400010	100005
法定代表人		于春玲	李民吉

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.ncfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	致同会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 层
注册登记机构	新华基金管理股份有限公司	重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2

号楼 19 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指 标	2023 年		2022 年		2021 年 5 月 26 日（基金合同 生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	新华鑫科技 3 个月滚动 持有灵活配 置混合 A	新华鑫科技 3 个月滚动 持有灵活配 置混合 C	新华鑫科技 3 个月滚动持 有灵活配置 混合 A	新华鑫科技 3 个月滚动持 有灵活配置 混合 C	新华鑫科技 3 个月滚动持 有灵活配置 混合 A	新华鑫科技 3 个月滚动持有 灵活配置混合 C
本期已 实现收 益	-4,672,011.8 5	-1,671,753. 98	-50,914,547.2 7	-17,378,922.1 4	83,175,646.5 4	27,816,380.40
本期利 润	-2,985,834. 97	-862,425.02	-64,882,511.4 5	-22,113,699.1 0	87,440,338.7 6	34,066,898.65
加权平 均基金 份额本 期利润	-0.0219	-0.0176	-0.3968	-0.3884	0.2174	0.2367
本期加 权平均 净值利 润率	-2.57%	-2.09%	-43.70%	-43.10%	19.44%	21.28%
本期基 金份额 净值增 长率	-4.49%	-4.96%	-33.18%	-33.52%	15.96%	15.62%

3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C
期末可供分配利润	-32,108,363.06	-11,661,289.64	-32,954,386.71	-12,402,920.93	29,780,147.40	9,299,143.67
期末可供分配基金份额利润	-0.2600	-0.2695	-0.2252	-0.2314	0.1596	0.1562
期末基金资产净值	91,393,280.11	31,604,273.49	113,358,526.19	41,201,244.13	216,356,273.74	68,839,159.42
期末基金份额净值	0.7400	0.7305	0.7748	0.7686	1.1596	1.1562
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C
基金份额累计净值增长率	-26.00%	-26.95%	-22.52%	-23.14%	15.96%	15.62%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、以上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（例如基金申购费赎回费

等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-8.73%	1.14%	-2.96%	0.75%	-5.77%	0.39%
过去六个月	-19.24%	1.23%	-10.34%	0.75%	-8.90%	0.48%
过去一年	-4.49%	1.50%	-1.66%	0.75%	-2.83%	0.75%
自基金合同生效起至今	-26.00%	1.62%	-15.07%	0.87%	-10.93%	0.75%

2. 新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-8.84%	1.14%	-2.96%	0.75%	-5.88%	0.39%
过去六个月	-19.44%	1.23%	-10.34%	0.75%	-9.10%	0.48%
过去一年	-4.96%	1.50%	-1.66%	0.75%	-3.30%	0.75%
自基金合同生效起至今	-26.95%	1.62%	-15.07%	0.87%	-11.88%	0.75%

1、本基金的业绩比较基准采用中证科技 100 指数收益率×60%+中债综合指数（总财富）收益率×30%+恒生指数收益率×10%。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

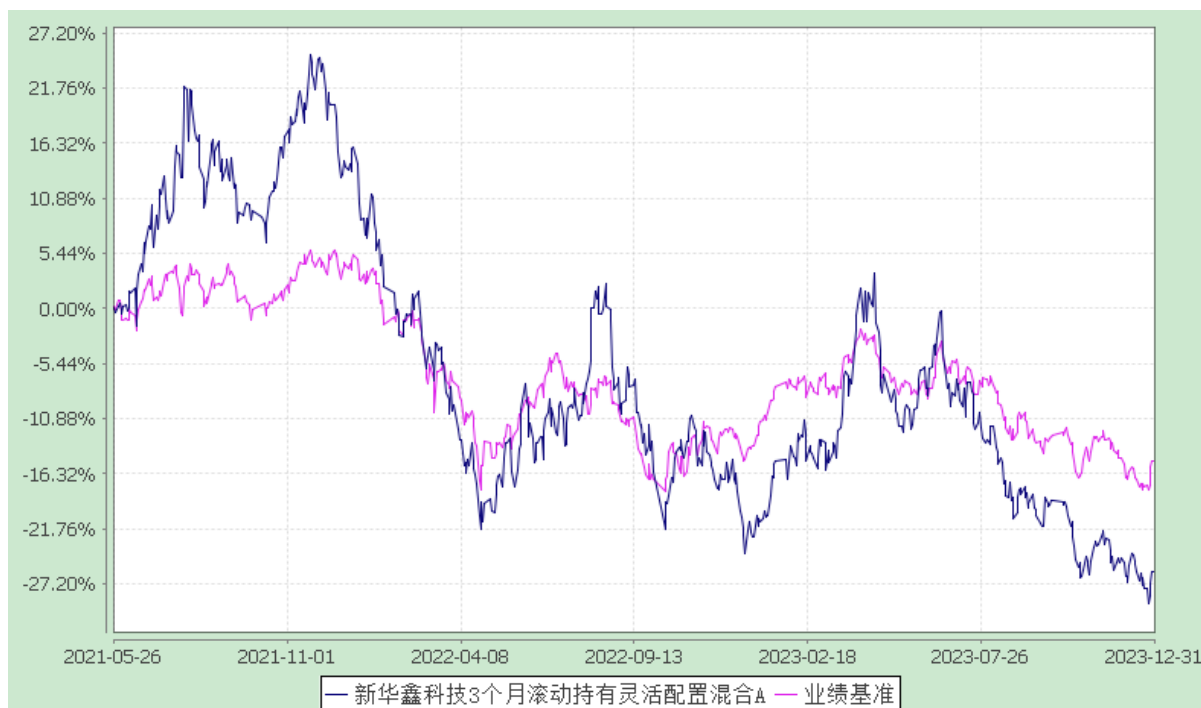
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金

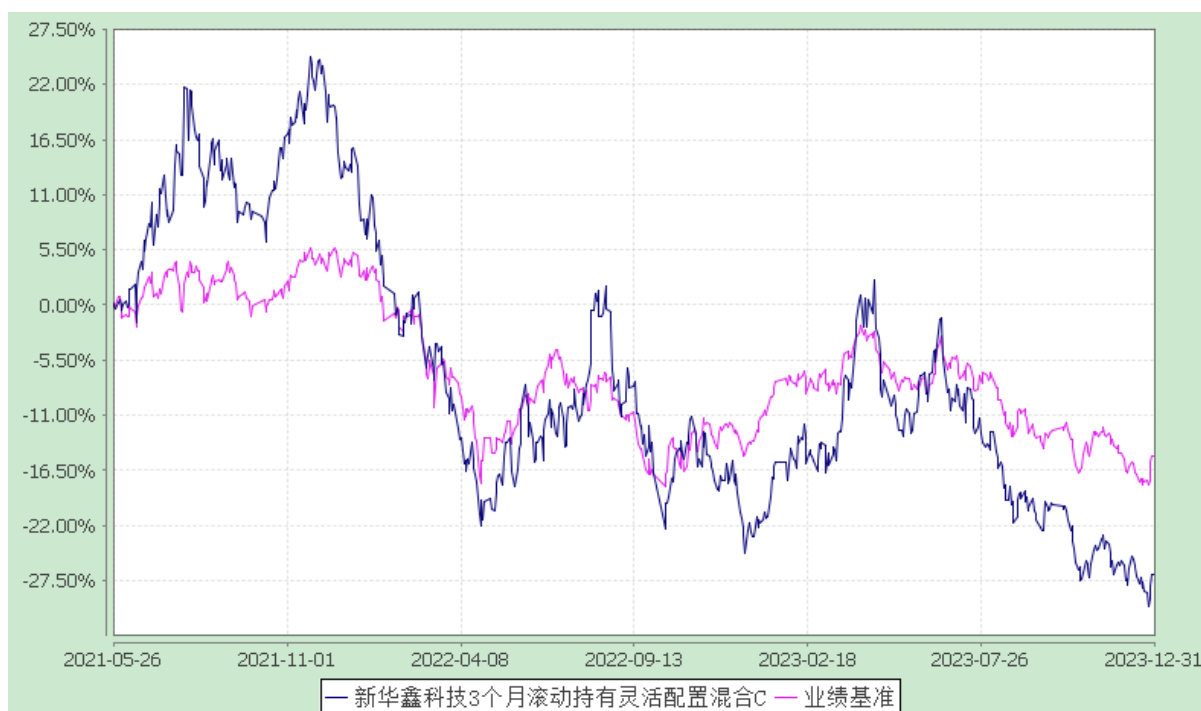
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021 年 5 月 26 日至 2023 年 12 月 31 日)

1、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A



2、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C



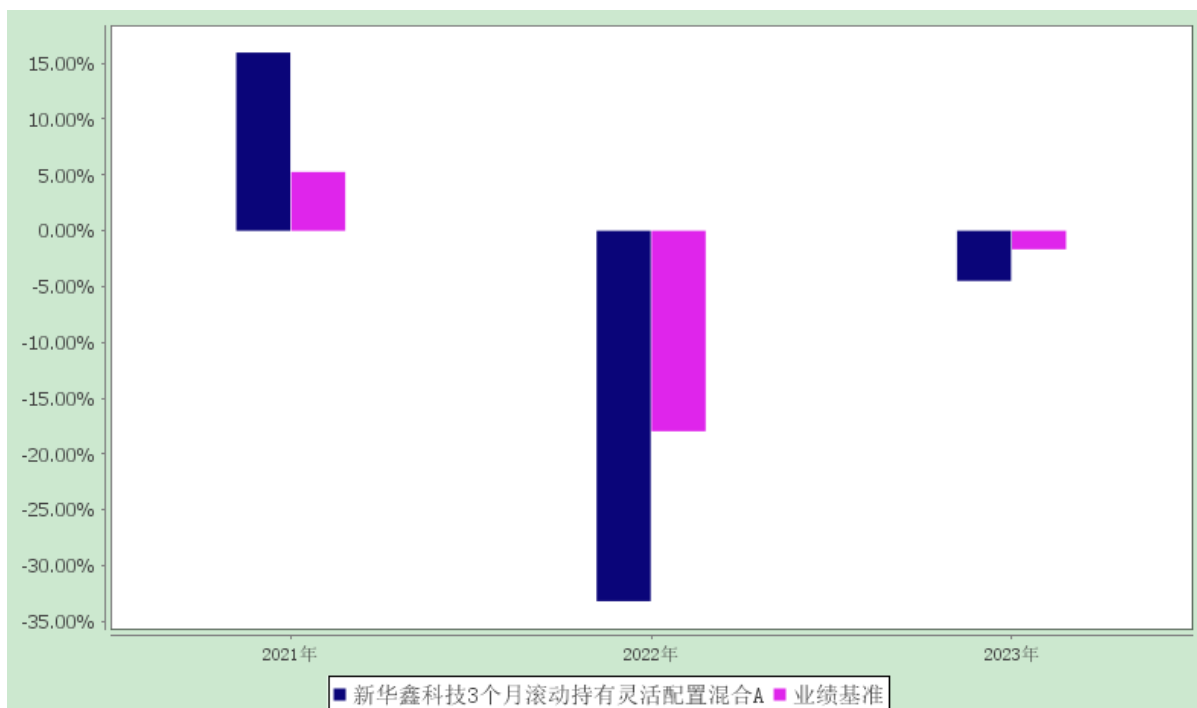
注：报告期内本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

