

# 新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人:新疆前海联合基金管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2023 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年3月24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。

本年度报告财务资料已经审计，致同会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2022年1月1日起至12月31日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
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.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§ 4 管理人报告.....	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
§ 5 托管人报告.....	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
§ 6 审计报告.....	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§ 7 年度财务报表.....	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§ 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.....	62
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.....	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	66
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 .....	66
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 .....	66
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 .....	66
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 .....	66
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	67
8.12 投资组合报告附注 .....	67
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>68</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	68
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 .....	68
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>69</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>69</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	69
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 .....	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
11.4 基金投资策略的改变 .....	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	70
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 .....	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	70
11.8 其他重大事件 .....	73
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>75</b>
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 .....	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	75
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>75</b>
13.1 备查文件目录 .....	75
13.2 存放地点 .....	75
13.3 查阅方式 .....	75

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金	
基金简称	前海联合价值优选混合	
基金主代码	009312	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 07 月 07 日	
基金管理人	新疆前海联合基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	848,136,599.11 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海联合价值优选混合 A	前海联合价值优选混合 C
下属分级基金的交易代码	009312	009313
报告期末下属分级基金的份额总额	718,870,407.12 份	129,266,191.99 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极优选具备利润创造能力并且估值水平具备竞争力的公司，同时通过优化风险收益配比以获取超额收益，力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	在价值创造主导的投资理念指导下，本基金的投资策略以自下而上的股票精选为主，同时也通过辅助性的主动类别资产配置，在投资组合中加入债券资产以降低整个资产组合的系统性风险。本基金充分发挥“自下而上”的主动选股能力，通过定量的业绩归因分析深入发掘主动性回报的相关信息，适当加大选股因素的贡献度，借助投资组合优化技术实现投资风险与收益的最佳配比。在宏观经济快速发展、市场化程度不断提高的过程中，行业经济秩序呈现出非均衡的特征，以价值增长为核心的公司更能在激烈的市场竞争中胜出，因此本基金以严格的价值创造评估为基础，遵循价值投资理念，在投资组合构建的具体过程中，坚持以具有估值优势和核心竞争优势的公司作为主要投资标的，并且在把握市场预期的前提下，更加精准地把握投资时机，从而实现价值投资基础上的优选策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，预期风险与预期收益水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新疆前海联合基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	邹文庆（代履职）	龚小武
	联系电话	0755-82780666	021-52629999-212056
	电子邮箱	service@qhlhfund.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		400-640-0099	95561
传真		0755-82780000	021-62159217
注册地址		新疆乌鲁木齐经济技术开发区维泰南路1号维泰大厦1506室	福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦
办公地址		深圳市南山区桂湾四路197号前海华润金融中心T1栋第28和29层	上海市浦东新区银城路167号4楼
邮政编码		518057	200120
法定代表人		邹文庆（代履职）	吕家进

## 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.qhlhfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	致同会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市朝阳区建国门外大街22号赛特广场5层
注册登记机构	新疆前海联合基金管理有限公司	深圳市南山区桂湾四路197号前海华润金融中心T1栋第28和29层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1 .1 期 间	2022 年		2021 年		2020 年 07 月 07 日（基金合同生效日）-2020 年 12 月 31 日	
	前海联合价值优选混合 A	前海联合价值优选混合	前海联合价值优选混合 A	前海联合价值优选混合	前海联合价值优选混合 A	前海联合价值优选混合

数据和指标		C		C		C
本期已实现收益	71,409,846.09	12,199,851.48	295,950,499.22	80,224,026.95	135,491,405.88	59,066,082.56
本期利润	-138,536,379.03	-26,096,821.06	156,890,862.22	47,324,938.23	305,712,500.25	139,311,275.81
加权平均基金份额本期利润	-0.1909	-0.1955	0.1939	0.2242	0.2402	0.2059
本期加权平均净值利润率	-15.26%	-15.76%	14.25%	16.60%	22.59%	19.59%
本期基金份额	-13.11%	-13.46%	14.33%	13.87%	26.02%	25.77%

额 净 值 增 长 率						
3.1 .2 期 末 数 据 和 指 标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期 末 可 供 分 配 利 润	181,080,540 .36	30,948,924. 25	324,584,889. 82	59,520,393. 71	115,708,600. 59	40,565,406. 63
期 末 可 供 分 配 基 金 份 额 利 润	0.2519	0.2394	0.4408	0.4322	0.1174	0.1152
期 末 基 金 资 产 净 值	899,950,947 .48	160,215,116 .24	1,060,884,44 8.38	197,234,823 .86	1,241,928,35 8.02	443,062,596 .88
期	1.2519	1.2394	1.4408	1.4322	1.2602	1.2577



末基金 份额 净值						
3.1 .3 累 计 期 末 指 标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金 份 额 累 计 净 值 增 长 率	25.19%	23.94%	44.08%	43.22%	26.02%	25.77%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或者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。

2、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。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

4、本基金的基金合同于 2020 年 7 月 7 日生效，截至 2020 年 12 月 31 日成立不满 1 年，故 2020 年年度数据与指标为不完整会计年度数据与指标。

## 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

#### 前海联合价值优选混合 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

		②		④		
过去三个月	6.47%	1.36%	1.15%	0.90%	5.32%	0.46%
过去六个月	-7.83%	1.24%	-9.60%	0.77%	1.77%	0.47%
过去一年	-13.11%	1.50%	-15.20%	0.90%	2.09%	0.60%
自基金合同生效起至今	25.19%	1.50%	-10.86%	0.86%	36.05%	0.64%

## 前海联合价值优选混合 C 净值表现

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	6.37%	1.36%	1.15%	0.90%	5.22%	0.46%
过去六个月	-8.02%	1.24%	-9.60%	0.77%	1.58%	0.47%
过去一年	-13.46%	1.50%	-15.20%	0.90%	1.74%	0.60%
自基金合同生效起至今	23.94%	1.50%	-10.86%	0.86%	34.80%	0.64%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×30%。

### 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

前海联合价值优选混合A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07月07日-2022年12月31日)

