

# 前海开源鼎安债券型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 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:2021 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月27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2021年01月01日起至2021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	7
2.5 其他相关资料	7
§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	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 中期财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	48
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	48
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	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51

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 .....	51
§9 开放式基金份额变动 .....	52
§10 重大事件揭示 .....	52
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
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 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
§12 备查文件目录 .....	57
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## § 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	51,248,856.72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	14,387,634.32份	36,861,222.40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、</p>

	<p>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	傅成斌	张燕
	联系电话	0755-88601888	0755-83199084
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话	4001666998	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	王兆华	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 (2021年01月01日-2021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	477,129.76	2,047,911.04
本期利润	445,750.07	1,589,560.29
加权平均基金份额本期利润	0.0538	0.0391
本期加权平均净值利润率	4.32%	3.19%
本期基金份额净值增长率	3.76%	3.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	3,493,651.52	8,380,982.55
期末可供分配基金份额利润	0.2428	0.2274
期末基金资产净值	18,237,274.68	46,148,251.12
期末基金份额净值	1.268	1.252
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	26.80%	25.20%

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	0.56%	0.21%	-0.24%	0.09%	0.80%	0.12%
过去三个月	2.84%	0.20%	0.77%	0.10%	2.07%	0.10%
过去六个月	3.76%	0.25%	0.70%	0.14%	3.06%	0.11%
过去一年	10.07%	0.26%	2.31%	0.13%	7.76%	0.13%
过去三年	24.80%	0.26%	8.98%	0.13%	15.82%	0.13%
自基金合同 生效起至今	26.80%	0.22%	7.04%	0.13%	19.76%	0.09%

## 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	0.48%	0.20%	-0.24%	0.09%	0.72%	0.11%
过去三个月	2.71%	0.19%	0.77%	0.10%	1.94%	0.09%
过去六个月	3.56%	0.25%	0.70%	0.14%	2.86%	0.11%
过去一年	9.63%	0.26%	2.31%	0.13%	7.32%	0.13%
过去三年	23.84%	0.26%	8.98%	0.13%	14.86%	0.13%
自基金合同 生效起至今	25.20%	0.22%	7.04%	0.13%	18.16%	0.09%

### 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07月19日-2021年06月30日)



前海开源鼎安债券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07月19日-2021年06月30日)



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

前海开源基金管理有限公司（以下简称“前海开源基金”）于2012年12月27日经中国证监会批准，2013年1月23日注册成立，截至报告期末，注册资本为2亿元人民币。其中，开源证券股份有限公司、北京市中盛金期投资管理有限公司、北京长和世纪资产管理有限公司和深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)各持股权25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海、广州设立分公司。经中国证监会批准，前海开源基金全资控股子公司--前海开源资产管理有限公司（以下简称“前海开源资管”）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95只开放式基金，资产管理规模超过1283亿元。

#### 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		
曾健飞	本基金的基金经理	2019-08-09	-	7年	曾健飞先生，密歇根州立大学数学硕士。2014年2月加盟前海开源基金管理有限公司，曾任公司固定收益部研究员，现任公司固收综合团队基金经理。
陆琦	本基金的基金经理、公司金融工程部执行总监	2021-06-24	-	10年	陆琦先生，南京大学硕士研究生。2011年至2015年任南方基金管理有限公司风险管理部量化分析高级经理，2015年10月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司金融工程部执行总监。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 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，因组合投资策略需要，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价出现1次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，基金经理按规定履行了审批程序。

## 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

利率方面，从国债收益率曲线来看，10年期国债收益率震荡下行，从年初的3.14%上行到2月份的3.28%，后持续下行至3.08%。转债市场方面，得益于中小市值股票的崛起和估值上行，中证转债指数录得4.04%的涨幅。