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

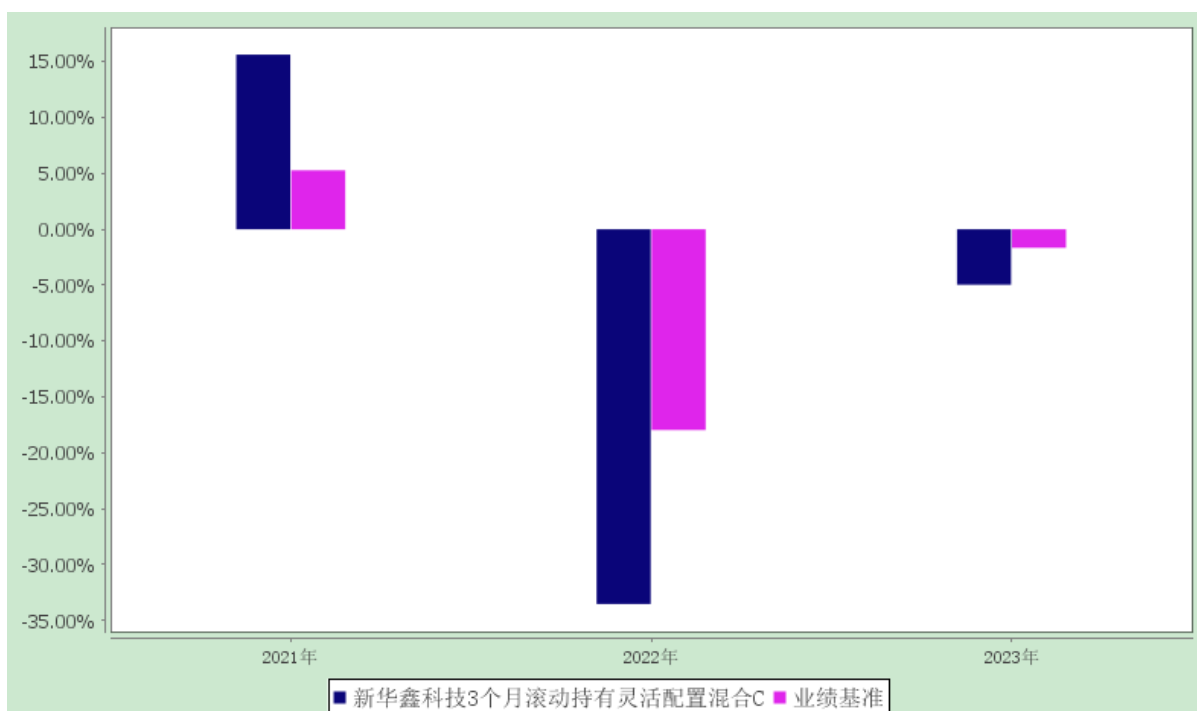
新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A



2、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C



注：1、本基金于 2021 年 5 月 26 日基金合同生效。

2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家基金管理公司。

截至 2023 年 12 月 31 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十五只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金、新华鼎利债券型证券投资基金、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、新华景气行业混合型证券投资基金、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金、新华利率债债券型证券投资基金、新华行业龙头主题股票型证券投资基金、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助	证券从业	说明
----	----	-------------	------	----

		理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
王永明	本基金基金经理，新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华景气行业混合型证券投资基金基金经理、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金基金经理。	2021-09-03	-	25	经济学博士，历任西南证券资产管理部研究员、恒泰证券研发中心经理、上海名禹资产管理有限公司研究总监、上海尚阳投资管理有限公司投资总监。

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司作出决定之日。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》、《基金从业人员管理规则》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期末本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订），公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理办法》，以避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为。该办法规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

公司通过合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，使各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”作为交易执行的公平原则，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理办法》的规定。

基金管理人对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内以及 5 日内股票和债券交易同向交易价差分析及相应情景分析表明：债券同向交易频率偏低；股票同向交易溢价率较高的因素主要是受到市场因素影响造成个股当日价格振幅较大或者是组合经理个人对交易时机的判断，即成交价格的日内变化较大以及投资组合的成交时间不一致而导致个别组合间的交易价差较大，结合通过对平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等不同组合不同时间段的同向交易价差分析表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

本报告期内，公平交易管理执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

基金管理人原则上不允许同日反向交易行为的发生，本报告期内，未发生有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年在新发展理念下，改革开放和产业结构优化都取得了一定的成果，高质量发展继续扎实推进。在经济回升向好的同时，仍面临着如国内有效需求不足、预期不稳、房地产供求关系出现实质性转变、外部环境严峻、复杂等压力和挑战。从证券市场看，主要指数出现先扬后抑的走势，在

上半年冲高后，下半年出现一定程度的调整。本基金年内对 AI、半导体设备和芯片设计、消费电子产业链进行了配置，但受市场系统性因素的影响，基金净值仍出现一定的回撤。

2023 年 12 月，中央经济工作会议的召开，在 2024 年各项任务中，科技创新被摆在头一条，显示高层对科技创新的重视程度。除政策支持外，由人工智能等带来的创新驱动和行业库存周期变化带来的周期驱动仍在继续，我们继续看好科技成长板块的投资机会，看好以下领域的投资机会：1、创新驱动的 AI 产业链、MR 产业链、智能驾驶和卫星互联网产业链。2、周期反转的存储、模拟、射频、CIS 等。3、国产半导体设备和材料、算力芯片等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 0.7400 元，本报告期份额净值增长率为-4.49%，同期比较基准的增长率为-1.66%；本基金 C 类份额净值为 0.7305 元，本报告期份额净值增长率为-4.96%，同期比较基准的增长率为-1.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经历了持续两年的调整后，证券市场的风险出现一定程度的出清，2024 年孕育着机会和希望，我们将在在基本面扎实研究、紧密跟踪和深入理解的基础上，顺应经济、产业和市场的趋势，敬畏、观察和思考市场和科技产业的持续变化和重大变化，重视市场呈现出的格局和结果，为持有人创造超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在开展内部监察稽核工作时本着合规运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的宗旨，由独立于各业务部门的督察长和监察稽核部对公司的经营管理、基金的投资运作、基金的销售等公司所有业务及员工行为规范等方面进行定期和不定期检查，及时发现问题并督促相关部门进行整改，并定期制作监察稽核报告报中国证监会、董事会和公司管理层。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定的要求，完善各项内部管理制度和业务流程，明确风险控制职责并具体落实相应措施，提高全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

二、督察长和监察稽核部针对各部门具体业务建立了相应的检查指标及检查重点，通过现场检查、电脑监控、人员询问、重点抽查等一系列方法，定期对公司和基金日常运作的各项业务进行合法合规检查，并对基金投资交易行为过程实施实时监控，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理

理，并按规定定期出具监察稽核报告报送监管机关、董事会和公司管理层。

三、根据中国证监会的规定，督察长和监察稽核部及时准确地向监管机关报送各项报告，并对公司所有对外信息，包括基金法定信息披露、基金产品宣传推介材料和媒体稿件等的合法合规情况进行事前审阅，确保其内容真实、准确、完整并符合中国证监会的相关规定。督察长和监察稽核部组织、协调各相关部门及时完成信息披露，确保公司的信息披露工作严格按照中国证监会规定的时间和方式进行。

四、在全公司范围内开展持续的学习和培训。督察长和监察稽核部对公司员工进行了法律法规的专项培训，并组织员工开展学习、讨论，提高和加深了公司员工对基金法律法规的认识和理解，明确风险控制职责，树立全员内控意识。

通过上述工作，在本报告期内，公司对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、招募说明书和公司制度进行，充分维护和保障了基金持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用资金资产，以风险控制为核心，进一步提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值小组，负责对各类投资品种的估值方法、估值模型等进行研究和论证，组织制定和适时修订估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

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 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2023 年年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

致同审字（2024）第 110A006088 号

新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“新华鑫科技混合基金”）财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表及相关财务报表附注。

6.1 审计意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定编制，公允反映了新华鑫科技混合基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 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，我们独立于新华鑫科技混合基金，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。

6.3 其他信息

新华鑫科技混合基金管理人新华基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）对其他信息负责。其他信息包括新华鑫科技混合基金 2023 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，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。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估新华鑫科技混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算新华鑫科技混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督新华鑫科技混合基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发

现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据所获取的审计证据，就可能对新华鑫科技混合基金的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新华鑫科技混合基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

致同会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

张伟 邓冰清

北京市朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 层

2024 年 3 月 29 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：新华鑫科技 3 个月滚动持有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	968,386.86	8,867,367.64
结算备付金		11,135,693.81	4,792,785.65
存出保证金		-	-

交易性金融资产	7.4.7.2	111,680,325.11	144,341,764.58
其中：股票投资		111,680,325.11	144,341,764.58
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,600.12	9,866.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		123,788,005.90	158,011,784.12
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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	2,841,251.31
应付赎回款		425,997.90	142,499.30
应付管理人报酬		125,606.87	206,326.93
应付托管费		20,934.48	34,387.82
应付销售服务费		13,398.18	18,297.53
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	204,514.87	209,250.91
负债合计		790,452.30	3,452,013.80
净资产：		-	-
实收基金	7.4.7.10	166,767,206.30	199,917,077.96
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.11	-43,769,652.70	-45,357,307.64
净资产合计		122,997,553.60	154,559,770.32
负债和净资产总计		123,788,005.90	158,011,784.12

