

# 前海开源鼎安债券型证券投资基金

## 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	6
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遵规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1	资产负债表	13
6.2	利润表	14
6.3	净资产（基金净值）变动表	15
6.4	报表附注	16
§ 7	投资组合报告	36
7.1	期末基金资产组合情况	36
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40
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	41
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	41
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	41
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	41
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41

7.12	投资组合报告附注 .....	41
§ 8	基金份额持有人信息 .....	43
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
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 .....	44
§ 9	开放式基金份额变动 .....	44
§ 10	重大事件揭示 .....	44
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	44
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 .....	44
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4	基金投资策略的改变 .....	45
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
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 .....	45
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
10.8	其他重大事件 .....	47
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	47
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 .....	47
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
§ 12	备查文件目录 .....	48
12.1	备查文件目录 .....	48
12.2	存放地点 .....	48
12.3	查阅方式 .....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源鼎安债券型证券投资基金	
基金简称	前海开源鼎安债券	
基金主代码	002971	
基金运作方式	契约型普通开放式	
基金合同生效日	2016 年 07 月 19 日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	44,239,975.07 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海开源鼎安债券 A	前海开源鼎安债券 C
下属分级基金的交易代码	002971	002972
报告期末下属分级基金的份额总额	26,566,153.24 份	17,673,821.83 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。
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，在充分研究宏观经济因素的基础上，判断宏观经济周期所处阶段和未来发展趋势。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的研究、分析和风险评估，分析未来一段时期内本基金在大类资产的配置方面的风险和收益预期，评估相关投资标的的投资价值，制定本基金在固定收益类、权益类和现金等大类资产之间的配置比例。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、可转债投资策略等积极投资策略。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金将精选有良好增值潜力的股票构建股票投资组合。股票投资策略将从定性和定量两方面入手，定性方面主要考察上市公司所属行业行业发展前景、行业地位、竞争优势、管理团队、创新能力等多种因素；定量方面考量公司估值、资产质量及财务状况，比较分析各优质上市公司的估值、成长及财务指标，优先选择具有相对比较优势的公司作为最终股票投资对象。</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、国债期货投资策略</p> <p>本基金对国债期货的投资以套期保值为主要目的。本基金将结合国债交易市场和期货交易市场的收益性、流动性的情况，通过多头或空头套期保值等投资策略进行套期保值，以获取超额收益。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p>
业绩比较基准	中债综合指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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	招商银行股份有限公司
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	95555
传真	0755-83181169	0755-83195201
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）	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518040	518040
法定代表人	李强	缪建民

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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）	
	前海开源鼎安债券 A	前海开源鼎安债券 C
本期已实现收益	-654,143.29	-444,932.50
本期利润	171,242.71	19,254.28
加权平均基金份额本期利润	0.0059	0.0011
本期加权平均净值利润率	0.45%	0.08%
本期基金份额净值增长率	0.23%	0.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）	
	前海开源鼎安债券 A	前海开源鼎安债券 C
期末可供分配利润	5,761,798.71	3,382,964.20
期末可供分配基金份额利润	0.2169	0.1914
期末基金资产净值	34,300,912.84	22,350,752.43
期末基金份额净值	1.291	1.265
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）	
	前海开源鼎安债券 A	前海开源鼎安债券 C
基金份额累计净值增长率	29.10%	26.50%

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

前海开源鼎安债券 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	-0.15%	0.36%	0.28%	0.09%	-0.43%	0.27%
过去三个月	-0.54%	0.40%	0.33%	0.08%	-0.87%	0.32%
过去六个月	0.23%	0.33%	1.06%	0.08%	-0.83%	0.25%
过去一年	-3.94%	0.30%	-0.23%	0.10%	-3.71%	0.20%
过去三年	12.07%	0.29%	2.35%	0.12%	9.72%	0.17%
自基金合同生效起至今	29.10%	0.25%	7.08%	0.12%	22.02%	0.13%

前海开源鼎安债券 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	-0.16%	0.37%	0.28%	0.09%	-0.44%	0.28%
过去三个月	-0.63%	0.40%	0.33%	0.08%	-0.96%	0.32%
过去六个月	0.08%	0.33%	1.06%	0.08%	-0.98%	0.25%
过去一年	-4.31%	0.30%	-0.23%	0.10%	-4.08%	0.20%
过去三年	10.77%	0.29%	2.35%	0.12%	8.42%	0.17%
自基金合同生 效起至今	26.50%	0.25%	7.08%	0.12%	19.42%	0.13%

