

前海开源一带一路主题精选灵活配置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：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：中国银河证券股份有限公司

送出日期：2023 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 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。

本报告中的财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录 .....	2
1.1	重要提示 .....	2
1.2	目录 .....	3
§ 2	基金简介 .....	5
2.1	基金基本情况 .....	5
2.2	基金产品说明 .....	5
2.3	基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4	信息披露方式 .....	6
2.5	其他相关资料 .....	7
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	7
3.1	主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2	基金净值表现 .....	8
3.3	过去三年基金的利润分配情况 .....	10
§ 4	管理人报告 .....	10
4.1	基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
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 .....	15
§ 5	托管人报告 .....	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
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 .....	15
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	15
§ 6	审计报告 .....	15
6.1	审计报告基本信息 .....	15
6.2	审计报告的基本内容 .....	15
§ 7	年度财务报表 .....	17
7.1	资产负债表 .....	17
7.2	利润表 .....	18
7.3	净资产（基金净值）变动表 .....	19
7.4	报表附注 .....	21
§ 8	投资组合报告 .....	49
8.1	期末基金资产组合情况 .....	49
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	49
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 .....	50
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	51
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	56

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 .....	56
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 .....	56
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 .....	56
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 .....	56
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	56
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
8.12	投资组合报告附注 .....	57
§ 9	基金份额持有人信息 .....	58
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	58
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	58
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 .....	58
§ 10	开放式基金份额变动 .....	59
§ 11	重大事件揭示 .....	59
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	59
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 .....	59
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
11.4	基金投资策略的改变 .....	59
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
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 .....	60
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	61
11.8	其他重大事件 .....	62
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
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 .....	65
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
§ 13	备查文件目录 .....	65
13.1	备查文件目录 .....	65
13.2	存放地点 .....	65
13.3	查阅方式 .....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	前海开源一带一路混合	
基金主代码	001209	
基金运作方式	契约型普通开放式	
基金合同生效日	2015 年 04 月 29 日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	中国银河证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	79,261,938.51 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海开源一带一路混合 A	前海开源一带一路混合 C
下属分级基金的交易代码	001209	002080
报告期末下属分级基金的份额总额	69,829,254.70 份	9,432,683.81 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力图把握“一带一路”战略带来的投资机会，通过主题精选和个股精选，分享“丝绸之路”经济带和“海上丝绸之路”建设所带来的长期投资价值。在严格控制投资风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的稳健收益。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下五方面内容：</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>在大类资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。本基金通过对股票等权益类、债券等固定收益类和现金资产分布的实时监控，根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场变化等因素以及基金的风险评估进行灵活调整。在各类资产中，根据其参与市场基本要素的变动，调整各类资产在基金投资组合中的比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金采取自上而下的宏观分析和自下而上精选个股的投资策略，在遵循本基金资产配置比例限制前提下，确定基金在各类资产具体投资比例。根据国家“一带一路”的相关规划和布局，自上而下重点投资基建、交运、贸易、旅游、文化和金融等相关板块，自下而上精选受益于“一带一路”主题的优质公司，构建核心股票池；再通过本基金已有的个股筛选打分体系，根据模拟组合的资产额度，构建投资组合，其后根据资产额度的变化，投资组合个股数量也会相应进行调整，以期追求超额收益，分享“一带一路”的建设带来的投</p>

	<p>资价值。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>在债券投资策略方面,本基金将在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理,采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。在宏观环境分析方面,结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析,根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征,定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整,确定不同类属资产的最优权重。在微观市场定价分析方面,本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。具体投资策略有收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>在权证投资方面,本基金根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值,发现市场对股票权证的非理性定价;利用权证衍生工具的特性,通过权证与证券的组合投资,来达到改善组合风险收益特征的目的。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金,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	前海开源基金管理有限公司	中国银河证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙辰健
	联系电话	0755-88601888
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com
客户服务电话	4001-666-998	95551; 400-888-8888
传真	0755-83181169	010-80928078
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)	北京市丰台区西营街8号院1号楼7至18层101
办公地址	深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦2206	北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦
邮政编码	518040	100073
法定代表人	李强	陈亮

### 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.qhkyfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	前海开源基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 2206

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年		2021 年		2020 年	
	前海开源一带一路混合 A	前海开源一带一路混合 C	前海开源一带一路混合 A	前海开源一带一路混合 C	前海开源一带一路混合 A	前海开源一带一路混合 C
本期已实现收益	-40,102,525.02	-4,914,357.72	20,570,356.67	1,647,876.61	70,503,526.76	2,764,646.47
本期利润	-39,931,332.04	-4,932,789.75	-11,253,738.23	-1,113,486.42	81,870,086.00	3,309,360.30
加权平均基金份额本期利润	-0.5597	-0.5975	-0.1421	-0.1628	0.6493	0.7392
本期加权平均净值利润率	-48.96%	-48.02%	-8.51%	-8.95%	52.19%	52.65%
本期基金份额净值增长率	-35.87%	-35.99%	-9.49%	-9.58%	67.36%	67.33%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
	前海开源一带一路混合 A	前海开源一带一路混合 C	前海开源一带一路混合 A	前海开源一带一路混合 C	前海开源一带一路混合 A	前海开源一带一路混合 C
期末可供分配利润	-1,068,500.94	719,617.20	39,693,350.89	5,486,546.19	42,739,179.42	2,838,284.92
期末可供分配基金份额利润	-0.0153	0.0763	0.5364	0.6810	0.4655	0.6072
期末基金资产净值	68,760,753.76	10,152,301.01	113,688,822.78	13,542,846.09	155,826,610.98	8,687,826.97
期末基金份额净值	0.985	1.076	1.536	1.681	1.697	1.859
3.1.3 累计	2022 年末		2021 年末		2020 年末	

期末指标	前海开源一 带一路混合 A	前海开源一 带一路混合 C	前海开源一 带一路混合 A	前海开源一 带一路混合 C	前海开源一 带一路混合 A	前海开源 一带一路 混合 C
基金份额累 计净值增长 率	-1.50%	7.60%	53.60%	68.10%	69.70%	85.90%

注：①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。

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。

## 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

前海开源一带一路混合 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
过去三个月	-6.55%	1.02%	1.29%	0.90%	-7.84%	0.12%
过去六个月	-15.88%	1.03%	-9.21%	0.77%	-6.67%	0.26%
过去一年	-35.87%	1.22%	-14.45%	0.90%	-21.42%	0.32%
过去三年	-2.86%	1.65%	0.97%	0.91%	-3.83%	0.74%
过去五年	15.07%	1.50%	7.23%	0.91%	7.84%	0.59%
自基金合同生 效起至今	-1.50%	1.28%	-0.06%	1.01%	-1.44%	0.27%

