

新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 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:2021 年 08 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月26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2021年1月1日起至6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	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
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	14
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17

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	17
§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表	20
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	55
7.1 期末基金资产组合情况	55
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56
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	57
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	65
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	66
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	66
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	66
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 投资组合报告附注	67
§ 8 基金份额持有人信息	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
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	69
§ 9 开放式基金份额变动	69
§ 10 重大事件揭示	70
10.1 基金份额持有人大会决议	70
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	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
10.4 基金投资策略的改变	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71

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.....	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
10.8 其他重大事件.....	75
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
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.....	76
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
§ 12 备查文件目录.....	77
12.1 备查文件目录.....	77
12.2 存放地点.....	77
12.3 查阅方式.....	77

§ 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	1,004,986,997.23 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	799,480,710.66 份	205,506,286.57 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	邱张斌	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	福州市湖东路 154 号
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	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼

	28 和 29 层	
邮政编码	518031	200120
法定代表人	吴昱村	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》
登载基金中期报告正文的 管理人互联网网址	www.qlhfund.com
基金中期报告备置地点	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
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（2021 年 01 月 01 日-2021 年 06 月 30 日）	
	前海联合价值优选混合 A	前海联合价值优选混合 C
本期已实现收益	178,151,270.50	53,144,486.78
本期利润	191,858,615.78	57,404,405.11
加权平均基金份额本期利润	0.2229	0.2223
本期加权平均净值利润率	16.75%	16.76%
本期基金份额净值增长率	17.66%	17.43%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2021 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	257,076,854.08	64,937,961.48
期末可供分配基金份额利润	0.3216	0.3160
期末基金资产净值	1,185,442,494.40	303,506,552.31
期末基金份额净值	1.4828	1.4769
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2021 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	48.28%	47.69%

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。

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	1.67%	1.25%	-1.42%	0.56%	3.09%	0.69%
过去三个 月	22.42%	1.50%	2.62%	0.68%	19.80%	0.82%
过去六个 月	17.66%	1.97%	0.58%	0.92%	17.08%	1.05%
自基金合	48.28%	1.60%	8.68%	0.89%	39.60%	0.71%

同生效起 至今						
------------	--	--	--	--	--	--

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
过去一个 月	1.63%	1.25%	-1.42%	0.56%	3.05%	0.69%
过去三个 月	22.30%	1.50%	2.62%	0.68%	19.68%	0.82%
过去六个 月	17.43%	1.97%	0.58%	0.92%	16.85%	1.05%
自基金合 同生效起 至今	47.69%	1.60%	8.68%	0.89%	39.01%	0.71%

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-2021年06月30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-2021年06月30日)



注：1、本基金的基金合同于 2020 年 7 月 7 日生效，截至报告期末，本基金成立未满 1 年。
2、本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。截至报告期末，本基金建仓期结束未满 1 年。

3.3 其他指标

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 34 只开放式基金，包括 2 只货币市场基金、18 只债券型基金、12 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 12 只专户理财产品，管理资产总规模超过 364 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何杰	本基金的基金经理，权益投资部总经理	2020-07-07	-	11 年	何杰先生，硕士研究生，11 年证券投资基金投资研究经验。 2013 年 5 月至 2018 年 2 月任前海人寿保险股份有限公司资产管理中心投资经理。 2010 年 3 月至 2013 年 3 月任华创证券股份有限责任公司研究所研究员。2018 年 3 月加入前海联合基金，2021 年 8 月离职。曾任新疆前海联合润丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2018 年 10 月 9 日至 2020 年 5 月 24 日）、新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2018 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 30 日）、新疆前海联合先进制造灵活

					配置混合型证券投资基金的基金经理(自 2019 年 1 月 24 日至 2020 年 5 月 24 日)、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 3 月 12 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 2018 年 4 月 12 日至 2021 年 7 月 26 日)、新疆前海联合研究优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 7 日至 2021 年 7 月 26 日)、新疆前海联合泳涛灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2020 年 3 月 12 日至 2021 年 7 月 26 日)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 2020 年 7 月 7 日至 2021 年 7 月 26 日)。
--	--	--	--	--	--

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、张永任自 2021 年 7 月 27 日起任新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金基金经理，何杰自 2021 年 7 月 27 日起离任新疆前海联合价值优选混合型证券投资基金基金经理。

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业务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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内，未发生有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2021 年上半年市场呈现过山车式大幅波动：春节前市场情绪亢奋涨幅过快，导致市场交易结构急剧恶化，机构集中持仓的白马股在节后快速杀跌；二季度，市场在犹豫中展开反弹。一方面，市场仍然担心经济复苏和流动性见顶；另一方面，宏观经济仍然保持韧性、流动性预期平稳。因此，市场表现为明显的结构性行情。新能源汽车、半导体、医药等高景气度板块表现较好，大消费和顺周期板块继续下跌。

