

金元顺安消费主题混合型证券投资基金

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:金元顺安基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2024 年 03 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告期自2023年01月01日起至2023年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	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	8
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	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	16
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	62
8.1 期末基金资产组合情况	62
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	63
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	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
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	73
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	73
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	73
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	73

8.10	本基金投资股指期货的投资政策	74
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
8.12	投资组合报告附注	74
§9	基金份额持有人信息	77
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	78
§10	开放式基金份额变动	78
§11	重大事件揭示	78
11.1	基金份额持有人大会决议	78
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	78
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	79
11.4	基金投资策略的改变	79
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	79
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	79
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	79
11.8	其他重大事件	81
§12	影响投资者决策的其他重要信息	84
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	84
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	84
§13	备查文件目录	84
13.1	备查文件目录	84
13.2	存放地点	85
13.3	查阅方式	85

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金元顺安消费主题混合型证券投资基金
基金简称	金元顺安消费主题混合
基金主代码	620006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年09月15日
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	108,075,755.46份
基金合同存续期	不定期

注：

"金元比联宝石动力保本混合型证券投资基金"（系本基金前身）合同生效日为2007年8月15日。自2010年10月1日起，本基金转型为混合型证券投资基金。故本报告中，本基金基金合同生效日为2010年10月1日。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在正确认识中国经济发展特点的基础上，重点投资于消费拉动经济增长过程中充分受益的消费主题行业及其中的优势企业，致力于分享中国经济增长及增长方式转变带来的投资机会，力争实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	本基金系采用主题投资方法的混合型基金产品，主要投资标的是消费拉动经济增长过程中充分受益的消费主题行业及其中的优势企业，分享中国经济增长及增长方式转变带来的投资机会。本基金将通过严格的股票选择，深入挖掘消费主题股票的获利机会，实现动态优化的投资布局。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金系混合型基金，其风险收益特征从长期平均及预期来看，低于股票型基金，高于债券型基金与

	货币市场基金，属于中等风险、中等收益的证券投资基金品种。
--	------------------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	金元顺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	封涌
	联系电话	021-68881801
	电子邮箱	service@jysa99.com
客户服务电话	400-666-0666	95588
传真	021-68881875	010-66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	任开宇	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层

注册登记机构	金元顺安基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室
--------	--------------	----------------------------------

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023年	2022年	2021年
本期已实现收益	6,301,364.84	6,374,523.42	21,169,178.26
本期利润	-13,460,965.21	-24,334,346.37	1,714,775.68
加权平均基金份额本期利润	-0.1246	-0.2259	0.0159
本期加权平均净值利润率	-8.39%	-14.77%	0.91%
本期基金份额净值增长率	-8.21%	-13.01%	0.87%
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	41,800,407.85	55,380,821.57	79,361,806.63
期末可供分配基金份额利润	0.3868	0.5115	0.7374
期末基金资产净值	149,876,163.31	163,653,928.07	186,983,879.30
期末基金份额净值	1.387	1.511	1.737
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	38.70%	51.10%	73.70%

注：

- 1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；

3、表中的"期末"均指报告期最后一日，即12月31日。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-6.98%	0.68%	-5.46%	0.63%	-1.52%	0.05%
过去六个月	-3.95%	0.81%	-8.45%	0.68%	4.50%	0.13%
过去一年	-8.21%	0.83%	-8.78%	0.67%	0.57%	0.16%
过去三年	-19.45%	1.16%	-27.29%	0.89%	7.84%	0.27%
过去五年	68.12%	1.25%	13.84%	0.97%	54.28%	0.28%
自基金合同生效起至今	38.70%	1.46%	20.55%	1.10%	18.15%	0.36%

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

金元顺安消费主题混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

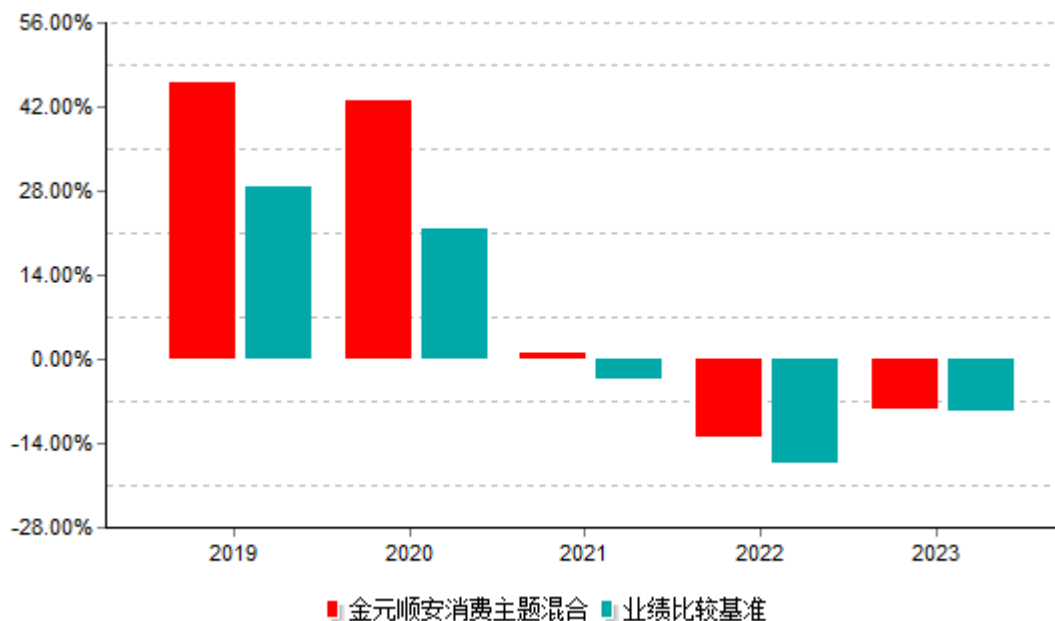
(2010年09月15日-2023年12月31日)



注：

- 1、本基金合同生效日为2010年09月15日，业绩基准累计增长率以2010年09月14日指数为基准；
- 2、本基金投资组合中股票及存托凭证投资比例为基金资产的60%-95%，其中，投资于消费主题行业的上市公司股票的比例不低于本基金股票资产的80%；债券、现金等金融工具以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%，其中，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- 3、本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年内未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

金元比联基金管理有限公司（以下简称“金元比联”、“公司”或“本基金管理人”，系金元顺安基金管理有限公司前身）成立于2006年11月，由金元证券股份有限公司（以下简称“金元证券”）与比利时联合资产管理公司（以下简称“比联资管”）共同发起

设立的中外合资基金管理有限公司。公司总部设在上海陆家嘴，旗下设立北京分公司及子公司--上海金元百利资产管理有限公司。

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

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

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

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

2020年04月，公司股东泉意金融更名为“上海前易信息咨询服务股份有限公司”。

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明

		任职日期	离任日期		
闵杭	总经理助理、投资总监、本基金基金经理	2015-10-16	-	29年	总经理助理、投资总监，金元顺安消费主题混合型证券投资基金、金元顺安桉盛债券型证券投资基金、金元顺安行业精选混合型证券投资基金和金元顺安产业臻选混合型证券投资基金的基金经理，上海交通大学工学学士。曾任湘财证券股份有限公司上海自营分公司总经理，申银万国证券股份有限公司证券投资总部投资总监。2015年8月加入金元顺安基金管理有限公司，历任金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安金通宝货币市场基金、金元顺安桉泰债券型证券投资基金、金元顺安新经济主题混合型证券投资基金和金元顺安宝石动力混合型证券投资基金的基金经理。29年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

