

# 前海开源鼎安债券型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 08 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 2024 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|      |                                     |    |
|------|-------------------------------------|----|
| § 1  | 重要提示及目录                             | 2  |
| 1.1  | 重要提示                                | 2  |
| 1.2  | 目录                                  | 3  |
| § 2  | 基金简介                                | 5  |
| 2.1  | 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2  | 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3  | 基金管理人和基金托管人                         | 6  |
| 2.4  | 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5  | 其他相关资料                              | 6  |
| § 3  | 主要财务指标和基金净值表现                       | 7  |
| 3.1  | 主要会计数据和财务指标                         | 7  |
| 3.2  | 基金净值表现                              | 7  |
| § 4  | 管理人报告                               | 9  |
| 4.1  | 基金管理人及基金经理情况                        | 9  |
| 4.2  | 管理人对报告期内本基金运作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                 | 11 |
| 4.4  | 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 11 |
| 4.5  | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12 |
| 4.6  | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12 |
| 4.7  | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 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       | 13 |
| § 5  | 托管人报告                               | 13 |
| 5.1  | 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 13 |
| 5.2  | 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13 |
| 5.3  | 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 13 |
| § 6  | 半年度财务会计报告（未经审计）                     | 13 |
| 6.1  | 资产负债表                               | 13 |
| 6.2  | 利润表                                 | 15 |
| 6.3  | 净资产变动表                              | 16 |
| 6.4  | 报表附注                                | 17 |
| § 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                    | 37 |
| 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       | 38 |
| 7.4  | 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 38 |
| 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   | 40 |
| 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   | 40 |
| 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      | 40 |
| 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 .....                     | 42 |
| 8.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....             | 42 |
| 8.2  | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 42 |
| 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 .....  | 43 |
| § 9  | 开放式基金份额变动 .....                     | 43 |
| § 10 | 重大事件揭示 .....                        | 43 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 .....                   | 43 |
| 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 .....   | 43 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 44 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 .....                     | 44 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 44 |
| 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 .....      | 44 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 44 |
| 10.8 | 其他重大事件 .....                        | 46 |
| § 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 .....                | 47 |
| § 12 | 备查文件目录 .....                        | 47 |
| 12.1 | 备查文件目录 .....                        | 47 |
| 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      | 24,259,680.60 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 | 9,318,586.07 份   | 14,941,094.53 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</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>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   | 张姗                          |
|         | 联系电话 | 0755-88601888                                 | 400-61-95555                |
|         | 电子邮箱 | qhky@qhkyfund.com                             | zhangshan_1027@cmbchina.com |
| 客户服务电话  |      | 4001-666-998                                  | 400-61-95555                |
| 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（2024年01月01日至2024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       | -217,211.86                  | -261,731.17   |
| 本期利润          | 110,315.82                   | 491,644.18    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0084                       | 0.0227        |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.67%                        | 1.85%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.11%                        | 0.89%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2024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      | 1,552,403.18                 | 2,055,934.33  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1666                       | 0.1376        |
| 期末基金资产净值      | 11,871,508.73                | 18,574,654.44 |
| 期末基金份额净值      | 1.274                        | 1.243         |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末（2024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   | 27.40%                       | 24.30%        |

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 | 0.24%    | 0.18%       | 0.25%      | 0.05%         | -0.01% | 0.13% |
| 过去三个月 | 1.84%    | 0.17%       | 0.75%      | 0.07%         | 1.09%  | 0.10% |
| 过去六个月 | 1.11%    | 0.22%       | 2.31%      | 0.09%         | -1.20% | 0.13% |
| 过去一年  | -1.32%   | 0.37%       | 1.96%      | 0.09%         | -3.28% | 0.28% |
| 过去三年  | 0.47%    | 0.33%       | 2.00%      | 0.11%         | -1.53% | 0.22% |

|            |        |       |       |       |        |       |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 27.40% | 0.27% | 9.18% | 0.12% | 18.22% | 0.15% |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|

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%    | 0.19%       | 0.25%      | 0.05%         | -0.09% | 0.14% |
| 过去三个月      | 1.72%    | 0.17%       | 0.75%      | 0.07%         | 0.97%  | 0.10% |
| 过去六个月      | 0.89%    | 0.22%       | 2.31%      | 0.09%         | -1.42% | 0.13% |
| 过去一年       | -1.74%   | 0.37%       | 1.96%      | 0.09%         | -3.70% | 0.28% |
| 过去三年       | -0.72%   | 0.33%       | 2.00%      | 0.11%         | -2.72% | 0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 24.30%   | 0.27%       | 9.18%      | 0.12%         | 15.12% | 0.15% |