### 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1.268元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.76%，同期业绩比较基准收益率为0.70%；截至报告期末前海开源鼎安债券C基金份额净值为1.252元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.56%，同期业绩比较基准收益率为0.70%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从政策和经济基本面来看，资金效率偏低、更依赖债务扩张的传统经济领域会受到一定的压制，而资金效率更高、活力更强、科技成分更高的新经济领域会有持续的支持。建党百年，不仅是全民小康，更是向全世界证明我国制度的优越性和一切为人民的理念。从中长期的维度看，我们坚定看好中国资产，坚定看好国产在制造、材料和信息技术等方面的全面进步。即使外部的压力不减反增，但中国人民的智慧和吃苦耐劳的品质，终将战胜一切困难。

作为管理人，我们始终保持敬畏市场和积极管理的初心，及时研究市场基本面及变化趋势，勤奋学习扩大自己的能力圈，努力为投资人取得较高收益。

在后续的投资运作中，本基金权益仓位保持在0~20%，将继续采用外资买入共识追踪的投资策略，即综合运用多维度指标跟踪境外资金投资中国A股的动向，精选外资看好且公司治理、基本面、市场流动性均良好的优质标的分散投资。债券部分主要投资于利率债及AAA评级信用债。2021年结束后15个工作日后，再决定是否调整策略。

#### 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、基金业协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。

本基金管理人设有估值委员会，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。估值委员会由督察长、基金核算部、监察稽核部、金融工程部、交易部、投资研究部门负责人及其他指定相关人员组成。估值委员会成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供固定收益品种和流通受限股票的估值相关数据。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 中期财务会计报告(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：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,687,778.73	239,884.53
结算备付金		127,134.75	156,108.19
存出保证金		5,785.19	11,756.44
交易性金融资产	6.4.7.2	65,683,481.47	54,206,521.02
其中：股票投资		7,179,552.13	10,351,594.02
基金投资		-	-
债券投资		58,503,929.34	43,854,927.00

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	847,389.65	663,137.17
应收股利		-	-
应收申购款		138,673.48	38,691.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		68,490,243.27	55,316,098.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		4,000,000.00	500,000.00
应付证券清算款		53.59	-
应付赎回款		2,497.54	13,433.86
应付管理人报酬		36,852.18	31,929.38
应付托管费		5,264.59	4,561.33
应付销售服务费		14,995.26	16,639.64
应付交易费用	6.4.7.7	13,086.32	17,175.26
应交税费		206.39	-
应付利息		444.27	127.82
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	31,317.33	30,009.75
负债合计		4,104,717.47	613,877.04

<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	51,248,856.72	45,206,827.30
未分配利润	6.4.7.10	13,136,669.08	9,495,394.60
所有者权益合计		64,385,525.80	54,702,221.90
负债和所有者权益总计		68,490,243.27	55,316,098.94

注：报告截止日2021年06月30日，前海开源鼎安债券基金份额总额51,248,856.72份，其中前海开源鼎安债券A类基金份额净值1.268元，基金份额14,387,634.32份；前海开源鼎安债券C类基金份额净值1.252元，基金份额36,861,222.40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：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
<b>一、收入</b>		2,483,191.01	1,050,009.49
1. 利息收入		682,927.60	236,662.40
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,458.28	6,607.11
债券利息收入		678,469.32	230,055.29
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,263,883.79	1,229,482.73
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,192,776.74	632,439.17
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.6	1,018,395.71	571,955.55



资产支持证券投资 收益	6.4.7.14. 5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	52,711.34	25,088.01
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.18	-489,730.44	-437,194.53
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.19	26,110.06	21,058.89
<b>减：二、费用</b>		447,880.65	199,454.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	209,242.57	73,845.86
2. 托管费	6.4.10.2. 2	29,891.76	10,549.40
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	99,097.25	28,533.39
4. 交易费用	6.4.7.20	40,398.14	50,288.27
5. 利息支出		16,597.95	572.60
其中：卖出回购金融资产 支出		16,597.95	572.60
6. 税金及附加		117.55	73.00
7. 其他费用	6.4.7.21	52,535.43	35,591.56
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		2,035,310.36	850,555.41
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		2,035,310.36	850,555.41

