

新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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:2024 年 03 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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2024年03月22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。

本年度报告财务资料已经审计，致同会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2023年01月01日起至2023年12月31日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	64
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	64
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	64
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	64
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	64
§ 9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	66
§ 10 开放式基金份额变动	66
§ 11 重大事件揭示	67
11.1 基金份额持有人大会决议	67
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8 其他重大事件	71
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	71
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 13 备查文件目录	72
13.1 备查文件目录	72
13.2 存放地点	72
13.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	120,030,297.91 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海联合新思路混合 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	58,954.36 份	119,971,343.55 份

2.2 基金产品说明

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。
--	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新疆前海联合基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	邹文庆（代履职）	郭明
	联系电话	0755-82780666	010-66105799
	电子邮箱	service@qhlhfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-640-0099	95588
传真		0755-82780000	010-66105798
注册地址		新疆乌鲁木齐经济技术开发区维泰南路1号维泰大厦1506室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		深圳市南山区桂湾四路197号前海华润金融中心T1栋第28和29层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518057	100140
法定代表人		邹文庆（代履职）	陈四清

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.qhlhfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	致同会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市朝阳区建国门外大街22号赛特广场5层
注册登记机构	新疆前海联合基金管理有限公司	深圳市南山区桂湾四路197号前海华润金融中心T1栋第28和29层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.	2023年	2022年	2021年
------	-------	-------	-------

1 期间数据和指标	前海联合新思路混合 A	前海联合新思路混合 C	前海联合新思路混合 A	前海联合新思路混合 C	前海联合新思路混合 A	前海联合新思路混合 C
本期已实现收益	7,729.63	9,480,304.19	10,105.39	10,447,011.50	40,725.72	30,151,742.37
本期利润	-3,238.84	-8,868,284.10	-12,772.29	-12,924,980.15	22,618.70	20,858,694.64
加权平均基金份额本期利润	-0.0261	-0.0611	-0.0718	-0.0750	0.0825	0.1079
本期加权平均净值利润率	-1.77%	-3.87%	-4.92%	-4.78%	5.61%	6.80%
本期基金份额净值增长率	-4.96%	-4.98%	-4.35%	-4.41%	6.86%	6.90%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	22,887.18	59,069,349.27	77,271.08	95,216,905.20	111,103.35	115,623,337.23
期末可供分配基金份额利润	0.3882	0.4924	0.4606	0.5706	0.5273	0.6428
期末	81,841.5	179,040,692.8	245,040.0	262,078,916.1	321,795.1	295,485,259.2

基金资产净值	4	2	5	3	6	8
期末基金份额净值	1.3882	1.4924	1.4606	1.5706	1.5270	1.6430
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	38.82%	108.09%	46.06%	118.99%	52.70%	129.09%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海联合新思路混合 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.51%	0.58%	-1.85%	0.24%	-3.66%	0.34%
过去六个月	-5.22%	0.58%	-2.73%	0.26%	-2.49%	0.32%
过去一年	-4.96%	0.54%	-2.35%	0.25%	-2.61%	0.29%
过去三年	-2.86%	0.63%	-8.05%	0.33%	5.19%	0.30%
过去五年	49.11%	0.75%	11.78%	0.36%	37.33%	0.39%
自基金合同生效起至今	38.82%	1.02%	11.01%	0.35%	27.81%	0.67%

前海联合新思路混合 C 净值表现

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基准	①-③	②-
----	-------	-------	-------	--------	-----	----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	收益率标准差 ④		④
过去三个月	-5.51%	0.58%	-1.85%	0.24%	-3.66%	0.34%
过去六个月	-5.23%	0.58%	-2.73%	0.26%	-2.50%	0.32%
过去一年	-4.98%	0.54%	-2.35%	0.25%	-2.63%	0.29%
过去三年	-2.90%	0.63%	-8.05%	0.33%	5.15%	0.30%
过去五年	47.03%	0.75%	11.78%	0.36%	35.25%	0.39%
自基金合同 生效起至今	108.09%	1.44%	11.01%	0.35%	97.08%	1.09%

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份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

前海联合新思路混合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12月31日)

