

新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金

2023 年第 3 季度报告

2023 年 09 月 30 日

基金管理人:新疆前海联合基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2023 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年10月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年7月1日起至2023年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	前海联合新思路混合
基金主代码	002778
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月11日
报告期末基金份额总额	126,280,909.77份
投资目标	本基金通过对股票、债券等金融资产的动态灵活配置，深入挖掘并充分理解国内经济增长、改革及战略转型等“新思路”，发现价值被市场低估且具潜在在国内经济增长和战略转型所带来的投资标的。在合理控制风险并保持良好流动性前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值，力求为投资者获取超额回报。
投资策略	本基金根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。通过对股票、债券等金融资产的动态灵活配置，深入挖掘并充分理解国内经济增长、改革及战略转型

	等“新思路”，发现价值被市场低估且具潜在国内经济增长和战略转型所带来的投资标的。在合理控制风险并保持良好流动性前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值，力求为投资者获取超额回报。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*30% + 一年期人民币定期存款利率（税后）*70%	
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的较高风险品种。	
基金管理人	新疆前海联合基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	前海联合新思路混合 A	前海联合新思路混合 C
下属分级基金的交易代码	002778	002779
报告期末下属分级基金的份额总额	133,833.49 份	126,147,076.28 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2023 年 07 月 01 日-2023 年 09 月 30 日)	
	前海联合新思路混合 A	前海联合新思路混合 C
1. 本期已实现收益	3,196.72	3,673,081.29
2. 本期利润	785.69	1,190,613.48
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0058	0.0084
4. 期末基金资产净值	196,624.80	199,253,476.46
5. 期末基金份额净值	1.4692	1.5795

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或者交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海联合新思路混合 A 净值表现

阶段	净值增长率	净值增长率	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-------	-------	--------	--------	-----	-----

	①	标准差②	收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	0.31%	0.57%	-0.89%	0.27%	1.20%	0.30%
过去六个月	-0.78%	0.53%	-2.15%	0.26%	1.37%	0.27%
过去一年	1.82%	0.60%	0.39%	0.30%	1.43%	0.30%
过去三年	15.05%	0.63%	-2.33%	0.34%	17.38%	0.29%
过去五年	46.19%	0.76%	9.92%	0.38%	36.27%	0.38%
自基金合同生效起至今	46.92%	1.04%	13.10%	0.35%	33.82%	0.69%

前海联合新思路混合 C 净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.30%	0.58%	-0.89%	0.27%	1.19%	0.31%
过去六个月	-0.79%	0.53%	-2.15%	0.26%	1.36%	0.27%
过去一年	1.84%	0.60%	0.39%	0.30%	1.45%	0.30%
过去三年	14.96%	0.63%	-2.33%	0.34%	17.29%	0.29%
过去五年	43.20%	0.76%	9.92%	0.38%	33.28%	0.38%
自基金合同生效起至今	120.23%	1.46%	13.10%	0.35%	107.13%	1.11%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*30% + 一年期人民币定期存款利率（税后）*70%。

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

前海联合新思路混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年11月11日-2023年09月30日)



前海联合新思路混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年11月11日-2023年09月30日)



3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张磊	本基金的基金经理	2020-07-07	-	10年	张磊先生，清华大学硕士，10年证券基金投资研究经验。曾任华润元大基金管理有限公司投资管理部研究员、新疆前海联合基金管理有限公司研究员、基金经理助理、新疆前海联合沪深300指数型证券投资基金基金经理（自2020年7月7日至2023年4月6日）。现任新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金基金经理（自