注：

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《金元顺安消费

主题混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

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

本报告期内，未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023年国内经济呈现弱复苏态势，市场整体震荡下行，市场风格以小盘股为主，TMT、中特估、高股息策略、低估值风格等均有阶段性行情。本基金持仓相对稳定，维持偏高仓位，行业配置上以金融、食品饮料和家电、生物医药等蓝筹股为主。未来，本基金将继续坚持价值投资理念，精选个股，保持业绩相对稳定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安消费主题混合基金份额净值为1.387元，本报告期内，基金份额净值增长率为-8.21%，同期业绩比较基准收益率为-8.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股票市场方面，2023年国内经济呈现弱复苏态势，市场整体震荡下行，上证综指下跌3.70%，深证成指下跌13.54%，创业板指下跌19.41%，市场风格以小盘股为主，TMT、中特估、高股息策略、低估值风格等均有阶段性行情。2024年，中国经济有望温和企稳，财政、货币和产业政策将持续发力稳增长、扩内需，货币政策将维持进一步稳健宽松，财政总量仍有进一步释放的空间和潜力。当前市场估值处于历史底部区域，随着经济复苏，企业盈利将获得改善，此外，海外宏观环境改善也将从一定程度上助力市场上行，随着美联储货币政策逐步宽松和美债供需压力持续缓解，24年美债利率或步入下行周期，在此背景下A股估值压制因素有望缓解，相对全球主要股票市场，中国股市估值修复空间较大，外资也有望出现积极变化。在震荡磨底之后，市场有望进入盈利和估值双重提升的阶段。在经济温和复苏、流动性宽松的背景下，主要机会在与经济弱相关或有独立产业逻辑的方向，重点关注以下方向：（1）人工智能推动下的科技投资大周期，芯片、光通信、大数据、游戏等行业；（2）消费驱动型经济下的受益行业，譬如白酒、医药等；（3）国内金融供给侧改革的受益行业，如券商，行业集中度或得到提升。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内，公司重点开展的监察稽核工作包括：

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

1、估值工作小组的职责分工

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

估值工作小组职责：

- （1）制定估值制度并在必要时修改；
- （2）确保估值方法符合现行法规；
- （3）批准证券估值的步骤和方法；
- （4）对异常情况做出决策。

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

估值决策由估值工作小组2/3或以上多数票通过。

2、基金事务部的职责分工

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

基金事务部职责：

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

基金事务部总监认为必要时，可以提议召开估值工作小组会议。

3、投资研究部的职责分工

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

4、交易部的职责分工

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

5、风险管理部、监察稽核部的职责分工

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

4.7.2参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期内，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形。

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§5 托管人报告**5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人--金元顺安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对金元顺安基金管理有限公司编制和披露的本基金2023年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部

2024年2月21日

§6 审计报告**6.1 审计报告基本信息**

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	安永华明(2024)审字第70023677_B06号
--------	----------------------------

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	金元顺安消费主题混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了金元顺安消费主题混合型证券投资基金的财务报表，包括2023年12月31日的资产负债表，2023年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的金元顺安消费主题混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了金元顺安消费主题混合型证券投资基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于金元顺安消费主题混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	金元顺安消费主题混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，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

	<p>们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估金元顺安消费主题混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督金元顺安消费主题混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p>

	<p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对金元顺安消费主题混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致金元顺安消费主题混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈露 李莉
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
审计报告日期	2024-03-28

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：金元顺安消费主题混合型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	3,824,616.15	2,804,711.14

结算备付金		1,300,585.00	612,076.40
存出保证金		1,705.62	2,964.40
交易性金融资产	7.4.7.2	135,987,646.03	152,414,035.08
其中：股票投资		127,945,783.02	143,298,467.68
基金投资		-	-
债券投资		8,041,863.01	9,115,567.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-976.43	7,997,700.82
应收清算款		9,003,905.75	155,315.68
应收股利		-	-
应收申购款		101,485.78	101,408.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		150,218,967.90	164,088,212.42
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款	7.4.12.3	-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,447.99	9,006.12
应付管理人报酬		150,817.26	206,796.00
应付托管费		25,136.23	34,466.00
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	7.4.7.6	165,403.11	184,016.23
负债合计		342,804.59	434,284.35
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	108,075,755.46	108,273,106.50
未分配利润	7.4.7.8	41,800,407.85	55,380,821.57
净资产合计		149,876,163.31	163,653,928.07
负债和净资产总计		150,218,967.90	164,088,212.42

注：

报告截止日2023年12月31日，基金份额净值1.387元，基金份额总额108,075,755.46份。

7.2 利润表

会计主体：金元顺安消费主题混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2 022年12月31日
一、营业总收入		-10,690,470.23	-21,250,417.06
1.利息收入		216,597.38	193,202.51
其中：存款利息收入	7.4.7.9	23,621.67	27,194.83
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		192,975.71	166,007.68
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		8,853,105.72	9,262,830.39
其中：股票投资收益	7.4.7.10	4,340,504.76	5,235,223.30

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	207,784.51	285,464.15
资产支持证券投资 收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	4,304,816.45	3,742,142.94
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.16	-19,762,330.05	-30,708,869.79
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号 填列）	7.4.7.17	2,156.72	2,419.83
减：二、营业总支出		2,770,494.98	3,083,929.31
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	2,221,778.51	2,477,574.37
2.托管费	7.4.10.2.2	370,296.47	412,928.94
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	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	7.4.7.19	178,420.00	193,426.00
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）		-13,460,965.21	-24,334,346.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-13,460,965.21	-24,334,346.37
五、其他综合收益的税后净		-	-

额			
六、综合收益总额		-13,460,965.21	-24,334,346.37

7.3 净资产变动表

会计主体：金元顺安消费主题混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	108,273,106.50	55,380,821.57	163,653,928.07
二、本期期初净资产	108,273,106.50	55,380,821.57	163,653,928.07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-197,351.04	-13,580,413.72	-13,777,764.76
（一）、综合收益总额	-	-13,460,965.21	-13,460,965.21
（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）	-197,351.04	-119,448.51	-316,799.55
其中：1.基金申购款	1,267,069.41	638,051.03	1,905,120.44
2.基金赎回款	-1,464,420.45	-757,499.54	-2,221,919.99
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
（四）、其他综合	-	-	-

收益结转留存收益			
四、本期期末净资产	108,075,755.46	41,800,407.85	149,876,163.31
项目	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	107,622,072.67	79,361,806.63	186,983,879.30
二、本期期初净资产	107,622,072.67	79,361,806.63	186,983,879.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	651,033.83	-23,980,985.06	-23,329,951.23
（一）、综合收益总额	-	-24,334,346.37	-24,334,346.37
（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）	651,033.83	353,361.31	1,004,395.14
其中：1.基金申购款	2,058,836.24	1,075,566.21	3,134,402.45
2.基金赎回款	-1,407,802.41	-722,204.90	-2,130,007.31
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	108,273,106.50	55,380,821.57	163,653,928.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

邝晓星

任笑菲

季泽

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

金元顺安消费主题混合型证券投资基金（原名为：金元比联消费主题股票型证券投资基金，以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2010]963号文《关于核准金元比联消费主题股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人金元比联基金管理有限公司（系金元顺安基金管理有限公司的前身）向社会公开发行人募集，基金合同于2010年9月15日正式生效，首次设立募集规模为407,031,537.62份基金份额。

本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构为金元顺安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

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

本基金在正确认识中国经济发展特点的基础上，重点投资于消费拉动经济增长过程中充分受益的消费主题行业及其中的优势企业，致力于分享中国经济增长及增长方式转变带来的投资机会，力争实现基金资产的中长期稳定增值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、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。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

1、金融资产分类

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

2、金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

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

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

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

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

4、如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

2、交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

5、买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年04月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；根据财政部、税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年09月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年05月01日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