注：截至 2023 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值 0.7400 元，基金 A 类份额 123,501,643.17 份；基金 C 类份额净值 0.7305 元，基金 C 类份额 43,265,563.13 份。

7.2 利润表

会计主体：新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-826,668.30	-83,004,964.62
1.利息收入		63,406.16	134,387.62
其中：存款利息收入	7.4.7.12	63,406.16	134,387.62
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,390,223.34	-64,466,431.32
其中：股票投资收益	7.4.7.13	-4,934,596.98	-65,058,658.53
基金投资收益	7.4.7.14	-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-

资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	1,544,373.64	592,227.21
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	2,495,505.84	-18,702,741.14
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	4,643.04	29,820.22
减：二、营业总支出		3,021,591.69	3,991,245.93
1. 管理人报酬		2,225,382.52	3,009,787.72
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		370,897.11	501,631.31
3. 销售服务费		207,312.06	257,326.90
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.24	218,000.00	222,500.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,848,259.99	-86,996,210.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,848,259.99	-86,996,210.55
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,848,259.99	-86,996,210.55

7.3 净资产变动表

会计主体：新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	199,917,077.96	-45,357,307.64	154,559,770.32
二、本期期初净资产	199,917,077.96	-45,357,307.64	154,559,770.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-33,149,871.66	1,587,654.94	-31,562,216.72
（一）、综合收益总额	-	-3,848,259.99	-3,848,259.99
（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）	-33,149,871.66	5,435,914.93	-27,713,956.73
其中：1.基金申购款	5,334,499.45	-714,984.11	4,619,515.34
2.基金赎回款	-38,484,371.11	6,150,899.04	-32,333,472.07
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	166,767,206.30	-43,769,652.70	122,997,553.60
项目	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	246,116,142.09	39,079,291.07	285,195,433.16
二、本期期初净资产	246,116,142.09	39,079,291.07	285,195,433.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-46,199,064.13	-84,436,598.71	-130,635,662.84
（一）、综合收益总额	-	-86,996,210.55	-86,996,210.55
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-46,199,064.13	2,559,611.84	-43,639,452.29

其中：1.基金申购款	14,402,420.36	-1,165,853.04	13,236,567.32
2.基金赎回款	-60,601,484.49	3,725,464.88	-56,876,019.61
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	199,917,077.96	-45,357,307.64	154,559,770.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 于春玲, 主管会计工作负责人: 杨金亮, 会计机构负责人: 徐端骞

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2021]1267 号文准予注册, 由新华基金管理股份有限公司于 2021 年 5 月 10 日至 5 月 21 日向社会公开募集, 首次募集资金总额 728,889,967.19 元, 其中募集资金产生利息 76,968.34 元, 并经致同会计师事务所致同验字(2021)第 110C000275 号验资报告予以验证。2021 年 5 月 26 日办理基金备案手续, 基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金, 存续期不限定, 本基金管理人为新华基金管理股份有限公司, 基金托管人为华夏银行股份有限公司。

根据《新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(简称“港股通标的股票”)、股指期货、债券(国债、政府债券、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具, 以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金股票资产投资比例为基金资产的 0-95%, 港股通标的股票最高投资比例不得超过股票资产的 50%, 投资于同业存

单的比例不超过基金资产的 20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，投资于科技创新主题产业的证券资产不低于本基金非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：中证科技 100 指数收益率×60% +中债综合指数（总财富）收益率×30%+恒生指数收益率×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于 2024 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 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等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决

于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为股票投资、债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权

重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果

该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金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平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值

累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，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

本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可供分配利润可能有所不同，同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的

交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中基协字[2022]566号《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种,按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育

辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

活期存款	968,386.86	8,867,367.64
等于：本金	968,283.45	8,866,502.36
加：应计利息	103.41	865.28
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
合计	968,386.86	8,867,367.64

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	117,372,349.94	-	111,680,325.11	-5,692,024.83
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	117,372,349.94	-	111,680,325.11	-5,692,024.83

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	152,529,295.25	-	144,341,764.58	-8,187,530.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	152,529,295.25	-	144,341,764.58	-8,187,530.67

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期末及上年度末，本基金无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
合计	-	-	-	-
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-
净额	-	-	-	0.00

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末无黄金衍生品余额。

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

本报告期末及上年度末，本基金无买入返售金融资产余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本报告期末及上年度末，本基金无债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本报告期末及上年度末，本基金无其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本报告期末及上年度末，本基金无其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金无其他资产余额。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	14.87	250.91
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	80,000.00	80,000.00
应付证券时报信披费	120,000.00	120,000.00
应付中债账户维护费	4,500.00	9,000.00
合计	204,514.87	209,250.91

7.4.7.10 实收基金

新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	146,312,912.90	146,312,912.90
本期申购	2,340,426.59	2,340,426.59
本期赎回（以“-”号填列）	-25,151,696.32	-25,151,696.32
本期末	123,501,643.17	123,501,643.17

新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	53,604,165.06	53,604,165.06
本期申购	2,994,072.86	2,994,072.86
本期赎回（以“-”号填列）	-13,332,674.79	-13,332,674.79
本期末	43,265,563.13	43,265,563.13

7.4.7.11 未分配利润

新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-12,875,055.48	-20,079,331.23	-32,954,386.71
本期期初	-12,875,055.48	-20,079,331.23	-32,954,386.71
本期利润	-4,672,011.85	1,686,176.88	-2,985,834.97
本期基金份额交易产生的变动数	1,542,389.71	2,289,468.91	3,831,858.62
其中：基金申购款	-142,999.61	-131,395.29	-274,394.90
基金赎回款	1,685,389.32	2,420,864.20	4,106,253.52
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-16,004,677.62	-16,103,685.44	-32,108,363.06
-----	----------------	----------------	----------------

新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,089,582.06	-7,313,338.87	-12,402,920.93
本期期初	-5,089,582.06	-7,313,338.87	-12,402,920.93
本期利润	-1,671,753.98	809,328.96	-862,425.02
本期基金份额交易产生的变动数	698,800.59	905,255.72	1,604,056.31
其中：基金申购款	-208,295.65	-232,293.56	-440,589.21
基金赎回款	907,096.24	1,137,549.28	2,044,645.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,062,535.45	-5,598,754.19	-11,661,289.64

7.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	21,132.65	31,814.19
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	42,273.51	102,573.43
其他	-	-
合计	63,406.16	134,387.62

7.4.7.13 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

		月 31 日
卖出股票成交总额	561,190,949.57	950,072,953.92
减：卖出股票成本总额	564,680,086.97	1,012,569,836.21
减：交易费用	1,445,459.58	2,561,776.24
买卖股票差价收入	-4,934,596.98	-65,058,658.53

7.4.7.14 基金投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无基金投资收益。

7.4.7.15 债券投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17 贵金属投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.18 衍生工具收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,544,373.64	592,227.21
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,544,373.64	592,227.21

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间

	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	2,495,505.84	-18,702,741.14
——股票投资	2,495,505.84	-18,702,741.14
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——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	2,495,505.84	-18,702,741.14

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	4,621.83	27,323.01
补差费收入	21.21	2,497.21
合计	4,643.04	29,820.22

7.4.7.22 持有基金产生的费用

本报告期及上年度可比期间，本基金无持有基金产生的费用。

7.4.7.23 信用减值损失

本报告期及上年度可比期间，本基金无信用减值损失。

7.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月	2022年1月1日至2022年12月31日

	31日	
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
中债账户维护费	18,000.00	22,500.00
合计	218,000.00	222,500.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金未发生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
华夏银行股份有限公司	基金托管人
首钢集团有限公司	基金托管人股东
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
新华信托股份有限公司	基金管理人股东
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东
杭州永原网络科技有限公司	基金管理人股东
北京新华富时资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
恒泰长财证券有限责任公司	基金管理人股东的全资子公司
北京金融街投资（集团）有限公司	基金管理人实际控制人

注：2023 年 2 月 8 日，本基金管理人发布了《新华基金管理股份有限公司关于公司变更实际控制人的公告》，中国证券监督管理委员会依法核准了北京金融街投资（集团）有限公司成为新华基金管理股份有限公司实际控制人。本次变更后本基金管理人控股股东仍为恒泰证券。

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	上年度可比期间
-------	----	---------

	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1日至2022年12月31日	
	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
恒泰证券股份有限公司	1,084,840,172.01	100.00%	1,877,154,456.96	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

截至本报告期末，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

截至本报告期末，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

截至本报告期末，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

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1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
恒泰证券股份有限公司	794,093.26	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
恒泰证券股份有限公司	1,363,630.73	100.00%	0.00	0.00%

注：1、上述佣金按合同约定的佣金率计算。

2、上述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,225,382.52	3,009,787.72
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,110,387.82	1,499,111.70
应支付基金管理人的净管理费	1,114,994.70	1,510,676.02

注：1、2023年1月1日至2023年8月20日基金管理费按前一日基金资产净值1.50%的年费率逐日计提，2023年8月21日至2023年12月31日基金管理费按前一日基金资产净值1.20%的年费率逐日计提，按月支付。

其计算公式为：日管理费=前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人及基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	370,897.11	501,631.31

注：2023年1月1日至2023年8月20日基金托管费按前一日的基金资产净值0.25%的年费率逐日计提，2023年8月21日至2023年12月31日基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率逐日计提，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华鑫科技 3 个月滚动持有 灵活配置混合 A	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵 活配置混合 C	合计
华夏银行股份有限公司	0.00	936.03	936.03
新华基金管理股份有限公司	0.00	435.73	435.73
恒泰证券股份有限公司	0.00	205,326.09	205,326.09
合计	0.00	206,697.85	206,697.85
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华鑫科技3个月滚动持有 灵活配置混合A	新华鑫科技3个月滚动持有灵 活配置混合C	合计
华夏银行股份有限公司	0.00	1,041.30	1,041.30
新华基金管理股份有限公司	0.00	827.91	827.91
恒泰证券股份有限公司	0.00	255,449.04	255,449.04
合计	0.00	257,318.25	257,318.25

注：本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.50% 年费率逐日计提，按月支付。

其计算公式为：日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.50%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期内除基金管理人之外的其他关联方未有投资本基金的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华夏银行股份有限公司	968,386.86	21,132.65	8,867,367.64	31,814.19