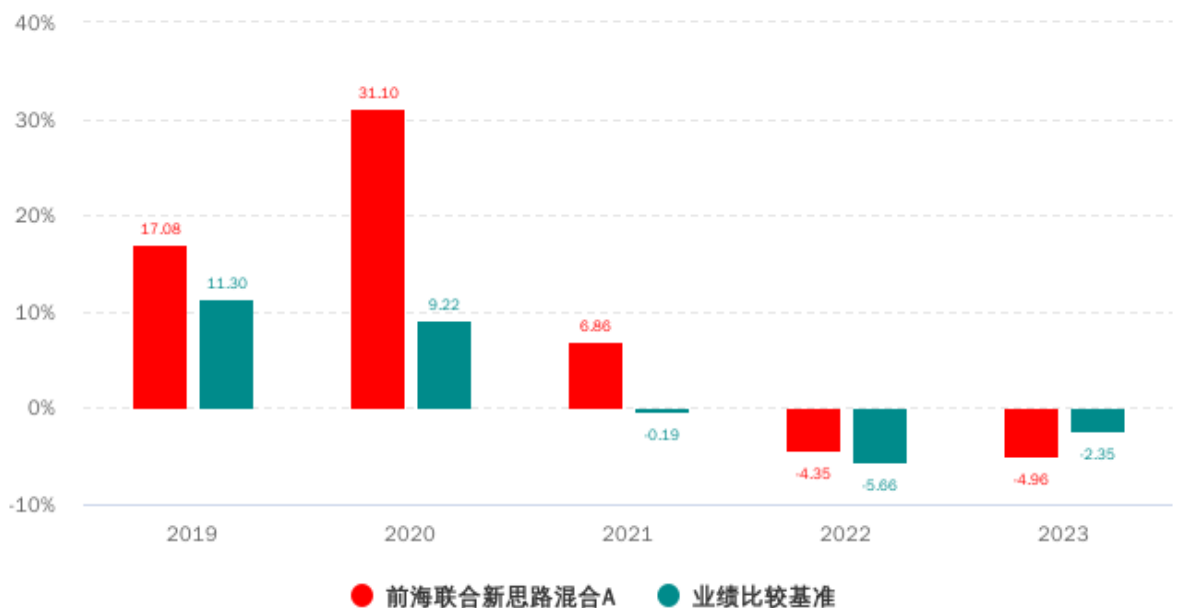


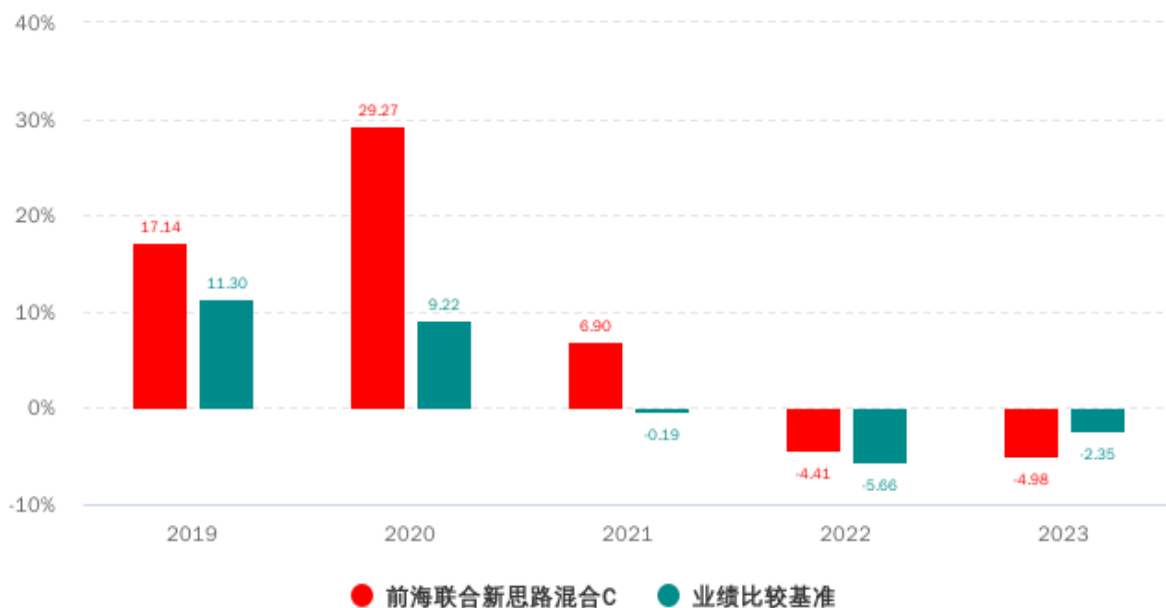
前海联合新思路混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年11月11日-2023年12月31日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

新疆前海联合基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监许可【2015】1842号文批准，于2015年8月7日成立。公司注册资本2亿元人民币，股东结构为：深圳市钜盛华股份有限公司（30%）、深圳粤商物流有限公司（25%）、深圳市深粤控股股份有限公司（25%）、凯信恒有限公司（20%）。本公司总部位于广东省深圳市，已设立上海分公司、北京分公司、深圳分公司。本公司经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，本公司旗下共管理28只产品，包括货币型、债券型、混合型和FOF等类型。

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	说明

		任职日期	离任日期	从业年限	
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年证券投资基金投资研究经验。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	-	11年	张文先生，硕士，11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

				<p>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)。</p>
--	--	--	--	---

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善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，两两组合间单日、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，并且交易占优比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内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 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

回顾 2023 年全年，作为疫情后的第一年，国内经济的整体发展低于年初过高的预期。由于疤痕效应，房地产销售低迷，除了地产产业链受到影响，财富效应的收缩也影响到了其他行业。除了餐饮旅游等行业快速反弹，其他行业大多恢复缓慢，汽车行业进入价格战，反而是出口比当初预期得好。全年来看增长最确定的细分行业是人工智能，但是受到美国制裁的限制，国内真正受益的公司不多。分行业来看，通信、传媒、煤炭、家电、石油石化等行业涨幅靠前，消费者服务、房地产、新能源、建材、基础化工跌幅靠前。报告期内，本基金主要寻找景气回升并在长期具有成长性的行业，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。

4.4.2 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 1.3882 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.96%，同期业绩比较基准收益率为-2.35%；截至报告期末前海联合新思路混合 C 基金份额净值为 1.4924 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.98%，同期业绩比较基准收益率为-2.35%。

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 2024 年我们认为，国内经济仍处于转型的阵痛期，居民的资产负债表的修复仍需时日，而海外地缘政治的风险也不容忽视。但目前房地产市场和股市都经历了较长时间的深度调整，利空因素已经体现在价格之中。随着三中全会和两会的召开，国家将确定长期和短期的发展路线，很可能会有超预期的政策，目前对后市不宜过于悲观。

科技行业作为经济转型的重要方向，国家高度重视，行业发展空间从低附加值向高附加值发展也符合产业规律。生成式 AI、虚拟现实、智能驾驶、人形机器人等创新层出不穷，目前正是创新的孕育期，我们将继续寻找并着重关注确定性强的科技龙头标的。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从保护基金份额持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保基金运作符合法律法规和基金合同的要求。公司监察稽核部通过合规审核、实时监控及专项检查等方法，对基金运作和公司管理进行独立的监察稽核，及时发现风险隐患，提出整改建议，并督促跟踪业务部门进行整改。

本报告期内，本基金管理人对公司内控制度与业务流程进行了检视与修订，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展

的合规性和制度执行的有效性；通过事前防范、事中控制和事后监督，加强对日常投资运作的监控，督促投研交易业务的合规开展；积极组织法律法规和职业道德培训，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况；保证各项信息披露的真实性、准确性和完整性；监督客户服务工作，保障投资者合法权益。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金的安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人的基金估值由基金会计负责，基金会计以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及账务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管人双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管人进行核对；每日估值结果必须与托管人核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。配备的基金会计具备基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了较为丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策的估值小组，由运营分管高管、投研分管高管、基金运营部负责人、研究发展部负责人、信用研究部负责人、监察稽核部负责人、风险管理部负责人及其他指定人员组成，分别具有投资研究、风险管理、估值核算等方面的专业经验。基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。

本报告期内，参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金的管理人——新疆前海联合基金管理有限公司在新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对新疆前海联合基金管理有限公司编制和披露的新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	致同审字（2024）第 441A004113 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“前海联合新思路混合基金”）的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称

	“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了前海联合新思路混合基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于前海联合新思路混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	前海联合新思路混合基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）的管理层对其他信息负责。其他信息包括前海联合新思路混合基金 2023 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估前海联合新思路混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算前海联合新思路混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督前海联合新思路混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当

	<p>的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据所获取的审计证据，就可能对前海联合新思路混合基金的持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致前海联合新思路混合基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就基金的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	致同会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	桑涛 谭瑛红
会计师事务所的地址	北京市朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 层
审计报告日期	2024-03-26

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	4,799,914.04	2,136,337.95
结算备付金		31,230.76	297,511.62
存出保证金		5,393.38	4,484.14
交易性金融资产	7.4.7.2	174,589,986.55	253,069,356.18
其中：股票投资		125,252,801.09	142,245,309.88

基金投资		-	-
债券投资		49,337,185.46	110,824,046.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	9,992,786.75
应收清算款		-	211,323.69
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		179,426,524.73	265,711,800.33
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	3,002,252.05
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	1.57
应付管理人报酬		105,289.92	155,882.75
应付托管费		15,041.42	22,268.98
应付销售服务费		4,510.37	6,674.45
应付投资顾问费		-	-
应交税费		236.00	2,261.66
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	178,912.66	198,502.69
负债合计		303,990.37	3,387,844.15
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	120,030,297.91	167,029,779.90
未分配利润	7.4.7.8	59,092,236.45	95,294,176.28
净资产合计		179,122,534.36	262,323,956.18
负债和净资产总计		179,426,524.73	265,711,800.33

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 120,030,297.91 份。其中前海联合新思路混合 A 基金份额净值 1.3882 元，基金份额总额 58,954.36 份；前海联合新思路混合 C 基金份额净值 1.4924 元，基金份额总额 119,971,343.55 份。