### 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

前海开源鼎安债券 A



前海开源鼎安债券 C



## § 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		
陆琦	本基金的基金经理、公司金融工程部执行总监	2021 年 06 月 24 日	-	12 年	陆琦先生，南京大学硕士研究生。2011 年至 2015 年任南方基金管

					理有限公司风险管理部量化分析高级经理，2015年10月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司金融工程部执行总监。
叶恒达	本基金的基金经理助理	2023年06月09日	-	4年	叶恒达先生，西安交通大学硕士研究生。2019年6月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司基金经理助理。

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

随着疫情达峰，一季度国内经济有所修复，但二季度伴随宏观数据的回落，经济“强复苏”的预期基本证伪。

权益市场方面，一月份北向资金天量流入，是市场的增量主力，各大指数均有所反弹。二月份起，主题投资机会逐步显现，ChatGPT 点燃科技板块投资浪潮，中国特色估值体系逆市上涨，央企定价重估、国企改革等主题关注度提升。伴随着经济复苏动能转弱，与总量经济相关的行业有所调整，中特估、AI、人形机器人等与总量经济相关性较弱的板块交替演绎。

固收市场方面，在宏观经济较弱的背景下，央行维持流动性合理充裕，债市一季度信用利差快速修复，二季度各期限利率快速下行。

报告期内，本组合坚持稳健增值的投资目标。在权益投资上，整体维持中性偏乐观的股票仓位，行业适当分散，着重在 A 股各行业中优选企业经营稳健向好、估值合理的股票，遗憾的是近半年权益部分投资表现不佳，拖累组合的整体表现。债券部分随着市场利率水平下行，整体投资从年初以短久期利率债为主，切换到以偏债型可转债投资为主的配置思路，辅以小仓位的平衡型可转债，还是争取先控制好回撤，再尝试寻找受益于经济弱复苏的结构性投资机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源鼎安债券 A 基金份额净值为 1.291 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.23%，同期业绩比较基准收益率为 1.06%；截至报告期末前海开源鼎安债券 C 基金份额净值为 1.265 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.08%，同期业绩比较基准收益率为 1.06%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济整体可能处于弱复苏的发展趋势。由于地产及地产链在社零中的占比较高，地产复苏与否或许会成为经济基本面的胜负手。就资本市场整体来看，当前已较大程度的反应了经济低迷的预期，债券利率处于历史相对低位，股票估值处于相对低位。权益方面，能源革命、科技创新、高端制造等方向基本面依然比较景气，或存在较多投资机会。另外当前消费虽然面临压力，但部分消费股的估值已处于相对低位，考虑到优质消费股经营相对稳定，在当前位置也有比较高的配置价值。转债市场方面，受益于流动性宽松，可转债参与机会成本较小，转债估值整体高位震荡，主要系债券收益率明显下行，对转债估值形成较强支撑，后续转债估值层面难以为投资者提供超额收益，更多需依赖正股的上涨。在流动性宽松环境下，中小盘有望受益，预计结构性机会较多，转债或有较多的个券投资机会。

#### 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：前海开源鼎安债券型证券投资基金

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	434,573.77	138,619.11
结算备付金		289,612.76	309,291.14
存出保证金		9,619.87	12,165.37
交易性金融资产	6.4.7.2	59,823,023.33	65,840,471.60
其中：股票投资		11,294,750.24	12,741,303.64
基金投资		-	-
债券投资		48,528,273.09	53,099,167.96
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		384,613.17	327,150.15
应收股利		-	-
应收申购款		1,788.31	2,640.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		60,943,231.21	66,630,337.62
<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		4,000,698.08	1,500,856.56
应付清算款		76,979.87	126,389.91
应付赎回款		15,175.64	3,073.28
应付管理人报酬		32,791.71	41,433.12

应付托管费		4,684.51	5,919.02
应付销售服务费		7,406.99	7,968.48
应付投资顾问费		-	-
应交税费		349.70	118.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	153,479.44	155,941.73
负债合计		4,291,565.94	1,841,700.16
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	44,239,975.07	50,647,317.54
未分配利润	6.4.7.8	12,411,690.20	14,141,319.92
净资产合计		56,651,665.27	64,788,637.46
负债和净资产总计		60,943,231.21	66,630,337.62