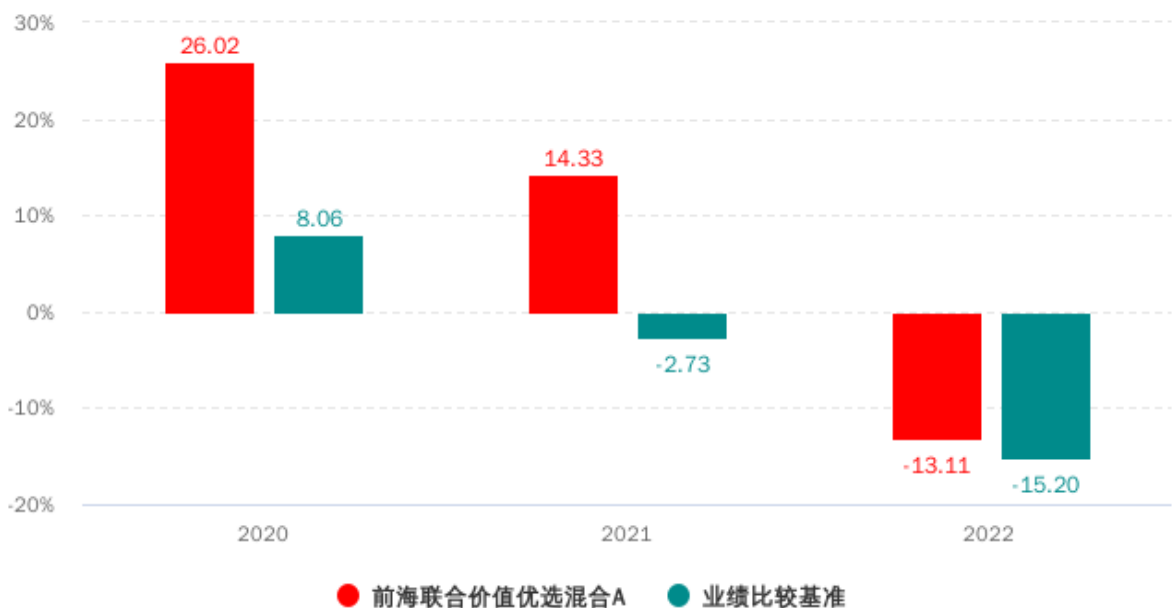


前海联合价值优选混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年07月07日-2022年12月31日)



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：本基金的基金合同于 2020 年 7 月 7 日生效，2020 年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

新疆前海联合基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监许可【2015】1842 号文批准，于 2015 年 8 月 7 日成立。公司注册资本 2 亿元人民币，股东结构为：深圳市钜盛华股份有限公司（30%）、深圳粤商物流有限公司（25%）、深圳市深粤控股股份有限公司（25%）、凯信恒有限公司（20%）。本公司总部位于广东省深圳市，已设立上海分公司、北京分公司、深圳分公司。本公司经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，本公司旗下共管理 29 只开放式基金，包括 2 只货币市场基金、12 只债券型基金、13 只混合型基金、1 只指数型基金和 1 只基金中基金（FOF），另管理 3 只专户理财产品，管理资产总规模超过 193 亿元人民币。

## 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		
张永任	本基金的基金经理，总经理助理、董事会秘书、权益投资部负责人、固定收益部负责人	2021-07-27	-	11年	张永任先生，博士，11年证券投资基金投资研究经验。曾任华西证券研究所行业研究员、四川金融资产交易所互联网金融部总经理、前海人寿资产管理中心投资经理、新疆前海联合先进制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2020年5月25日至2021年6月18日）、新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2021年7月27日至2022年10月31日）。现任新疆前海联合基金管理有限公司总经理助理、董事会秘书、权益投资部负责人、固定收益部负责人、新疆前海联合泳隼灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2020年5月12日起任职）和新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金的基金经理（自2021年7月27日起任职）。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”根据公司对外公告的解聘日期填写；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别根据公司对外公告的聘任日期和解聘日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

## 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和基金合同的规定，

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，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

### 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

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善了相应的制度和流程，通过系统和人工等各种方式在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，保护投资者合法权益。

本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

新冠病毒疫情一波三折、俄乌冲突地缘博弈、美联储超预期加息、人民币大幅贬值、机构资金流入阶段性波动、稳住经济大盘宏观与产业政策持续发力、国内外重要会议召开等因素是驱动 2022 全年市场走势的关键因素。受此影响，A 股市场全年下跌、震荡。指数方面，wind 全 A 下跌 18.66%，科创 50、中证 500、沪深 300、上证 50 分别下跌 31.35%、20.31%、21.63%、19.52%。行业方面，电子、计算机、国防军工、传媒、建材、电力设备等 10 个行业跌幅超过 20%；只有煤炭、餐饮旅游、交通运输等 3 个行业上涨。

本基金重点布局在新材料、锂电、光伏、大数据、信息安全、半导体、被动元器件、高端白酒、医疗设备、智能家电等相关细分领域，充分挖掘高质量发展大背景下细分行业龙头个股的结构性投资机会，并阶段性参与房地产、金融等深度价值个股，全年保持均衡配置、高仓位运作，受超预期因素冲击影响，本产品净值出现幅度较为明显的回撤，但跑赢主要市场指数。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合价值优选混合 A 基金份额净值为 1.2519 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-13.11%，同期业绩比较基准收益率为-15.20%；截至报告期末前海联合价值优选混合 C 基金份额净值为 1.2394 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-13.46%，同期业绩比较基准收益率为-15.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年，国内经济恢复的基础尚不牢固，需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力仍然较大，外部环境动荡不安，给国内经济带来的影响加深。但也要看到，我国经济韧性强、潜力大、活力足，各项政策效果持续显现，2023 年经济运行有望总体回升。另外，中央经济工作会议定调 2023 年经济工作坚持“稳字当头、稳中求进”，继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，加大宏观政策调控力度，加强各类政策协调配合，形成共促高质量发展合力。重点抓好着力扩大国内需求、加快建设现代化产业体系、切实落实“两个毫不动摇”、更大力度吸引和利用外资、有效防范化解重大经济金融风险等五项重点工作。其中，高质量发展作为全面建设社会主义现代化国家的首要任务。

从宏观经济基本面来看，2022 年我国经济在多重超预期因素反复冲击下，国务院及时出台稳经济一揽子政策，力促经济顶住压力企稳回升，全年实现了 3% 的 GDP 增长，经济总量达到 121 万亿元，按年均汇率计算，折合美元约 18 万亿美元，稳居世界第二位。从人均水平来看，达到 12741 美元，连续两年保持在 1.2 万美元以上。展望 2023 年，由于消费、地产投资对经济增长的支撑作用明显增强，净出口虽然将面临压力但韧性依然存在，同时考虑到低基数，预计 2023 年经济增速在 5% 左右。