7.2 利润表

会计主体：新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-6,697,904.90	-10,385,217.01
1. 利息收入		58,167.05	225,455.36
其中：存款利息收入	7.4.7.9	15,903.24	11,896.90
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		42,263.81	213,558.46
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,603,425.30	12,784,145.13
其中：股票投资收益	7.4.7.10	4,651,376.96	4,480,011.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	2,764,089.99	4,673,353.86
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	4,187,958.35	3,630,779.65
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-18,359,556.76	-23,394,869.33
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	59.51	51.83
减：二、营业总支出		2,173,618.04	2,552,535.43
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,609,489.76	1,898,257.98
2. 托管费	7.4.10.2.2	229,927.19	271,179.72
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	68,922.70	81,275.60
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		61,012.13	93,093.51
其中：卖出回购金融资产支出		61,012.13	93,093.51
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		1,285.85	4,104.91
8. 其他费用	7.4.7.19	202,980.41	204,623.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,871,522.94	-12,937,752.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,871,522.94	-12,937,752.44
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-8,871,522.94	-12,937,752.44

7.3 净资产变动表

会计主体：新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	167,029,779.90	95,294,176.28	262,323,956.18
二、本期期初净资产	167,029,779.90	95,294,176.28	262,323,956.18
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-46,999,481.99	-36,201,939.83	-83,201,421.82
（一）、综合收益总额	-	-8,871,522.94	-8,871,522.94
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-46,999,481.99	-27,330,416.89	-74,329,898.88
其中：1. 基金申购款	2,489.26	1,011.29	3,500.55
2. 基金赎回款	-47,001,971.25	-27,331,428.18	-74,333,399.43
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	120,030,297.91	59,092,236.45	179,122,534.36
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	180,072,613.86	115,734,440.58	295,807,054.44
二、本期期初净资产	180,072,613.86	115,734,440.58	295,807,054.44
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-13,042,833.96	-20,440,264.30	-33,483,098.26
（一）、综合收益总额	-	-12,937,752.44	-12,937,752.44
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-13,042,833.96	-7,502,511.86	-20,545,345.82
其中：1. 基金申购款	3,758.33	1,783.71	5,542.04
2. 基金赎回款	-13,046,592.29	-7,504,295.57	-20,550,887.86
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	167,029,779.90	95,294,176.28	262,323,956.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

邹文庆

党刚

陈艳

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]65号文《关于准予新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》进行募集，由新疆前海联合基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》及其他法律法规公开募集。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 200,781,590.76 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1331 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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》于 2016 年 11 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,782,143.62 份基金份额，其中认购资金利息折合 552.86 份基金份额。本基金的基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将本基金分设 A 类和 C 类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，本基金的 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。相关费率及费率水平在招募说明书中列示。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》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、创业板及其他中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、银行存款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：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种等合计占基金资产的比例为 5%-100%，其中权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%；每个交易日日终，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、存出保证金及应收申购款等。本基金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%。

本财务报表由本基金的基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司于审计报告日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号（年度报告和中期报告）》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资

产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：（1）现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；（2）实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未

实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	4,799,914.04	2,136,337.95
等于：本金	4,799,445.75	2,136,147.53
加：应计利息	468.29	190.42
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
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	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	4,799,914.04	2,136,337.95

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	151,531,804.73	-	125,252,801.09	-26,279,003.64	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	8,973,770.00	113,480.54	9,103,880.54	16,630.00
	银行间市场	40,023,468.63	88,304.92	40,233,304.92	121,531.37
	合计	48,997,238.63	201,785.46	49,337,185.46	138,161.37
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	200,529,043.36	201,785.46	174,589,986.55	-26,140,842.27	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	149,660,481.32	-	142,245,309.88	-7,415,171.44	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	25,057,077.56	307,095.07	25,201,045.07	-163,127.56
	银行间市场	85,091,486.51	734,501.23	85,623,001.23	-202,986.51
	合计	110,148,564.07	1,041,596.30	110,824,046.30	-366,114.07

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	259,809,045.39	1,041,596.30	253,069,356.18	-7,781,285.51

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	9,992,786.75	-
合计	9,992,786.75	-

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 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	5,612.66	15,202.69
其中：交易所市场	3,286.16	10,972.76
银行间市场	2,326.50	4,229.93
应付利息	-	-
预提费用	173,300.00	183,300.00
合计	178,912.66	198,502.69

7.4.7.7 实收基金

前海联合新思路混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	167,768.97	167,768.97
本期申购	1,671.96	1,671.96
本期赎回（以“-”号填列）	-110,486.57	-110,486.57
本期末	58,954.36	58,954.36

前海联合新思路混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	166,862,010.93	166,862,010.93
本期申购	817.30	817.30
本期赎回（以“-”号填列）	-46,891,484.68	-46,891,484.68
本期末	119,971,343.55	119,971,343.55

注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

7.4.7.8 未分配利润

前海联合新思路混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	116,049.08	-38,778.00	77,271.08
本期期初	116,049.08	-38,778.00	77,271.08
本期利润	7,729.63	-10,968.47	-3,238.84
本期基金份额交易产生的变动数	-79,428.71	28,283.65	-51,145.06
其中：基金申购款	1,251.93	-643.34	608.59
基金赎回款	-80,680.64	28,926.99	-51,753.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,350.00	-21,462.82	22,887.18

前海联合新思路混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	144,778,118.69	-49,561,213.49	95,216,905.20
本期期初	144,778,118.69	-49,561,213.49	95,216,905.20

本期利润	9,480,304.19	-18,348,588.29	-8,868,284.10
本期基金份额交易产生的变动数	-42,411,871.91	15,132,600.08	-27,279,271.83
其中：基金申购款	758.54	-355.84	402.70
基金赎回款	-42,412,630.45	15,132,955.92	-27,279,674.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	111,846,550.97	-52,777,201.70	59,069,349.27

7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	13,665.47	9,754.98
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	2,168.08	2,023.26
其他	69.69	118.66
合计	15,903.24	11,896.90

7.4.7.10 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	14,668,186.55	24,338,633.39
减：卖出股票成本总额	9,985,863.77	19,748,064.65
减：交易费用	30,945.82	110,557.12
买卖股票差价收入	4,651,376.96	4,480,011.62

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
----	---------------------------------------	--

债券投资收益——利息收入	2,447,745.16	3,660,191.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	316,344.83	1,013,162.07
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	2,764,089.99	4,673,353.86

7.4.7.11.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	425,121,363.60	728,316,523.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	421,624,004.32	722,588,046.28
减：应计利息总额	3,172,151.95	4,703,746.41
减：交易费用	8,862.50	11,569.21
买卖债券差价收入	316,344.83	1,013,162.07

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13 贵金属投资收益

7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	4,187,958.35	3,630,779.65
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,187,958.35	3,630,779.65

7.4.7.16 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-18,359,556.76	-23,394,869.33
——股票投资	-18,863,832.20	-22,045,593.74
——债券投资	504,275.44	-1,349,275.59
——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	-18,359,556.76	-23,394,869.33

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	59.51	46.02
转换费收入	-	5.81
合计	59.51	51.83