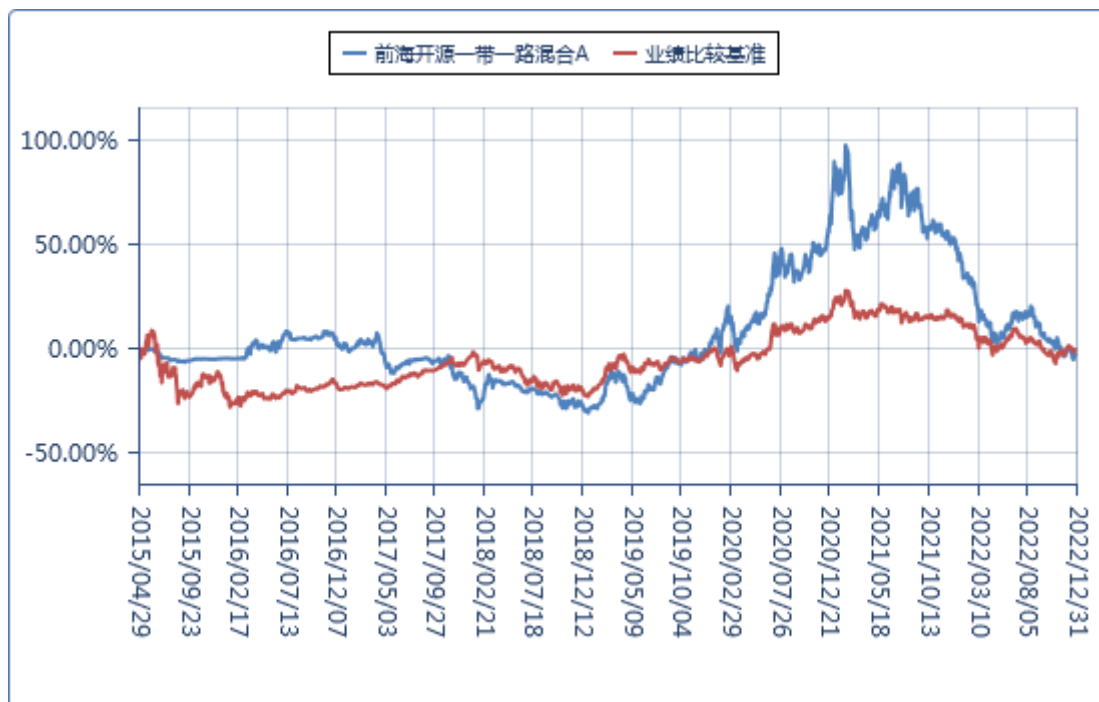
前海开源一带一路混合 C

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
过去三个月	-6.60%	1.02%	1.29%	0.90%	-7.89%	0.12%
过去六个月	-16.00%	1.03%	-9.21%	0.77%	-6.79%	0.26%
过去一年	-35.99%	1.22%	-14.45%	0.90%	-21.54%	0.32%
过去三年	-3.15%	1.65%	0.97%	0.91%	-4.12%	0.74%
过去五年	14.47%	1.50%	7.23%	0.91%	7.24%	0.59%
自基金合同生 效起至今	7.60%	1.33%	14.88%	0.87%	-7.28%	0.46%

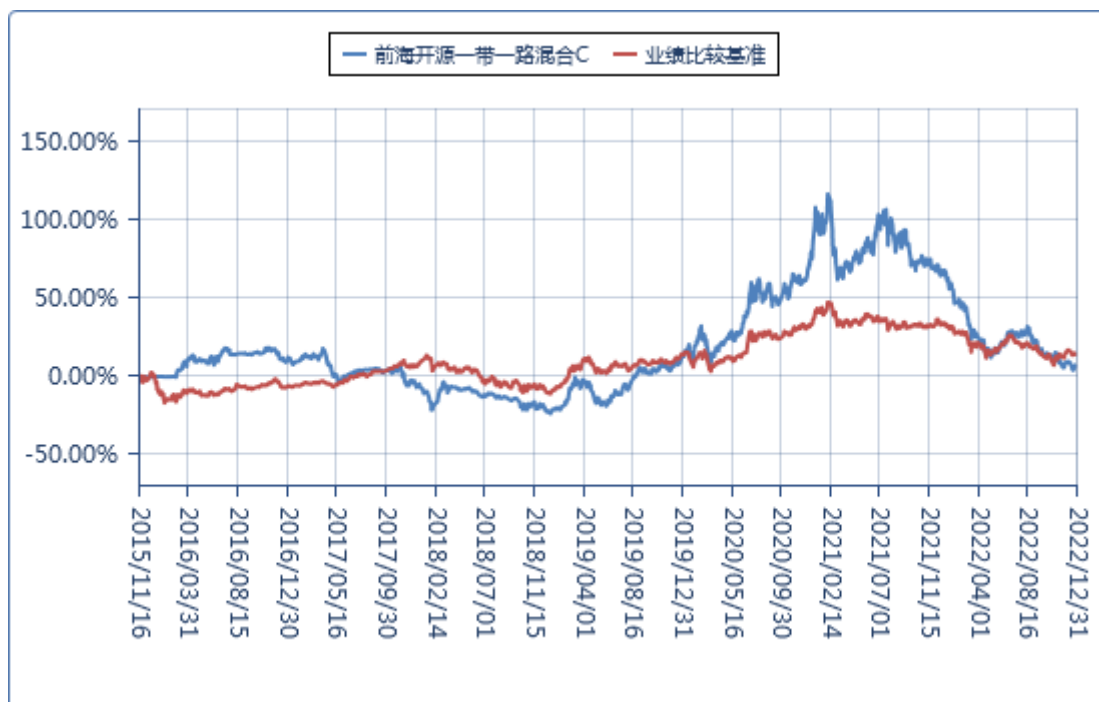
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



