

新华钻石品质企业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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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                              | 7  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 9  |
| §4 管理人报告                                | 9  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11 |
| 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             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14 |
| 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       | 14 |
| §5 托管人报告                                | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14 |
| 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 | 14 |
| 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       | 14 |
| §6 审计报告                                 | 14 |
| 6.1 审计意见                                | 15 |
| 6.2 形成审计意见的基础                           | 15 |
| 6.3 其他信息                                | 15 |
| 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任                     | 15 |
| 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任                     | 16 |
| §7 年度财务报表                               | 17 |
| 7.1 资产负债表                               | 17 |
| 7.2 利润表                                 | 18 |
| 7.3 净资产变动表                              | 20 |
| 7.4 报表附注                                | 21 |
| §8 投资组合报告                               | 51 |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 51 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合                      | 51 |
| 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       | 52 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 54 |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 57        |
| 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 .....    | 57        |
| 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 ..... | 57        |
| 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 ..... | 57        |
| 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 .....    | 57        |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 57        |
| 8.12 本报告期投资基金情况 .....                       | 57        |
| 8.13 投资组合报告附注 .....                         | 58        |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>59</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 59        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 59        |
| 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 .....     | 59        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>59</b> |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>60</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 60        |
| 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 .....      | 60        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 61        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 61        |
| 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....               | 61        |
| 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 61        |
| 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 .....         | 61        |
| 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 61        |
| 11.16 其他重大事件 .....                          | 64        |
| <b>12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>              | <b>66</b> |
| <b>§13 备查文件目录 .....</b>                     | <b>66</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 66        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 67        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 67        |

## §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 基金名称       | 新华钻石品质企业混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 新华钻石品质企业混合        |
| 基金主代码      | 519093            |
| 交易代码       | 519093            |
| 基金运作方式     | 契约型开放式            |
| 基金合同生效日    | 2010年2月3日         |
| 基金管理人      | 新华基金管理股份有限公司      |
| 基金托管人      | 中国建设银行股份有限公司      |
| 报告期末基金份额总额 | 46,765,985.88 份   |
| 基金合同存续期    | 不定期               |

## 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金通过对上市公司基本面的深入研究，结合宏观经济周期和行业景气度分析，力求在有效控制风险并适度保持良好流动性的前提下，精选具有稳定价值性和高质量成长性的钻石品质类的优质上市公司。   |
| 投资策略   | 本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略，通过对经济周期、行业特征等宏观层面的信息进行全面分析，调整大类资产配置比例和行业配置比例；在个股个券的选择上采用自下而上的投资策略，核心是从企业价值的稳定性和成长的高质量出发，筛选具有钻石品质的优质企业，并进行重点配置。钻石品质企业股票的配置比例不低于股票资产配置的 80%。钻石品质企业是指具有稳定价值性和高质量成长性的上市公司，它们具有安全、透明、稳定、创新与领导气质五大优秀品质。 |
| 业绩比较基准 | 80%×沪深 300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等预期风险中等预期收益品种，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。  |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                       | 基金托管人                  |
|-------------|------|-----------------------------|------------------------|
| 名称          |      | 新华基金管理股份有限公司                | 中国建设银行股份有限公司           |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 齐岩                          | 王小飞                    |
|             | 联系电话 | 010-68779688                | 021-60637103           |
|             | 电子邮箱 | qiyan@ncfund.com.cn         | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话      |      | 4008198866                  | 021-60637111           |
| 传真          |      | 010-68779528                | 021-60635778           |
| 注册地址        |      | 重庆市江北区聚贤岩广场6号<br>力帆中心2号楼19层 | 北京市西城区金融大街25号          |
| 办公地址        |      | 重庆市江北区聚贤岩广场6号<br>力帆中心2号楼19层 | 北京市西城区闹市口大街1号<br>院1号楼  |
| 邮政编码        |      | 400010                      | 100033                 |
| 法定代表人       |      | 于春玲                         | 田国立                    |

### 2.4 信息披露方式

|                     |                   |
|---------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券日报              |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.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<br>5层 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司   | 北京市西城区太平桥大街17号            |

## §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         |
|---------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期已实现收益       | -442,217.70    | -35,859,249.71 | 25,000,168.10  |
| 本期利润          | -17,332,005.86 | -36,840,276.75 | -24,172,202.75 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.3456        | -0.7049        | -0.4110        |
| 本期加权平均净值利润率   | -13.46%        | -26.67%        | -11.47%        |
| 本期基金份额净值增长率   | -13.48%        | -21.07%        | -12.13%        |
| 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      | 58,587,122.49  | 82,550,536.84  | 121,966,109.24 |
| 期末可供分配基金份额利润  | 1.2528         | 1.6037         | 2.2988         |
| 期末基金资产净值      | 105,353,108.37 | 134,027,076.05 | 175,022,249.17 |
| 期末基金份额净值      | 2.2528         | 2.6037         | 3.2988         |
| 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   | 125.28%        | 160.37%        | 229.88%        |

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与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -7.62%   | 0.93%       | -5.47%     | 0.63%         | -2.15% | 0.30% |
| 过去六个月 | -10.91%  | 1.00%       | -8.30%     | 0.68%         | -2.61% | 0.32% |

|            |         |       |         |       |         |       |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去一年       | -13.48% | 1.06% | -8.40%  | 0.68% | -5.08%  | 0.38% |
| 过去三年       | -39.99% | 1.32% | -26.23% | 0.89% | -13.76% | 0.43% |
| 过去五年       | 40.71%  | 1.37% | 17.08%  | 0.97% | 23.63%  | 0.40% |
| 自基金合同生效起至今 | 125.28% | 1.40% | 25.33%  | 1.11% | 99.95%  | 0.29% |

注：1、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深 300 指数收益率，债券投资部分的业绩比较基准选择上证国债指数收益率，复合业绩比较基准为 80%×沪深 300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率。

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

新华钻石品质企业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  
(2010 年 2 月 3 日至 2023 年 12 月 31 日)



