

联博智选混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：联博基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2024 年 08 月 28 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。本中期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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 04 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 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	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8	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	12
§ 5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1	资产负债表	13
6.2	利润表	14
6.3	净资产变动表	15
6.4	报表附注	16
§ 7	投资组合报告	38
7.1	期末基金资产组合情况	39
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3	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	40
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	43
7.6	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	43
7.7	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	43
7.8	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	43
7.9	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	43
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	44
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44

7.12	投资组合报告附注	44
§ 8	基金份额持有人信息	45
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.3	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	45
§ 9	开放式基金份额变动	45
§ 10	重大事件揭示	46
10.1	基金份额持有人大会决议	46
10.2	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	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4	基金投资策略的改变	46
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	46
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	46
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8	其他重大事件	47
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	48
11.1	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	48
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	48
§ 12	备查文件目录	48
12.1	备查文件目录	48
12.2	存放地点	49
12.3	查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	联博智选混合型证券投资基金	
基金简称	联博智选混合	
基金主代码	020842	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 04 月 01 日	
基金管理人	联博基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	499,800,861.63 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	联博智选混合 A	联博智选混合 C
下属分级基金的交易代码	020842	020843
报告期末下属分级基金的份额总额	259,836,911.45 份	239,963,950.18 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要采自下而上的选股方式，结合基本面研究与量化分析，投资价值被低估的上市公司，并在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金以价值投资作为核心理念，主要投资价值被低估、并具备正向催化剂的高质量企业。基金管理人通过对上市公司的深度基本面研究与量化分析，挑选长期盈利能力遭低估的公司，并识别这类公司是否存在使市场重估其价值的正向催化剂，精选出具备投资价值的优质上市公司进行投资。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>3、金融衍生品投资策略</p> <p>4、存托凭证投资策略</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>6、参与融资业务投资策略</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*90%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）*10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，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		联博基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	方芳	方圆
	联系电话	021-80276528	95559

	话		
	电子邮箱	Kelly.Fang@alliancebernstein.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		4000011300	95559
传真		021-52560862-9999	021-62701216
注册地址		中国上海市静安区石门一路 288 号兴业太古汇香港兴业中心二座 16 楼 1606 室	中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		中国上海市静安区石门一路 288 号兴业太古汇香港兴业中心二座 16 楼 1606 室	中国(上海)长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200041	200336
法定代表人		钱峰	任德奇

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	https://www.alliancebernstein.com.cn/
基金中期报告备置地点	基金管理人办公场所及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	联博基金管理有限公司	中国上海市静安区石门一路 288 号兴业太古汇香港兴业中心二座 16 楼 1606 室

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2024 年 04 月 01 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日）	
	联博智选混合 A	联博智选混合 C
本期已实现收益	-2,255,343.22	-2,377,296.71
本期利润	-5,924,203.00	-5,759,320.83
加权平均基金份额本期利润	-0.0228	-0.0240
本期加权平均净值利润率	-2.27%	-2.39%
本期基金份额净值增长率	-2.28%	-2.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
	联博智选混合 A	联博智选混合 C
期末可供分配利润	-5,924,203.00	-5,759,320.83
期末可供分配基金份额利润	-0.0228	-0.0240
期末基金资产净值	253,912,708.45	234,204,629.35
期末基金份额净值	0.9772	0.9760
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	

	联博智选混合 A	联博智选混合 C
基金份额累计净值增长率	-2.28%	-2.40%

注：1、本基金合同生效日为 2024 年 04 月 01 日，截至报告期末基金合同生效未满半年。

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与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、上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

联博智选混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.08%	0.70%	-3.81%	0.51%	1.73%	0.19%
自基金合同生效起至今	-2.28%	0.79%	-2.92%	0.75%	0.64%	0.04%

联博智选混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.13%	0.70%	-3.81%	0.51%	1.68%	0.19%
自基金合同生效起至今	-2.40%	0.79%	-2.92%	0.75%	0.52%	0.04%

注：本基金合同于 2024 年 04 月 01 日生效，截至本报告期末基金合同生效不满一年。

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

联博智选混合 A



联博智选混合 C



注：1、本基金合同于 2024 年 04 月 01 日生效，截至本报告期末基金合同生效不满一年。
 2、按照本基金基金合同约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至本报告期末本基金尚处于建仓期内。