7.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年01月01日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

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

7.4.6.5 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月09日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年01月01日起，证券投

资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年09月08日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	3,824,616.15	2,804,711.14
等于：本金	3,824,257.03	2,804,482.65
加：应计利息	359.12	228.49
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-

合计	3,824,616.15	2,804,711.14
----	--------------	--------------

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		156,595,168.95	-	127,945,783.02	-28,649,385.93
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,970,400.00	57,863.01	8,041,863.01	13,600.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,970,400.00	57,863.01	8,041,863.01	13,600.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		164,565,568.95	57,863.01	135,987,646.03	-28,635,785.93
项目		上年度末 2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		152,163,913.56	-	143,298,467.68	-8,865,445.88
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	9,003,510.00	120,067.40	9,115,567.40	-8,010.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	9,003,510.00	120,067.40	9,115,567.40	-8,010.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		161,167,423.56	120,067.40	152,414,035.08	-8,873,455.88

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-976.43	-
银行间市场	-	-
合计	-976.43	-
项目	上年度末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,997,700.82	-
银行间市场	-	-
合计	7,997,700.82	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	5.07	28.01
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	5,398.04	8,988.22

其中：交易所市场	5,398.04	8,988.22
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
审计费用	40,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	165,403.11	184,016.23

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	108,273,106.50	108,273,106.50
本期申购	1,267,069.41	1,267,069.41
本期赎回（以“-”号填列）	-1,464,420.45	-1,464,420.45
本期末	108,075,755.46	108,075,755.46

注：

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

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	137,267,745.92	-81,886,924.35	55,380,821.57
本期期初	137,267,745.92	-81,886,924.35	55,380,821.57
本期利润	6,301,364.84	-19,762,330.05	-13,460,965.21
本期基金份额交易产生的变动数	-244,242.35	124,793.84	-119,448.51
其中：基金申购款	1,639,970.87	-1,001,919.84	638,051.03
基金赎回款	-1,884,213.22	1,126,713.68	-757,499.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	143,324,868.41	-101,524,460.56	41,800,407.85

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
活期存款利息收入	11,214.64	14,136.12
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	12,363.00	13,009.60
其他	44.03	49.11
合计	23,621.67	27,194.83

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
卖出股票成交总额	13,792,740.94	28,474,951.76
减：卖出股票成本总额	9,420,394.14	23,128,324.52
减：交易费用	31,842.04	111,403.94
买卖股票差价收入	4,340,504.76	5,235,223.30

7.4.7.11 债券投资收益**7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	185,374.51	167,143.58
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	22,410.00	118,320.57

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	207,784.51	285,464.15

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	18,324,900.00	9,297,071.01
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,977,590.00	9,024,800.00
减：应计利息总额	324,900.00	153,949.30
减：交易费用	-	1.14
买卖债券差价收入	22,410.00	118,320.57

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,304,816.45	3,742,142.94
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,304,816.45	3,742,142.94

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	-19,762,330.05	-30,708,869.79
——股票投资	-19,783,940.05	-30,701,659.79
——债券投资	21,610.00	-7,210.00
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-19,762,330.05	-30,708,869.79

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
基金赎回费收入	2,107.49	2,419.83

转换费收入	49.23	-
合计	2,156.72	2,419.83

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
审计费用	40,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	420.00	426.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	178,420.00	193,426.00

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
金元顺安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
金元证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
上海前易信息咨询服务有限公司	基金管理人的股东
上海金元百利资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至20 22年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,221,778.51	2,477,574.37
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,105,778.06	1,235,240.76
应支付基金管理人的净管理费	1,116,000.45	1,242,333.61

注：

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	370,296.47	412,928.94

注：

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	3,824,616.15	11,214.64	2,804,711.14	14,136.12

注：

除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2023年度获得的利息收入为人民币12,363.00元（2022年度：人民币13,009.60元），2023年末结算备付金余额为人民币1,300,585.00元（2022年末：人民币612,076.40元）。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688347	华虹公司	2023-07-27	6个月	新股流通受限	52.00	42.04	4,296	223,392.00	180,603.84	-
688717	艾罗能源	2023-12-26	5个交易日	新股未上市	55.66	55.66	2,935	163,362.10	163,362.10	-
300904	威力传动	2023-08-02	6个月	新股流通受限	35.41	61.39	213	7,542.33	13,076.07	-
301526	国际复材	2023-12-19	6个月	新股流通受限	2.66	5.26	2,365	6,290.90	12,439.90	-
301510	固高科技	2023-08-04	6个月	新股流通受限	12.00	35.00	335	4,020.00	11,725.00	-
301421	波长光电	2023-08-16	6个月	新股流通受限	29.38	59.36	185	5,435.30	10,981.60	-
301516	中远通	2023-12-01	6个月	新股流通受限	6.87	20.06	486	3,338.82	9,749.16	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新股流通受限	39.78	69.04	139	5,529.42	9,596.56	-
301172	君逸数码	2023-07-19	6个月	新股流通受限	31.33	38.14	234	7,331.22	8,924.76	-
688627	精智达	2023-07-11	6个月	新股流通	46.77	87.67	95	4,443.15	8,328.65	-

				受限							
301413	安培龙	2023-12-11	6个月	新股流通受限	33.25	70.25	116	3,857.00	8,149.00	-	
688548	广钢气体	2023-08-08	6个月	新股流通受限	9.87	12.74	630	6,218.10	8,026.20	-	
301558	三态股份	2023-09-21	6个月	新股流通受限	7.33	13.67	587	4,302.71	8,024.29	-	
688549	中巨芯	2023-08-30	6个月	新股流通受限	5.18	8.09	988	5,117.84	7,992.92	-	
301370	国科恒泰	2023-07-03	6个月	新股流通受限	13.39	16.00	496	6,641.44	7,936.00	-	
688592	司南导航	2023-08-07	6个月	新股流通受限	50.50	50.53	157	7,928.50	7,933.21	-	
688720	艾森股份	2023-11-29	6个月	新股流通受限	28.03	57.51	132	3,699.96	7,591.32	-	
688652	京仪装备	2023-11-22	6个月	新股流通受限	31.95	57.06	127	4,057.65	7,246.62	-	
301555	惠柏新材	2023-10-24	6个月	新股流通受限	22.88	39.68	182	4,164.16	7,221.76	-	
301499	维科精密	2023-07-13	6个月	新股流通受限	19.50	28.90	247	4,816.50	7,138.30	-	
688563	航材股份	2023-07-12	6个月	新股流通	78.99	60.47	118	9,320.82	7,135.46	-	

				受限							
688591	泰凌微	2023-08-18	6个月	新股流通受限	24.98	28.02	242	6,045.16	6,780.84	-	
301508	中机认检	2023-11-23	6个月	新股流通受限	16.82	32.25	210	3,532.20	6,772.50	-	
688653	康希通信	2023-11-10	6个月	新股流通受限	10.50	18.86	357	3,748.50	6,733.02	-	
688582	芯动联科	2023-06-21	6个月	新股流通受限	26.74	38.32	174	4,652.76	6,667.68	-	
688573	信宇人	2023-08-09	6个月	新股流通受限	23.68	28.79	228	5,399.04	6,564.12	-	
301372	科净源	2023-08-03	6个月	新股流通受限	45.00	43.48	148	6,660.00	6,435.04	-	
688648	中邮科技	2023-11-06	6个月	新股流通受限	15.18	24.91	246	3,734.28	6,127.86	-	
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	新股流通受限	55.00	74.10	80	4,400.00	5,928.00	-	
301568	思泰克	2023-11-21	6个月	新股流通受限	23.23	43.26	136	3,159.28	5,883.36	-	
301507	民生健康	2023-08-24	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	369	3,690.00	5,848.65	-	
601096	宏盛华源	2023-12-15	6个月	新股流通	1.70	5.23	1,114	1,893.80	5,826.22	-	

