

新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:新疆前海联合基金管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 月 29 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年08月21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2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....1

1.1 重要提示1

1.2 目录.....2

§ 2 基金简介.....6

2.1 基金基本情况6

2.2 基金产品说明6

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

3.3 其他指标9

§ 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合规守信情况的说明11

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	14
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 半年度财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
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	39
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	41
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	41
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	41
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	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 盈利投资者数量占比	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.4 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	44
§ 10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
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	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	45
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	45
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	新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	前海联合添瑞一年持有混合	
基金主代码	011290	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 04 月 20 日	
基金管理人	新疆前海联合基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,382,457.17 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海联合添瑞一年持有混合 A	前海联合添瑞一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	011290	011291
报告期末下属分级基金的份额总额	3,074,669.80 份	1,307,787.37 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用多因素分析框架，从宏观经济环境、政策因素、市场利率水平、市场投资价值、资金供求因素、证券市场走势等方面，对各类市场的投资机会和风险特征等因素进行综合研判，在固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间进行比例配置并对配置比例进行动态调整，以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

注：基金管理人对本基金的风险等级评价结果以公司官网最新披露的旗下基金产品风险等级评价说明为准。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新疆前海联合基金管 理有限公司	中国邮政储蓄银行股 份有限公司
信息披露负责人	姓名	郑妍	张立学
	联系电话	0755-82780666	010-68858126
	电子邮箱	service@qhlhfund.co m	zhanglixue@psbcoa.c om.cn

客户服务热线	400-640-0099	95580
传真	0755-82780000	010-86353609
注册地址	新疆乌鲁木齐经济技术开发区维泰南路 1 号维泰大厦 1506 室	北京市西城区金融大街 3 号
办公地址	深圳市南山区桂湾四路 197 号前海华润金融中心 T1 栋第 28 和 29 层	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码	518057	100808
法定代表人	贺国灵	郑国雨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.qhlhfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人办公地址及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	新疆前海联合基金管理有限公司	深圳市南山区桂湾四路 197 号前海华润金融中心 T1 栋第 28 和 29 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	前海联合添瑞一年持有混合 A	前海联合添瑞一年持有混合 C
本期已实现收益	-104,156.14	-48,661.52
本期利润	88,676.28	38,283.78
加权平均基金份额本期利润	0.0256	0.0249
本期加权平均净值利润率	2.72%	2.70%
本期基金份额净值增长率	3.00%	2.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-337,487.70	-171,442.10
期末可供分配基金份额利润	-0.1098	-0.1311
期末基金资产净值	2,974,654.31	1,235,912.18
期末基金份额净值	0.9675	0.9450
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	

基金份额累计净值增长率	-3.25%	-5.50%
-------------	--------	--------

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海联合添瑞一年持有混合 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	5.61%	0.55%	2.86%	0.26%	2.75%	0.29%
过去六个月	3.00%	0.51%	2.33%	0.23%	0.67%	0.28%
过去一年	1.12%	0.38%	4.56%	0.20%	-3.44%	0.18%
过去三年	-2.48%	0.33%	10.44%	0.21%	-12.92%	0.12%
过去五年	-3.89%	0.31%	7.04%	0.22%	-10.93%	0.09%
自基金合同生效起至今	-3.25%	0.31%	7.86%	0.22%	-11.11%	0.09%

前海联合添瑞一年持有混合 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	5.48%	0.55%	2.86%	0.26%	2.62%	0.29%
过去六个月	2.76%	0.51%	2.33%	0.23%	0.43%	0.28%
过去一年	0.65%	0.38%	4.56%	0.20%	-3.91%	0.18%
过去三年	-3.81%	0.33%	10.44%	0.21%	-14.25%	0.12%
过去五年	-6.04%	0.31%	7.04%	0.22%	-13.08%	0.09%
自基金合同生效起至今	-5.50%	0.30%	7.86%	0.22%	-13.36%	0.08%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%。

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

前海联合添瑞一年持有混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年04月20日-2026年06月30日)



前海联合添瑞一年持有混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年04月20日-2026年06月30日)