前海开源一带一路混合 A



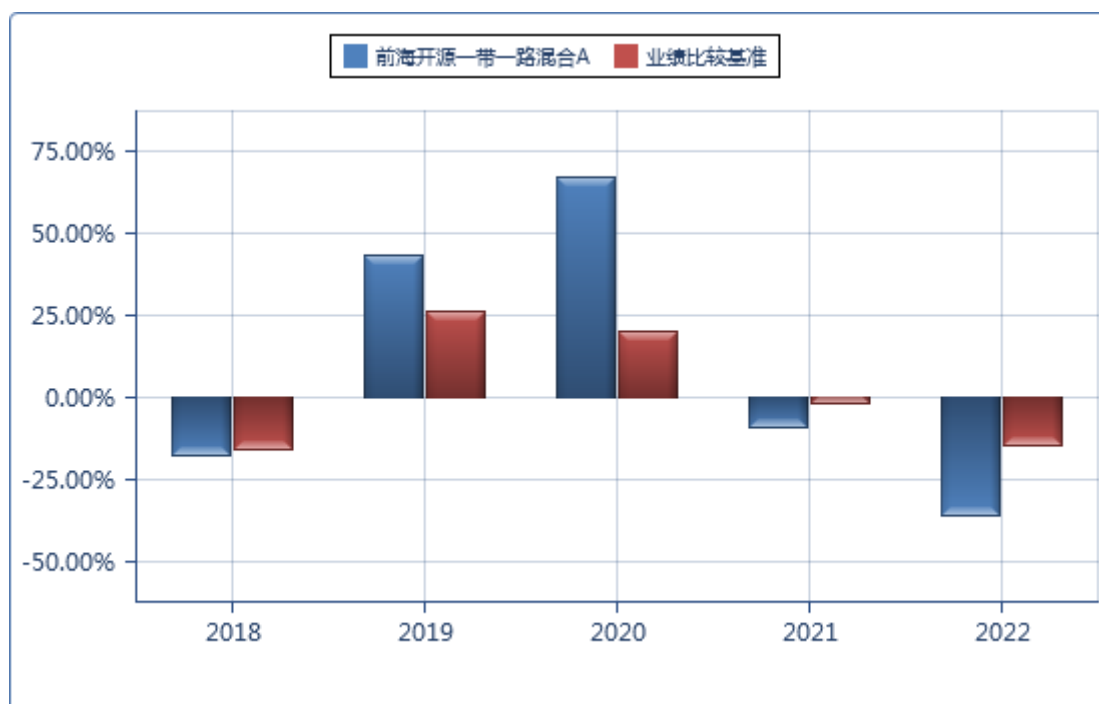
前海开源一带一路混合 C



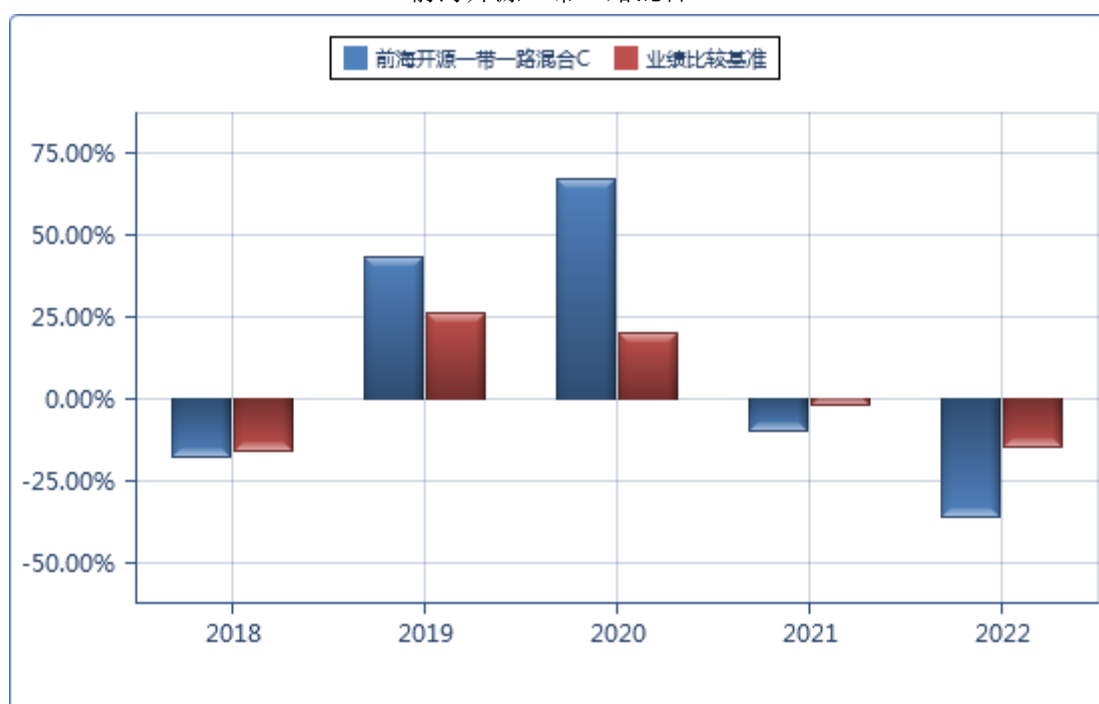
注：本基金自 2015 年 11 月 16 日起，增加前海开源一带一路混合 C 基金份额并设置对应基金代码。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海开源一带一路混合 A



前海开源一带一路混合 C



### 3.3 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

前海开源基金管理有限公司（以下简称“前海开源基金”）于 2012 年 12 月 27 日经中国证监会批准，2013 年 1 月 23 日注册成立，截至报告期末，注册资本为 2 亿元人民币。其中，开源证券股份有限公司、北京市中盛金期投资管理有限公司、北京长和世纪资产管理有限公司和深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)各持股权 25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海、广州设立分公司。经中国证监会批准，前海开源基金全资控股子公司--前海开源资产管理有限公司已于 2013 年 9 月 5 日在深圳市注册成立，并于 2013 年 9 月 18 日取得中国证监会核发的《特定客户资产管理业务资格证书》，截至报告期末，注册资本为 1.8 亿元人民币。

截至报告期末，前海开源基金旗下管理 97 只开放式基金，资产管理规模超过 1181 亿元。

#### 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		
吴国清	本基金的基金经理、公司执行投资总监	2019 年 07 月 19 日	-	15 年	吴国清先生，清华大学博士研究生。历任南方基金管理有限公司研究员、基金经理助理、投资经理。2015 年 8 月加入前海开源基金管理有限公司，现任公司执行投资总监。

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”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，针对股票市场、债券市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节，制定了《前海开源基金管理有限公司公平交易管理办法》、《前海开源基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

### 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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 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，因组合投资策略需要，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价出现 1 次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，基金经理按规定履行了审批程序。

## 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

2022 年，国内宏观经济进入“衰退期”，A 股基本面趋势下行。开年以来，美联储加息预期上行、俄乌局势恶化、全国多地疫情影响经济活动，市场悲观预期大幅发酵，市场大幅下探。5-6 月，美国经济走弱的信号开始出现，美联储加息预期边际放缓，国内复工复产推进，经济弱复苏但新能源板块需求亮点突出，市场走出大幅反弹。三季度，国内宏观经济展望不佳，出口预期下修，各地疫情散发扰动，地产供给端停贷风波发酵，海外通胀预期再起，美联储坚定抗通胀，紧缩预期继续上修，人民币汇率快速回落，市场回调兑现。四季度政策预期修复，重磅政策推出，地产“三箭齐发”和防疫政策优化，消费场景恢复、居民支出意愿回升的乐观预期发酵，市场风险偏好回升，指数震荡上行。整体而言，2022 年市场波动显著放大。上证综指全年下跌 15.13%，万得全 A 全年下跌 18.66%。

结构方面，一季度国内稳增长预期，叠加俄乌冲突使大宗商品供给偏紧，三季度再通胀交易发酵，煤炭全年表现占优。年末防疫政策优化，疫后复苏预期升温，线下服务消费板块社会服务、美容护理、商贸零售四季度反弹，全年跌幅较小，相对表现同样靠前。

报告期内，本基金依据宏观经济政策的变动以及相关板块景气度和估值水平调整股票仓位和板块配置结构。后续操作中，我们仍将精选具备长期增长潜力、拥有核心竞争力、估值与成长相匹配的优质个股，努力为投资者创造可持续的投资回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源一带一路混合 A 基金份额净值为 0.985 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-35.87%，同期业绩比较基准收益率为-14.45%；截至报告期末前海开源一带一路混合 C 基金份额净值为 1.076 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-35.99%，同期业绩比较基准收益率为-14.45%。

#### 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，权益市场收益率预计边际改善。2023 年中国内需周期与欧美需求周期明显分化，将为权益市场带来收益率边际改善的机会，仍需积极布局。节奏上，全年盈利增速预计较为温和，中途基本面改善的验证过程难免波折，春季躁动、以及三季度经济数据真正改善，将为市场带来战术配置机会。

