

前海开源可转债债券型发起式证券投资基金
2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5	托管人报告	11
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
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	11
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	12
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1	资产负债表	12
6.2	利润表	13
6.3	净资产（基金净值）变动表	14
6.4	报表附注	15
§ 7	投资组合报告	35
7.1	期末基金资产组合情况	35
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	39
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	39
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	39
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	39
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	39
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39

7.12	投资组合报告附注	39
§ 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	42
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	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	43
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	47
12.3	查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源可转债债券型发起式证券投资基金
基金简称	前海开源可转债债券
基金主代码	000536
基金运作方式	契约型普通开放式
基金合同生效日	2014 年 03 月 25 日
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,515,429,671.56 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要利用可转债品种兼具债券和股票的特性,在合理控制风险、保持适当流动性的基础上,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下四方面内容:</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、息差策略等积极投资策略。针对本基金主要投资标的的可转债,在投资策略上将根据可转债自身特点,分析发行主体赋予其可转债的各项条款,结合分析市场行情,在转股期内做出合理的投资决策。</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>

业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×20%+沪深 300 指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金，低于混合型基金、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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙辰健
	联系电话	0755-88601888
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com
客户服务电话	4001-666-998	95599
传真	0755-83181169	010-68121816
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）	北京市东城区建国门内大街 69 号
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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	李强	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.qhkyfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	前海开源基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 2206

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	-15,025,978.63
本期利润	77,094,531.94
加权平均基金份额本期利润	0.0451
本期加权平均净值利润率	3.25%
本期基金份额净值增长率	2.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）

期末可供分配利润	534,048,126.69
期末可供分配基金份额利润	0.3524
期末基金资产净值	2,076,793,369.10
期末基金份额净值	1.370
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023年06月30日）
基金份额累计净值增长率	95.60%

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

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	2.09%	0.57%	0.83%	0.31%	1.26%	0.26%
过去三个月	-1.58%	0.64%	-0.26%	0.35%	-1.32%	0.29%
过去六个月	2.70%	0.64%	2.86%	0.34%	-0.16%	0.30%
过去一年	-5.58%	0.72%	-2.73%	0.40%	-2.85%	0.32%
过去三年	56.57%	1.06%	14.69%	0.52%	41.88%	0.54%
自基金合同生效起至今	95.60%	1.15%	56.94%	0.96%	38.66%	0.19%

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

前海开源基金管理有限公司（以下简称“前海开源基金”）于 2012 年 12 月 27 日经中国证监会批准，2013 年 1 月 23 日注册成立，截至报告期末，注册资本为 2 亿元人民币。其中，开源证券股份有限公司、北京市中盛金期投资管理有限公司、北京长和世纪资产管理有限公司和深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)各持股权 25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海、广州设立分公司。经中国证监会批准，前海开源基金全资控股子公司——前海开源资产管理有限公司已于 2013 年 9 月 5 日在深圳市注册成立，并于 2013 年 9 月 18 日取得中国证监会核发的《特定客户资产管理业务资格证书》，截至报告期末，注册资本为 1.8 亿元人民币。

截至报告期末，前海开源基金旗下管理 97 只开放式基金，资产管理规模超过 1121 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
易千	本基金的基金经理、公司投资副总监	2022 年 07 月 05 日	-	10 年	易千先生，财政部财政科学研究所财政学博士研究生。2005 年 7

