

# 前海开源恒泽混合型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 08 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1	资产负债表	13
6.2	利润表	15
6.3	净资产（基金净值）变动表	16
6.4	报表附注	17
§ 7	投资组合报告	44
7.1	期末基金资产组合情况	44
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51
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	51
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	52
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52

7.12	投资组合报告附注 .....	52
§ 8	基金份额持有人信息 .....	53
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
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 .....	54
§ 9	开放式基金份额变动 .....	54
§ 10	重大事件揭示 .....	54
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	54
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4	基金投资策略的改变 .....	55
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8	其他重大事件 .....	59
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
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 .....	60
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
§ 12	备查文件目录 .....	61
12.1	备查文件目录 .....	61
12.2	存放地点 .....	61
12.3	查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源恒泽混合型证券投资基金	
基金简称	前海开源恒泽混合	
基金主代码	002690	
基金运作方式	契约型普通开放式	
基金合同生效日	2019 年 07 月 20 日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	315,392,420.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海开源恒泽混合 A	前海开源恒泽混合 C
下属分级基金的交易代码	002690	002691
报告期末下属分级基金的份额总额	6,607,311.17 份	308,785,108.91 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过挖掘和利用股票、固定收益证券和现金等大类资产中的潜在投资机会，在严格控制风险并保持基金资产流动性的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下六方面内容：</p> <p>（1）资产配置策略</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，制定本基金在债券、股票、现金等大类资产之间的配置比例。</p> <p>本基金通过对债券等固定收益类、股票等权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）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。</p> <p>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>（3）股票投资策略</p> <p>1) 行业配置策略</p> <p>在行业配置方面，本基金将通过对行业景气度和行业竞争格局的深入分析，对各行业的投资价值进行综合评估，从而确定并动态调整</p>

	<p>行业配置比例。</p> <p>2) 个股投资策略</p> <p>①公司基本面分析②估值水平分析③股票组合的构建与调整</p> <p>(4) 存托凭证投资策略</p> <p>对于存托凭证投资,本基金将在深入研究的基础上,通过定性分析和定量分析相结合的方式,精选出具有比较优势的存托凭证进行投资。</p> <p>(5) 可转债投资策略</p> <p>基于行业分析、企业基本面分析和可转换债券估值模型分析,并结合市场环境情况等,本基金在一、二级市场投资可转换债券,以达到在严格控制风险的基础上,实现基金资产稳健增值的目的。</p> <p>(6) 权证投资策略</p> <p>本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。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>
业绩比较基准	中证全债指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%。
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙辰健	王小飞
	联系电话	0755-88601888	021-60637103
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4001-666-998	021-60637228
传真		0755-83181169	021-60635778
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)	北京市西城区金融大街 25 号
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518040	100033
法定代表人		李强	田国立

### 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.qhkyfund.com
基金中期报告备置地点	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
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（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日）	
	前海开源恒泽混合 A	前海开源恒泽混合 C
本期已实现收益	181,101.52	8,208,834.36
本期利润	68,662.42	2,650,663.11
加权平均基金份额本期利润	0.0103	0.0085
本期加权平均净值利润率	0.87%	0.73%
本期基金份额净值增长率	0.80%	0.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）	
	前海开源恒泽混合 A	前海开源恒泽混合 C
期末可供分配利润	1,141,539.46	50,056,597.88
期末可供分配基金份额利润	0.1728	0.1621
期末基金资产净值	7,748,850.63	358,841,706.79
期末基金份额净值	1.1728	1.1621
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）	
	前海开源恒泽混合 A	前海开源恒泽混合 C
基金份额累计净值增长率	9.10%	8.61%

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

前海开源恒泽混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.36%	0.33%	0.69%	0.16%	0.67%	0.17%
过去三个月	-0.69%	0.30%	0.55%	0.16%	-1.24%	0.14%
过去六个月	0.80%	0.34%	2.29%	0.16%	-1.49%	0.18%

过去一年	-1.26%	0.38%	0.69%	0.19%	-1.95%	0.19%
过去三年	5.02%	0.38%	9.57%	0.24%	-4.55%	0.14%
自基金合同生效起至今	9.10%	0.35%	16.24%	0.24%	-7.14%	0.11%

前海开源恒泽混合 C

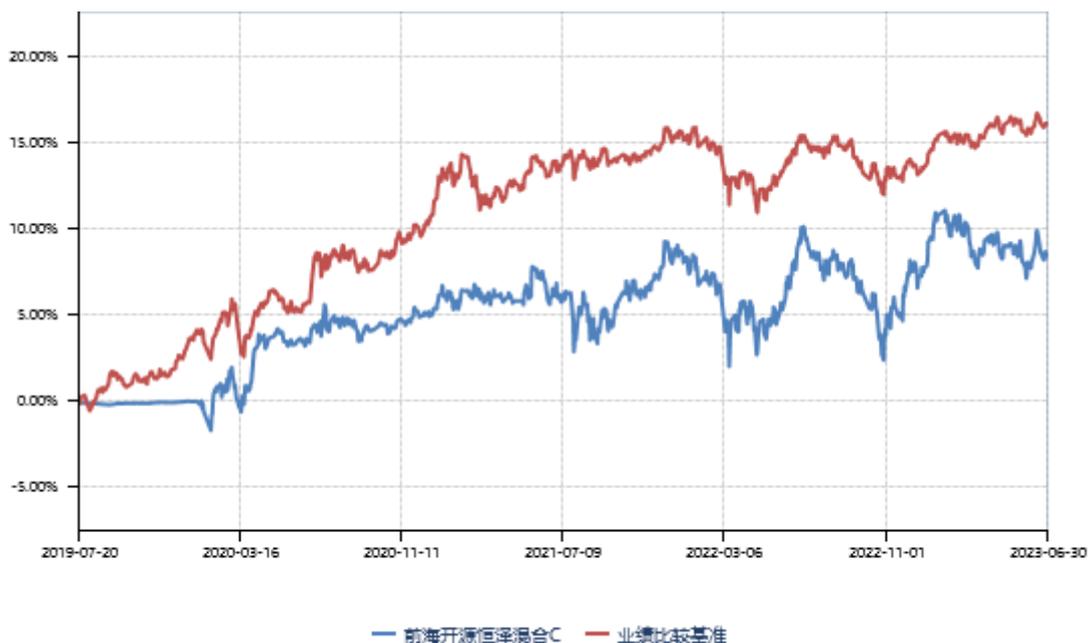
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.34%	0.33%	0.69%	0.16%	0.65%	0.17%
过去三个月	-0.73%	0.30%	0.55%	0.16%	-1.28%	0.14%
过去六个月	0.75%	0.34%	2.29%	0.16%	-1.54%	0.18%
过去一年	-1.37%	0.38%	0.69%	0.19%	-2.06%	0.19%
过去三年	4.70%	0.38%	9.57%	0.24%	-4.87%	0.14%
自基金合同生效起至今	8.61%	0.35%	16.24%	0.24%	-7.63%	0.11%

