

# 淳厚欣颐一年持有期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:淳厚基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年3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。

本报告财务资料已经审计，上会会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了2023年度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01月01日起至2023年12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现 .....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
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的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 审计报告.....	15
6.1 审计报告基本信息 .....	15
6.2 审计报告的基本内容 .....	15
§7 年度财务报表.....	18
7.1 资产负债表 .....	18
7.2 利润表 .....	20
7.3 净资产变动表 .....	21
7.4 报表附注 .....	23
§8 投资组合报告.....	61
8.1 期末基金资产组合情况 .....	61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	61
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.....	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	70
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	70
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.....	70

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 .....	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
8.12 投资组合报告附注 .....	70
§9 基金份额持有人信息.....	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	71
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.....	72
§10 开放式基金份额变动 .....	72
§11 重大事件揭示 .....	72
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	72
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.....	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	72
11.4 基金投资策略的改变 .....	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	73
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.....	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	73
11.8 其他重大事件 .....	74
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
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 .....	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	77
§13 备查文件目录 .....	77
13.1 备查文件目录 .....	77
13.2 存放地点 .....	77
13.3 查阅方式.....	77

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金
基金简称	淳厚欣颐
基金主代码	010551
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年12月22日
基金管理人	淳厚基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	223,665,035.20份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对企业基本面全面、深入的研究，持续挖掘具有长期发展潜力和估值优势的上市公司，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> <li>1、资产配置策略</li> <li>2、股票投资策略             <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 行业分析与配置</li> <li>(2) 公司财务状况评估</li> <li>(3) 价值评估</li> <li>(4) 股票选择与组合优化</li> <li>(5) 港股投资策略</li> <li>(6) 存托凭证投资策略</li> </ol> </li> <li>3、债券投资策略             <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 利率策略</li> <li>(2) 信用策略</li> <li>(3) 债券选择与组合优化</li> <li>(4) 可转换债券、可交换债券投资</li> </ol> </li> <li>4、资产支持证券投资策略</li> <li>5、衍生品投资策略             <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 股指期货投资策略</li> </ol> </li> </ol>

	<p>(2) 国债期货投资策略</p> <p>(3) 股票期权投资策略</p> <p>6、融资业务的投资策略</p>
业绩比较基准	<p>沪深300指数收益率×50%+经人民币汇率调整的中证港股通综合指数收益率×20%+中债综合全价（总值）指数收益率×30%</p>
风险收益特征	<p>本基金属于混合型证券投资基金，其预期风险收益水平低于股票型证券投资基金、高于债券型证券投资基金、货币市场基金。</p> <p>本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

### 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	淳厚基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	沈志婷
	联系电话	021-60602373
	电子邮箱	shenzt@purekindfund.com
客户服务电话	4000009738	95595
传真	021-60607060	010-63639132
注册地址	上海市虹口区临潼路170号607室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址	上海市浦东新区丁香路778号丁香国际大厦西塔7F	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码	200135	100033
法定代表人	邢媛	王江

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网	<a href="http://www.purekindfund.com/">http://www.purekindfund.com/</a>

址	
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区丁香路778号丁香国际大厦西塔7F

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	上会会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市威海路755号上海报业集团大厦25层
注册登记机构	淳厚基金管理有限公司	上海市浦东新区丁香路778号丁香国际大厦西塔7F

## §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	7,217.85	-43,341,062.75	108,960,187.62
本期利润	-5,656,064.33	-77,715,402.61	130,614,755.22
加权平均基金份额本期利润	-0.0231	-0.2583	0.2306
本期加权平均净值利润率	-2.16%	-24.06%	20.90%
本期基金份额净值增长率	-3.28%	-18.28%	22.93%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末	2022年末	2021年末
期末可供分配利润	-3,866,056.10	3,935,924.85	79,650,877.53
期末可供分配基金份额利润	-0.0173	0.0160	0.1932
期末基金资产净值	219,798,979.10	249,469,915.01	512,587,156.68
期末基金份额净值	0.9827	1.0160	1.2432
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	-1.73%	1.60%	24.32%
-------------	--------	-------	--------

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、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	-6.48%	0.82%	-4.59%	0.57%	-1.89%	0.25%
过去六个月	-11.96%	0.81%	-7.44%	0.61%	-4.52%	0.20%
过去一年	-3.28%	0.82%	-7.57%	0.60%	4.29%	0.22%
过去三年	-2.83%	1.06%	-23.01%	0.79%	20.18%	0.27%
自基金合同生效起至今	-1.73%	1.06%	-21.15%	0.79%	19.42%	0.27%

#### 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

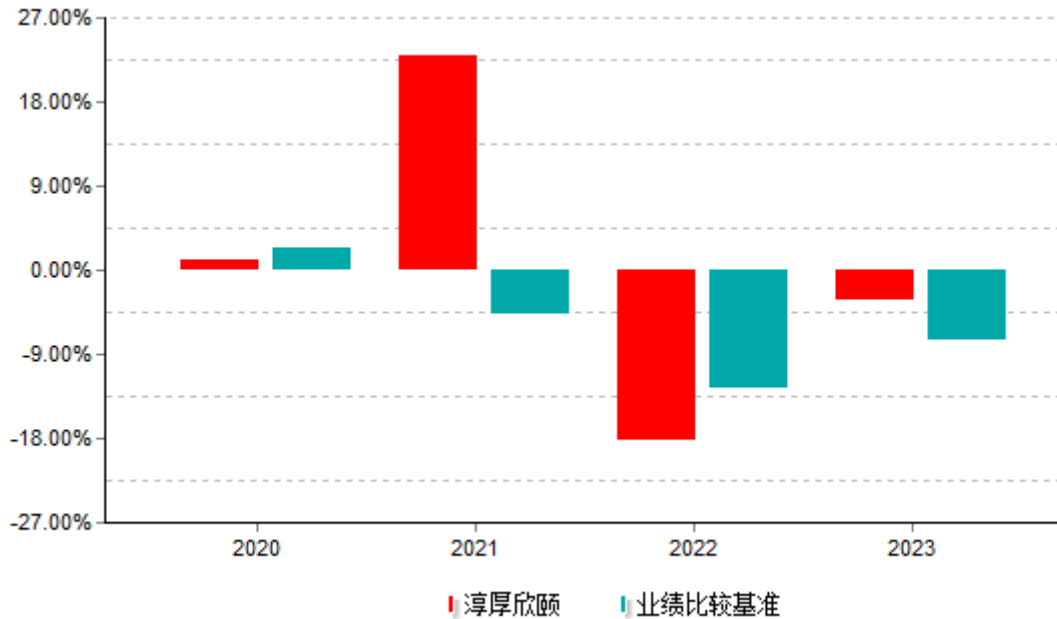


淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年12月22日-2023年12月31日)