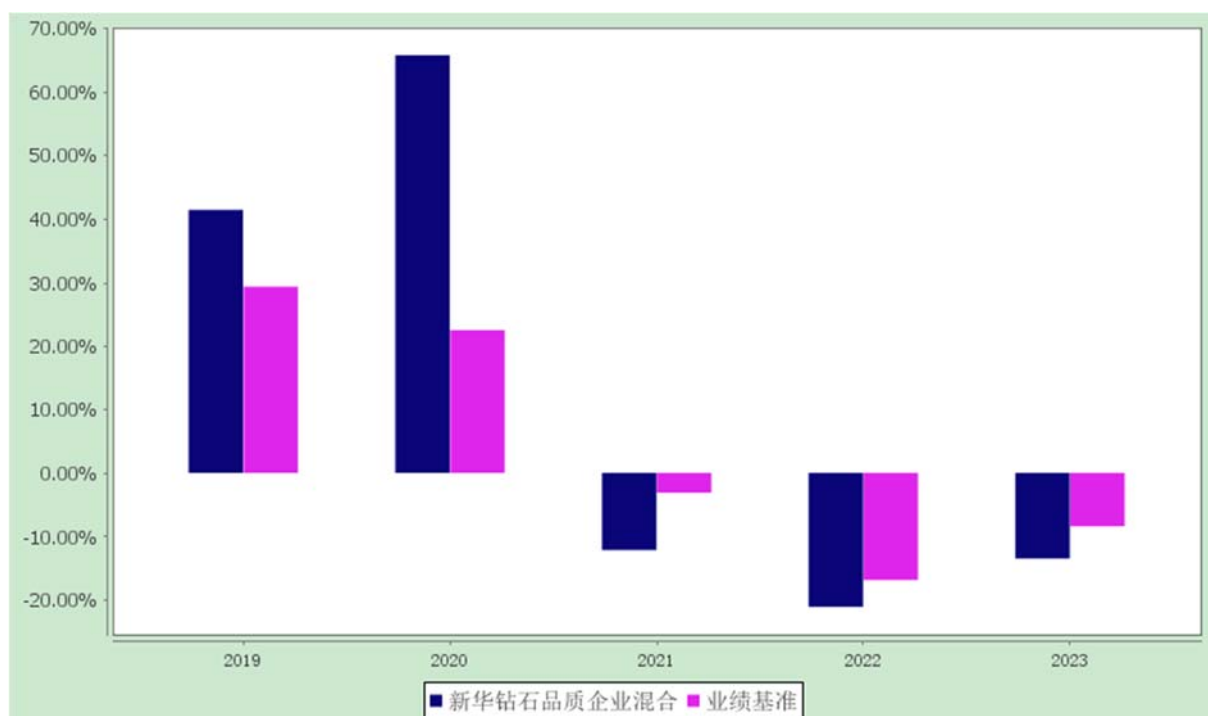
注：本基金于 2010 年 2 月 3 日基金合同生效，报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

### 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

新华钻石品质企业混合型证券投资基金



过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金无利润分配。

## §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基金中基金、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（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                    |
|-----|---|-----------------|------|--------|---------------------------------------|
|     |   | 任职日期            | 离任日期 |        |                                       |
| 蔡春红 | 本基金基金经理，新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、新华优选消费混合型证券投资基金基金经理。 | 2017-01-06      | -    | 13     | 国际金融硕士，历任新华基金管理股份有限公司研究部行业研究员，基金经理助理。 |

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钻石品质企业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》、《新华钻石品质企业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 年开年，市场进入疫后强复苏状态，整体走势佳。但一季度后，国内经济恢复持续低预期，一方面是地产市场的大幅回落，出口和消费均不佳，ppi 和 cpi 转负；另一方面，海外通胀高企，利率不断攀升，带来市场信心不足，外资持续了流出，市场出现较大调整。全年来看，除红利资产以及微盘股指数获得超额收益外，基金重仓个股跌幅较大。在此状况下，政府出台了多项稳增长的举措，对房地产实施“因城施策”，放开不合理限制，加大城中村改造力度等刺激需求政策。报告期内，本基金保持中高仓位，考虑到宏观环境以及产品定位，在个股选择以及行业配置上，重点布局低估值高分红以及受经济波动影响较小的行业和个股。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 2.2528 元，本报告期份额净值增长率为-13.48%，同期比较基准的增长率为-8.40%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入 2024 年，1 月份市场出现了较大调整，触发流动性风险，市场信心羸弱。但我们认为 2024 年中央经济会议定调偏积极，对可能的风险都有认识和防范。风险防范化解是 2024 年重点工作，房地产领域融资端支持力度或加大，“三大工程”托底投资；地方债务统筹好地方债务风险化解和稳定发展，这些稳增长和防风险措施，有助于风险偏好的回升。

当下市场预期较低，其风险在前期下跌中释放较为充分，市场或将迎来转折。因此，当前时点对国内经济以及消费没有必要过度悲观。估值层面看，市场已经跌至历史较低位置。弱势环境下，我们将踏实做好深度研究工作，重点关注未来需求回暖的优质龙头公司。

## 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，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元的情况。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 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

本托管人复核审查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。

### §6 审计报告

致同审字（2024）第 110A006058 号

新华钻石品质企业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钻石品质企业混合型证券投资基金（以下简称“新华钻石品质企业混合基金”）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，公允反映了新华钻石品质企业混合基金 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，我们独立于新华钻石品质企业混合基金，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

新华钻石品质企业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”）对其其他信息负责。其他信息包括新华钻石品质企业混合基金 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钻石品质企业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钻石品质企业混合基金、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钻石品质企业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，就可能导致对新华钻石品质企业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钻石品质企业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：新华钻石品质企业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<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产：         |         | -                       | -                        |
| 货币资金        | 7.4.7.1 | 12,883,932.16           | 8,163,337.11             |
| 结算备付金       |         | 316,368.52              | 362,204.03               |
| 存出保证金       |         | 42,275.34               | 50,456.72                |
| 交易性金融资产     | 7.4.7.2 | 94,586,529.10           | 126,684,544.36           |
| 其中：股票投资     |         | 94,586,529.10           | 126,684,544.36           |
| 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      |         | -                       | -                        |
| 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       |         | 17,003.02               | 3,862.57                 |
| 递延所得税资产     |         | -                       | -                        |
| 其他资产        | 7.4.7.8 | -                       | -                        |
| <b>资产总计</b> |         | <b>107,846,108.14</b>   | <b>135,264,404.79</b>    |
| 负债和净资产      | 附注号     | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>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           |          | 1,298,696.59          | -                     |
| 应付赎回款           |          | 26,519.43             | 6,987.12              |
| 应付管理人报酬         |          | 111,035.89            | 170,455.19            |
| 应付托管费           |          | 18,505.97             | 28,409.19             |
| 应付销售服务费         |          | -                     | -                     |
| 应付投资顾问费         |          | -                     | -                     |
| 应交税费            |          | -                     | -                     |
| 应付利润            |          | -                     | -                     |
| 递延所得税负债         |          | -                     | -                     |
| 其他负债            | 7.4.7.9  | 1,038,241.89          | 1,031,477.24          |
| <b>负债合计</b>     |          | <b>2,492,999.77</b>   | <b>1,237,328.74</b>   |
| <b>净资产：</b>     |          | -                     | -                     |
| 实收基金            | 7.4.7.10 | 46,765,985.88         | 51,476,539.21         |
| 其他综合收益          |          | -                     | -                     |
| 未分配利润           | 7.4.7.11 | 58,587,122.49         | 82,550,536.84         |
| <b>净资产合计</b>    |          | <b>105,353,108.37</b> | <b>134,027,076.05</b> |
| <b>负债和净资产总计</b> |          | <b>107,846,108.14</b> | <b>135,264,404.79</b> |

注：报告截至 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.2528 元，基金份额总额 46,765,985.88 份。