当前市场仍处于春季行情中，分子端，春节人流消费恢复得到验证，基本面改善确定；分母端，美联储加息尾声预期上行，外资战术性回流 A 股。继续看好春季行情，指数仍有上行空间。结构方面，短期消费难以验证强复苏，外资回流可能边际放缓，消费可能钝化，科技成长有望成为占优风格。进入二季度，经济的实际复苏情况或将成为影响行情的主要矛盾，美国经济一旦确认衰退，外需回落将给国内经济基本面带来压力，A 股基本面难免承压，市场可能转向调整。而进入三季度，复苏期投资启动，经济开始真正复苏，而彼时海外经济大概率仍处于衰退期，预计 A 股率先迎来机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益的角度出发，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，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具

监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 本年度，我公司采取外聘律师和内部专业人士相结合的方式，对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训，进一步提高了我公司从业人员的合规素质和职业道德修养。

(2) 本年度，我公司按照证监会的要求对公司治理、投资、研究、交易、基金会计、注册登记、人力资源、基金销售等主要业务进行定期稽核工作。同时，对信息技术、用户权限、通信管理与视频监控、基金直销、后台运营、内幕交易防控等相关业务开展了专项稽核工作，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性等。

(3) 通过事前合规防范、事中系统控制、事后完善纠偏的方式，全面加强了对公司产品日常投资运作的管理与监控，保证投资符合既定的投资决策程序与业务流程，基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

(4) 全面参与新产品设计、新业务拓展工作，负责日常合同审查，监督客户投诉处理。积极参与证监会新规定出台前的讨论并提出修改建议。

(5) 完成各基金及公司的各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；重视媒体监督和投资者关系管理工作。

(6) 按照规定向人民银行报送反洗钱相关报表和报告，按监管要求制定客户洗钱风险划分的标准，并升级了客户洗钱风险划分系统。

本基金管理人承诺将依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引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。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会主席由总经理办公会指定，估值委员会成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的基金行业实践经验。

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和流通受限股票的估值相关数据。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 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

本基金本报告期内，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元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银河证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人按照《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法复核前海开源基金管理有限公司编制和披露的前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告、投资组合报告等内容，以上内容真实、准确和完整。

### § 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	普华永道中天审字(2023)第 23035 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	前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

<p>审计意见</p>	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“前海开源一带一路混合基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>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,公允反映了前海开源一带一路混合基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于前海开源一带一路混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>无</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>前海开源一带一路混合基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司(以下简称“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。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估前海开源一带一路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开源一带一路混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督前海开源一带一路混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>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:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风</p>



	<p>险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 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>(三) 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。</p> <p>(四) 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，根据获取的审计证据，就可能对前海开源一带一路混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致前海开源一带一路混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	陈熹   施翊洲
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2023 年 03 月 28 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：前海开源一带一路主题精选灵活配置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	11,886,406.72	16,436,804.84
结算备付金		375,724.71	375,943.89
存出保证金		167,246.95	381,135.78
交易性金融资产	7.4.7.2	66,971,054.34	114,747,716.58
其中：股票投资		66,971,054.34	114,747,716.58
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	1,558,397.29
应收股利		-	-
应收申购款		5,586.75	56,209.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	2,142.10
资产总计		79,406,019.47	133,558,350.47
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	5,498,052.47
应付赎回款		61,286.57	172,695.52
应付管理人报酬		100,475.84	162,526.97
应付托管费		16,745.98	27,087.84
应付销售服务费		859.75	1,119.71
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	313,596.56	465,199.09
负债合计		492,964.70	6,326,681.60
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.7	79,261,938.51	82,051,771.79
未分配利润	7.4.7.8	-348,883.74	45,179,897.08
净资产合计		78,913,054.77	127,231,668.87
负债和净资产总计		79,406,019.47	133,558,350.47

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，前海开源一带一路混合基金份额总额 79,261,938.51 份，其中，前海开源一带一路混合 A 类基金份额净值 0.985 元，基金份额总额 69,829,254.70 份；前海开源一带一路混合 C 类基金份额净值 1.076 元，基金份额总额 9,432,683.81 份。

## 7.2 利润表

会计主体：前海开源一带一路主题精选灵活配置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>		-43,092,737.92	-6,348,783.40
1. 利息收入		62,171.07	79,699.57
其中：存款利息收入	7.4.7.9	62,171.07	79,699.57
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-43,347,118.86	27,947,757.55
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-43,846,445.67	27,579,684.11
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	499,326.81	368,073.44
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	152,760.95	-34,585,457.93
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	39,448.92	209,217.41
<b>减：二、营业总支出</b>		1,771,383.87	6,018,441.25
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,382,660.08	2,176,795.49
2. 托管费	7.4.10.2.2	230,443.45	362,799.30
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	10,280.34	12,419.19
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	7.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.20	148,000.00	3,466,427.27
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-44,864,121.79	-12,367,224.65
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-44,864,121.79	-12,367,224.65
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-44,864,121.79	-12,367,224.65

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：前海开源一带一路主题精选灵活配置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)	82,051,771.79	-	45,179,897.08	127,231,668.87
二、本期期初净资产 (基金净值)	82,051,771.79	-	45,179,897.08	127,231,668.87
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-2,789,833.28	-	-45,528,780.82	-48,318,614.10
(一)、综合收益总额	-	-	-44,864,121.79	-44,864,121.79
(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)	-2,789,833.28	-	-664,659.03	-3,454,492.31
其中：1. 基金申购款	17,745,628.51	-	3,588,027.87	21,333,656.38
2. 基金赎回款	-20,535,461.79	-	-4,252,686.90	-24,788,148.69
(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、本期期末净资产 (基金净值)	79,261,938.51	-	-348,883.74	78,913,054.77
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 (基金净值)	96,488,236.00	-	68,026,201.95	164,514,437.95
二、本期期初净资产 (基金净值)	96,488,236.00	-	68,026,201.95	164,514,437.95
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-14,436,464.21	-	-22,846,304.87	-37,282,769.08
(一)、综合收益总额	-	-	-12,367,224.65	-12,367,224.65
(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)	-14,436,464.21	-	-10,479,080.22	-24,915,544.43
其中：1. 基金申购款	46,642,638.60	-	35,808,431.83	82,451,070.43

2. 基金赎回款	-61,079,102.81	-	-46,287,512.05	-107,366,614.86
(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、本期期末净资产(基金净值)	82,051,771.79	-	45,179,897.08	127,231,668.87

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：

秦亚峰

何璁

傅智

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

前海开源一带一路主题精选灵活配置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[2015]426号《关于准予前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由前海开源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《前海开源一带一路主题精选灵活配置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1,613,336,326.04元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2015]02030037号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年4月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,613,952,378.29份基金份额,其中认购资金利息折合616,052.25份基金份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司,基金托管人为中国银河证券股份有限公司。

根据本基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司于2015年11月15日发布的《关于前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同的公告》以及更新的《前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,自2015年11月16日起,本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,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,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《前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券

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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券等)、资产支持证券、权证、货币市场工具、股指期货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相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 0-95%；投资于一带一路主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指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、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。

本财务报表由本基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司于审计报告日批准报出。

#### 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》、《前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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。

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。

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、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(可转换债券和可交换债券除外)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(可转换债券和可交换债券除外)，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，2021年度的比较财务报表未重列。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。