注：本基金基金合同生效日为2020年12月22日。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例均符合基金合同约定。

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



注：1) 本基金合同于2020年12月22日生效。  
2) 2020年是合同生效当年，按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金未进行利润分配。

## §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

淳厚基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2018】1618号文批准，于2018年11月3日成立，是由六位资深专业人士发起设立的公募基金管理公司。公司注册地上海，注册资本金为1亿元人民币。公司于2019年2月1日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。本基金管理人拥有公募、特定客户资产管理等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资等方面为客户提供资产管理解决方案。

#### 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		
薛莉丽	基金经理、副总经理兼研究部总监	2020-12-22	-	16年	上海财经大学经济学硕士。曾任兴业证券证券投资部（权益自营部）投资经理、总经理助理、部门副总监。2019年加入淳厚基金，现任淳厚基金副总经理兼研究部总监、淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理、淳厚信睿核心精选混合型证券投资基金基金经理、淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金经理、淳厚益加增强债券型证券投资基金基金经理、淳厚鑫淳一年持有期混合型证券投资基金基金经理、淳厚

					现代服务业股票型证券投资基金基金经理、淳厚鑫悦商业模式优选混合型证券投资基金基金经理、淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
顾伟	基金经理	2022-10-27	-	8年	上海财经大学经济学硕士。曾任兴业证券资产管理有限公司研究部研究员。2019年加入淳厚基金，现任淳厚基金管理有限公司淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；  
2、证券从业年限计算标准遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、本基金《基金合同》等法律文件和其他相关法律法规的规定，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，力争为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

基金管理人根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，制定了《淳厚基金管理有限公司公平交易制度》和《淳厚基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施情况的监控与检查稽核、异常交易的监控等进行了规定。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，基金管理人合理设置了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，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、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。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。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保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。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司交易部和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过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。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形，未发现异常交易行为。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 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

23年全年上证50、沪深300和中证500分别下跌11.73%、11.38%和7.42%。下半年市场轮动加快，风格上超大盘和超小盘有较好的超额收益。

本基金始终坚持“自下而上选择优质股票，以合理估值买入并持有”的投资策略，在组合层面本基金一直坚持行业均衡、估值均衡的配置思路。本人希望坚持长期投资理念的同时，不断完善自己的方法论，希望每年可以有一定的进步，来持续提升获取超额收益的能力。回顾23年在选股层面依然发挥了自己的优势，下半年在市场轮动较快的节

奏中，本人增加了一些短期配置，未来在选股过程中会更加看重公司核心竞争力和估值匹配程度。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末淳厚欣颐基金份额净值为0.9827元，本报告期内，基金份额净值增长率为-3.28%，同期业绩比较基准收益率为-7.57%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计国内经济政策以稳增长为主基调，中央财政仍有发力空间，房地产市场在经历去年下半年大幅下滑后环比有望逐步企稳。海外经济在经历23年美债利率高企后，通胀开始逐步下行，美国实际利率已经为正，今年某个时点可能进入降息通道。

展望后市，我认为A股估值目前相对较低，积极看好后市表现，权益市场目前风险偏好极低，预计风险偏好将逐步回升。我们继续保持自下而上个股挖掘优势，同时继续完善投资体系，争取为投资人创造更好的回报。

#### 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，基金管理人有序进行监察稽核工作，主要采取了如下监察稽核措施：定期对本基金投研交易、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，跟进后续改进情况，完成监察稽核季报。同时，按照监管机构下发的各项通知，开展有针对性的专项稽核工作。持续完善制度流程和监控模型，采用有效手段，日常监控投资管理人员的个人行为，利用公平交易分析投资人员的投资行为，防范出现违规行为。关注内部控制的健全性和有效性，全面梳理各项业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。同时，结合出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和完善业务流程。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，应参照协会通知执行。

报告期内，本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会主任委员由分管运营的首席信息官（副总经理级）担任，专业委员若干名，由权益投资部、固定收益投资部、研究部、运营保障部、监察稽核部、风险管理部、市场综合部等部门负责人或其指定人员组成。

估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理可列席公司估值委员会，不介入基金日常估值业务，但可参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，但不能参与表决，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人会同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：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按除权后的基金份额净值自动转为相应类别的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；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。

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现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，中国光大银行股份有限公司在淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

### 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，中国光大银行股份有限公司依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金2023年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## §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	上会师报字（2024）第1543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	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金全体份额持有人
审计意见	我们审计了淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金(以下简称"淳厚欣颐")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，后附淳厚欣颐的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业

	<p>实务操作的有关规定编制，公允反映了淳厚欣颐 2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于淳厚欣颐，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。</p>
<p>强调事项</p>	<p>-</p>
<p>其他事项</p>	<p>我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系淳厚欣颐管理人(以下简称“管理人”)根据《淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的规定为其基金份额持有人编制的，因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人提供淳厚欣颐份额持有人和向中国证券投资基金业协会及其派出机构报送使用，不得用于其他目的。</p>
<p>其他信息</p>	<p>管理人对其他信息负责。其他信息包括淳厚欣颐 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。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券业投资基金业协会发布</p>



	<p>的关于基金行业实务操作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，管理人负责评估淳厚欣颐的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</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、评价管理人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、对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对淳厚欣颐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</p>

	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淳厚欣颐不能持续经营。5、评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与管理人就淳厚欣颐的审计范围、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。
会计师事务所的名称	上会会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	胡治华、赵静文
会计师事务所的地址	上海市威海路755号上海报业集团大厦25层
审计报告日期	2024-03-29

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：淳厚欣颐一年持有期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
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	25,938,451.56	17,846,626.08
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	194,429,429.92	234,491,957.99
其中：股票投资		194,429,429.92	221,402,827.85
基金投资		-	-
债券投资		-	13,089,130.14
资产支持证券投 资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,732.20	2,145.38
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		220,370,613.68	252,340,729.45
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	2,056,002.53
应付赎回款		163,811.91	285,913.45
应付管理人报酬		222,705.14	325,498.64
应付托管费		37,117.53	43,399.82
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	7.4.7.5	148,000.00	160,000.00
负债合计		571,634.58	2,870,814.44
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.6	223,665,035.20	245,533,990.16
未分配利润	7.4.7.7	-3,866,056.10	3,935,924.85