				受限						
301517	陕西华达	2023-10-09	6个月	新股流通受限	26.87	51.90	111	2,982.57	5,760.90	-
688671	碧兴物联	2023-08-02	6个月	新股流通受限	36.12	34.14	168	6,068.16	5,735.52	-
301578	辰奕智能	2023-12-21	6个月	新股流通受限	48.94	74.43	76	3,719.44	5,656.68	-
301509	金凯生科	2023-07-26	6个月	新股流通受限	56.56	62.14	91	5,146.96	5,654.74	-
301489	思泉新材	2023-10-16	6个月	新股流通受限	41.66	67.77	82	3,416.12	5,557.14	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6个月	新股流通受限	38.13	28.20	194	7,397.22	5,470.80	-
301362	民爆光电	2023-07-27	6个月	新股流通受限	51.05	38.50	142	7,249.10	5,467.00	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6个月	新股流通受限	31.90	44.48	122	3,891.80	5,426.56	-
688610	埃科光电	2023-07-10	6个月	新股流通受限	73.33	50.97	106	7,772.98	5,402.82	-
688702	盛科通信	2023-09-06	6个月	新股流通受限	42.66	48.19	110	4,692.60	5,300.90	-
603296	华勤技术	2023-08-01	6个月	新股流通	80.80	77.72	68	5,494.40	5,284.96	-

				受限						
688651	盛邦安全	2023-07-19	6个月	新股流通受限	39.90	46.03	114	4,548.60	5,247.42	-
301251	威尔高	2023-08-30	6个月	新股流通受限	28.88	34.64	151	4,360.88	5,230.64	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	新股流通受限	36.90	50.81	102	3,763.80	5,182.62	-
301272	英华特	2023-07-06	6个月	新股流通受限	51.39	53.27	97	4,984.83	5,167.19	-
301498	乖宝宠物	2023-08-09	6个月	新股流通受限	39.99	38.79	133	5,318.67	5,159.07	-
301329	信音电子	2023-07-05	6个月	新股流通受限	21.00	22.21	226	4,746.00	5,019.46	-
301533	威马农机	2023-08-07	6个月	新股流通受限	29.50	33.15	151	4,454.50	5,005.65	-
301505	苏州规划	2023-07-12	6个月	新股流通受限	26.35	35.79	139	3,662.65	4,974.81	-
301469	恒达新材	2023-08-10	6个月	新股流通受限	36.58	33.10	145	5,304.10	4,799.50	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	新股流通受限	57.88	45.12	103	5,961.64	4,647.36	-
301468	博盈特焊	2023-07-12	6个月	新股流通	47.58	30.21	153	7,279.74	4,622.13	-

				受限						
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股流通受限	25.82	31.77	144	3,718.08	4,574.88	-
301528	多浦乐	2023-08-17	6个月	新股流通受限	71.80	68.86	66	4,738.80	4,544.76	-
301550	斯菱股份	2023-09-06	6个月	新股流通受限	37.56	43.58	104	3,906.24	4,532.32	-
301519	舜禹股份	2023-07-19	6个月	新股流通受限	20.93	20.20	224	4,688.32	4,524.80	-
301511	德福科技	2023-08-08	6个月	新股流通受限	28.00	22.67	197	5,516.00	4,465.99	-
688638	誉辰智能	2023-07-04	6个月	新股流通受限	83.90	59.65	73	6,124.70	4,354.45	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	新股流通受限	26.68	18.67	230	6,136.40	4,294.10	-
688716	中研股份	2023-09-13	6个月	新股流通受限	29.66	36.38	118	3,499.88	4,292.84	-
688693	锆威特	2023-08-10	6个月	新股流通受限	40.83	43.40	95	3,878.85	4,123.00	-
688719	爱科赛博	2023-09-20	6个月	新股流通受限	69.98	60.10	68	4,758.64	4,086.80	-
301456	盘古智能	2023-07-06	6个月	新股流通	37.96	30.36	133	5,048.68	4,037.88	-

				受限							
688602	康鹏科技	2023-07-13	6个月	新股流通受限	8.66	11.05	356	3,082.96	3,933.80	-	
301529	福赛科技	2023-08-31	6个月	新股流通受限	36.60	37.88	101	3,696.60	3,825.88	-	
301525	儒竞科技	2023-08-23	6个月	新股流通受限	99.57	81.46	45	4,480.65	3,665.70	-	
001378	德冠新材	2023-10-23	6个月	新股流通受限	31.68	36.39	100	3,168.00	3,639.00	-	
301500	飞南资源	2023-09-13	6个月	新股流通受限	23.97	20.89	173	4,146.81	3,613.97	-	
688646	逸飞激光	2023-07-21	6个月	新股流通受限	46.80	36.06	98	4,586.40	3,533.88	-	
301515	港通医疗	2023-07-13	6个月	新股流通受限	31.16	28.26	122	3,801.52	3,447.72	-	
301559	中集环科	2023-09-26	6个月	新股流通受限	24.22	18.25	184	4,456.48	3,358.00	-	
688612	威迈斯	2023-07-19	6个月	新股流通受限	47.29	37.94	88	4,161.52	3,338.72	-	
001239	永达股份	2023-12-04	6个月	新股流通受限	12.05	21.94	147	1,771.35	3,225.18	-	
301520	万邦医药	2023-09-18	6个月	新股流通	67.88	52.74	61	4,140.68	3,217.14	-	

				受限						
688657	浩辰软件	2023-09-25	6个月	新股流通受限	103.40	79.31	40	4,136.00	3,172.40	-
301548	崇德科技	2023-09-11	6个月	新股流通受限	66.80	59.03	53	3,540.40	3,128.59	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	6个月	新股流通受限	55.68	37.55	83	4,621.44	3,116.65	-
001326	联域股份	2023-11-01	6个月	新股流通受限	41.18	51.74	59	2,429.62	3,052.66	-
601083	锦江航运	2023-11-28	6个月	新股流通受限	11.25	11.85	249	2,801.25	2,950.65	-
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6个月	新股流通受限	16.80	34.50	83	1,394.40	2,863.50	-
688450	光格科技	2023-07-17	6个月	新股流通受限	53.09	36.41	75	3,981.75	2,730.75	-
603273	天元智能	2023-10-16	6个月	新股流通受限	9.50	20.45	133	1,263.50	2,719.85	-
603373	安邦护卫	2023-12-13	6个月	新股流通受限	19.10	40.47	67	1,279.70	2,711.49	-
001306	夏厦精密	2023-11-09	6个月	新股流通受限	53.63	84.62	32	1,716.16	2,707.84	-
603270	金帝股份	2023-08-25	6个月	新股流通	21.77	29.58	87	1,893.99	2,573.46	-

				受限						
603107	上海汽配	2023-10-25	6个月	新股流通受限	14.23	21.96	107	1,522.61	2,349.72	-
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6个月	新股流通受限	15.32	23.86	86	1,317.52	2,051.96	-
603275	众辰科技	2023-08-16	6个月	新股流通受限	49.97	39.70	51	2,548.47	2,024.70	-
001358	兴欣新材	2023-12-14	6个月	新股流通受限	41.00	46.28	42	1,722.00	1,943.76	-
603193	润本股份	2023-10-09	6个月	新股流通受限	17.38	17.02	114	1,981.32	1,940.28	-
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6个月	新股流通受限	58.08	59.52	32	1,858.56	1,904.64	-
603276	恒兴新材	2023-09-18	6个月	新股流通受限	25.73	24.88	71	1,826.83	1,766.48	-
603075	热威股份	2023-09-01	6个月	新股流通受限	23.10	23.32	69	1,593.90	1,609.08	-
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6个月	新股流通受限	21.29	22.26	68	1,447.72	1,513.68	-