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、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 16,436,804.84 元、375,943.89 元、381,135.78 元、2,142.10 元、1,558,397.29 元和 56,209.99 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、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 16,438,572.17 元、376,130.01 元、381,324.43 元、0.00 元、1,558,397.29 元和 56,209.99 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 114,747,716.58 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 114,747,716.58 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 5,498,052.47 元、172,695.52 元、162,526.97 元、27,087.84 元、1,119.71 元、290,662.03 元和 37.06 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 5,498,052.47 元、172,695.52 元、162,526.97 元、27,087.84 元、1,119.71 元、290,662.03 元和 37.06 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

无。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 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2018年1月1日起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	11,886,406.72	16,436,804.84

等于：本金	11,885,356.27	16,436,804.84
加：应计利息	1,050.45	-
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	11,886,406.72	16,436,804.84

#### 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	63,353,866.31	-	66,971,054.34	3,617,188.03
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	63,353,866.31	-	66,971,054.34	3,617,188.03
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	111,283,289.50	-	114,747,716.58	3,464,427.08
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	111,283,289.50	-	114,747,716.58	3,464,427.08

#### 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。

## 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

无。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 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	-	2,142.10
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	2,142.10

## 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	61.42	37.06
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	179,035.14	290,662.03
其中：交易所市场	179,035.14	290,662.03
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	134,500.00	174,500.00
合计	313,596.56	465,199.09

## 7.4.7.7 实收基金

前海开源一带一路混合 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	73,995,471.89	73,995,471.89

本期申购	10,314,665.38	10,314,665.38
本期赎回（以“-”号填列）	-14,480,882.57	-14,480,882.57
本期末	69,829,254.70	69,829,254.70

前海开源一带一路混合 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	8,056,299.90	8,056,299.90
本期申购	7,430,963.13	7,430,963.13
本期赎回（以“-”号填列）	-6,054,579.22	-6,054,579.22
本期末	9,432,683.81	9,432,683.81

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

前海开源一带一路混合 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	51,314,582.25	-11,621,231.36	39,693,350.89
本期利润	-40,102,525.02	171,192.98	-39,931,332.04
本期基金份额交易产生的变动数	-1,596,420.86	765,901.07	-830,519.79
其中：基金申购款	3,542,006.45	-1,857,035.85	1,684,970.60
基金赎回款	-5,138,427.31	2,622,936.92	-2,515,490.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,615,636.37	-10,684,137.31	-1,068,500.94

前海开源一带一路混合 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	6,889,603.33	-1,403,057.14	5,486,546.19
本期利润	-4,914,357.72	-18,432.03	-4,932,789.75
本期基金份额交易产生的变动数	345,576.38	-179,715.62	165,860.76
其中：基金申购款	3,267,719.83	-1,364,662.56	1,903,057.27
基金赎回款	-2,922,143.45	1,184,946.94	-1,737,196.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,320,821.99	-1,601,204.79	719,617.20

#### 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	51,154.69

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	7,308.34	15,063.43
其他	3,708.04	5,779.70
合计	62,171.07	79,699.57

#### 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	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022年12月31日	2021年01月01日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	607,858,406.72	1,248,879,656.43
减：卖出股票成本总额	650,112,558.48	1,221,299,972.32
减：交易费用	1,592,293.91	-
买卖股票差价收入	-43,846,445.67	27,579,684.11

#### 7.4.7.11 基金投资收益

无。

#### 7.4.7.12 债券投资收益

##### 7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.12.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

无。

#### 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.14.2 贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

## 7.4.7.15.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.15.2 衍生工具收益—其他投资收益

无。

## 7.4.7.16 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	499,326.81	368,073.44
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	499,326.81	368,073.44

## 7.4.7.17 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
1. 交易性金融资产	152,760.95	-34,585,457.93
—股票投资	152,760.95	-34,585,457.93
—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	152,760.95	-34,585,457.93

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	35,604.28	196,415.32
转换费收入	3,844.64	12,802.09
合计	39,448.92	209,217.41

#### 7.4.7.19 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	18,000.00	22,500.00
交易费用	-	3,273,927.27
合计	148,000.00	3,466,427.27

#### 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

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国银河证券股份有限公司（“中国银河证券”）	基金托管人、基金销售机构
开源证券股份有限公司（“开源证券”）	基金销售机构、基金管理人的股东
深圳市和合投信资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
北京长和世纪资产管理有限公司	基金管理人的股东
北京市中盛金期投资管理有限公司	基金管理人的股东
前海开源资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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费	1,382,660.08	2,176,795.49
其中：支付销售机构的客户维护费	454,935.69	676,726.33

注：支付基金管理人前海开源基金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。

##### 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	230,443.45	362,799.30

注：支付基金托管人中国银河证券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×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		
	前海开源一带一路混合 A	前海开源一带一路混合 C	合计
前海开源基金	-	1,137.01	1,137.01
合计	-	1,137.01	1,137.01
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		
	前海开源一带一路混合 A	前海开源一带一路混合 C	合计
前海开源基金	-	1,794.67	1,794.67
开源证券	-	7.98	7.98
合计	-	1,802.65	1,802.65

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 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给前海开源基金，再由前海开源基金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。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.10% / 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

无。

#### 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

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

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

无。

##### 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



本基金投资于股票、债券等金融工具，在日常投资管理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奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理团队和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理团队负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或其他国内大中型商业银行处，因而与银行存款相关的信用风险不重大。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 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有债券、资产支持证券和同业存单投资（2021 年 12 月 31 日：同）。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 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在开放期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在开放期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，除卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他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（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约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》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时间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，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计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，本基金组合资产中经确认的当日净赎回金额未超过 7 个工作日可变现资产的账面价值。

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、结算备付金和存出保证金等。

#### 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	11,886,406.72	-	-	-	11,886,406.72
结算备付金	375,724.71	-	-	-	375,724.71
存出保证金	167,246.95	-	-	-	167,246.95
交易性金融资产	-	-	-	66,971,054.34	66,971,054.34
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,586.75	5,586.75
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,429,378.38	-	-	66,976,641.09	79,406,019.47
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	-	-	-	61,286.57	61,286.57
应付管理人报酬	-	-	-	100,475.84	100,475.84
应付托管费	-	-	-	16,745.98	16,745.98
应付销售服务费	-	-	-	859.75	859.75
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	-	-	-	313,596.56	313,596.56
负债总计	-	-	-	492,964.70	492,964.70
利率敏感度缺口	12,429,378.38	-	-	66,483,676.39	78,913,054.77
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2021 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	16,436,804.84	-	-	-	16,436,804.84
结算备付金	375,943.89	-	-	-	375,943.89
存出保证金	381,135.78	-	-	-	381,135.78
交易性金融资产	-	-	-	114,747,716.58	114,747,716.58
应收清算款	-	-	-	1,558,397.29	1,558,397.29
其他资产	-	-	-	2,142.10	2,142.10
应收申购款	-	-	-	56,209.99	56,209.99
资产总计	17,193,884.51	-	-	116,364,465.96	133,558,350.47
负债					
应付清算款	-	-	-	5,498,052.47	5,498,052.47
应付赎回款	-	-	-	172,695.52	172,695.52
应付管理人报酬	-	-	-	162,526.97	162,526.97
应付托管费	-	-	-	27,087.84	27,087.84
应付销售服务费	-	-	-	1,119.71	1,119.71
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	465,199.09	465,199.09
负债总计	-	-	-	6,326,681.60	6,326,681.60
利率敏感度缺口	17,193,884.51	-	-	110,037,784.36	127,231,668.87