净资产合计		219,798,979.10	249,469,915.01
负债和净资产总计		220,370,613.68	252,340,729.45

注：报告截止日2023年12月31日，基金份额净值0.9827元,基金份额总额223,665,035.20份。

## 7.2 利润表

会计主体：淳厚欣颐一年持有期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		-1,308,496.75	-72,023,978.52
1.利息收入		129,923.04	344,147.32
其中：存款利息收入	7.4.7.8	129,923.04	271,273.93
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		-	72,873.39
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		4,224,862.39	-37,993,785.98
其中：股票投资收益	7.4.7.9	-447,782.57	-41,868,695.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.10	165,892.86	771,741.60
资产支持证券投资 收益	7.4.7.11	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	4,506,752.10	3,103,167.51
其他投资收益		-	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-5,663,282.18	-34,374,339.86
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		4,347,567.58	5,691,424.09
1.管理人报酬		3,673,682.88	4,880,653.20
2.托管费		525,884.70	650,753.79
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	7.4.7.15	-	-
7.税金及附加		-	17.10
8.其他费用	7.4.7.16	148,000.00	160,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-5,656,064.33	-77,715,402.61
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-5,656,064.33	-77,715,402.61
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-5,656,064.33	-77,715,402.61

### 7.3 净资产变动表

会计主体：淳厚欣颐一年持有期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	245,533,990.16	3,935,924.85	249,469,915.01
二、本期期初净资产	245,533,990.16	3,935,924.85	249,469,915.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-21,868,954.96	-7,801,980.95	-29,670,935.91
（一）、综合收益总额	-	-5,656,064.33	-5,656,064.33
（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）	-21,868,954.96	-2,145,916.62	-24,014,871.58
其中：1.基金申购款	36,411,388.50	2,832,959.94	39,244,348.44
2.基金赎回款	-58,280,343.46	-4,978,876.56	-63,259,220.02
（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	223,665,035.20	-3,866,056.10	219,798,979.10
项目	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	412,312,433.74	100,274,722.94	512,587,156.68
二、本期期初净资产	412,312,433.74	100,274,722.94	512,587,156.68

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-166,778,443.58	-96,338,798.09	-263,117,241.67
（一）、综合收益总额	-	-77,715,402.61	-77,715,402.61
（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）	-166,778,443.58	-18,623,395.48	-185,401,839.06
其中：1.基金申购款	25,523,492.95	4,153,492.02	29,676,984.97
2.基金赎回款	-192,301,936.53	-22,776,887.50	-215,078,824.03
（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	245,533,990.16	3,935,924.85	249,469,915.01

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：

邢媛

刘远新

李述银

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

淳厚欣颐一年持有期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[2020] 2733号《关于准予淳厚欣颐一年持有期

混合型证券投资基金注册的批复》核准，由淳厚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)负责公开募集。本基金的基金管理人为淳厚基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。本基金于2020年12月22日募集成立，募集期为自2020年12月01日至2020年12月18日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，本基金共募集有效净认购资金，532,284,605.47元，折合532,284,605.47份淳厚欣颐基金份额。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币149,809.52元，折合149,809.52份淳厚欣颐基金份额，以上收到的实收基金共计人民币532,434,414.99元，折合532,434,414.99份淳厚欣颐基金份额，有效认购户数为8,844户。按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《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》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可交换债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%+经人民币汇率调整的中证港股通综合指数收益率×20%+中债综合全价（总值）指数收益率×30%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的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”）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



本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，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

以人民币为记账本位币，记账本位币单位为元。

##### 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商业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。

###### ① 债务工具

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：

###### 1) 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商业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。

###### 2) 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债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

###### ② 权益工具

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。

## (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以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衍生金融资产/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，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

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；

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。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于其他金融负债，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。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等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；

(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基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占净资产的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 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预期收益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，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），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) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除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利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

(8) 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

(1) 本基金的管理人报酬、托管费、销售服务费等按《基金合同》约定的方法进行计提。

(2) 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

(3) 其他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。

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。

#### 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,本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,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按除权后的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3) 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) 本基金每一基金份额享有同等分配权;

(5) 当日申购的基金份额自下一交易日起,享有基金的收益分配权益;当日赎回的基金份额自下一交易日起,不享有基金的收益分配权益;

(6) 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

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,本基金确定以下股票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,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)》,按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(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、可交换债券、可分离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《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、可交换债券、可分离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固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任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

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、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》、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》、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》、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号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作,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，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人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，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

5、基金卖出股票缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	3,477,781.30	1,538,355.02
等于：本金	3,476,964.36	1,537,974.94
加：应计利息	816.94	380.08
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	22,460,670.26	16,308,271.06
等于：本金	22,455,882.22	16,305,615.24
加：应计利息	4,788.04	2,655.82
减：坏账准备	-	-
合计	25,938,451.56	17,846,626.08

注：其他存款-本金本期期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 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	206,260,370.81	-	194,429,429.92	-11,830,940.89
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	206,260,370.81	-	194,429,429.92	-11,830,940.89
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	227,561,595.56	-	221,402,827.85	-6,158,767.71
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	113,830.14	13,089,130.14	-8,891.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	113,830.14	13,089,130.14	-8,891.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	240,545,786.56	113,830.14	234,491,957.99	-6,167,658.71

#### 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未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末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

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 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	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-

应付利息	-	-
预提费用-审计费	28,000.00	40,000.00
预提费用-信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	148,000.00	160,000.00

#### 7.4.7.6 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	245,533,990.16	245,533,990.16
本期申购	36,411,388.50	36,411,388.50
本期赎回（以“-”号填列）	-58,280,343.46	-58,280,343.46
本期末	223,665,035.20	223,665,035.20

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.7 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	12,878,001.13	-8,942,076.28	3,935,924.85
本期期初	12,878,001.13	-8,942,076.28	3,935,924.85
本期利润	7,217.85	-5,663,282.18	-5,656,064.33
本期基金份额交易产生的变动数	-2,529,382.64	383,466.02	-2,145,916.62
其中：基金申购款	2,097,291.65	735,668.29	2,832,959.94
基金赎回款	-4,626,674.29	-352,202.27	-4,978,876.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,355,836.34	-14,221,892.44	-3,866,056.10