					月至 2007 年 8 月任北京大学生命科学学院团委书记；2009 年 7 月至 2010 年 8 月任北京大学中国教育财政科学研究所研究部研究助理；2013 年 7 月至 2016 年 5 月，任华安财保资产管理有限责任公司固定收益部研究员；2016 年 5 月至 2022 年 3 月任银河金汇证券资产管理有限公司固定收益投资部投资经理。2022 年 3 月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司基金经理、投资副总监。
林汉耀	本基金的基金经理	2022 年 08 月 08 日	-	9 年	林汉耀先生，中山大学财政学硕士研究生。2014 年 7 月至 2015 年 3 月任招商基金管理有限公司基金核算部职员；2015 年 4 月加盟前海开源基金管理有限公司，历任交易员、研究员，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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，国内股票市场和可转债市场在年初快速上行后，呈现波动下行的走势。本基金基于对于中国权益市场的看好，上半年组合中股票和可转债均维持了较高的仓位，其中股票仓位在 19%以上，可转债仓位在 90%左右。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源可转债债券基金份额净值为 1.370 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 2.70%，同期业绩比较基准收益率为 2.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，中国宏观经济在一季度出现较好的复苏之后，二季度经济有所走弱，主要是由于一季度的补偿性修复之后，外需增速下行叠加国内需求较弱所致。我们预计二季度的宏观经济在环比数据上可能是全年的低点，后续三四季度或会有所好转，我们仍然认为经济恢复的路径继续沿着服务业恢复-失业率下降-居民收入及收入预期改善-消费支出增加-经济全面复苏的节奏在进行之中，我们已经看到今年一、二季度农村外出务工劳动力人数均创下同期历史新高，全社会总体失业率和居民消费倾向也处于逐步改善的过程之中。另外，外需以及国务院“推动经济持续回升向好的一批政策措施”可能逐步落地，以及工业企业库存快速去化阶段的结束，都会给三、四季度的经济带来一定的支撑。

从证券市场来看，随着宏观经济可能的复苏，以及美联储加息接近尾声，我们看好中国权益类

资产的表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会主席由总经理办公会指定，估值委员会成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的基金行业实践经验。

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

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-前海开源基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，前海开源基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的

行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，前海开源基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：前海开源可转债债券型发起式证券投资基金
报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	19,574,539.12	18,362,590.32
结算备付金		11,561,307.09	6,387,475.74
存出保证金		248,807.08	439,407.15
交易性金融资产	6.4.7.2	2,355,553,405.56	2,447,755,297.23
其中：股票投资		411,739,113.51	421,611,906.32
基金投资		-	-
债券投资		1,943,814,292.05	2,026,143,390.91
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		12,760,533.78	5,662,625.84
应收股利		-	-
应收申购款		380,244.73	567,637.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,400,078,837.36	2,479,175,033.75
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		310,058,287.12	285,135,185.83
应付清算款		9,740,842.15	-
应付赎回款		814,813.39	1,449,005.07
应付管理人报酬		1,710,281.75	1,885,071.60
应付托管费		342,056.35	377,014.35
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		18,173.55	17,720.99
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	601,013.95	438,892.08
负债合计		323,285,468.26	289,302,889.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,515,429,671.56	1,642,098,693.01
未分配利润	6.4.7.8	561,363,697.54	547,773,450.82
净资产合计		2,076,793,369.10	2,189,872,143.83
负债和净资产总计		2,400,078,837.36	2,479,175,033.75

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，前海开源可转债债券基金份额净值 1.370 元，基金份额总额 1,515,429,671.56 份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源可转债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日
一、营业总收入		96,112,471.72	-269,927,820.16
1. 利息收入		211,616.64	219,856.97
其中：存款利息收入	6.4.7.9	211,616.64	219,856.97
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,440,594.56	-138,342,808.48
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,871,331.16	-80,130,071.24
基金投资收益	6.4.7.11	-	-

债券投资收益	6.4.7.12	-4,151,524.14	-59,668,246.22
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	4,720,787.54	1,455,508.98
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	92,120,510.57	-132,764,475.43
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	339,749.95	959,606.78
减：二、营业总支出		19,017,939.78	18,031,284.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,851,027.38	12,917,286.83
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,370,205.43	2,583,457.41
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,664,599.51	2,391,724.99
其中：卖出回购金融资产支出		4,664,599.51	2,391,724.99
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		11,627.40	14,068.85
8. 其他费用	6.4.7.20	120,480.06	124,746.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		77,094,531.94	-287,959,104.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		77,094,531.94	-287,959,104.94
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		77,094,531.94	-287,959,104.94

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：前海开源可转债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,642,098,693.01	-	547,773,450.82	2,189,872,143.83
二、本期期初净资产（基金净值）	1,642,098,693.01	-	547,773,450.82	2,189,872,143.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-126,669,021.45	-	13,590,246.72	-113,078,774.73
（一）、综合收益总额	-	-	77,094,531.94	77,094,531.94
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-126,669,021.45	-	-63,504,285.22	-190,173,306.67