从本基金实际操作情况看：我们继续坚守长期价值投资理念，在市场波动中认真审视持仓标的基本面和估值，并基于公司基本面变化和市场波动情况，对持仓结构优化调整。从结

果上看，我们的大部分持仓经受住了市场考验，尽管经历一季度大幅波动，但二季度收获了远超基准的反弹幅度。

投资方向上，我们仍然将会沿着高质量发展新格局的主线进行投资布局，在先进制造、消费升级、科技创新等方向进行继续深入挖掘。6 月份以来，市场交易结构再次向热门赛道集中，对此我们仍然坚持以长期价值的视角来应对。对于长期价值明确短期超跌的品种继续加仓；而对于短期超涨过度透支未来价值的品种，我们要做的则是保持在亢奋的市场环境中保持冷静，努力为持有人维护好既往良好的长期投资体验。

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 1.4828 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 17.66%，同期业绩比较基准收益率为 0.58%；截至报告期末前海联合价值优选混合 C 基金份额净值为 1.4769 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 17.43%，同期业绩比较基准收益率为 0.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济增长前景总体稳定，出口增速高位回落，投资、消费等内需仍具备修复空间，制造业将成为新阶段经济增长的持续动能。在流动性仍保持合理宽裕的情况下，我们认为下半年整体市场波动幅度会明显小于上半年。但与当前市场看好成长风格的一致预期不同，我们认为下半年价值风格存在更大的修复空间，市场风格会趋于均衡。

4.6 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帐务处理；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。

会计师事务所就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，由研究发展部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部负责人及其他指定相关人员组成，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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

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

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合规守信、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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 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：2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	3,515,050.78	17,499,631.59
结算备付金		6,356,173.97	3,995,360.22
存出保证金		498,981.84	1,177,974.21
交易性金融资产	6.4.7.2	1,416,557,809.58	1,615,952,722.87
其中：股票投资		1,336,549,809.58	1,526,087,722.87
基金投资		—	—

债券投资		80,008,000.00	89,865,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	58,000,000.00	70,000,000.00
应收证券清算款		31,430,269.52	35,069,983.55
应收利息	6.4.7.5	400,813.95	1,153,910.67
应收股利		-	-
应收申购款		1,641,584.35	3,495,061.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,518,400,683.99	1,748,344,644.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 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		-	-
应付证券清算款		14,065,557.97	35,243,204.56
应付赎回款		12,340,805.47	23,593,735.26
应付管理人报酬		1,785,895.47	2,093,357.68
应付托管费		297,649.25	348,892.93
应付销售服务费		98,879.34	151,453.47
应付交易费用	6.4.7.7	775,991.64	1,780,708.30
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.8	86,858.14	142,337.39
负债合计		29,451,637.28	63,353,689.59
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,004,986,997.23	1,337,813,837.52
未分配利润	6.4.7.10	483,962,049.48	347,177,117.38
所有者权益合计		1,488,949,046.71	1,684,990,954.90
负债和所有者权益总计		1,518,400,683.99	1,748,344,644.49

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,004,986,997.23 份，其中前海联合价值优选混合 A 基金份额净值 1.4828 元，基金份额总额 799,480,710.66 份；其中前海联合价值优选混合 C 基金份额净值 1.4769 元，基金份额总额 205,506,286.57 份。

6.2 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：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
一、收入		267,473,331.68
1. 利息收入		1,379,173.37
其中：存款利息收入	6.4.7.11	67,657.82
债券利息收入		964,019.18
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		347,496.37
证券出借利息收入		—
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		247,360,471.34
其中：股票投资收益	6.4.7.12	242,386,297.60
基金投资收益		—

债券投资收益	6.4.7.13	283,200.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	—
贵金属投资收益	6.4.7.14	—
衍生工具收益	6.4.7.15	—
股利收益	6.4.7.16	4,690,973.74
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	17,967,263.61
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17.1	766,423.36
减：二、费用		18,210,310.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,157,917.93
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,859,652.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	686,560.63
4. 交易费用	6.4.7.18	4,407,670.08
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 税金及附加		—
7. 其他费用	6.4.7.19	98,509.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		249,263,020.89
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		249,263,020.89

注：本基金的基金合同于 2020 年 7 月 7 日生效，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（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：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值)	1,337,813,837.52	347,177,117.38	1,684,990,954.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	249,263,020.89	249,263,020.89
三、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)	-332,826,840.29	-112,478,088.79	-445,304,929.08
其中：1. 基金申购款	272,724,695.09	98,376,894.81	371,101,589.90
2. 基金赎回款	-605,551,535.38	-210,854,983.60	-816,406,518.98
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,004,986,997.23	483,962,049.48	1,488,949,046.71