#### 7.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年01月01日至2023年 12月31日	2022年01月01日至2022年 12月31日
活期存款利息收入	22,203.17	30,242.24
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	107,719.87	240,760.32
结算备付金利息收入	-	271.37
其他	-	-
合计	129,923.04	271,273.93

注：其他存款利息收入为券商保证金利息收入。

#### 7.4.7.9 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	350,148,694.33	1,159,822,345.28
减：卖出股票成本总额	349,643,542.62	1,198,678,744.53
减：交易费用	952,934.28	3,012,295.84
买卖股票差价收入	-447,782.57	-41,868,695.09

#### 7.4.7.10 债券投资收益

##### 7.4.7.10.1 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	150,621.50	170,369.13
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	15,271.36	601,372.47
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	165,892.86	771,741.60

#### 7.4.7.10.2 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	17,604,551.64	65,635,240.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,283,402.00	63,923,602.61
减：应计利息总额	305,811.64	1,108,968.36
减：交易费用	66.64	1,297.45
买卖债券差价收入	15,271.36	601,372.47

#### 7.4.7.11 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无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,506,752.10	3,103,167.51
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	4,506,752.10	3,103,167.51
----	--------------	--------------

**7.4.7.14 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	-5,663,282.18	-34,374,339.86
——股票投资	-5,672,173.18	-34,401,748.86
——债券投资	8,891.00	27,409.00
——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	-5,663,282.18	-34,374,339.86

**7.4.7.15 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。

**7.4.7.16 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	28,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-

合计	148,000.00	160,000.00
----	------------	------------

#### 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
淳厚基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
光大证券股份有限公司	基金托管人的主要关联方
邢媛	基金管理人股东
柳志伟	基金管理人股东
李雄厚	基金管理人股东
李文忠	基金管理人股东
董卫军	基金管理人股东
聂日明	基金管理人股东

注：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 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无应支付关联方的佣金。

#### 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	3,673,682.88	4,880,653.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,542,030.35	1,874,669.77
应支付基金管理人的净管理费	2,131,652.53	3,005,983.43

注：

- 1、从基金成立日至2023年8月13日，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数；
- 2、从2023年8月14日起，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数；
- 3、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年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	525,884.70	650,753.79



注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数；

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	0.00	5,001,638.89
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	5,001,638.89
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注：1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。  
2、本基金管理人运用固有资金申赎（包含转换）本基金所适用费率符合基金合同、招募说明书及相关公告的规定。

**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**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
邢媛	1,024,541.85	0.46%	1,013,434.54	0.41%

李雄厚	0.00	0.00%	99.05	0.00%
-----	------	-------	-------	-------

注：1、上表展示的比例系四舍五入后的结果。

2、本报告期及上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的适用费率符合基金合同、招募说明书及相关公告的规定。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年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
中国光大银行股份有限公司	3,477,781.30	22,203.17	1,538,355.02	30,242.24

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，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

金额单位：人民币元

本期 2023年01月01日至2023年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
光大证券股份有限公司	688535.SH	华海诚科	首次公开发行股票	1,607	56,245.00
光大证券股份有限公司	603125.SH	常青科技	首次公开发行股票	745	19,355.10
光大证券股份有限公司	301382.SZ	蜂助手	首次公开发行股票	2,448	58,262.40
上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日					

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
光大证券股份有限公司	301201.SZ	诚达药业	首次公开发行股票	2,517	182,960.73
光大证券股份有限公司	001268.SZ	联合精密	首次公开发行股票	409	7,873.25
光大证券股份有限公司	001222.SZ	源飞宠物	首次公开发行股票	434	5,950.14
光大证券股份有限公司	001256.SZ	炜冈科技	首次公开发行股票	474	6,465.36
光大证券股份有限公司	301297.SZ	富乐德	首次公开发行股票	10,147	86,046.56

**7.4.10.7 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。

**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
688717	艾罗	2023-12-26	5个	新股	55.66	55.66	4,110	228,762.60	228,762.60	-

	能源		交易 日	未上 市						
3013 48	蓝箭 电子	2023- 08-01	6个 月	创业 板打 新限 售	18.08	44.57	369	6,67 1.52	16,44 6.33	-
3014 88	豪恩 汽电	2023- 06-26	6个 月	创业 板打 新限 售	39.78	69.09	187	7,43 8.86	12,91 9.83	-
3013 81	赛维 时代	2023- 07-05	6个 月	创业 板打 新限 售	20.45	29.69	418	8,54 8.10	12,41 0.42	-
3015 26	国际 复材	2023- 12-19	6个 月	创业 板打 新限 售	2.66	4.45	2,559	6,80 6.94	11,38 7.55	-
3011 72	君逸 数码	2023- 07-19	6个 月	创业 板打 新限 售	31.33	38.16	292	9,14 8.36	11,14 2.72	-
6886 27	精智 达	2023- 07-11	6个 月	科创 板打 新限 售	46.77	87.72	127	5,93 9.79	11,14 0.44	-
6885 49	中巨 芯	2023- 08-30	6个 月	科创 板打 新限 售	5.18	8.09	1,288	6,67 1.84	10,41 9.92	-
6885 48	广钢 气体	2023- 08-08	6个 月	科创 板打 新限 售	9.87	12.75	810	7,99 4.70	10,32 7.50	-

3015 10	固高科技	2023- 08-04	6个 月	创业 板打 新限 售	12.00	35.01	291	3,49 2.00	10,18 7.91	-
3013 70	国科恒泰	2023- 07-03	6个 月	创业 板打 新限 售	13.39	16.01	620	8,30 1.80	9,92 6.20	-
3015 66	达利凯普	2023- 12-22	6个 月	创业 板打 新限 售	8.90	22.14	432	3,84 4.80	9,56 4.48	-
3014 99	维科精密	2023- 07-13	6个 月	创业 板打 新限 售	19.50	28.93	321	6,25 9.50	9,28 6.53	-
6885 63	航材股份	2023- 07-12	6个 月	科创 板打 新限 售	78.99	60.49	151	11,92 7.49	9,13 3.99	-
3015 16	中远通	2023- 12-01	6个 月	创业 板打 新限 售	6.87	15.51	575	3,95 0.25	8,91 8.25	-
3015 58	三态股份	2023- 09-21	6个 月	创业 板打 新限 售	7.33	13.40	648	4,74 9.84	8,68 3.20	-
6885 91	泰凌微	2023- 08-18	6个 月	科创 板打 新限 售	24.98	28.02	284	7,09 4.32	7,95 7.68	-
3012 91	明阳电气	2023- 06-21	6个 月	创业 板打	38.13	28.36	277	10,56 2.01	7,85 5.72	-