注：

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的债券、权证。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末2023年12月31日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	8,041,863.01	9,115,567.40
合计	8,041,863.01	9,115,567.40

注：未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债和超短期融资券。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为货币资金、存出保证金、结算备付金、债券投资及买入返售金融资产等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,824,616.15	-	-	-	3,824,616.15
结算备付金	1,300,585.00	-	-	-	1,300,585.00
存出保证金	1,705.62	-	-	-	1,705.62
交易性金融资产	8,041,863.01	-	-	127,945,783.02	135,987,646.03
买入返售金融资产	-976.43	-	-	-	-976.43
应收清算款	-	-	-	9,003,905.75	9,003,905.75
应收申购款	-	-	-	101,485.78	101,485.78
资产总计	13,167,793.35	-	-	137,051,174.55	150,218,967.90
负债					
应付赎回	-	-	-	1,447.99	1,447.99

回款					
应付管理人报酬	-	-	-	150,817.26	150,817.26
应付托管费	-	-	-	25,136.23	25,136.23
其他负债	-	-	-	165,403.11	165,403.11
负债总计	-	-	-	342,804.59	342,804.59
利率敏感度缺口	13,167,793.35	-	-	136,708,369.96	149,876,163.31
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,804,711.14	-	-	-	2,804,711.14
结算备付金	612,076.40	-	-	-	612,076.40
存出保证金	2,964.40	-	-	-	2,964.40
交易性金融资产	9,115,567.40	-	-	143,298,467.68	152,414,035.08
买入返售金融资产	7,997,700.82	-	-	-	7,997,700.82
应收清算款	-	-	-	155,315.68	155,315.68
应收申购款	-	-	-	101,408.90	101,408.90
资产总计	20,533,020.16	-	-	143,555,192.26	164,088,212.42

负债					
应付赎回款	-	-	-	9,006.12	9,006.12
应付管理人报酬	-	-	-	206,796.00	206,796.00
应付托管费	-	-	-	34,466.00	34,466.00
其他负债	-	-	-	184,016.23	184,016.23
负债总计	-	-	-	434,284.35	434,284.35
利率敏感度缺口	20,533,020.16	-	-	143,120,907.91	163,653,928.07

注：

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.以中央国债登记结算有限责任公司公布的2023年12月31日及2022年12月31日各债券的基点价值(BP价值)为主要计算依据；		
假设	2、债券持仓结构保持不变；		
假设	3、货币资金、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响；		
假设	4、该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	基准利率增加一个基点	-449.36	-283.85
	基准利率减少一个基点	449.40	283.87

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

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金的金融资产以公允价值计量，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	127,945,783.02	85.37	143,298,467.68	87.56
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	8,041,863.01	5.37	9,115,567.40	5.57
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	135,987,646.03	90.73	152,414,035.08	93.13

注：本基金投资组合中股票及存托凭证投资比例为基金资产的60%-95%，其中，投资于消费主题行业的上市公司股票及存托凭证的比例不低于本基金股票及存托凭证资产的80%；债券、现金等金融工具以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%，其中，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金投资组合中股票投资的贝塔系数紧密相关；		
	2、以下分析中，除市场指标发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	沪深300指数上涨5%	6,493,039.54	7,160,478.72
	沪深300指数下跌5%	-6,493,039.54	-7,160,478.72

注：

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

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	127,111,796.19	142,558,098.92
第二层次	8,205,225.11	9,239,586.10
第三层次	670,624.73	616,350.06
合计	135,987,646.03	152,414,035.08

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	616,350.06	616,350.06
当期购买	-	624,964.30	624,964.30
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	616,350.06	616,350.06
当期利得或损失总额	-	45,660.43	45,660.43
其中：计入损益的利得或损失	-	45,660.43	45,660.43
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

期末余额	-	670,624.73	670,624.73
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	-	45,660.43	45,660.43
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2,512,055.87	2,512,055.87
当期购买	-	691,454.35	691,454.35
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,512,055.87	2,512,055.87
当期利得或损失总额	-	-75,104.29	-75,104.29
其中：计入损益的利得或损失	-	-75,104.29	-75,104.29
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	616,350.06	616,350.06
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	-	-75,104.29	-75,104.29

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系

限售股票	670,624.73	平均价格亚式期权模型	波动率	14.7588%-153.1612%	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
限售股票	616,350.06	平均价格亚式期权模型	波动率	19.0909%-87.9166%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于2024年3月28日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	127,945,783.02	85.17
	其中：股票	127,945,783.02	85.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,041,863.01	5.35
	其中：债券	8,041,863.01	5.35

	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	-976.43	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,125,201.15	3.41
8	其他各项资产	9,107,097.15	6.06
9	合计	150,218,967.90	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	57,856,321.51	38.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,207.85	0.02
E	建筑业	2,173.05	0.00
F	批发和零售业	28,838.80	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,950.65	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	67,207.89	0.04
J	金融业	63,998,540.37	42.70
K	房地产业	124,474.00	0.08
L	租赁和商务服务业	842,007.49	0.56
M	科学研究和技术服务业	20,527.38	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	15,490.39	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,955,043.64	3.31

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	127,945,783.02	85.37

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	7,600	13,117,600.00	8.75
2	000001	平安银行	937,800	8,805,942.00	5.88
3	002001	新和成	490,320	8,315,827.20	5.55
4	002142	宁波银行	388,420	7,811,126.20	5.21
5	600030	中信证券	356,615	7,264,247.55	4.85
6	601166	兴业银行	430,722	6,982,003.62	4.66
7	000333	美的集团	111,000	6,063,930.00	4.05
8	600887	伊利股份	203,400	5,440,950.00	3.63
9	601628	中国人寿	187,300	5,309,955.00	3.54
10	000858	五粮液	33,100	4,644,261.00	3.10
11	300015	爱尔眼科	293,225	4,638,819.50	3.10
12	600036	招商银行	158,700	4,415,034.00	2.95
13	600276	恒瑞医药	95,760	4,331,224.80	2.89
14	300059	东方财富	288,000	4,043,520.00	2.70
15	601318	中国平安	94,100	3,792,230.00	2.53
16	000651	格力电器	111,835	3,597,731.95	2.40
17	600000	浦发银行	531,700	3,519,854.00	2.35
18	601658	邮储银行	750,000	3,262,500.00	2.18
19	002966	苏州银行	430,900	2,783,614.00	1.86

20	000538	云南白药	51,660	2,539,089.00	1.69
21	601009	南京银行	309,000	2,280,420.00	1.52
22	300122	智飞生物	33,700	2,059,407.00	1.37
23	000513	丽珠集团	58,100	2,034,081.00	1.36
24	601211	国泰君安	135,000	2,008,800.00	1.34
25	601601	中国太保	72,300	1,719,294.00	1.15
26	002304	洋河股份	9,564	1,051,083.60	0.70
27	000596	古井贡酒	3,800	884,640.00	0.59
28	002027	分众传媒	132,800	839,296.00	0.56
29	002415	海康威视	23,600	819,392.00	0.55
30	688506	百利天恒	5,021	702,437.90	0.47
31	000786	北新建材	22,400	523,264.00	0.35
32	002271	东方雨虹	27,000	518,400.00	0.35
33	600763	通策医疗	4,000	305,800.00	0.20
34	688347	华虹公司	4,296	180,603.84	0.12
35	688717	艾罗能源	2,935	163,362.10	0.11
36	002798	帝欧家居	19,900	130,345.00	0.09
37	000002	万科A	11,900	124,474.00	0.08
38	001286	陕西能源	3,767	32,207.85	0.02
39	603172	万丰股份	1,037	18,282.31	0.01
40	688249	晶合集成	914	15,766.50	0.01
41	300904	威力传动	213	13,076.07	0.01
42	688361	中科飞测	173	12,876.39	0.01
43	688443	智翔金泰	312	12,464.40	0.01
44	301526	国际复材	2,365	12,439.90	0.01
45	301510	固高科技	335	11,725.00	0.01
46	301383	天键股份	180	11,700.00	0.01
47	301421	波长光电	185	10,981.60	0.01
48	301293	三博脑科	167	10,424.14	0.01
49	688535	华海诚科	110	10,205.80	0.01
50	301516	中远通	486	9,749.16	0.01