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，前海开源鼎安债券基金份额总额 44,239,975.07 份，其中，前海开源鼎安债券 A 类基金份额净值 1.291 元，基金份额总额 26,566,153.24 份；前海开源鼎安债券 C 类基金份额净值 1.265 元，基金份额总额 17,673,821.83 份。

## 6.2 利润表

会计主体：前海开源鼎安债券型证券投资基金

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>		632,823.68	-2,634,157.50
1. 利息收入		3,324.94	10,555.60
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,324.94	10,555.60
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）		-660,659.62	-445,540.33
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-970,405.10	-3,514,981.63
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	216,330.90	2,987,679.66
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	93,414.58	81,761.64
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	1,289,572.78	-2,235,776.97
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	585.58	36,604.20
<b>减：二、营业总支出</b>		442,326.69	806,670.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	211,868.62	486,217.00
2. 托管费	6.4.10.2.2	30,266.84	69,459.53
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	45,736.70	99,280.96
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		72,426.64	45,542.10
其中：卖出回购金融资产支出		72,426.64	45,542.10
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		201.06	30.63
8. 其他费用	6.4.7.20	81,826.83	106,140.75
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		190,496.99	-3,440,828.47
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		190,496.99	-3,440,828.47
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		190,496.99	-3,440,828.47

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：前海开源鼎安债券型证券投资基金

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）	50,647,317.54	-	14,141,319.92	64,788,637.46
二、本期期初净资产（基金净值）	50,647,317.54	-	14,141,319.92	64,788,637.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,407,342.47	-	-1,729,629.72	-8,136,972.19
（一）、综合收益总额	-	-	190,496.99	190,496.99
（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）	-6,407,342.47	-	-1,920,126.71	-8,327,469.18
其中：1. 基金申购款	1,307,835.31	-	390,707.55	1,698,542.86
2. 基金赎回款	-7,715,177.78	-	-2,310,834.26	-10,026,012.04
（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）	44,239,975.07	-	12,411,690.20	56,651,665.27
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）	174,173,622.93	-	60,792,660.11	234,966,283.04
二、本期期初净资产（基金净值）	174,173,622.93	-	60,792,660.11	234,966,283.04
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-87,552,637.09	-	-31,705,282.04	-119,257,919.13
（一）、综合收益总额	-	-	-3,440,828.47	-3,440,828.47
（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）	-87,552,637.09	-	-28,264,453.57	-115,817,090.66
其中：1. 基金申购款	23,424,091.66	-	7,535,299.28	30,959,390.94
2. 基金赎回款	-110,976,728.75	-	-35,799,752.85	-146,776,481.60
（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）	86,620,985.84	-	29,087,378.07	115,708,363.91

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

前海开源鼎安债券型证券投资基金(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[2016]1413号《关于准予前海开源鼎安债券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《前海开源鼎安债券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600,528,866.89元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2016]02230124号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源鼎安债券型证券投资基金基金合同》于2016年7月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为600,609,937.47份基金份额,其中认购资金利息折合81,070.58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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、而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；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、但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《前海开源鼎安债券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，包括国家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、协议存款、通知存款、定期存款、同业存单、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券、债券质押及买断式回购、资产支持证券、货币市场工具、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、权证、国债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：投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；投资于国内依法发行上市的股票、权证等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的 20%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券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。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

#### 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》、《前海开源鼎安债券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。

## 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	434,573.77
等于：本金	434,456.93
加：应计利息	116.84
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	434,573.77

### 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	11,139,412.89	-	11,294,750.24	155,337.35
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	48,621,657.53	197,161.68	48,528,273.09	-290,546.12
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	48,621,657.53	197,161.68	48,528,273.09	-290,546.12
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		59,761,070.42	197,161.68	59,823,023.33	-135,208.77

### 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	0.55
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	37,491.82
其中：交易所市场	37,491.82
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	115,987.07
合计	153,479.44

### 6.4.7.7 实收基金

前海开源鼎安债券 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	32,334,536.79	32,334,536.79
本期申购	831,564.59	831,564.59
本期赎回（以“-”号填列）	-6,599,948.14	-6,599,948.14
本期末	26,566,153.24	26,566,153.24