				新限售						
301413	安培龙	2023-12-11	6个月	创业板打新限售	33.25	58.19	134	4,45 5.50	7,79 7.46	-
688652	京仪装备	2023-11-22	6个月	科创板打新限售	31.95	52.25	145	4,63 2.75	7,57 6.25	-
688720	艾森股份	2023-11-29	6个月	科创板打新限售	28.03	49.84	151	4,23 2.53	7,52 5.84	-
301292	海科新源	2023-06-29	6个月	创业板打新限售	19.99	19.35	369	7,37 6.31	7,14 0.15	-
301272	英华特	2023-07-06	6个月	创业板打新限售	51.39	53.38	132	6,78 3.48	7,04 6.16	-
301533	威马农机	2023-08-07	6个月	创业板打新限售	29.50	33.16	209	6,16 5.50	6,93 0.44	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	创业板打新限售	57.88	45.48	150	8,68 2.00	6,82 2.00	-
301507	民生健康	2023-08-24	6个月	创业板打新限售	10.00	15.85	426	4,26 0.00	6,75 2.10	-

688651	盛邦安全	2023-07-19	6个月	科创板打新限售	39.90	46.05	146	5,825.40	6,723.30	-
301393	昊帆生物	2023-07-05	6个月	创业板打新限售	67.68	59.37	112	7,580.16	6,649.44	-
688702	盛科通信	2023-09-06	6个月	科创板打新限售	42.66	48.18	138	5,887.08	6,648.84	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	创业板打新限售	36.90	50.85	130	4,797.00	6,610.50	-
688653	康希通信	2023-11-10	6个月	科创板打新限售	10.50	15.99	413	4,336.50	6,603.87	-
301251	威尔高	2023-08-30	6个月	创业板打新限售	28.88	34.59	190	5,487.20	6,572.10	-
301508	中机认检	2023-11-23	6个月	创业板打新限售	16.82	26.68	246	4,137.72	6,563.28	-
301568	思泰克	2023-11-21	6个月	创业板打新限售	23.23	35.58	182	4,227.86	6,475.56	-
301489	思泉新材	2023-10-16	6个月	创业板打	41.66	64.11	100	4,166.00	6,411.00	-

				新限售						
301468	博盈特焊	2023-07-12	6个月	创业板打新限售	47.58	30.22	202	9,611.16	6,104.44	-
301517	陕西华达	2023-10-09	6个月	创业板打新限售	26.87	43.69	138	3,708.06	6,029.22	-
301418	协昌科技	2023-08-10	6个月	创业板打新限售	51.88	50.20	120	6,225.60	6,024.00	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	创业板打新限售	26.68	18.69	321	8,564.28	5,999.49	-
301519	舜禹股份	2023-07-19	6个月	创业板打新限售	20.93	20.21	293	6,132.49	5,921.53	-
688602	康鹏科技	2023-07-13	6个月	科创板打新限售	8.66	11.06	533	4,615.78	5,894.98	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6个月	创业板打新限售	31.90	39.84	144	4,593.60	5,736.96	-
301528	多浦乐	2023-08-17	6个月	创业板打新限售	71.80	68.91	83	5,959.40	5,719.53	-



301578	辰奕智能	2023-12-21	6个月	创业板打新限售	48.94	68.32	82	4,013.08	5,602.24	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	创业板打新限售	25.82	31.80	176	4,544.32	5,596.80	-
301456	盘古智能	2023-07-06	6个月	创业板打新限售	37.96	30.39	181	6,870.76	5,500.59	-
301550	斯菱股份	2023-09-06	6个月	创业板打新限售	37.56	43.57	125	4,695.00	5,446.25	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	6个月	创业板打新限售	55.68	37.58	132	7,349.76	4,960.56	-
688719	爱科赛博	2023-09-20	6个月	科创板打新限售	69.98	60.10	81	5,668.38	4,868.10	-
301529	福赛科技	2023-08-31	6个月	创业板打新限售	36.60	37.88	126	4,611.60	4,772.88	-
301525	儒竞科技	2023-08-23	6个月	创业板打新限售	99.57	81.46	58	5,775.06	4,724.68	-
301515	港通医疗	2023-07-13	6个月	创业板打	31.16	28.27	166	5,172.56	4,692.82	-

				新限售						
601096	宏盛华源	2023-12-15	6个月	新股锁定	1.70	4.06	1,139	1,936.30	4,624.34	-
688612	威迈斯	2023-07-19	6个月	科创板打新限售	47.29	37.97	119	5,627.51	4,518.43	-
301559	中集环科	2023-09-26	6个月	创业板打新限售	24.22	18.24	226	5,473.72	4,122.24	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6个月	创业板打新限售	67.88	52.74	77	5,226.76	4,060.98	-
688657	浩辰软件	2023-09-25	6个月	科创板打新限售	103.40	78.23	49	5,066.60	3,833.27	-
301548	崇德科技	2023-09-11	6个月	创业板打新限售	66.80	58.99	64	4,275.20	3,775.36	-
001239	永达股份	2023-12-04	6个月	新股锁定	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
688450	光格科技	2023-07-17	6个月	科创板打新限售	53.09	36.42	95	5,043.55	3,459.90	-
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6个月	新股锁定	15.32	23.87	136	2,083.52	3,246.32	-
603270	金帝	2023-08-25	6个月	新股	21.77	29.58	104	2,264.08	3,076.32	-

	股份		月	锁定						
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6个月	新股锁定	16.80	31.19	95	1,596.00	2,963.05	-
001306	夏厦精密	2023-11-09	6个月	新股锁定	53.63	75.36	38	2,037.94	2,863.68	-
603373	安邦护卫	2023-12-13	6个月	新股锁定	19.10	34.75	72	1,375.20	2,502.00	-
603107	上海汽配	2023-10-25	6个月	新股锁定	14.23	18.19	129	1,835.67	2,346.51	-
603193	润本股份	2023-10-09	6个月	新股锁定	17.38	16.66	129	2,242.02	2,149.14	-
603075	热威股份	2023-09-01	6个月	新股锁定	23.10	23.31	85	1,963.50	1,981.35	-
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6个月	新股锁定	21.29	21.53	87	1,852.23	1,873.11	-

#### 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证券款余额。

##### 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证券款余额。

#### 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

了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

#### **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。本基金投资于一家上市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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的托管行，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**