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，本基金未持有交易性债券投资(2021 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(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化而发生波动的风险。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证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金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市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等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	66,971,054.34	84.87	114,747,716.58	90.19
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	66,971,054.34	84.87	114,747,716.58	90.19

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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)
	业绩比较基准上升 5%	4,328,502.28	5,928,502.05
	业绩比较基准下降 5%	-4,328,502.28	-5,928,502.05

### 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	66,971,054.34	112,682,153.10
第二层次	-	5,504.49
第三层次	-	2,060,058.99
合计	66,971,054.34	114,747,716.58

##### 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	-	2,060,058.99	2,060,058.99
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	3,608.00	3,608.00
转出第三层次	-	2,057,361.27	2,057,361.27
当期利得或损失总额	-	-6,305.72	-6,305.72
其中：计入损益的利得或损失	-	-6,305.72	-6,305.72
期末余额	-	-	-

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	-	-	-
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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,906,565.52	1,906,565.52
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	153,493.47	153,493.47
其中：计入损益的利得或损失	-	153,493.47	153,493.47
期末余额	-	2,060,058.99	2,060,058.99
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	-	153,493.47	153,493.47

注：于 2022 年 12 月 31 日，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 2022 年度，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
-	-	-	-	-	-
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
流动性折扣估值处于限售期的股票	2,060,058.99	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	17.17%-195.47%	负相关



投资					
----	--	--	--	--	--

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日:同)。

#### 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	66,971,054.34	84.34
	其中:股票	66,971,054.34	84.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,262,131.43	15.44
8	其他各项资产	172,833.70	0.22
9	合计	79,406,019.47	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	42,718,493.36	54.13

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,340,000.00	2.97
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	9,284,959.98	11.77
J	金融业	7,699,840.00	9.76
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,289,918.00	2.90
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	2,637,843.00	3.34
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	66,971,054.34	84.87

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300124	汇川技术	54,900	3,815,550.00	4.84
2	000001	平安银行	286,600	3,771,656.00	4.78
3	300438	鹏辉能源	46,800	3,649,932.00	4.63
4	001215	千味央厨	51,600	3,382,896.00	4.29
5	600588	用友网络	132,800	3,209,776.00	4.07
6	603517	绝味食品	51,500	3,146,135.00	3.99
7	688111	金山办公	11,819	3,126,007.31	3.96
8	002791	坚朗五金	25,500	2,650,725.00	3.36
9	300015	爱尔眼科	84,900	2,637,843.00	3.34
10	600132	重庆啤酒	18,500	2,356,530.00	2.99
11	688308	欧科亿	31,184	2,354,392.00	2.98

12	603816	顾家家居	55,000	2,349,050.00	2.98
13	000963	华东医药	50,000	2,340,000.00	2.97
14	002142	宁波银行	71,600	2,323,420.00	2.94
15	300661	圣邦股份	13,300	2,295,580.00	2.91
16	300068	南都电源	107,700	2,294,010.00	2.91
17	601888	中国中免	10,600	2,289,918.00	2.90
18	605117	德业股份	6,700	2,219,040.00	2.81
19	002920	德赛西威	20,600	2,170,004.00	2.75
20	300760	迈瑞医疗	6,100	1,927,417.00	2.44
21	300525	博思软件	85,500	1,692,900.00	2.15
22	300633	开立医疗	30,000	1,644,900.00	2.08
23	300973	立高食品	16,900	1,625,442.00	2.06
24	000776	广发证券	103,600	1,604,764.00	2.03
25	688099	晶晨股份	17,817	1,256,276.67	1.59
26	601882	海天精工	44,200	1,158,040.00	1.47
27	600600	青岛啤酒	9,800	1,053,500.00	1.34
28	688533	上声电子	15,977	917,079.80	1.16
29	603345	安井食品	5,100	825,588.00	1.05
30	603606	东方电缆	12,000	813,960.00	1.03
31	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.09

#### 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	601668	中国建筑	16,890,009.60	13.28
2	300750	宁德时代	16,161,772.00	12.70
3	002271	东方雨虹	11,373,191.64	8.94
4	600048	保利发展	11,006,839.00	8.65
5	300274	阳光电源	10,038,914.00	7.89
6	002371	北方华创	9,991,112.97	7.85
7	002714	牧原股份	9,585,177.20	7.53
8	600519	贵州茅台	9,498,862.00	7.47
9	601669	中国电建	8,816,191.00	6.93
10	688390	固德威	7,756,084.12	6.10
11	300014	亿纬锂能	7,335,846.00	5.77
12	300776	帝尔激光	7,126,292.00	5.60
13	601111	中国国航	6,900,272.00	5.42
14	600036	招商银行	6,566,644.74	5.16
15	002791	坚朗五金	6,522,823.25	5.13

16	603606	东方电缆	5,843,780.20	4.59
17	300015	爱尔眼科	5,808,012.68	4.56
18	300438	鹏辉能源	5,542,415.74	4.36
19	002920	德赛西威	5,472,156.00	4.30
20	000002	万科 A	5,360,889.00	4.21
21	600123	兰花科创	5,360,664.00	4.21
22	000983	山西焦煤	5,200,135.00	4.09
23	600702	舍得酒业	5,028,640.22	3.95
24	600588	用友网络	4,982,928.02	3.92
25	600009	上海机场	4,978,769.00	3.91
26	600809	山西汾酒	4,907,544.28	3.86
27	603363	傲农生物	4,775,487.00	3.75
28	000568	泸州老窖	4,589,675.96	3.61
29	688707	振华新材	4,557,319.94	3.58
30	600132	重庆啤酒	4,513,576.00	3.55
31	688556	高测股份	4,473,631.18	3.52
32	603035	常熟汽饰	4,431,048.00	3.48
33	601699	潞安环能	4,430,897.00	3.48
34	688202	美迪西	4,427,546.46	3.48
35	688111	金山办公	4,405,829.20	3.46
36	601888	中国中免	4,310,883.00	3.39
37	002624	完美世界	4,294,721.00	3.38
38	300068	南都电源	4,291,397.00	3.37
39	002709	天赐材料	4,263,856.00	3.35
40	688599	天合光能	4,256,295.44	3.35
41	601898	中煤能源	4,193,952.00	3.30
42	000333	美的集团	4,184,691.00	3.29
43	300680	隆盛科技	4,136,891.00	3.25
44	605117	德业股份	4,113,894.60	3.23
45	000625	长安汽车	4,078,509.70	3.21
46	600547	山东黄金	4,058,034.00	3.19
47	600110	诺德股份	4,004,768.00	3.15
48	300502	新易盛	3,923,317.46	3.08
49	601633	长城汽车	3,875,422.00	3.05
50	000001	平安银行	3,859,960.00	3.03
51	688063	派能科技	3,812,579.82	3.00
52	300124	汇川技术	3,772,994.00	2.97
53	688126	沪硅产业	3,691,584.85	2.90
54	002487	大金重工	3,595,658.00	2.83
55	600383	金地集团	3,476,606.00	2.73
56	688308	欧科亿	3,475,884.54	2.73