(净值减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	869,861,248.10	-	342,740,426.75	1,212,601,674.85
2. 基金赎回款	-996,530,269.55	-	-406,244,711.97	-1,402,774,981.52
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,515,429,671.56	-	561,363,697.54	2,076,793,369.10
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,794,007,112.29	-	1,035,798,388.22	2,829,805,500.51
二、本期期初净资产(基金净值)	1,794,007,112.29	-	1,035,798,388.22	2,829,805,500.51
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	327,509,855.50	-	-78,510,110.32	248,999,745.18
(一)、综合收益总额	-	-	-287,959,104.94	-287,959,104.94
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	327,509,855.50	-	209,448,994.62	536,958,850.12
其中：1. 基金申购款	1,945,664,202.53	-	872,459,772.79	2,818,123,975.32
2. 基金赎回款	-1,618,154,347.03	-	-663,010,778.17	-2,281,165,125.20
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,121,516,967.79	-	957,288,277.90	3,078,805,245.69

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

前海开源可转债债券型发起式证券投资基金(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[2014]108号《关于核准前海开源可转债债券型发起式证券投资基金募集的批复》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《前海开源可转债债券型发起式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147,769,483.56元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2014]02030005号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源可转债债券型发起式证券投资基金基金合同》于2014年3月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为147,792,458.95份基金份额,其中认购资金利息折合22,975.39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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为9,999,525.00基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源可转债债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金所投资的固定收益类资产包括可转债(含分离交易可转债)、公司债、金融债、企业债、国债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款等。本基金的投资组合比例为:对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%;投资于可转债(含分离交易可转债)的投资比例不低于非现金基金资产的80%;股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%;现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例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:中证可转换债券指数收益率 \times 70%+中证综合债指数收益率 \times 20%+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、《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》、《前海开源可转债债券型发起式证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的其他有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

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

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

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

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
活期存款	19,574,539.12
等于: 本金	19,570,386.08
加: 应计利息	4,153.04
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	19,574,539.12

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		450,546,791.77	-	411,739,113.51	-38,807,678.26
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,980,366,168.60	4,310,046.57	1,913,472,513.97	-71,203,701.20
	银行间市场	29,932,200.00	341,778.08	30,341,778.08	67,800.00
	合计	2,010,298,368.60	4,651,824.65	1,943,814,292.05	-71,135,901.20
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,460,845,160.37	4,651,824.65	2,355,553,405.56	-109,943,579.46

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	445.60
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	351,930.00
其中：交易所市场	351,705.00
银行间市场	225.00
应付利息	-
预提费用	248,638.35

合计	601,013.95
----	------------

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,642,098,693.01	1,642,098,693.01
本期申购	869,861,248.10	869,861,248.10
本期赎回（以“-”号填列）	-996,530,269.55	-996,530,269.55
本期末	1,515,429,671.56	1,515,429,671.56

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

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	595,838,372.75	-48,064,921.93	547,773,450.82
本期利润	-15,025,978.63	92,120,510.57	77,094,531.94
本期基金份额交易产生的变动数	-46,764,267.43	-16,740,017.79	-63,504,285.22
其中：基金申购款	311,729,722.02	31,010,704.73	342,740,426.75
基金赎回款	-358,493,989.45	-47,750,722.52	-406,244,711.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	534,048,126.69	27,315,570.85	561,363,697.54

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
	活期存款利息收入
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	83,926.44
其他	2,245.60
合计	211,616.64

6.4.7.10 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	466,172,722.17
减：交易费用	1,219,519.68

买卖股票差价收入	2,871,331.16
----------	--------------

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益--利息收入	6,721,781.54
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-10,873,305.68
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	-4,151,524.14

6.4.7.12.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,505,222,845.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,510,232,561.54
减：应计利息总额	5,685,825.17
减：交易费用	177,764.50
买卖债券差价收入	-10,873,305.68

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益--买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益—其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	4,720,787.54
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,720,787.54

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
1. 交易性金融资产	92,120,510.57
--股票投资	1,578,817.63
--债券投资	90,541,692.94
--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	92,120,510.57

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	336,570.04
转换费收入	3,179.91

合计	339,749.95
----	------------

6.4.7.19 信用减值损失

无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	7,341.71
账户维护费	9,000.00
合计	120,480.06