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

##### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

##### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

##### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，除在附注“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。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

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时关于未来现金流的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

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

2月31日					
资产					
货币资金	25,938,451.56	-	-	-	25,938,451.56
交易性金融资产	-	-	-	194,429,429.92	194,429,429.92
应收申购款	-	-	-	2,732.20	2,732.20
资产总计	25,938,451.56	-	-	194,432,162.12	220,370,613.68
负债					
应付赎回款	-	-	-	163,811.91	163,811.91
应付管理人报酬	-	-	-	222,705.14	222,705.14
应付托管费	-	-	-	37,117.53	37,117.53
其他负债	-	-	-	148,000.00	148,000.00
负债总计	-	-	-	571,634.58	571,634.58
利率敏感度缺口	25,938,451.56	-	-	193,860,527.54	219,798,979.10
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	17,846,626.08	-	-	-	17,846,626.08
交易性金融资产	13,089,130.14	-	-	221,402,827.85	234,491,957.99

应收申购款	-	-	-	2,145.38	2,145.38
资产总计	30,935,756.22	-	-	221,404,973.23	252,340,729.45
负债					
应付清算款	-	-	-	2,056,002.53	2,056,002.53
应付赎回款	-	-	-	285,913.45	285,913.45
应付管理人报酬	-	-	-	325,498.64	325,498.64
应付托管费	-	-	-	43,399.82	43,399.82
其他负债	-	-	-	160,000.00	160,000.00
负债总计	-	-	-	2,870,814.44	2,870,814.44
利率敏感度缺口	30,935,756.22	-	-	218,534,158.79	249,469,915.01

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。本基金于本报告期末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	41,723,188.01	-	41,723,188.01
资产合计	-	41,723,188.01	-	41,723,188.01
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	41,723,188.01	-	41,723,188.01
项目	上年度末 2022年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	29,163,596.89	-	29,163,596.89
资产合计	-	29,163,596.89	-	29,163,596.89
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	29,163,596.89	-	29,163,596.89

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
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
	所有港币均相对人民币升值5%	2,086,159.40	1,458,179.84
	所有港币均相对人民币贬值5%	-2,086,159.40	-1,458,179.84



### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

#### 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	194,429,429.92	88.46	221,402,827.85	88.75
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	13,089,130.14	5.25
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	194,429,429.92	88.46	234,491,957.99	94.00

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、假定业绩比较基准变化5%，其他市场变量不变；
	2、Beta系数是根据组合在过去一个年度的净值数据和业绩比较基准数据回

	归得出，对于成立不足一年的组合，取自成立以来的数据计算。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	12,698,344.36	14,292,293.89
	业绩比较基准下降5%	-12,698,344.36	-14,292,293.89

注：本基金管理人运用定量分析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，证券投资价格发生合理、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	193,757,354.41	220,978,272.90
第二层次	228,762.60	13,089,130.14
第三层次	443,312.91	424,554.95
合计	194,429,429.92	234,491,957.99

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于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。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。

**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	-	424,554.95	424,554.95
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	678,635.56	678,635.56
转出第三层次	-	847,203.89	847,203.89
当期利得或损失总额	-	187,326.29	187,326.29
其中：计入损益的利得或损失	-	187,326.29	187,326.29
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	443,312.91	443,312.91
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	-	80,589.66	80,589.66
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	-	3,126,205.81	3,126,205.81

当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	582,709.52	582,709.52
转出第三层次	-	2,972,565.01	2,972,565.01
当期利得或损失总额	-	-311,795.37	-311,795.37
其中：计入损益的利得或损失	-	-311,795.37	-311,795.37
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	424,554.95	424,554.95
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	-	-34,004.27	-34,004.27

**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
限售期股票	443,312.91	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.1462~2.1775	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
限售期股票	424,554.95	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.2127 - 2.4756	负相关

**7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金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

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	194,429,429.92	88.23
	其中：股票	194,429,429.92	88.23
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	25,938,451.56	11.77
8	其他各项资产	2,732.20	0.00
9	合计	220,370,613.68	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为41,723,188.01元，占基金总资产比例为18.93%。

#### 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	136,785,122.47	62.23
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	2,424,281.72	1.10
G	交通运输、仓储和邮政业	2,163,000.00	0.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,368,048.13	1.08
J	金融业	5,484,177.80	2.50
K	房地产业	635,664.00	0.29
L	租赁和商务服务业	2,502.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	10,624.26	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	5,921.53	0.00
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	2,826,900.00	1.29
	合计	152,706,241.91	69.48

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
原材料	524,837.31	0.24
非日常生活消费品	3,819,717.30	1.74
日常消费品	10,446,904.16	4.75
金融	624,680.10	0.28
信息技术	5,136,060.75	2.34
通讯业务	13,329,916.22	6.06

公用事业	5,064,863.58	2.30
房地产	2,776,208.59	1.26
合计	41,723,188.01	18.98

注:以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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	000921	海信家电	548,500	11,189,400.00	5.09
1	H00921	海信家电	250,000	3,819,717.30	1.74
2	H00700	腾讯控股	50,100	13,329,916.22	6.06
3	H00168	青岛啤酒股份	220,000	10,446,904.16	4.75
4	601126	四方股份	540,000	7,646,400.00	3.48
5	600885	宏发股份	256,206	7,081,533.84	3.22
6	000651	格力电器	220,100	7,080,617.00	3.22
7	002011	盾安环境	479,294	6,590,292.50	3.00
8	603589	口子窖	118,600	5,372,580.00	2.44
9	603369	今世缘	104,200	5,079,750.00	2.31
10	H00902	华能国际电力股份	1,350,000	5,064,863.58	2.30
11	002270	华明装备	320,000	4,518,400.00	2.06
12	002158	汉钟精机	191,500	4,262,790.00	1.94
13	001380	华纬科技	120,132	4,185,398.88	1.90
14	H03888	金山软件	180,000	3,931,182.36	1.79
15	601231	环旭电子	240,091	3,627,775.01	1.65
16	600519	贵州茅台	2,100	3,624,600.00	1.65
17	603297	永新光学	36,000	3,576,600.00	1.63
18	002595	豪迈科技	120,000	3,572,400.00	1.63