### 3.2.2 自基金转型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

前海开源恒泽混合 A



前海开源恒泽混合 C



注：2019年07月20日（含当日）起，本基金转型为“前海开源恒泽混合型证券投资基金”。

## § 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1121亿元。

#### 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		
吴彦	本基金的基金经理	2021年06月	-	11年	吴彦女士，北京大学硕

		17 日			士。历任财达证券固定收益部债券研究员，2014 年 4 月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司固收产品策略团队基金经理。
叶嘉	本基金的基金经理	2021 年 08 月 12 日	-	11 年	叶嘉先生，管理学硕士。2011 年 7 月至 2015 年 3 月，任中投证券对外联络主管；2015 年 3 月至 2016 年 3 月任小牛资本基金产品经理；2016 年 3 月加入前海开源基金，现任公司基金经理。

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。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的

交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的 5%的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

固定收益方面，本报告期内，经济增长、政策预期及流动性是主导债市的关键因素。具体来看：

1 月份，由于疫情快速过峰后消费强劲反弹，地产数据亦有较好的表现，市场对经济的预期较为乐观，债市走弱。春节后，尽管数据仍较好，但由于基本已在预期内，债市迎来了一波较为强劲的反弹。2 月下旬，资本新规出台，对信贷的风险权重进行了一定程度的下调，市场对信贷投放及经济刺激政策的乐观预期升温，加上月末资金紧，且《货币政策执行报告》没有再提“灵活适度”，债市迎来了一波较为显著的回调。3 月初，由于《政府工作报告》将年内经济增长目标定为 5%左右，市场对经济刺激政策的乐观预期降温，加上降准后市场对资金面的预期改善，债券收益率顶部确立，高等级信用策略开始有超额收益。尽管 3 月数据较好，但 4 月因高频数据走弱，债市开启了一轮较为强劲的趋势性行情，长久期高等级信用债领涨。5 月份，债市大涨后进入宽幅震荡，由于资金转松，且前期长久期品种大涨后期限利差已压缩至极限，短端表现明显好于长端。6 月上旬，在地产强刺激政策被证伪后，债市开启了一轮新的上涨，并在 OMO 降息后上涨加速。之后由于经济数据不及预期，市场焦点转向宽信用，债市陷入调整。6 月 20 日，因 LPR 下调幅度并未超过 10BP，债市止跌回升。整个上半年来看，高等级信用债表现好于利率债，高等级信用策略在 2 季度获得显著的超额收益。

操作上，组合以高等级信用债和利率债为主。1 月份基于疫情快速过峰后经济短期大概率反弹的判断，组合久期维持在较为中性的水平。2 月后，由于判断经济基本面改善已基本在预期内，组合逐步将久期拉至略高于中性水平。4 月份基于经济数据不及预期及政策难有强刺激，将组合久期拉至中性水平以上，5 月后进一步拉长组合久期。报告期内，组合运作较为平稳。

权益方面，今年上半年 A 股行情较为曲折。年初市场对于经济复苏预期较高，彼时经济数据也较好，市场出现了普涨。春节后到 4 月下旬市场开始担忧复苏的持续性，但总的来说对于经济复苏的预期仍然比较强。4 月下旬至 6 月底，经济数据有部分不及市场预期，市场呈现弱预期、弱现实的状态，A 股表现总体比较疲弱。上半年结构性分化是市场主要的特点，一方面是包含人工智能的 TMT 板块异军突起，一方面是中特估板块表现出色，其他大部分公司表现乏力，创业板指数跌幅较大，沪深 300 小幅下跌。我们预计虽然部分行业复苏的进程可能存在一定的曲折，但是大部分行业的温和复苏仍是相对确定的。我们持有的部分消费、制造类龙头在其中展现出相对较强的商业韧性，后续基本面可能随经济进一步向上攀升，中长期我们将继续持有此类相对优质资产，并积极参与新

股申购力争增厚收益，努力为持有人持续创造绝对收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源恒泽混合 A 基金份额净值为 1.1728 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.80%，同期业绩比较基准收益率为 2.29%；截至报告期末前海开源恒泽混合 C 基金份额净值为 1.1621 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.75%，同期业绩比较基准收益率为 2.29%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，固定收益方面，因融资需求偏弱，社融增速可能延续低位运行，货币政策有望保持宽松，债市整体风险不大。不过由于 2 季度收益率大幅下行，目前 10 年国债收益率已接近历史低点区间。尽管后续经济数据可能延续弱势，但稳增长措施可能加码，长久期利率债收益率进一步下行空间有限。不过由于经济面临下行压力，货币政策大概率维持宽松。相对于长端，中短端的安全边际更高。节奏上，由于基数较高，且稳增长政策即使出台，政策的推进也需要时间，社融增速大概率将于 3 季度见底。4 季度虽然社融增速反弹幅度可能有限，但进一步走低的可能性不大。因此相对于 4 季度，3 季度做多债券的安全边际可能更高。目前高等级信用债的期限利差及信用利差均处于较为合理的水平。基于此，组合将继续以高等级信用策略为主，选取高等级信用债及利率债里性价比较高的期限和品种构建组合，在此基础上进行一定的波段操作，争取增厚组合收益。