7.4.7.18 信用减值损失

无。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他费用	5,780.41	7,423.71
账户维护费	37,200.00	37,200.00
合计	202,980.41	204,623.71

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

新疆前海联合基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
深圳粤商物流有限公司	基金管理人的股东
深圳市深粤控股股份有限公司	基金管理人的股东
凯信恒有限公司	基金管理人的股东
深圳市钜盛华股份有限公司	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,609,489.76	1,898,257.98
其中：应支付销售机构的客户维护费	12.07	27.01
应支付基金管理人的净管理费	1,609,477.69	1,898,230.97

注：支付基金管理人新疆前海联合的管理人报酬按前一日基金资产净值 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 X 0.70% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	229,927.19	271,179.72

注：支付基金托管人中国工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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合新思路混合 A	前海联合新思路混合 C	合计
新疆前海联合基金管理有限公司	-	68,922.70	68,922.70
合计	-	68,922.70	68,922.70
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合新思路混合 A	前海联合新思路混合 C	合计
新疆前海联合基金管理有限公司	-	81,275.60	81,275.60
合计	-	81,275.60	81,275.60

注：1、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 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给新疆前海联合，再由新疆前海联合计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

2、根据本基金管理人于 2020 年 8 月 19 日发布的《前海联合基金管理有限公司关于开展前海联合新思路混合基金 C 类份额销售服务费率优惠活动的公告》，自 2020 年 8 月 20 日起，本基金的销售服务费率由 0.3%调整为 0.03%。截至资产负债表日，该优惠活动未发生变化。后续优惠活动变化及结束具体时间，以管理人公告为准。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	4,799,914.04	13,665.47	2,136,337.95	9,754.98

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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

688347	华虹半导体公司	2023年07月27日	6个月	网下新股限售	52.00	42.06	6,279	326,508.00	264,094.74	-
688717	艾罗能源	2023年12月26日	5个交易日	新股未上市	55.66	55.66	2,935	163,362	163,362	-
301487	盟固利	2023年08月01日	6个月	网下新股限售	5.32	40.96	1,073	5,708.36	43,950.08	-
301510	固高科技	2023年08月04日	6个月	网下新股限售	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301172	君逸数码	2023年07月19日	6个月	网下新股限售	31.33	38.16	307	9,618.31	11,715.12	-
688548	广钢气体股份	2023年08月08日	6个月	网下新股限售	9.87	12.75	882	8,705.34	11,245.50	-
688549	中巨芯科技	2023年08月30日	6个月	网下新股限售	5.18	8.09	1,370	7,096.60	11,083.30	-
688627	精智达技术	2023年07月11日	6个月	网下新股限售	46.77	87.72	124	5,799.48	10,877.28	-
301370	国科恒泰	2023年07月03日	6个月	网下新股限售	13.39	16.01	625	8,368.75	10,006.25	-
301499	维科	2023年07月13日	6个月	网下新股	19.50	28.93	344	6,708.00	9,951.92	-

	精密	日		限售						
301558	三态股份	2023年09月21日	6个月	网下新股限售	7.33	13.40	729	5,343.57	9,768.60	-
688582	芯动联科	2023年06月21日	6个月	网下新股限售	26.74	38.67	239	6,390.86	9,242.13	-
688591	泰凌微	2023年08月18日	6个月	网下新股限售	24.98	28.02	307	7,668.86	8,602.14	-
301516	中远通	2023年12月01日	6个月	网下新股限售	6.87	15.51	552	3,792.24	8,561.52	-
688603	天承科技	2023年06月30日	6个月	网下新股限售	55.00	74.14	112	6,160.00	8,303.68	-
301507	民生健康	2023年08月24日	6个月	网下新股限售	10.00	15.85	522	5,220.00	8,273.70	-
688573	信宇人	2023年08月09日	6个月	网下新股限售	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
301509	金凯生科	2023年07月26日	6个月	网下新股限售	56.56	62.23	129	7,296.24	8,027.67	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	网下新股限售	28.03	49.84	157	4,400.71	7,824.88	-
301261	恒工精密	2023年06月29日	6个月	网下新股限售	36.90	50.85	153	5,645.70	7,780.05	-
301292	海科新源	2023年06月29日	6个月	网下新股限售	19.99	19.35	396	7,916.04	7,662.60	-
688610	埃	2023年	6个月	网下	73.33	51.00	147	10,779.51	7,497.00	-

	科光电	07月10日		新股限售							
688702	盛科通信	2023年09月06日	6个月	网下新股限售	42.66	48.18	155	6,612.30	7,467.90	-	
603296	华勤技术	2023年08月01日	6个月	网下新股限售	80.80	77.75	95	7,676.00	7,386.25	-	
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	网下新股限售	33.25	58.19	125	4,156.25	7,273.75	-	
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	网下新股限售	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-	
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	网下新股限售	31.95	52.25	139	4,441.05	7,262.75	-	
301251	威尔高	2023年08月30日	6个月	网下新股限售	28.88	34.59	209	6,035.92	7,229.31	-	
301511	德福科技	2023年08月08日	6个月	网下新股限售	28.00	22.67	309	8,652.00	7,005.03	-	
301210	金杨股份	2023年06月21日	6个月	网下新股限售	57.88	45.48	154	8,913.52	7,003.92	-	
301505	苏州规划	2023年07月12日	6个月	网下新股限售	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-	
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	网下新股限售	10.50	15.99	430	4,515.00	6,875.70	-	
301486	致尚科	2023年06月30日	6个月	网下新股限售	57.66	47.25	145	8,360.70	6,851.25	-	

	技									
301272	英 华 特	2023 年 07 月 06 日	6 个月	网下 新股 限售	51.39	53.38	128	6,577.92	6,832.64	-
301469	恒 达 新 材	2023 年 08 月 10 日	6 个月	网下 新股 限售	36.58	33.09	204	7,462.32	6,750.36	-
301362	民 爆 光 电	2023 年 07 月 27 日	6 个月	网下 新股 限售	51.05	38.52	173	8,831.65	6,663.96	-
301329	信 音 电 子	2023 年 07 月 05 日	6 个月	网下 新股 限售	21.00	22.23	285	5,985.00	6,335.55	-
301489	思 泉 新 材	2023 年 10 月 16 日	6 个月	网下 新股 限售	41.66	64.11	98	4,082.68	6,282.78	-
301393	昊 帆 生 物	2023 年 07 月 05 日	6 个月	网下 新股 限售	67.68	59.37	104	7,038.72	6,174.48	-
301528	多 浦 乐	2023 年 08 月 17 日	6 个月	网下 新股 限售	71.80	68.91	89	6,390.20	6,132.99	-
301518	长 华 化 学	2023 年 07 月 26 日	6 个月	网下 新股 限售	25.75	23.01	266	6,849.50	6,120.66	-
301519	舜 禹 股 份	2023 年 07 月 19 日	6 个月	网下 新股 限售	20.93	20.21	296	6,195.28	5,982.16	-
301202	朗 威 股 份	2023 年 06 月 28 日	6 个月	网下 新股 限售	25.82	31.80	187	4,828.34	5,946.60	-
688648	中 邮 科 技	2023 年 11 月 06 日	6 个月	网下 新股 限售	15.18	21.43	277	4,204.86	5,936.11	-
688638	誉	2023 年	6 个月	网下	83.90	59.68	98	8,222.20	5,848.64	-