51	301488	豪恩汽电	139	9,596.56	0.01
52	301387	光大同创	137	9,274.90	0.01
53	688629	华丰科技	422	9,241.80	0.01
54	301320	豪江智能	492	9,087.24	0.01
55	301172	君逸数码	234	8,924.76	0.01
56	688469	芯联集成	1,725	8,659.50	0.01
57	688562	航天软件	349	8,376.00	0.01
58	688472	阿特斯	661	8,348.43	0.01
59	688627	精智达	95	8,328.65	0.01
60	301413	安培龙	116	8,149.00	0.01
61	688548	广钢气体	630	8,026.20	0.01
62	301558	三态股份	587	8,024.29	0.01
63	688549	中巨芯	988	7,992.92	0.01
64	301370	国科恒泰	496	7,936.00	0.01
65	688592	司南导航	157	7,933.21	0.01
66	688720	艾森股份	132	7,591.32	0.01
67	688352	颀中科技	473	7,288.93	0.00
68	688652	京仪装备	127	7,246.62	0.00
69	301555	惠柏新材	182	7,221.76	0.00
70	301315	威士顿	136	7,188.96	0.00
71	301307	美利信	206	7,146.14	0.00
72	301499	维科精密	247	7,138.30	0.00
73	688563	航材股份	118	7,135.46	0.00
74	301325	曼恩斯特	91	7,056.14	0.00
75	688591	泰凌微	242	6,780.84	0.00
76	301508	中机认检	210	6,772.50	0.00
77	688653	康希通信	357	6,733.02	0.00
78	688582	芯动联科	174	6,667.68	0.00
79	688484	南芯科技	165	6,575.25	0.00
80	688573	信宇人	228	6,564.12	0.00
81	301262	海看股份	208	6,479.20	0.00

82	301372	科净源	148	6,435.04	0.00
83	301382	蜂助手	180	6,411.60	0.00
84	301225	恒勃股份	178	6,372.40	0.00
85	688543	国科军工	110	6,149.00	0.00
86	688648	中邮科技	246	6,127.86	0.00
87	688523	航天环宇	228	6,114.96	0.00
88	688576	西山科技	63	6,056.19	0.00
89	688593	新相微	408	6,005.76	0.00
90	688603	天承科技	80	5,928.00	0.00
91	301429	森泰股份	289	5,907.16	0.00
92	301568	思泰克	136	5,883.36	0.00
93	688531	日联科技	58	5,862.64	0.00
94	301507	民生健康	369	5,848.65	0.00
95	601096	宏盛华源	1,114	5,826.22	0.00
96	301281	科源制药	170	5,786.80	0.00
97	301517	陕西华达	111	5,760.90	0.00
98	688671	碧兴物联	168	5,735.52	0.00
99	301578	辰奕智能	76	5,656.68	0.00
100	301509	金凯生科	91	5,654.74	0.00
101	301310	鑫宏业	115	5,594.75	0.00
102	688334	西高院	321	5,562.93	0.00
103	301489	思泉新材	82	5,557.14	0.00
104	301428	世纪恒通	143	5,526.95	0.00
105	301291	明阳电气	194	5,470.80	0.00
106	301362	民爆光电	142	5,467.00	0.00
107	301459	丰茂股份	122	5,426.56	0.00
108	688610	埃科光电	106	5,402.82	0.00
109	301399	英特科技	141	5,396.07	0.00
110	688620	安凯微	456	5,389.92	0.00
111	688581	安杰思	43	5,366.83	0.00
112	688702	盛科通信	110	5,300.90	0.00

113	603296	华勤技术	68	5,284.96	0.00
114	301295	美硕科技	159	5,277.21	0.00
115	688651	盛邦安全	114	5,247.42	0.00
116	301251	威尔高	151	5,230.64	0.00
117	688552	航天南湖	222	5,214.78	0.00
118	301261	恒工精密	102	5,182.62	0.00
119	688146	中船特气	152	5,169.52	0.00
120	301272	英华特	97	5,167.19	0.00
121	301498	乖宝宠物	133	5,159.07	0.00
122	688458	美芯晟	67	5,156.32	0.00
123	688570	天玛智控	185	5,033.85	0.00
124	301329	信音电子	226	5,019.46	0.00
125	301533	威马农机	151	5,005.65	0.00
126	301505	苏州规划	139	4,974.81	0.00
127	301397	溯联股份	109	4,924.62	0.00
128	301376	致欧科技	203	4,855.76	0.00
129	301469	恒达新材	145	4,799.50	0.00
130	301357	北方长龙	95	4,795.60	0.00
131	688433	华曙高科	149	4,656.25	0.00
132	301210	金杨股份	103	4,647.36	0.00
133	301355	南王科技	306	4,635.90	0.00
134	301468	博盈特焊	153	4,622.13	0.00
135	301202	朗威股份	144	4,574.88	0.00
136	301528	多浦乐	66	4,544.76	0.00
137	301550	斯菱股份	104	4,532.32	0.00
138	301305	朗坤环境	251	4,530.55	0.00
139	301519	舜禹股份	224	4,524.80	0.00
140	001287	中电港	216	4,499.28	0.00
141	301511	德福科技	197	4,465.99	0.00
142	688638	誉辰智能	73	4,354.45	0.00
143	301332	德尔玛	355	4,338.10	0.00

144	688631	莱斯信息	122	4,300.50	0.00
145	301386	未来电器	169	4,297.67	0.00
146	301395	仁信新材	230	4,294.10	0.00
147	688716	中研股份	118	4,292.84	0.00
148	688693	锆威特	95	4,123.00	0.00
149	688719	爱科赛博	68	4,086.80	0.00
150	301456	盘古智能	133	4,037.88	0.00
151	300804	广康生化	128	3,950.08	0.00
152	688602	康鹏科技	356	3,933.80	0.00
153	301323	新莱福	106	3,920.94	0.00
154	301529	福赛科技	101	3,825.88	0.00
155	301232	飞沃科技	78	3,782.22	0.00
156	688429	时创能源	178	3,771.82	0.00
157	301525	儒竞科技	45	3,665.70	0.00
158	001378	德冠新材	100	3,639.00	0.00
159	301500	飞南资源	173	3,613.97	0.00
160	301337	亚华电子	116	3,550.76	0.00
161	688646	逸飞激光	98	3,533.88	0.00
162	301170	锡南科技	116	3,529.88	0.00
163	601061	中信金属	457	3,523.47	0.00
164	301515	港通医疗	122	3,447.72	0.00
165	301559	中集环科	184	3,358.00	0.00
166	688612	威迈斯	88	3,338.72	0.00
167	001380	华纬科技	95	3,309.80	0.00
168	001239	永达股份	147	3,225.18	0.00
169	301520	万邦医药	61	3,217.14	0.00
170	688657	浩辰软件	40	3,172.40	0.00
171	301548	崇德科技	53	3,128.59	0.00
172	688623	双元科技	44	3,123.12	0.00
173	301371	敷尔佳	83	3,116.65	0.00
174	001326	联域股份	59	3,052.66	0.00