57	605305	中际联合	3,468,617.89	2.73
58	601899	紫金矿业	3,439,186.00	2.70
59	600085	同仁堂	3,390,445.00	2.66
60	300896	爱美客	3,343,220.00	2.63
61	600763	通策医疗	3,326,696.00	2.61
62	000933	神火股份	3,311,169.00	2.60
63	600690	海尔智家	3,280,520.00	2.58
64	300973	立高食品	3,266,371.00	2.57
65	603816	顾家家居	3,262,804.00	2.56
66	688516	奥特维	3,242,196.17	2.55
67	000776	广发证券	3,226,838.00	2.54
68	002142	宁波银行	3,193,961.00	2.51
69	601600	中国铝业	3,186,298.00	2.50
70	603348	文灿股份	3,171,969.00	2.49
71	601001	晋控煤业	3,142,823.00	2.47
72	300661	圣邦股份	3,108,439.00	2.44
73	300666	江丰电子	3,088,259.85	2.43
74	300724	捷佳伟创	3,074,312.00	2.42
75	603345	安井食品	3,051,291.00	2.40
76	603259	药明康德	3,027,008.00	2.38
77	002049	紫光国微	2,997,848.00	2.36
78	300498	温氏股份	2,944,149.00	2.31
79	601689	拓普集团	2,938,660.00	2.31
80	000977	浪潮信息	2,915,264.00	2.29
81	001215	千味央厨	2,914,006.00	2.29
82	601088	中国神华	2,880,227.00	2.26
83	002881	美格智能	2,861,414.00	2.25
84	300769	德方纳米	2,766,852.00	2.17
85	600153	建发股份	2,721,015.00	2.14
86	603650	彤程新材	2,713,830.00	2.13
87	000066	中国长城	2,695,368.00	2.12
88	600436	片仔癀	2,642,674.00	2.08
89	600600	青岛啤酒	2,617,480.00	2.06
90	002466	天齐锂业	2,603,958.00	2.05
91	601666	平煤股份	2,590,819.00	2.04
92	002101	广东鸿图	2,575,843.00	2.02
93	603517	绝味食品	2,564,262.00	2.02

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，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	601668	中国建筑	22,380,625.00	17.59
2	300750	宁德时代	15,990,221.00	12.57
3	600519	贵州茅台	13,192,489.00	10.37
4	601669	中国电建	11,208,260.00	8.81
5	002271	东方雨虹	10,840,089.50	8.52
6	600048	保利发展	10,351,462.00	8.14
7	300274	阳光电源	10,227,096.00	8.04
8	002714	牧原股份	9,068,281.00	7.13
9	002371	北方华创	8,786,566.00	6.91
10	300776	帝尔激光	8,500,382.60	6.68
11	002624	完美世界	6,472,231.49	5.09
12	688390	固德威	6,462,305.08	5.08
13	300014	亿纬锂能	6,368,419.00	5.01
14	601111	中国国航	6,041,234.00	4.75
15	000983	山西焦煤	5,827,378.00	4.58
16	600036	招商银行	5,693,713.00	4.48
17	603606	东方电缆	5,282,123.60	4.15
18	600690	海尔智家	5,193,731.00	4.08
19	688063	派能科技	5,097,698.48	4.01
20	603363	傲农生物	5,041,791.00	3.96
21	600702	舍得酒业	4,817,019.00	3.79
22	600123	兰花科创	4,794,847.00	3.77
23	000002	万科 A	4,712,759.00	3.70
24	300413	芒果超媒	4,664,667.00	3.67
25	600809	山西汾酒	4,647,448.00	3.65
26	600009	上海机场	4,516,725.00	3.55
27	688707	振华新材	4,378,920.05	3.44
28	300680	隆盛科技	4,302,461.00	3.38
29	601898	中煤能源	4,257,567.00	3.35
30	002049	紫光国微	4,139,730.00	3.25
31	600436	片仔癀	4,072,204.00	3.20
32	688556	高测股份	4,044,377.51	3.18
33	600547	山东黄金	4,015,546.00	3.16
34	688202	美迪西	3,978,718.36	3.13
35	601699	潞安环能	3,952,089.00	3.11
36	600588	用友网络	3,915,371.00	3.08
37	603690	至纯科技	3,888,160.00	3.06
38	000625	长安汽车	3,873,689.50	3.04

39	300638	广和通	3,872,958.00	3.04
40	601633	长城汽车	3,859,717.00	3.03
41	603035	常熟汽饰	3,848,365.00	3.02
42	002709	天赐材料	3,841,138.00	3.02
43	300496	中科创达	3,840,182.43	3.02
44	688516	奥特维	3,827,518.20	3.01
45	000568	泸州老窖	3,810,750.00	3.00
46	300308	中际旭创	3,695,933.00	2.90
47	002791	坚朗五金	3,656,496.00	2.87
48	002920	德赛西威	3,652,644.00	2.87
49	603345	安井食品	3,642,296.00	2.86
50	688599	天合光能	3,634,096.65	2.86
51	002126	银轮股份	3,623,491.00	2.85
52	603816	顾家家居	3,610,721.00	2.84
53	300015	爱尔眼科	3,581,585.10	2.82
54	600845	宝信软件	3,555,517.00	2.79
55	300760	迈瑞医疗	3,539,661.00	2.78
56	000066	中国长城	3,534,868.81	2.78
57	300896	爱美客	3,525,520.00	2.77
58	002487	大金重工	3,476,237.00	2.73
59	300529	健帆生物	3,450,887.00	2.71
60	000333	美的集团	3,427,183.71	2.69
61	000786	北新建材	3,378,082.00	2.66
62	300059	东方财富	3,377,258.00	2.65
63	605305	中际联合	3,334,236.69	2.62
64	600110	诺德股份	3,283,965.00	2.58
65	601001	晋控煤业	3,273,755.00	2.57
66	300724	捷佳伟创	3,248,684.00	2.55
67	002881	美格智能	3,234,685.00	2.54
68	300502	新易盛	3,227,295.00	2.54
69	601899	紫金矿业	3,216,346.00	2.53
70	000933	神火股份	3,155,439.00	2.48
71	600085	同仁堂	3,062,437.00	2.41
72	688126	沪硅产业	3,053,676.19	2.40
73	688169	石头科技	2,991,527.62	2.35
74	600383	金地集团	2,975,717.00	2.34
75	603369	今世缘	2,963,998.00	2.33
76	603348	文灿股份	2,933,171.00	2.31
77	603997	继峰股份	2,874,117.00	2.26
78	002466	天齐锂业	2,873,966.00	2.26
79	603727	博迈科	2,847,664.00	2.24

80	601600	中国铝业	2,837,602.00	2.23
81	300499	高澜股份	2,733,954.00	2.15
82	600763	通策医疗	2,676,140.00	2.10
83	300498	温氏股份	2,646,505.00	2.08
84	601689	拓普集团	2,643,814.00	2.08
85	300763	锦浪科技	2,637,010.50	2.07
86	000063	中兴通讯	2,628,661.00	2.07
87	600153	建发股份	2,607,706.00	2.05
88	603259	药明康德	2,596,189.00	2.04
89	603650	彤程新材	2,592,786.00	2.04
90	601088	中国神华	2,564,941.00	2.02

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，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	602,183,135.29
卖出股票收入（成交）总额	607,858,406.72

注：买入股票成本、卖出股票收入均按照买卖成交金额（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

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。



## 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

无。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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