§ 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

联博基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）于 2021 年 9 月 3 日成立。公司经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2023 年 3 月 3 日《关于核准设立联博基金管理有限公司的批复》（证监许可[2023]464 号）核准设立，并于 2023 年 12 月 29 日取得中国证监会核发的《中华人民共和国经营证券期货业务许可证》。公司股东为联博香港有限公司，注册资本为人民币 30000 万元。

截至 2024 年 06 月 30 日，公司公开募集证券投资基金资产管理规模为人民币 4.88 亿元，包括联博智选混合型证券投资基金 1 只产品。

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		
朱良	本基金的基金经理、董事、副总经理、投资总监	2024 年 04 月 01 日	-	20 年	朱良于 2006 年加入联博集团，现任联博基金管理有限公司董事、副总经理、投资总监，负责投资管理等相关事务。曾任联博汇智（上海）海外投资基金管理有限公司投资组合经理；联博管理咨询（上海）有限公司（曾用名：联博汇智（上海）投资管理有限公司）股票投资部投资总监、投资组合经理；联博香港有限公司亚太量化研究负责人；联博集团上海代表处资深量计分析师；光大保德信基金管理有限公司高级组合分析师；天同基金管理有限公司基金经理；美国梅隆资本管理公司（Mellon Capital Management LTD）投资研究部高级经理。朱良拥有美国匹兹堡大学经济学硕士，北京大学

					数学系基础数学学士。
--	--	--	--	--	------------

注：1. 此处的任职日期和离职日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从中国证监会《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》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、规范性文件要求和本基金基金合同约定，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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作无违法违规、未履行基金合同或其他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 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司建立了公平交易相关制度体系，使得不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格控制公平交易执行，确保所有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。

本报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部相关公平交易制度等规定。公司对各投资组合公平对待，不存在不公平交易或利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 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

本基金成立于 2024 年 4 月 1 日，2024 年二季度 A 股历经了先涨后跌的震荡市，4 月中旬新“国

九条”发布后激励了市场信心；然而，随着国内宏观数据强弱参差、加上海外美元利率居高不下等因素导致股市陷入震荡，并伴随成交量萎缩。

本基金将持续坚持以价值投资策略稳健运作，关注经营稳健、现金流健康、重视投资者回报的企业，持续保持出口优势的企业，以及自主消费类板块。与此同时，本基金将继续坚持自下而上的方法构造投资组合，并对宏观因素进行中性化处理，保持投资组合的分散度，以应对市场热点分散的状况。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末联博智选混合 A 份额净值为 0.9772 元，本报告期联博智选混合 A 份额净值增长率为-2.28%，同期业绩比较基准收益率为-2.92%；截至本报告期末联博智选混合 C 份额净值为 0.9760 元，本报告期联博智选混合 C 份额净值增长率为-2.40%，同期业绩比较基准收益率为-2.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然市场短期震荡，但我们看好 A 股后市的立场不变，主要理由是：(1) 市场情绪见底、(2) 估值水平偏低、(3) 改革政策发力。

首先，市场情绪通常会领先宏观基本面率先见底，历史经验显示，市场情绪见底后 A 股的投资胜率有望提高。

其次，估值偏低虽不保证市场立刻反弹，但对于预判股市中长期的走势还是有一定的参考性。根据历史经验，当估值被严重低估时，虽然无法预测股市的短期回报，但时间稍微拉长来看，投资胜率预计将提高。

再者，我们认为新“国九条”的发布预示着 A 股市场的新变化。2004 年发布的“国九条”基本塑造了现代 A 股市场，2014 年发布的“国九条”引发了新兴成长公司的 IPO 热潮。最新发布的“国九条”，监管机构的关注重点更加贴近成熟市场，旨在提升上市公司质量，推进上市公司治理结构的制度性改革，不断强化、细化上市公司对投资者回报的责任与义务。从周边市场类似政策推出所取得的成功经验来看，我们认为这将成为提升中国股市长期可投资性的关键因素。

最后，从投资策略来看，“外循环”与“内循环”将同样重要。我们从全球资本市场的发展路径

也学习到，“外循环”与“内循环”并进的的经验也曾出现在日本 1990 年代房地产调整期。日本股市在 1995-2013 年期间，表现较好的板块大部份是以出口为主导，包括：医疗设备与仪器、汽车与零部件、科技、耐用消费品与服饰等。