权益方面，2023 年经济呈现出弱复苏的特征，消费市场企稳向好，商品消费持续增长，餐饮、文化及旅游等相关服务消费弹性更大，包括互联网消费等消费新动能较快成长，成为经济复苏的重要支撑，服务业的持续复苏可能是增加消费动力的一个基础。现阶段 A 股、港股市场部分资产相较于无风险利率比价处于历史较高水平，部分较低估值的 A 股、港股类资产，特别是处于刚性需求行业中的龙头类公司确定性较高，值得长期关注。

#### 4.6 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。

#### 4.7 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

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支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。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 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

本托管人复核审查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。

### § 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：前海开源恒泽混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,576,621.98	682,862.46
结算备付金		1,066,616.85	1,563,316.16
存出保证金		3,555.25	10,070.59
交易性金融资产	6.4.7.2	469,754,624.32	430,558,920.20
其中：股票投资		131,152,658.20	139,058,789.78
基金投资		-	-
债券投资		338,601,966.12	291,500,130.42
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		10,412,039.51	2,192,837.93
应收股利		-	-
应收申购款		5,059.99	35.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		483,818,517.90	435,008,043.32
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		115,822,958.84	66,163,288.23
应付清算款		920,334.80	-
应付赎回款		12,457.64	37,446.50
应付管理人报酬		181,291.88	188,996.68
应付托管费		60,430.61	62,998.88
应付销售服务费		29,578.14	30,492.52
应付投资顾问费		-	-
应交税费		8,357.41	7,586.25
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	192,551.16	237,095.37
负债合计		117,227,960.48	66,727,904.43
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	315,392,420.08	319,206,988.66
未分配利润	6.4.7.8	51,198,137.34	49,073,150.23
净资产合计		366,590,557.42	368,280,138.89
负债和净资产总计		483,818,517.90	435,008,043.32

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，前海开源恒泽混合基金份额总额 315,392,420.08 份，其中，

前海开源恒泽混合 A 类基金份额净值 1.1728 元，基金份额总额 6,607,311.17 份；前海开源恒泽混合 C 类基金份额净值 1.1621 元，基金份额总额 308,785,108.91 份。

## 6.2 利润表

会计主体：前海开源恒泽混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		5,520,492.19	4,066,375.52
1. 利息收入		20,061.65	47,348.89
其中：存款利息收入	6.4.7.9	14,035.01	18,970.34
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		6,026.64	28,378.55
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,165,951.02	12,828,516.15
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,027,825.71	3,947,035.07
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	5,387,919.01	6,450,004.24
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	2,750,206.30	2,431,476.84
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-5,670,610.35	-8,815,542.67
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	5,089.87	6,053.15
<b>减：二、营业总支出</b>		2,801,166.66	2,487,468.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,108,233.79	1,201,357.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	369,411.21	400,452.54
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	180,784.34	192,985.11
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,025,118.88	570,380.92
其中：卖出回购金融资产支出		1,025,118.88	570,380.92
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		5,428.17	7,717.86
8. 其他费用	6.4.7.20	112,190.27	114,574.63
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,719,325.53	1,578,906.87

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,719,325.53	1,578,906.87
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,719,325.53	1,578,906.87

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：前海开源恒泽混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 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）	319,206,988.66	-	49,073,150.23	368,280,138.89
二、本期期初净资产（基金净值）	319,206,988.66	-	49,073,150.23	368,280,138.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,814,568.58	-	2,124,987.11	-1,689,581.47
（一）、综合收益总额	-	-	2,719,325.53	2,719,325.53
（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）	-3,814,568.58	-	-594,338.42	-4,408,907.00
其中：1. 基金申购款	3,351,747.17	-	567,005.74	3,918,752.91
2. 基金赎回款	-7,166,315.75	-	-1,161,344.16	-8,327,659.91
（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）	315,392,420.08	-	51,198,137.34	366,590,557.42
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 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）	386,655,456.49	-	63,535,954.96	450,191,411.45
二、本期期初净资产（基金净值）	386,655,456.49	-	63,535,954.96	450,191,411.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-57,722,537.05	-	-4,814,960.01	-62,537,497.06
（一）、综合收益总额	-	-	1,578,906.87	1,578,906.87
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-57,722,537.05	-	-6,393,866.88	-64,116,403.93

(净值减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	22,813,852.27	-	3,312,331.02	26,126,183.29
2. 基金赎回款	-80,536,389.32	-	-9,706,197.90	-90,242,587.22
(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)	328,932,919.44	-	58,720,994.95	387,653,914.39

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：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

前海开源恒泽混合型证券投资基金是根据原前海开源恒泽保本混合型证券投资基金(以下简称“前海开源恒泽保本混合基金”)《前海开源恒泽保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,由原前海开源恒泽保本混合基金转型而来。原前海开源恒泽保本混合基金为契约型开放式基金,存续期限不定,第一个保本期于 2019 年 7 月 15 日到期,因未能符合保本基金存续条件,基金管理人经与托管人协商一致,根据《前海开源恒泽保本混合型证券投资基金基金合同》的约定将原前海开源恒泽保本混合基金转型为非避险策略基金,即自 2019 年 7 月 20 日起,前海开源恒泽保本混合基金更名为前海开源恒泽混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),《前海开源恒泽混合型证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用、并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;在投资人申购时不收取申购费用,并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《前海开源恒泽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(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、

次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证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:股票等权益类资产占基金资产的比例为 0-40%, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等, 权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%。本基金的业绩比较基准为: 中证全债指数收益率 $\times$ 80%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及相关规定(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》、《前海开源恒泽混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的其他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。

#### 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其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 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

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 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	
	2023 年 06 月 30 日	
活期存款	2,576,621.98	
等于：本金	2,576,190.98	
加：应计利息	431.00	
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	2,576,621.98	

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2023 年 06 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	162,662,314.45	-	131,152,658.20	-31,509,656.25	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	40,683,711.08	653,604.39	41,197,604.39	-139,711.08
	银行间市场	292,879,877.39	3,602,261.73	297,404,361.73	922,222.61
	合计	333,563,588.47	4,255,866.12	338,601,966.12	782,511.53
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	496,225,902.92	4,255,866.12	469,754,624.32	-30,727,144.72	