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
开源证券	-	-	1,039,936,093.05	66.90%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
开源证券	-	-	2,662,157,162.90	50.78%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
开源证券	-	-	955,000,000.00	22.91%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
开源证券	760,515.10	66.90%	230,561.93	60.02%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务

等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,851,027.38	12,917,286.83
其中：支付销售机构的客户维护费	3,782,613.35	4,762,913.71

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 1.00% 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×1.00%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,370,205.43	2,583,457.41

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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自有资金投资本基金的情况

无。

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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	19,574,539.12	125,444.60	27,134,226.41	150,256.08

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末 2023 年 06 月 30 日本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 310,058,287.12 元，于 2023 年 07 月 07 日先后到期。该类交易要求本基金在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于股票、债券等金融工具，在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理团队和相关业务部门构成的多层级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理团队负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	107,585,636.71	111,837,613.16
合计	107,585,636.71	111,837,613.16

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	578,385,772.77	673,948,092.11
AAA 以下	1,257,842,882.57	1,240,357,685.64
未评级	-	-
合计	1,836,228,655.34	1,914,305,777.75

注：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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 2023 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估

与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2023 年 6 月 30 日，本基金组合资产中经确认的当日净赎回金额未超过 7 个工作日可变现资产的账面价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年06月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	19,574,539.12	-	-	-	19,574,539.12
结算备付金	11,561,307.09	-	-	-	11,561,307.09
存出保证金	248,807.08	-	-	-	248,807.08
交易性金融资产	259,210,734.65	1,102,176,179.14	582,427,378.26	411,739,113.51	2,355,553,405.56
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	12,760,533.78	12,760,533.78
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	380,244.73	380,244.73
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	290,595,387.94	1,102,176,179.14	582,427,378.26	424,879,892.02	2,400,078,837.36
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	310,058,287.12	-	-	-	310,058,287.12
应付清算款	-	-	-	9,740,842.15	9,740,842.15
应付赎回款	-	-	-	814,813.39	814,813.39
应付管理人报酬	-	-	-	1,710,281.75	1,710,281.75
应付托管费	-	-	-	342,056.35	342,056.35
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	18,173.55	18,173.55
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	601,013.95	601,013.95
负债总计	310,058,287.12	-	-	13,227,181.14	323,285,468.26
利率敏感度缺口	-19,462,899.18	1,102,176,179.14	582,427,378.26	411,652,710.88	2,076,793,369.10
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	18,362,590.32	-	-	-	18,362,590.32
结算备付金	6,387,475.74	-	-	-	6,387,475.74
存出保证金	439,407.15	-	-	-	439,407.15
交易性金融资产	137,737,650.44	1,162,032,572.92	726,373,167.55	421,611,906.32	2,447,755,297.23
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融	-	-	-	-	-

资产					
应收清算款	-	-	-	5,662,625.84	5,662,625.84
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	567,637.47	567,637.47
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	162,927,123.65	1,162,032,572.92	726,373,167.55	427,842,169.63	2,479,175,033.75
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	285,135,185.83	-	-	-	285,135,185.83
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,449,005.07	1,449,005.07
应付管理人报酬	-	-	-	1,885,071.60	1,885,071.60
应付托管费	-	-	-	377,014.35	377,014.35
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	17,720.99	17,720.99
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	438,892.08	438,892.08
负债总计	285,135,185.83	-	-	4,167,704.09	289,302,889.92
利率敏感度缺口	-122,208,062.18	1,162,032,572.92	726,373,167.55	423,674,465.54	2,189,872,143.83

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2023年06月30日)	上年度末(2022年12月31日)

	市场利率增加 0.25%	-47,764.61	-84,761.46
	市场利率减少 0.25%	47,837.51	84,926.34

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	411,739,113.51	19.83	421,611,906.32	19.25
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	411,739,113.51	19.83	421,611,906.32	19.25

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变
----	----------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2023年06月30日)	上年度末(2022年12月31日)
	业绩比较基准上升 5%	20,092,734.05	24,657,032.00
	业绩比较基准下降 5%	-20,092,734.05	-24,657,032.00

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年末 2022年12月31日
第一层次	2,247,967,768.85	2,335,917,684.07
第二层次	107,585,636.71	111,837,613.16
第三层次	-	-
合计	2,355,553,405.56	2,447,755,297.23