前海开源鼎安债券 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	18,312,780.75	18,312,780.75
本期申购	476,270.72	476,270.72
本期赎回（以“-”号填列）	-1,115,229.64	-1,115,229.64
本期末	17,673,821.83	17,673,821.83

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

前海开源鼎安债券 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	7,740,140.77	1,568,129.19	9,308,269.96
本期利润	-654,143.29	825,386.00	171,242.71
本期基金份额交易产生的变动数	-1,324,198.77	-420,554.30	-1,744,753.07
其中：基金申购款	193,170.15	62,996.59	256,166.74
基金赎回款	-1,517,368.92	-483,550.89	-2,000,919.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,761,798.71	1,972,960.89	7,734,759.60

前海开源鼎安债券 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	3,955,516.94	877,533.02	4,833,049.96
本期利润	-444,932.50	464,186.78	19,254.28
本期基金份额交易产生的变动数	-127,620.24	-47,753.40	-175,373.64
其中：基金申购款	99,871.72	34,669.09	134,540.81
基金赎回款	-227,491.96	-82,422.49	-309,914.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,382,964.20	1,293,966.40	4,676,930.60

#### 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	1,272.87
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	1,973.14
其他	78.93
合计	3,324.94

#### 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	39,295,714.27
减：卖出股票成本总额	40,152,255.08
减：交易费用	113,864.29
买卖股票差价收入	-970,405.10

#### 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	405,306.28
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-188,975.38
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	216,330.90

##### 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	72,132,040.07
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	71,504,826.60
减：应计利息总额	812,302.79
减：交易费用	3,886.06

买卖债券差价收入	-188,975.38
----------	-------------

#### 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	93,414.58
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	93,414.58

#### 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	1,289,572.78
--股票投资	1,004,008.27

—债券投资	285,564.51
—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	1,289,572.78

#### 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	572.36
转换费收入	13.22
合计	585.58

#### 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	22,315.49
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	—
汇划手续费	1,239.76
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	81,826.83

#### 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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

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	211,868.62	486,217.00
其中：支付销售机构的客户维护费	39,968.21	87,854.35

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 0.70% 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×0.70%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年06月30日	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	30,266.84	69,459.53

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/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		
	前海开源鼎安债券 A	前海开源鼎安债券 C	合计
前海开源基金	-	25,270.78	25,270.78
招商银行	-	988.77	988.77
开源证券	-	1,738.38	1,738.38
合计	-	27,997.93	27,997.93
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		
	前海开源鼎安债券 A	前海开源鼎安债券 C	合计
招商银行	-	2,891.07	2,891.07
前海开源基金	-	39,648.70	39,648.70
开源证券	-	2,972.12	2,972.12
合计	-	45,511.89	45,511.89

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给前海开源基金，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×0.40%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

前海开源鼎安债券 C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年06月30日	2022年01月01日至2022年06月30日
基金合同生效日(2016年07月19日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,756,097.56	9,756,097.56
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,756,097.56	9,756,097.56
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	55.20%	29.39%

##### 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		上年度可比期间	
	2023年01月01日至2023年06月30日		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
招商银行	434,573.77	1,272.87	773,164.96	8,167.49

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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 4,000,698.08 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

无。

##### 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	26,589,529.86	8,090,448.15
AAA 以下	18,663,750.13	4,422,718.44
未评级	3,274,993.10	40,586,001.37
合计	48,528,273.09	53,099,167.96

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	434,573.77	-	-	-	434,573.77
结算备付金	289,612.76	-	-	-	289,612.76
存出保证金	9,619.87	-	-	-	9,619.87
交易性金融资产	3,274,993.10	35,503,395.16	9,749,884.83	11,294,750.24	59,823,023.33
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	384,613.17	384,613.17
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,788.31	1,788.31
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,008,799.50	35,503,395.16	9,749,884.83	11,681,151.72	60,943,231.21
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	4,000,698.08	-	-	-	4,000,698.08
应付清算款	-	-	-	76,979.87	76,979.87
应付赎回款	-	-	-	15,175.64	15,175.64
应付管理人报酬	-	-	-	32,791.71	32,791.71
应付托管费	-	-	-	4,684.51	4,684.51
应付销售服务费	-	-	-	7,406.99	7,406.99
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	349.70	349.70
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	153,479.44	153,479.44
负债总计	4,000,698.08	-	-	290,867.86	4,291,565.94
利率敏感度缺口	8,101.42	35,503,395.16	9,749,884.83	11,390,283.86	56,651,665.27
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	138,619.11	-	-	-	138,619.11
结算备付金	309,291.14	-	-	-	309,291.14