而目前海外市场的宏观环境也相当稳健，包括：美国经济仍相对强劲、甚至有经济过热的通胀问题(但通胀已改善)，欧洲经济也明显回升，日本也摆脱长期的通货紧缩。更重要的是，全球制造业的去库存周期似乎已经结束，目前正处于回补库存的复苏阶段，这对我国的制造业，特别是以出口为导向的上市企业无疑是个强心针。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，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。日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会审核和决定投资资产估值的相关事务，确保基金估值的公允、合理，切实维护基金持有人利益。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金的基金合同等规定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未实施利润分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同的规定实施利润分配。

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在联博智选混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，联博基金管理有限公司在联博智选混合型证券投资基金投资运作、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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由联博基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关联博智选混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：联博智选混合型证券投资基金
报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日
资产：		
货币资金	6.4.7.1	33,900,559.12
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	448,091,240.14
其中：股票投资		448,091,240.14
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	6,851,771.33
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		488,843,570.59
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日
负债：		

短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		486,357.96
应付托管费		81,059.66
应付销售服务费		97,244.28
应付投资顾问费		-
应交税费		352.46
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	61,218.43
负债合计		726,232.79
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	499,800,861.63
未分配利润	6.4.7.8	-11,683,523.83
净资产合计		488,117,337.80
负债和净资产总计		488,843,570.59

注：1、报告截止日 2024 年 06 月 30 日，联博智选混合 A 基金份额净值 0.9772 元，基金份额总额 259,836,911.45 份；联博智选混合 C 基金份额净值 0.9760 元，基金份额总额 239,963,950.18 份。联博智选混合份额总额合计为 499,800,861.63 份。

2、本基金合同生效日为 2024 年 04 月 01 日，财务报表的实际编制期间为 2024 年 04 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日，无上年度末数据。

6.2 利润表

会计主体：联博智选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 04 月 01 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2024 年 04 月 01 日（基金合同生效日） 至 2024 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-9,598,010.50
1. 利息收入		125,112.44
其中：存款利息收入	6.4.7.9	74,014.78
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		51,097.66
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,672,239.04

其中：股票投资收益	6.4.7.10	-10,385,144.03
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	7,712,904.99
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-7,050,883.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-
减：二、营业总支出		2,085,513.33
1. 管理人报酬		1,480,740.76
2. 托管费		246,790.14
3. 销售服务费		296,128.32
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		183.96
8. 其他费用	6.4.7.17	61,670.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-11,683,523.83
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-11,683,523.83
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-11,683,523.83

注：本基金合同生效日为 2024 年 04 月 01 日，财务报表的实际编制期间为 2024 年 04 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日，无上年度可比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：联博智选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 04 月 01 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 04 月 01 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本年期初净资产	499,800,861.63	-	499,800,861.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-11,683,523.83	-11,683,523.83

(一)、综合收益总额	-	-11,683,523.83	-11,683,523.83
(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)	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	499,800,861.63	-11,683,523.83	488,117,337.80

注:本基金合同生效日为 2024 年 04 月 01 日,财务报表的实际编制期间为 2024 年 04 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日,无上年度可比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>钱峰</u>	<u>Bing Li</u>	<u>龚黎</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

联博智选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[2024]第 278 号《关于准予联博智选混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由联博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《联博智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基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 499,653,220.03 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2024)第 0101 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《联博智选混合型证券投资基金基金合同》于 2024 年 4 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 499,800,861.63 份基金份额,其中认购资金利息折合 147,641.60 份基金份额。本基金的基金管理人为联博基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《联博智选混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、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,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《联博智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、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（包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债以及其他法律法规、中国证监会允许投资的债券）、金融衍生品（股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单及货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为 60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×90%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人联博基金管理有限公司于 2024 年 08 月 27 日批准报出。

6.4.2 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》及其他相关规定（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》、《联博智选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 04 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 04 月 01 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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、金融负债或权益工具。

(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。

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。

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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且

将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券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。

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后的净额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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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、债券投资和资产支持证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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
活期存款	33,311,194.19
等于：本金	33,304,533.50

加：应计利息	6,660.69
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	589,364.93
等于：本金	589,314.78
加：应计利息	50.15
合计	33,900,559.12

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用资金账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	455,142,124.04	-	448,091,240.14	-7,050,883.90
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	455,142,124.04	-	448,091,240.14	-7,050,883.90

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,851,771.33	-
银行间市场	-	-
合计	6,851,771.33	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30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	-
应付审计费	19,854.38
应付信息披露费	41,364.05
合计	61,218.43