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	411,739,113.51	17.16
	其中：股票	411,739,113.51	17.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,943,814,292.05	80.99
	其中：债券	1,943,814,292.05	80.99
	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	31,135,846.21	1.30
8	其他各项资产	13,389,585.59	0.56
9	合计	2,400,078,837.36	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	10,735,696.00	0.52
C	制造业	267,481,783.58	12.88
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	25,865,997.00	1.25

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,114,262.83	2.03
J	金融业	42,396,429.10	2.04
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	23,144,945.00	1.11
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	411,739,113.51	19.83

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	300059	东方财富	2,062,816	29,291,987.20	1.41
2	002415	海康威视	871,500	28,855,365.00	1.39
3	603707	健友股份	1,689,563	22,809,100.50	1.10
4	002841	视源股份	315,000	21,054,600.00	1.01
5	300124	汇川技术	292,100	18,755,741.00	0.90
6	600570	恒生电子	409,367	18,130,864.43	0.87
7	600584	长电科技	578,200	18,022,494.00	0.87
8	603986	兆易创新	166,200	17,658,750.00	0.85
9	600276	恒瑞医药	368,060	17,630,074.00	0.85
10	600309	万华化学	185,850	16,325,064.00	0.79
11	603882	金域医学	207,600	15,673,800.00	0.75
12	002709	天赐材料	354,172	14,588,344.68	0.70
13	002410	广联达	447,400	14,536,026.00	0.70
14	603997	继峰股份	936,300	13,389,090.00	0.64
15	601872	招商轮船	2,273,600	13,164,144.00	0.63
16	601601	中国太保	504,405	13,104,441.90	0.63
17	002352	顺丰控股	281,700	12,701,853.00	0.61

18	300760	迈瑞医疗	42,300	12,681,540.00	0.61
19	000887	中鼎股份	923,600	12,089,924.00	0.58
20	300408	三环集团	405,900	11,913,165.00	0.57
21	600988	赤峰黄金	797,600	10,735,696.00	0.52
22	601799	星宇股份	78,500	9,702,600.00	0.47
23	603899	晨光股份	212,300	9,477,072.00	0.46
24	300996	普联软件	307,732	9,447,372.40	0.45
25	002472	双环传动	219,928	7,983,386.40	0.38
26	300244	迪安诊断	291,500	7,471,145.00	0.36
27	603267	鸿远电子	97,500	6,366,750.00	0.31
28	600521	华海药业	333,900	6,147,099.00	0.30
29	600867	通化东宝	194,600	2,031,624.00	0.10

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	002415	海康威视	29,970,130.00	1.37
2	600276	恒瑞医药	24,282,053.00	1.11
3	002841	视源股份	22,648,022.00	1.03
4	300124	汇川技术	21,131,099.50	0.96
5	603986	兆易创新	17,841,271.00	0.81
6	600584	长电科技	17,836,610.00	0.81
7	600570	恒生电子	17,632,272.44	0.81
8	300760	迈瑞医疗	17,503,053.00	0.80
9	000333	美的集团	16,263,730.00	0.74
10	002410	广联达	16,112,977.60	0.74
11	002352	顺丰控股	16,031,098.47	0.73
12	603882	金域医学	15,474,189.00	0.71
13	300452	山河药辅	15,215,633.30	0.69
14	601601	中国太保	14,944,068.70	0.68
15	300408	三环集团	12,384,833.00	0.57
16	600436	片仔癀	11,540,352.00	0.53
17	603899	晨光股份	11,471,749.00	0.52
18	601117	中国化学	11,174,995.00	0.51
19	600309	万华化学	10,581,740.00	0.48
20	300996	普联软件	10,497,444.09	0.48