具体分项来看，考虑到疫情逐步接近尾声、居民可支配收入增速不佳、2022 年低基数、收入预期改善等因素影响，2023 年消费增速将继续修复至 8%左右；基建投资有望持续发力、房地产投资增速由负转正、制造业投资维持温和复苏，2023 年固定资产投资增速小幅下滑至 5%左右；受外需走弱、产能替代效应消退、人民币走强、高基数等影响，出口增速全年-6%左右。物价方面，综合考虑 2023 年经济增速、货币政策环境、基数效应、猪价走势、疫后消费恢复、国内地产投资大概率回暖、欧美经济有增速下行压力、全球地缘冲突外溢影响等因素，全年 CPI 增速 2.0%左右，PPI 全年均值 0.0%，不会成为影响市场走势的主要因素。从中长期来看，人均 GDP 超过 1.2 万美元接近世界银行所划的高收入国家门槛、GDP 突破 120 万亿元人民币成为全球第二大经济体是当前我们面临的最重要的国情。从全要素生产率水平横向比较，我国仍处于并将长期处于重要战略机遇期，以创新驱动的高质量发展足够支撑经济保持中高速。

从证券市场来看，资本市场正成为推动科技创新和实体经济转型升级的枢纽，随着 2022 年黑天鹅、灰犀牛等突发事件对 A 股市场造成的冲击，市场下行风险大幅减弱，结构日益改善，市场活力和韧性明显增强。随着陆港通全面建立、MSCI 持续提升中国权重、公募保险等机构规模持续增长，截至 2022 年底，北上、公募、险资三类机构持仓 A 股市值已达 13.73 万亿元，约占 A 股总市值（79.01 万亿）的 17%左右，机构主导的价值投资生态越来越成熟。长期以来我国居民的资产配置结构明显偏向房产，股票、偏股型基金等权益类资产仅占 2%，低于美国的 34%、德国的 12%、日本的 9%，从大类资产配置的角度看，居民权益资产配置需求空间较大。当前 A 股市场整体估值在 18 倍附近，正好处于近 10 年以来的中位数水平，在经济基本面相对确定的背景下，具有较好的风险收益比，存在良好的配置价值。

从行业配置方向来看，“加快构建新发展格局与着力推动高质量发展”已经成为中国经济发展的顶层设计，年度中央经济工作会议又把“恢复和扩大消费摆在优先位置，加快建设现代产业体系、保证产业体系自主可控与安全可靠、大力发展数字经济等”作为经济发展的优先方向，所以，看好可选消费、高端制造、数字经济等符合产业发展趋势以及受益于政策边际改善的深度价值这四大方向。具体到细分行业，相对看好新能源、新材料、创新药、元宇宙、半导体、美容护理、医疗服务、餐饮旅游、可选商品、智能制造等领域。个股上，主要精选所处细分赛道长、竞争格局好、自身有一定壁垒与竞争优势、业绩增长趋势较为确定、当前估值相对合理的细分领域龙头个股。理念上，将继续秉承“深度研究发现价值+长期投资分享价值”的理念，通过“构建均衡组合与持续动态优化”，充分享受上市公司业绩增长带来的价值创造。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从保护基金份额持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保基金运作符合法律法规和基金合同的要求。公司监察稽核部通过合规审核、实时监控及专项检查等方法，对基金运作和公司管理进行独立的监察稽核，及时发现风险隐患，提出整改建议，并督促跟踪业务部门进行整改。

本报告期内，本基金管理人对公司内控制度与业务流程进行了检视与修订，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展



的合规性和制度执行的有效性；通过事前防范、事中控制和事后监督，加强对日常投资运作的监控，督促投研交易业务的合规开展；积极组织法律法规和职业道德培训，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况；保证各项信息披露的真实性、准确性和完整性；监督客户服务工作，保障投资者合法权益。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金的安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人的基金估值由基金会计负责，基金会计以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及账务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管人双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管人进行核对；每日估值结果必须与托管人核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。配备的基金会计具备基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了较为丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策的估值小组，由运营分管高管、投研分管高管、基金运营部负责人、研究发展部负责人、信用研究部负责人、监察稽核部负责人、风险管理部负责人及其他指定人员组成，分别具有投资研究、风险管理、估值核算等方面的专业经验。基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。

本报告期内，参与估值流程各方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

无。

#### 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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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	致同审字（2023）第 441A004722 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	新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金（以下简称“前海联合价值优选混合基金”）的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允

	反映了前海联合价值优选混合基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。
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，我们独立于前海联合价值优选混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	前海联合价值优选混合基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)的管理层对其他信息负责。其他信息包括前海联合价值优选混合基金 2022 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估前海联合价值优选混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算前海联合价值优选混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督前海联合价值优选混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的

	<p>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。</p> <p>(3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据所获取的审计证据,就可能对前海联合价值优选混合基金的持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致前海联合价值优选混合基金不能持续经营。(5)评价财务报表的总体列报、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就基金的审计范围、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	致同会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	桑涛	谭瑛红
会计师事务所的地址	北京市朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 层	
审计报告日期	2023-03-28	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体:新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金

报告截止日:2022 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	34,705,122.88	21,063,929.73
结算备付金		58,242.66	7,266,581.29
存出保证金		105,675.35	421,671.81
交易性金融资产	7.4.7.2	1,027,220,967.93	1,178,081,752.75
其中:股票投资		976,220,690.58	1,108,032,752.75
基金投资		-	-
债券投资		51,000,277.35	70,049,000.00
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	-	60,000,000.00
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	36,098.62
应收股利		-	-
应收申购款		27,323.12	156,143.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	1,200,375.92
资产总计		1,062,117,331.94	1,268,226,553.21
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<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		-	6,372,152.29
应付赎回款		76,569.30	1,174,632.11
应付管理人报酬		1,356,186.92	1,616,157.26
应付托管费		226,031.14	269,359.55
应付销售服务费		53,439.28	69,099.33
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	239,041.58	605,880.43
负债合计		1,951,268.22	10,107,280.97
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	848,136,599.11	874,013,988.71
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	212,029,464.61	384,105,283.53
净资产合计		1,060,166,063.72	1,258,119,272.24
负债和净资产总计		1,062,117,331.94	1,268,226,553.21

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 848,136,599.11 份。其中前海联合价值优选混合 A 基金份额净值 1.2519 元，基金份额总额 718,870,407.12 份；前海联合价值优选混合 C 基金份额净值 1.2394 元，基金份额总额 129,266,191.99 份。

## 7.2 利润表

会计主体：新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-144,985,996.41	237,310,692.61
1. 利息收入		265,747.98	3,483,500.68
其中：存款利息收入	7.4.7.9	112,112.33	187,794.46
债券利息收入		-	1,900,304.11
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		153,635.65	1,395,402.11
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		102,958,523.70	404,833,830.10
其中：股票投资收益	7.4.7.10	90,328,415.09	396,137,859.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	1,835,802.35	289,960.00
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	10,794,306.26	8,406,011.05
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
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	-248,242,897.66	-171,958,725.72
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	32,629.57	952,087.55
<b>减：二、营业总支出</b>		19,647,203.68	33,094,892.16
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	16,099,381.61	20,885,741.24
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,683,230.22	3,480,956.88
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	662,735.00	1,150,733.56
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		0.81	-
8. 其他费用	7.4.7.19	201,856.04	7,577,460.48
<b>三、利润总额（亏损总额以</b>		-164,633,200.09	204,215,800.45