注：本基金的银行存款由基金托管人华夏银行股份有限公司保管，按银行同业利率计算。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金报告期内无其他关联交易事项的说明。

7.4.11 利润分配情况

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301487	盟固利	2023-08-01	1-6个月(含)	新股锁定期内	5.32	40.96	867.00	4,612.44	35,512.32	-
300904	威力传动	2023-08-02	1-6个月(含)	新股锁定期内	35.41	61.53	213.00	7,542.33	13,105.89	-
301510	固高科技	2023-08-04	1-6个月(含)	新股锁定期内	12.00	35.01	335.00	4,020.00	11,728.35	-

30138 1	赛维时代	2023-0 7-05	1-6 个月(含)	新股 锁定期内	20.45	29.69	330.00	6,748. 50	9,797. 70	-
68859 2	司南导航	2023-0 8-07	1-6 个月(含)	新股 锁定期内	50.50	50.53	157.00	7,928. 50	7,933. 21	-
30149 9	维科精密	2023-0 7-13	1-6 个月(含)	新股 锁定期内	19.50	28.93	260.00	5,070. 00	7,521. 80	-
68856 3	航材股份	2023-0 7-12	1-6 个月(含)	新股 锁定期内	78.99	60.49	118.00	9,320. 82	7,137. 82	-
68858 2	芯动联科	2023-0 6-21	1-6 个月(含)	新股 锁定期内	26.74	38.67	184.00	4,920. 16	7,115. 28	-
30137 2	科净源	2023-0 8-03	1-6 个月(含)	新股 锁定期内	45.00	43.59	153.00	6,885. 00	6,669. 27	-
68857 3	信宇人	2023-0 8-09	1-6 个月(含)	新股 锁定期内	23.68	28.80	220.00	5,209. 60	6,336. 00	-
30150 9	金凯生科	2023-0 7-26	1-6 个月(含)	新股 锁定期内	56.56	62.23	99.00	5,599. 44	6,160. 77	-
30136 2	民爆光电	2023-0 7-27	1-6 个月(含)	新股 锁定期内	51.05	38.52	152.00	7,759. 60	5,855. 04	-
68867 1	碧兴物联	2023-0 8-02	1-6 个月(含)	新股 锁定期内	36.12	34.30	164.00	5,923. 68	5,625. 20	-
30127 2	英华特	2023-0 7-06	1-6 个月(含)	新股 锁定期内	51.39	53.38	104.00	5,344. 56	5,551. 52	-
68861 0	埃科光电	2023-0 7-10	1-6 个月(含)	新股 锁定期内	73.33	51.00	106.00	7,772. 98	5,406. 00	-
30150 7	民生健康	2023-0 8-24	1-6 个月(含)	新股 锁定期内	10.00	15.85	341.00	3,410. 00	5,404. 85	-
68865 1	盛邦安全	2023-0 7-19	1-6 个月(含)	新股 锁定期内	39.90	46.05	117.00	4,668. 30	5,387. 85	-
30153 3	威马农机	2023-0 8-07	1-6 个月(含)	新股 锁定	29.50	33.16	157.00	4,631. 50	5,206. 12	-

				期内						
301505	苏州规划	2023-07-12	1-6 个月(含)	新股锁定期内	26.35	35.81	145.00	3,820.75	5,192.45	-
301498	乖宝宠物	2023-08-09	1-6 个月(含)	新股锁定期内	39.99	38.81	133.00	5,318.67	5,161.73	-
301329	信音电子	2023-07-05	1-6 个月(含)	新股锁定期内	21.00	22.23	226.00	4,746.00	5,023.98	-
301468	博盈特焊	2023-07-12	1-6 个月(含)	新股锁定期内	47.58	30.22	163.00	7,755.54	4,925.86	-
301555	惠柏新材	2023-10-24	1-6 个月(含)	新股锁定期内	22.88	32.44	151.00	3,454.88	4,898.44	-
301251	威尔高	2023-08-30	1-6 个月(含)	新股锁定期内	28.88	34.59	138.00	3,985.44	4,773.42	-
301469	恒达新材	2023-08-10	1-6 个月(含)	新股锁定期内	36.58	33.09	141.00	5,157.78	4,665.69	-
688602	康鹏科技	2023-07-13	1-6 个月(含)	新股锁定期内	8.66	11.06	412.00	3,567.92	4,556.72	-
301518	长华化学	2023-07-26	1-6 个月(含)	新股锁定期内	25.75	23.01	196.00	5,047.00	4,509.96	-
301393	昊帆生物	2023-07-05	1-6 个月(含)	新股锁定期内	67.68	59.37	75.00	5,076.00	4,452.75	-
301456	盘古智能	2023-07-06	1-6 个月(含)	新股锁定期内	37.96	30.39	144.00	5,466.24	4,376.16	-
301418	协昌科技	2023-08-10	1-6 个月(含)	新股锁定期内	51.88	50.20	85.00	4,409.80	4,267.00	-
301528	多浦乐	2023-08-17	1-6 个月(含)	新股锁定期内	71.80	68.91	60.00	4,308.00	4,134.60	-
301550	斯菱股份	2023-09-06	1-6 个月(含)	新股锁定期内	37.56	43.57	93.00	3,493.08	4,052.01	-
68869	锆威	2023-0	1-6 个	新股	40.83	43.41	89.00	3,633.	3,863.	-

3	特	8-10	月(含)	锁定期内				87	49	
301515	港通医疗	2023-07-13	1-6个月(含)	新股锁定期内	31.16	28.27	133.00	4,144.28	3,759.91	-
688646	逸飞激光	2023-07-21	1-6个月(含)	新股锁定期内	46.80	36.07	102.00	4,773.60	3,679.14	-
301529	福赛科技	2023-08-31	1-6个月(含)	新股锁定期内	36.60	37.88	95.00	3,477.00	3,598.60	-
688612	威迈斯	2023-07-19	1-6个月(含)	新股锁定期内	47.29	37.97	88.00	4,161.52	3,341.36	-
301525	儒竞科技	2023-08-23	1-6个月(含)	新股锁定期内	99.57	81.46	41.00	4,082.37	3,339.86	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	1-6个月(含)	新股锁定期内	55.68	37.58	87.00	4,844.16	3,269.46	-
688450	光格科技	2023-07-17	1-6个月(含)	新股锁定期内	53.09	36.42	72.00	3,822.48	2,622.24	-
001378	德冠新材	2023-10-23	1-6个月(含)	新股锁定期内	31.68	31.27	82.00	2,597.76	2,564.14	-
001326	联域股份	2023-11-01	1-6个月(含)	新股锁定期内	41.18	48.64	52.00	2,141.36	2,529.28	-
603119	浙江荣泰	2023-07-21	1-6个月(含)	新股锁定期内	15.32	23.87	88.00	1,348.16	2,100.56	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末，本基金无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

本报告期末，本基金无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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

本基金管理人建立了科学有效、职责明晰的风险管理组织架构，建立和完善了与其业务特点、规模和复杂程度相适应的风险管理体系。董事会、监事会、经理层依法履行职责，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。

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。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金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；在银行间同业市场进行的交易通过交易对手库管理控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末本基金未持有按短期信用评级的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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。

本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。

除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

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。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日					
资产					
货币资金	968,386.86	-	-	-	968,386.86
结算备付金	11,135,693.81	-	-	-	11,135,693.81
存出保证金	0.00	-	-	-	0.00
交易性金融资产	0.00	0.00	0.00	111,680,325.11	111,680,325.11
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他权益工具投资	-	-	-	0.00	0.00
应收清算款	-	-	-	0.00	0.00
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	3,600.12	3,600.12
递延所得税资产	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	12,104,080.67	0.00	0.00	111,683,925.23	123,788,005.90
负债					
短期借款	-	-	-	0.00	0.00
交易性金融负债	-	-	-	0.00	0.00
衍生金融负债	-	-	-	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00
应付清算款	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	425,997.90	425,997.90
应付管理人报酬	-	-	-	125,606.87	125,606.87
应付托管费	-	-	-	20,934.48	20,934.48
应付销售服务费	-	-	-	13,398.18	13,398.18
应付投资顾问费	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
递延所得税负债	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	204,514.87	204,514.87
负债总计	0.00	0.00	0.00	790,452.30	790,452.30
利率敏感度缺口	12,104,080.67	0.00	0.00	110,893,472.93	122,997,553.60

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					
银行存款	8,867,367.64	-	-	-	8,867,367.64
结算备付金	4,792,785.65	-	-	-	4,792,785.65
存出保证金	0.00	-	-	-	0.00
交易性金融资产	0.00	0.00	0.00	144,341,764.58	144,341,764.58
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他权益工具投资	-	-	-	0.00	0.00
应收证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	9,866.25	9,866.25
递延所得税资产	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	13,660,153.29	0.00	0.00	144,351,630.83	158,011,784.12
负债					
短期借款	-	-	-	0.00	0.00
交易性金融负债	-	-	-	0.00	0.00
衍生金融负债	-	-	-	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00
应付证券清算款	-	-	-	2,841,251.31	2,841,251.31
应付赎回款	-	-	-	142,499.30	142,499.30
应付管理人报酬	-	-	-	206,326.93	206,326.93
应付托管费	-	-	-	34,387.82	34,387.82
应付销售服务费	-	-	-	18,297.53	18,297.53
应付投资顾问费	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
递延所得税负债	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	209,250.91	209,250.91
负债总计	0.00	0.00	0.00	3,452,013.80	3,452,013.80

利率敏感度缺口	13,660,153.29	0.00	0.00	140,899,617.03	154,559,770.32
---------	---------------	------	------	----------------	----------------

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，本基金无债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	907,473.30	907,473.30
资产合计	-	907,473.30	907,473.30
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞 口净额	-	907,473.30	907,473.30
项目	上年度末 2022年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计

以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	4,541,415.95	4,541,415.95
资产合计	-	4,541,415.95	4,541,415.95
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	4,541,415.95	4,541,415.95

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,港币相对人民币升值 5%或者贬值 5%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	港币相对人民币升值 5%	增加约 45,373.67	增加约 227,070.80
	港币相对人民币贬值 5%	减少约 45,373.67	减少约 227,070.80

7.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中,本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险,并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	111,680,325.11	90.80	144,341,764.58	93.39
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	111,680,325.11	90.80	144,341,764.58	93.39