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	002555	三七互娱	34,098,699.98	1.56
2	600938	中国海油	28,661,025.86	1.31
3	601128	常熟银行	20,958,400.00	0.96
4	600150	中国船舶	19,202,801.00	0.88
5	601058	赛轮轮胎	17,705,960.00	0.81
6	000333	美的集团	16,698,507.00	0.76
7	300452	山河药辅	16,367,714.00	0.75
8	601601	中国太保	15,558,018.00	0.71
9	601111	中国国航	15,444,476.00	0.71
10	002155	湖南黄金	15,266,362.66	0.70
11	600309	万华化学	15,105,621.00	0.69
12	000683	远兴能源	14,250,943.00	0.65
13	300803	指南针	13,114,694.00	0.60
14	601899	紫金矿业	13,058,744.00	0.60
15	300973	立高食品	12,475,251.00	0.57
16	002812	恩捷股份	11,887,900.00	0.54
17	600436	片仔癀	11,859,668.54	0.54
18	300558	贝达药业	11,166,539.00	0.51
19	300760	迈瑞医疗	11,154,488.00	0.51
20	002129	TCL 中环	10,081,314.00	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	454,721,111.73
卖出股票收入（成交）总额	470,263,573.01

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	107,585,636.71	5.18
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）	1,836,228,655.34	88.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,943,814,292.05	93.60

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	132018	G 三峡 EB1	1,015,000	143,988,873.28	6.93
2	113050	南银转债	1,170,000	131,723,921.10	6.34
3	110053	苏银转债	806,910	101,441,630.20	4.88
4	110079	杭银转债	860,000	98,912,746.85	4.76
5	113052	兴业转债	700,000	71,199,147.94	3.43

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前

一年内受到公开谴责、处罚说明

报告期末，本基金投资的前十名证券除“兴业转债（证券代码 113052）”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	248,807.08
2	应收清算款	12,760,533.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	380,244.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,389,585.59

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	143,988,873.28	6.93
2	113050	南银转债	131,723,921.10	6.34
3	110053	苏银转债	101,441,630.20	4.88
4	110079	杭银转债	98,912,746.85	4.76
5	113052	兴业转债	71,199,147.94	3.43
6	113025	明泰转债	45,235,984.93	2.18
7	113582	火炬转债	41,731,786.04	2.01
8	113534	鼎胜转债	35,765,443.29	1.72
9	113618	美诺转债	31,468,719.98	1.52
10	113063	赛轮转债	31,245,604.81	1.50
11	113626	伯特转债	30,645,942.22	1.48
12	111010	立昂转债	30,400,467.70	1.46
13	110090	爱迪转债	29,289,701.10	1.41
14	128141	旺能转债	28,825,620.11	1.39
15	128109	楚江转债	28,627,059.18	1.38

16	123085	万顺转 2	28,305,753.92	1.36
17	113656	嘉诚转债	27,138,455.70	1.31
18	123156	博汇转债	26,625,734.67	1.28
19	110074	精达转债	25,402,672.24	1.22
20	113653	永 22 转债	24,033,206.45	1.16
21	123078	飞凯转债	22,435,767.55	1.08
22	110089	兴发转债	21,683,083.38	1.04
23	113640	苏利转债	21,552,391.23	1.04
24	111007	永和转债	20,140,939.73	0.97
25	123107	温氏转债	20,120,483.59	0.97
26	127065	瑞鹄转债	19,816,701.92	0.95
27	113658	密卫转债	19,692,444.42	0.95
28	123103	震安转债	19,515,920.39	0.94
29	113647	禾丰转债	18,468,180.90	0.89
30	123164	法本转债	18,252,170.31	0.88
31	128144	利民转债	18,052,854.24	0.87
32	127058	科伦转债	17,355,193.51	0.84
33	118011	银微转债	17,314,905.20	0.83
34	113051	节能转债	15,778,016.28	0.76
35	113654	永 02 转债	15,207,238.72	0.73
36	113637	华翔转债	14,812,927.72	0.71
37	118027	宏图转债	14,506,256.22	0.70
38	123150	九强转债	14,225,109.59	0.68
39	113648	巨星转债	13,881,810.96	0.67
40	118004	博瑞转债	13,625,871.75	0.66
41	111008	沿浦转债	13,127,511.84	0.63
42	127043	川恒转债	12,984,824.19	0.63
43	123131	奥飞转债	12,901,738.41	0.62
44	118018	瑞科转债	12,659,511.62	0.61
45	127064	杭氧转债	12,343,815.89	0.59
46	113545	金能转债	12,332,041.76	0.59
47	123115	捷捷转债	12,053,394.33	0.58
48	113064	东材转债	12,044,633.42	0.58
49	113660	寿 22 转债	11,864,838.52	0.57
50	127049	希望转 2	10,998,969.81	0.53
51	127030	盛虹转债	10,830,998.02	0.52
52	118022	锂科转债	10,630,542.99	0.51
53	127077	华宏转债	10,518,033.90	0.51
54	118012	微芯转债	9,893,723.01	0.48
55	113059	福莱转债	9,593,282.19	0.46
56	118024	冠宇转债	9,472,441.02	0.46