注：本基金的基金合同于 2020 年 7 月 7 日生效，无上年度可比期间数据。

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：

吴昱村

吴昱村

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

6.4 报表附注

6.4.1 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

国《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 2021 年 8 月 26 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 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

本基金本报告期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基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
活期存款	3,515,050.78
定期存款	—
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	—
合计	3,515,050.78

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 06 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,068,163,858.35	1,336,549,809.58	268,385,951.23
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	79,960,400.00	80,008,000.00	47,600.00
	合计	79,960,400.00	80,008,000.00	47,600.00
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		1,148,124,2	1,416,557,809.58	268,433,551.23

	58.35		
--	-------	--	--

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

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 2021 年 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	58,000,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	58,000,000.00	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
应收活期存款利息	929.03
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	2,859.70
应收债券利息	396,800.00
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—

应收出借证券利息	-
其他	225.22
合计	400,813.95

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
交易所市场应付交易费用	775,241.64
银行间市场应付交易费用	750.00
合计	775,991.64

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,974.38
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	19,876.39
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-账户维护费	4,500.00
合计	86,858.14

6.4.7.9 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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	985,532,529.50	985,532,529.50
本期申购	103,053,625.08	103,053,625.08
本期赎回（以“-”号填列）	-289,105,443.92	-289,105,443.92
本期末	799,480,710.66	799,480,710.66

前海联合价值优选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	352,281,308.02	352,281,308.02
本期申购	169,671,070.01	169,671,070.01
本期赎回（以“-”号填列）	-316,446,091.46	-316,446,091.46
本期末	205,506,286.57	205,506,286.57

注：申购含转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.10 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
上年度末	115,708,600.59	140,687,227.93	256,395,828.52
本期利润	178,151,270.50	13,707,345.28	191,858,615.78
本期基金份额交易产生的变动数	-36,783,017.01	-25,509,643.55	-62,292,660.56
其中：基金申购款	20,547,784.95	17,103,552.99	37,651,337.94
基金赎回款	-57,330,801.96	-42,613,196.54	-99,943,998.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	257,076,854.08	128,884,929.66	385,961,783.74

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
上年度末	40,565,406.63	50,215,882.23	90,781,288.86
本期利润	53,144,486.78	4,259,918.33	57,404,405.11
本期基金份额交易产生的变动数	-28,771,931.93	-21,413,496.30	-50,185,428.23
其中：基金申购款	34,582,697.48	26,142,859.39	60,725,556.87
基金赎回款	-63,354,629.41	-47,556,355.69	-110,910,985.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	64,937,961.48	33,062,304.26	98,000,265.74

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	26,634.33
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	32,747.45
其他	8,276.04
合计	67,657.82

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,807,758,281.36
减：卖出股票成本总额	1,565,371,983.76
买卖股票差价收入	242,386,297.60

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	283,200.00
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	283,200.00

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	112,070,278.91
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	109,718,120.00
减：应收利息总额	2,068,958.91
买卖债券差价收入	283,200.00

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,690,973.74
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	4,690,973.74

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	17,967,263.61
——股票投资	18,056,643.61
——债券投资	-89,380.00
——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	17,967,263.61

6.4.7.17.1 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	765,415.33
转换费收入	1,008.03
合计	766,423.36

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
交易所市场交易费用	4,406,745.08
银行间市场交易费用	925.00

交易基金产生的费用	—
合计	4,407,670.08

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行汇划费	10,625.40
账户维护费	13,500.00
合计	98,509.16

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。

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
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
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

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。

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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,157,917.93
其中：支付销售机构的客户维护费	2,427,605.10

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 × 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,859,652.99

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 $\times$ 0.25% / 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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 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	-	1,538.51	1,538.51
兴业银行股份有限公司	-	526,429.21	526,429.21
合计	-	527,967.72	527,967.72

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 $\times$ 0.40% / 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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	3,515,050.78	26,634.33

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2021 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021 年 05 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	创业板新股锁定	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 07 月 12 日	创业板新股锁定	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 07 月 07 日	创业板新股锁定	13.39	30.10	217.00	2,905.63	6,531.70	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 07 月 02 日	创业板新股锁定	24.60	163.00	610.00	15,006.00	99,430.00	-
300929	华骐环保	2021 年 01 月 12 日	2021 年 07 月 20 日	创业板新股锁定	13.87	29.55	183.00	2,538.21	5,407.65	-

		日	日	定						
300933	中辰股份	2021年01月15日	2021年07月22日	创业板新股锁定期	3.37	10.44	1,112.00	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年01月20日	2021年07月27日	创业板新股锁定期	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021年01月27日	2021年08月03日	创业板新股锁定期	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	-
300943	春晖智控	2021年02月03日	2021年08月10日	创业板新股锁定期	9.79	23.01	255.00	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年02月03日	2021年08月10日	创业板新股锁定期	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年02月18日	2021年08月25日	创业板新股锁定期	13.00	27.42	324.00	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021年02月24日	2021年09月03日	创业板新股锁定期	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	-