					2020 年 6 月 8 日起任职)、新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理 (自 2020 年 7 月 7 日起任职) 和新疆前海联合泳隆灵活配置混合型证券投资基金的基金经理 (自 2021 年 3 月 5 日起任职)。
张文	本基金的基金经理	2020-10-29	-	10 年	<p>张文先生, 硕士, 10 年证券投资基金投资研究交易经验。曾任中山证券有限责任公司固定收益部交易员、第一创业证券股份有限公司资产管理部高级交易经理、深圳慈曜资产管理有限公司交易管理部交易主管、新疆前海联合基金管理有限公司基金经理助理、新疆前海联合泳益纯债债券型证券投资基金基金经理 (自 2021 年 8 月 20 日至 2021 年 9 月 14 日)、新疆前海联合泓旭纯债 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理 (自 2021 年 8 月 20 日至 2022 年 1 月 5 日) 和新疆前海联合泳嘉纯债债券型证券投资基金基金经理 (自 2021 年 8 月 20 日至 2022 年 7 月 27 日)。现任新疆前海联合泓元纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理 (自 2020 年 10 月 28 日起任职)、新疆前海联合淳安纯债 3 年定期开放债券型证券投资基金基金经理 (自 2020 年 10 月 28 日起任职)、新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理 (自 2020 年 10 月 29 日起任职)、新疆前海联合汇盈货币市场基金基金经理 (自 2020 年 12 月 1 日起任职)、新疆前海联合海盈货币市场基金基金经理 (自 2021 年 5 月 18 日起任职)、新疆前海联合泓瑞定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理 (自 2021 年 8 月 20 日起</p>

					任职)、新疆前海联合添鑫 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理(自 2021 年 8 月 20 日起任职)、新疆前海联合淳丰纯债 87 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理(自 2021 年 8 月 20 日起任职)、新疆前海联合润盈短债债券型证券投资基金基金经理(自 2022 年 3 月 5 日起任职)和新疆前海联合添和纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2022 年 3 月 5 日起任职)。
--	--	--	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”根据公司对外公告的解聘日期填写；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别根据公司对外公告的聘任日期和解聘日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善了相应的制度和流程，通过系统和人工等各种方式在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，保护投资者合法权益。

本报告期内，两两组间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组间相互利益输送的情况。

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，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾 2023 年三季度，各大指数有所分化，上证 50 上涨 0.6%，沪深 300 下跌 3.98%，科创 50 下跌 11.67%，创业板下跌 9.53%，中证 1000 下跌 7.92%，以上证 50 为代表的大盘价值风格明显占优。分行业来看，煤炭、非银、石油石化、银行、房地产等行业涨幅靠前，传媒、计算机、新能源、军工、机械等行业跌幅靠前。从主题上看，人工智能在三季度出现了大幅回调。

由于上半年国内经济低于预期，7 月份政治局会议表态更加积极，随后的经济政策也逐渐加大力度。虽然地产销售仍然低迷，但社会消费品零售和汽车销售等数据都出现了触底反弹，出行旅游依旧火爆。国内居民消费受到疤痕效应影响，出口受到逆全球化趋势影响，国内经济的恢复尚需时日，但已经看到曙光，科技行业作为未来重要的经济引擎也将持续受益。报告期内，本基金在寻找景气向上的行业的同时，逐步调整持仓结构，寻找更有性价比的标的。

本基金坚持自下而上精选优质个股，坚持从公司的基本面、估值出发，重点选取基本面坚实、具备核心竞争力、资产负债表健康、业绩具有稳定性的行业龙头公司。同时中观跟踪把握细分行业的景气周期和政策预期，合理调整板块权重。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合新思路混合 A 基金份额净值为 1.4692 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.31%，同期业绩比较基准收益率为-0.89%；截至报告期末前海联合新思路混合 C 基金份额净值为 1.5795 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.30%，同期业绩比较基准收益率为-0.89%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	135,715,002.43	67.95
	其中：股票	135,715,002.43	67.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	56,930,327.12	28.50
	其中：债券	56,930,327.12	28.50
	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	5,001,908.90	2.50
	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	1,898,027.97	0.95
8	其他资产	187,629.15	0.09
9	合计	199,732,895.57	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	3,335,280.00	1.67
C	制造业	92,466,952.05	46.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,074,016.97	1.04
E	建筑业	5,780.15	0.00
F	批发和零售业	1,711,401.24	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	1,108,056.00	0.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	599,172.10	0.30
J	金融业	26,967,379.10	13.52
K	房地产业	5,330,064.00	2.67
L	租赁和商务服务业	7,758.60	0.00
M	科学研究和技术服务业	2,043,404.93	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	19,870.23	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	45,867.06	0.02
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	135,715,002.43	68.04