### 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投资合伙企业(有限合伙)各持股 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 96 只开放式基金，资产管理规模超过 949 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、公司金融工程部负责人 | 2021 年 06 月 24 日 | 2024 年 01 月 09 日 | 13 年   | 陆琦先生，南京大学硕士。2011 年至 2015 年任南方基金管 |

|    |          |                  |   |      |  |
|----|----------|------------------|---|------|--|
|    |          |                  |   |      | 理股份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负责人、基金经理。  |
| 史延 | 本基金的基金经理 | 2024 年 01 月 09 日 | - | 11 年 | 史延女士，北京航空航天大学硕士。历任东方金诚国际信用评估有限公司中小企业部分析师、联合资信评估股份有限公司工商企业部分析师、众安在线财产保险股份有限公司阿里事业部产品经理；2016 年 6 月加盟前海开源基金管理有限公司，历任固收研究员，现任公司基金经理。 |
| 田维 | 本基金的基金经理 | 2024 年 01 月 09 日 | - | 7 年  | 田维先生，北京大学硕士。2016 年 7 月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司基金经理。   |

注：①对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

③自 2024 年 1 月 9 日起，基金管理人增聘史延、田维为本基金的基金经理，陆琦不再担任本基金的基金经理。

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

投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

固定收益方面，报告期内经济增长、流动性、机构行为、风险偏好是影响债市走势的关键因素。具体来看：1-2 月，由于融资增速延续下行，且风险资产弱势，债市整体较为强势，超长期利率债、高等级信用债等高票息资产更为强势。进入 3 月，随着经济数据回暖，债市由单边下行转为震荡，波动明显加大。4 月初，市场对长久期利率债趋于谨慎，而由于跨季后资金较为宽松，中短久期利率债表现明显强势。此外，配置需求对债券类资产走势也有很大的影响，非银配置需求强劲，各类利差压缩至低位。4 月 24 日后，由于地产销售跌幅收窄，债市出现了较大幅度的调整，信用债调整幅度明显大于利率债。之后随着市场修复，负反馈担忧解除，加上配置需求仍然强劲，信用债重新走强。5 月后，虽然地产政策持续出台，但在基本面数据偏弱、流动性宽松、机构配置需求较强的共同作用下，债市延续强势，信用利差收窄至历史低位。整体看，上半年债券市场走势较强。

操作上，组合投资以债券为主，上半年组合持仓主要为利率债和偏债型可转债，组合久期整体维持在市场中性水平，根据市场情况调整优化持有债券品种的结构。

权益方面，报告期内，国内外宏观环境仍然较为复杂。国内方面，上半年经济景气前高后低，物价低位运行，整体呈现供强需弱，外需强于内需的格局。国际方面，美国经济数据逐步走弱，但通胀仍然顽固，降息预期一再推迟。市场方面，报告期内 A 股市场整体呈现震荡态势，沪深 300 指数上涨 0.89%。从板块上看，红利和科技类资产表现较好。

报告期内，权益的整体投资思路是按照“高质量发展”的内涵，重点配置于竞争格局优化、自

由现金流强劲、股东回报提升的优质企业。

#### 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 1.274 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.11%，同期业绩比较基准收益率为 2.31%；截至报告期末前海开源鼎安债券 C 基金份额净值为 1.243 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.89%，同期业绩比较基准收益率为 2.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，固定收益方面，经济新旧动能转换，对融资的依赖逐步下降，债券收益率有望继续下行。长期来看，债券收益率趋于下行，但中期内，社融增速仍是影响债市短期走势的关键因素。考虑到金融挤水分仍在继续，但随着时间推移，金融挤水分对社融增速的影响可能会趋于弱化，社融增速可能会在 3 季度见底。另外，因 6 月份社融增速已较低，即使 3 季度金融挤水分导致社融增速进一步下行，空间也比较有限。未来，债券收益率下行的速度大概率放缓，且波动可能加大。

权益方面，我们预计未来仍要面临复杂多变的外部环境，尤其地缘环境的不确定性在明显增加。但随着国内地产接近筑底，海外降息周期临近，积极因素也在不断累积，我们认为仍有结构性机会可以把握。我们的整体投资思路仍将聚焦“高质量发展”，寻找优质标的，力求为投资者带来稳健可持续的回报。

#### 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，估值委员会成员包含投资、研究、会计和风控等岗位资深人员，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的情形。

本基金从 2023 年 10 月 24 日至 2024 年 01 月 09 日连续 55 个工作日、从 2024 年 01 月 17 日至 2024 年 03 月 29 日连续 47 个工作日基金资产净值低于五千万元。

## § 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：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资产   | 附注号     | 本期末<br>2024 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产：  |         |                         |                          |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 155,336.46              | 834,723.37               |