存出保证金	12,165.37	-	-	-	12,165.37
交易性金融资产	40,586,001.37	10,826,072.95	1,687,093.64	12,741,303.64	65,840,471.60
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	327,150.15	327,150.15
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,640.25	2,640.25
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	41,046,076.99	10,826,072.95	1,687,093.64	13,071,094.04	66,630,337.62
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	1,500,856.56	-	-	-	1,500,856.56
应付清算款	-	-	-	126,389.91	126,389.91
应付赎回款	-	-	-	3,073.28	3,073.28
应付管理人报酬	-	-	-	41,433.12	41,433.12
应付托管费	-	-	-	5,919.02	5,919.02
应付销售服务费	-	-	-	7,968.48	7,968.48
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	118.06	118.06
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	155,941.73	155,941.73
负债总计	1,500,856.56	-	-	340,843.60	1,841,700.16
利率敏感度缺口	39,545,220.43	10,826,072.95	1,687,093.64	12,730,250.44	64,788,637.46

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%	-67.14	-46,249.25
	市场利率减少0.25%	67.14	46,356.44

#### 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	11,294,750.24	19.94	12,741,303.64	19.67
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	11,294,750.24	19.94	12,741,303.64	19.67

##### 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%	807,683.26	782,376.02
	业绩比较基准下降 5%	-807,683.26	-782,376.02

#### 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	56,548,030.23	25,254,470.23
第二层次	3,274,993.10	40,586,001.37
第三层次	-	-
合计	59,823,023.33	65,840,471.60

###### 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	11,294,750.24	18.53
	其中：股票	11,294,750.24	18.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	48,528,273.09	79.63
	其中：债券	48,528,273.09	79.63
	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	724,186.53	1.19
8	其他各项资产	396,021.35	0.65
9	合计	60,943,231.21	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	-	-
C	制造业	6,773,295.18	11.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	326,331.00	0.58
E	建筑业	1,084,761.00	1.91
F	批发和零售业	106,360.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	215,388.00	0.38
H	住宿和餐饮业	411,682.00	0.73
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,912,105.06	3.38
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	239,328.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	112,250.00	0.20
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	113,250.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	11,294,750.24	19.94

### 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	601186	中国铁建	55,700	548,645.00	0.97
2	601668	中国建筑	93,400	536,116.00	0.95
3	600519	贵州茅台	300	507,300.00	0.90
4	002475	立讯精密	10,900	353,705.00	0.62
5	000651	格力电器	9,600	350,496.00	0.62
6	688111	金山办公	740	349,442.80	0.62
7	600021	上海电力	30,300	326,331.00	0.58
8	600584	长电科技	7,900	246,243.00	0.43
9	000100	TCL 科技	61,800	243,492.00	0.43
10	000400	许继电气	10,500	242,025.00	0.43
11	002654	万润科技	27,700	239,328.00	0.42
12	600875	东方电气	12,800	238,720.00	0.42
13	300124	汇川技术	3,600	231,156.00	0.41
14	600570	恒生电子	5,200	230,308.00	0.41
15	600600	青岛啤酒	2,200	227,986.00	0.40
16	601872	招商轮船	37,200	215,388.00	0.38
17	600941	中国移动	2,300	214,590.00	0.38
18	600258	首旅酒店	11,000	208,450.00	0.37
19	601728	中国电信	36,900	207,747.00	0.37
20	600754	锦江酒店	4,800	203,232.00	0.36
21	688698	伟创电气	4,623	184,827.54	0.33
22	688036	传音控股	1,127	165,669.00	0.29