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	9,500	17,086,225.00	8.57
2	000568	泸州老窖	33,300	7,214,445.00	3.62
3	600887	伊利股份	253,700	6,730,661.00	3.37

4	601318	中国平安	130,600	6,307,980.00	3.16
5	600036	招商银行	179,100	5,904,927.00	2.96
6	002594	比亚迪	21,600	5,112,720.00	2.56
7	600309	万华化学	52,400	4,627,968.00	2.32
8	601166	兴业银行	264,100	4,302,189.00	2.16
9	000858	五粮液	24,800	3,871,280.00	1.94
10	300750	宁德时代	18,900	3,837,267.00	1.92

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	4,704,997.40	2.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	42,198,055.75	21.16
	其中：政策性金融债	11,434,343.56	5.73
4	企业债券	10,027,273.97	5.03
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	56,930,327.12	28.54

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	2128036	21 平安银行二级	100,000	10,477,040.55	5.25
2	232380009	23 建行二级资本债 01A	100,000	10,282,651.37	5.16
3	210202	21 国开 02	100,000	10,240,172.60	5.13
4	112962	19 深建 01	100,000	10,027,273.97	5.03
5	148026	22 广发 07	100,000	10,004,020.27	5.02

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

1.21 平安银行二级发债主体受监管处罚情况：

2023 年 7 月 27 日，根据银罚决字（2023）55 号，由于违反反洗钱法，违规占压财政存款或资金等违法违规行为，平安银行被中国人民银行警告，没收违法所得 1848.67 元，罚款 3492.50 万元。

基金管理人经审慎分析，认为平安银行净资产规模大，经营情况良好，且平安银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，上述罚款占其净资产及净利润比例低，上述事项对平安银行自身信用基本面影响很小，对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于平安银行的决策程序说明：基于平安银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于平安银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析，认为上述事项对平安银行经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

2.23 建行二级资本债 01A 发债主体受监管处罚情况：

2023 年 2 月 16 日，根据银保监罚决字（2023）10 号，由于信息披露虚假或严重误导性陈述以

及违规经营等违法违规事项，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条；《中华人民共和国商业银行法》第三十四条、第三十五条、第四十条、第五十条、第六十二条、第七十三条、第七十四条，建设银行被银保监会没收违法所得并处罚款合计 19891.56 万元，其中总行 7341.56 万元、分支机构 12550 万元。

基金管理人经审慎分析，认为建设银行净资产规模大，经营情况良好，且建设银行主体评级为市场最高的 AAA 评级，上述罚款占其净资产及净利润比例低，上述事项对建设银行自身信用基本面影响很小，对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于建设银行的决策程序说明：基于建设银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于建设银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析，认为上述事项对建设银行经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

3.19 深建 01 发债主体受监管处罚情况：

(1) 2022 年 10 月 26 日，根据深交罚决第（2022）ZD15208 号，由于未经审批同意开设路口的违法行为，依据《深圳经济特区道路交通安全管理条例》第一百零八条第一款，深圳特区建发被深圳市交通运输局处罚款 8 万元。

(2) 2022 年 11 月 30 日，根据粤深海综罚（2022）44 号，由于非法改变海域用途的违法违规行为，依据《中华人民共和国海域使用管理法》第四十六条；《中华人民共和国行政处罚法》第三十二条第一项；《深圳市海洋行政处罚自由裁量权标准》中序号 14，深圳特区建发被深圳市海洋综合执法支队处罚款 27.05 万元。

(3) 2023 年 2 月 9 日，根据深交罚决第 2023ZD04109 号，由于未按照批准的期限占用或者挖掘城市道路，或者需要延长时间，未提前办理变更审批手续的违法行为，依据《城市道路管理条例》第四十二条第（六）项，深圳特区建发被深圳市交通运输局处罚款 2 万元。

基金管理人经审慎分析，认为深圳特区建发股东背景强，净资产规模较大，经营情况良好，且深圳特区建发主体评级为市场最高的 AAA 评级，上述罚款占其净资产及净利润比例很低，上述事项对深圳特区建发自身信用基本面影响很小，对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于深圳特区建发的决策程序说明：基于深圳特区建发基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于深圳特区建发，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析，认为上述事项对深圳特区建发经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