“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-164,633,200.09	204,215,800.45
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-164,633,200.09	204,215,800.45

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	874,013,988.71	-	384,105,283.53	1,258,119,272.24
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	874,013,988.71	-	384,105,283.53	1,258,119,272.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-25,877,389.60	-	-172,075,818.92	-197,953,208.52
（一）、综合收益总额	-	-	-164,633,200.09	-164,633,200.09
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-25,877,389.60	-	-7,442,618.83	-33,320,008.43
其中：1. 基金申购款	54,503,461.32	-	13,790,111.45	68,293,572.77
2. 基金赎回款	-80,380,850.92	-	-21,232,730.28	-101,613,581.20
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	848,136,599.11	-	212,029,464.61	1,060,166,063.72
项目	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基	1,337,813,837.52	-	347,177,117.38	1,684,990,954.90

金净值)				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,337,813,837.52	-	347,177,117.38	1,684,990,954.90
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-463,799,848.81	-	36,928,166.15	-426,871,682.66
(一)、综合收益总额	-	-	204,215,800.45	204,215,800.45
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-463,799,848.81	-	-167,287,634.30	-631,087,483.11
其中：1.基金申购款	333,399,120.50	-	122,178,565.74	455,577,686.24
2.基金赎回款	-797,198,969.31	-	-289,466,200.04	-1,086,665,169.35
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	874,013,988.71	-	384,105,283.53	1,258,119,272.24

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：

邹文庆

党刚

陈艳

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

新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据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]480号《关于准予新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金注册的批复》进行募集,由新疆前海联合基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,473,708,123.52元,业经致同会计师事务所(特殊普通合伙)验字(2020)第441ZC00198号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金合同》于2020年7月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,474,643,568.40份基金份额,其中认购资金利息折合935,444.88份基金份额。本基金的基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。



根据《新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金合同》，本基金根据认(申)购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。收取认购费、申购费并根据持有期限收取赎回费，不收取销售服务费的，称为 A 类基金份额；收取销售服务费并根据持有期限收取赎回费，不收取认购费及申购费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券等）、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、衍生工具（股指期货、国债期货）、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 60%-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×30%。

本财务报表由本基金的基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司于 2023 年 3 月 28 日批准报出。

#### 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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号（年度报告和中期报告）》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 新金融工具准则

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

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 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：

##### 以摊余成本计量：

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

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 权益工具

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

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及其他金融负债。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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利

率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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

##### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分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。

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，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(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度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债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》、《企业会计准则第24号——套期会计》及《企业会计准则第37号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，财政部于2022年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14号)，中国证监会于2022年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，对2021年度比较财务报表数据不予调整。于2021年12月31日及2022年1月1日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收证券清算款、应收申购款、应收股利和应收利息，金额分别为 21,063,929.73 元、7,266,581.29 元、421,671.81 元、60,000,000.00 元、36,098.62 元、156,143.09 元、0.00 元和 1,200,375.92 元；新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收清算款、应收申购款、应收股利和其他资产-应收利息，金额分别为 21,065,239.47 元、7,270,178.40 元、421,880.59 元、59,972,926.04 元、36,098.62 元、156,143.09 元、0.00 元、1,200,375.92 元；原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,178,081,752.75 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,179,304,087.00 元；原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 6,372,152.29 元、1,174,632.11 元、1,616,157.26 元、269,359.55 元、69,099.33 元、446,243.84 元、159,636.59 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 6,372,152.29 元、1,174,632.11 元、1,616,157.26 元、269,359.55 元、69,099.33 元、446,243.84 元、159,636.59 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

#### (b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、



财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	34,705,122.88	21,063,929.73
等于：本金	34,701,825.69	21,063,929.73
加：应计利息	3,297.19	-
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	34,705,122.88	21,063,929.73

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,145,867,084.34	-	976,220,690.58	-169,646,393.76
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	50,073,943.00	1,015,276.35	51,000,277.35	-88,942.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	50,073,943.00	1,015,276.35	51,000,277.35	-88,942.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,195,941,027.34	1,015,276.35	1,027,220,967.93	-169,735,335.76
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,029,608,840.85	-	1,108,032,752.75	78,423,911.90
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	69,965,350.00	-	70,049,000.00	83,650.00
	合计	69,965,350.00	-	70,049,000.00	83,650.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,099,574,190.85	-	1,178,081,752.75	78,507,561.90

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

#### 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 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	60,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	60,000,000.00	-

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

## 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	1,200,375.92
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	1,200,375.92

## 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	7.25	136.59
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	50,534.33	446,243.84
其中：交易所市场	50,534.33	446,243.84
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	188,500.00	159,500.00
合计	239,041.58	605,880.43

## 7.4.7.7 实收基金

## 前海联合价值优选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	736,299,558.56	736,299,558.56
本期申购	18,491,879.92	18,491,879.92
本期赎回（以“-”号填列）	-35,921,031.36	-35,921,031.36
本期末	718,870,407.12	718,870,407.12

## 前海联合价值优选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	137,714,430.15	137,714,430.15
本期申购	36,011,581.40	36,011,581.40
本期赎回（以“-”号填列）	-44,459,819.56	-44,459,819.56
本期末	129,266,191.99	129,266,191.99

注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

## 7.4.7.8 未分配利润

## 前海联合价值优选混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	348,408,897.87	-23,824,008.05	324,584,889.82
本期利润	71,409,846.09	-209,946,225.12	-138,536,379.03
本期基金份额交易产生的变动数	-8,549,152.84	3,581,182.41	-4,967,970.43
其中：基金申购款	9,395,625.45	-4,700,231.43	4,695,394.02
基金赎回款	-17,944,778.29	8,281,413.84	-9,663,364.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	411,269,591.12	-230,189,050.76	181,080,540.36

## 前海联合价值优选混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	63,918,918.46	-4,398,524.75	59,520,393.71
本期利润	12,199,851.48	-38,296,672.54	-26,096,821.06
本期基金份额交易产生的变动数	-4,086,009.06	1,611,360.66	-2,474,648.40
其中：基金申购款	17,694,798.67	-8,600,081.24	9,094,717.43
基金赎回款	-21,780,807.73	10,211,441.90	-11,569,365.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	72,032,760.88	-41,083,836.63	30,948,924.25

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	78,947.87	64,379.31
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	29,720.03	111,395.48
其他	3,444.43	12,019.67
合计	112,112.33	187,794.46