19	002402	和而泰	240,000	3,429,600.00	1.56
20	000858	五粮液	24,100	3,381,471.00	1.54
21	300627	华测导航	100,000	3,102,000.00	1.41
22	000333	美的集团	54,600	2,982,798.00	1.36
23	301377	鼎泰高科	120,000	2,838,000.00	1.29
24	000551	创元科技	270,000	2,826,900.00	1.29
25	002463	沪电股份	120,026	2,654,975.12	1.21
26	300396	迪瑞医疗	90,000	2,650,500.00	1.21
27	300415	伊之密	150,000	2,644,500.00	1.20
28	603855	华荣股份	130,000	2,594,800.00	1.18
29	603920	世运电路	140,000	2,559,200.00	1.16
30	002223	鱼跃医疗	70,000	2,420,600.00	1.10
31	601702	华峰铝业	134,000	2,405,300.00	1.09
32	000034	神州数码	80,000	2,392,800.00	1.09
33	601398	工商银行	500,000	2,390,000.00	1.09
34	603309	维力医疗	160,000	2,276,800.00	1.04
35	301093	华兰股份	70,000	2,261,000.00	1.03
36	600426	华鲁恒升	80,000	2,207,200.00	1.00
37	601006	大秦铁路	300,000	2,163,000.00	0.98
38	301160	翔楼新材	45,000	1,900,350.00	0.86
39	600030	中信证券	91,300	1,859,781.00	0.85
40	600887	伊利股份	67,200	1,797,600.00	0.82
41	002422	科伦药业	60,000	1,743,000.00	0.79
42	300750	宁德时代	10,200	1,665,252.00	0.76
43	600536	中国软件	45,000	1,631,700.00	0.74
44	603296	华勤技术	20,000	1,597,800.00	0.73
45	688581	安杰思	12,000	1,497,720.00	0.68
46	603203	快克智能	50,000	1,445,500.00	0.66
47	H06049	保利物业	52,400	1,367,594.73	0.62
48	300059	东方财富	87,920	1,234,396.80	0.56
49	688190	云路股份	15,000	1,074,450.00	0.49



50	300258	精锻科技	80,000	1,033,600.00	0.47
51	002983	芯瑞达	30,000	925,800.00	0.42
52	H06655	华新水泥	85,800	524,837.31	0.24
52	600801	华新水泥	29,000	360,470.00	0.16
53	688665	四方光电	10,000	737,600.00	0.34
54	H02382	舜宇光学科 技	11,300	725,524.26	0.33
55	300002	神州泰岳	80,000	708,000.00	0.32
56	002508	老板电器	30,000	653,400.00	0.30
57	H02318	中国平安	19,500	624,680.10	0.28
58	H03990	美的置业	116,200	565,475.84	0.26
59	600419	天润乳业	48,000	563,040.00	0.26
60	600690	海尔智家	25,000	525,000.00	0.24
61	H00968	信义光能	116,000	479,354.13	0.22
62	600048	保利发展	45,000	445,500.00	0.20
63	601865	福莱特	16,600	443,220.00	0.20
64	H02869	绿城服务	164,000	432,484.43	0.20
65	H03900	绿城中国	57,000	410,653.59	0.19
66	002080	中材科技	25,700	409,144.00	0.19
67	688717	艾罗能源	4,110	228,762.60	0.10
68	001914	招商积余	15,900	190,164.00	0.09
69	301348	蓝箭电子	369	16,446.33	0.01
70	301488	豪恩汽电	187	12,919.83	0.01
71	301381	赛维时代	418	12,410.42	0.01
72	301526	国际复材	2,559	11,387.55	0.01
73	301172	君逸数码	292	11,142.72	0.01
74	688627	精智达	127	11,140.44	0.01
75	688549	中巨芯	1,288	10,419.92	0.00
76	688548	广钢气体	810	10,327.50	0.00
77	301510	固高科技	291	10,187.91	0.00
78	301370	国科恒泰	620	9,926.20	0.00

79	301566	达利凯普	432	9,564.48	0.00
80	301499	维科精密	321	9,286.53	0.00
81	301558	三态股份	679	9,145.10	0.00
82	688563	航材股份	151	9,133.99	0.00
83	301516	中远通	575	8,918.25	0.00
84	688591	泰凌微	284	7,957.68	0.00
85	301291	明阳电气	277	7,855.72	0.00
86	301413	安培龙	134	7,797.46	0.00
87	688652	京仪装备	145	7,576.25	0.00
88	688720	艾森股份	151	7,525.84	0.00
89	301292	海科新源	369	7,140.15	0.00
90	301272	英华特	132	7,046.16	0.00
91	301533	威马农机	209	6,930.44	0.00
92	301210	金杨股份	150	6,822.00	0.00
93	301507	民生健康	426	6,752.10	0.00
94	688651	盛邦安全	146	6,723.30	0.00
95	301393	昊帆生物	112	6,649.44	0.00
96	688702	盛科通信	138	6,648.84	0.00
97	301261	恒工精密	130	6,610.50	0.00
98	688653	康希通信	413	6,603.87	0.00
99	301251	威尔高	190	6,572.10	0.00
100	301508	中机认检	246	6,563.28	0.00
101	301568	思泰克	182	6,475.56	0.00
102	301489	思泉新材	100	6,411.00	0.00
103	301468	博盈特焊	202	6,104.44	0.00
104	301517	陕西华达	138	6,029.22	0.00
105	301418	协昌科技	120	6,024.00	0.00
106	301529	福赛科技	157	6,008.23	0.00
107	301395	仁信新材	321	5,999.49	0.00
108	301519	舜禹股份	293	5,921.53	0.00
109	688602	康鹏科技	533	5,894.98	0.00