|               |            |                    |                    |
|---------------|------------|--------------------|--------------------|
| 结算备付金         |            | 100,383.23         | 224,100.23         |
| 存出保证金         |            | 12,505.70          | 10,466.05          |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 30,005,298.14      | 38,048,690.86      |
| 其中：股票投资       |            | 5,243,529.30       | 7,416,069.92       |
| 基金投资          |            | -                  | -                  |
| 债券投资          |            | 24,761,768.84      | 30,632,620.94      |
| 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         |            | 448,062.31         | 1,750,481.32       |
| 应收股利          |            | -                  | -                  |
| 应收申购款         |            | 1,037.93           | 1,054.15           |
| 递延所得税资产       |            | -                  | -                  |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                  | -                  |
| 资产总计          |            | 30,722,623.77      | 40,869,515.98      |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末</b>         | <b>上年度末</b>        |
|               |            | <b>2024年06月30日</b> | <b>2023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     |            | -                  | 1,999,871.59       |
| 应付清算款         |            | -                  | 375,127.17         |
| 应付赎回款         |            | 185,352.23         | 734,441.32         |
| 应付管理人报酬       |            | 23,965.70          | 22,935.18          |
| 应付托管费         |            | 3,423.67           | 3,276.43           |
| 应付销售服务费       |            | 8,397.55           | 6,674.93           |
| 应付投资顾问费       |            | -                  | -                  |
| 应交税费          |            | 39.55              | 914.03             |
| 应付利润          |            | -                  | -                  |
| 递延所得税负债       |            | -                  | -                  |
| 其他负债          | 6.4.7.6    | 55,281.90          | 97,754.18          |
| 负债合计          |            | 276,460.60         | 3,240,994.83       |
| <b>净资产：</b>   |            |                    |                    |
| 实收基金          | 6.4.7.7    | 24,259,680.60      | 30,208,946.27      |
| 未分配利润         | 6.4.7.8    | 6,186,482.57       | 7,419,574.88       |
| 净资产合计         |            | 30,446,163.17      | 37,628,521.15      |
| 负债和净资产总计      |            | 30,722,623.77      | 40,869,515.98      |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，前海开源鼎安债券基金份额总额 24,259,680.60 份，其中，前海开源鼎安债券 A 类基金份额净值 1.274 元，基金份额总额 9,318,586.07 份；前海开源鼎安债

券 C 类基金份额净值 1.243 元，基金份额总额 14,941,094.53 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：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号        | 本期<br>2024 年 01 月 01<br>日至 2024 年 06<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 01 月 01<br>日至 2023 年 06 月<br>30 日 |
|----------------------------|------------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>             |            | 884,854.00                                     | 632,823.68  |
| 1. 利息收入                    |            | 6,232.90                                       | 3,324.94  |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.9    | 6,232.90                                       | 3,324.94  |
| 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                 |            | -  | -   |
| 其他利息收入                     |            | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | -211,285.00                                    | -660,659.62   |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.10   | -317,670.09                                    | -970,405.10   |
| 基金投资收益                     | 6.4.7.11   | -  | -   |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.12   | 45,345.28                                      | 216,330.90  |
| 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   | 61,039.81                                      | 93,414.58   |
| 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   | 1,080,903.03                                   | 1,289,572.78  |
| 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   | 9,003.07                                       | 585.58  |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 282,894.00                                     | 442,326.69  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 149,897.73                                     | 211,868.62  |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 21,414.02                                      | 30,266.84   |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 52,971.70                                      | 45,736.70   |
| 4. 投资顾问费                   |            | -  | -   |
| 5. 利息支出                    |            | 3,006.28                                       | 72,426.64   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 3,006.28                                       | 72,426.64   |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.19   | -  | -   |
| 7. 税金及附加                   |            | 41.29  | 201.06  |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 55,562.98                                      | 81,826.83   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 601,960.00                                     | 190,496.99  |
| 减：所得税费用                    |            | -  | -   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 601,960.00                                     | 190,496.99  |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -  | -   |

|          |  |            |            |
|----------|--|------------|------------|
| 六、综合收益总额 |  | 601,960.00 | 190,496.99 |
|----------|--|------------|------------|

### 6.3 净资产变动表

会计主体：前海开源鼎安债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日      |               |                |
|--|---|---------------|----------------|
|  | 实收基金  | 未分配<br>利润     | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产                                | 30,208,946.27                                 | 7,419,574.88  | 37,628,521.15  |
| 二、本期期初净资产                                | 30,208,946.27                                 | 7,419,574.88  | 37,628,521.15  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -5,949,265.67                                 | -1,233,092.31 | -7,182,357.98  |
| （一）、综合收益总额                               | -   | 601,960.00    | 601,960.00     |
| （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）      | -5,949,265.67                                 | -1,835,052.31 | -7,784,317.98  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 30,298,640.17                                 | 6,585,871.06  | 36,884,511.23  |
| 2. 基金赎回款                                 | -36,247,905.84                                | -8,420,923.37 | -44,668,829.21 |
| （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                                | 24,259,680.60                                 | 6,186,482.57  | 30,446,163.17  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |               |                |
|  | 实收基金  | 未分配<br>利润     | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产                                | 50,647,317.54                                 | 14,141,319.92 | 64,788,637.46  |
| 二、本期期初净资产                                | 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净资产变动数（净资产减少以“-”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净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -   | -             | -              |
| 四、本期期末净资产                                | 44,239,975.07                                 | 12,411,690.20 | 56,651,665.27  |