报告期末，本基金投资的前十名证券除“平安银行（000001）”外其他证券的发行主体本期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。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	167,246.95
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,586.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	172,833.70

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 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
前海开源 一带一路 混合 A	6,336	11,021.03	-	-	69,829,254.70	100.00%
前海开源 一带一路 混合 C	3,285	2,871.44	-	-	9,432,683.81	100.00%
合计	9,621	8,238.43	-	-	79,261,938.51	100.00%

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	前海开源一带 一路混合 A	99.89	0.0001%
	前海开源一带 一路混合 C	500.41	0.0053%
	合计	600.30	0.0008%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金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 研究部门负责人持有本 开放式基金	前海开源一带一路 混合 A	0
	前海开源一带一路	0

	混合 C	
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	前海开源一带一路混合 A	0
	前海开源一带一路混合 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	前海开源一带一路混合 A	前海开源一带一路混合 C
基金合同生效日（2015 年 04 月 29 日）基金份额总额	1,613,952,378.29	-
本报告期期初基金份额总额	73,995,471.89	8,056,299.90
本报告期基金总申购份额	10,314,665.38	7,430,963.13
减：本报告期基金总赎回份额	14,480,882.57	6,054,579.22
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	69,829,254.70	9,432,683.81

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人的重大人事变动：（1）2022 年 2 月 25 日起，孙辰健先生任督察长；（2）2022 年 6 月 21 日起，董事长由王兆华先生变更为李强先生。

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

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 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普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本年度应支付的审计费用为 50,000.00 元。该事务所自 2019 年 11 月 23 日起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

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	中国银河证券股份有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 06 月 24 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会北京监管局
受到的具体措施类型	行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	2022 年 7 月 1 日，公司收到北京证监局《关于对中国银河证券股份有限公司采取责令改正行政监管措施的决定》，北京证监局在对国寿安保-国保新三板 2 号资产管理计划（以下简称“新三板 2 号”）检查中认为，公司在履行托管人职责方面存在以下违规问题：一是对于管理人国寿安保基金管理有限公司（以下简称管理人）多次调整新三板 2 号持有的中科招商估值技术，仅是被动接受管理人的意见，且在已发现管理人未事先按照产品合同约定与托管人进行商定的情况下，亦未提出异议，客观上默许了管理人上述违规行为的发生。二是在新三板 2 号单位净值低于止损线后，未能发现并提示管理人存在主动申购货币基金等违反合同约定的情形。北京证监局认为，上述问题反映公司未能勤勉谨慎地履行托管职责，未按照基金合同对相关投资限制约定进行严格监督，违反了《证券投资基金托管业务管理办法》（证监会令第 92 号）第四条，第二十一条第一款的规定。根据《证券投资基金托管业务管理办法》（证监会令第 92 号）第三十八条的规定，北京证监局对公司采取责令改正的行政监管措施。
托管人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司对此高度重视，立刻组织人员梳理相关问题，制定整改措施；报告期内，公司已形成《中国银河证券股份有限公司关于对“国寿安保-国保新三板 2 号资产管理计划”托管业务整改情况的报告》，并报

	送北京证监局。
其他	-

## 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	
方正证券	2	1,209,694,756.37	100.00%	884,647.83	100.00%	-
中国银河证券	6	-	-	-	-	-

注：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，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

#### A: 选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

#### B: 选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 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	回购交易	权证交易	基金
------	------	------	------	----

	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 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
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

## 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	前海开源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	中国证监会规定媒介	2022年01月01日
2	前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2022年01月24日
3	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在湘财证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2022年01月26日
4	关于增加中信百信银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022年02月17日
5	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金开展申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022年02月25日
6	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过北京雪球基金销售有限公司办理业务最低限额的公告	中国证监会规定媒介	2022年02月28日
7	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式证券投资基金转换业务补差费用计算方法的公告	中国证监会规定媒介	2022年03月26日
8	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过北京中植基金销售有限公司办理定投业务起点金额的公告	中国证监会规定媒介	2022年03月28日
9	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过上海中欧财富基金销售有限公司办理定投业务起点金额的公告	中国证监会规定媒介	2022年03月30日
10	前海开源基金关于电子直销交易平台相关业务费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2022年03月31日
11	前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会规定媒介	2022年03月31日
12	前海开源基金管理有限公司关于旗下部	中国证监会规定媒介	2022年04月12日

	分基金在渤海证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告		日
13	前海开源基金管理有限公司关于终止与深圳前海凯恩斯基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 04 月 21 日
14	前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2022 年 04 月 22 日
15	前海开源基金管理有限公司关于终止与北京唐鼎耀华基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 04 月 23 日
16	前海开源基金管理有限公司关于终止与北京植信基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 04 月 26 日
17	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过中信证券华南股份有限公司办理定投业务起点金额的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 05 月 27 日
18	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过京东肯特瑞基金销售有限公司办理业务最低限额的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 06 月 08 日
19	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在东兴证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 06 月 16 日
20	前海开源基金管理有限公司关于终止与北京懒猫基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 06 月 17 日
21	前海开源基金管理有限公司关于终止与深圳腾元基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 06 月 17 日
22	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过申万宏源证券、申万宏源西部证券办理定投业务起点金额的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 06 月 22 日
23	前海开源基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 06 月 22 日
24	前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2022 年 07 月 21 日
25	前海开源基金管理有限公司关于终止与深圳市锦安基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 07 月 21 日
26	关于防范不法分子冒用前海开源基金名义进行非法活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2022 年 07 月 29 日
27	前海开源基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司合作关系	中国证监会规定媒介	2022 年 08 月 02 日

	的公告		
28	前海开源基金管理有限公司关于终止与中民财富基金销售(上海)有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2022年08月02日
29	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过平安银行股份有限公司办理业务最低限额的公告	中国证监会规定媒介	2022年08月08日
30	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过平安银行股份有限公司办理业务最低限额的公告	中国证监会规定媒介	2022年08月25日
31	关于增加广发银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022年08月29日
32	关于防范不法分子冒用前海开源基金名义进行非法活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2022年08月31日
33	前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金 2022 年中期报告	中国证监会规定媒介	2022年08月31日
34	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过平安证券股份有限公司办理业务最低限额的公告	中国证监会规定媒介	2022年09月21日
35	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过招商银行股份有限公司办理业务最低限额的公告	中国证监会规定媒介	2022年10月19日
36	前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2022年10月26日
37	关于增加通华财富(上海)基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022年11月08日
38	关于防范不法分子冒用前海开源基金名义进行非法活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2022年11月11日
39	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过中国工商银行股份有限公司办理业务最低限额的公告	中国证监会规定媒介	2022年11月15日
40	前海开源基金管理有限公司关于终止与和谐保险销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2022年12月13日
41	前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新(20221213更新)	中国证监会规定媒介	2022年12月13日
42	前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(20221213更新)	中国证监会规定媒介	2022年12月13日
43	前海开源基金管理有限公司关于终止与部分销售机构合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2022年12月28日



44	前海开源基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 12 月 30 日
----	---------------------------	-----------	------------------

## § 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

无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 《前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (5) 前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 13.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人前海开源基金管理有限公司，客户服务电话：4001-666-998
- (3) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：[www.qhkyfund.com](http://www.qhkyfund.com)

前海开源基金管理有限公司  
2023 年 03 月 31 日