23	688160	步科股份	1,936	161,656.00	0.29
24	688700	东威科技	1,420	141,616.60	0.25
25	600066	宇通客车	9,500	140,030.00	0.25
26	002315	焦点科技	3,500	140,000.00	0.25
27	603339	四方科技	8,400	133,644.00	0.24
28	002801	微光股份	4,800	129,888.00	0.23
29	002230	科大讯飞	1,900	129,124.00	0.23
30	002979	雷赛智能	5,400	128,304.00	0.23
31	603019	中科曙光	2,500	127,250.00	0.22
32	002270	华明装备	11,600	127,020.00	0.22
33	300170	汉得信息	10,900	125,786.00	0.22
34	688072	拓荆科技	288	122,679.36	0.22
35	002028	思源电气	2,600	121,472.00	0.21
36	688100	威胜信息	4,017	119,746.77	0.21
37	688099	晶晨股份	1,418	119,565.76	0.21
38	600967	内蒙一机	11,700	118,170.00	0.21
39	002389	航天彩虹	5,300	117,713.00	0.21
40	002534	西子洁能	7,000	117,600.00	0.21
41	603267	鸿远电子	1,800	117,540.00	0.21
42	301391	卡莱特	1,000	117,170.00	0.21
43	300115	长盈精密	9,700	115,527.00	0.20
44	688297	中无人机	2,239	114,838.31	0.20
45	603169	兰石重装	15,400	114,576.00	0.20
46	603212	赛伍技术	5,500	114,455.00	0.20
47	600409	三友化工	21,000	114,450.00	0.20
48	688686	奥普特	695	114,313.60	0.20
49	300232	洲明科技	12,500	114,250.00	0.20
50	603882	金域医学	1,500	113,250.00	0.20
51	002733	雄韬股份	6,500	112,385.00	0.20
52	301230	泓博医药	2,500	112,250.00	0.20
53	002261	拓维信息	5,800	111,998.00	0.20
54	601989	中国重工	23,200	111,824.00	0.20
55	300879	大叶股份	5,800	110,374.00	0.19
56	300286	安科瑞	2,900	109,794.00	0.19
57	600585	海螺水泥	4,600	109,204.00	0.19
58	000034	神州数码	4,000	106,360.00	0.19
59	002156	通富微电	4,700	106,220.00	0.19
60	301101	明月镜片	2,500	102,575.00	0.18
61	301236	软通动力	3,750	102,037.50	0.18
62	002236	大华股份	5,000	98,750.00	0.17
63	603258	电魂网络	2,200	93,522.00	0.17

64	688256	寒武纪	468	87,984.00	0.16
65	603833	欧派家居	800	76,640.00	0.14

## 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	002475	立讯精密	907,856.00	1.40
2	601668	中国建筑	848,946.00	1.31
3	000651	格力电器	827,228.00	1.28
4	600754	锦江酒店	579,901.00	0.90
5	601390	中国中铁	571,911.00	0.88
6	601186	中国铁建	567,259.00	0.88
7	688111	金山办公	552,311.69	0.85
8	002027	分众传媒	505,800.00	0.78
9	600519	贵州茅台	495,832.00	0.77
10	600642	申能股份	492,828.00	0.76
11	000100	TCL 科技	482,636.00	0.74
12	000543	皖能电力	481,566.00	0.74
13	688036	传音控股	408,909.47	0.63
14	002461	珠江啤酒	397,732.00	0.61
15	600570	恒生电子	386,633.00	0.60
16	688385	复旦微电	380,868.51	0.59
17	603993	洛阳钼业	380,038.00	0.59
18	601966	玲珑轮胎	370,320.00	0.57
19	600875	东方电气	356,705.00	0.55
20	002493	荣盛石化	350,729.00	0.54

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	002475	立讯精密	1,084,086.00	1.67
2	603605	珀莱雅	797,922.00	1.23
3	000651	格力电器	706,600.00	1.09
4	300059	东方财富	700,507.40	1.08
5	600011	华能国际	657,254.00	1.01
6	002594	比亚迪	655,040.00	1.01
7	000543	皖能电力	643,991.00	0.99

8	600887	伊利股份	642,109.00	0.99
9	600795	国电电力	629,986.00	0.97
10	300014	亿纬锂能	614,879.00	0.95
11	601390	中国中铁	601,330.00	0.93
12	600027	华电国际	592,342.00	0.91
13	600642	申能股份	547,516.00	0.85
14	601966	玲珑轮胎	525,168.00	0.81
15	002027	分众传媒	507,680.00	0.78
16	600570	恒生电子	471,132.00	0.73
17	688261	东微半导	460,044.36	0.71
18	601689	拓普集团	448,668.00	0.69
19	603993	洛阳钼业	415,346.00	0.64
20	002461	珠江啤酒	401,626.00	0.62

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	37,701,693.41
卖出股票收入（成交）总额	39,295,714.27