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,沪深 300 指数上升 1%或者下降 1%		
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 指数上升 1%	增加约 1,424,691.17	增加约 1,284,741.11
	沪深 300 指数下降 1%	减少约 1,424,691.17	减少约 1,284,741.11

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	111,423,211.31	143,285,396.64
第二层次	-	-
第三层次	257,113.80	1,056,367.94
合计	111,680,325.11	144,341,764.58

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,056,367.94	1,056,367.94
当期购买	-	-	-
当期出售 / 结算	-	-	-
转入第三 层次	-	618,356.45	618,356.45
转出第三 层次	-	1,828,452.15	1,828,452.15
当期利得 或损失总 额	-	410,841.56	410,841.56
其中：计 入损益的 利得或损 失	-	410,841.56	410,841.56
计 入其他综 合收益的 利得或损 失（若有）	-	-	-
期末余额	-	257,113.80	257,113.80
期末仍持 有的第三 层次金融 资产计入 本期损益 的未实现 利得或损 失的变动	-	45,112.73	45,112.73

——公允价值变动损益			
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	3,833,137.16	3,833,137.16
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,509,227.31	1,509,227.31
转出第三层次	-	4,035,704.56	4,035,704.56
当期利得或损失总额	-	-250,291.97	-250,291.97
其中：计入损益的利得或损失	-	-250,291.97	-250,291.97
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	1,056,367.94	1,056,367.94
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	-	73,082.24	73,082.24

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	采用的估值技术	不可观察输入值
----	-------	---------	---------

	价值		名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
交易所上市尚在限售期内股票	257,113.80	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1462-1.9293	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
交易所上市尚在限售期内股票	1,056,367.94	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1444-2.4756	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于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资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	111,680,325.11	90.22
	其中：股票	111,680,325.11	90.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合	12,104,080.67	9.78

	计		
8	其他各项资产	3,600.12	0.00
9	合计	123,788,005.90	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为人民币 907,473.30 元，占期末净值比例 0.74%。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	36,234.48	0.03
C	制造业	99,364,976.79	80.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,153.13	0.03
E	建筑业	2,085,992.52	1.70
F	批发和零售业	422,407.21	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	13,569.57	0.01
H	住宿和餐饮业	7,351.56	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,550,139.84	6.14
J	金融业	29,204.89	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	83,368.72	0.07
M	科学研究和技术服务业	533,903.65	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	291,211.14	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	184,550.60	0.15
R	文化、体育和娱乐业	128,787.71	0.10

S	综合	-	-
	合计	110,772,851.81	90.06

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	70,508.45	0.06
工业	2,020.87	0.00
通信服务	834,943.98	0.68
合计	907,473.30	0.74

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	占基金资产净值比例(%)
1	002475	立讯精密	246,200	8,481,590.00	6.90
2	002241	歌尔股份	343,200	7,210,632.00	5.86
3	300308	中际旭创	52,900	5,972,939.00	4.86
4	688012	中微公司	28,761	4,417,689.60	3.59
5	000063	中兴通讯	151,300	4,006,424.00	3.26
6	603501	韦尔股份	35,900	3,830,889.00	3.11
7	002463	沪电股份	171,083	3,784,355.96	3.08
8	600941	中国移动	37,400	3,720,552.00	3.02
9	688200	华峰测控	28,074	3,447,487.20	2.80
10	300502	新易盛	69,300	3,417,876.00	2.78
11	603986	兆易创新	35,400	3,270,606.00	2.66
12	300394	天孚通信	33,100	3,029,312.00	2.46
13	688037	芯源微	22,652	3,026,533.72	2.46
14	601728	中国电信	460,400	2,490,764.00	2.03
15	600584	长电科技	79,900	2,385,814.00	1.94
16	002371	北方华创	9,700	2,383,387.00	1.94
17	688032	禾迈股份	7,631	2,060,370.00	1.68
18	000032	深桑达 A	96,800	2,050,224.00	1.67
19	002446	盛路通信	239,400	1,987,020.00	1.62
20	605117	德业股份	23,300	1,954,870.00	1.59
21	301308	江波龙	19,703	1,813,661.15	1.47
22	002409	雅克科技	31,700	1,766,641.00	1.44
23	688123	聚辰股份	28,714	1,758,158.22	1.43
24	688525	佰维存储	26,254	1,645,075.64	1.34
25	688362	甬矽电子	55,586	1,455,797.34	1.18

26	002179	中航光电	36,600	1,427,400.00	1.16
27	300762	上海瀚讯	86,800	1,308,944.00	1.06
28	300638	广和通	65,500	1,246,465.00	1.01
29	603197	保隆科技	21,200	1,195,680.00	0.97
30	300763	锦浪科技	15,000	1,048,500.00	0.85
31	003021	兆威机电	11,100	1,043,289.00	0.85
32	300604	长川科技	25,400	964,946.00	0.78
33	688668	鼎通科技	17,354	960,023.28	0.78
34	688418	震有科技	48,187	908,806.82	0.74
35	301391	卡莱特	7,600	870,048.00	0.71
36	01896	猫眼娱乐	102,600	834,943.98	0.68
37	603296	华勤技术	7,700	615,153.00	0.50
38	600685	中船防务	23,500	600,425.00	0.49
39	300474	景嘉微	7,600	537,396.00	0.44
40	688512	慧智微	24,290	473,412.10	0.38
41	300693	盛弘股份	12,300	367,893.00	0.30
42	688110	东芯股份	5,337	183,752.91	0.15
43	688270	臻镭科技	2,530	173,001.40	0.14
44	688249	晶合集成	9,872	170,292.00	0.14
45	688351	微电生理	6,065	155,567.25	0.13
46	688443	智翔金泰	3,379	134,991.05	0.11
47	688387	信科移动	18,334	132,188.14	0.11
48	688153	唯捷创芯	1,931	126,480.50	0.10
49	301383	天键股份	1,912	124,280.00	0.10
50	688361	中科飞测	1,661	123,628.23	0.10
51	688322	奥比中光	3,280	123,262.40	0.10
52	688439	振华风光	1,371	122,169.81	0.10
53	301188	力诺特玻	6,470	115,748.30	0.09
54	301263	泰恩康	7,007	114,424.31	0.09
55	688210	统联精密	4,347	113,674.05	0.09
56	688262	国芯科技	3,820	112,078.80	0.09
57	688102	斯瑞新材	8,442	111,349.98	0.09
58	688230	芯导科技	2,645	110,666.80	0.09
59	301293	三博脑科	1,728	107,861.76	0.09
60	688295	中复神鹰	3,550	107,600.50	0.09
61	688220	翱捷科技	1,523	107,280.12	0.09
62	688244	永信至诚	1,911	106,614.69	0.09
63	688283	坤恒顺维	1,542	105,827.46	0.09
64	688486	龙迅股份	888	105,467.76	0.09
65	688205	德科立	2,090	103,413.20	0.08
66	688469	中芯集成	20,285	101,830.70	0.08
67	688167	炬光科技	892	101,688.00	0.08
68	688035	德邦科技	1,892	100,957.12	0.08
69	301381	赛维时代	3,294	99,577.26	0.08

70	688375	国博电子	1,222	97,185.66	0.08
71	301179	泽宇智能	3,742	97,104.90	0.08
72	688629	华丰科技	4,364	95,571.60	0.08
73	688515	裕太微	956	94,462.36	0.08
74	688400	凌云光	3,481	93,987.00	0.08
75	688234	天岳先进	1,400	92,498.00	0.08
76	301338	凯格精机	2,216	90,856.00	0.07
77	301136	招标股份	7,172	90,725.80	0.07
78	301122	采纳股份	2,655	89,898.30	0.07
79	688480	赛恩斯	2,302	89,133.44	0.07
80	301339	通行宝	4,403	88,852.54	0.07
81	301217	铜冠铜箔	7,481	88,724.66	0.07
82	688403	汇成股份	8,287	87,427.85	0.07
83	301109	军信股份	5,512	87,089.60	0.07
84	301212	联盛化学	3,187	86,049.00	0.07
85	301100	风光股份	4,226	85,703.28	0.07
86	688306	均普智能	15,384	85,688.88	0.07
87	688236	春立医疗	3,234	85,054.20	0.07
88	301327	华宝新能	1,100	84,040.00	0.07
89	301316	慧博云通	3,584	83,292.16	0.07
90	301270	汉仪股份	2,095	83,276.25	0.07
91	301268	铭利达	2,791	83,255.53	0.07
92	301138	华研精机	2,849	82,621.00	0.07
93	688206	概伦电子	3,760	81,968.00	0.07
94	688238	和元生物	9,060	81,449.40	0.07
95	301193	家联科技	4,752	80,688.96	0.07
96	688253	英诺特	3,197	79,956.97	0.07
97	301092	争光股份	2,995	79,307.60	0.06
98	688073	毕得医药	1,425	79,087.50	0.06
99	301133	金钟股份	2,860	78,850.20	0.06
100	688432	有研硅	6,374	78,718.90	0.06
101	688247	宣泰医药	7,155	78,561.90	0.06
102	688380	中微半导	3,284	78,356.24	0.06
103	688273	麦澜德	2,345	78,111.95	0.06
104	301118	恒光股份	3,142	76,759.06	0.06
105	301103	何氏眼科	2,558	76,688.84	0.06
106	688130	晶华微	1,867	76,266.95	0.06
107	301499	维科精密	2,597	76,252.97	0.06
108	301132	满坤科技	2,647	75,995.37	0.06
109	301382	蜂助手	2,121	75,550.02	0.06
110	688121	卓然股份	3,681	74,466.63	0.06
111	688237	超卓航科	1,957	73,935.46	0.06
112	301181	标榜股份	2,618	73,906.14	0.06
113	301116	益客食品	5,764	73,894.48	0.06