6.4.7.7 实收基金

联博智选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年04月01日(基金合同生效日)至2024 年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	259,836,911.45	259,836,911.45
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	259,836,911.45	259,836,911.45

联博智选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 04 月 01 日(基金合同生效日)至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	239,963,950.18	239,963,950.18
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	239,963,950.18	239,963,950.18

注：本基金合同生效日为 2024 年 04 月 01 日。本基金自 2024 年 03 月 11 日至 2024 年 03 月 28 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 499,653,220.03 元，折合为 499,653,220.03 份基金份额(其中 A 类基金份额为 259,742,334.49 份，C 类基金份额为 239,910,885.54 份)。根据《联博智选混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 147,641.60 元在本基金成立后，折合为 147,641.60 份基金份额(其中 A 类基金份额 94,576.96 份，C 类基金份额 53,064.64 份)，划入基金份额持有人账户。

6.4.7.8 未分配利润

联博智选混合 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-2,255,343.22	-3,668,859.78	-5,924,203.00
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,255,343.22	-3,668,859.78	-5,924,203.00

联博智选混合 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-2,377,296.71	-3,382,024.12	-5,759,320.83
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,377,296.71	-3,382,024.12	-5,759,320.83

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 04 月 01 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	69,659.32
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,355.46
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	74,014.78

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用资金账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 04 月 01 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	172,930,214.73
减：卖出股票成本总额	182,574,727.73
减：交易费用	740,631.03
买卖股票差价收入	-10,385,144.03

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年04月01日(基金合同生效日)至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	7,712,904.99
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	7,712,904.99

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年04月01日(基金合同生效日)至2024年06月30日
1. 交易性金融资产	-7,050,883.90
--股票投资	-7,050,883.90
--债券投资	-
--资产支持证券投资	-
--基金投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2. 衍生工具	-
--权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-7,050,883.90

6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年04月01日(基金合同生效日)至2024年06月30日
审计费用	19,854.38
信息披露费	41,364.05
证券出借违约金	-
存托服务费	51.72
证券开户费	400.00
合计	61,670.15

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
联博基金管理有限公司（“联博基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 04 月 01 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,480,740.76
其中：应支付销售机构的客户维护费	729,322.54
应支付基金管理人的净管理费	751,418.22

注：支付基金管理人联博基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 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 × 1.20% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 04 月 01 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	246,790.14

注：支付基金托管人交通银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 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 2024 年 04 月 01 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	联博智选混合 A	联博智选混合 C	合计
交通银行股份有限公司	-	98,740.49	98,740.49
合计	-	98,740.49	98,740.49

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给联博基金管理有限公司，再由联博基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 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

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

本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未持有过本基金份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 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 2024 年 04 月 01 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	33,311,194.19	69,659.32

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末 2024 年 06 月 30 日本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金未因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了分工明确、相互制约的风险管理组织架构体系。公司的风险管理组织架构体系由公司董事会、监事会、董事会风险控制委员会、公司管理层及其风险管理委员会、督察长、风控部、监察稽核部以及各个业务部门和全体员工共同组成。

董事会负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略，审议重大事件、重大决策的风险评估，审批重大风险解决方案，批准公司基本风险管理制度，对维持有效的公司风险管理框架承担最终责任。董事会下设风险控制委员会，负责审查公司监察稽核、风险管理工作情况，负责对公司合规管理制度、风险管理制度的执行情况进行监督。公司管理层负责风险管理制度的制定，在董事会授权范围内审批重大事件的风险评估意见和解决方案，组织各部门实施风险解决方案和开展风险管理工作，对有效的风险管理承担直接责任。公司管理层下设风险管理委员会，根据董事会和管理层的授权开展风险管理工作。督察长通过监察稽核部和风控部对风险控制措施的执行情况进行监督，并对各个部门和员工实施的相关制度和控制措施提出建议。风控部负责就风险问题提供指导和建议，负责评估、监控、检查和报告公司风险管理状况，执行公司的风险管理战略和决策，定性和定量评估风险。公司各业务部门负责贯彻落实公司的风险管理措施，定期对本部门的风险进行全面评估，并对本部门风险控制的有效性负责。公司所有员工是本岗位风险控制的直接责任人，负责具体风险管理职责的实施。

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评估各种风险可能产生的损失。从定性的角度出发，根据每个基金的投资目标，确定组合的相关风险收益特征，确保基金的风险收益特征与基金投资策略相适配；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的特征通过特定的风险量化指标、模型、日常量化报告，以及对各种风险量化指标进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