## 7.2 利润表

会计主体：新华钻石品质企业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<br>2023 年 12 月 31 日 | 2022 年 1 月 1 日至<br>2022 年 12 月 31 日 |
|    |     |                                     |                                     |

|                          |          |                       |                       |
|--------------------------|----------|-----------------------|-----------------------|
| <b>一、营业总收入</b>           |          | <b>-15,005,706.68</b> | <b>-34,198,996.35</b> |
| 1.利息收入                   |          | 45,679.44             | 49,954.10             |
| 其中：存款利息收入                | 7.4.7.12 | 45,679.44             | 49,954.10             |
| 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）         |          | 1,832,468.15          | -33,274,747.85        |
| 其中：股票投资收益                | 7.4.7.13 | -21,608.62            | -34,866,966.57        |
| 基金投资收益                   |          | -                     | -                     |
| 债券投资收益                   | 7.4.7.15 | -                     | 20,350.21             |
| 资产支持证券投资收益               |          | -                     | -                     |
| 贵金属投资收益                  |          | -                     | -                     |
| 衍生工具收益                   |          | -                     | -                     |
| 股利收益                     | 7.4.7.19 | 1,854,076.77          | 1,571,868.51          |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）    | 7.4.7.20 | -16,889,788.16        | -981,027.04           |
| 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 | 5,933.89              | 6,824.44              |
| <b>减：二、营业总支出</b>         |          | <b>2,326,299.18</b>   | <b>2,641,280.40</b>   |
| 1. 管理人报酬                 |          | 1,806,432.12          | 2,076,484.60          |
| 其中：暂估管理人报酬（若有）           |          | -                     | -                     |
| 2. 托管费                   |          | 301,072.06            | 346,080.77            |
| 3. 销售服务费                 |          | -                     | -                     |
| 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. 税金及附加                 |          | -                     | 0.03                  |
| 8. 其他费用                  | 7.4.7.24 | 218,795.00            | 218,715.00            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填</b> |          | <b>-17,332,005.86</b> | <b>-36,840,276.75</b> |

|                          |  |                       |                       |
|--------------------------|--|-----------------------|-----------------------|
| 列)                       |  |                       |                       |
| 减：所得税费用                  |  | -                     | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b> |  | <b>-17,332,005.86</b> | <b>-36,840,276.75</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>     |  | <b>-</b>              | <b>-</b>              |
| <b>六、综合收益总额</b>          |  | <b>-17,332,005.86</b> | <b>-36,840,276.75</b> |

### 7.3 净资产变动表

会计主体：新华钻石品质企业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<br>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                                | 51,476,539.21                          | 82,550,536.84  | 134,027,076.05 |
| 二、本期期初净资产                                | 51,476,539.21                          | 82,550,536.84  | 134,027,076.05 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -4,710,553.33                          | -23,963,414.35 | -28,673,967.68 |
| （一）、综合收益总额                               | -                                      | -17,332,005.86 | -17,332,005.86 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -4,710,553.33                          | -6,631,408.49  | -11,341,961.82 |
| 其中：1.基金申购款                               | 2,189,716.46                           | 3,623,298.13   | 5,813,014.59   |
| 2.基金赎回款                                  | -6,900,269.79                          | -10,254,706.62 | -17,154,976.41 |
| （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                                | 46,765,985.88                          | 58,587,122.49  | 105,353,108.37 |
| 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                                | 53,056,139.93                    | 121,966,109.24 | 175,022,249.17 |
| 二、本期期初净资产                                | 53,056,139.93                    | 121,966,109.24 | 175,022,249.17 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -1,579,600.72                    | -39,415,572.40 | -40,995,173.12 |
| （一）、综合收益总额                               | -                                | -36,840,276.75 | -36,840,276.75 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -1,579,600.72                    | -2,575,295.65  | -4,154,896.37  |
| 其中：1.基金申购款                               | 2,899,371.60                     | 4,802,604.29   | 7,701,975.89   |
| 2.基金赎回款                                  | -4,478,972.32                    | -7,377,899.94  | -11,856,872.26 |
| （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                                | 51,476,539.21                    | 82,550,536.84  | 134,027,076.05 |

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

新华钻石品质企业混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]第 1220 号《关于核准新华钻石品质企业混合型证券投资基金募集的批复》核准，由新华基金管理股份有限公司于 2010 年 1 月 4 日至 1 月 29 日向社会公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，设立募集期间募集及利息结转的基金份额共 1,937,798,339.14 份，其中募集净认购资金金额 1,936,938,537.27 元，募集资金产生利息 859,801.87 元，并经国富浩华

会计师事务所浩华验字【2010】第 8 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金合同》于 2010 年 2 月 3 日正式生效,本基金的基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《新华钻石品质企业混合型证券投资基金招募说明书》及《新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于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(含存托凭证)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金股票(含存托凭证)资产投资比例为基金资产的 60%—95%,其中投资于具有钻石品质上市公司的股票市值不低于股票投资的 80%。债券、现金类资产及权证、资产支持证券的投资比例为基金资产的 5%—40%,其中,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%,权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为:80%×沪深 300 指数+20%×上证国债指数。

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》、《新华钻石品质企业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、资产支持证券投资，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或资产支持证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、债券投资、资产支持证券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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券投资和资产支持证券投资发行企业代扣

代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值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

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              | 上年度末             |
|----------------|------------------|------------------|
|                | 2023 年 12 月 31 日 | 2022 年 12 月 31 日 |
| 活期存款           | 12,883,932.16    | 8,163,337.11     |
| 等于：本金          | 12,882,408.84    | 8,162,518.92     |
| 加：应计利息         | 1,523.32         | 818.19           |
| 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             | 12,883,932.16    | 8,163,337.11     |

##### 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 | 103,701,981.40   | -    | 94,586,529.10 | -9,115,452.30 |

|               |       |                  |      |                |               |
|---------------|-------|------------------|------|----------------|---------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                | -    | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场 | -                | -    | -              | -             |
|               | 银行间市场 | -                | -    | -              | -             |
|               | 合计    | -                | -    | -              | -             |
| 资产支持证券        |       | -                | -    | -              | -             |
| 基金            |       | -                | -    | -              | -             |
| 其他            |       | -                | -    | -              | -             |
| 合计            |       | 103,701,981.40   | -    | 94,586,529.10  | -9,115,452.30 |
| 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            |       | 118,910,208.50   | -    | 126,684,544.36 | 7,774,335.86  |
| 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            |       | 118,910,208.50   | -    | 126,684,544.36 | 7,774,335.86  |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末，本基金均无衍生金融资产/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

本报告期末及上年度末，本基金未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金未持有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，本基金未持有债权投资。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他债权投资。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他权益投资。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他权益工具投资。

#### 7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | 4.66                    | 9.91                     |
| 应付证券出借违约金   | -                       | -                        |
| 应付交易费用      | 833,737.23              | 826,967.33               |
| 其中：交易所市场    | 833,737.23              | 826,967.33               |
| 银行间市场       | -                       | -                        |
| 应付利息        | -                       | -                        |
| 应付审计费       | 80,000.00               | 80,000.00                |
| 应付证券日报      | 120,000.00              | 120,000.00               |
| 应付账户维护费     | 4,500.00                | 4,500.00                 |
| 合计          | 1,038,241.89            | 1,031,477.24             |



## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|--|---------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额          |
| 上年度末          | 51,476,539.21                          | 51,476,539.21 |
| 本期申购          | 2,189,716.46                           | 2,189,716.46  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -6,900,269.79                          | -6,900,269.79 |
| 本期末           | 46,765,985.88                          | 46,765,985.88 |

## 7.4.7.11 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | 120,053,404.22 | -37,502,867.38 | 82,550,536.84  |
| 本期期初           | 120,053,404.22 | -37,502,867.38 | 82,550,536.84  |
| 本期利润           | -442,217.70    | -16,889,788.16 | -17,332,005.86 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -11,200,944.58 | 4,569,536.09   | -6,631,408.49  |
| 其中：基金申购款       | 5,336,752.09   | -1,713,453.96  | 3,623,298.13   |
| 基金赎回款          | -16,537,696.67 | 6,282,990.05   | -10,254,706.62 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 108,410,241.94 | -49,823,119.45 | 58,587,122.49  |