3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

新疆前海联合基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监许可【2015】1842 号文批准，于 2015 年 8 月 7 日成立。公司注册资本 4.00 亿元人民币，公司股东为上海证券有限责任公司，持股比例为 100%。本公司总部位于广东省深圳市，已设立上海分公司、北京分公司、深圳分公司。本公司经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，本公司旗下共管理 30 只产品，包括货币型、债券型、混合型和 FOF 等类型。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孟晓婧	本基金的基金 经理	2022-08-05	-	15 年	孟晓婧女士， 中国人民银行 金融研究所硕 士，15 年证 券基金投资研 究经验。曾任 安邦保险资产 管理有限公司 投资部行业研 究员、世纪证 券有限责任公 司研究所行业 分析师、前海 人寿保险股份 有限公司资产 管理中心行业 研究员和新疆 前海联合基金 管理有限公司 专户投资部投 资经理、新疆 前海联合添利 债券型发起式 证券投资基金 基金经理 （自 2022 年 7 月 29 日起 至 2026 年 3 月 30 日）。现 任新疆前海联 合添瑞一年持 有期混合型证

					券投资基金基金经理（自 2022 年 8 月 5 日起任职）。
--	--	--	--	--	---------------------------------

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

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2026 年上半年，国内宏观经济总体呈现总量承压、结构分化、新动能持续培育壮大的格局。需求端，固定资产投资整体偏弱；高技术服务业、电子设备制造业投资具备较强韧性，新兴动

能持续发力。外贸运行表现亮眼，出口维持较高增速，高端产业链出口扩张叠加大宗商品价格因素共同支撑外贸保持强势。消费复苏节奏偏缓，社零增速有所回落，居民消费意愿趋于谨慎。供给端，工业整体增速有所下行，传统制造业、采矿业增长动能减弱，高技术制造业延续较高景气。物价维度，CPI 温和低位修复，核心通胀小幅改善；PPI 受上游原材料价格带动明显回升。展望下半年，伴随中东油气供给修复，PPI 环比涨幅或边际回落。整体判断，下半年宏观经济或延续外强内弱格局，依托新质生产力发展与“十五五”规划相关政策落地，经济有望迎来温和修复。

债券市场方面，债市迎来超预期上涨行情，10 年期国债收益率先震荡上行后持续下行，阶段低点一度触及 1.70%。1-2 月中旬，股债相关性有所弱化，市场流动性宽松预期升温。2 月下旬至 3 月，美伊地缘冲突推升通胀预期，两会政策预期平稳落地，流动性维持宽松环境持续托底市场。4-5 月，美伊紧张局势缓和，国内基本面边际走弱，资金面保持相对宽松。6 月以来，央行加大流动性回笼力度，市场对于资金环境的预期进入重新校准阶段。（数据来源：Wind）

权益市场结构性特征突出，AI 上游板块领涨，行情呈现极致分化特征。1 月市场年初短暂上行后，市场投机情绪逐步降温，行情由短期躁动转入休整。2 月，受美联储人事调整、大宗商品下跌带来的流动性冲击影响，市场震荡调整，春节后逐步企稳反弹，“算电协同”与资源品涨价成为两条核心投资主线。3 月，中东地缘风险升级引发市场新一轮风险偏好下修，市场成交显著萎缩。4 月中下旬，外部扰动逐步缓和，前期压抑的做多情绪集中释放，创业板指带领市场普涨，通信、电子等算力硬件板块强势领涨，科技赛道抱团格局初步形成。进入 5 月，市场行情演化为极致的“算力虹吸”，资金在 AI 主线内部高度博弈，传统行业持续面临资金分流压力。6 月，高位抱团筹码出现松动，资金在机器人、物理 AI、半导体材料等方向快速轮动博弈。

报告期内，本基金权益资产聚焦半导体、机器人等具备长期成长产业逻辑、基本面质地优良的标的进行布局，为基金净值创造正向收益；纯债资产方面，结合市场利率走势择机拉长组合久期，把握利率下行行情收益；可转债保持稳健配置，为投资组合提供风险对冲。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合添瑞一年持有混合 A 基金份额净值为 0.9675 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 3.00%，同期业绩比较基准收益率为 2.33%；截至报告期末前海联合添瑞一年持有混合 C 基金份额净值为 0.9450 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.76%，同期业绩比较基准收益率为 2.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，伴随中东油气供给修复，PPI 环比涨幅或边际回落。整体判断，下半年宏观经济或延续外强内弱格局，依托新质生产力发展与“十五五”规划相关政策落地，经济有望迎来温和修复。权益市场重点聚焦海内外货币政策周期变化及 AI 产业演进主线。AI 产业层面，北美科技企业资本开支维持高位，AI 基础设施建设需求持续扩张。国内 AI 产业链以硬件环节为核心，充分受益于海外巨头资本开支扩张，行业景气度有望延续上行态势。债券市场或将进入低收益、低风险的新生态格局。流动性持续宽松、机构配置需求构成利率上限，股债跷跷板冲击、经济韧性、货币政策加码空间有限构成利率下限，把握波段行情相对占优。可转债市场预计跟随权益市场震荡走