6.4.13.2 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。本基金的银行存款以活期存款方式存放在本基金的托管行，因而与银行存款相关的信用风险不大。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。

于本期末，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

6.4.13.3 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，有效保障基金份额持有人利益。

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日约为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）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。

6.4.13.3.1 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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风控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 6.4.12。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%。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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。于本期末，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的相关制度：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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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、买入返售金融资产和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 06 月 30	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----------------------	-------	-------	-------	-----	----

日					
资产					
货币资金	33,900,559.12	-	-	-	33,900,559.12
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	448,091,240.14	448,091,240.14
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	6,851,771.33	-	-	-	6,851,771.33
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	40,752,330.45	-	-	448,091,240.14	488,843,570.59
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	486,357.96	486,357.96
应付托管费	-	-	-	81,059.66	81,059.66
应付销售服务费	-	-	-	97,244.28	97,244.28
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	352.46	352.46
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	61,218.43	61,218.43
负债总计	-	-	-	726,232.79	726,232.79
利率敏感度缺口	40,752,330.45	-	-	447,365,007.35	488,117,337.80

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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注重严格风险控制的基础上，动态调整资产配置，使风险和预期目标相匹配，并选择符合基金合同约定范围内的投资品种进行投资。同时，本基金充分发挥基金管理人的研究优势，通过对经济发展、社会结构、宏观政策、产业政策和科学技术的跟踪研究，将定性分析和定量模型相结合，根据投资策略或市场环境的变化构建和管理投资组合，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金投资组合中股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 60%-95%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或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金、存出保证金、应收申购款等。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，以识别和测算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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	448,091,240.14	91.80
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	448,091,240.14	91.80

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本期末，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金净资产的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2024年06月30日
第一层次	448,091,240.14
第二层次	-
第三层次	-
合计	448,091,240.14

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 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。

6.4.15 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	448,091,240.14	91.66
	其中：股票	448,091,240.14	91.66
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	6,851,771.33	1.40
	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	33,900,559.12	6.93
8	其他各项资产	-	-
9	合计	488,843,570.59	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	21,619,181.00	4.43
C	制造业	302,734,008.15	62.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,370,184.00	2.33
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,299,660.00	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	17,077,129.99	3.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,082,327.00	0.43
J	金融业	89,908,750.00	18.42
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	448,091,240.14	91.80

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 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	000858	五粮液	118,800	15,211,152.00	3.12
2	601318	中国平安	342,300	14,157,528.00	2.90
3	600219	南山铝业	3,604,300	13,732,383.00	2.81
4	600000	浦发银行	1,663,500	13,690,605.00	2.80
5	601688	华泰证券	1,089,600	13,500,144.00	2.77
6	300760	迈瑞医疗	41,600	12,101,856.00	2.48
7	600036	招商银行	345,800	11,822,902.00	2.42
8	601138	工业富联	423,300	11,598,420.00	2.38
9	000651	格力电器	281,400	11,036,508.00	2.26
10	601857	中国石油	960,100	9,908,232.00	2.03
11	300750	宁德时代	51,200	9,217,536.00	1.89
12	300433	蓝思科技	500,400	9,132,300.00	1.87
13	600066	宇通客车	345,000	8,901,000.00	1.82
14	601567	三星医疗	249,800	8,743,000.00	1.79
15	600737	中粮糖业	887,500	8,511,125.00	1.74
16	600519	贵州茅台	5,300	7,777,167.00	1.59
17	600141	兴发集团	385,600	7,357,248.00	1.51
18	600584	长电科技	230,700	7,315,497.00	1.50
19	002273	水晶光电	427,000	7,250,460.00	1.49
20	000157	中联重科	939,500	7,215,360.00	1.48
21	300274	阳光电源	115,080	7,138,412.40	1.46
22	002422	科伦药业	233,175	7,072,197.75	1.45
23	000598	兴蓉环境	939,000	7,061,280.00	1.45
24	000338	潍柴动力	431,700	7,010,808.00	1.44
25	000725	京东方 A	1,660,900	6,793,081.00	1.39
26	300628	亿联网络	179,000	6,581,830.00	1.35
27	600919	江苏银行	884,700	6,573,321.00	1.35
28	600887	伊利股份	249,200	6,439,328.00	1.32