## 7.4.7.10 股票投资收益

## 7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	721,625,714.16	2,983,083,666.15
减：卖出股票成本总额	629,312,429.46	2,586,945,807.10
减：交易费用	1,984,869.61	-
买卖股票差价收入	90,328,415.09	396,137,859.05

## 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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	1,280,711.18	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	555,091.17	289,960.00
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	1,835,802.35	289,960.00

## 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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	104,991,723.30	122,182,839.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	101,908,350.00	119,713,170.00
减：应计利息总额	2,528,228.91	2,179,709.59
减：交易费用	53.22	-
买卖债券差价收入	555,091.17	289,960.00

## 7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

## 7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.13 贵金属投资收益

## 7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.14 衍生工具收益

## 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	10,794,306.26	8,406,011.05
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	10,794,306.26	8,406,011.05

## 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022	上年度可比期间 2021 年 01 月
------	---------------------------	---------------------

	年 12 月 31 日	01 日至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-248,242,897.66	-171,958,725.72
——股票投资	-248,070,305.66	-171,905,395.72
——债券投资	-172,592.00	-53,330.00
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-248,242,897.66	-171,958,725.72

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	32,593.25	950,330.48
转换费收入	36.32	1,757.07
合计	32,629.57	952,087.55

#### 7.4.7.18 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	30,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	18,000.00	22,500.00
银行汇划费	-	16,072.27
交易费用	-	7,388,888.21
其他费用	3,856.04	-
合计	201,856.04	7,577,460.48

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
新疆前海联合基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
深圳粤商物流有限公司	基金管理人的股东
深圳市深粤控股股份有限公司	基金管理人的股东
凯信恒有限公司	基金管理人的股东
深圳市钜盛华股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述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

无。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理	16,099,381.61	20,885,741.24

费		
其中：支付销售机构的客户维护费	2,302,248.73	4,036,228.94

注：支付基金管理人新疆前海联合的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,683,230.22	3,480,956.88

注：支付基金托管人兴业银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合价值优选混合 A	前海联合价值优选混合 C	合计
新疆前海联合基金管理有限公司	-	733.44	733.44
兴业银行股份有限公司	-	542,683.00	542,683.00
合计	-	543,416.44	543,416.44
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合价值优选混合 A	前海联合价值优选混合 C	合计
新疆前海联合基金管理有限公司	-	2,169.91	2,169.91
兴业银行股份有限公司	-	891,539.35	891,539.35
合计	-	893,709.26	893,709.26

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给新疆前海联合，再由新疆前海联合计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X 0.40% / 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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 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
兴业银行股份有限公司	34,705,122.88	78,947.87	21,063,929.73	64,379.31

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 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

无。

## 7.4.12 期末（2022 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	证	成功	受限	流	认购价	期末估	数量	期末成本总	期末估值总	备

码	券名称	认购日	期	通受限类型	格	值单价	(单位:股)	额	额	注
688387	信科移动	2022年09月19日	6个月	科创板新股锁定	6.05	4.88	98,399	595,313.95	480,187.12	-
688114	华大智造	2022年09月02日	6个月	科创板新股锁定	87.18	105.05	3,694	322,042.92	388,054.70	-
688506	百利天恒	2022年12月28日	7个交易日	新股流通受限	24.70	24.70	15,622	385,863.40	385,863.40	-
688237	超卓航科	2022年06月24日	6个月	科创板新股锁定	41.27	55.67	2,668	110,108.36	148,527.56	-
688370	从麟科技	2022年08月17日	6个月	科创板新股锁定	59.76	34.87	3,254	194,459.04	113,466.98	-
688132	邦彦技术	2022年09月16日	6个月	科创板新股	28.88	22.80	4,844	139,894.72	110,443.20	-

				锁定							
688420	美腾科技	2022年12月01日	6个月	科创板新股锁定	48.96	39.04	2,408	117,895.68	94,008.32	-	
688203	海正生材	2022年08月09日	6个月	科创板新股锁定	16.68	15.09	5,486	91,506.48	82,783.74	-	
301269	华大九天	2022年07月21日	6个月	创业板新股锁定	32.69	87.94	919	30,042.11	80,816.86	-	
688525	佰维存储	2022年12月23日	6个月	科创板新股锁定	13.99	15.27	4,614	64,549.86	70,455.78	-	
301308	江波龙	2022年07月27日	6个月	创业板新股锁定	55.67	56.72	819	45,593.73	46,453.68	-	
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	创业板新股锁定	50.88	66.20	662	33,682.56	43,824.40	-	

301327	华宝新能	2022年09月08日	6个月	创业板新股锁定	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301175	中科环保	2022年06月30日	6个月	创业板新股锁定	3.82	6.01	6,370	24,333.40	38,283.70	-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	创业板新股锁定	119.88	175.78	211	25,294.68	37,089.58	-
301195	北路智控	2022年07月25日	6个月	创业板新股锁定	71.17	73.04	300	21,351.00	21,912.00	-
301330	熵基科技	2022年08月10日	6个月	创业板新股锁定	43.32	31.31	694	30,064.08	21,729.14	-
301389	隆扬电子	2022年10月18日	6个月	创业板新股锁定	22.50	17.16	1,242	27,945.00	21,312.72	-
301152	天力	2022年08	6个月	创业	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-

	锂能	月 19 日		板新股锁定							
301171	易点天下	2022 年 08 月 10 日	6 个月	创业板新股锁定	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-	
301115	建科股份	2022 年 08 月 23 日	6 个月	创业板新股锁定	42.05	24.04	650	27,332.50	15,626.00	-	
301296	新巨丰	2022 年 08 月 26 日	6 个月	创业板新股锁定	18.19	14.90	1,042	18,953.98	15,525.80	-	
301223	中荣股份	2022 年 10 月 13 日	6 个月	创业板新股锁定	26.28	18.13	815	21,418.20	14,775.95	-	
301121	紫建电子	2022 年 08 月 01 日	6 个月	创业板新股锁定	61.07	49.77	290	17,710.30	14,433.30	-	
301339	通行宝	2022 年 09 月 02 日	6 个月	创业板新	18.78	15.59	881	16,545.18	13,734.79	-	

				股 锁 定							
301328	维峰电子	2022 年 08 月 30 日	6 个月	创业 板 新 股 锁 定	78.80	76.96	174	13,711.20	13,391.04	-	
301335	天元宠物	2022 年 11 月 11 日	6 个月	创业 板 新 股 锁 定	49.98	33.82	392	19,592.16	13,257.44	-	
301297	富乐德	2022 年 12 月 23 日	6 个月	创业 板 新 股 锁 定	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85	-	
301311	昆船智能	2022 年 11 月 23 日	6 个月	创业 板 新 股 锁 定	13.88	15.86	795	11,034.60	12,608.70	-	
301280	珠城科技	2022 年 12 月 19 日	6 个月	创业 板 新 股 锁 定	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-	
301365	矩阵股份	2022 年 11 月 14 日	6 个月	创业 板 新 股 锁 定	34.72	23.87	516	17,915.52	12,316.92	-	