	辰智能	07月04日		新股限售							
688602	康鹏科技	2023年07月13日	6个月	网下新股限售	8.66	11.06	524	4,537.84	5,795.44	-	
301456	盘古智能	2023年07月06日	6个月	网下新股限售	37.96	30.39	189	7,174.44	5,743.71	-	
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	网下新股限售	23.23	35.58	159	3,693.57	5,657.22	-	
688693	锆威特	2023年08月10日	6个月	网下新股限售	40.83	43.41	128	5,226.24	5,556.48	-	
688716	中研股份	2023年09月13日	6个月	网下新股限售	29.66	36.39	150	4,449.00	5,458.50	-	
301459	丰茂股份	2023年12月06日	6个月	网下新股限售	31.90	39.84	135	4,306.50	5,378.40	-	
601096	宏盛华源铁塔集团	2023年12月15日	6个月	网下新股限售	1.70	4.06	1,261	2,143.70	5,119.66	-	
301529	福赛科技	2023年08月31日	6个月	网下新股限售	36.60	37.88	135	4,941.00	5,113.80	-	
301525	儒竞科技	2023年08月23日	6个月	网下新股限售	99.57	81.46	62	6,173.34	5,050.52	-	
688646	逸飞激	2023年07月21日	6个月	网下新股限售	46.80	36.07	135	6,318.00	4,869.45	-	

	光										
688719	爱科赛博	2023年 09月20 日	6个月	网下 新股 限售	69.98	60.10	81	5,668.38	4,868.10	-	
301500	飞南资源	2023年 09月13 日	6个月	网下 新股 限售	23.97	20.89	225	5,393.25	4,700.25	-	
301515	港通医疗	2023年 07月13 日	6个月	网下 新股 限售	31.16	28.27	164	5,110.24	4,636.28	-	
301371	敷尔佳	2023年 07月24 日	6个月	网下 新股 限售	55.68	37.58	121	6,737.28	4,547.18	-	
688612	威迈斯	2023年 07月19 日	6个月	网下 新股 限售	47.29	37.97	116	5,485.64	4,404.52	-	
301559	中集环科	2023年 09月26 日	6个月	网下 新股 限售	24.22	18.24	237	5,740.14	4,322.88	-	
301548	崇德科技	2023年 09月11 日	6个月	网下 新股 限售	66.80	58.99	72	4,809.60	4,247.28	-	
301520	万邦医药	2023年 09月18 日	6个月	网下 新股 限售	67.88	52.74	77	5,226.76	4,060.98	-	
688657	浩辰软件	2023年 09月25 日	6个月	网下 新股 限售	103.40	78.23	49	5,066.60	3,833.27	-	
688450	光格科技	2023年 07月17 日	6个月	网下 新股 限售	53.09	36.42	100	5,309.00	3,642.00	-	
603270	金帝精密科	2023年 08月25 日	6个月	网下 新股 限售	21.77	29.58	117	2,547.09	3,460.86	-	

	技股份									
001239	永达股份	2023年12月04日	6个月	网下新股限售	12.05	19.92	172	2,072.60	3,426.24	-
001326	联域股份	2023年11月01日	6个月	网下新股限售	41.18	48.64	70	2,882.60	3,404.80	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	网下新股限售	11.25	11.07	293	3,296.25	3,243.51	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	网下新股限售	9.50	18.97	170	1,615.00	3,224.90	-
603373	安邦护卫集团股份	2023年12月13日	6个月	网下新股限售	19.10	34.75	85	1,623.50	2,953.75	-
603119	浙江荣泰股份	2023年07月21日	6个月	网下新股限售	15.32	23.87	114	1,746.48	2,721.18	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	网下新股限售	16.80	31.19	87	1,461.60	2,713.53	-
603275	上海众辰科技	2023年08月16日	6个月	网下新股限售	49.97	39.70	65	3,248.05	2,580.50	-
001306	夏	2023年	6个月	网下	53.63	75.36	33	1,769.79	2,486.88	-

	厦精密	11月09日		新股限售						
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	网下新股限售	14.23	18.19	125	1,778.75	2,273.75	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	网下新股限售	58.08	57.81	38	2,207.04	2,196.78	-
603075	热威科技股份	2023年09月01日	6个月	网下新股限售	23.10	23.31	94	2,171.40	2,191.14	-
603276	恒兴新材料科技	2023年09月18日	6个月	网下新股限售	25.73	24.88	86	2,212.78	2,139.68	-
603231	索宝蛋白	2023年12月06日	6个月	网下新股限售	21.29	21.53	75	1,596.75	1,614.75	-

注：实际可流通日以该证券公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，预期收益和预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、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、货币市场工具、权证、资产支持证券、银行存款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）。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，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。

本基金的基金管理人建立了由董事会风险控制委员会、经营层投资风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设立投资风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等问题向总经理提供咨询意见和建议；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部和风险管理部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行。对于定期银行存款，本基金通过选择具备适当信用水平的银行作为交易对手、平衡信用风险与投资收益率、综合参考内外部信用评级信息评价及调整投资限额，管理相关信用风险并定期评估减值损失。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	9,103,880.54	12,667,879.04
合计	9,103,880.54	12,667,879.04

注：1、短期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	9,996,393.55
合计	-	9,996,393.55

注：短期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.4 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	10,036,520.00	51,810,354.52
AAA 以下	-	-
未评级	30,196,784.92	36,349,419.19
合计	40,233,304.92	88,159,773.71

注：1、长期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债、政策性金融债、一般中期票据。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的市值未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2023 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足

额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金和存出保证金等生息资产，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年12 月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,799,914.04	-	-	-	4,799,914.04
结算备付金	31,230.76	-	-	-	31,230.76
存出保证金	5,393.38	-	-	-	5,393.38
交易性金融资产	9,103,880.54	30,106,164.81	10,127,140.11	125,252,801.09	174,589,986.55
资产总计	13,940,418.72	30,106,164.81	10,127,140.11	125,252,801.09	179,426,524.73
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	105,289.92	105,289.92
应付托管费	-	-	-	15,041.42	15,041.42
应付销售服务费	-	-	-	4,510.37	4,510.37
应交税费	-	-	-	236.00	236.00
其他负债	-	-	-	178,912.66	178,912.66
负债总计	-	-	-	303,990.37	303,990.37
利率敏感度缺口	13,940,418.72	30,106,164.81	10,127,140.11	124,948,810.72	179,122,534.36