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源鼎安债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	45,206,827.30	9,495,394.60	54,702,221.90
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	2,035,310.36	2,035,310.36
三、本期基金份额交 易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	6,042,029.42	1,605,964.12	7,647,993.54
其中：1. 基金申购款	39,376,548.91	9,132,025.89	48,508,574.80
2. 基金赎回 款	-33,334,519.49	-7,526,061.77	-40,860,581.26
四、本期向基金份额 持有人分配利润产 生的基金净值变动 (净值减少以“-” 号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	51,248,856.72	13,136,669.08	64,385,525.80
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	20,227,356.33	2,297,031.23	22,524,387.56
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	850,555.41	850,555.41
三、本期基金份额交	-9,991,343.53	-1,642,517.81	-11,633,861.34

易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	57,058,245.92	6,629,350.41	63,687,596.33
2. 基金赎回款	-67,049,589.45	-8,271,868.22	-75,321,457.67
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	10,236,012.80	1,505,068.83	11,741,081.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

秦亚峰

何璁

傅智

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

前海开源鼎安债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1413号《关于准予前海开源鼎安债券型证券投资基金注册的批复》核准,由前海开源基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源鼎安债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币600,528,866.89元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2016]02230124号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源鼎安债券型证券投资基金基金合同》于2016年7月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为600,609,937.47份基金份额,其中认购资金利息折合81,070.58份基金份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、但从

本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源鼎安债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、协议存款、通知存款、定期存款、同业存单、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券、债券质押及买断式回购、资产支持证券、货币市场工具、国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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 $\times$ 90%+沪深300指数收益率 $\times$ 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》及其他中国证监会、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。

#### 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基金净值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会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年

(含1年)的, 暂减按50%计入应纳税所得额; 持股期限超过1年的, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末	
	2021年06月30日	
活期存款	1,687,778.73	
定期存款	-	
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	-	
合计	1,687,778.73	

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末			
	2021年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	6,690,666.44	7,179,552.13	488,885.69	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	18,037,719.98	18,189,929.34	152,209.36
	银行间市	40,309,320.00	40,314,000.00	4,680.00

	场			
	合计	58,347,039.98	58,503,929.34	156,889.36
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		65,037,706.42	65,683,481.47	645,775.05

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	233.62
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	57.20
应收债券利息	847,096.13
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.10
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	2.60

合计	847,389.65
----	------------

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	9,401.47
银行间市场应付交易费用	3,684.85
合计	13,086.32

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.84
应付证券出借违约金	-
预提费用	31,315.49
合计	31,317.33

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 前海开源鼎安债券A

金额单位：人民币元

项目 (前海开源鼎安债券A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	3,934,652.25	3,934,652.25
本期申购	13,395,052.89	13,395,052.89
本期赎回(以“-”号填列)	-2,942,070.82	-2,942,070.82



本期末	14,387,634.32	14,387,634.32
-----	---------------	---------------

## 6.4.7.9.2 前海开源鼎安债券C

金额单位：人民币元

项目 (前海开源鼎安债券C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	41,272,175.05	41,272,175.05
本期申购	25,981,496.02	25,981,496.02
本期赎回(以“-”号填列)	-30,392,448.67	-30,392,448.67
本期末	36,861,222.40	36,861,222.40

## 6.4.7.10 未分配利润

## 6.4.7.10.1 前海开源鼎安债券A

单位：人民币元

项目 (前海开源鼎安债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	749,527.72	123,896.69	873,424.41
本期利润	477,129.76	-31,379.69	445,750.07
本期基金份额交易产生的变动数	2,266,994.04	263,471.84	2,530,465.88
其中：基金申购款	2,898,311.86	348,352.16	3,246,664.02
基金赎回款	-631,317.82	-84,880.32	-716,198.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,493,651.52	355,988.84	3,849,640.36