强，但整体估值性价比有所回落，行情结构性分化加剧，后续将重点依托精细化个券研究挖掘超额收益。

本基金将根据市场变化，在基金合同约定范围内动态调整股票、可转债及利率债相关仓位。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 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

截至本报告期末，本基金基金资产净值连续 60 个工作日以上低于 5000 万元。本基金管理人已向证监会报告持续运作本基金。

报告期内，本基金的信息披露费、审计费、银行间账户维护费等固定费用由本基金管理人支付承担。

§ 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

报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	159,320.18	170,183.59
结算备付金		16,329.85	47,474.94
存出保证金		4,346.92	2,446.33
交易性金融资产	6.4.7.2	3,636,712.18	4,054,991.97
其中：股票投资		1,024,217.00	385,519.00
基金投资		-	-
债券投资		2,612,495.18	3,669,472.97
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	400,000.00	799,897.54
应收清算款		19.34	20,041.78
应收股利		-	-
应收申购款		147.90	139.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		4,216,876.37	5,095,176.14
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		10.07	19,186.36
应付管理人报酬		2,737.81	3,512.45
应付托管费		684.48	878.11
应付销售服务费		453.46	603.86
应付投资顾问费		-	-
应交税费		41.66	6.49
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,382.40	2,074.43
负债合计		6,309.88	26,261.70
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	4,382,457.17	5,432,468.31
未分配利润	6.4.7.8	-171,890.68	-363,553.87
净资产合计		4,210,566.49	5,068,914.44
负债和净资产总计		4,216,876.37	5,095,176.14

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 4,382,457.17 份。其中前海联合添瑞一年持有混合 A 基金份额净值 0.9675 元，基金份额总额 3,074,669.80 份；前海联合添瑞一年持有混合 C 基金份额净值 0.9450 元，基金份额总额 1,307,787.37 份。

6.2 利润表

会计主体：新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		153,416.09	42,426.97
1. 利息收入		2,799.95	16,957.35
其中：存款利息收入	6.4.7.9	713.70	4,029.97
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		2,086.25	12,927.38
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		-129,161.58	-51,635.95
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-135,478.84	-111,259.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	4,798.56	60,088.16
资产支持证券 投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收 益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,518.70	-465.00
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填 列）	6.4.7.16	279,777.72	77,105.57
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	6.4.7.17	-	-
减：二、营业总支出		26,456.03	43,027.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	18,607.33	30,647.94
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,651.88	7,662.07
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,175.29	4,715.72
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融 资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		21.53	2.16
8. 其他费用	6.4.7.19	-	-

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		126,960.06	-600.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		126,960.06	-600.92
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		126,960.06	-600.92

6.3 净资产变动表

会计主体：新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,432,468.31	-363,553.87	5,068,914.44
二、本期期初净资产	5,432,468.31	-363,553.87	5,068,914.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,050,011.14	191,663.19	-858,347.95
（一）、综合收益总额	-	126,960.06	126,960.06
（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）	-1,050,011.14	64,703.13	-985,308.01
其中：1. 基金申购款	80,258.22	-5,799.97	74,458.25
2. 基金赎回款	-1,130,269.36	70,503.10	-1,059,766.26
（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	4,382,457.17	-171,890.68	4,210,566.49
项 目	上年度可比期间		
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	8,706,124.92	-416,202.44	8,289,922.48
二、本期期初净资产	8,706,124.92	-416,202.44	8,289,922.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,136,967.75	50,892.75	-1,086,075.00

(一)、综合收益总额	-	-600.92	-600.92
(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)	-1,136,967.75	51,493.67	-1,085,474.08
其中: 1. 基金申购款	69,186.66	-4,167.96	65,018.70
2. 基金赎回款	-1,206,154.41	55,661.63	-1,150,492.78
(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	7,569,157.17	-365,309.69	7,203,847.48