				定						
301366	一博科技	2022年09月19日	6个月	创业板新股锁定	65.35	45.09	263	17,187.05	11,858.67	-
301132	满坤科技	2022年08月03日	6个月	创业板新股锁定	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301277	新天地	2022年11月09日	6个月	创业板新股锁定	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301282	金禄电子	2022年08月18日	6个月	创业板新股锁定	30.38	25.25	434	13,184.92	10,958.50	-
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	创业板新股锁定	44.09	35.13	308	13,579.72	10,820.04	-
301283	聚胶股份	2022年08月26日	6个月	创业板新股锁定	52.69	51.41	210	11,064.90	10,796.10	-
301379	天	2022	6个月	创	31.51	24.63	427	13,454.77	10,517.01	-

	山电子	年 10 月 19 日		业板新股锁定						
301273	瑞晨环保	2022 年 10 月 11 日	6 个月	创业板新股锁定	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-
301227	森鹰窗业	2022 年 09 月 16 日	6 个月	创业板新股锁定	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301326	捷邦科技	2022 年 09 月 09 日	6 个月	创业板新股锁定	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74	-
301197	工大科雅	2022 年 07 月 29 日	6 个月	创业板新股锁定	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-
301161	唯万密封	2022 年 09 月 06 日	6 个月	创业板新股锁定	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301318	维海德	2022 年 08 月 03 日	6 个月	创业板	64.68	41.74	180	11,642.40	7,513.20	-

		日		新股 锁定							
301276	嘉曼服饰	2022年09月01日	6个月	创业板新股 锁定	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-	
301313	凡拓数创	2022年09月22日	6个月	创业板新股 锁定	25.25	29.14	232	5,858.00	6,760.48	-	
301368	丰立智能	2022年12月07日	6个月	创业板新股 锁定	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-	
301300	远翔新材	2022年08月09日	6个月	创业板新股 锁定	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-	
301388	欣灵电气	2022年10月26日	6个月	创业板新股 锁定	25.88	21.60	275	7,117.00	5,940.00	-	
301231	荣信文化	2022年08月31日	6个月	创业板新股	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-	

				锁定						
301233	盛帮股份	2022年06月24日	6个月	创业板新股锁定	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301309	万得凯	2022年09月08日	6个月	创业板新股锁定	39.00	24.46	219	8,541.00	5,356.74	-
301319	唯特偶	2022年09月22日	6个月	创业板新股锁定	47.75	53.27	94	4,488.50	5,007.38	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 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

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 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

本基金是一只混合型基金，其风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券等）、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、衍生工具（股指期货、国债期货）、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立了由董事会风险控制委员会、经营层投资风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层层面设立投资风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等问题向总经理提供咨询意见和建议；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部和风险管理部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人兴业银行。对于定期银行存款，本基金通过选择具备适当信用水平的银行作为交易对手、平衡信用风险与投资收益率、综合参考内外部信用评级信息评价及调整投资限额，

管理相关信用风险并定期评估减值损失。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	51,000,277.35	70,049,000.00
合计	51,000,277.35	70,049,000.00

注：1、短期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债、政策性金融债。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的市值未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2022 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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受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对于未来现金流影响的风险。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年12 月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	34,705,122.88	-	-	-	34,705,122.88
结算备付金	58,242.66	-	-	-	58,242.66
存出保证金	105,675.35	-	-	-	105,675.35
交易性金融资产	51,000,277.35	-	-	976,220,690.58	1,027,220,967.93
应收申购款	-	-	-	27,323.12	27,323.12
资产总计	85,869,318.24	-	-	976,248,013.70	1,062,117,331.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	76,569.30	76,569.30
应付管理人报酬	-	-	-	1,356,186.92	1,356,186.92
应付托管费	-	-	-	226,031.14	226,031.14
应付销售服务费	-	-	-	53,439.28	53,439.28
其他负债	-	-	-	239,041.58	239,041.58
负债总计	-	-	-	1,951,268.22	1,951,268.22
利率敏感度缺口	85,869,318.24	-	-	974,296,745.48	1,060,166,063.72
上年度末 2021年12	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计



月 31 日					
资产					
银行存款	21,063,929.73	-	-	-	21,063,929.73
结算备付金	7,266,581.29	-	-	-	7,266,581.29
存出保证金	421,671.81	-	-	-	421,671.81
交易性金融资产	70,049,000.00	-	-	1,108,032,752.75	1,178,081,752.75
买入返售金融资产	60,000,000.00	-	-	-	60,000,000.00
应收清算款	-	-	-	36,098.62	36,098.62
应收申购款	-	-	-	156,143.09	156,143.09
其他资产	-	-	-	1,200,375.92	1,200,375.92
资产总计	158,801,182.83	-	-	1,109,425,370.38	1,268,226,553.21
负债					
应付清算款	-	-	-	6,372,152.29	6,372,152.29
应付赎回款	-	-	-	1,174,632.11	1,174,632.11
应付管理人报酬	-	-	-	1,616,157.26	1,616,157.26
应付托管费	-	-	-	269,359.55	269,359.55
应付销售服务费	-	-	-	69,099.33	69,099.33
其他负债	-	-	-	605,880.43	605,880.43
负债总计	-	-	-	10,107,280.97	10,107,280.97
利率敏感度缺口	158,801,182.83	-	-	1,099,318,089.41	1,258,119,272.24

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

于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.81%(2021 年 12 月 31 日：5.66%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 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

的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的60%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付、存出保证及应收申购款等；国债期货、股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律和监管机构的规定。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	976,220,690.58	92.08	1,108,032,752.75	88.07
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	976,220,690.58	92.08	1,108,032,752.75	88.07

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1. 沪深 300 指数上升	55,231,981.85	62,284,934.59

	5%		
	2. 沪深 300 指数下降	-55,231,981.85	-62,284,934.59
	5%		

#### 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	973,622,727.72	1,105,811,383.64
第二层次	51,386,140.75	70,429,229.35
第三层次	2,212,099.46	1,841,139.76
合计	1,027,220,967.93	1,178,081,752.75

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,841,139.76	1,841,139.76
当期购买	-	3,065,398.10	3,065,398.10
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,901,595.47	1,901,595.47