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

## 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

无。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 其他资产

无。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	34,291.01
其中：交易所市场	6,390.44
银行间市场	27,900.57
应付利息	-
预提费用	158,260.15
合计	192,551.16

#### 6.4.7.7 实收基金

前海开源恒泽混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,909,778.90	6,909,778.90
本期申购	211,568.99	211,568.99
本期赎回（以“-”号填列）	-514,036.72	-514,036.72
本期末	6,607,311.17	6,607,311.17

前海开源恒泽混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	312,297,209.76	312,297,209.76
本期申购	3,140,178.18	3,140,178.18
本期赎回（以“-”号填列）	-6,652,279.03	-6,652,279.03
本期末	308,785,108.91	308,785,108.91

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

前海开源恒泽混合 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	1,555,845.83	-425,946.12	1,129,899.71
本期利润	181,101.52	-112,439.10	68,662.42
本期基金份额交易产生的变动数	-69,395.40	12,372.73	-57,022.67
其中：基金申购款	48,953.40	-10,978.76	37,974.64
基金赎回款	-118,348.80	23,351.49	-94,997.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,667,551.95	-526,012.49	1,141,539.46

前海开源恒泽混合 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	67,041,025.78	-19,097,775.26	47,943,250.52
本期利润	8,208,834.36	-5,558,171.25	2,650,663.11
本期基金份额交易产生的变动数	-813,964.75	276,649.00	-537,315.75
其中：基金申购款	702,366.20	-173,335.10	529,031.10
基金赎回款	-1,516,330.95	449,984.10	-1,066,346.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	74,435,895.39	-24,379,297.51	50,056,597.88

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	6,274.10
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	7,691.13
其他	69.78
合计	14,035.01

#### 6.4.7.10 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	14,441,921.52
减：卖出股票成本总额	11,384,968.09
减：交易费用	29,127.72

买卖股票差价收入	3,027,825.71
----------	--------------

#### 6.4.7.11 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益--利息收入	5,007,216.40
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	380,702.61
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	5,387,919.01

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	886,959,732.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	872,652,739.80
减：应计利息总额	13,894,065.33
减：交易费用	32,225.00
买卖债券差价收入	380,702.61

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

#### 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。

#### 6.4.7.15 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
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,750,206.30
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	2,750,206.30

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-5,670,610.35
--股票投资	-7,134,335.40
--债券投资	1,463,725.05
--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	-5,670,610.35

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	4,687.17
转换费收入	402.70

合计	5,089.87
----	----------

#### 6.4.7.19 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	4,330.12
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	112,190.27

#### 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

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 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
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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、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 2023年01月01日至2023 年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,108,233.79	1,201,357.59
其中：支付销售机构的客户维护费	19,146.45	60,841.69

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 0.60% 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×0.60%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	369,411.21	400,452.54

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源恒泽混合 A	前海开源恒泽混 合 C	合计
前海开源基金	-	178,020.19	178,020.19
中国建设银行	-	1,182.25	1,182.25
合计	-	179,202.44	179,202.44
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源恒泽混合 A	前海开源恒泽混 合 C	合计
建设银行	-	1,505.19	1,505.19
前海开源基金	-	173,227.90	173,227.90
合计	-	174,733.09	174,733.09

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。

#### 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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,576,621.98	6,274.10	3,203,134.46	9,497.06

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按适用利率或约定利率计息。

## 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

无。

## 6.4.12 期末 2023 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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023年05月15日	6个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	431	5,120.28	9,059.62	-
00132	长青	2023年	6个月	新股流	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-

4	科技	05月12日		通受限							
001328	登康口腔	2023年03月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-	
001360	南矿集团	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-	
001367	海森药业	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-	
001380	华纬科技	2023年05月09日	6个月	新股流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-	
301141	中科磁业	2023年03月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-	
301157	华塑科技	2023年03月01日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-	
301170	锡南科技	2023年06月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-	
301202	朗威股份	2023年06月28日	6个交易日	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-	
301202	朗威股份	2023年06月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-	
301203	国泰环保	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-	
301210	金杨股份	2023年06月21日	6个月	新股流通受限	57.88	49.17	234	13,543.92	11,505.78	-	
301225	恒勃股份	2023年06月08日	6个月	新股流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-	
301232	飞沃科技	2023年06月08日	6个月	新股流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-	
301246	宏源药业	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	50.00	30.71	484	24,200.00	14,863.64	-	

		日								
301260	格力博	2023年01月20日	6个月	新股流通受限	30.85	23.63	943	29,091.55	22,283.09	-
301261	恒工精密	2023年06月29日	8个交易日	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023年06月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301281	科源制药	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	31.50	25.10	338	10,647.38	8,483.80	-
301291	明阳电气	2023年06月21日	6个月	新股流通受限	38.13	31.03	459	17,501.67	14,242.77	-
301292	海科新源	2023年06月29日	7个交易日	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023年06月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023年04月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023年06月19日	6个月	新股流通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,427	17,135.00	30,705.92	-
301307	美利信	2023年04月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	495	16,008.30	15,770.70	-
301310	鑫宏业	2023年05月26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.43	262	17,627.36	17,142.66	-
301315	威士顿	2023年06月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023年01月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-

301320	豪江智能	2023年06月01日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023年02月27日	6个月	新股流通受限	87.41	53.24	216	18,879.84	11,499.84	-
301323	新莱福	2023年05月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023年05月04日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	178	13,670.40	19,215.10	-
301332	德尔玛	2023年05月09日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	874	12,943.94	12,000.02	-
301337	亚华电子	2023年05月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	163	11,972.35	7,602.32	-
301357	北方长龙	2023年04月11日	6个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023年02月01日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	565	13,430.05	24,232.85	-
301360	荣旗科技	2023年04月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023年01月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023年06月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023年05月09日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301383	天键股份	2023年05月31日	6个月	新股流通受限	46.16	35.72	441	20,356.56	15,752.52	-
301388	未来	2023年	6个月	新股流	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-