175	601083	锦江航运	249	2,950.65	0.00
176	603004	鼎龙科技	83	2,863.50	0.00
177	603135	中重科技	168	2,748.48	0.00
178	688450	光格科技	75	2,730.75	0.00
179	688479	友车科技	117	2,728.44	0.00
180	603273	天元智能	133	2,719.85	0.00
181	603373	安邦护卫	67	2,711.49	0.00
182	001306	夏厦精密	32	2,707.84	0.00
183	603270	金帝股份	87	2,573.46	0.00
184	603107	上海汽配	107	2,349.72	0.00
185	601065	江盐集团	193	2,207.92	0.00
186	601133	柏诚股份	165	2,173.05	0.00
187	001282	三联锻造	60	2,170.20	0.00
188	603119	浙江荣泰	86	2,051.96	0.00
189	603275	众辰科技	51	2,024.70	0.00
190	001328	登康口腔	71	2,010.01	0.00
191	001324	长青科技	81	1,965.87	0.00
192	001358	兴欣新材	42	1,943.76	0.00
193	603193	润本股份	114	1,940.28	0.00
194	603062	麦加芯彩	32	1,904.64	0.00
195	603276	恒兴新材	71	1,766.48	0.00
196	603125	常青科技	58	1,741.16	0.00
197	001360	南矿集团	98	1,704.22	0.00
198	603075	热威股份	69	1,609.08	0.00
199	603231	索宝蛋白	68	1,513.68	0.00
200	001367	海森药业	33	1,450.68	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	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金
---	------	------	----------	-------

号				资产净值比例(%)
1	300122	智飞生物	1,996,940.00	1.22
2	000858	五粮液	1,993,057.00	1.22
3	001286	陕西能源	361,603.20	0.22
4	688347	华虹公司	319,072.00	0.19
5	688249	晶合集成	181,341.66	0.11
6	688717	艾罗能源	163,362.10	0.10
7	688443	智翔金泰	118,147.72	0.07
8	688343	云天励飞	113,269.68	0.07
9	301260	格力博	100,355.05	0.06
10	688469	芯联集成	98,146.81	0.06
11	301246	宏源药业	96,100.00	0.06
12	688563	航材股份	92,734.26	0.06
13	688531	日联科技	87,923.26	0.05
14	688576	西山科技	85,146.60	0.05
15	301383	天键股份	82,903.36	0.05
16	301429	森泰股份	82,857.50	0.05
17	301303	真兰仪表	80,748.40	0.05
18	301387	光大同创	79,898.40	0.05
19	688592	司南导航	78,881.00	0.05
20	301310	鑫宏业	77,372.00	0.05

注：

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	001286	陕西能源	339,000.00	0.21

2	688343	云天励飞	312,059.00	0.19
3	301510	固高科技	225,825.00	0.14
4	688249	晶合集成	188,826.66	0.12
5	301526	国际复材	173,186.64	0.11
6	688435	英方软件	163,116.50	0.10
7	688549	中巨芯	133,290.00	0.08
8	301516	中远通	132,380.70	0.08
9	301358	湖南裕能	124,858.66	0.08
10	688531	日联科技	124,617.09	0.08
11	688172	燕东微	124,538.63	0.08
12	688502	茂莱光学	115,362.00	0.07
13	601059	信达证券	114,301.40	0.07
14	301260	格力博	114,213.29	0.07
15	301555	惠柏新材	113,022.00	0.07
16	301320	豪江智能	110,675.00	0.07
17	688362	甬矽电子	109,678.46	0.07
18	301507	民生健康	108,830.40	0.07
19	688347	华虹公司	108,339.20	0.07
20	688307	中润光学	107,771.00	0.07

注：

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	13,851,649.53
卖出股票收入（成交）总额	13,792,740.94

注：

本项的"买入股票的成本"、"卖出股票的收入"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	8,041,863.01	5.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,041,863.01	5.37

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019709	23国债16	80,000	8,041,863.01	5.37
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未投资贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未投资权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

1、平安银行（000001.SZ）

中国银行间市场交易商协会于2023年01月18日披露自律处分信息：

平安银行股份有限公司作为相关债务融资工具联席主承销商，未按发行文件约定，取利率区间上限开展余额包销，相关行为挤占了其他市场投资人的份额，损害了其他投资人权益，并影响了发行利率，对市场正常秩序造成了一定不良影响。

根据银行间债券市场相关自律规定，经自律处分会议初审、复审，对平安银行予以通报批评；责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

本基金管理人做出说明如下：

（1）投资决策程序：通过对公司的基本面进行分析，认为基本面发展势头良好，业绩表现符合预期，后续业务持续发展尚有一定的潜力；

（2）平安银行股份有限公司作为相关债务融资工具联席主承销商，未按发行文件约定，取利率区间上限开展余额包销，中国银行间市场交易商协会对平安银行予以通报批评，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。经过分析，我们认为该事项对公司影响可控，因此继续持有该公司股票。

2、中信证券（600030.SH）

（1）中信证券股份有限公司（以下简称“公司”）于2023年04月11日收到深圳证券交易所下发的《关于对中信证券股份有限公司的监管函》（深证函〔2023〕226号），主要内容如下：

在担任陕西嘉禾生物科技股份有限公司（以下简称嘉禾生物或发行人）首次公开发行股票并在创业板上市的申请项目保荐人过程中，公司存在以下违规行为：

一、对发行人境外存货核查程序执行不到位，实际开展的核查工作与披露情况存在差异

二、未充分关注发行人境外销售交易存在的异常情形并进行审慎核查

三、未充分关注发行人销售、采购、研发相关内部控制存在的薄弱环节

四、对发行人转贷、与供应商异常资金往来等事项核查不到位，发表的核查意见不准确

公司作为项目保荐人，承担了对发行人经营状况的尽职调查、申请文件的核查验证等职责，但未按照《保荐人尽职调查工作准则》等执业规范的要求，对发行人境外存货、境外销售、内部控制等异常情形保持充分关注并进行审慎核查，发表的核查意见不准确。上述行为违反了《深圳证券交易所创业板股票发行上市审核规则》（以下简称《审核规则》）第三十条、第四十二条的规定。

鉴于上述事实 and 情节，根据《审核规则》第七十二条、七十四条的有关规定，决定对公司采取书面警示的自律监管措施。

（2）中信证券股份有限公司（以下简称“公司”）于2023年05月12日收到上海证券交易所下发的《关于对西藏华钰矿业股份有限公司保荐机构及保荐代表人予以监管警示的决定》（上海证券交易所监管措施决定书[2023]22号），主要内容如下：

作为西藏华钰矿业股份有限公司（以下简称华钰矿业或公司）首次公开发行并上市项目保荐机构，在2017年至2018年6月持续督导工作中存在以下问题：

第一、对关联方及关联交易现场检查不到位，未保持应有的职业审慎并开展审慎核查，未能督导发行人有效防止关联方违规占用发行人资金。

第二、对销售收入及主要客户异常变化核查不充分，未采取充分的核查程序。

中信证券上述行为违反了《证券发行上市保荐业务管理办法》（证监会令第58号）第四条、《证券发行上市保荐业务管理办法》（证监会令第137号）第四条以及《上海证券交易所股票上市规则（2020年修订）》（以下简称《股票上市规则》）第1.4条、第2.24条等有关规定。徐欣、宋永新作为公司首次公开发行并上市项目持续督导工作的签字保荐代表人，对相关违规行为负有主要责任，违反了《股票上市规则》第2.24条等有关规定。