## 6.4.7.10.2 前海开源鼎安债券C

单位：人民币元

项目 (前海开源鼎安债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,332,560.24	1,289,409.95	8,621,970.19
本期利润	2,047,911.04	-458,350.75	1,589,560.29

本期基金份额交易产生的变动数	-999,488.73	74,986.97	-924,501.76
其中：基金申购款	4,999,910.64	885,451.23	5,885,361.87
基金赎回款	-5,999,399.37	-810,464.26	-6,809,863.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,380,982.55	906,046.17	9,287,028.72

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
活期存款利息收入	3,307.30	
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	475.90	
其他	675.08	
合计	4,458.28	

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
卖出股票成交总额	13,565,780.24	
减：卖出股票成本总额	12,373,003.50	
买卖股票差价收入	1,192,776.74	

#### 6.4.7.13 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,018,395.71
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	1,018,395.71

#### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	210,816,023.52
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	206,571,031.18
减：应收利息总额	3,226,596.63
买卖债券差价收入	1,018,395.71

#### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

##### 6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

**6.4.7.15.2 贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入**

无。

**6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.16 衍生工具收益****6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	52,711.34
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	52,711.34

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-489,730.44
——股票投资	-420,949.37
——债券投资	-68,781.07

——资产支持证券投资	-
——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	-489,730.44

## 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	20,565.87
转换费收入	5,544.19
合计	26,110.06

## 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	35,973.14
银行间市场交易费用	4,425.00
合计	40,398.14

## 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	22,315.49

信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,619.94
账户维护费	27,000.00
其他	600.00
合计	52,535.43

#### 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”）	基金管理人的股东、基金销售机构
北京市中盛金期投资管理有限公司	基金管理人的股东
北京长和世纪资产管理有限公司	基金管理人的股东
深圳市和合投信资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
前海开源资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	209,242.57	73,845.86
其中：支付销售机构的客户维护费	18,360.06	21,449.22

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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	29,891.76	10,549.40

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 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源鼎安债券A	前海开源鼎安债券C	合计
招商银行	0.00	164.27	164.27
前海开源 基金	0.00	79,852.49	79,852.49
合计	0.00	80,016.76	80,016.76
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源鼎安债券A	前海开源鼎安债券C	合计
前海开源 基金管理 有限公司	0.00	12,215.99	12,215.99
开源证券 股份有限 公司	0.00	5.66	5.66
合计	0.00	12,221.65	12,221.65

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 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.4.1 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A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

前海开源鼎安债券C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	9,756,097.56	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	9,756,097.56	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	26.47%	0.00%

注：

1. 期间申购总份额含转换入份额。
2. 基金管理人前海开源基金在本期间申购/赎回本基金的交易委托前海开源基金直销中心办理，无申购/赎回费。

## 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020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 股份有限公司	1,687,778.73	3,307.30	283,392.32	2,946.20

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

无。

#### 6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额4,000,000.00元，于2021年7月6日到期。该类交易要求本基金在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.13 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次风险管理架构体系。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与绩效评估。

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或其他国内大中型商业银行处，因而与银行存款相关的信用风险不重大。在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	33,253,275.00	2,848,395.00
合计	33,253,275.00	2,848,395.00

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	12,162,823.85	-
AAA以下	6,680.49	-
未评级	13,081,150.00	41,006,532.00
合计	25,250,654.34	41,006,532.00

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

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2021年6月30日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变

现价值。于2021年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值未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。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,687,778.73	-	-	-	1,687,778.73
结算备付金	127,134.75	-	-	-	127,134.75
存出保证金	5,785.19	-	-	-	5,785.19
交易性金融资	33,802,125.00	21,932,896.50	2,768,907.84	7,179,552.13	65,683,481.47