300952	恒辉 安防	2021 年 03 月 03 日	2021 年 09 月 13 日	创业 板新 股锁 定	11.7 2	27.0 8	340.0 0	3,984. 80	9,207. 20	-
300953	震裕 科技	2021 年 03 月 11 日	2021 年 09 月 22 日	创业 板新 股锁 定	28.7 7	99.8 5	240.0 0	6,904. 80	23,964 .00	-
300955	嘉亨 家化	2021 年 03 月 16 日	2021 年 09 月 24 日	创业 板新 股锁 定	16.5 3	46.0 7	232.0 0	3,834. 96	10,688 .24	-
300956	英力 股份	2021 年 03 月 16 日	2021 年 09 月 27 日	创业 板新 股锁 定	12.8 5	25.8 0	371.0 0	4,767. 35	9,571. 80	-
300958	建工 修复	2021 年 03 月 18 日	2021 年 09 月 29 日	创业 板新 股锁 定	8.53	27.2 2	300.0 0	2,559. 00	8,166. 00	-
300960	通业 科技	2021 年 03 月 22 日	2021 年 09 月 29 日	创业 板新 股锁 定	12.0 8	23.0 6	234.0 0	2,826. 72	5,396. 04	-
300962	中金 辐照	2021 年 03 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	创业 板新 股锁 定	3.40	16.3 7	576.0 0	1,958. 40	9,429. 12	-
3009	中洲	2021	2021	创业	12.1	22.4	283.0	3,432.	6,364.	-

63	特材	年 03 月 30 日	年 10 月 11 日	板新 股锁 定	3	9	0	79	67	
3009 66	共同 药业	2021 年 03 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	创业 板新 股锁 定	8.24	31.5 4	286.0 0	2,356. 64	9,020. 44	-
3009 68	格林 精密	2021 年 04 月 06 日	2021 年 10 月 15 日	创业 板新 股锁 定	6.87	12.0 7	1,162 .00	7,982. 94	14,025 .34	-
3009 71	博亚 精工	2021 年 04 月 07 日	2021 年 10 月 15 日	创业 板新 股锁 定	18.2 4	28.2 9	245.0 0	4,468. 80	6,931. 05	-
3009 72	万辰 生物	2021 年 04 月 08 日	2021 年 10 月 19 日	创业 板新 股锁 定	7.19	12.6 5	430.0 0	3,091. 70	5,439. 50	-
3009 73	立高 食品	2021 年 04 月 08 日	2021 年 10 月 15 日	创业 板新 股锁 定	28.2 8	115. 71	360.0 0	10,180 .80	41,655 .60	-
3009 75	商络 电子	2021 年 04 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	创业 板新 股锁 定	5.48	13.0 3	492.0 0	2,696. 16	6,410. 76	-
3009 78	东箭 科技	2021 年 04	2021 年 10	创业 板新	8.42	13.6 0	593.0 0	4,993. 06	8,064. 80	-

		月 15 日	月 26 日	股锁 定						
3009 81	中红 医疗	2021 年 04 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	创业 板新 股锁 定	48.5 9	90.3 9	601.0 0	29,202 .59	54,324 .39	—
3009 82	苏文 电能	2021 年 04 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	创业 板新 股锁 定	15.8 3	45.2 9	317.0 0	5,018. 11	14,356 .93	—
3009 85	致远 新能	2021 年 04 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	创业 板新 股锁 定	24.9 0	24.8 1	295.0 0	7,345. 50	7,318. 95	—
3009 86	志特 新材	2021 年 04 月 21 日	2021 年 11 月 01 日	创业 板新 股锁 定	14.7 9	30.5 7	264.0 0	3,904. 56	8,070. 48	—
3009 87	川网 传媒	2021 年 04 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	创业 板新 股锁 定	6.79	26.8 1	301.0 0	2,043. 79	8,069. 81	—
3009 91	创益 通	2021 年 05 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	创业 板新 股锁 定	13.0 6	26.5 1	254.0 0	3,317. 24	6,733. 54	—
3009 92	泰福 泵业	2021 年 05 月 17	2021 年 11 月 25	创业 板新 股锁	9.36	20.3 2	187.0 0	1,750. 32	3,799. 84	—