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

基金管理人负责人

王厚琼

主管会计工作负责人

傅智

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。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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2024 年 06 月 30 日 |            |
|----------------|-------------------------|------------|
|                | 活期存款                    |            |
| 等于：本金          |                         | 155,304.43 |
| 加：应计利息         |                         | 32.03      |
| 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             |                         | 155,336.46 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2024 年 06 月 30 日 |               |               |               |            |
|---------------|-------------------------|---------------|---------------|---------------|------------|
|               | 成本                      | 应计利息          | 公允价值          | 公允价值变动        |            |
| 股票            | 4,677,683.71            | -             | 5,243,529.30  | 565,845.59    |            |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                       | -             | -             | -             |            |
| 债券            | 交易所市场                   | 24,301,347.72 | 197,536.04    | 24,761,768.84 | 262,885.08 |
|               | 银行间市场                   | -             | -             | -             | -          |
|               | 合计                      | 24,301,347.72 | 197,536.04    | 24,761,768.84 | 262,885.08 |
| 资产支持证券        | -                       | -             | -             | -             |            |
| 基金            | -                       | -             | -             | -             |            |
| 其他            | -                       | -             | -             | -             |            |
| 合计            | 28,979,031.43           | 197,536.04    | 30,005,298.14 | 828,730.67    |            |

#### 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<br>2024年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | 139.17             |
| 应付证券出借违约金   | -                  |
| 应付交易费用      | 10,292.11          |
| 其中：交易所市场    | 10,292.11          |
| 银行间市场       | -                  |
| 应付利息        | -                  |
| 预提费用        | 44,850.62          |
| 合计          | 55,281.90          |

## 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<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |               |
|---------------|-------------------------------|---------------|
|               | 基金份额（份）                       | 账面金额          |
| 上年度末          | 14,399,413.15                 | 14,399,413.15 |
| 本期申购          | 1,414,357.31                  | 1,414,357.31  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -6,495,184.39                 | -6,495,184.39 |
| 本期末           | 9,318,586.07                  | 9,318,586.07  |

前海开源鼎安债券 C

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |                |
|---------------|-------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                       | 账面金额           |
| 上年度末          | 15,809,533.12                 | 15,809,533.12  |
| 本期申购          | 28,884,282.86                 | 28,884,282.86  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -29,752,721.45                | -29,752,721.45 |
| 本期末           | 14,941,094.53                 | 14,941,094.53  |

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       |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 上年度末           | 2,559,188.21  | 1,189,736.25 | 3,748,924.46  |
| 本期期初           | 2,559,188.21  | 1,189,736.25 | 3,748,924.46  |
| 本期利润           | -217,211.86   | 327,527.68   | 110,315.82    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -789,573.17   | -516,744.45  | -1,306,317.62 |
| 其中：基金申购款       | 219,815.19    | 165,970.73   | 385,785.92    |
| 基金赎回款          | -1,009,388.36 | -682,715.18  | -1,692,103.54 |
| 本期已分配利润        | -             | -            | -             |
| 本期末            | 1,552,403.18  | 1,000,519.48 | 2,552,922.66  |

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       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | 2,383,858.16  | 1,286,792.26  | 3,670,650.42  |
| 本期期初           | 2,383,858.16  | 1,286,792.26  | 3,670,650.42  |
| 本期利润           | -261,731.17   | 753,375.35    | 491,644.18    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -66,192.66    | -462,542.03   | -528,734.69   |
| 其中：基金申购款       | 3,682,248.42  | 2,517,836.72  | 6,200,085.14  |
| 基金赎回款          | -3,748,441.08 | -2,980,378.75 | -6,728,819.83 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 2,055,934.33  | 1,577,625.58  | 3,633,559.91  |

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                      |
|-----------|-------------------------|
|           | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 活期存款利息收入  | 4,498.46                |
| 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 | 1,639.78                |
| 其他        | 94.66                   |
| 合计        | 6,232.90                |

## 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                      |
|------------|-------------------------|
|            | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 卖出股票成交总额   | 23,503,378.70           |
| 减：卖出股票成本总额 | 23,774,276.55           |
| 减：交易费用     | 46,772.24               |

|          |             |
|----------|-------------|
| 买卖股票差价收入 | -317,670.09 |
|----------|-------------|

#### 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<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |
|----------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益--利息收入                     | 301,536.13                    |
| 债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付）<br>差价收入 | -256,190.85                   |
| 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                               | 45,345.28                     |

##### 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<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 173,523,257.24                |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 172,568,320.68                |
| 减：应计利息总额               | 1,206,256.38                  |
| 减：交易费用                 | 4,871.03                      |
| 买卖债券差价收入               | -256,190.85                   |

#### 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                      |
|---------------|-------------------------|
|               | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 61,039.81               |
| 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            | 61,039.81               |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                      |
|------------------------|-------------------------|
|                        | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 1. 交易性金融资产             | 1,080,903.03            |
| --股票投资                 | 788,029.85              |
| --债券投资                 | 292,873.18              |
| --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                     | 1,080,903.03            |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                      |
|---------|-------------------------|
|         | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 基金赎回费收入 | 8,999.93                |
| 转换费收入   | 3.14                    |



|    |          |
|----|----------|
| 合计 | 9,003.07 |
|----|----------|

#### 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                      |
|---------|-------------------------|
|         | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 审计费用    | 18,223.66               |
| 信息披露费   | 17,626.96               |
| 证券出借违约金 | -                       |
| 汇划手续费   | 1,112.36                |
| 账户维护费   | 18,000.00               |
| 其他      | 600.00                  |
| 合计      | 55,562.98               |