## 7.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月<br>31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12<br>月 31 日 |
|----------|---|--|
|          | 活期存款利息收入                                  | 40,367.72                                      |
| 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 | 5,311.72  | 7,646.17  |
| 其他        | -         | -         |
| 合计        | 45,679.44 | 49,954.10 |

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息。

#### 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 |
| 卖出股票成交总额   | 465,718,844.39        | 539,398,246.03        |
| 减：卖出股票成本总额 | 464,565,677.25        | 572,776,886.84        |
| 减：交易费用     | 1,174,775.76          | 1,488,325.76          |
| 买卖股票差价收入   | -21,608.62            | -34,866,966.57        |

#### 7.4.7.14 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

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 |
| 债券投资收益——利息收入                 | -                     | 8.74                  |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -                     | 20,341.47             |
| 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                           | -                     | 20,350.21             |

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                    | 上年度可比期间               |
|------------------------|-----------------------|-----------------------|
|                        | 2023年1月1日至2023年12月31日 | 2022年1月1日至2022年12月31日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | -                     | 99,354.45             |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | -                     | 79,000.00             |
| 减：应计利息总额               | -                     | 9.00                  |
| 减：交易费用                 | -                     | 3.98                  |
| 买卖债券差价收入               | -                     | 20,341.47             |

#### 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。

#### 7.4.7.17 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。

#### 7.4.7.18 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。

#### 7.4.7.19 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 | 1,854,076.77          | 1,571,868.51          |
| 基金投资产生的股利收益 | -                     | -                     |
| 合计          | 1,854,076.77          | 1,571,868.51          |

#### 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 | -16,889,788.16        | -981,027.04           |

|                        |                |             |
|------------------------|----------------|-------------|
| ——股票投资                 | -16,889,788.16 | -981,027.04 |
| ——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                     | -16,889,788.16 | -981,027.04 |

#### 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 | 5,809.84              | 6,793.06              |
| 补差费收入   | 124.05                | 31.38                 |
| 合计      | 5,933.89              | 6,824.44              |

#### 7.4.7.22 持有基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间无持有基金产生的费用。

#### 7.4.7.23 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 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31日 | 2022年1月1日至2022年12月31日 |
| 审计费用 | 80,000.00             | 80,000.00             |

|         |            |            |
|---------|------------|------------|
| 信息披露费   | -          | -          |
| 证券出借违约金 | -          | -          |
| 银行汇划费   | 795.00     | 715.00     |
| 账户维护费   | 18,000.00  | 18,000.00  |
| 证券日报    | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 合计      | 218,795.00 | 218,715.00 |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金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       |
|-----------------|---------------|
| 新华基金管理股份有限公司    | 基金管理人、基金发起人   |
| 中国建设银行股份有限公司    | 基金托管人         |
| 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       |
| 中央汇金投资有限责任公司    | 基金托管人股东       |
| 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<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间<br>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 | 208,547,226.82 | 22.85%       | 66,059,971.17 | 6.14%        |

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间,本基金均无通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

本报告期及上年度可比期间,本基金均无通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间,本基金无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<br>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 | 152,512.05                       | 21.16%     | -         | -            |
| 关联方名称      | 上年度可比期间<br>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 | 48,310.48                        | 5.81%      | 46,712.29 | 5.65%        |

注：1、上述佣金按合同约定的佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

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。

#### 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<br>2023年1月1日至2023年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12<br>月31日 |
|------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 1,806,432.12                    | 2,076,484.60                         |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 807,369.62                      | 929,105.90                           |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 999,062.50                      | 1,147,378.70                         |

注：1、2023年1月1日至2023年8月20日基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率逐日计提确认。计算公式为：

$$\text{每日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times (1.5\% \div \text{当年天数})$$

自2023年8月21日起本基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.2%的年费率逐日计提确认。计算公式为：

$$\text{每日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times (1.2\% \div \text{当年天数})$$

2、客户维护费是指基金管理人与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<br>2023年1月1日至2023年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12<br>月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 301,072.06                      | 346,080.77                           |

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%的年费率逐日计提确认。其计算公式为：日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

自 2023 年 8 月 21 日起本基金托管费按前一日的基金资产净值 0.2% 的年费率逐日计提确认。其计算公式为:日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.2%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

本报告期及上年度可比期间, 本基金未发生销售服务费。

#### 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, 本基金未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

报告期内, 基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

##### 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

本报告期末及上年度末, 除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.5 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                    |           | 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 |           |
|              | 期末余额                  | 当期利息收入    | 期末余额                  | 当期利息收入    |
| 中国建设银行股份有限公司 | 12,883,932.16         | 40,367.72 | 8,163,337.11          | 42,307.93 |

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管, 按银行同业利率计息。

#### 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

本报告期及上年度可比期间, 本基金无其他关联交易事项。

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



本报告期及上年度可比期间，本基金无当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无收益分配事项。

#### 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 |
| 301526               | 国际复材 | 2023-12-19 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 2.66  | 4.45   | 1,812.00 | 4,819.92 | 8,063.40 | -  |
| 301566               | 达利凯普 | 2023-12-22 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 8.90  | 22.14  | 308.00   | 2,741.20 | 6,819.12 | -  |
| 301516               | 中远通  | 2023-12-01 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 6.87  | 15.51  | 388.00   | 2,665.56 | 6,017.88 | -  |
| 301499               | 维科精密 | 2023-07-13 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 19.50 | 28.93  | 193.00   | 3,763.50 | 5,583.49 | -  |
| 688582               | 芯动联科 | 2023-06-21 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 26.74 | 38.67  | 137.00   | 3,663.38 | 5,297.79 | -  |
| 301413               | 安培龙  | 2023-12-11 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 33.25 | 58.19  | 87.00    | 2,892.75 | 5,062.53 | -  |
| 301498               | 乖宝宠物 | 2023-08-09 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 39.99 | 38.81  | 107.00   | 4,278.93 | 4,152.67 | -  |
| 301505               | 苏州规划 | 2023-07-12 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 26.35 | 35.81  | 110.00   | 2,898.50 | 3,939.10 | -  |
| 30145                | 丰茂   | 2023-1     | 1-6个     | 新股     | 31.90 | 39.84  | 96.00    | 3,062.   | 3,824.   | -  |

|        |      |            |          |        |       |       |        |          |          |   |
|--------|------|------------|----------|--------|-------|-------|--------|----------|----------|---|
| 9      | 股份   | 2-06       | 月(含)     | 锁定期内   |       |       |        | 40       | 64       |   |
| 301469 | 恒达新材 | 2023-08-10 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 36.58 | 33.09 | 114.00 | 4,170.12 | 3,772.26 | - |
| 301468 | 博盈特焊 | 2023-07-12 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 47.58 | 30.22 | 120.00 | 5,709.60 | 3,626.40 | - |
| 301528 | 多浦乐  | 2023-08-17 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 71.80 | 68.91 | 50.00  | 3,590.00 | 3,445.50 | - |
| 301418 | 协昌科技 | 2023-08-10 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 51.88 | 50.20 | 66.00  | 3,424.08 | 3,313.20 | - |
| 301515 | 港通医疗 | 2023-07-13 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 31.16 | 28.27 | 100.00 | 3,116.00 | 2,827.00 | - |
| 301371 | 敷尔佳  | 2023-07-24 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 55.68 | 37.58 | 64.00  | 3,563.52 | 2,405.12 | - |
| 001239 | 永达股份 | 2023-12-04 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 12.05 | 19.92 | 111.00 | 1,337.55 | 2,211.12 | - |
| 001358 | 兴欣新材 | 2023-12-14 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 41.00 | 44.16 | 34.00  | 1,394.00 | 1,501.44 | - |