		日	日	定						
300993	玉马遮阳	2021年05月17日	2021年11月24日	创业板新股锁定期	12.10	19.29	410.00	4,961.00	7,908.90	—
300996	普联软件	2021年05月26日	2021年12月03日	创业板新股锁定期	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	—
300998	宁波方正	2021年05月25日	2021年12月02日	创业板新股锁定期	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	—
301002	崧盛股份	2021年05月27日	2021年12月07日	创业板新股锁定期	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	—
301007	德迈仕	2021年06月04日	2021年12月16日	创业板新股锁定期	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	—
301010	晶雪节能	2021年06月09日	2021年12月20日	创业板新股锁定期	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	—
301011	华立科技	2021年06月09日	2021年12月17日	创业板新股锁定期	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	—

301012	扬电科技	2021年06月15日	2021年12月22日	创业板新股锁定	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年06月21日	2021年12月29日	创业板新股锁定	8.72	27.11	471.00	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021年06月22日	2021年12月30日	创业板新股锁定	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年06月23日	2021年12月30日	创业板新股锁定	13.75	32.98	275.00	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021年06月23日	2022年01月05日	新股流通受限	8.86	8.86	5,550.00	49,173.00	49,173.00	-
301020	密封科技	2021年06月28日	2022年01月06日	新股流通受限	10.64	10.64	4,210.00	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021年06月28日	2022年01月06日	新股流通受限	9.46	9.46	2,899.00	27,424.54	27,424.54	-
6051	新中	2021	2021	新股	6.07	6.07	1,377	8,358.	8,358.	-

62	港	年 06 月 29 日	年 07 月 07 日	流通 受限			.00	39	39	
6052 87	德才 股份	2021 年 06 月 28 日	2021 年 07 月 06 日	新股 流通 受限	31.5 6	31.5 6	349.0 0	11,014 .44	11,014 .44	-
6880 67	爱威 科技	2021 年 06 月 07 日	2021 年 12 月 16 日	科创 板新 股锁 定	14.7 1	24.8 3	1,259 .00	18,519 .89	31,260 .97	-
6880 87	英科 再生	2021 年 06 月 30 日	2021 年 07 月 09 日	新股 流通 受限	21.9 6	21.9 6	2,469 .00	54,219 .24	54,219 .24	-
6882 26	威腾 电气	2021 年 06 月 28 日	2021 年 07 月 07 日	新股 流通 受限	6.42	6.42	2,693 .00	17,289 .06	17,289 .06	-
6882 39	航宇 科技	2021 年 06 月 25 日	2021 年 07 月 05 日	新股 流通 受限	11.4 8	11.4 8	4,926 .00	56,550 .48	56,550 .48	-
6882 69	凯立 新材	2021 年 06 月 01 日	2021 年 12 月 09 日	科创 板新 股锁 定	18.9 4	100. 92	1,941 .00	36,762 .54	195,88 5.72	-
6883 19	欧林 生物	2021 年 05	2021 年 12	科创 板新	9.88	27.3 4	3,412 .00	33,710 .56	93,284 .08	-

		月 31 日	月 08 日	股锁 定						
6883 55	明志 科技	2021 年 04 月 30 日	2021 年 11 月 12 日	科创 板新 股锁 定	17.6 5	23.8 0	2,710 .00	47,831 .50	64,498 .00	-
6884 56	有研 粉材	2021 年 03 月 10 日	2021 年 09 月 17 日	科创 板新 股锁 定	10.6 2	26.5 0	3,396 .00	36,065 .52	89,994 .00	-
6884 99	利元 亨	2021 年 06 月 23 日	2021 年 07 月 01 日	新股 流通 受限	38.8 5	38.8 5	2,149 .00	83,488 .65	83,488 .65	-
6885 33	上声 电子	2021 年 04 月 09 日	2021 年 10 月 19 日	科创 板新 股锁 定	7.72	19.1 1	3,493 .00	26,965 .96	66,751 .23	-
6886 55	迅捷 兴	2021 年 04 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	科创 板新 股锁 定	7.59	15.7 7	3,083 .00	23,399 .97	48,618 .91	-
6886 96	极米 科技	2021 年 02 月 23 日	2021 年 09 月 03 日	科创 板新 股锁 定	133. 73	780. 24	1,252 .00	167,42 9.96	976,86 0.48	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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。

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同责任，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。

6.4.13.2.1 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 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	80,008,000.00	89,865,000.00
合计	80,008,000.00	89,865,000.00

注:1、短期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为政策性金融债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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,有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日,本基金所承担的全部金融负债的合约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。

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》(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 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 2021 年 6 月 30 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 2021 年 6 月 30 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。