110	301459	丰茂股份	144	5,736.96	0.00
111	301528	多浦乐	83	5,719.53	0.00
112	301578	辰奕智能	82	5,602.24	0.00
113	301202	朗威股份	176	5,596.80	0.00
114	301456	盘古智能	181	5,500.59	0.00
115	301550	斯菱股份	125	5,446.25	0.00
116	301371	敷尔佳	132	4,960.56	0.00
117	688719	爱科赛博	81	4,868.10	0.00
118	301525	儒竞科技	58	4,724.68	0.00
119	301515	港通医疗	166	4,692.82	0.00
120	601096	宏盛华源	1,139	4,624.34	0.00
121	688612	威迈斯	119	4,518.43	0.00
122	301559	中集环科	226	4,122.24	0.00
123	301520	万邦医药	77	4,060.98	0.00
124	688657	浩辰软件	49	3,833.27	0.00
125	301548	崇德科技	64	3,775.36	0.00
126	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
127	688450	光格科技	95	3,459.90	0.00
128	603119	浙江荣泰	136	3,246.32	0.00
129	603270	金帝股份	104	3,076.32	0.00
130	603004	鼎龙科技	95	2,963.05	0.00
131	001306	夏厦精密	38	2,863.68	0.00
132	603373	安邦护卫	72	2,502.00	0.00
133	603107	上海汽配	129	2,346.51	0.00
134	603193	润本股份	129	2,149.14	0.00
135	603075	热威股份	85	1,981.35	0.00
136	603231	索宝蛋白	87	1,873.11	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	H00700	腾讯控股	15,492,372.89	6.21
2	603589	口子窖	9,676,358.36	3.88
3	002463	沪电股份	9,149,211.12	3.67
4	600131	国网信通	7,687,485.10	3.08
5	300033	同花顺	6,779,336.00	2.72
6	300770	新媒股份	6,016,084.00	2.41
7	601607	上海医药	5,820,653.00	2.33
8	601231	环旭电子	5,779,020.14	2.32
9	002011	盾安环境	5,727,411.40	2.30
10	600536	中国软件	5,357,501.50	2.15
11	H00168	青岛啤酒股份	5,292,751.02	2.12
12	H03888	金山软件	5,197,029.10	2.08
13	H00902	华能国际电力股份	5,143,497.62	2.06
14	002402	和而泰	4,438,246.00	1.78
15	603198	迎驾贡酒	4,135,090.00	1.66
16	301093	华兰股份	4,128,920.00	1.66
17	600845	宝信软件	4,025,628.00	1.61
18	601318	中国平安	3,957,986.00	1.59
19	001380	华纬科技	3,908,348.12	1.57
20	601126	四方股份	3,853,808.00	1.54

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（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	300033	同花顺	22,460,754.00	9.00
2	601669	中国电建	10,629,045.00	4.26
3	601607	上海医药	8,468,138.98	3.39
4	600536	中国软件	7,798,245.60	3.13
5	603369	今世缘	7,426,661.00	2.98
6	000921	海信家电	7,265,869.00	2.91
7	301153	中科江南	7,229,165.02	2.90
8	301306	西测测试	6,905,009.00	2.77
9	300073	当升科技	6,651,895.00	2.67
10	002463	沪电股份	6,320,384.00	2.53
11	002960	青鸟消防	6,177,502.50	2.48
12	300014	亿纬锂能	6,118,917.25	2.45
13	002908	德生科技	6,066,851.00	2.43
14	600131	国网信通	5,810,306.00	2.33
15	300770	新媒股份	5,675,296.00	2.27
16	600875	东方电气	5,584,137.00	2.24
17	002222	福晶科技	5,577,276.00	2.24
18	002311	海大集团	5,425,679.00	2.17
19	600223	福瑞达	5,281,425.35	2.12
20	600519	贵州茅台	5,036,833.00	2.02
21	002595	豪迈科技	5,018,105.00	2.01

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（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	328,342,317.87
卖出股票收入（成交）总额	350,148,694.33

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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 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收到公开谴责、处罚的情形**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

**8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

**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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,732.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,732.20

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 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
4,300	52,015.12	1,774,689.03	0.79%	221,890,346.17	99.21%

注：上表展示的比例系四舍五入后的结果。

#### 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	3,649,335.04	1.63%

注：上表展示的比例系四舍五入后的结果。

### 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年12月22日)基金份额总额	532,434,414.99
本报告期期初基金份额总额	245,533,990.16
本报告期基金总申购份额	36,411,388.50
减：本报告期基金总赎回份额	58,280,343.46
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	223,665,035.20

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人的重大人事变动：

根据本基金管理人2023年4月18日的公告，沈志婷女士担任督察长，谢芳女士离任督察长。

#### 2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，本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，未发生影响公司经营或基金运营业务的诉讼。本报告期内，无涉及本基金基金托管业务的诉讼事项。



### 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

上会会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2020年12月22日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付未付的审计费用为人民币28,000.00元整。

### 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，本基金管理人及其相关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，本基金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	
华创证券	1	261,966,325.92	39.05%	196,357.50	39.60%	-
大同证券	2	55,851,903.30	8.32%	41,390.83	8.35%	-
光大证券	2	233,326,330.95	34.78%	170,945.01	34.48%	-
湘财证券	2	119,770,721.28	17.85%	87,117.87	17.57%	-

注：1.根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。  
2.本报告期内，本基金停用兴业证券沪深两个交易单元。

**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
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	6,663,122.64	100.00%	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：1.根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。  
2.本报告期内，本基金停用兴业证券沪深两个交易单元。

**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	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金2022年第四季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-20
2	淳厚基金管理有限公司旗下基金2022年4季度报告提示性公告	《中国证券报》	2023-01-20
3	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
4	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31

5	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金2022年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
6	淳厚基金管理有限公司旗下基金2022年年度报告提示性公告	《中国证券报》	2023-03-31
7	淳厚基金管理有限公司关于调整旗下部分基金 2023 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-24
8	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金2023年第1季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-24
9	淳厚基金管理有限公司旗下基金2023年1季度报告提示性公告	《中国证券报》	2023-04-24
10	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-11
11	淳厚基金管理有限公司关于终止旗下基金在江西正融基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-12
12	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金2023年第2季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-07-21
13	淳厚基金管理有限公司旗下基金2023年2季度报告提示性公告	《中国证券报》	2023-07-21
14	淳厚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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-12
15	淳厚欣颐一年持有期混合型	基金管理人网站及中国证监	2023-08-12

	证券投资基金托管协议更新	会基金电子披露网站	
16	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金合同更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-12
17	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-16
18	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金招募说明书更新（2023年第1期）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-16
19	淳厚基金管理有限公司关于基金产品风险等级划分结果的更新公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-19
20	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金2023年中期报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-31
21	淳厚基金管理有限公司旗下基金2023年中期报告提示性公告	《中国证券报》	2023-08-31
22	淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金2023年第3季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-10-25
23	淳厚基金管理有限公司旗下基金2023年3季度报告提示性公告	《中国证券报》	2023-10-25
24	淳厚基金管理有限公司关于旗下部分基金2024年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-12-30

## §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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立淳厚基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金设立的文件；
- 3、《淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、《淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 存放地点

淳厚基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区丁香路778号丁香国际西塔7楼

### 13.3 查阅方式

上述文件可在淳厚基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到淳厚基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人淳厚基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-000-9738

网址：<http://www.purekindfund.com/>

淳厚基金管理有限公司

二〇二四年三月三十日