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末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

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 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<br>2023 年 12 月 31<br>日 | 1 年以内         | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息           | 合计            |
|----------------------------|---------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 资产                         |               |       |       |               |               |
| 货币资金                       | 12,883,932.16 | -     | -     | -             | 12,883,932.16 |
| 结算备付金                      | 316,368.52    | -     | -     | -             | 316,368.52    |
| 存出保证金                      | 42,275.34     | -     | -     | -             | 42,275.34     |
| 交易性金融资产                    | 0.00          | 0.00  | 0.00  | 94,586,529.10 | 94,586,529.10 |
| 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                    | -             | -     | -     | 17,003.02      | 17,003.02      |
| 递延所得税资产                  | -             | -     | -     | 0.00           | 0.00           |
| 其他资产                     | -             | -     | -     | 0.00           | 0.00           |
| 资产总计                     | 13,242,576.02 | 0.00  | 0.00  | 94,603,532.12  | 107,846,108.14 |
| 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                    | -             | -     | -     | 1,298,696.59   | 1,298,696.59   |
| 应付赎回款                    | -             | -     | -     | 26,519.43      | 26,519.43      |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 111,035.89     | 111,035.89     |
| 应付托管费                    | -             | -     | -     | 18,505.97      | 18,505.97      |
| 应付销售服务费                  | -             | -     | -     | 0.00           | 0.00           |
| 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                     | -             | -     | -     | 1,038,241.89   | 1,038,241.89   |
| 负债总计                     | 0.00          | 0.00  | 0.00  | 2,492,999.77   | 2,492,999.77   |
| 利率敏感度缺口                  | 13,242,576.02 | 0.00  | 0.00  | 92,110,532.35  | 105,353,108.37 |
| 上年度末<br>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                     | 8,163,337.11  | -     | -     | -              | 8,163,337.11   |
| 结算备付金                    | 362,204.03    | -     | -     | -              | 362,204.03     |
| 存出保证金                    | 50,456.72     | -     | -     | -              | 50,456.72      |
| 交易性金融资产                  | 0.00          | 0.00  | 0.00  | 126,684,544.36 | 126,684,544.36 |

|           |              |      |      |                |                |
|-----------|--------------|------|------|----------------|----------------|
|           |              |      |      |                | 6              |
| 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     | -            | -    | -    | 3,862.57       | 3,862.57       |
| 递延所得税资产   | -            | -    | -    | 0.00           | 0.00           |
| 其他资产      | -            | -    | -    | 0.00           | 0.00           |
| 资产总计      | 8,575,997.86 | 0.00 | 0.00 | 126,688,406.93 | 135,264,404.79 |
| 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   | -            | -    | -    | 0.00           | 0.00           |
| 应付赎回款     | -            | -    | -    | 6,987.12       | 6,987.12       |
| 应付管理人报酬   | -            | -    | -    | 170,455.19     | 170,455.19     |
| 应付托管费     | -            | -    | -    | 28,409.19      | 28,409.19      |
| 应付销售服务费   | -            | -    | -    | 0.00           | 0.00           |
| 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      | -            | -    | -    | 1,031,477.24   | 1,031,477.24   |
| 负债总计      | 0.00         | 0.00 | 0.00 | 1,237,328.74   | 1,237,328.74   |
| 利率敏感度缺口   | 8,575,997.86 | 0.00 | 0.00 | 125,451,078.19 | 134,027,076.05 |

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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<br>2023 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |                          |
|---------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
|               | 公允价值                    | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 94,586,529.10           | 89.78                    | 126,684,544.36           | 94.52                    |
| 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            | 94,586,529.10           | 89.78                    | 126,684,544.36           | 94.52                    |

##### 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 指数上升或下降 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<br>影响金额（单位：人民币元）                                   |
|     |                            | <table border="1"> <tr> <td>本期末</td> <td>上年度末</td> </tr> </table> |
| 本期末 | 上年度末                       |   |

|                | 2023 年 12 月 31 日 | 2022 年 12 月 31 日 |
|----------------|------------------|------------------|
| 沪深 300 指数上升 1% | 增加约 1,044,772.75 | 增加约 1,454,599.93 |
| 沪深 300 指数下降 1% | 减少约 1,044,772.75 | 减少约 1,454,599.93 |

#### 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<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 94,514,666.44           | 125,985,549.43           |
| 第二层次          | -                       | -                        |
| 第三层次          | 71,862.66               | 698,994.93               |
| 合计            | 94,586,529.10           | 126,684,544.36           |

###### 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<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |      | 合计 |
|----|--|------|----|
|    | 交易性金融资产                                |      |    |
|    | 债券投资                                   | 股票投资 |    |
|    |  |      |    |



|  |                                  |              |              |
|--|----------------------------------|--------------|--------------|
| 期初余额   | -                                | 698,994.93   | 698,994.93   |
| 当期购买   | -                                | -            | -            |
| 当期出售<br>/结算  | -                                | -            | -            |
| 转入第三<br>层次   | -                                | 217,021.96   | 217,021.96   |
| 转出第三<br>层次   | -                                | 1,135,425.84 | 1,135,425.84 |
| 当期利得<br>或损失总<br>额  | -                                | 291,271.61   | 291,271.61   |
| 其中：计<br>入损益的<br>利得或损<br>失  | -                                | 291,271.61   | 291,271.61   |
| 计<br>入其他综<br>合收益的<br>利得或损<br>失（若有）   | -                                | -            | -            |
| 期末余额   | -                                | 71,862.66    | 71,862.66    |
| 期末仍持<br>有的第三<br>层次金融<br>资产计入<br>本期损益<br>的未实现<br>利得或损<br>失的变动<br>——公允<br>价值变动<br>损益 | -                                | 14,771.65    | 14,771.65    |
| 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   | -                                | 2,596,491.02 | 2,596,491.02 |
| 当期购买   | -                                | -            | -            |
| 当期出售<br>/结算  | -                                | -            | -            |
| 转入第三<br>层次   | -                                | 811,380.95   | 811,380.95   |
| 转出第三<br>层次   | -                                | 2,813,956.94 | 2,813,956.94 |

|  |   |            |            |
|--|---|------------|------------|
| 当期利得或损失总额                                  | - | 105,079.90 | 105,079.90 |
| 其中：计入损益的利得或损失                              | - | 105,079.90 | 105,079.90 |
| 计入其他综合收益的利得或损失（若有）                         | - | -          | -          |
| 期末余额                                       | - | 698,994.93 | 698,994.93 |
| 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 | - | 117,106.18 | 117,106.18 |