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、存出保证金、债券投资和买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2021 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,515,050.78	-	-	-	3,515,050.78
结算备付金	6,356,173.97	-	-	-	6,356,173.97
存出保证金	498,981.84	-	-	-	498,981.84
交易性金融资产	80,008,000.00	-	-	1,336,549.809.58	1,416,557.809.58
买入返售金融资产	58,000,000.00	-	-	-	58,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	31,430,269.52	31,430,269.52
应收利息	-	-	-	400,813.95	400,813.95
应收申购款	-	-	-	1,641,584.35	1,641,584.35
资产总计	148,378,206.59	-	-	1,370,022,477.40	1,518,400,683.99
负债					
应付证券清算款	-	-	-	14,065,557.97	14,065,557.97
应付赎回款	-	-	-	12,340,805.47	12,340,805.47
应付管理人报酬	-	-	-	1,785,895.47	1,785,895.47
应付托管费	-	-	-	297,649.25	297,649.25
应付销售服	-	-	-	98,879.34	98,879.34

务费					
应付交易费用	-	-	-	775,991.64	775,991.64
其他负债	-	-	-	86,858.14	86,858.14
负债总计	-	-	-	29,451,637.28	29,451,637.28
利率敏感度缺口	148,378,206.59	-	-	1,340,570,840.12	1,488,949,046.71
上年度末 2020 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	17,499,631.59	-	-	-	17,499,631.59
结算备付金	3,995,360.22	-	-	-	3,995,360.22
存出保证金	1,177,974.21	-	-	-	1,177,974.21
交易性金融资产	89,865,000.00	-	-	1,526,087,722.87	1,615,952,722.87
买入返售金融资产	70,000,000.00	-	-	-	70,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	35,069,983.55	35,069,983.55
应收利息	-	-	-	1,153,910.67	1,153,910.67
应收申购款	-	-	-	3,495,061.38	3,495,061.38
资产总计	182,537,966	-	-	1,565,806,6	1,748,344,6

	.02			78.47	44.49
负债					
应付证券清算款	-	-	-	35,243,204.56	35,243,204.56
应付赎回款	-	-	-	23,593,735.26	23,593,735.26
应付管理人报酬	-	-	-	2,093,357.68	2,093,357.68
应付托管费	-	-	-	348,892.93	348,892.93
应付销售服务费	-	-	-	151,453.47	151,453.47
应付交易费用	-	-	-	1,780,708.30	1,780,708.30
其他负债	-	-	-	142,337.39	142,337.39
负债总计	-	-	-	63,353,689.59	63,353,689.59
利率敏感度缺口	182,537,966.02	-	-	1,502,452,988.88	1,684,990,954.90

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 2021 年 6 月 30 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 5.37% (2020 年 12 月 31 日：5.33%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020 年 12 月 31 日：同)。

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规和监管机构的规定。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。

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 2021 年 06 月 30 日		上年度末 2020 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	1,336,549,809.58	89.76	1,526,087,722.87	90.57
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	80,008,000.00	5.37	89,865,000.00	5.33

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	1,416,55	95.14	1,615,95	95.90
	7,809.58		2,722.87	

6.4.13.4.3.2 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 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1. 沪深 300 指数上升 5%	86,372,193.04	81,003,502.50
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-86,372,193.04	-81,003,502.50

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	1,336,549,80	88.02
		9.58	
	其中: 股票	1,336,549,80	88.02

		9.58	
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	80,008,000.00	5.27
	其中：债券	80,008,000.00	5.27
	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	58,000,000.00	3.82
	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	9,871,224.75	0.65
8	其他各项资产	33,971,649.66	2.24
9	合计	1,518,400,683.99	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	5,439.50	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,238,711,406.35	83.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00

E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	95,577.58	0.01
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	46,251.64	0.00
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	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	35,742.75	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	97,617,000.00	6.56
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	1,336,549,809.58	89.76

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通过港股通机制投资港股。

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	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	235,000	125,678,000.00	8.44
2	600690	海尔智家	4,480,000	116,076,800	7.80

			0	.00	
3	600519	贵州茅台	55,800	114,763,860	7.71
				.00	
4	000858	五粮液	370,000	110,219,300	7.40
				.00	
5	002460	赣锋锂业	880,000	106,559,200	7.16
				.00	
6	600438	通威股份	2,350,000	101,684,500	6.83
				.00	
7	300760	迈瑞医疗	210,000	100,810,500	6.77
				.00	
8	000568	泸州老窖	420,000	99,094,800.	6.66
				00	
9	603345	安井食品	355,000	90,177,100.	6.06
				00	
10	600031	三一重工	2,550,000	74,128,500.	4.98
				00	
11	300124	汇川技术	850,000	63,121,000.	4.24
				00	
12	002597	金禾实业	1,700,000	58,990,000.	3.96
				00	
13	300015	爱尔眼科	700,000	49,686,000.	3.34
				00	
14	603882	金域医学	300,000	47,931,000.	3.22
				00	
15	002812	恩捷股份	180,000	42,138,000.	2.83
				00	
16	688169	石头科技	25,500	32,155,500.	2.16
				00	