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	3,274,993.10	5.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	45,253,279.99	79.88
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	48,528,273.09	85.66

#### 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	113052	兴业转债	46,800	4,760,171.61	8.40
2	113065	齐鲁转债	46,460	4,588,101.93	8.10
3	110059	浦发转债	40,270	4,352,875.87	7.68
4	113044	大秦转债	36,430	4,208,253.87	7.43
5	127034	绿茵转债	37,290	3,966,011.15	7.00

#### 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“兴业转债（证券代码 113052）”、“浦发转债（证券代码 110059）”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	9,619.87
2	应收清算款	384,613.17
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,788.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	396,021.35

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113052	兴业转债	4,760,171.61	8.40
2	113065	齐鲁转债	4,588,101.93	8.10
3	110059	浦发转债	4,352,875.87	7.68
4	113044	大秦转债	4,208,253.87	7.43
5	127034	绿茵转债	3,966,011.15	7.00
6	127045	牧原转债	2,837,935.10	5.01
7	113050	南银转债	2,408,183.48	4.25
8	127061	美锦转债	2,269,299.61	4.01
9	127049	希望转 2	2,034,563.55	3.59
10	113056	重银转债	1,860,657.37	3.28
11	110063	鹰 19 转债	1,710,716.94	3.02
12	123107	温氏转债	1,242,270.31	2.19
13	118018	瑞科转债	1,176,439.46	2.08
14	110088	淮 22 转债	1,134,451.87	2.00
15	113650	博 22 转债	846,276.80	1.49
16	113623	凤 21 转债	769,447.95	1.36
17	127024	盈峰转债	584,382.10	1.03
18	113648	巨星转债	567,766.07	1.00
19	127076	中宠转 2	292,811.49	0.52
20	113644	艾迪转债	291,136.38	0.51
21	123085	万顺转 2	289,805.67	0.51
22	113064	东材转债	287,732.91	0.51
23	123169	正海转债	287,727.88	0.51

24	127074	麦米转 2	287,438.56	0.51
25	128083	新北转债	285,465.28	0.50
26	123164	法本转债	283,049.51	0.50
27	127051	博杰转债	280,793.29	0.50
28	113519	长久转债	278,971.99	0.49
29	127058	科伦转债	277,788.92	0.49
30	113549	白电转债	226,898.65	0.40

### 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 鼎安债券 A	862	30,819.20	7,838,405.12	29.51%	18,727,748.12	70.49%
前海开源 鼎安债券 C	997	17,727.00	9,876,727.35	55.88%	7,797,094.48	44.12%
合计	1,859	23,797.73	17,715,132.4 7	40.04%	26,524,842.60	59.96%

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	前海开源鼎安 债券 A	884.20	0.0033%
	前海开源鼎安	7.58	0.0000%

	债券 C		
	合计	891.78	0.0020%

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	前海开源鼎安债券 A	0
	前海开源鼎安债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放 式基金	前海开源鼎安债券 A	0
	前海开源鼎安债券 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	前海开源鼎安债券 A	前海开源鼎安债券 C
基金合同生效日（2016 年 07 月 19 日）基金 份额总额	600,205,790.22	404,147.25
本报告期期初基金份额总额	32,334,536.79	18,312,780.75
本报告期基金总申购份额	831,564.59	476,270.72
减：本报告期基金总赎回份额	6,599,948.14	1,115,229.64
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	26,566,153.24	17,673,821.83

## § 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	
德邦证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	2	15,999,440.71	20.78%	11,700.06	17.08%	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	60,997,966.97	79.22%	56,806.51	82.92%	-

中国国际 金融	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
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
联储证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
山西证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万和证 券	33,987,8 57.23	24.74%	34,000, 000.00	18.41%	-	-	-	-
五矿证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	103,399, 770.53	75.26%	150,70 0,000.0 0	81.59%	-	-	-	-
中国国 际金融	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	前海开源鼎安债券型证券投资基金 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	前海开源鼎安债券型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023年03月31日
4	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
5	前海开源鼎安债券型证券投资基金 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	中国证监会规定媒介	2023年05月04日
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

## § 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况

类别	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	20230303-20230630	9,756,097.56	-	-	9,756,097.56	22.05%
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鼎安债券型证券投资基金设立的文件
- (2) 《前海开源鼎安债券型证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源鼎安债券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) 前海开源鼎安债券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