## 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 |
| 交易所上市尚在限售期内股票 | 71,862.66  | 平均价格亚式期权模型 | 预期波动率   | 0.1463-2.1752 | 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 | 698,994.93 | 平均价格亚式期权模型 | 预期波动率   | 0.2601-1.1135 | 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              | 94,586,529.10  | 87.71         |
|    | 其中：股票             | 94,586,529.10  | 87.71         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | -              | -             |
|    | 其中：债券             | -              | -             |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -              | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 13,200,300.68  | 12.24         |
| 8  | 其他各项资产            | 59,278.36      | 0.05          |
| 9  | 合计                | 107,846,108.14 | 100.00        |

### 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      | -    | -             |

|   |                  |               |       |
|---|------------------|---------------|-------|
| C | 制造业              | 82,962,380.00 | 78.75 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -     |
| E | 建筑业              | -             | -     |
| F | 批发和零售业           | 3,877,800.00  | 3.68  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -     |
| H | 住宿和餐饮业           | 3,887,000.00  | 3.69  |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 396,260.00    | 0.38  |
| J | 金融业              | -             | -     |
| K | 房地产业             | -             | -     |
| L | 租赁和商务服务业         | 1,104,800.00  | 1.05  |
| M | 科学研究和技术服务业       | 2,358,289.10  | 2.24  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -     |
| P | 教育               | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作          | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -             | -     |
| S | 综合               | -             | -     |
|   | 合计               | 94,586,529.10 | 89.78 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 603057 | 紫燕食品 | 350,984 | 7,574,234.72 | 7.19         |
| 2  | 300760 | 迈瑞医疗 | 23,000  | 6,683,800.00 | 6.34         |
| 3  | 000333 | 美的集团 | 120,000 | 6,555,600.00 | 6.22         |
| 4  | 000521 | 长虹美菱 | 800,000 | 4,504,000.00 | 4.28         |
| 5  | 000729 | 燕京啤酒 | 500,000 | 4,315,000.00 | 4.10         |
| 6  | 000860 | 顺鑫农业 | 200,000 | 4,258,000.00 | 4.04         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 7  | 603027 | 千禾味业 | 254,998 | 4,123,317.66 | 3.91 |
| 8  | 600559 | 老白干酒 | 180,000 | 4,059,000.00 | 3.85 |
| 9  | 600754 | 锦江酒店 | 130,000 | 3,887,000.00 | 3.69 |
| 10 | 603195 | 公牛集团 | 38,000  | 3,634,700.00 | 3.45 |
| 11 | 600779 | 水井坊  | 50,000  | 2,938,500.00 | 2.79 |
| 12 | 000568 | 泸州老窖 | 13,000  | 2,332,460.00 | 2.21 |
| 13 | 688382 | 益方生物 | 140,000 | 2,119,600.00 | 2.01 |
| 14 | 688235 | 百济神州 | 15,000  | 2,085,600.00 | 1.98 |
| 15 | 002727 | 一心堂  | 90,000  | 2,084,400.00 | 1.98 |
| 16 | 002008 | 大族激光 | 100,000 | 2,072,000.00 | 1.97 |
| 17 | 000799 | 酒鬼酒  | 28,000  | 2,048,200.00 | 1.94 |
| 18 | 001308 | 康冠科技 | 72,997  | 2,042,456.06 | 1.94 |
| 19 | 001215 | 千味央厨 | 37,000  | 1,953,970.00 | 1.85 |
| 20 | 300207 | 欣旺达  | 130,000 | 1,918,800.00 | 1.82 |
| 21 | 300203 | 聚光科技 | 120,000 | 1,902,000.00 | 1.81 |
| 22 | 300997 | 欢乐家  | 130,000 | 1,816,100.00 | 1.72 |
| 23 | 603883 | 老百姓  | 60,000  | 1,793,400.00 | 1.70 |
| 24 | 600519 | 贵州茅台 | 1,000   | 1,726,000.00 | 1.64 |
| 25 | 301096 | 百诚医药 | 25,000  | 1,627,500.00 | 1.54 |
| 26 | 000739 | 普洛药业 | 100,000 | 1,539,000.00 | 1.46 |
| 27 | 603081 | 大丰实业 | 100,000 | 1,362,000.00 | 1.29 |
| 28 | 600276 | 恒瑞医药 | 30,000  | 1,356,900.00 | 1.29 |
| 29 | 002223 | 鱼跃医疗 | 35,000  | 1,210,300.00 | 1.15 |
| 30 | 300662 | 科锐国际 | 40,000  | 1,104,800.00 | 1.05 |
| 31 | 300181 | 佐力药业 | 100,000 | 1,066,000.00 | 1.01 |
| 32 | 688331 | 荣昌生物 | 16,000  | 992,960.00   | 0.94 |
| 33 | 000938 | 紫光股份 | 50,000  | 967,500.00   | 0.92 |
| 34 | 002046 | 国机精工 | 70,000  | 808,500.00   | 0.77 |
| 35 | 603707 | 健友股份 | 50,000  | 750,000.00   | 0.71 |
| 36 | 603919 | 金徽酒  | 30,000  | 738,600.00   | 0.70 |
| 37 | 301307 | 美利信  | 20,000  | 693,800.00   | 0.66 |
| 38 | 301257 | 普蕊斯  | 10,000  | 635,000.00   | 0.60 |
| 39 | 300337 | 银邦股份 | 50,000  | 404,500.00   | 0.38 |
| 40 | 002846 | 英联股份 | 30,000  | 328,500.00   | 0.31 |
| 41 | 688111 | 金山办公 | 1,000   | 316,200.00   | 0.30 |
| 42 | 300416 | 苏试试验 | 5,000   | 91,850.00    | 0.09 |
| 43 | 300496 | 中科创达 | 1,000   | 80,060.00    | 0.08 |
| 44 | 688249 | 晶合集成 | 728     | 12,558.00    | 0.01 |
| 45 | 301526 | 国际复材 | 1,812   | 8,063.40     | 0.01 |
| 46 | 301566 | 达利凯普 | 308     | 6,819.12     | 0.01 |
| 47 | 301516 | 中远通  | 388     | 6,017.88     | 0.01 |
| 48 | 301499 | 维科精密 | 193     | 5,583.49     | 0.01 |
| 49 | 688582 | 芯动联科 | 137     | 5,297.79     | 0.01 |
| 50 | 301413 | 安培龙  | 87      | 5,062.53     | 0.00 |