6	电器	03月21日		通受限							
301387	光大同创	2023年04月10日	6个月	新股流通受限	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-	
301397	溯联股份	2023年06月15日	6个月	新股流通受限	53.27	40.20	249	13,264.23	10,009.80	-	
301408	华人健康	2023年02月22日	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-	
301419	阿莱德	2023年02月02日	6个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-	
301428	世纪恒通	2023年05月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-	
301429	森泰股份	2023年04月10日	6个月	新股流通受限	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-	
301439	泓淋电力	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	636	12,713.64	10,748.40	-	
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	7个交易日	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-	
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-	
601061	中信金属	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	964	6,343.12	7,307.12	-	
601065	江盐集团	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	372	3,853.92	4,404.48	-	
601133	柏诚股份	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	344	4,011.04	4,217.44	-	
603125	常青科技	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	114	2,961.72	2,796.42	-	
603135	中重科技	2023年03月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	337	5,998.60	6,028.93	-	

603137	恒尚节能	2023年04月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023年04月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023年04月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	311	11,242.65	11,858.43	-
688334	西高院	2023年06月09日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	716	10,138.56	11,606.36	-
688352	硕中科技	2023年04月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	1,016	12,293.60	12,263.12	-
688361	中科飞测	2023年05月12日	6个月	新股流通受限	23.60	64.67	339	8,000.40	21,923.13	-
688429	时创能源	2023年06月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023年04月07日	6个月	新股流通受限	26.66	31.50	334	8,904.44	10,521.00	-
688443	智翔金泰	2023年06月13日	6个月	新股流通受限	37.88	29.49	624	23,637.12	18,401.76	-
688458	美芯晟	2023年05月15日	6个月	新股流通受限	75.00	90.76	158	11,850.00	14,340.08	-
688469	中芯集成	2023年04月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	3,630	20,654.70	19,638.30	-
688472	阿特斯	2023年06月02日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	1,489	16,527.90	25,372.56	-
688478	晶升股份	2023年04月13日	6个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023年05月04日	6个月	新股流通受限	33.99	29.49	260	8,837.40	7,667.40	-

688507	索辰科技	2023年04月10日	6个月	新股流通受限	165.33	122.11	101	16,698.08	12,333.11	-
688512	慧智微	2023年05月08日	6个月	新股流通受限	20.92	19.16	570	11,924.40	10,921.20	-
688523	航天环宇	2023年05月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023年03月24日	6个月	新股流通受限	152.38	135.97	127	19,352.26	17,268.19	-
688535	华海诚科	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023年06月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	250	10,917.50	13,262.50	-
688552	航天南湖	2023年05月08日	6个月	新股流通受限	21.17	23.50	526	11,135.42	12,361.00	-
688562	航天软件	2023年05月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023年05月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	419	12,678.94	10,613.27	-
688581	安杰思	2023年05月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	89	11,196.20	10,504.67	-
688582	芯动联科	2023年06月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	420	11,230.80	17,085.60	-
688593	新相微	2023年05月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	913	10,207.34	13,320.67	-
688603	天承科技	2023年06月30日	7个交易日	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023年06月30日	6个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
68862	安凯	2023年	6个月	新股流	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-

0	微	06 月 15 日		通受限						
688623	双元科技	2023 年 05 月 31 日	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	107	13,469.16	9,286.53	-
688629	华丰科技	2023 年 06 月 16 日	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023 年 06 月 19 日	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	282	7,128.96	8,423.34	-

注：①根据《上海证券交易所首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》和《深圳证券交易所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或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分股票设置不低于 6 个月的限售期。

②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。

③基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

④本报告期，“科源制药”（股票代码：301281）新股申购持有数量为 241 股，根据《山东科源制药股份有限公司 2022 年年度权益分派实施公告》，以资本公积转增股本 97 股，报告期末本基金持有“科源制药”限售股票数量合计为 338 股，认购价格为除权后的价格；本报告期，“绿通科技”（股票代码：301322）新股申购持有数量为 144 股，根据《广东绿通新能源电动车科技股份有限公司 2022 年年度权益分派实施公告》，以资本公积转增股本 72 股，报告期末本基金持有“绿通科技”限售股票数量合计为 216 股，认购价格为除权后的价格；本报告期，“索辰科技”（股票代码：688507）新股申购持有数量为 68 股，根据《上海索辰信息科技股份有限公司 2022 年年度权益分派实施公告》，以资本公积转增股本 33 股，报告期末本基金持有“索辰科技”限售股票数量合计为 101 股，认购价格为除权后的价格。

#### 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

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 105,022,485.21 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102280189	22 中车集 MTN001	2023 年 07 月 06 日	101.58	100,000	10,158,158.36
102280278	22 邮政 MTN001	2023 年 07 月 06 日	101.45	100,000	10,144,704.11
102280606	22 京国资 MTN001	2023 年 07 月 06 日	101.57	100,000	10,156,649.18
102280731	22 中电投 MTN004	2023 年 07 月 05 日	101.30	100,000	10,129,531.15
102280866	22 浙能源 MTN001	2023 年 07 月 05 日	100.86	100,000	10,086,453.55
102281272	22 浙能源 MTN002	2023 年 07 月 06 日	100.66	100,000	10,066,212.02
190311	19 进出 11	2023 年 07 月 06 日	103.77	100,000	10,376,693.15
2128030	21 交通银行二级	2023 年 07 月 06 日	104.73	100,000	10,472,600.00
220408	22 农发 08	2023 年 07 月 07 日	101.31	106,000	10,739,034.25
2228004	22 工商银行二级 01	2023 年 07 月 06 日	102.18	100,000	10,218,462.47
2228007	22 浦发银行 01	2023 年 07 月 06 日	101.46	100,000	10,145,565.48
合计				1,106,000	112,694,063.72

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 10,800,473.63 元，于 2023 年 07 月 05 日先后到期。该类交易要求本基金在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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级风险管理架构体系。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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款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。

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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	20,262,328.77	20,306,290.41
合计	20,262,328.77	20,306,290.41