产					
应收利息	-	-	-	847,389.65	847,389.65
应收申购款	5,000.30	-	-	133,673.18	138,673.48
资产总计	35,627,823.97	21,932,896.50	2,768,907.84	8,160,614.96	68,490,243.27
负债					
卖出回购金融资产款	4,000,000.00	-	-	-	4,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	53.59	53.59
应付赎回款	-	-	-	2,497.54	2,497.54
应付管理人报酬	-	-	-	36,852.18	36,852.18
应付托管费	-	-	-	5,264.59	5,264.59
应付销售服务费	-	-	-	14,995.26	14,995.26
应付交易费用	-	-	-	13,086.32	13,086.32
应交税费	-	-	-	206.39	206.39
应付利息	-	-	-	444.27	444.27
其他负债	-	-	-	31,317.33	31,317.33
负债总计	4,000,000.00	-	-	104,717.47	4,104,717.47
利率敏感度缺口	31,627,823.97	21,932,896.50	2,768,907.84	8,055,897.49	64,385,525.80
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	239,884.53	-	-	-	239,884.53
结算备	156,108.19	-	-	-	156,108.19

付金					
存出保证金	11,756.44	-	-	-	11,756.44
交易性金融资产	2,848,395.00	39,823,232.00	1,183,300.00	10,351,594.02	54,206,521.02
应收利息	-	-	-	663,137.17	663,137.17
应收申购款	-	-	-	38,691.59	38,691.59
资产总计	3,256,144.16	39,823,232.00	1,183,300.00	11,053,422.78	55,316,098.94
负债					
卖出回购金融资产款	500,000.00	-	-	-	500,000.00
应付赎回款	-	-	-	13,433.86	13,433.86
应付管理人报酬	-	-	-	31,929.38	31,929.38
应付托管费	-	-	-	4,561.33	4,561.33
应付销售服务费	-	-	-	16,639.64	16,639.64
应付交易费用	-	-	-	17,175.26	17,175.26
应付利息	-	-	-	127.82	127.82
其他负债	-	-	-	30,009.75	30,009.75
负债总计	500,000.00	-	-	113,877.04	613,877.04
利率敏感度缺口	2,756,144.16	39,823,232.00	1,183,300.00	10,939,545.74	54,702,221.90

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率增加0.25%	-58,780.94	-251,587.41
	市场利率减少0.25%	59,133.03	255,888.71

#### 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 2021年06月30日		上年度末 2020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	7,179,552.13	11.15	10,351,594.02	18.92

产—股票投资				
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	7,179,552.13	11.15	10,351,594.02	18.92

#### 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	439,557.04	528,515.39
	业绩比较基准下降5%	-439,557.04	-528,515.39

6.4.14 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	7,179,552.13	10.48
	其中：股票	7,179,552.13	10.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	58,503,929.34	85.42

	其中：债券	58,503,929.34	85.42
	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	1,814,913.48	2.65
8	其他各项资产	991,848.32	1.45
9	合计	68,490,243.27	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,177,273.41	8.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	136,186.52	0.21
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	696,598.80	1.08
J	金融业	449,090.40	0.70
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	141,150.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	151,893.00	0.24
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	145,540.00	0.23
R	文化、体育和娱乐业	281,820.00	0.44
S	综合	-	-
	合计	7,179,552.13	11.15

### 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	002747	埃斯顿	4,500	175,725.00	0.27
2	300450	先导智能	2,880	173,203.20	0.27
3	300059	东方财富	5,160	169,196.40	0.26
4	600885	宏发股份	2,600	163,020.00	0.25
5	002690	美亚光电	2,900	161,704.00	0.25
6	300782	卓胜微	300	161,250.00	0.25
7	603501	韦尔股份	500	161,000.00	0.25
8	300124	汇川技术	2,150	159,659.00	0.25
9	002008	大族激光	3,900	157,521.00	0.24
10	300759	康龙化成	700	151,893.00	0.24
11	603986	兆易创新	800	150,320.00	0.23
12	300274	阳光电源	1,300	149,578.00	0.23
13	002230	科大讯飞	2,200	148,676.00	0.23
14	300244	迪安诊断	3,800	145,540.00	0.23
15	002460	赣锋锂业	1,200	145,308.00	0.23
16	002050	三花智控	6,040	144,839.20	0.22
17	000301	东方盛虹	6,900	144,210.00	0.22
18	300413	芒果超媒	2,100	144,060.00	0.22