|    |        |      |     |          |      |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 51 | 301498 | 乖宝宠物 | 107 | 4,152.67 | 0.00 |
| 52 | 301505 | 苏州规划 | 110 | 3,939.10 | 0.00 |
| 53 | 301459 | 丰茂股份 | 96  | 3,824.64 | 0.00 |
| 54 | 301469 | 恒达新材 | 114 | 3,772.26 | 0.00 |
| 55 | 301468 | 博盈特焊 | 120 | 3,626.40 | 0.00 |
| 56 | 301528 | 多浦乐  | 50  | 3,445.50 | 0.00 |
| 57 | 301418 | 协昌科技 | 66  | 3,313.20 | 0.00 |
| 58 | 301515 | 港通医疗 | 100 | 2,827.00 | 0.00 |
| 59 | 301371 | 敷尔佳  | 64  | 2,405.12 | 0.00 |
| 60 | 001239 | 永达股份 | 111 | 2,211.12 | 0.00 |
| 61 | 001358 | 兴欣新材 | 34  | 1,501.44 | 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  | 601318 | 中国平安 | 8,670,670.35 | 6.47            |
| 2  | 300760 | 迈瑞医疗 | 8,585,667.00 | 6.41            |
| 3  | 000860 | 顺鑫农业 | 8,220,794.00 | 6.13            |
| 4  | 688073 | 毕得医药 | 8,039,131.44 | 6.00            |
| 5  | 000651 | 格力电器 | 7,627,138.32 | 5.69            |
| 6  | 000333 | 美的集团 | 7,336,405.00 | 5.47            |
| 7  | 603027 | 千禾味业 | 7,175,495.32 | 5.35            |
| 8  | 000729 | 燕京啤酒 | 6,548,865.00 | 4.89            |
| 9  | 000521 | 长虹美菱 | 6,170,031.00 | 4.60            |
| 10 | 300347 | 泰格医药 | 5,907,036.56 | 4.41            |
| 11 | 600600 | 青岛啤酒 | 5,610,113.00 | 4.19            |
| 12 | 000596 | 古井贡酒 | 5,405,691.00 | 4.03            |
| 13 | 000785 | 居然之家 | 5,241,436.00 | 3.91            |
| 14 | 688176 | 亚虹医药 | 5,140,972.67 | 3.84            |
| 15 | 600559 | 老白干酒 | 5,094,152.00 | 3.80            |
| 16 | 688382 | 益方生物 | 4,995,339.53 | 3.73            |
| 17 | 688331 | 荣昌生物 | 4,914,003.17 | 3.67            |
| 18 | 002043 | 兔宝宝  | 4,821,052.00 | 3.60            |
| 19 | 603195 | 公牛集团 | 4,769,332.00 | 3.56            |
| 20 | 603057 | 紫燕食品 | 4,746,828.36 | 3.54            |
| 21 | 002646 | 天佑德酒 | 4,665,907.00 | 3.48            |
| 22 | 600779 | 水井坊  | 4,639,471.97 | 3.46            |
| 23 | 300203 | 聚光科技 | 4,396,222.60 | 3.28            |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 24 | 000568 | 泸州老窖 | 4,306,007.00 | 3.21 |
| 25 | 300997 | 欢乐家  | 4,287,730.00 | 3.20 |
| 26 | 600754 | 锦江酒店 | 4,237,968.00 | 3.16 |
| 27 | 688046 | 药康生物 | 3,820,853.74 | 2.85 |
| 28 | 002271 | 东方雨虹 | 3,659,179.00 | 2.73 |
| 29 | 600859 | 王府井  | 3,654,910.00 | 2.73 |
| 30 | 600276 | 恒瑞医药 | 3,606,905.20 | 2.69 |
| 31 | 301307 | 美利信  | 3,565,488.60 | 2.66 |
| 32 | 688588 | 凌志软件 | 3,466,291.71 | 2.59 |
| 33 | 002304 | 洋河股份 | 3,437,137.00 | 2.56 |
| 34 | 603208 | 江山欧派 | 3,420,929.86 | 2.55 |
| 35 | 000719 | 中原传媒 | 3,380,042.00 | 2.52 |
| 36 | 000759 | 中百集团 | 3,368,767.00 | 2.51 |
| 37 | 000625 | 长安汽车 | 3,315,375.00 | 2.47 |
| 38 | 600258 | 首旅酒店 | 3,288,639.00 | 2.45 |
| 39 | 603076 | 乐惠国际 | 3,136,986.20 | 2.34 |
| 40 | 300182 | 捷成股份 | 2,976,152.00 | 2.22 |
| 41 | 601828 | 美凯龙  | 2,838,359.00 | 2.12 |
| 42 | 600861 | 北京城乡 | 2,799,988.00 | 2.09 |
| 43 | 000799 | 酒鬼酒  | 2,765,883.00 | 2.06 |
| 44 | 600048 | 保利发展 | 2,684,978.00 | 2.00 |

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以数量)填列,不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|---------------|--------------------|
| 1  | 002304 | 洋河股份 | 10,820,166.00 | 8.07               |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 10,220,461.00 | 7.63               |
| 3  | 600600 | 青岛啤酒 | 10,155,105.20 | 7.58               |
| 4  | 000596 | 古井贡酒 | 9,557,103.33  | 7.13               |
| 5  | 600258 | 首旅酒店 | 9,129,438.01  | 6.81               |
| 6  | 600519 | 贵州茅台 | 9,120,112.00  | 6.80               |
| 7  | 688073 | 毕得医药 | 8,325,337.11  | 6.21               |
| 8  | 600559 | 老白干酒 | 8,016,765.00  | 5.98               |
| 9  | 000858 | 五粮液  | 7,992,171.00  | 5.96               |
| 10 | 600702 | 舍得酒业 | 7,796,550.00  | 5.82               |
| 11 | 000651 | 格力电器 | 7,451,504.00  | 5.56               |
| 12 | 000729 | 燕京啤酒 | 6,663,937.00  | 4.97               |
| 13 | 603589 | 口子窖  | 6,368,672.00  | 4.75               |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 14 | 600276 | 恒瑞医药 | 6,091,578.80 | 4.55 |
| 15 | 600197 | 伊力特  | 5,955,210.00 | 4.44 |
| 16 | 300997 | 欢乐家  | 5,836,115.78 | 4.35 |
| 17 | 600754 | 锦江酒店 | 5,361,114.60 | 4.00 |
| 18 | 688176 | 亚虹医药 | 5,238,917.69 | 3.91 |
| 19 | 300347 | 泰格医药 | 5,156,174.72 | 3.85 |
| 20 | 000625 | 长安汽车 | 5,136,080.00 | 3.83 |
| 21 | 002043 | 兔宝宝  | 5,084,372.00 | 3.79 |
| 22 | 000785 | 居然之家 | 4,741,980.99 | 3.54 |
| 23 | 601888 | 中国中免 | 4,582,474.00 | 3.42 |
| 24 | 002646 | 天佑德酒 | 4,577,794.00 | 3.42 |
| 25 | 603027 | 千禾味业 | 4,243,865.00 | 3.17 |
| 26 | 688331 | 荣昌生物 | 4,085,992.70 | 3.05 |
| 27 | 000568 | 泸州老窖 | 3,913,750.00 | 2.92 |
| 28 | 000719 | 中原传媒 | 3,641,866.54 | 2.72 |
| 29 | 688588 | 凌志软件 | 3,515,666.12 | 2.62 |
| 30 | 688382 | 益方生物 | 3,506,092.14 | 2.62 |
| 31 | 000759 | 中百集团 | 3,353,417.00 | 2.50 |
| 32 | 603076 | 乐惠国际 | 3,352,226.00 | 2.50 |
| 33 | 600859 | 王府井  | 3,305,847.00 | 2.47 |
| 34 | 603208 | 江山欧派 | 3,296,271.90 | 2.46 |
| 35 | 300558 | 贝达药业 | 3,210,674.00 | 2.40 |
| 36 | 603596 | 伯特利  | 3,159,743.00 | 2.36 |
| 37 | 301307 | 美利信  | 3,134,844.44 | 2.34 |
| 38 | 300559 | 佳发教育 | 3,100,683.10 | 2.31 |
| 39 | 300182 | 捷成股份 | 3,063,434.00 | 2.29 |
| 40 | 002271 | 东方雨虹 | 2,968,167.00 | 2.21 |
| 41 | 002174 | 游族网络 | 2,934,364.00 | 2.19 |
| 42 | 601828 | 美凯龙  | 2,925,448.20 | 2.18 |
| 43 | 002508 | 老板电器 | 2,876,325.00 | 2.15 |
| 44 | 600048 | 保利发展 | 2,835,084.47 | 2.12 |
| 45 | 605337 | 李子园  | 2,762,820.80 | 2.06 |
| 46 | 600028 | 中国石化 | 2,751,544.00 | 2.05 |
| 47 | 600861 | 北京城乡 | 2,723,129.00 | 2.03 |
| 48 | 301267 | 华夏眼科 | 2,722,045.84 | 2.03 |