#### 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<br>2024年01月01日至<br>2024年06月30日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至<br>2023年06月30日 |
|------------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 149,897.73                        | 211,868.62                             |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 35,353.96                         | 39,968.21                              |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 114,543.77                        | 171,900.41                             |

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<br>2024年01月01日至2024年<br>06月30日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023<br>年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 21,414.02                         | 30,266.84                              |

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<br>2024年01月01日至2024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<br>A                      | 前海开源鼎安债<br>券C | 合计        |
| 前海开源基金         | -                                  | 23,965.22     | 23,965.22 |
| 招商银行           | -                                  | 884.88        | 884.88    |
| 开源证券           | -                                  | 14,035.74     | 14,035.74 |
| 合计             | -                                  | 38,885.84     | 38,885.84 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>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<br>A                      | 前海开源鼎安债<br>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 |

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                            |
|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|
|                                  | 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 | 2023 年 01 月 01 日至 2023 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                       |
| 报告期间申购/买入总份额                     | -                                  | -                                  |
| 报告期间因拆分变动份额                      | -                                  | -                                  |
| 减：报告期间赎回/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              | 65.30%                             | 55.20%                             |

## 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                            |          |
|-------|------------------------------------|----------|------------------------------------|----------|
|       | 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |          | 2023 年 01 月 01 日至 2023 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  | 155,336.46                         | 4,498.46 | 434,573.77                         | 1,272.87 |

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 2024 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

无。

#### 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，参见附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 1,730,923.70            | 2,434,073.42             |
| 合计     | 1,730,923.70            | 2,434,073.42             |

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

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2024 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 8,562,035.24            | 9,896,603.46             |
| AAA 以下 | 2,086,260.90            | 18,301,944.06            |
| 未评级    | 12,382,549.00           | -                        |

|    |               |               |
|----|---------------|---------------|
| 合计 | 23,030,845.14 | 28,198,547.52 |
|----|---------------|---------------|

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。

本报告期末，除卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的

开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本报告期末，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。本报告期末，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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024 年 06 月 30<br>日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|----------------------------|-------|-------|-------|-----|----|
| 资产                         |       |       |       |     |    |



|                  |              |               |               |              |               |
|------------------|--------------|---------------|---------------|--------------|---------------|
| 货币资金             | 155,336.46   | -             | -             | -            | 155,336.46    |
| 结算备付金            | 100,383.23   | -             | -             | -            | 100,383.23    |
| 存出保证金            | 12,505.70    | -             | -             | -            | 12,505.70     |
| 交易性金融资产          | 1,730,923.70 | 10,648,296.14 | 12,382,549.00 | 5,243,529.30 | 30,005,298.14 |
| 衍生金融资产           | -            | -             | -             | -            | -             |
| 买入返售金融资产         | -            | -             | -             | -            | -             |
| 应收清算款            | -            | -             | -             | 448,062.31   | 448,062.31    |
| 应收股利             | -            | -             | -             | -            | -             |
| 应收申购款            | -            | -             | -             | 1,037.93     | 1,037.93      |
| 递延所得税资产          | -            | -             | -             | -            | -             |
| 其他资产             | -            | -             | -             | -            | -             |
| 资产总计             | 1,999,149.09 | 10,648,296.14 | 12,382,549.00 | 5,692,629.54 | 30,722,623.77 |
| 负债               | -            | -             | -             | -            | -             |
| 短期借款             | -            | -             | -             | -            | -             |
| 交易性金融负债          | -            | -             | -             | -            | -             |
| 衍生金融负债           | -            | -             | -             | -            | -             |
| 卖出回购金融资产款        | -            | -             | -             | -            | -             |
| 应付清算款            | -            | -             | -             | -            | -             |
| 应付赎回款            | -            | -             | -             | 185,352.23   | 185,352.23    |
| 应付管理人报酬          | -            | -             | -             | 23,965.70    | 23,965.70     |
| 应付托管费            | -            | -             | -             | 3,423.67     | 3,423.67      |
| 应付销售服务费          | -            | -             | -             | 8,397.55     | 8,397.55      |
| 应付投资顾问费          | -            | -             | -             | -            | -             |
| 应交税费             | -            | -             | -             | 39.55        | 39.55         |
| 应付利润             | -            | -             | -             | -            | -             |
| 递延所得税负债          | -            | -             | -             | -            | -             |
| 其他负债             | -            | -             | -             | 55,281.90    | 55,281.90     |
| 负债总计             | -            | -             | -             | 276,460.60   | 276,460.60    |
| 利率敏感度缺口          | 1,999,149.09 | 10,648,296.14 | 12,382,549.00 | 5,416,168.94 | 30,446,163.17 |
| 上年度末             |              |               |               |              |               |
| 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             | 834,723.37   | -             | -             | -            | 834,723.37    |
| 结算备付金            | 224,100.23   | -             | -             | -            | 224,100.23    |
| 存出保证金            | 10,466.05    | -             | -             | -            | 10,466.05     |
| 交易性金融资产          | 2,434,073.42 | 23,898,626.79 | 4,299,920.73  | 7,416,069.92 | 38,048,690.86 |
| 衍生金融资产           | -            | -             | -             | -            | -             |
| 买入返售金融资产         | -            | -             | -             | -            | -             |
| 应收清算款            | -            | -             | -             | 1,750,481.32 | 1,750,481.32  |