114	688193	仁度生物	1,635	73,771.20	0.06
115	688563	航材股份	1,174	71,765.02	0.06
116	301201	诚达药业	2,819	71,687.17	0.06
117	301102	兆讯传媒	3,719	71,181.66	0.06
118	03690	美团-W	950	70,508.45	0.06
119	301161	唯万密封	3,460	69,961.20	0.06
120	301231	荣信文化	2,744	69,834.80	0.06
121	301088	戎美股份	4,573	69,646.79	0.06
122	688409	富创精密	886	69,382.66	0.06
123	301182	凯旺科技	2,932	68,550.16	0.06
124	301222	浙江恒威	2,301	68,408.73	0.06
125	301366	一博科技	2,050	68,408.50	0.06
126	301135	瑞德智能	2,743	68,081.26	0.06
127	688376	美埃科技	1,789	67,964.11	0.06
128	301313	凡拓数创	1,884	67,937.04	0.06
129	301200	大族数控	1,770	66,852.90	0.05
130	688419	耐科装备	1,866	66,336.30	0.05
131	301328	维峰电子	1,354	66,291.84	0.05
132	301130	西点药业	2,370	66,075.60	0.05
133	688282	理工导航	1,666	65,473.80	0.05
134	301279	金道科技	2,641	65,470.39	0.05
135	301310	鑫宏业	1,341	65,239.65	0.05
136	301171	易点天下	3,281	64,865.37	0.05
137	301285	鸿日达	4,059	64,862.82	0.05
138	688543	国科军工	1,160	64,844.00	0.05
139	301325	曼恩斯特	818	63,427.72	0.05
140	301190	善水科技	3,343	63,416.71	0.05
141	688426	康为世纪	2,071	63,269.05	0.05
142	301123	奕东电子	2,693	63,177.78	0.05
143	688334	西高院	3,612	62,595.96	0.05
144	688152	麒麟信安	887	62,152.09	0.05
145	301152	天力锂能	1,682	61,527.56	0.05
146	301555	惠柏新材	1,501	61,503.94	0.05
147	301233	盛帮股份	1,379	61,255.18	0.05
148	301158	德石股份	3,783	60,868.47	0.05
149	688084	晶品特装	812	60,859.40	0.05
150	688459	哈铁科技	6,472	60,577.92	0.05
151	688522	纳睿雷达	1,091	60,539.59	0.05
152	688211	中科微至	1,650	60,505.50	0.05
153	688576	西山科技	627	60,273.51	0.05
154	688388	嘉元科技	2,955	59,927.40	0.05
155	301362	民爆光电	1,519	59,660.16	0.05
156	301360	荣旗科技	636	59,529.60	0.05
157	688552	航天南湖	2,525	59,312.25	0.05

158	301056	森赫股份	5,716	58,417.52	0.05
159	688620	安凯微	4,938	58,367.16	0.05
160	301121	紫建电子	1,399	58,142.44	0.05
161	301326	捷邦科技	1,449	58,119.39	0.05
162	301227	森鹰窗业	2,130	57,659.10	0.05
163	688325	赛微微电	1,469	57,570.11	0.05
164	301151	冠龙节能	2,810	57,520.70	0.05
165	301189	奥尼电子	1,979	57,212.89	0.05
166	688593	新相微	3,846	56,613.12	0.05
167	301062	上海艾录	5,225	56,534.50	0.05
168	688255	凯尔达	2,309	56,455.05	0.05
169	688722	同益中	3,687	56,411.10	0.05
170	301272	英华特	1,037	56,232.08	0.05
171	301206	三元生物	1,938	55,969.44	0.05
172	301273	瑞晨环保	2,024	55,842.16	0.05
173	301260	格力博	3,186	55,372.68	0.05
174	688143	长盈通	1,547	54,686.45	0.04
175	688610	埃科光电	1,052	54,522.32	0.04
176	688132	邦彦技术	2,543	54,496.49	0.04
177	301198	喜悦智行	4,416	53,610.24	0.04
178	301081	严牌股份	4,829	53,601.90	0.04
179	301216	万凯新材	3,777	53,369.01	0.04
180	301282	金禄电子	2,133	53,303.67	0.04
181	688581	安杰思	424	52,919.44	0.04
182	301505	苏州规划	1,450	52,694.45	0.04
183	688175	高凌信息	1,886	52,675.98	0.04
184	301296	新巨丰	5,075	52,272.50	0.04
185	301300	远翔新材	1,650	52,189.50	0.04
186	688458	美芯晟	668	51,409.28	0.04
187	688570	天玛智控	1,882	51,209.22	0.04
188	301329	信音电子	2,256	51,104.98	0.04
189	688115	思林杰	1,464	50,756.88	0.04
190	301176	逸豪新材	3,008	50,444.16	0.04
191	301237	和顺科技	1,653	50,366.91	0.04
192	301318	维海德	1,404	49,715.64	0.04
193	301468	博盈特焊	1,630	49,654.69	0.04
194	301251	威尔高	1,379	49,263.27	0.04
195	301197	工大科雅	2,615	49,135.85	0.04
196	688146	中船特气	1,431	48,668.31	0.04
197	301258	富士莱	1,507	48,645.96	0.04
198	301246	宏源药业	1,860	48,322.80	0.04
199	688203	海正生材	3,703	48,213.06	0.04
200	301276	嘉曼服饰	1,966	47,931.08	0.04
201	301469	恒达新材	1,410	47,545.20	0.04

202	688631	莱斯信息	1,343	47,340.75	0.04
203	301166	优宁维	1,221	46,910.82	0.04
204	301332	德尔玛	3,832	46,827.04	0.04
205	301319	唯特偶	797	46,552.77	0.04
206	301115	建科股份	2,600	46,540.00	0.04
207	688455	科捷智能	3,653	46,429.63	0.04
208	301357	北方长龙	918	46,340.64	0.04
209	688602	康鹏科技	4,113	46,118.95	0.04
210	301283	聚胶股份	1,399	45,999.12	0.04
211	688137	近岸蛋白	828	45,937.44	0.04
212	301518	长华化学	1,960	45,787.56	0.04
213	301072	中捷精工	1,802	45,500.50	0.04
214	301035	润丰股份	644	45,080.00	0.04
215	301386	未来电器	1,751	44,527.93	0.04
216	301393	昊帆生物	742	44,479.42	0.04
217	688370	丛麟科技	1,797	44,385.90	0.04
218	301456	盘古智能	1,439	44,262.16	0.04
219	688231	隆达股份	2,002	44,064.02	0.04
220	688433	华曙高科	1,400	43,750.00	0.04
221	001287	中电港	2,089	43,513.87	0.04
222	301373	凌玮科技	1,451	43,022.15	0.03
223	301550	斯菱股份	924	42,593.79	0.03
224	688173	希荻微	2,250	39,577.50	0.03
225	688225	亚信安全	2,156	39,541.04	0.03
226	688503	聚和材料	727	38,967.20	0.03
227	301323	新莱福	1,053	38,950.47	0.03
228	300834	星辉环材	1,777	37,992.26	0.03
229	301529	福赛科技	950	37,670.35	0.03
230	688275	万润新能	602	37,125.34	0.03
231	688646	逸飞激光	1,011	36,984.90	0.03
232	688353	华盛锂电	1,343	36,798.20	0.03
233	001314	亿道信息	508	36,540.44	0.03
234	301345	涛涛车业	596	36,296.40	0.03
235	301487	盟固利	867	35,512.32	0.03
236	300854	中兰环保	2,026	35,353.70	0.03
237	301196	唯科科技	1,027	35,308.26	0.03
238	301063	海锅股份	1,524	34,747.20	0.03
239	301525	儒竞科技	409	34,391.70	0.03
240	301439	泓淋电力	2,339	34,196.18	0.03
241	688612	威迈斯	874	33,956.06	0.03
242	301219	腾远钴业	842	33,149.54	0.03
243	301371	敷尔佳	864	32,958.63	0.03
244	001286	陕西能源	3,767	32,207.85	0.03
245	688184	帕瓦股份	1,652	32,147.92	0.03

246	001311	多利科技	649	32,131.99	0.03
247	603281	江瀚新材	1,208	31,758.32	0.03
248	301079	邵阳液压	1,815	31,399.50	0.03
249	301309	万得凯	1,122	31,359.90	0.03
250	001378	德冠新材	817	31,104.19	0.03
251	688038	中科通达	2,132	30,722.12	0.02
252	600955	维远股份	1,694	30,407.30	0.02
253	688479	友车科技	1,300	30,316.00	0.02
254	601089	福元医药	1,749	30,152.76	0.02
255	301349	信德新材	637	29,989.96	0.02
256	600927	永安期货	1,859	29,204.89	0.02
257	688267	中触媒	1,486	28,560.92	0.02
258	688420	美腾科技	1,100	28,424.00	0.02
259	688623	二元科技	394	27,966.12	0.02
260	001339	智微智能	812	27,916.56	0.02
261	001326	联域股份	511	27,833.95	0.02
262	001330	博纳影业	3,564	25,660.80	0.02
263	301050	雷电微力	419	24,410.94	0.02
264	001308	康冠科技	867	24,258.66	0.02
265	301101	明月镜片	556	23,274.16	0.02
266	601065	江盐集团	1,939	22,182.16	0.02
267	603206	嘉环科技	1,210	21,550.10	0.02
268	603119	浙江荣泰	878	21,218.56	0.02
269	601133	柏诚股份	1,606	21,151.02	0.02
270	001338	永顺泰	1,649	19,886.94	0.02
271	301039	中集车辆	2,064	19,360.32	0.02
272	603132	金徽股份	1,342	18,358.56	0.01
273	603255	鼎际得	488	18,202.40	0.01
274	601121	宝地矿业	2,532	17,875.92	0.01
275	603191	望变电气	1,149	17,843.97	0.01
276	603122	合富中国	2,198	17,693.90	0.01
277	603230	内蒙新华	1,141	17,685.50	0.01
278	001298	好上好	584	17,414.88	0.01
279	301215	中汽股份	2,783	17,171.11	0.01
280	301090	华润材料	1,556	16,898.16	0.01
281	603125	常青科技	553	16,601.06	0.01
282	600935	华塑股份	4,811	16,213.07	0.01
283	603153	上海建科	740	15,636.20	0.01
284	301058	中粮科工	1,386	15,148.98	0.01
285	301211	亨迪药业	696	15,138.00	0.01
286	301149	隆华新材	1,214	15,017.18	0.01
287	688416	恒烁股份	256	14,999.04	0.01
288	301004	嘉益股份	312	14,180.40	0.01
289	001367	海森药业	318	13,979.28	0.01