4.22 广发 07 发债主体受监管处罚情况：

(1) 2023 年 4 月 18 日，根据证监立案字 0382023005 号，由于广发证券在美尚生态景观股份有限公司 2018 年非公开发行股票的保荐业务中未勤勉尽责，涉嫌违法，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，证监会决定对广发证券立案调查；7 月 17 日广发证券收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字〔2023〕40 号），9 月 22 日，广发证券收到证监会《行政处罚决定书》（〔2023〕65 号），由于广发证券违反了《证券发行与承销管理办法》（证监会令第 144 号）第二十八条的规定，依据《证券法》第一百九十一条第三项，第一百九十二条的规定，证监会决定对广发证券责令改正，给予警告，没收保荐业务收入 94.34 万元，并处以 94.34 万

元罚款；没收承销股票违法所得 783.02 万元，并处以 50 万元罚款，罚没款合计 1021.70 万元。

(2) 2023 年 8 月 22 日，根据广东银罚决字（2023）11 号，由于违反反洗钱业务管理规定，广发证券被中国人民银行广东省分行处以 486 万元罚款。

基金管理人经审慎分析，认为广发证券资产规模大，经营情况良好，且广发证券主体评级为市场最高的 AAA 评级，上述罚款占其净资产及净利润比例低，上述事项对广发证券自身信用基本面影响很小，对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于广发证券的决策程序说明：基于广发证券基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于广发证券，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析，认为上述事项对广发证券经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

5. 招商银行股票发行主体受监管处罚情况：

招商银行及其分支机构在报告编制日前一年内因未依法履行职责、违规经营、违反反洗钱管理规定等原因，受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行等监管部门罚款等处罚。

基金管理人分析认为，罚款金额占公司营业利润比例低，监管部门处罚事件对公司正常经营影响较小。

本基金投资于招商银行的决策程序说明：基于招商银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于招商银行，其决策流程符合相关法律法规和公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析，认为该事项对公司的经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

6. 兴业银行股票发行主体受监管处罚处罚情况：

兴业银行及其分支机构在报告编制日前一年内因未依法履行职责等原因，受到国家金融监督管理总局济宁监管分局等监管部门罚款等处罚。

基金管理人分析认为，罚款金额占公司营业利润比例低，监管部门处罚事件对公司正常经营影响较小。

本基金投资于兴业银行的决策程序说明：基于兴业银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于兴业银行，其决策流程符合相关法律法规和公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析，认为该事项对公司的经营和价值应不会构成重大影响，对基金运作无影响。

7. 21 国开 02 发债发行主体受监管处罚处罚情况：

国家开发银行多家分行，因违规经营，未依法履行责任，涉嫌违反法律法规，受到当地银保监分局和央行分行的罚款。

基金管理人经审慎分析，认为国家开发银行资产规模大，经营情况良好，上述罚款占其净利润及净资产的比例很低，该事项对国家开发银行自身信用基本面影响很小，对其短期流动性影响可以忽略不计。

本基金投资于国家开发银行的决策程序说明：基于国家开发银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于国家开发银行，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

基金管理人经审慎分析，认为该事项对国家开发银行经营和价值应不会构成重大影响，对基金

运作无影响。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,087.73
2	应收证券清算款	182,541.42
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	187,629.15

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	前海联合新思路混合 A	前海联合新思路混合 C
报告期期初基金份额总额	137,453.03	150,861,914.21
报告期期间基金总申购份额	47.08	-
减：报告期期间基金总赎回份额	3,666.62	24,714,837.93
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	133,833.49	126,147,076.28

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购或者赎回本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20230825-20230930	29,703,738.79	-	-	29,703,738.79	23.52%
	2	20230830-20230930	29,536,887.68	-	-	29,536,887.68	23.39%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注：报告期内申购份额包含红利再投份额。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、本报告期内公开披露的基金净值信息及其他临时公告。

9.2 存放地点

除上述第 6 项文件存放于基金托管人处外，其他备查文件等文本存放于基金管理人处。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

新疆前海联合基金管理有限公司

二〇二三年十月二十五日