19	603899	晨光文具	1,700	143,752.00	0.22
20	601636	旗滨集团	7,700	142,912.00	0.22
21	601012	隆基股份	1,600	142,144.00	0.22
22	600176	中国巨石	9,130	141,606.30	0.22
23	600309	万华化学	1,300	141,466.00	0.22
24	300496	中科创达	900	141,354.00	0.22
25	300003	乐普医疗	4,400	141,328.00	0.22
26	002027	分众传媒	15,000	141,150.00	0.22
27	002812	恩捷股份	600	140,460.00	0.22
28	000001	平安银行	6,200	140,244.00	0.22
29	601939	建设银行	21,000	139,650.00	0.22
30	002007	华兰生物	3,800	139,384.00	0.22
31	002439	启明星辰	4,800	139,248.00	0.22
32	300724	捷佳伟创	1,200	139,212.00	0.22
33	601138	工业富联	11,200	138,992.00	0.22
34	300308	中际旭创	3,600	138,672.00	0.22
35	002271	东方雨虹	2,500	138,300.00	0.21
36	002557	洽洽食品	3,200	137,920.00	0.21
37	603605	珀莱雅	701	137,893.71	0.21
38	300144	宋城演艺	8,200	137,760.00	0.21
39	600406	国电南瑞	5,920	137,580.80	0.21
40	002241	歌尔股份	3,200	136,768.00	0.21
41	300285	国瓷材料	2,800	136,500.00	0.21
42	603658	安图生物	1,800	136,386.00	0.21
43	603939	益丰药房	2,428	136,186.52	0.21
44	601966	玲珑轮胎	3,100	135,594.00	0.21
45	002601	龙佰集团	3,900	134,862.00	0.21
46	002572	索菲亚	5,500	133,100.00	0.21
47	300146	汤臣倍健	4,000	131,600.00	0.20
48	300454	深信服	500	129,740.00	0.20
49	600298	安琪酵母	2,300	125,074.00	0.19

50	300760	迈瑞医疗	200	96,010.00	0.15
----	--------	------	-----	-----------	------

#### 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	000725	京东方 A	341,700.00	0.62
2	002460	赣锋锂业	276,336.00	0.51
3	002557	洽洽食品	273,924.00	0.50
4	600176	中国巨石	261,956.00	0.48
5	300274	阳光电源	260,526.00	0.48
6	600132	重庆啤酒	248,004.00	0.45
7	300015	爱尔眼科	234,551.24	0.43
8	300496	中科创达	226,233.00	0.41
9	002241	歌尔股份	215,150.00	0.39
10	002007	华兰生物	160,949.00	0.29
11	600309	万华化学	159,420.00	0.29
12	600438	通威股份	152,841.00	0.28
13	300782	卓胜微	148,644.00	0.27
14	002242	九阳股份	146,915.00	0.27
15	300724	捷佳伟创	145,838.00	0.27
16	603501	韦尔股份	145,073.00	0.27
17	300759	康龙化成	144,851.00	0.26
18	601138	工业富联	141,904.00	0.26
19	603882	金域医学	141,400.00	0.26
20	603899	晨光文具	141,389.00	0.26