17	688696	极米科技	1,252	976,860.48	0.07
18	688606	奥泰生物	2,703	402,747.00	0.03
19	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.01
20	300986	志特新材	2,632	103,429.84	0.01
21	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
22	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.01
23	688456	有研粉材	3,396	89,994.00	0.01
24	300950	德固特	2,186	89,334.49	0.01
25	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
26	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.00
27	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.00
28	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.00
29	688350	富淼科技	2,552	58,236.64	0.00
30	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
31	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
32	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
33	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
34	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.00
35	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
36	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
37	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
38	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.00
39	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
40	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
41	300911	亿田智能	309	21,407.52	0.00
42	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
43	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
44	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
45	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00

46	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
47	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
48	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
49	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
50	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
51	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
52	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
53	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
54	300962	中金辐照	676	11,829.12	0.00
55	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
56	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
57	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
58	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
59	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
60	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
61	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
62	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
63	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
64	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
65	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
66	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
67	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
68	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
69	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
70	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
71	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
72	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
73	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
74	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00

75	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
76	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
77	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
78	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
79	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
80	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
81	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
82	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
83	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
84	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
85	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
86	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
87	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
88	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
89	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
90	300992	泰福泵业	187	3,799.84	0.00

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	600031	三一重工	117,311,539.41	6.96
2	300750	宁德时代	111,982,697.70	6.65
3	000568	泸州老窖	102,026,815.00	6.06

4	603198	迎驾贡酒	90,696,505.92	5.38
5	300124	汇川技术	85,927,497.00	5.10
6	600763	通策医疗	67,382,215.45	4.00
7	002597	金禾实业	67,141,949.54	3.98
8	002466	天齐锂业	67,126,240.22	3.98
9	002812	恩捷股份	63,814,498.00	3.79
10	002460	赣锋锂业	61,044,594.58	3.62
11	600690	海尔智家	60,617,490.15	3.60
12	000858	五粮液	51,170,358.00	3.04
13	600438	通威股份	47,147,202.32	2.80
14	600745	闻泰科技	40,710,758.72	2.42
15	603799	华友钴业	34,261,437.72	2.03
16	603345	安井食品	31,768,764.80	1.89
17	688169	石头科技	30,620,547.80	1.82
18	603259	药明康德	27,854,999.	1.65

			00	
19	600519	贵州茅台	27,186,963.00	1.61
20	300618	寒锐钴业	24,895,538.96	1.48

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002460	赣锋锂业	121,236,089.87	7.20
2	603198	迎驾贡酒	102,051,626.73	6.06
3	300015	爱尔眼科	99,479,310.53	5.90
4	002705	新宝股份	96,112,128.46	5.70
5	600036	招商银行	95,921,210.31	5.69
6	600745	闻泰科技	95,321,450.33	5.66
7	603259	药明康德	89,445,516.05	5.31
8	002597	金禾实业	86,859,355.65	5.15
9	600161	天坛生物	84,455,856.97	5.01

10	600438	通威股份	78,014,860.03	4.63
11	603712	七一二	72,410,271.44	4.30
12	603882	金域医学	65,946,853.00	3.91
13	600763	通策医疗	65,941,978.92	3.91
14	001914	招商积余	58,544,901.31	3.47
15	002466	天齐锂业	54,576,731.88	3.24
16	000858	五粮液	54,501,978.30	3.23
17	002812	恩捷股份	52,628,737.41	3.12
18	002821	凯莱英	50,742,176.86	3.01
19	300124	汇川技术	46,454,438.20	2.76
20	600926	杭州银行	45,522,985.38	2.70
21	600519	贵州茅台	45,283,662.80	2.69
22	300760	迈瑞医疗	45,140,955.00	2.68
23	300750	宁德时代	42,599,660.03	2.53
24	600031	三一重工	35,142,056.	2.09

			18	
--	--	--	----	--

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。

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	1,357,777,426.86
卖出股票收入（成交）总额	1,807,758,281.36

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。

7.5 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	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	80,008,000.00	5.37
	其中：政策性金融债	80,008,000.00	5.37
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	80,008,000.00	5.37

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

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	210206	21 国开 06	800,000	80,008,000. 00	5.37

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 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。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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没有出现在本报告期内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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	498,981.84
2	应收证券清算款	31,430,269.52
3	应收股利	—
4	应收利息	400,813.95
5	应收申购款	1,641,584.35
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	33,971,649.66

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

由于四舍五入的原因，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
前海联合价值优选混合 A	10,301	77,611.95	600,104,666.66	75.06%	199,376,044.00	24.94%
前海联合价值优选混合 C	8,610	23,868.33	12,845.58	0.01%	205,493,440.99	99.99%
合计	18,528	54,241.53	600,117,512.24	59.71%	404,869,484.99	40.29%

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。

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	前海联合价值优选混合 A	330,106.27	0.0413%
	前海联合价值优选混合 C	151,507.50	0.0737%
	合计	481,613.77	0.0479%