|           |              |               |              |              |               |
|-----------|--------------|---------------|--------------|--------------|---------------|
| 应收股利      | -            | -             | -            | -            | -             |
| 应收申购款     | -            | -             | -            | 1,054.15     | 1,054.15      |
| 递延所得税资产   | -            | -             | -            | -            | -             |
| 其他资产      | -            | -             | -            | -            | -             |
| 资产总计      | 3,503,363.07 | 23,898,626.79 | 4,299,920.73 | 9,167,605.39 | 40,869,515.98 |
| 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 | 1,999,871.59 | -             | -            | -            | 1,999,871.59  |
| 应付清算款     | -            | -             | -            | 375,127.17   | 375,127.17    |
| 应付赎回款     | -            | -             | -            | 734,441.32   | 734,441.32    |
| 应付管理人报酬   | -            | -             | -            | 22,935.18    | 22,935.18     |
| 应付托管费     | -            | -             | -            | 3,276.43     | 3,276.43      |
| 应付销售服务费   | -            | -             | -            | 6,674.93     | 6,674.93      |
| 应付投资顾问费   | -            | -             | -            | -            | -             |
| 应交税费      | -            | -             | -            | 914.03       | 914.03        |
| 应付利润      | -            | -             | -            | -            | -             |
| 递延所得税负债   | -            | -             | -            | -            | -             |
| 其他负债      | -            | -             | -            | 97,754.18    | 97,754.18     |
| 负债总计      | 1,999,871.59 | -             | -            | 1,241,123.24 | 3,240,994.83  |
| 利率敏感度缺口   | 1,503,491.48 | 23,898,626.79 | 4,299,920.73 | 7,926,482.15 | 37,628,521.15 |

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（2024年06月30日）            | 上年度末（2023年12月31日） |
|    | 市场利率下降25个基点        | 297,581.41                  | 1,906.76          |
|    | 市场利率上升25个基点        | -288,563.97                 | -1,903.78         |

#### 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<br>2024年06月30日 |                  | 上年度末<br>2023年12月31日 |                  |
|---------------|--------------------|------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值               | 占基金资产净值<br>比例(%) | 公允价值                | 占基金资产净<br>值比例(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 5,243,529.30       | 17.22            | 7,416,069.92        | 19.71            |
| 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            | 5,243,529.30       | 17.22            | 7,416,069.92        | 19.71            |

#### 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（2024年06月30日）            | 上年度末（2023年12月31日） |
|            | 业绩比较基准上升5%           | 80,715.73                   | 420,128.91        |
| 业绩比较基准下降5% | -80,715.73           | -420,128.91                 |                   |

### 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<br>2024年06月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | 15,891,825.44      | 35,614,617.44       |
| 第二层次          | 14,113,472.70      | 2,434,073.42        |
| 第三层次          | -                  | -                   |
| 合计            | 30,005,298.14      | 38,048,690.86       |

##### 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2024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(2023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              | 5,243,529.30  | 17.07         |
|    | 其中：股票             | 5,243,529.30  | 17.07         |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 24,761,768.84 | 80.60         |
|    | 其中：债券             | 24,761,768.84 | 80.60         |
|    | 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      | 255,719.69    | 0.83          |
| 8  | 其他各项资产            | 461,605.94    | 1.50          |
| 9  | 合计                | 30,722,623.77 | 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              | 826,241.00   | 2.71          |
| C  | 制造业              | 224,137.00   | 0.74          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,634,889.30 | 11.94         |
| E  | 建筑业              | -            | -             |
| F  | 批发和零售业           | -            | -             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -            | -             |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -            | -             |
| J  | 金融业              | 558,262.00   | 1.83          |
| K  | 房地产业             | -            | -             |
| L  | 租赁和商务服务业         | -            | -             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -            | -             |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -            | -             |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -            | -             |
| P  | 教育               | -            | -             |
| Q  | 卫生和社会工作          | -            | -             |

|   |           |              |       |
|---|-----------|--------------|-------|
| R | 文化、体育和娱乐业 | -            | -     |
| S | 综合        | -            | -     |
|   | 合计        | 5,243,529.30 | 17.22 |