注：未评级债券为国债、央票及政策性金融债等。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	210,905,735.50	117,635,841.09
AAA 以下	3,223,540.11	-
未评级	104,210,361.74	153,557,998.92
合计	318,339,637.35	271,193,840.01

注：未评级债券为国债、央票及政策性金融债等。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 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。

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风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 2023 年 6 月 30 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 2023 年 6 月 30 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。

### 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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	2,576,621.98	-	-	-	2,576,621.98
结算备付金	1,066,616.85	-	-	-	1,066,616.85
存出保证金	3,555.25	-	-	-	3,555.25
交易性金融资产	30,453,783.02	138,702,647.56	169,445,535.54	131,152,658.20	469,754,624.32
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	10,412,039.51	10,412,039.51
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,059.99	5,059.99
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	34,100,577.10	138,702,647.56	169,445,535.54	141,569,757.70	483,818,517.90
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	115,822,958.84	-	-	-	115,822,958.84
应付清算款	-	-	-	920,334.80	920,334.80
应付赎回款	-	-	-	12,457.64	12,457.64
应付管理人报酬	-	-	-	181,291.88	181,291.88
应付托管费	-	-	-	60,430.61	60,430.61
应付销售服务费	-	-	-	29,578.14	29,578.14
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	8,357.41	8,357.41
应付利润	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	192,551.16	192,551.16
负债总计	115,822,958.84	-	-	1,405,001.64	117,227,960.48
利率敏感度缺口	-81,722,381.74	138,702,647.56	169,445,535.54	140,164,756.06	366,590,557.42
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	682,862.46	-	-	-	682,862.46
结算备付金	1,563,316.16	-	-	-	1,563,316.16
存出保证金	10,070.59	-	-	-	10,070.59
交易性金融资产	20,306,290.41	215,184,499.74	56,009,340.27	139,058,789.78	430,558,920.20
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,192,837.93	2,192,837.93
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	35.98	35.98
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	22,562,539.62	215,184,499.74	56,009,340.27	141,251,663.69	435,008,043.32
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	66,163,288.23	-	-	-	66,163,288.23
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	37,446.50	37,446.50
应付管理人报酬	-	-	-	188,996.68	188,996.68
应付托管费	-	-	-	62,998.88	62,998.88
应付销售服务费	-	-	-	30,492.52	30,492.52
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	7,586.25	7,586.25
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	237,095.37	237,095.37
负债总计	66,163,288.23	-	-	564,616.20	66,727,904.43
利率敏感度缺口	-43,600,748.61	215,184,499.74	56,009,340.27	140,687,047.49	368,280,138.89

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2023年06月30日)	上年度末(2022年12月31日)
	市场利率增加 0.25%	-2,006,302.43	-1,250,975.28
市场利率减少 0.25%	2,040,094.43	1,261,014.75	

#### 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。

#### 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。

##### 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 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	131,152,658.20	35.78	139,058,789.78	37.76
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	131,152,658.20	35.78	139,058,789.78	37.76

#### 6.4.13.4.3.2 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(2023年06月30日)	上年度末(2022年12月31日)
	业绩比较基准上升 5%	7,495,577.68	7,686,890.67
	业绩比较基准下降 5%	-7,495,577.68	-7,686,890.67

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年末 2022年12月31日
第一层次	129,718,551.49	137,177,597.94
第二层次	339,050,849.82	291,847,412.42
第三层次	985,223.01	1,533,909.84
合计	469,754,624.32	430,558,920.20

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	131,152,658.20	27.11
	其中：股票	131,152,658.20	27.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	338,601,966.12	69.99
	其中：债券	338,601,966.12	69.99
	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	3,643,238.83	0.75
8	其他各项资产	10,420,654.75	2.15
9	合计	483,818,517.90	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,464,858.00	0.40

C	制造业	92,948,553.98	25.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,123,347.47	0.31
E	建筑业	406,082.95	0.11
F	批发和零售业	2,613,406.59	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	2,640,433.00	0.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	768,486.99	0.21
J	金融业	20,046,931.60	5.47
K	房地产业	5,295,395.00	1.44
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,196,592.56	0.87
N	水利、环境和公共设施管理业	7,740.00	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	640,830.06	0.17
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	131,152,658.20	35.78

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	7,400	12,513,400.00	3.41
2	000858	五粮液	64,400	10,533,908.00	2.87
3	601166	兴业银行	602,084	9,422,614.60	2.57
4	002594	比亚迪	28,600	7,386,522.00	2.01
5	000568	泸州老窖	33,100	6,936,767.00	1.89
6	000333	美的集团	108,408	6,387,399.36	1.74
7	601318	中国平安	116,200	5,391,680.00	1.47
8	600276	恒瑞医药	83,400	3,994,860.00	1.09
9	600887	伊利股份	123,100	3,486,192.00	0.95
10	000895	双汇发展	139,100	3,406,559.00	0.93