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）。

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	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	0~10
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

§ 9 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	985,532,529.50	352,281,308.02
本报告期基金总申购份额	103,053,625.08	169,671,070.01
减：本报告期基金总赎回份额	289,105,443.92	316,446,091.46
本报告期基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	799,480,710.66	205,506,286.57

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。

§ 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

1、本报告期内，王晓耕女士自 2021 年 4 月 15 日起不再担任公司总经理职务，张永任先生自 2021 年 4 月 15 日起代为履行公司总经理职责；吴昱村先生自 2021 年 5 月 26 日起担任公司总经理，张永任先生不再代为履行总经理职责；邹文庆先生自 2021 年 6 月 21 日起担任公司总经理助理。

2、经 2021 年 4 月 12 日召开的公司股东会 2021 年第 1 次临时会议与会股东一致审议通过，段军山先生接替孙学致先生担任公司独立董事。

3、经 2021 年 4 月 17 日召开的公司股东会 2021 年第 2 次临时会议与会股东一致审议通过，王晓耕女士辞去公司第二届董事会董事职务。

4、经 2021 年 5 月 28 日召开的公司股东会 2021 年第 3 次临时会议与会股东一致审议通过，聘任吴昱村先生担任公司第二届董事会董事。

5、经 2021 年 6 月 28 日召开的公司股东会 2021 年定期会议与会股东一致审议通过，乔宗利

先生辞去公司第二届董事会董事/副董事长职务，由孙莉女士担任公司第二届董事会董事。经 2021 年 7 月 16 日召开的公司第二届董事会 2021 年第 10 次临时会议与会董事一致审议通过，孙莉女士担任公司第二届董事会副董事长。

6、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。

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、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金于 2021 年 1 月 30 日公告投资范围新增存托凭证，投资策略相应增加“存托凭证投资策略”，相关内容请参见 2021 年 1 月 30 日公告。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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

本报告期内，本基金管理人、托管人及其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	
中国银河	1	676, 59	21. 44%	494, 79	21. 62%	—

证券股份 有限公司		8,070. 37		6.50		
兴业证券 股份有限 公司	1	201,21 9,822. 87	6.37%	127,03 0.13	5.55%	—
华创证券 有限责任 公司	2	—	—	—	—	—
南京证券 股份有限 公司	1	382,18 1,664. 74	12.11%	279,48 9.59	12.21%	—
国信证券 股份有限 公司	2	398,56 1,469. 49	12.63%	291,46 8.66	12.74%	—
国盛证券 有限责任 公司	1	191,65 7,386. 08	6.07%	140,15 9.45	6.13%	—
广发证券 股份有限 公司	2	—	—	—	—	—
海通证券 股份有限 公司	1	74,233 ,362.6 5	2.35%	54,286 .94	2.37%	—
长江证券 股份有限 公司	2	1,231, 947,77 6.93	39.03%	900,92 2.66	39.37%	—

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：海通证券股份有限公司。本报告期内退租交易单元：无。

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
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	692,000.00	19.79%	-	-	-	-

有限公司								
华创 证券 有限 责任 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
南京 证券 股份 有限 公司	-	-	227,0 00,00 0.00	6.49%	-	-	-	-
国信 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	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	804,0 00,00	23.00%	-	-	-	-

股份 有限 公司			0.00					
长江 证券 股份 有限 公司	-	-	1,773 ,000, 000.0 0	50.72%	-	-	-	-

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	前海联合价值优选混合基金 2020 年第 4 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	2021-01-22
2	前海联合基金管理有限公司 关于旗下部分基金投资范围 增加存托凭证并修订相关法 律文件的公告	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	2021-01-30
3	前海联合基金管理有限公司 关于调整旗下部分基金在直 销柜台首次申购及追加申购 单笔最低金额的公告	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	2021-02-27
4	关于提醒投资者及时更新已 过期身份证件及其他身份基 本信息的公告	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	2021-03-20
5	前海联合基金管理有限公司 关于旗下部分基金根据侧袋 机制指引修订相关法律文件 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	2021-03-29

6	前海联合价值优选混合基金 2020 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	2021-03-30
7	前海联合价值优选混合基金 2021 年第 1 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	2021-04-22

§ 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

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	20210101-20210630	300,052,333.33	0.00	0.00	300,052,333.33	29.86%
机构	2	20210101-20210630	300,052,333.33	0.00	0.00	300,052,333.33	29.86%
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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》等法律法规及各基金基金合同等规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，本基金管理人就旗下 25 只证券投资基金（包括本基金）增加侧袋机制相关内容并相应对相关法律文件进行修订，有关详细信息请参见本基金管理人于 2021 年 3 月 29 日发布的相关公告。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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。

12.3 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

二〇二一年八月三十日