### 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  | 600900 | 长江电力 | 23,600  | 682,512.00 | 2.24         |
| 2  | 600674 | 川投能源 | 34,400  | 645,000.00 | 2.12         |
| 3  | 600795 | 国电电力 | 99,500  | 596,005.00 | 1.96         |
| 4  | 003816 | 中国广核 | 125,500 | 581,065.00 | 1.91         |
| 5  | 600886 | 国投电力 | 31,400  | 572,736.00 | 1.88         |
| 6  | 601985 | 中国核电 | 52,305  | 557,571.30 | 1.83         |
| 7  | 601899 | 紫金矿业 | 18,100  | 318,017.00 | 1.04         |
| 8  | 601088 | 中国神华 | 4,400   | 195,228.00 | 0.64         |
| 9  | 601398 | 工商银行 | 34,100  | 194,370.00 | 0.64         |
| 10 | 601939 | 建设银行 | 24,900  | 184,260.00 | 0.61         |
| 11 | 601288 | 农业银行 | 41,200  | 179,632.00 | 0.59         |
| 12 | 601857 | 中国石油 | 15,300  | 157,896.00 | 0.52         |
| 13 | 600938 | 中国海油 | 4,700   | 155,100.00 | 0.51         |
| 14 | 000683 | 远兴能源 | 13,300  | 91,903.00  | 0.30         |
| 15 | 000333 | 美的集团 | 1,300   | 83,850.00  | 0.28         |
| 16 | 300181 | 佐力药业 | 3,200   | 48,384.00  | 0.16         |

### 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  | 001965 | 招商公路 | 1,803,706.02 | 4.79           |
| 2  | 600900 | 长江电力 | 1,523,242.00 | 4.05           |
| 3  | 601899 | 紫金矿业 | 1,372,284.00 | 3.65           |
| 4  | 600795 | 国电电力 | 1,043,316.00 | 2.77           |
| 5  | 003816 | 中国广核 | 952,669.00   | 2.53           |
| 6  | 601985 | 中国核电 | 850,746.00   | 2.26           |
| 7  | 600674 | 川投能源 | 779,078.00   | 2.07           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 8  | 600886 | 国投电力 | 674,133.00 | 1.79 |
| 9  | 600028 | 中国石化 | 608,029.00 | 1.62 |
| 10 | 601939 | 建设银行 | 539,719.00 | 1.43 |
| 11 | 601398 | 工商银行 | 538,076.00 | 1.43 |
| 12 | 601288 | 农业银行 | 537,970.00 | 1.43 |
| 13 | 601088 | 中国神华 | 499,464.00 | 1.33 |
| 14 | 603259 | 药明康德 | 498,086.00 | 1.32 |
| 15 | 601988 | 中国银行 | 468,878.00 | 1.25 |
| 16 | 300705 | 九典制药 | 392,091.00 | 1.04 |
| 17 | 300750 | 宁德时代 | 370,018.00 | 0.98 |
| 18 | 601658 | 邮储银行 | 360,991.00 | 0.96 |
| 19 | 601598 | 中国外运 | 360,242.00 | 0.96 |
| 20 | 601328 | 交通银行 | 359,730.00 | 0.96 |

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  | 001965 | 招商公路 | 1,847,991.72 | 4.91            |
| 2  | 601899 | 紫金矿业 | 1,424,122.00 | 3.78            |
| 3  | 600900 | 长江电力 | 1,023,186.00 | 2.72            |
| 4  | 300750 | 宁德时代 | 729,882.00   | 1.94            |
| 5  | 600795 | 国电电力 | 617,809.00   | 1.64            |
| 6  | 600028 | 中国石化 | 616,284.00   | 1.64            |
| 7  | 603259 | 药明康德 | 523,956.00   | 1.39            |
| 8  | 601988 | 中国银行 | 478,480.00   | 1.27            |
| 9  | 003816 | 中国广核 | 469,337.00   | 1.25            |
| 10 | 300705 | 九典制药 | 415,679.20   | 1.10            |
| 11 | 601288 | 农业银行 | 405,482.00   | 1.08            |
| 12 | 601985 | 中国核电 | 389,200.20   | 1.03            |
| 13 | 601398 | 工商银行 | 387,639.00   | 1.03            |
| 14 | 601088 | 中国神华 | 381,957.15   | 1.02            |
| 15 | 601328 | 交通银行 | 381,150.00   | 1.01            |
| 16 | 002128 | 电投能源 | 373,518.00   | 0.99            |
| 17 | 601939 | 建设银行 | 368,874.00   | 0.98            |
| 18 | 300274 | 阳光电源 | 367,230.00   | 0.98            |
| 19 | 601658 | 邮储银行 | 362,537.00   | 0.96            |
| 20 | 600754 | 锦江酒店 | 354,569.00   | 0.94            |

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 | 20,813,706.08 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 23,503,378.70 |

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      | 14,113,472.70 | 46.36        |
| 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） | 10,648,296.14 | 34.97        |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 24,761,768.84 | 81.33        |

#### 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  | 019735 | 24 国债 04 | 75,000 | 7,637,342.47 | 25.08        |
| 2  | 019729 | 23 国债 26 | 30,000 | 3,116,719.73 | 10.24        |
| 3  | 110059 | 浦发转债     | 24,000 | 2,646,608.88 | 8.69         |
| 4  | 128129 | 青农转债     | 21,000 | 2,234,932.19 | 7.34         |
| 5  | 113037 | 紫银转债     | 19,000 | 2,086,260.90 | 6.85         |

#### 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“建设银行(证券代码 601939)”、“青农转债(证券代码 128129)”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 | 12,505.70  |
| 2  | 应收清算款 | 448,062.31 |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 1,037.93   |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 461,605.94 |