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					
货币资金	2,136,337.95	-	-	-	2,136,337.95
结算备付金	297,511.62	-	-	-	297,511.62
存出保证金	4,484.14	-	-	-	4,484.14
交易性金融资产	35,337,265.47	75,486,780.83	-	142,245,309.88	253,069,356.18
买入返售金融资产	9,992,786.75	-	-	-	9,992,786.75
应收清算款	-	-	-	211,323.69	211,323.69
资产总计	47,768,385.93	75,486,780.83	-	142,456,633.57	265,711,800.33
负债					
卖出回购金融资产款	3,002,252.05	-	-	-	3,002,252.05
应付赎回款	-	-	-	1.57	1.57
应付管理人报酬	-	-	-	155,882.75	155,882.75
应付托管费	-	-	-	22,268.98	22,268.98
应付销售服务费	-	-	-	6,674.45	6,674.45
应交税费	-	-	-	2,261.66	2,261.66
其他负债	-	-	-	198,502.69	198,502.69
负债总计	3,002,252.05	-	-	385,592.10	3,387,844.15
利率敏感度缺口	44,766,133.88	75,486,780.83	-	142,071,041.47	262,323,956.18

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1. 市场利率下降 25 个	367,582.53	560,759.77

	基点		
	2. 市场利率上升 25 个基点	-361, 202. 95	-555, 255. 82

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外币汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种等合计占基金资产的比例为 5%-100%，其中权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%；每个交易日日终，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、存出保证金及应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	125, 252, 801. 09	69. 93	142, 245, 309. 88	54. 23
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	125, 252, 801. 09	69. 93	142, 245, 309. 88	54. 23

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变
----	-------------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1. 沪深 300 指数上升 5%	6,108,174.26	7,362,821.23
2. 沪深 300 指数下降 5%	-6,108,174.26	-7,362,821.23	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	124,311,684.21	141,556,711.29
第二层次	49,500,547.56	110,812,841.22
第三层次	777,754.78	699,803.67
合计	174,589,986.55	253,069,356.18

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	699,803.67	699,803.67
当期购买	-	1,207,201.28	1,207,201.28

当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,148,520.86	1,148,520.86
当期利得或损失总额	-	19,270.69	19,270.69
其中：计入损益的利得或损失	-	19,270.69	19,270.69
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	777,754.78	777,754.78
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	35,118.78	35,118.78
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	3,344,616.53	3,344,616.53
当期购买	-	1,587,277.02	1,587,277.02
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	3,480,975.10	3,480,975.10
当期利得或损失总额	-	-751,114.78	-751,114.78
其中：计入损益的利得或损失	-	-751,114.78	-751,114.78
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	699,803.67	699,803.67
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	15,848.09	15,848.09

注：于报告期末，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于报告期内，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系

限售股票	777,754.78	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	18.55%至 219.88%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	699,803.67	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	17.17%至 274.17%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	125,252,801.09	69.81
	其中：股票	125,252,801.09	69.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	49,337,185.46	27.50
	其中：债券	49,337,185.46	27.50
	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	-	-
	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	4,831,144.80	2.69
8	其他各项资产	5,393.38	0.00
9	合计	179,426,524.73	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,351,315.00	1.87
C	制造业	86,661,157.25	48.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,220,600.00	1.24
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,538,895.87	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	1,071,355.51	0.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	482,022.17	0.27
J	金融业	23,869,742.30	13.33
K	房地产业	4,267,981.00	2.38
L	租赁和商务服务业	10,341.79	0.01
M	科学研究和技术服务业	1,727,263.41	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	12,144.33	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	39,982.46	0.02
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	125,252,801.09	69.93

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	9,500	16,397,000.00	9.15
2	600887	伊利股份	253,700	6,786,475.00	3.79
3	000568	泸州老窖	34,300	6,154,106.00	3.44
4	601318	中国平安	130,600	5,263,180.00	2.94
5	600036	招商银行	179,100	4,982,562.00	2.78
6	002594	比亚迪	22,200	4,395,600.00	2.45
7	601166	兴业银行	264,100	4,281,061.00	2.39
8	600309	万华化学	52,400	4,025,368.00	2.25
9	600660	福耀玻璃	97,300	3,638,047.00	2.03
10	000333	美的集团	65,600	3,583,728.00	2.00
11	000858	五粮液	25,500	3,577,905.00	2.00

12	601088	中国神华	106,900	3,351,315.00	1.87
13	000596	古井贡酒	14,200	3,305,760.00	1.85
14	300750	宁德时代	19,400	3,167,244.00	1.77
15	600276	恒瑞医药	65,400	2,958,042.00	1.65
16	000651	格力电器	83,855	2,697,615.35	1.51
17	000063	中兴通讯	94,000	2,489,120.00	1.39
18	000001	平安银行	256,200	2,405,718.00	1.34
19	000538	云南白药	48,580	2,387,707.00	1.33
20	601939	建设银行	358,900	2,336,439.00	1.30
21	002142	宁波银行	115,230	2,317,275.30	1.29
22	600585	海螺水泥	97,200	2,192,832.00	1.22
23	002415	海康威视	61,800	2,145,696.00	1.20
24	600048	保利发展	211,800	2,096,820.00	1.17
25	000002	万科A	193,100	2,019,826.00	1.13
26	002304	洋河股份	16,600	1,824,340.00	1.02
27	002460	赣锋锂业	41,520	1,777,056.00	0.99
28	603259	药明康德	23,480	1,708,404.80	0.95
29	000895	双汇发展	58,300	1,557,193.00	0.87
30	600056	中国医药	135,060	1,508,620.20	0.84
31	300059	东方财富	102,425	1,438,047.00	0.80
32	600741	华域汽车	84,200	1,370,776.00	0.77
33	300760	迈瑞医疗	4,400	1,278,640.00	0.71
34	600886	国投电力	95,700	1,261,326.00	0.70
35	000513	丽珠集团	28,400	994,284.00	0.56
36	300003	乐普医疗	60,949	984,935.84	0.55
37	600900	长江电力	41,100	959,274.00	0.54
38	002422	科伦药业	30,300	880,215.00	0.49
39	002736	国信证券	99,000	845,460.00	0.47
40	002352	顺丰控股	18,000	727,200.00	0.41
41	000338	潍柴动力	49,600	677,040.00	0.38
42	000425	徐工机械	115,000	627,900.00	0.35
43	601012	隆基绿能	24,156	553,172.40	0.31
44	002001	新和成	32,196	546,044.16	0.30
45	002202	金风科技	65,900	527,200.00	0.29
46	600031	三一重工	33,798	465,398.46	0.26
47	002475	立讯精密	12,000	413,400.00	0.23
48	600009	上海机场	10,400	340,912.00	0.19
49	002007	华兰生物	12,800	283,264.00	0.16
50	688383	新益昌科技	2,701	283,037.79	0.16
51	688347	华虹半导体公司	6,279	264,094.74	0.15
52	002624	完美世界	19,400	229,696.00	0.13
53	688320	禾川科技	5,346	219,186.00	0.12