57	113045	环旭转债	9,107,007.03	0.44
58	127045	牧原转债	8,266,976.99	0.40
59	118006	阿拉转债	8,226,647.19	0.40
60	113504	艾华转债	7,636,224.66	0.37
61	113662	豪能转债	7,616,007.45	0.37
62	113663	新化转债	7,328,037.99	0.35
63	118009	华锐转债	6,962,058.88	0.34
64	127053	豪美转债	6,954,412.87	0.33
65	123166	蒙泰转债	6,723,093.23	0.32
66	113657	再 22 转债	6,638,714.73	0.32
67	127028	英特转债	6,587,397.26	0.32
68	123165	回天转债	6,308,377.47	0.30
69	127038	国微转债	5,614,304.66	0.27
70	127040	国泰转债	4,388,802.24	0.21
71	118007	山石转债	2,542,899.18	0.12
72	118029	富淼转债	2,234,634.47	0.11
73	123127	耐普转债	866,506.19	0.04

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

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
86,462	17,527.12	517,385,961.22	34.14%	998,043,710.34	65.86%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	511,397.10	0.0337%

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	50~100

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总 数	持有份额占基 金总份额比例	发起份额 总数	发起份额占基金 总份额比例	发起份额承诺持 有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	506,088.17	0.03%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	5,308.93	0.00%	-	-	-
合计	511,397.10	0.03%	-	-	-

注：1、上述份额总数为扣除认购费用并包含利息结转份额后的总份额数。

2、本基金发起式资金提供方仅为基金管理人，基金管理人高级管理人员、基金经理、基金管理人股东、其他从业人员持有的基金份额不属于发起份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年03月25日）基金份额总额	147,792,458.95
本报告期期初基金份额总额	1,642,098,693.01
本报告期基金总申购份额	869,861,248.10
减：本报告期基金总赎回份额	996,530,269.55
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,515,429,671.56

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

本报告期内基金托管人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

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	
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	453,229,237.61	49.00%	331,446.42	49.00%	-
东吴证券	1	203,703,754.78	22.02%	148,969.02	22.02%	-
东兴证券	1	268,051,692.35	28.98%	196,021.96	28.98%	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	3	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-

中国国际金融	2	-	-	-	-
中国银河证券	2	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-

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

A：选择标准

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

B：选择流程

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	1,312,51	27.99%	95,000,	0.94%	-	-	-	-

富证券	9,519.49		000.00					
东吴证 券	1,276,65 1,190.85	27.23%	5,004,0 00,000. 00	49.43%	-	-	-	-
东兴证 券	2,099,96 1,114.57	44.78%	5,025,0 00,000. 00	49.63%	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银 河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	前海开源可转债债券型发起式证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023年01月20日
2	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金定期定额投资业务起点金额的公告	中国证监会规定媒介	2023年02月08日
3	前海开源可转债债券型发起式证券投资	中国证监会规定媒介	2023年03月31日

	基金 2022 年年度报告		
4	前海开源基金管理有限公司关于变更公司官方电子直销交易平台 APP 名称的公告	中国证监会规定媒介	2023年03月31日
5	前海开源可转债债券型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023年04月22日
6	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过蚂蚁（杭州）基金销售有限公司办理业务最低限额的公告	中国证监会规定媒介	2023年05月04日
7	关于旗下部分基金增加广东顺德农村商业银行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	2023年05月12日
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上海中欧财富基金销售有限公司办理业务最低限额的公告	中国证监会规定媒介	2023年05月15日
9	关于旗下部分基金增加杭州银行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	2023年06月08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

无。

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可转债债券型发起式证券投资基金设立的文件
- (2) 《前海开源可转债债券型发起式证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源可转债债券型发起式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) 前海开源可转债债券型发起式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

前海开源基金管理有限公司
2023 年 08 月 31 日