##### 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  | 110059 | 浦发转债 | 2,646,608.88 | 8.69          |
| 2  | 128129 | 青农转债 | 2,234,932.19 | 7.34          |
| 3  | 113037 | 紫银转债 | 2,086,260.90 | 6.85          |
| 4  | 113056 | 重银转债 | 1,949,011.43 | 6.40          |
| 5  | 113052 | 兴业转债 | 1,731,482.74 | 5.69          |

### 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 | 907       | 10,274.08 | 155.23       | 0.00%  | 9,318,430.84  | 100.00% |
| 前海开源鼎安债券 C | 765       | 19,530.84 | 9,756,097.56 | 65.30% | 5,184,996.97  | 34.70%  |
| 合计         | 1,672     | 14,509.38 | 9,756,252.79 | 40.22% | 14,503,427.81 | 59.78%  |

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 | 499.89     | 0.0054%  |

|  |            |        |         |
|--|------------|--------|---------|
|  | 前海开源鼎安债券 C | 15.61  | 0.0001% |
|  | 合计         | 515.50 | 0.0021% |

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                    | 14,399,413.15  | 15,809,533.12 |
| 本报告期基金总申购份额                     | 1,414,357.31   | 28,884,282.86 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 6,495,184.39   | 29,752,721.45 |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -              | -             |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 9,318,586.07   | 14,941,094.53 |

## § 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的重大人事变动：2024 年 4 月 23 日起，王厚琼先生任副总经理。

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      | 43,234,535.76 | 100.00%      | 32,249.05 | 100.00%    | -  |
| 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      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 五矿证券   | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 招商证券   | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |

|            |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|
| 中国国际<br>金融 | 2 | - | - | - | - |
|------------|---|---|---|---|---|

注：依据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》和相关业务规则，本基金管理人制定了基金租用证券公司交易单元的选择标准和程序，其中，除被动股票型基金以外的其他类型基金租用证券公司交易单元的选择标准和程序如下：

A：选择标准

1. 分类评价结果；2. 研究所人数及成立时间；3. 研究所行业覆盖度；4. 近 1 年研究及经纪业务未受到重大行政处罚，或受到重大行政处罚时间已满 1 年并且完成整改；5. 其他可增强资质的情况及特色。

B：选择程序

证券公司的选择由本基金管理人交易单元管理小组决定。管理小组根据选择标准来挑选财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易，并根据证券公司提供研究服务的情况对各往来证券公司进行评估，评估结果作为交易单元租用选择和调整的参考依据。

### 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           |              | 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 |
| 德邦证券   | 338,050,093.86 | 100.00%      | 7,200,000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |
| 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   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 五矿证券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 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基金经理变更公告                     | 中国证监会规定媒介 | 2024年01月11日 |
| 2  | 前海开源鼎安债券型证券投资基金招募说明书（20240112 更新）           | 中国证监会规定媒介 | 2024年01月12日 |
| 3  | 前海开源鼎安债券型证券投资基金基金产品资料概要更新（20240112 更新）      | 中国证监会规定媒介 | 2024年01月12日 |
| 4  | 前海开源鼎安债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告              | 中国证监会规定媒介 | 2024年01月22日 |
| 5  | 关于旗下部分基金增加贵州省贵文文化基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024年03月05日 |
| 6  | 关于旗下部分基金增加西部证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告      | 中国证监会规定媒介 | 2024年03月06日 |
| 7  | 前海开源基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告                   | 中国证监会规定媒介 | 2024年03月18日 |
| 8  | 前海开源鼎安债券型证券投资基金 2023 年年度报告                  | 中国证监会规定媒介 | 2024年03月30日 |
| 9  | 前海开源鼎安债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告              | 中国证监会规定媒介 | 2024年04月22日 |
| 10 | 前海开源基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                   | 中国证监会规定媒介 | 2024年04月24日 |
| 11 | 关于防范不法分子冒用前海开源基金名义进行非法活动的风险提示               | 中国证监会规定媒介 | 2024年05月15日 |
| 12 | 关于旗下部分基金增加上海证券有限责任公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告      | 中国证监会规定媒介 | 2024年05月23日 |
| 13 | 前海开源鼎安债券型证券投资基金基金产品资料概要更新（20240626 更新）      | 中国证监会规定媒介 | 2024年06月26日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |              |               |               | 报告期末持有基金情况   |        |
|-------|----------------|-------------------------|--------------|---------------|---------------|--------------|--------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额         | 申购份额          | 赎回份额          | 持有份额         | 份额占比   |
| 机构    | 1              | 20240101-20240630       | 9,756,097.56 | -             | -             | 9,756,097.56 | 40.22% |
|       | 2              | 20240110-20240116       | -            | 11,637,572.73 | 11,637,572.73 | -            | -      |
|       | 3              | 20240401-20240612       | -            | 13,099,997.32 | 13,099,997.32 | -            | -      |

#### 产品特有风险

##### 1. 巨额赎回风险

(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；

(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；

##### 2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

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；

##### 3. 流动性风险

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；

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。

### 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，客户服务热线：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  
2024 年 08 月 30 日