29	002563	森马服饰	1,105,600	6,423,536.00	1.32
30	600096	云天化	315,900	6,134,778.00	1.26
31	002594	比亚迪	24,400	6,106,100.00	1.25
32	000887	中鼎股份	435,800	5,334,192.00	1.09
33	600690	海尔智家	182,900	5,190,702.00	1.06
34	300308	中际旭创	36,400	5,018,832.00	1.03
35	601601	中国太保	178,600	4,975,796.00	1.02
36	000100	TCL 科技	1,145,600	4,948,992.00	1.01
37	601899	紫金矿业	278,300	4,889,731.00	1.00
38	002223	鱼跃医疗	129,400	4,865,440.00	1.00
39	601229	上海银行	656,900	4,769,094.00	0.98
40	002001	新和成	246,700	4,736,640.00	0.97
41	600380	健康元	421,400	4,707,038.00	0.96
42	600346	恒力石化	330,900	4,616,055.00	0.95
43	601168	西部矿业	256,600	4,605,970.00	0.94
44	600015	华夏银行	716,500	4,585,600.00	0.94
45	000333	美的集团	71,000	4,579,500.00	0.94
46	600350	山东高速	513,401	4,543,598.85	0.93
47	002156	通富微电	201,800	4,518,302.00	0.93
48	601211	国泰君安	330,200	4,474,210.00	0.92
49	600008	首创环保	1,607,800	4,308,904.00	0.88
50	002475	立讯精密	108,100	4,249,411.00	0.87
51	601009	南京银行	389,100	4,042,749.00	0.83
52	001965	招商公路	337,549	4,003,331.14	0.82
53	000425	徐工机械	541,600	3,872,440.00	0.79
54	603198	迎驾贡酒	66,500	3,823,750.00	0.78
55	000568	泸州老窖	25,900	3,716,391.00	0.76
56	601169	北京银行	635,500	3,711,320.00	0.76
57	603369	今世缘	78,900	3,645,180.00	0.75
58	002736	国信证券	414,900	3,605,481.00	0.74
59	000039	中集集团	387,200	3,585,472.00	0.73
60	600019	宝钢股份	535,300	3,559,745.00	0.73
61	600529	山东药玻	138,700	3,514,658.00	0.72
62	600566	济川药业	110,400	3,500,784.00	0.72
63	600916	中国黄金	343,000	3,299,660.00	0.68
64	002056	横店东磁	254,400	3,172,368.00	0.65
65	601000	唐山港	670,600	3,151,820.00	0.65
66	600104	上汽集团	215,400	2,985,444.00	0.61
67	601598	中国外运	527,200	2,968,136.00	0.61
68	600761	安徽合力	132,700	2,871,628.00	0.59
69	601600	中国铝业	325,400	2,482,802.00	0.51

70	601919	中远海控	155,600	2,410,244.00	0.49
71	689009	九号公司	60,800	2,238,048.00	0.46
72	601958	金铂股份	212,800	2,215,248.00	0.45
73	000513	丽珠集团	59,100	2,199,111.00	0.45
74	000997	新大陆	149,700	2,082,327.00	0.43

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	17,896,794.00	3.67
2	600519	贵州茅台	16,793,154.00	3.44
3	601688	华泰证券	15,330,803.00	3.14
4	601318	中国平安	14,036,068.00	2.88
5	600000	浦发银行	13,453,694.00	2.76
6	688036	传音控股	13,364,273.28	2.74
7	600219	南山铝业	13,201,207.00	2.70
8	000338	潍柴动力	12,484,632.00	2.56
9	600584	长电科技	12,418,279.05	2.54
10	601138	工业富联	12,258,357.00	2.51
11	601211	国泰君安	12,127,979.00	2.48
12	300760	迈瑞医疗	11,699,640.00	2.40
13	000651	格力电器	11,280,918.29	2.31
14	600036	招商银行	11,265,022.00	2.31
15	600066	宇通客车	11,108,212.00	2.28
16	601168	西部矿业	10,413,566.00	2.13
17	300750	宁德时代	10,064,407.00	2.06
18	600998	九州通	9,926,478.33	2.03
19	603501	韦尔股份	9,643,658.00	1.98
20	601857	中国石油	9,600,085.00	1.97

注：买入金额均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	688036	传音控股	9,800,644.73	2.01
2	603501	韦尔股份	9,377,893.00	1.92
3	603927	中科软	8,970,090.40	1.84
4	600016	民生银行	8,754,919.00	1.79
5	600998	九州通	8,671,037.40	1.78