290	603097	江苏华辰	577	13,842.23	0.01
291	603190	亚通精工	470	13,761.60	0.01
292	603235	天新药业	572	13,750.88	0.01
293	001319	铭科精技	536	13,705.52	0.01
294	603209	兴通股份	833	13,569.57	0.01
295	300904	威力传动	213	13,105.89	0.01
296	301087	可孚医疗	339	12,848.10	0.01
297	603070	万控智造	775	12,446.50	0.01
298	001229	魅视科技	347	12,353.20	0.01
299	001278	一彬科技	473	12,260.16	0.01
300	001228	永泰运	383	12,187.06	0.01
301	603176	汇通集团	1,924	11,890.32	0.01
302	301089	拓新药业	220	11,882.20	0.01
303	603057	紫燕食品	549	11,847.42	0.01
304	603282	亚光股份	457	11,808.88	0.01
305	301510	固高科技	335	11,728.35	0.01
306	301013	利和兴	706	11,190.10	0.01
307	300814	中富电路	328	11,053.60	0.01
308	301052	果麦文化	252	11,032.56	0.01
309	605566	福莱茵特	435	10,962.00	0.01
310	001260	坤泰股份	484	10,681.88	0.01
311	301175	中科环保	2,139	10,673.61	0.01
312	001366	播恩集团	645	10,623.15	0.01
313	001313	粤海饲料	1,232	10,619.84	0.01
314	001219	青岛食品	459	10,579.95	0.01
315	603130	云中马	480	10,344.00	0.01
316	001268	联合精密	409	10,225.00	0.01
317	001266	宏英智能	345	10,108.50	0.01
318	301030	仕净科技	242	10,091.40	0.01
319	603219	富佳股份	739	10,020.84	0.01
320	603215	比依股份	575	9,947.50	0.01
321	603280	南方路机	363	9,706.62	0.01
322	603051	鹿山新材	272	9,446.56	0.01
323	001333	光华股份	426	9,431.64	0.01
324	301111	粤万年青	379	9,308.24	0.01
325	603170	宝立食品	542	9,165.22	0.01
326	301020	密封科技	421	9,148.33	0.01
327	001238	浙江正特	374	9,114.38	0.01
328	301045	天禄科技	335	9,112.00	0.01
329	001288	运机集团	537	9,032.34	0.01
330	001299	美能能源	576	8,945.28	0.01
331	001222	源飞宠物	607	8,922.90	0.01
332	301048	金鹰重工	843	8,885.22	0.01
333	301096	百诚医药	136	8,853.60	0.01

334	001368	通达创智	351	8,806.59	0.01
335	001230	劲旅环境	375	8,797.50	0.01
336	001256	炜冈科技	474	8,773.74	0.01
337	603048	浙江黎明	464	8,616.48	0.01
338	301028	东亚机械	733	8,598.09	0.01
339	688472	阿特斯	647	8,171.61	0.01
340	001234	泰慕士	333	8,145.18	0.01
341	603151	邦基科技	535	8,073.15	0.01
342	603182	嘉华股份	546	8,064.42	0.01
343	301139	元道通信	238	8,046.78	0.01
344	603065	宿迁联盛	581	8,006.18	0.01
345	688592	司南导航	157	7,933.21	0.01
346	605567	春雪食品	629	7,931.69	0.01
347	001336	楚环科技	274	7,869.28	0.01
348	301046	能辉科技	290	7,864.80	0.01
349	301021	英诺激光	290	7,629.90	0.01
350	605033	美邦股份	423	7,592.85	0.01
351	300994	久祺股份	504	7,408.80	0.01
352	001231	农心科技	355	7,394.65	0.01
353	301073	君亭酒店	324	7,351.56	0.01
354	603150	万朗磁塑	250	7,262.50	0.01
355	688582	芯动联科	184	7,115.28	0.01
356	301177	迪阿股份	238	7,018.62	0.01
357	301372	科净源	153	6,669.27	0.01
358	301038	深水规院	345	6,620.55	0.01
359	688573	信宇人	220	6,336.00	0.01
360	301078	孩子王	756	6,206.76	0.01
361	301509	金凯生科	99	6,160.77	0.01
362	301016	雷尔伟	275	6,066.50	0.00
363	301059	金三江	492	5,963.04	0.00
364	301429	森泰股份	283	5,784.52	0.00
365	301428	世纪恒通	149	5,758.85	0.00
366	688671	碧兴物联	164	5,625.20	0.00
367	605138	盛泰集团	723	5,603.25	0.00
368	301507	民生健康	341	5,404.85	0.00
369	688651	盛邦安全	117	5,387.85	0.00
370	301533	威马农机	157	5,206.12	0.00
371	301032	新柴股份	513	5,196.69	0.00
372	301498	乖宝宠物	133	5,161.73	0.00
373	301055	张小泉	355	5,119.10	0.00
374	301033	迈普医学	108	4,702.32	0.00
375	301025	读客文化	403	4,574.05	0.00
376	301040	中环海陆	241	4,571.77	0.00
377	300774	倍杰特	444	4,568.76	0.00

378	301036	双乐股份	205	4,544.85	0.00
379	301049	超越科技	196	4,539.36	0.00
380	301355	南王科技	285	4,317.75	0.00
381	301418	协昌科技	85	4,267.00	0.00
382	301037	保立佳	212	4,225.16	0.00
383	301528	多浦乐	60	4,134.60	0.00
384	301337	亚华电子	128	3,918.08	0.00
385	688429	时创能源	184	3,898.96	0.00
386	688693	锆威特	89	3,863.49	0.00
387	001380	华纬科技	110	3,832.40	0.00
388	301515	港通医疗	133	3,759.91	0.00
389	301027	华蓝集团	286	3,577.86	0.00
390	603137	恒尚节能	139	2,727.18	0.00
391	688450	光格科技	72	2,622.24	0.00
392	001324	长青科技	93	2,257.11	0.00
393	001282	三联锻造	60	2,170.20	0.00
394	603172	万丰股份	122	2,150.86	0.00
395	03898	时代电气	100	2,020.87	0.00
396	001360	南矿集团	94	1,634.66	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	000977	浪潮信息	17,757,983.64	11.49
2	300308	中际旭创	15,172,097.00	9.82
3	300502	新易盛	15,015,335.70	9.71
4	688041	海光信息	14,881,255.67	9.63
5	00700	腾讯控股	14,851,992.03	9.61
6	688012	中微公司	14,433,250.17	9.34
7	600050	中国联通	12,669,171.00	8.20
8	300394	天孚通信	12,434,270.00	8.04
9	688111	金山办公	11,567,148.46	7.48
10	002475	立讯精密	11,490,424.00	7.43
11	002371	北方华创	10,564,186.00	6.84
12	300188	国投智能	10,524,220.06	6.81
13	00762	中国联通	9,858,711.24	6.38
14	000063	中兴通讯	9,779,198.00	6.33
15	00728	中国电信	9,052,544.37	5.86

16	300638	广和通	8,576,124.00	5.55
17	300782	卓胜微	8,215,819.10	5.32
18	002222	福晶科技	8,102,509.00	5.24
19	300820	英杰电气	7,513,545.00	4.86
20	688008	澜起科技	7,326,723.21	4.74
21	000032	深桑达 A	7,292,441.76	4.72
22	002049	紫光国微	7,083,246.00	4.58
23	600498	烽火通信	6,784,596.00	4.39
24	002463	沪电股份	6,721,930.00	4.35
25	00941	中国移动	6,488,957.18	4.20
26	002241	歌尔股份	6,308,778.00	4.08
27	601728	中国电信	6,142,646.00	3.97
28	300274	阳光电源	6,117,447.00	3.96
29	688521	芯原股份	6,059,875.02	3.92
30	002230	科大讯飞	6,040,251.00	3.91
31	000021	深科技	5,821,140.36	3.77
32	688256	寒武纪	5,812,063.36	3.76
33	600641	万业企业	5,689,470.13	3.68
34	002384	东山精密	5,301,247.88	3.43
35	603986	兆易创新	5,289,819.00	3.42
36	002179	中航光电	5,214,039.78	3.37
37	600941	中国移动	5,191,256.00	3.36
38	688048	长光华芯	5,093,851.13	3.30
39	003021	兆威机电	5,051,656.00	3.27
40	688037	芯源微	5,041,705.02	3.26
41	300570	太辰光	5,021,607.00	3.25
42	688362	甬矽电子	4,844,461.73	3.13
43	300496	中科创达	4,739,138.00	3.07
44	688668	鼎通科技	4,572,464.96	2.96
45	688036	传音控股	4,524,596.58	2.93
46	300624	万兴科技	4,251,572.00	2.75
47	002446	盛路通信	4,200,113.00	2.72
48	300661	圣邦股份	4,080,542.00	2.64
49	603501	韦尔股份	3,980,528.00	2.58
50	688002	睿创微纳	3,949,611.79	2.56
51	002153	石基信息	3,827,034.00	2.48
52	300750	宁德时代	3,692,310.71	2.39
53	002156	通富微电	3,680,340.70	2.38
54	600100	同方股份	3,588,409.00	2.32
55	603893	瑞芯微	3,537,365.00	2.29
56	001270	铖昌科技	3,514,048.00	2.27
57	688498	源杰科技	3,101,065.26	2.01

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	000977	浪潮信息	18,539,869.90	12.00
2	688041	海光信息	17,326,376.13	11.21
3	00700	腾讯控股	17,097,154.40	11.06
4	002463	沪电股份	13,563,190.60	8.78
5	002371	北方华创	12,936,636.90	8.37
6	600050	中国联通	12,895,999.00	8.34
7	688037	芯源微	12,798,964.59	8.28
8	688111	金山办公	10,709,558.19	6.93
9	688012	中微公司	10,588,669.76	6.85
10	300188	国投智能	10,078,441.53	6.52
11	603893	瑞芯微	9,966,333.00	6.45
12	00762	中国联通	9,750,757.21	6.31
13	300394	天孚通信	9,278,560.00	6.00
14	300661	圣邦股份	8,442,531.00	5.46
15	000063	中兴通讯	8,233,621.00	5.33
16	002384	东山精密	8,166,200.95	5.28
17	00728	中国电信	8,100,453.21	5.24
18	300502	新易盛	8,013,206.00	5.18
19	688008	澜起科技	7,996,725.14	5.17
20	300782	卓胜微	7,875,381.60	5.10
21	002475	立讯精密	7,814,304.50	5.06
22	688052	纳芯微	7,717,393.81	4.99
23	300638	广和通	7,709,039.00	4.99
24	300474	景嘉微	7,635,294.54	4.94
25	603986	兆易创新	7,545,818.00	4.88
26	002222	福晶科技	7,426,046.00	4.80
27	300820	英杰电气	7,317,245.00	4.73
28	300308	中际旭创	7,258,205.00	4.70
29	601728	中国电信	7,117,581.00	4.61
30	00941	中国移动	7,117,288.65	4.60
31	002230	科大讯飞	6,883,554.89	4.45
32	600498	烽火通信	6,519,896.00	4.22
33	002049	紫光国微	6,003,260.00	3.88
34	000021	深科技	5,876,577.00	3.80
35	300570	太辰光	5,747,322.00	3.72
36	688256	寒武纪	5,660,503.90	3.66