54	688778	厦钨新能源	4,337	171,918.68	0.10
55	688717	艾罗能源	2,935	163,362.10	0.09
56	688232	国泰新点软件	4,251	153,886.20	0.09
57	002146	荣盛发展	88,500	151,335.00	0.08
58	688626	翔宇医疗	2,270	120,968.30	0.07
59	301487	盟固利	1,073	43,950.08	0.02
60	300896	爱美客	94	27,667.02	0.02
61	301035	润丰股份	378	26,460.00	0.01
62	300999	金龙鱼	757	25,268.66	0.01
63	301269	华大九天	230	24,345.50	0.01
64	301029	怡合达	665	17,143.70	0.01
65	688361	中科飞测	216	16,076.88	0.01
66	300919	中伟股份	308	15,132.04	0.01
67	301293	三博脑科	236	14,731.12	0.01
68	301510	固高科技	396	13,863.96	0.01
69	300973	立高食品	270	13,108.50	0.01
70	688629	四川华丰科技	587	12,855.30	0.01
71	688469	芯联集成	2,443	12,263.86	0.01
72	301172	君逸数码	307	11,715.12	0.01
73	300911	亿田智能	309	11,627.67	0.01
74	688548	广钢气体股份	882	11,245.50	0.01
75	688549	中巨芯科技	1,370	11,083.30	0.01
76	688627	精智达技术	124	10,877.28	0.01
77	300894	火星人	628	10,198.72	0.01
78	301117	佳缘科技	187	10,193.37	0.01
79	688352	颀中科技	650	10,016.50	0.01
80	301370	国科恒泰	625	10,006.25	0.01
81	301499	维科精密	344	9,951.92	0.01
82	301558	三态股份	729	9,768.60	0.01
83	301327	华宝新能	126	9,626.40	0.01
84	301367	怡和嘉业	76	9,253.00	0.01
85	688582	芯动联科	239	9,242.13	0.01
86	301267	华夏眼科	285	9,145.65	0.01
87	301195	北路智控	225	9,130.50	0.01
88	301262	海看股份	291	9,064.65	0.01
89	688591	泰凌微	307	8,602.14	0.00
90	301313	凡拓数创	238	8,582.28	0.00
91	301516	中远通	552	8,561.52	0.00
92	301302	华如科技	333	8,361.63	0.00
93	301122	采纳股份	246	8,329.56	0.00
94	301103	何氏眼科	277	8,304.46	0.00
95	688603	天承科技	112	8,303.68	0.00
96	301507	民生健康	522	8,273.70	0.00

97	688593	新相微	558	8,213.76	0.00
98	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
99	301509	金凯生科	129	8,027.67	0.00
100	688334	西高院	453	7,850.49	0.00
101	688720	艾森股份	157	7,824.88	0.00
102	301060	兰卫医学	587	7,801.23	0.00
103	301261	恒工精密	153	7,780.05	0.00
104	301292	海科新源	396	7,662.60	0.00
105	688146	中船派瑞特气	223	7,584.23	0.00
106	688620	安凯微电子	641	7,576.62	0.00
107	688610	埃科光电	147	7,497.00	0.00
108	688702	盛科通信	155	7,467.90	0.00
109	301121	紫建电子	179	7,439.24	0.00
110	301102	兆讯传媒	386	7,388.04	0.00
111	603296	华勤技术	95	7,386.25	0.00
112	301413	安培龙	125	7,273.75	0.00
113	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
114	688652	京仪装备	139	7,262.75	0.00
115	301251	威尔高	209	7,229.31	0.00
116	301397	溯联股份	157	7,093.26	0.00
117	301511	德福科技	309	7,005.03	0.00
118	301210	金杨股份	154	7,003.92	0.00
119	688433	华曙高科	224	7,000.00	0.00
120	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
121	688653	康希通信	430	6,875.70	0.00
122	301486	致尚科技	145	6,851.25	0.00
123	301272	英华特	128	6,832.64	0.00
124	301469	恒达新材	204	6,750.36	0.00
125	688581	安杰思医学	54	6,739.74	0.00
126	301362	民爆光电	173	6,663.96	0.00
127	301329	信音电子	285	6,335.55	0.00
128	301489	思泉新材	98	6,282.78	0.00
129	301066	万事利	482	6,208.16	0.00
130	301376	致欧科技	259	6,195.28	0.00
131	301393	昊帆生物	104	6,174.48	0.00
132	300614	百川畅银	329	6,162.17	0.00
133	301528	多浦乐	89	6,132.99	0.00
134	301518	长华化学	266	6,120.66	0.00
135	301519	舜禹股份	296	5,982.16	0.00
136	688429	时创能源	281	5,954.39	0.00
137	301202	朗威股份	187	5,946.60	0.00
138	688648	中邮科技	277	5,936.11	0.00
139	301206	三元生物	203	5,862.64	0.00

140	688638	誉辰智能	98	5,848.64	0.00
141	688602	康鹏科技	524	5,795.44	0.00
142	688631	莱斯信息	163	5,745.75	0.00
143	301456	盘古智能	189	5,743.71	0.00
144	301062	上海艾录	523	5,658.86	0.00
145	301568	思泰克	159	5,657.22	0.00
146	301150	中一科技	168	5,587.68	0.00
147	688693	锆威特	128	5,556.48	0.00
148	688716	中研股份	150	5,458.50	0.00
149	301002	崧盛股份	261	5,413.14	0.00
150	301459	丰茂股份	135	5,378.40	0.00
151	601096	宏盛华源铁塔集团	1,261	5,119.66	0.00
152	301529	福赛科技	135	5,113.80	0.00
153	301525	儒竞科技	62	5,050.52	0.00
154	688646	逸飞激光	135	4,869.45	0.00
155	301170	锡南科技	160	4,868.80	0.00
156	688719	爱科赛博	81	4,868.10	0.00
157	301322	绿通科技	116	4,774.56	0.00
158	301500	飞南资源	225	4,700.25	0.00
159	301515	港通医疗	164	4,636.28	0.00
160	301371	敷尔佳	121	4,547.18	0.00
161	688612	威迈斯	116	4,404.52	0.00
162	301559	中集环科	237	4,322.88	0.00
163	301177	迪阿股份	146	4,305.54	0.00
164	301548	崇德科技	72	4,247.28	0.00
165	301520	万邦医药	77	4,060.98	0.00
166	301219	腾远钴业	103	4,055.11	0.00
167	688657	浩辰软件	49	3,833.27	0.00
168	688450	光格科技	100	3,642.00	0.00
169	603270	金帝精密科技股份	117	3,460.86	0.00
170	001239	永达股份	172	3,426.24	0.00
171	001326	联域股份	70	3,404.80	0.00
172	601083	锦江航运	293	3,243.51	0.00
173	603273	天元智能	170	3,224.90	0.00
174	603373	安邦护卫集团股份	85	2,953.75	0.00
175	001328	登康口腔	97	2,746.07	0.00
176	603119	浙江荣泰股份	114	2,721.18	0.00
177	603004	鼎龙科技	87	2,713.53	0.00
178	603275	上海众辰科技	65	2,580.50	0.00
179	001306	夏厦精密	33	2,486.88	0.00