11	600048	保利发展	257,700	3,357,831.00	0.92
12	600585	海螺水泥	127,400	3,024,476.00	0.83
13	600309	万华化学	33,900	2,977,776.00	0.81
14	000596	古井贡酒	9,700	2,399,586.00	0.65
15	603259	药明康德	36,740	2,289,269.40	0.62
16	002142	宁波银行	89,070	2,253,471.00	0.61
17	000651	格力电器	60,300	2,201,553.00	0.60
18	000002	万 科 A	138,200	1,937,564.00	0.53
19	600660	福耀玻璃	53,800	1,928,730.00	0.53
20	600056	中国医药	135,320	1,756,453.60	0.48
21	002695	煌上煌	160,100	1,711,469.00	0.47
22	002352	顺丰控股	37,800	1,704,402.00	0.46
23	000001	平安银行	145,600	1,635,088.00	0.45
24	002304	洋河股份	12,100	1,589,335.00	0.43
25	600741	华域汽车	75,600	1,395,576.00	0.38
26	000513	丽珠集团	32,800	1,276,248.00	0.35
27	002415	海康威视	36,100	1,195,271.00	0.33
28	600196	复星医药	37,200	1,149,480.00	0.31
29	601088	中国神华	36,200	1,113,150.00	0.30
30	600886	国投电力	86,000	1,087,900.00	0.30
31	002371	北方华创	2,900	921,185.00	0.25
32	002736	国信证券	102,400	893,952.00	0.24
33	300896	爱美客	2,000	889,900.00	0.24
34	300750	宁德时代	3,780	864,826.20	0.24
35	688012	中微公司	5,385	842,483.25	0.23
36	600066	宇通客车	55,700	821,018.00	0.22
37	300124	汇川技术	12,700	815,467.00	0.22
38	300760	迈瑞医疗	2,700	809,460.00	0.22
39	300274	阳光电源	6,800	793,084.00	0.22
40	002422	科伦药业	23,600	700,448.00	0.19
41	688169	石头科技	2,038	653,545.84	0.18
42	000963	华东医药	14,300	620,191.00	0.17
43	300015	爱尔眼科	33,264	617,047.20	0.17
44	603806	福斯特	15,988	594,593.72	0.16
45	603290	斯达半导	2,700	581,040.00	0.16
46	002007	华兰生物	24,900	558,009.00	0.15
47	002236	大华股份	26,500	523,375.00	0.14
48	601006	大秦铁路	69,700	517,871.00	0.14
49	300014	亿纬锂能	8,500	514,250.00	0.14
50	603486	科沃斯	6,600	513,282.00	0.14
51	600104	上汽集团	35,900	508,703.00	0.14

52	603501	韦尔股份	5,080	498,043.20	0.14
53	600703	三安光电	28,200	486,168.00	0.13
54	688363	华熙生物	5,287	471,388.92	0.13
55	002821	凯莱英	3,920	462,011.20	0.13
56	000425	徐工机械	67,300	455,621.00	0.12
57	603127	昭衍新药	11,012	450,390.80	0.12
58	000776	广发证券	30,600	450,126.00	0.12
59	601012	隆基绿能	15,660	448,972.20	0.12
60	300347	泰格医药	6,900	445,326.00	0.12
61	002624	完美世界	22,900	386,781.00	0.11
62	002202	金风科技	34,500	366,390.00	0.10
63	002812	恩捷股份	3,800	366,130.00	0.10
64	600028	中国石化	55,300	351,708.00	0.10
65	000338	潍柴动力	27,500	342,650.00	0.09
66	002008	大族激光	13,000	340,600.00	0.09
67	600050	中国联通	62,100	298,080.00	0.08
68	601111	中国国航	31,800	262,032.00	0.07
69	601390	中国中铁	24,600	186,468.00	0.05
70	600115	中国东航	32,800	156,128.00	0.04
71	600976	健民集团	1,700	131,053.00	0.04
72	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.03
73	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.03
74	600993	马应龙	3,100	86,211.00	0.02
75	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
76	601186	中国铁建	7,800	76,830.00	0.02
77	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
78	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
79	601668	中国建筑	12,000	68,880.00	0.02
80	600820	隧道股份	11,200	67,312.00	0.02
81	601607	上海医药	2,900	64,989.00	0.02
82	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
83	301301	川宁生物	3,427	30,705.92	0.01
84	688472	阿特斯	1,489	25,372.56	0.01
85	301358	湖南裕能	565	24,232.85	0.01
86	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.01
87	301260	格力博	943	22,283.09	0.01
88	688361	中科飞测	339	21,923.13	0.01
89	688469	中芯集成	3,630	19,638.30	0.01
90	301325	曼恩斯特	178	19,215.10	0.01
91	688443	智翔金泰	624	18,401.76	0.01
92	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00

93	688531	日联科技	127	17,268.19	0.00
94	301310	鑫宏业	262	17,142.66	0.00
95	688582	芯动联科	420	17,085.60	0.00
96	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
97	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
98	301307	美利信	495	15,770.70	0.00
99	301383	天键股份	441	15,752.52	0.00
100	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
101	301246	宏源药业	484	14,863.64	0.00
102	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
103	688458	美芯晟	158	14,340.08	0.00
104	301291	明阳电气	459	14,242.77	0.00
105	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
106	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
107	688593	新相微	913	13,320.67	0.00
108	688543	国科军工	250	13,262.50	0.00
109	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
110	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
111	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
112	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
113	688552	航天南湖	526	12,361.00	0.00
114	688507	索辰科技	101	12,333.11	0.00
115	688352	颀中科技	1,016	12,263.12	0.00
116	301332	德尔玛	874	12,000.02	0.00
117	688146	中船特气	311	11,858.43	0.00
118	688334	西高院	716	11,606.36	0.00
119	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
120	301210	金杨股份	234	11,505.78	0.00
121	301322	绿通科技	216	11,499.84	0.00
122	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
123	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
124	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
125	688512	慧智微	570	10,921.20	0.00
126	301439	泓淋电力	636	10,748.40	0.00
127	688570	天玛智控	419	10,613.27	0.00
128	688433	华曙高科	334	10,521.00	0.00
129	688581	安杰思	89	10,504.67	0.00
130	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
131	301397	溯联股份	249	10,009.80	0.00
132	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
133	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00

134	688623	双元科技	107	9,286.53	0.00
135	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
136	001287	中电港	431	9,059.62	0.00
137	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
138	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
139	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
140	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
141	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
142	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
143	688631	莱斯信息	282	8,423.34	0.00
144	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
145	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
146	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
147	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
148	688479	友车科技	260	7,667.40	0.00
149	301345	涛涛车业	163	7,602.32	0.00
150	601061	中信金属	964	7,307.12	0.00
151	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
152	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
153	603135	中重科技	337	6,028.93	0.00
154	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
155	601065	江盐集团	372	4,404.48	0.00
156	601133	柏诚股份	344	4,217.44	0.00
157	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
158	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
159	603125	常青科技	114	2,796.42	0.00
160	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
161	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
162	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
163	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
164	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	001286	陕西能源	361,603.20	0.10
2	301260	格力博	290,822.95	0.08
3	301246	宏源药业	241,850.00	0.07
4	688443	智翔金泰	236,333.32	0.06