当期利得或损失总额	-	-792,842.93	-792,842.93
其中：计入损益的利得或损失	-	-792,842.93	-792,842.93
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,212,099.46	2,212,099.46
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	-	-174,468.59	-174,468.59
项目	上年度可比同期 2021 年 01 月 01 日至 2021 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	-	4,217,507.02	4,217,507.02
当期购买	-	1,797,892.28	1,797,892.28
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,580,379.89	2,580,379.89
当期利得或损失总额	-	-1,593,879.65	-1,593,879.65
其中：计入损益的利得或损失	-	-1,593,879.65	-1,593,879.65
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,841,139.76	1,841,139.76
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	-	618,374.34	618,374.34

注：于报告期末，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于报告期内，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 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	2,212,099.46	平均价格 亚式期权 模型	预期年化波动率	14.44%至 165%	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	1,841,139.76	平均价格 亚式期权 模型	预期年化波动率	31.38%至 274.17%	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

无。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	976,220,690.58	91.91
	其中：股票	976,220,690.58	91.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	51,000,277.35	4.80
	其中：债券	51,000,277.35	4.80
	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	34,763,365.54	3.27
8	其他各项资产	132,998.47	0.01
9	合计	1,062,117,331.94	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	902,619,451.18	85.14
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	73,221,860.73	6.91
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	178,199.09	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	151,750.68	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	43,824.40	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	976,220,690.58	92.08

### 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通过港股通机制投资港股。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600309	万华化学	1,000,000	92,650,000.00	8.74
2	300750	宁德时代	200,000	78,684,000.00	7.42
3	002439	启明星辰	2,801,900	73,073,552.00	6.89
4	000977	浪潮信息	3,299,937	71,014,644.24	6.70
5	601012	隆基股份	1,599,806	67,607,801.56	6.38
6	600690	海尔智家	2,600,000	63,596,000.00	6.00

7	300760	迈瑞医疗	170,000	53,714,900.00	5.07
8	300782	卓胜微	460,712	52,659,381.60	4.97
9	000636	风华高科	3,500,731	51,915,840.73	4.90
10	000858	五粮液	250,000	45,172,500.00	4.26
11	002415	海康威视	1,199,951	41,614,300.68	3.93
12	688180	君实生物-U	630,039	39,440,441.40	3.72
13	600745	闻泰科技	700,000	36,806,000.00	3.47
14	300724	捷佳伟创	290,000	33,065,800.00	3.12
15	603986	兆易创新	310,000	31,765,700.00	3.00
16	002648	卫星化学	1,999,834	30,997,427.00	2.92
17	002460	赣锋锂业	400,104	27,811,229.04	2.62
18	300558	贝达药业	500,000	24,635,000.00	2.32
19	300725	药石科技	180,084	14,496,762.00	1.37
20	603501	韦尔股份	161,500	12,450,035.00	1.17
21	688153	唯捷创芯	257,083	9,442,658.59	0.89
22	688235	百济神州	60,000	7,947,000.00	0.75
23	600276	恒瑞医药	200,000	7,706,000.00	0.73
24	603236	移远通信	50,000	5,041,000.00	0.48
25	688387	信科移动	98,399	480,187.12	0.05
26	688114	华大智造	3,694	388,054.70	0.04
27	688506	百利天恒	15,622	385,863.40	0.04
28	301297	富乐德	10,147	150,256.17	0.01
29	688237	超卓航科	2,668	148,527.56	0.01
30	688370	从麟科技	3,254	113,466.98	0.01
31	688132	邦彦技术	4,844	110,443.20	0.01
32	688496	清越科技	12,000	108,960.00	0.01
33	688420	美腾科技	2,408	94,008.32	0.01
34	688203	海正生材	5,486	82,783.74	0.01
35	301269	华大九天	919	80,816.86	0.01
36	688525	佰维存储	4,614	70,455.78	0.01
37	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.01
38	301308	江波龙	819	46,453.68	0.00
39	301267	华夏眼科	662	43,824.40	0.00
40	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
41	301175	中科环保	6,370	38,283.70	0.00
42	301367	怡和嘉业	211	37,089.58	0.00
43	301195	北路智控	300	21,912.00	0.00
44	301330	熵基科技	694	21,729.14	0.00
45	301389	隆扬电子	1,242	21,312.72	0.00
46	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
47	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
48	301115	建科股份	650	15,626.00	0.00
49	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00

50	301223	中荣股份	815	14,775.95	0.00
51	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
52	301339	通行宝	881	13,734.79	0.00
53	301328	维峰电子	174	13,391.04	0.00
54	301335	天元宠物	392	13,257.44	0.00
55	301311	昆船智能	795	12,608.70	0.00
56	301280	珠城科技	279	12,499.20	0.00
57	301365	矩阵股份	516	12,316.92	0.00
58	301366	一博科技	263	11,858.67	0.00
59	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
60	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
61	301282	金禄电子	434	10,958.50	0.00
62	301290	东星医疗	308	10,820.04	0.00
63	301283	聚胶股份	210	10,796.10	0.00
64	301379	天山电子	427	10,517.01	0.00
65	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
66	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
67	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
68	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
69	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
70	301318	维海德	180	7,513.20	0.00
71	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
72	301313	凡拓数创	232	6,760.48	0.00
73	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
74	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
75	301388	欣灵电气	275	5,940.00	0.00
76	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
77	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
78	301309	万得凯	219	5,356.74	0.00
79	301319	唯特偶	94	5,007.38	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	300750	宁德时代	54,101,306.00	4.30
2	601012	隆基股份	50,059,344.08	3.98
3	000636	风华高科	49,293,135.28	3.92
4	002876	三利谱	47,437,389.40	3.77
5	300782	卓胜微	47,192,733.72	3.75
6	600745	闻泰科技	44,629,802.88	3.55
7	688180	君实生物-U	44,290,603.54	3.52



8	000977	浪潮信息	43,283,131.78	3.44
9	300724	捷佳伟创	35,802,333.00	2.85
10	002648	卫星化学	31,119,758.41	2.47
11	300558	贝达药业	25,988,661.50	2.07
12	600309	万华化学	23,950,218.16	1.90
13	603501	韦尔股份	20,456,018.00	1.63
14	300725	药石科技	16,679,388.88	1.33
15	002460	赣锋锂业	15,295,606.00	1.22
16	600585	海螺水泥	14,680,383.00	1.17
17	603236	移远通信	12,727,127.70	1.01
18	688153	唯捷创芯	12,531,875.40	1.00
19	300760	迈瑞医疗	12,306,350.12	0.98
20	000999	华润三九	12,252,348.00	0.97