37	600941	中国移动	5,651,281.00	3.66
38	300274	阳光电源	5,617,059.00	3.63
39	688766	普冉股份	5,201,509.38	3.37
40	300223	北京君正	5,112,384.60	3.31
41	688048	长光华芯	4,961,038.67	3.21
42	688200	华峰测控	4,954,014.03	3.21
43	688521	芯原股份	4,947,679.41	3.20
44	600641	万业企业	4,938,582.00	3.20
45	300115	长盈精密	4,925,319.00	3.19
46	000032	深桑达 A	4,877,858.00	3.16
47	688362	甬矽电子	4,675,271.70	3.02
48	688036	传音控股	4,547,850.79	2.94
49	688099	晶晨股份	4,224,269.20	2.73
50	300496	中科创达	4,116,537.91	2.66
51	300624	万兴科技	4,092,762.00	2.65
52	300750	宁德时代	3,885,085.54	2.51
53	300327	中颖电子	3,821,711.00	2.47
54	003021	兆威机电	3,732,352.00	2.41
55	002156	通富微电	3,648,305.00	2.36
56	688002	睿创微纳	3,614,835.47	2.34
57	600100	同方股份	3,331,624.00	2.16
58	002436	兴森科技	3,302,859.00	2.14
59	300229	拓尔思	3,242,912.00	2.10
60	001270	铖昌科技	3,221,525.96	2.08
61	603501	韦尔股份	3,175,876.00	2.05
62	300627	华测导航	3,156,269.80	2.04
63	688259	创耀科技	3,094,211.33	2.00

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

买入股票的成本（成交）总额	529,523,141.66
卖出股票的收入（成交）总额	561,190,949.57

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

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

本基金基金合同无国债期货投资策略。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同无国债期货投资策略。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

8.13 投资组合报告附注

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

本报告期末本基金投资的前十名证券没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.13.2 本报告期内,本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.13.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,600.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,600.12

8.13.4 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。

8.13.5 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的情况。

8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	3,060	40,360.01	1.10	0.00%	123,501,642.07	100.00%
新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C	1,443	29,983.07	-	0.00%	43,265,563.13	100.00%
合计	4,503	37,034.69	1.10	0.00%	166,767,205.20	100.00%

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	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	1.77	0.00%
	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C	87.76	0.00%
	合计	89.53	0.00%

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的情况

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	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	0
	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	0
	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C
基金合同生效日（2021 年 5 月 26 日）基金份额总额	512,573,928.99	216,316,038.20
本报告期期初基金份额总额	146,312,912.90	53,604,165.06
本报告期基金总申购份额	2,340,426.59	2,994,072.86
减：本报告期基金总赎回份额	25,151,696.32	13,332,674.79
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	123,501,643.17	43,265,563.13

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2023 年 2 月 28 日，第二届董事会第三十七次会议决议于春玲女士代任本基金管理人董事长，翟晨曦女士离任董事长，刘征宇先生由于个人原因不再担任副总经理，崔凤廷先生担任副总经理职务。

2023 年 4 月 24 日，本基金管理人收到重庆市市场监督管理局工商变更批复，法定代表人变更为于春玲女士。

2023 年 6 月 28 日，第三届董事会第一次会议决议于春玲女士担任本基金管理人董事长职务、代任总经理职务，崔凤廷先生担任副总经理兼董事会秘书职务，张宗友先生不再担任联席董事长职务。经 2023 年第二次股东大会审议通过，选举于春玲女士、张宗友先生、李磊先生、匡双礼先生、张坤女士、徐经长先生担任本基金管理人第三届董事会董事，其中匡双礼先生、张坤女士、徐经长先生为独立董事。经公司审议，杨淑飞、张浩不再担任第二届监事会监事职务，选举卢东亮、孙义为第三届监事会监事成员，其中，卢东亮为监事会主席。

2023 年 9 月 1 日，第三届董事会第四次（临时）会议决议杨金亮先生担任本基金管理人总经理职务，于春玲女士不再代任总经理职务。2023 年 9 月 15 日，经 2023 年第五次股东大会审议通过，增补杨金亮先生为第三届董事会董事。

2023 年 12 月 1 日，经 2023 年第六次（临时）股东大会审议通过，徐经长先生不再担任公司独立董事，增补陈佳俊女士担任公司独立董事。

本报告期内，本基金托管人 2023 年 2 月 23 日发布公告，胡捷先生自 2023 年 2 月 23 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内，本基金托管人 2023 年 4 月 7 日发布公告，朱绍纲先生自 2023 年 4 月 4 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内，本基金托管人 2023 年 7 月 3 日发布公告，郑鹏先生自 2023 年 5 月 16 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部风险总监。

本报告期内，本基金托管人 2023 年 7 月 27 日发布公告，国然女士自 2023 年 7 月 18 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，基金管理人（次承租人）及原深圳办公区所租房屋出租方（承租人）与房屋业主之间的物权保护纠纷案件（2020），二审法院做出生效判决，判决基金管理人需向业主支付房屋占用费，承租人不当收取房租。基金管理人履行完生效判决后继续起诉承租人向其追偿损失，法院组织双方和解并出具了民事调解书，承租人已自动履行完毕。

基金管理人管理的专户产品众富 1 号交易对手湖北蕲春农商行与基金管理人之间的客户欺诈责任纠纷案件（2022），原告于开庭前自行撤诉，法院同意其撤诉申请后予以结案。

本报告期末有涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金会计师事务所为致同会计师事务所（特殊普通合伙）。报告年度应支付给其报酬 80,000.00 元人民币。自 2021 年，致同会计师事务所为本基金连续提供 3 年审计服务。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	分公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023-10-18
采取稽查或处罚等措施的机构	上海证监局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	不完整报送分支机构负责人参股及兼职信息
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-

11.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的 比例	佣金	占当期佣金总量的 比例	
恒泰证券	2	1,084,840,172.01	100.00%	794,093.26	100.00%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基金字[1998]29号）以及《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，本基金共租用 2 个交易席位，其中报告期内新增 0 个交易席位，退租 0 个交易席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全。
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平。

二、交易席位的选择流程

- 1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。
- 2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

1、券商提供独立的或第三方研究报告及服务，包括宏观经济、行业分析、公司研发、市场数据、财经信息、行业期刊、组合分析软件、绩效评估、研讨会、统计信息、交易评估等，用以支持投资决策。

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员和交易员分别打分，根据经纪商给投资带来的增值确定经纪商的排名。

考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小和评分高低成正比。

3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

11.15.2 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		回购交易		权证交易	
	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
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

11.16 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	新华基金管理股份有限公司关于部分基金增加国金证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告	上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-01-18
2	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2022 年 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-01-20
3	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2023-01-20
4	新华基金管理股份有限公司关于公司变更实际控制人的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-02-08
5	新华基金管理股份有限公司关于调整直销柜	中国证券报、上海证券	2023-02-15

	台及网上直销交易优惠费率的公告	报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	
6	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-03-02
7	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-03-02
8	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告	上海证券报、证券时报、公司网站、电子信披网站	2023-03-06
9	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-03-24
10	新华基金管理股份有限公司旗下基金年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-03-30
11	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2023-03-30
12	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海大智慧基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-04-14
13	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-04-21
14	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2023-04-21
15	新华基金管理股份有限公司关于公司法定代表人变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-04-25
16	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	公司网站、电子信披网站	2023-05-04
17	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金（新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A）基金产品资料概要（更新）	公司网站、电子信披网站	2023-05-04
18	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金（新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C）基金产品资料概要（更新）	公司网站、电子信披网站	2023-05-04
19	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告	证券时报、公司网站、电子信披网站	2023-05-11
20	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加北京雪球基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、电子信披网站	2023-06-09

21	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海中正达广基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-06-29
22	新华基金管理股份有限公司关于旗下新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金在部分渠道上线公告	证券时报、公司网站、电子信披网站	2023-06-30
23	新华基金管理股份有限公司关于公司董事变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-06-30
24	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-06-30
25	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-06-30
26	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-06-30
27	新华基金管理股份有限公司旗下基金 2 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-07-21
28	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	公司网站、电子信披网站	2023-07-21
29	新华基金管理股份有限公司关于设立广东分公司的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-07-29
30	新华基金管理股份有限公司关于暂停新华基金 APP 运营及维护服务的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-08-16
31	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为代销机构并参加网上费率优惠活动公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-08-18
32	新华基金管理股份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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-08-19
33	新华基金管理股份有限公司关于旗下全部基金中期报告的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-08-30
34	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告	公司网站、电子信披网站	2023-08-30
35	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-09-02
36	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加乾道基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信	2023-09-05

		披网站	
37	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分证券投资基金增加博时基金销售有限责任公司为销售机构并开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-10-13
38	新华基金管理股份有限公司旗下基金 3 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-10-25
39	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	公司网站、电子信披网站	2023-10-25
40	新华基金管理股份有限公司关于公司独立董事变更的公告	中国证券报、证券时报、公司网站、电子信披网站	2023-12-02

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 影响投资者决策的其他重要信息

2023 年 2 月 8 日，本基金管理人发布了《新华基金管理股份有限公司关于公司变更实际控制人的公告》，中国证券监督管理委员会依法核准了北京金融街投资（集团）有限公司成为新华基金管理股份有限公司实际控制人。本次变更后本基金管理人控股股东仍为恒泰证券。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (二)关于申请募集新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (三)新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (四)新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- (五)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- (六)《新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》（更新）
- (七)《新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要》（更新）
- (八)基金管理人业务资格批件、营业执照及公司章程
- (九)基金托管人业务资格批件和营业执照
- (十)中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇二四年三月三十日