6	601211	国泰君安	7,489,863.00	1.53
7	600655	豫园股份	7,356,260.00	1.51
8	600519	贵州茅台	7,180,032.00	1.47
9	601077	渝农商行	7,111,117.00	1.46
10	002600	领益智造	7,065,445.00	1.45
11	601006	大秦铁路	6,625,517.00	1.36
12	600406	国电南瑞	6,617,842.00	1.36
13	600584	长电科技	5,993,700.00	1.23
14	600398	海澜之家	5,858,429.00	1.20
15	002555	三七互娱	5,750,751.00	1.18
16	601168	西部矿业	4,959,767.00	1.02
17	603589	口子窖	4,748,970.00	0.97
18	000338	潍柴动力	4,336,953.60	0.89
19	002517	恺英网络	4,305,932.00	0.88
20	600845	宝信软件	4,264,438.00	0.87

注：卖出金额均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	637,716,851.77
卖出股票收入（成交）总额	172,930,214.73

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

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，并充分考虑股指期货的流动性与收益及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险与特殊情况下的流动性风险，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并充分考虑国债期货的流动性与收益及风险特征，运用国债期货对冲系统性风险与特殊情况下的流动性风险。本基金也将结合对宏观形势的判断、对债券市场进行研究分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性与波动性等指标进行跟踪监控。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期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、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司及华泰证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到监管部门公开处罚或行政监管措施。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 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

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
联博智选 混合 A	1,288	201,736.73	197,691.46	0.08%	259,639,219.99	99.92%
联博智选 混合 C	3,239	74,085.81	3,659,488.52	1.53%	236,304,461.66	98.47%
合计	4,527	110,404.43	3,857,179.98	0.77%	495,943,681.65	99.23%

注：1、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的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 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	联博智选混合 A	3,973,135.18	1.53%
	联博智选混合 C	1,025,253.57	0.43%
	合计	4,998,388.75	1.00%

8.3 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 研究部门负责人持有本 开放式基金	联博智选混合 A	>100
	联博智选混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放 式基金	联博智选混合 A	>100
	联博智选混合 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	联博智选混合 A	联博智选混合 C
基金合同生效日（2024 年 04 月 01 日）基金份额总额	259,836,911.45	239,963,950.18
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	259,836,911.45	239,963,950.18

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

本基金管理人于 2024 年 6 月 27 日发布公告，朱建荣先生自 2024 年 6 月 25 日起担任本公司副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门托管部门无重大人事变动。

10.3 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，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
海通证券	2	810,647,066.50	100.00%	602,518.13	100.00%	-

注：1. 此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、债券、债券回购、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2. 根据《关于新设公募基金管理人证券交易模式转换有关事项的通知》（证监办发[2019]14号）及《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告[2024]3号）的有关规定，基金产品管理人可选择一家或多家证券公司开展证券交易，并可免于执行相关分仓规定。

3. 本基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强，能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。

4. 本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。

10.7.2 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
海通证券	-	-	303,845,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 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	联博智选混合型证券投资基金产品资料概要（A类份额）	中国证监会规定媒介	2024年03月05日
2	联博智选混合型证券投资基金产品资料概要（C类份额）	中国证监会规定媒介	2024年03月05日
3	联博智选混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2024年03月05日
4	联博智选混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2024年03月05日
5	联博智选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2024年03月05日

	及招募说明书提示性公告		
6	联博智选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2024年03月05日
7	联博智选混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2024年03月05日
8	联博基金管理有限公司关于个人投资者开户证件类型说明的公告	中国证监会规定媒介	2024年03月05日
9	联博智选混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2024年04月02日
10	关于警惕冒用联博基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	中国证监会规定媒介	2024年04月11日
11	关于警惕冒用联博基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	中国证监会规定媒介	2024年04月29日
12	联博基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	中国证监会规定媒介	2024年05月28日
13	联博智选混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2024年06月26日
14	联博智选混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024年06月26日
15	联博智选混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024年06月26日
16	联博基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2024年06月27日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

本报告期内无单一投资者持有本基金份额比例达到或超过 20%。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金募集的文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《托管协议》
- 4、本基金的《招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本基金在规定媒介披露的各项公告

7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人办公场所及基金托管人住所

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站 <https://www.alliancebernstein.com.cn/> 查阅。

联博基金管理有限公司

2024 年 08 月 28 日