注：买入金额按成交金额（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	002876	三利谱	76,149,926.53	6.05
2	300724	捷佳伟创	71,720,917.07	5.70
3	600519	贵州茅台	64,057,174.32	5.09
4	001979	招商蛇口	63,528,245.10	5.05
5	000001	平安银行	52,462,614.00	4.17
6	603236	移远通信	48,245,580.10	3.83
7	600438	通威股份	42,635,170.00	3.39
8	600104	上汽集团	28,238,420.14	2.24
9	603882	金域医学	26,955,659.00	2.14
10	000858	五粮液	25,250,824.00	2.01
11	601186	中国铁建	16,185,320.00	1.29
12	002460	赣锋锂业	16,063,155.60	1.28
13	603218	日月股份	15,823,091.88	1.26
14	000999	华润三九	15,702,493.00	1.25
15	300999	金龙鱼	14,545,611.10	1.16
16	002466	天齐锂业	14,223,439.34	1.13
17	600741	华域汽车	12,825,485.00	1.02
18	600585	海螺水泥	12,487,154.00	0.99
19	300014	亿纬锂能	11,873,383.00	0.94
20	601318	中国平安	8,614,344.00	0.68

注：卖出金额按成交金额（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	745,570,672.95
卖出股票收入（成交）总额	721,625,714.16

注：买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额均按买卖成交金额（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	51,000,277.35	4.81
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	51,000,277.35	4.81

## 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	019666	22 国债 01	499,900	51,000,277.35	4.81

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

## 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

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 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

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 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受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有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。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

### 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	105,675.35
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	27,323.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	132,998.47

### 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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
前海联合价值优选混合 A	5,969	120,433.98	604,010,362.56	84.02%	114,860,044.56	15.98%
前海联合价值优选混合 C	5,133	25,183.36	7,211,779.49	5.58%	122,054,412.50	94.42%
合计	10,913	77,718.01	611,222,142.05	72.07%	236,914,457.06	27.93%

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	前海联合价值优选混合 A	188,002.01	0.0262%
	前海联合价值优选混合 C	93,619.72	0.0724%
	合计	281,621.73	0.0332%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	前海联合价值优选混合 A	0~10
	前海联合价值优选混合 C	0~10
	合计	10~50

本基金基金经理持有本开放式基金	前海联合价值优选混合 A	0
	前海联合价值优选混合 C	0~10
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	前海联合价值优选混合 A	前海联合价值优选混合 C
基金合同生效日（2020 年 07 月 07 日）基金份额总额	1,454,867,238.81	1,019,776,329.59
本报告期期初基金份额总额	736,299,558.56	137,714,430.15
本报告期基金总申购份额	18,491,879.92	36,011,581.40
减：本报告期基金总赎回份额	35,921,031.36	44,459,819.56
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	718,870,407.12	129,266,191.99

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

无。

### 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、以下为基金管理人变动信息：

本报告期内，吴昱村先生因个人原因无法履行总经理职务，经公司第二届董事会 2022 年第 5 次临时会议审议通过，邹文庆先生代为履行公司总经理、法定代表人职责；经公司第二届董事会 2022 年第 7 次临时会议审议通过，聘任党刚先生担任公司副总经理；经公司第二届董事会 2022 年第 8 次临时会议审议通过，聘任邹文庆先生担任公司副总经理；经公司第二届董事会 2022 年第 8 次临时会议审议通过，邱张斌先生不再担任公司合规负责人（督察长）职务，由邹文庆先生代为履行公司合规负责人（督察长）职责。

2、本报告期内，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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未有重大改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计服务的会计师事务所为致同会计师事务所（特殊普通合伙），本基金本年度应支付的审计费用为人民币 60,000.00 元。该事务所自基金成立以来为本基金提供审计服务至今，本报告期内无改聘会计师事务所的事项。

#### 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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人、高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 04 月 01 日
采取稽查或处罚等措施的机构	深圳证监局
受到的具体措施类型	责令改正等相关行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人高度重视，已按法律法规和监管要求及时进行了整改，并已提交整改报告
其他	无

##### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券股份有限公司	2	549,434,853.00	38.34%	401,803.16	38.34%	-
申万宏源	1	460,188,280.08	32.11%	336,535.39	32.11%	-
金元证	1	231,256,610.07	16.14%	169,118.61	16.14%	-

券						
海通证券股份有限公司	1	158,558,948.97	11.06%	115,954.75	11.06%	-
国信证券股份有限公司	2	33,768,259.35	2.36%	24,695.17	2.36%	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
南京证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1. 根据中国证监会《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《交易单元及券商研究服务评价管理办法》：

（1）券商选择标准：

- 1) 实力雄厚，信誉良好；内部管理规范，严格；注册资本符合证监会相关要求；
- 2) 研究实力较强，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；
- 3) 券商利用其他专业研究咨询机构为公司提供研究与支持服务的，对该券商研究方面的要求按照上述第 2 点规定执行；

## (2) 券商选择程序:

- 1) 券商研究质量与研究服务评价;
  - 2) 拟定租用对象。由研究发展部根据券商选择标准拟定备选的券商;
  - 3) 上报批准。研究发展部将拟定租用对象上报分管领导批准;
  - 4) 签约。在获得批准后, 按公司签约程序代表公司与确定券商签约。
2. 本报告期内增加交易单元: 申万宏源证券有限公司、金元证券股份有限公司。本报告期内退租交易单元: 无。

## 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
长江证券股份有限公司	52,559,723.30	63.62%	674,000,000.00	58.41%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	30,055,943.00	36.38%	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	480,000,000.00	41.59%	-	-	-	-



公司								
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	前海联合基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-01-04
2	关于新疆前海联合基金管理有限公司旗下公募基金产品开通转托管业务的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-01-10
3	前海联合价值优选混合型证券	上海证券报、中国证监会基金	2022-01-24

	投资基金 2021 年第四季度报告	电子披露网站及基金管理人网站	
4	新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金_2021 年年度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-03-30
5	新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金_2022 年第一季度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-04-22
6	前海联合基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司和北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-04-25
7	新疆前海联合基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-05-09
8	新疆前海联合基金管理有限公司关于终止深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-05-09
9	新疆前海联合基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-05-13
10	新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金 2022 年第二季度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-07-21
11	新疆前海联合基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-07-22
12	新疆前海联合基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-07-23
13	新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金 2022 年中期报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-08-30
14	新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金_2022 年第三季度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-10-26
15	关于新疆前海联合基金管理有限公司深圳分公司负责人变更的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022-11-12
16	关于新疆前海联合基金管理有限公司上海分公司负责人变更	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2022-12-07

的公告	站
-----	---

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220101-20221231	300,052,333.33	-	-	300,052,333.33	35.38%
	2	20220101-20221231	300,052,333.33	-	-	300,052,333.33	35.38%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注：报告期内申购份额包含红利再投份额。

### 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、中国证监会核准新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金净值信息及其他临时公告。

### 13.2 存放地点

除上述第 6 项文件存放于基金托管人处外，其他备查文件等文本存放于基金管理人处。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支

付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

新疆前海联合基金管理有限公司

二〇二三年三月三十日