5	688469	中芯集成	206,501.48	0.06
6	301383	天键股份	203,288.64	0.06
7	688531	日联科技	193,370.22	0.05
8	301322	绿通科技	188,273.96	0.05
9	688539	高华科技	183,456.00	0.05
10	301387	光大同创	179,042.40	0.05
11	301310	鑫宏业	176,206.32	0.05
12	301291	明阳电气	174,978.57	0.05
13	688507	索辰科技	165,753.00	0.05
14	688472	阿特斯	165,223.50	0.04
15	301307	美利信	159,856.62	0.04
16	688522	纳睿雷达	143,541.00	0.04
17	301429	森泰股份	143,433.75	0.04
18	301317	鑫磊股份	143,367.12	0.04
19	301408	华人健康	142,652.16	0.04
20	301325	曼恩斯特	136,089.60	0.04

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。

#### 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	001286	陕西能源	486,346.00	0.13
2	688506	百利天恒	455,290.05	0.12
3	301260	格力博	322,550.93	0.09
4	688502	茂莱光学	297,807.50	0.08
5	688439	振华风光	289,945.34	0.08
6	688435	英方软件	286,812.00	0.08
7	301358	湖南裕能	268,336.57	0.07
8	688401	路维光电	231,710.54	0.06
9	688531	日联科技	223,363.78	0.06
10	688361	中科飞测	221,403.85	0.06
11	688469	中芯集成	199,920.59	0.05
12	688443	智翔金泰	197,485.15	0.05
13	688522	纳睿雷达	186,744.75	0.05
14	301383	天键股份	186,459.15	0.05
15	301408	华人健康	183,647.15	0.05
16	688582	芯动联科	181,629.28	0.05
17	301246	宏源药业	174,685.89	0.05
18	688562	航天软件	174,180.25	0.05

19	688472	阿特斯	172,639.62	0.05
20	301322	绿通科技	172,081.48	0.05

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。

#### 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	10,613,171.91
卖出股票收入（成交）总额	14,441,921.52

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。

#### 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	6,119,237.16	1.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	234,505,441.13	63.97
	其中：政策性金融债	61,241,218.73	16.71
4	企业债券	31,006,150.14	8.46
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	66,971,137.69	18.27
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	338,601,966.12	92.37

#### 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	2128030	21 交通银行二级	200,000	20,945,200.00	5.71
2	190311	19 进出 11	200,000	20,753,386.30	5.66
3	2228017	22 邮储银行二级 01	200,000	20,537,967.21	5.60
4	2228004	22 工商银行二级 01	200,000	20,436,924.93	5.57
5	220408	22 农发 08	200,000	20,262,328.77	5.53

#### 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

无。

#### 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

无。

### 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

无。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 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

无。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

报告期末，本基金投资的前十名证券除“中国平安（证券代码 601318）”、“兴业银行（证券代码 601166）”、“21 交通银行二级（证券代码 2128030）”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。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 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	3,555.25
2	应收清算款	10,412,039.51
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,059.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	10,420,654.75

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

### § 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
前海开源恒泽混合 A	325	20,330.19	-	-	6,607,311.17	100.00%
前海开源恒泽混合 C	971	318,007.32	303,274,474.47	98.22%	5,510,634.44	1.78%
合计	1,296	243,358.35	303,274,474.47	96.16%	12,117,945.61	3.84%

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	前海开源恒泽混合 A	0.00	0.0000%
	前海开源恒泽混合 C	130,228.37	0.0422%
	合计	130,228.37	0.0413%

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）。

### 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	前海开源恒泽混合 A	0
	前海开源恒泽混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	前海开源恒泽混合 A	0
	前海开源恒泽混合 C	10~50
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	前海开源恒泽混合 A	前海开源恒泽混合 C
基金合同生效日（2019 年 07 月 20 日）基金份额总额	69,311,971.15	32,807,151.75
本报告期期初基金份额总额	6,909,778.90	312,297,209.76
本报告期基金总申购份额	211,568.99	3,140,178.18
减：本报告期基金总赎回份额	514,036.72	6,652,279.03
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	6,607,311.17	308,785,108.91

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

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

本报告期内本基金投资策略未改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内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

##### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内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。

##### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

#### 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	
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	4	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	4	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-

国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	2	4,140,568.49	28.67%	3,028.32	28.67%	-
国信证券	4	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞信证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	4	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
野村东方 国际	1	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中国国际 金融	2	3,105,935.78	21.51%	2,271.20	21.50%	-
中国银河 证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	4	7,195,417.25	49.82%	5,261.86	49.82%	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-

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。

## 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		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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东北证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券	-	-	558,10 0,000.0 0	52.73%	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
万联证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融	-	-	500,30 0,000.0 0	47.27%	-	-	-	-	-
中国银 河证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中航证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	9,999,20 5.21	100.00%	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	前海开源恒泽混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023年01月20日
2	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金定期定额投资业务起点金额的公告	中国证监会规定媒介	2023年02月08日
3	前海开源基金管理有限公司关于变更公司官方电子直销交易平台 APP 名称的公告	中国证监会规定媒介	2023年03月31日
4	前海开源恒泽混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023年03月31日
5	前海开源恒泽混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023年04月22日
6	前海开源基金管理有限公司关于调整旗	中国证监会规定媒介	2023年05月04日

	下部分证券投资基金通过蚂蚁（杭州）基金销售有限公司办理业务最低限额的公告		
7	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上海中欧财富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	2023年05月15日
8	关于旗下部分基金增加杭州银行股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023年06月08日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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	20230101-20230630	307,578,712.34	-	4,330,000.00	303,248,712.34	96.15%
产品特有风险							
<p>1. 巨额赎回风险</p> <p>(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定延缓支付赎回款项、部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务的办理；</p> <p>2. 转换运作方式或终止基金合同的风险</p> <p>个别投资者大额赎回后，若本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决，其他投资者可能面临相应风险；</p> <p>3. 流动性风险</p> <p>单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；</p> <p>4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源恒泽混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 《前海开源恒泽混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源恒泽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) 前海开源恒泽混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 12.3 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 08 月 31 日