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	300015	爱尔眼科	450,966.08	0.82
2	600660	福耀玻璃	373,149.00	0.68
3	600019	宝钢股份	370,904.00	0.68
4	002353	杰瑞股份	321,489.00	0.59
5	601888	中国中免	318,770.00	0.58
6	000725	京东方 A	314,946.00	0.58
7	603737	三棵树	314,221.00	0.57
8	600132	重庆啤酒	308,709.00	0.56
9	603338	浙江鼎力	303,285.00	0.55
10	300012	华测检测	300,662.00	0.55
11	000338	潍柴动力	298,531.00	0.55
12	600309	万华化学	285,661.00	0.52
13	000538	云南白药	284,072.00	0.52
14	600690	海尔智家	276,764.00	0.51
15	600887	伊利股份	266,044.00	0.49
16	600031	三一重工	264,134.00	0.48
17	000157	中联重科	257,430.00	0.47
18	002410	广联达	253,801.00	0.46
19	300347	泰格医药	252,635.00	0.46
20	600570	恒生电子	251,639.00	0.46

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	9,621,910.98
卖出股票收入（成交）总额	13,565,780.24

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	13,253,275.00	20.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	33,081,150.00	51.38
	其中：政策性金融债	33,081,150.00	51.38
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)	12,169,504.34	18.90
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	58,503,929.34	90.87

## 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	200406	20农发06	200,000	20,000,000.00	31.06
2	180204	18国开04	100,000	10,313,000.00	16.02
3	200010	20付息国债10	100,000	10,001,000.00	15.53
4	132018	G三峡EB1	42,000	5,045,040.00	7.84
5	110061	川投转债	26,000	3,405,740.00	5.29

## 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

#### 7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

#### 7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名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。

7.12.2 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	5,785.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	847,389.65
5	应收申购款	138,673.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	991,848.32

#### 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	132018	G三峡EB1	5,045,040.00	7.84
2	110061	川投转债	3,405,740.00	5.29
3	113044	大秦转债	1,234,920.00	1.92
4	113009	广汽转债	548,850.00	0.85

#### 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	持有份额	占总份额比例	

				比例		
前海 开源 鼎安 债券A	904	15,915.52	8,038,585.21	55.8 7%	6,349,049.11	44.13%
前海 开源 鼎安 债券C	1,86 4	19,775.33	31,108,757.93	84.3 9%	5,752,464.47	15.61%
合计	2,76 8	18,514.76	39,147,343.14	76.3 9%	12,101,513.58	23.61%

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	600.98	0.00%
	前海开源鼎安 债券C	91,921.58	0.25%
	合计	92,522.56	0.18%

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	前海开源鼎安债券 A	0

基金	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	0~10
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	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	3,934,652.25	41,272,175.05
本报告期基金总申购份额	13,395,052.89	25,981,496.02
减：本报告期基金总赎回份额	2,942,070.82	30,392,448.67
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	14,387,634.32	36,861,222.40

## § 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如下：

(1) 本基金管理人于2021年3月13日发布公告，前海开源基金管理有限公司总经理贾红波先生离任，并由董事长王兆华先生代任总经理一职

(2) 本基金管理人于2021年5月21日发布公告，曲扬先生、邱杰先生自2021年5月19日起担任前海开源基金管理有限公司副总经理

(3) 本基金管理人于2021年5月22日发布公告，何隽先生自2021年5月21日起担任前海开源基金管理有限公司副总经理

上述事项经前海开源基金管理有限公司董事会审议通过，并已按相关法律法规的规定进行备案。具体情况详见基金管理人在中国证监会规定媒介发布的相关公告；

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情形。

### 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	
东北证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	9,086,010.96	39.18%	6,644.25	33.60%	-

西部						
招商 证券	2	14,101,680.26	60.82%	13,132.79	66.40%	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源 西部	62,207,83 1.32	72.0 0%	29,400,00 0.00	89.6 3%	-	-	-	-
招商证券	24,196,11 1.02	28.0 0%	3,400,00 0.00	10.3 7%	-	-	-	-