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）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

|               |                |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 449,357,450.15 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 465,718,844.39 |



注：本项“买入股票的成本(成交)总额”与“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额(成交单价乘以数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### **8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

#### **8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### **8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### **8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

#### **8.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金合同尚无股指期货投资政策。

#### **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**

本基金合同尚无国债期货投资政策。

##### **8.11.2 本期国债期货投资评价**

本报告期末本基金无国债期货投资。

#### **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

(1)北京燕京啤酒股份有限公司在报告编制日前一年内曾被 顺义区交通局认为其 1 年内违法超限运输的货运车辆超过本单位货运车辆总数 10%，其行为违反了《公路安全保护条例》第六十六条的规定。根据《公路安全保护条例》第六十六条的规定。应予处罚，建议立案调查；

(2)公牛集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾被浙江省互联网信息办公室认为其相关 App 开发者应严格进行整改。

本公司对以上证券的投资决策符合法律法规及公司制度的相关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期末本基金投资的其他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 本报告期末本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

#### 8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额        |
|----|-------|-----------|
| 1  | 存出保证金 | 42,275.34 |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 17,003.02 |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | -         |
| 8  | 其他    | -         |
| 9  | 合计    | 59,278.36 |

#### 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

| 持有人户数(户) | 户均持有的<br>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<br>比例 | 持有份额          | 占总份额<br>比例 |
| 6,321    | 7,398.51      | 296,537.19 | 0.63%      | 46,469,448.69 | 99.37%     |

**9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

| 项目                   | 持有份额总数（份）  | 占基金总份额比例 |
|----------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有<br>本基金 | 462,704.52 | 0.99%    |

**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                                 | 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<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 10~50             |

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份；该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 10~50 万份。

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

|                          |                  |
|--------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2010年2月3日)基金份额总额 | 1,937,798,339.14 |
| 本报告期期初基金份额总额             | 51,476,539.21    |
| 本报告期基金总申购份额              | 2,189,716.46     |
| 减：本报告期基金总赎回份额            | 6,900,269.79     |
| 本报告期基金拆分变动份额             | -                |
| 本报告期期末基金份额总额             | 46,765,985.88    |

## §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，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起，施伟为资产托管业务部副总经理。

### 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。

本报告期未有涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期未有基金投资策略的改变。

### 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

本报告期内为本基金进行审计的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 80000 元人民币。审计年限为 1 年。自 2020 年，致同会计师事务所为本基金连续提供 4 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） | 已完成整改措施             |
| 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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<br>例 | 佣金         | 占当期佣金总量的<br>比例 |    |
| 太平洋证券 | 2      | 257,365,261.36 | 28.19%           | 190,374.37 | 26.41%         | -  |
| 恒泰证券  | 2      | 208,547,226.82 | 22.85%           | 152,512.05 | 21.16%         | -  |
| 国信证券  | 1      | 178,948,481.83 | 19.60%           | 166,653.84 | 23.12%         | -  |
| 中信建投  | 1      | 73,613,086.30  | 8.06%            | 54,430.01  | 7.55%          | -  |
| 银河证券  | 1      | 43,555,486.62  | 4.77%            | 41,184.86  | 5.71%          | -  |
| 国投证券  | 2      | 42,238,114.21  | 4.63%            | 30,888.51  | 4.28%          | -  |
| 华创证券  | 1      | 35,894,281.60  | 3.93%            | 26,641.59  | 3.70%          | -  |
| 广发证券  | 1      | 22,413,461.35  | 2.46%            | 16,717.98  | 2.32%          | -  |
| 东北证券  | 1      | 18,542,134.10  | 2.03%            | 13,831.17  | 1.92%          | -  |
| 国金证券  | 1      | 12,663,460.64  | 1.39%            | 11,848.34  | 1.64%          | -  |
| 方正证券  | 1      | 10,655,029.23  | 1.17%            | 7,947.57   | 1.10%          | -  |
| 申银万国  | 1      | 8,414,195.09   | 0.92%            | 7,835.53   | 1.09%          | -  |
| 华安证券  | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 华西证券  | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 大同证券  | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 东吴证券  | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |

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20个交易席位，其中报告期内新增0个交易席位，退租2个交易席位。退租席位为：大同证券上海席位、大同证券深圳席位。

### 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 |
| 太平洋证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 恒泰证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 国信证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中信建投  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 银河证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 国投证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 华创证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 广发证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 东北证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 国金证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 方正证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 申银万国  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 华安证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 华西证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 大同证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 东吴证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |

## 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 |
| 2  | 新华钻石品质企业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 |
| 3  | 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 |
| 4  | 新华基金管理股份有限公司关于调整直销柜台及网上直销交易优惠费率的公告           | 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 | 2023-02-15 |
| 5  | 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 |
| 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  | 新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）                | 公司网站、电子信披网站                       | 2023-03-16 |
| 8  | 新华钻石品质企业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                       | 2023-03-16 |
| 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 | 新华钻石品质企业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 |
| 13 | 新华钻石品质企业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 |
| 14 | 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 |
| 15 | 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 |
| 16 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基                          | 中国证券报、上海证券                        | 2023-06-30 |



|    |  |                                   |            |
|----|--|-----------------------------------|------------|
|    | 金参加中国人寿保险股份有限公司基金申购、定期定额投资业务费率优惠活动的公告                            | 报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站           |            |
| 17 | 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 |
| 18 | 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 |
| 19 | 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 |
| 20 | 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 |
| 21 | 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 |
| 22 | 新华钻石品质企业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 |
| 23 | 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 |
| 24 | 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 |
| 25 | 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 |
| 26 | 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 |
| 27 | 新华钻石品质企业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 |
| 28 | 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 |
| 29 | 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、电子信披网站 | 2023-09-05 |
| 30 | 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 |
| 31 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分证券投资基金参加海通证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告                  | 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    | 2023-10-21 |

|    |  | 披网站                               |            |
|----|--|-----------------------------------|------------|
| 32 | 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 |
| 33 | 新华钻石品质企业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 |
| 34 | 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 |
| 35 | 新华基金管理股份有限公司关于公司旗下部分开放式基金参加平安银行股份有限公司转换费率优惠活动的公告 | 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 | 2023-12-19 |

## 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钻石品质企业股票型证券投资基金募集的文件
- (二)关于申请募集新华钻石品质企业股票型证券投资基金之法律意见书
- (三)新华钻石品质企业混合型证券投资基金托管协议
- (四)新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金合同
- (五)新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则
- (六)更新的《新华钻石品质企业混合型证券投资基金招募说明书》
- (七)《新华钻石品质企业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)重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复
- (十一)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