鉴于上述违规事实和情节，根据《股票上市规则》第16.1条和《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》的有关规定，作出如下监管措施决定：对中信证券及徐欣、宋永新予以监管警示。

（3）中国证监会2023年07月13日公布《深圳证监局关于对中信证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（行政监管措施决定书（2023）102号）和《深圳证监局关于对方兴、侯敏、何涛采取出具警示函措施的决定》（行政监管措施决定书（2023）101号）。

经查，深圳证监局发现中信证券在2023年6月19日的网络安全事件中，存在机房基础设施建设安全性不足，信息系统设备可靠性管理疏漏等问题。上述行为违反了《证券期货业网络和信息安全管理办法》（证监会令第218号，以下简称《网络和信息安全管理办法》）第十三条相关规定。

方兴作为中信证券首席信息官兼信息技术中心行政负责人，全面负责公司信息技术工作，侯敏作为信息技术中心分管运维负责人，何涛作为信息技术中心机房与网络负责人，对相关问题负有责任。

依据《网络和信息安全管理办法》第六十二条第二款，以及《证券期货业网络安全事件报告与调查处理办法》（证监会公告〔2021〕12号）第二十八条的规定，深圳证监局决定对中信证券采取出具警示函的行政监管措施；对方兴、侯敏、何涛采取出具警示函的行政监管措施。

本基金管理人做出说明如下：

（1）投资决策程序：通过对公司的基本面进行分析，认为基本面发展势头良好，业绩表现符合预期，后续业务持续发展尚有一定的潜力；

（2）因在担任陕西嘉禾生物科技股份有限公司首次公开发行股票并在创业板上市的申请项目保荐人过程中，公司存在违规行为，公司收到深交所监管函，作为西藏华钰矿业股份有限公司首次公开发行并上市项目保荐机构，在2017年至2018年6月持续督导工作中存在问题相关人员收到上交所监管警示，因存在机房基础设施建设安全性不足，信息系统设备可靠性管理疏漏等问题，相关责任人被深圳证监局出具警示函。经过分析，我们认为该事项对公司影响可控，因此继续持有该公司股票。

3、兴业银行（601166.SH）

（1）中国银行间市场交易商协会于2023年01月18日发布公告，兴业银行存在以下问题：

一是低价包销多期债务融资工具，影响了市场正常秩序。二是多期债务融资工具的簿记建档利率区间未在充分询价基础上形成，发行工作程序执行不到位、工作开展不规范。

自律处分会议还考量了兴业银行曾于2020年5月因承销环节违规受到自律处分的情况。根据银行间债券市场相关自律规定，经自律处分会议审议，对兴业银行予以警告；责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

（2）关于福建证监局于2023年5月8日作出的关于对兴业银行股份有限公司采取责令改正措施的决定，经查，兴业银行基金销售业务在销售产品准入集中统一管理、基金销售业务数据统计质量等方面存在不足。

上述问题分别违反了《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（证监会令 第175号，以下简称《基金销售办法》）第二十七条第一款、第四十二条第一款的相关规定。根据《基金销售办法》第五十三条规定，采取责令改正的措施。

本基金管理人做出说明如下：

（1）投资决策程序：通过对公司的基本面进行分析，认为基本面发展势头良好，业绩表现符合预期，后续业务持续发展尚有一定的潜力；

(2) 因在债务融资工具的发行和包销中存在的问题，中国银行间市场交易商协会于2023年01月18日对兴业银行予以警告，责令其针对暴露出的问题进行全面深入的整改。因在基金业务中存在问题，福建证监局于2023年5月8日作出对兴业银行股份有限公司采取责令改正措施的决定。经过分析，我们认为该事项对公司影响可控，因此继续持有该公司股票。

8.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,705.62
2	应收清算款	9,003,905.75
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	101,485.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,107,097.15

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,250	86,460.60	0.00	0.00%	108,075,755.46	100.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	383,756.06	0.36%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年09月15日)基金份额总额	407,031,537.62
本报告期期初基金份额总额	108,273,106.50
本报告期基金总申购份额	1,267,069.41
减：本报告期基金总赎回份额	1,464,420.45
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	108,075,755.46

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未举行基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

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

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

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

2、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，未发生改聘会计师事务所的情况。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴	1	-	-	-	-	-

证券						
方正证券	1	11,697,331.16	65.78%	10,863.34	65.66%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申银万国证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	6,085,406.78	34.22%	5,681.48	34.34%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-

注：

1、专用交易单元的选择标准和程序

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

（1）选择标准。

- 1) 公司具有较强的研究实力，能够出具高质量的各种研究报告。研究及投资建议质量较高、报告出具及时、能及时地交流和对需求做出反应，有较广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。
- 2) 公司资信状况较好，无重大不良记录。
- 3) 公司经营规范，能满足基金运作的合法、合规需求。
- 4) 能够对持有人提供较高质量的服务。能够向持有人提供咨询、查询等服务；可以向投资人提供及时、主动的信息以及其它增值服务，无被持有人投诉的记录。

(2) 选择流程。

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

2、截至本报告期末2023年12月31日止，本基金无新租或退租交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	16,944,480.00	100.00%	1,954,500,000.00	100.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金2022年第四季度报告	规定披露媒介	2023-01-20
2	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-02-10
3	关于金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金在部分代	规定披露媒介	2023-02-22

	销机构开展赎回费率优惠活动的公告		
4	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加中泰证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-03-14
5	关于金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金在部分代销机构开展赎回费率优惠活动的公告	规定披露媒介	2023-03-15
6	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金2022年度报告	规定披露媒介	2023-03-31
7	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金2023年第一季度报告	规定披露媒介	2023-04-22
8	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加德邦证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-06-06
9	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加麦高证券有限责任公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-06-29
10	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金2023年第二季度报告	规定披露媒介	2023-07-20
11	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加博时财富基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-07-21
12	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加江海证券	规定披露媒介	2023-07-28

	有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告		
13	金元顺安消费主题混合型证券投资基金托管协议	规定披露媒介	2023-08-05
14	金元顺安消费主题混合型证券投资基金基金合同	规定披露媒介	2023-08-05
15	金元顺安基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	规定披露媒介	2023-08-05
16	金元顺安消费主题混合型证券投资基金基金产品资料概要更新[2023年08月09日更新]	规定披露媒介	2023-08-09
17	金元顺安消费主题混合型证券投资基金更新招募说明书[2023年08月09日更新]	规定披露媒介	2023-08-09
18	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金2023年中期报告	规定披露媒介	2023-08-31
19	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加东方证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-09-19
20	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增上海证券有限责任公司为销售机构并参与费率优惠的公告	规定披露媒介	2023-10-11
21	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金2023年第三季度报告	规定披露媒介	2023-10-25
22	金元顺安消费主题混合型证券投资基金更新招募说明书[2023年11月04日更新]	规定披露媒介	2023-11-04

23	金元顺安消费主题混合型证券投资基金基金产品资料概要更新[2023年11月04日更新]	规定披露媒介	2023-11-04
----	--	--------	------------

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	2023年01月01日 - 2023年12月31日	50,393,592.51	-	-	50,393,592.51	46.63%
	2	2023年01月01日 - 2023年12月31日	51,246,107.43	-	-	51,246,107.43	47.42%
产品特有风险							
<p>持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。</p> <p>基金净值大幅波动的风险 高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予金元顺安消费主题混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金元顺安消费主题混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《金元顺安消费主题混合型证券投资基金基金招募说明书》；
- 4、《金元顺安消费主题混合型证券投资基金托管协议》；

- 5、关于申请募集注册金元顺安消费主题混合型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

金元顺安基金管理有限公司
中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室

13.3 查阅方式

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

金元顺安基金管理有限公司
二〇二四年三月三十日