## 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	前海开源基金管理有限公司关于暂停北京晟视天下基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-01-15
2	前海开源基金管理有限公司关于暂停北京恒宇天泽基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-01-15
3	前海开源鼎安债券型证券投资基金2020年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2021-01-22
4	前海开源鼎安债券型证券投资基金招募说明书（20210312更新）	中国证监会规定媒介	2021-03-12
5	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（20210312更新）	中国证监会规定媒介	2021-03-12
6	前海开源鼎安债券型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会规定媒介	2021-03-31
7	前海开源鼎安债券型证券投资基金2021年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2021-04-22
8	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过珠海盈米基金销售有限公司办理业务最低限额的公告	中国证监会规定媒介	2021-04-28
9	前海开源基金管理有限公司关于终止与深圳市小牛基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2021-04-29
10	前海开源鼎安债券型证券投	中国证监会规定媒介	2021-06-03

	资基金托管协议（2021年6月修订）		
11	前海开源鼎安债券型证券投资基金基金合同（2021年6月修订）	中国证监会规定媒介	2021-06-03
12	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分基金投资范围、增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	中国证监会规定媒介	2021-06-03
13	关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过诺亚正行基金销售有限公司办理定投业务起点金额的公告	中国证监会规定媒介	2021-06-03
14	前海开源鼎安债券型证券投资基金招募说明书（20210603更新）	中国证监会规定媒介	2021-06-03
15	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（20210603更新）	中国证监会规定媒介	2021-06-03
16	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	2021-06-26
17	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（20210628更新）	中国证监会规定媒介	2021-06-28
18	前海开源鼎安债券型证券投资基金招募说明书（20210628更新）	中国证监会规定媒介	2021-06-28

## § 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	20210101 - 20210120	15,038,462.19	0.00	8,203,450.00	6,835,012.19	13.34%
	2	20210101 - 20210118	10,384,429.63	0.00	0.00	10,384,429.63	20.26%
	3	20210121 - 20210630	10,384,429.63	0.00	0.00	10,384,429.63	20.26%
产品特有风险							
<p>1. 巨额赎回风险</p> <p>(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大, 单一投资者的巨额赎回, 可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要, 对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响;</p> <p>(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时, 在符合基金合同约定情况下, 如基金管理人认为有必要, 可延期办理本基金的赎回申请, 投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险; 如果连续2个开放日以上(含)发生巨额赎回, 基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请, 对剩余投资者的赎回办理造成影响;</p> <p>2. 转换运作方式或终止基金合同的风险</p> <p>单一投资者巨额赎回后, 若本基金连续60个工作日基金份额持有人低于200人或基金资产净值低于5000万情形的, 基金管理人应当向中国证监会提出解决方案, 或按基金合同约定, 转换运作方式或终止基金合同, 其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险;</p> <p>3. 流动性风险</p> <p>单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对, 可能会产生基金仓位调整困难, 导致流动性风险;</p> <p>4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小, 导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。</p>							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据业务发展需要, 并经前海开源基金管理有限公司股东会批准, 本公司本报告期内设立广州分公司, 具体情况详见基金管理人在中国证监会规定媒介发布的相关公告。

2、根据相关法律法规的规定和基金合同的约定, 经与各基金托管人协商一致, 并向中国证监会备案, 本公司对旗下15只债券基金的基金合同等法律文件进行了修订, 包括增加侧袋机制和/或投资范围中增加存托凭证等相关内容。本次修订系根据法律法规的变动而进行的修订, 对基金份额持有人利益无实质性不利影响, 无需召开份额持有人大会, 修订将自2021年6月4日起正式生效。具体情况详见基金管理人在中国证监会规定媒介发布的相关公告。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源鼎安债券型证券投资基金设立的文件
- (2) 《前海开源鼎安债券型证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源鼎安债券型证券投资基金托管协议》
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (5) 前海开源鼎安债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 12.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人前海开源基金管理有限公司，客户服务电话：4001-666-998
- (3) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：[www.qhkyfund.com](http://www.qhkyfund.com)

前海开源基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日