180	603107	上海汽配	125	2,273.75	0.00
181	603062	麦加芯彩	38	2,196.78	0.00
182	603075	热威科技股份	94	2,191.14	0.00
183	603276	恒兴新材料科技	86	2,139.68	0.00
184	603231	索宝蛋白	75	1,614.75	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688347	华虹半导体公司	466,388.00	0.18
2	001286	陕西能源	361,603.20	0.14
3	000568	泸州老窖	210,946.00	0.08
4	688717	艾罗能源	163,362.10	0.06
5	688469	芯联集成	138,978.25	0.05
6	002594	比亚迪	138,042.00	0.05
7	301310	鑫宏业	120,363.92	0.05
8	301317	鑫磊股份	119,100.54	0.05
9	688531	日联科技股份	114,285.00	0.04
10	301303	真兰仪表	113,337.20	0.04
11	000858	五粮液	107,602.00	0.04
12	688610	埃科光电	107,135.13	0.04
13	000596	古井贡酒	105,587.00	0.04
14	688472	阿特斯阳光电力	101,909.10	0.04
15	301322	绿通科技	100,036.93	0.04
16	000333	美的集团	99,154.00	0.04
17	301172	君逸数码	95,963.79	0.04
18	688484	南芯科技	95,176.20	0.04
19	688435	英方软件	93,557.20	0.04
20	301210	金杨股份	89,135.20	0.03

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	001286	陕西能源	541,950.87	0.21
2	688435	英方软件	270,967.40	0.10
3	688506	百利天恒药业	256,096.00	0.10

4	301510	固高科技	245,756.67	0.09
5	301487	盟固利	209,072.16	0.08
6	688549	中巨芯科技	161,457.50	0.06
7	688502	茂莱光学	159,495.00	0.06
8	301516	中远通	156,366.00	0.06
9	688439	振华风光	155,044.10	0.06
10	301507	民生健康	154,531.30	0.06
11	688347	华虹半导体公司	146,067.00	0.06
12	301317	鑫磊股份	143,422.36	0.05
13	301303	真兰仪表	141,758.85	0.05
14	301511	德福科技	137,363.80	0.05
15	301555	惠柏新材	136,751.00	0.05
16	301558	三态股份	134,480.00	0.05
17	688361	中科飞测	133,738.19	0.05
18	301172	君逸数码	131,957.28	0.05
19	301499	维科精密	129,660.48	0.05
20	688469	芯联集成	126,408.50	0.05

注：卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	11,857,187.18
卖出股票收入（成交）总额	14,668,186.55

注：买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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	39,300,665.46	21.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,036,520.00	5.60
	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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	49,337,185.46	27.54

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	230027	23 附息国债 27	200,000	20,069,644.81	11.20
2	230026	23 附息国债 26	100,000	10,127,140.11	5.65
3	2228050	22 光大银行	100,000	10,036,520.00	5.60
4	019709	23 国债 16	50,000	5,026,164.38	2.81
5	019694	23 国债 01	40,000	4,077,716.16	2.28

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

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

1. 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。

本基金对招商银行所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司投资制度的要求。

2. 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。

本基金对兴业银行所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司投资制度的要求。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,393.38
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,393.38

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户	户均持有的基	持有人结构
------	------	--------	-------

	数（户）	金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
前海联合新思路混合 A	354	166.54	-	-	58,954.36	100%
前海联合新思路混合 C	74	1,621,234.37	119,966,416.49	100.00%	4,927.06	0.00%
合计	404	297,104.70	119,966,416.49	99.95%	63,881.42	0.05%

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	前海联合新思路混合 A	562.91	0.9548%
	前海联合新思路混合 C	93.30	0.0001%
	合计	656.21	0.0005%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

不存在本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人以及本基金基金经理持有本开放式基金的情况。

§ 10 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
基金合同生效日（2016 年 11 月 11 日）基金份额总额	200,172.01	200,581,971.61
本报告期初基金份额总额	167,768.97	166,862,010.93
本报告期基金总申购份额	1,671.96	817.30
减：本报告期基金总赎回份额	110,486.57	46,891,484.68
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	58,954.36	119,971,343.55

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

无。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、本报告期内，基金管理人无重大人事变动。
- 2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计服务的会计师事务所为致同会计师事务所（特殊普通合伙），本年度应支付的审计费用为 40,000.00 元。该事务所自 2021 年 5 月 28 日起为本基金提供审计服务至今，本报告期内无改聘会计师事务所的事项。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

华创证券 有限责任公司	2	8,601,118.25	52.58%	8,061.90	55.90%	-
国盛证券 有限责任公司	1	3,172,318.76	19.39%	2,320.28	16.09%	-
兴业证券 股份有限公司	1	2,703,535.00	16.53%	2,535.56	17.58%	-
中信建投 证券股份 有限公司	1	913,622.79	5.58%	668.12	4.63%	-
广发证券 股份有限 公司	1	622,128.14	3.80%	579.39	4.02%	-
民生证券 股份有限 公司	1	332,255.72	2.03%	242.98	1.68%	-
国投证券 股份有限 公司	1	14,218.89	0.09%	13.45	0.09%	-
东兴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
五矿证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
华金证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了《交易单元及券商研究服务评价管理办法》：

（1）券商选择标准：

- 1）实力雄厚，信誉良好；内部管理规范，严格；注册资本符合证监会相关要求；
- 2）研究实力较强，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；

3) 券商利用其他专业研究咨询机构为公司提供研究与支持服务的, 对该券商研究方面的要求按照上述第 2 点规定执行;

(2) 券商选择程序:

- 1) 券商研究质量与研究服务评价;
- 2) 拟定租用对象。由研究发展部根据券商选择标准拟定备选的券商;
- 3) 上报批准。研究发展部将拟定租用对象上报分管领导批准;
- 4) 签约。在获得批准后, 按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

2. 本报告期内, 新租交易单元: 民生证券股份有限公司(1 个), 退租交易单元: 东兴证券股份有限公司(1 个)。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华创证券有限责任公司	50,335,250.13	33.18%	95,663,000.00	36.58%	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	29,432,240.00	19.40%	22,000,000.00	8.41%	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	50,752,046.03	33.46%	121,800,000.00	46.58%	-	-	-	-
中信	10,087,384.42	6.65%	13,047,000.00	4.99%	-	-	-	-

建投 证券 股份 有限 公司								
广发 证券 股份 有限 公司	1,009,700.00	0.67%	9,000,000.00	3.44%	-	-	-	-
民生 证券 股份 有限 公司	10,085,563.01	6.65%	-	-	-	-	-	-
国投 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿 证券 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华金 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第四季度报告及提示性公告	证券日报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023-01-28
2	新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告及提示性公告	证券日报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023-03-30
3	新疆前海联合基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件及完善身份信息公告的公告	证券日报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023-04-18
4	新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第一季度报告及提示性公告	证券日报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023-04-22
5	新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第二季度报告及提示性公告	证券日报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023-07-21
6	新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告及提示性公告	证券日报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023-08-30
7	新疆前海联合基金管理有限公司关于终止南京途牛基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	证券日报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023-09-15
8	新疆前海联合基金管理有限公司关于北京分公司营业场所变更的公告	证券日报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023-09-21
9	新疆前海联合基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的公告	证券日报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023-09-26
10	新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第三季度报告及提示性公告	证券日报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023-10-25
11	新疆前海联合基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	证券日报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023-11-22

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20230825-20231231	29,703,738.79	-	-	29,703,738.79	24.75%
	2	20230830-20231231	29,536,887.68	-	-	29,536,887.68	24.61%
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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证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。

13.2 存放地点

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

13.3 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

二〇二四年三月三十日