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:

贺国灵	党刚	陈艳
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3635号文《关于准予新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》进行募集,由新疆前海联合基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金基金合同》及其他法律法规公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次募集期间为2021年2月22日至2021年4月16日,首次发售募集的有效认购资金扣除认购费用的净认购金额为人民币220,152,099.03元;有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币39,413.55元,折合为39,413.55份基金份额。以上金额共计人民币220,191,512.58元,经致同会计师事务所(特殊普通合伙)致同验字(2021)第441C000187号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2021年4月20日正式生效。本基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司,托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

本基金根据认(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。收取认购费/申购费并根据持有期限收取赎回费,不收取销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;收取销售服务费并根据持有期限收取赎回费,不收取认购费/申购费的基金份额,称为C类基金份额;本基金A类基金份额、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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市的股票(包括主

板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、政府支持机构债券、政府支持债券、证券公司短期公司债券及其他中国证监会允许基金投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、国债期货、股指期货、信用衍生品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的相关规定)。本基金股票投资占基金资产比例为 0-40%。每个交易日日终在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%。

本财务报表由本基金的基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司于 2026 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》,中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定：资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

(4) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2026 年 06 月 30 日
活期存款	159,320.18
等于：本金	159,294.64
加：应计利息	25.54
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	159,320.18

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		749,036.67	-	1,024,217.00	275,180.33
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,611,281.37	11,879.68	2,612,495.18	-10,665.87
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,611,281.37	11,879.68	2,612,495.18	-10,665.87
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,360,318.04	11,879.68	3,636,712.18	264,514.46

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	400,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	400,000.00	-

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 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	2,382.40
其中：交易所市场	2,382.40
银行间市场	-
应付利息	-
合计	2,382.40

6.4.7.7 实收基金

前海联合添瑞一年持有混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,719,685.39	3,719,685.39
本期申购	23,469.10	23,469.10
本期赎回（以“-”号填列）	-668,484.69	-668,484.69
本期末	3,074,669.80	3,074,669.80

前海联合添瑞一年持有混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,712,782.92	1,712,782.92
本期申购	56,789.12	56,789.12
本期赎回（以“-”号填列）	-461,784.67	-461,784.67
本期末	1,307,787.37	1,307,787.37

注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

前海联合添瑞一年持有混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-301,158.47	75,354.46	-225,804.01
本期期初	-301,158.47	75,354.46	-225,804.01
本期利润	-104,156.14	192,832.42	88,676.28
本期基金份额交易产生的变动数	67,826.91	-30,714.67	37,112.24
其中：基金申购款	-2,088.39	846.21	-1,242.18
基金赎回款	69,915.30	-31,560.88	38,354.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-337,487.70	237,472.21	-100,015.49

前海联合添瑞一年持有混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-172,748.49	34,998.63	-137,749.86
本期期初	-172,748.49	34,998.63	-137,749.86
本期利润	-48,661.52	86,945.30	38,283.78
本期基金份额交易产生的变动数	49,967.91	-22,377.02	27,590.89
其中：基金申购款	-6,415.28	1,857.49	-4,557.79
基金赎回款	56,383.19	-24,234.51	32,148.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-171,442.10	99,566.91	-71,875.19

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	613.65
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	92.82
其他	7.23
合计	713.70

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	5,140,720.00
减：卖出股票成本总额	5,267,906.33
减：交易费用	8,292.51
买卖股票差价收入	-135,478.84

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	27,412.70
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-22,614.14
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	4,798.56
----	----------

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,638,466.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,637,523.50
减：应计利息总额	23,544.24
减：交易费用	12.51
买卖债券差价收入	-22,614.14

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,518.70
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	1,518.70

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	279,777.72
——股票投资	250,737.33
——债券投资	29,040.39
——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	279,777.72

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 信用减值损失

无。

6.4.7.19 其他费用

无。

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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
新疆前海联合基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	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

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	18,607.33	30,647.94
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,257.47	14,803.62
应支付基金管理人的净管理费	9,349.86	15,844.32

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%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 × 0.80% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,651.88	7,662.07

注：支付基金托管人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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合添瑞一年持	前海联合添瑞一年持	合计

	有混合 A	有混合 C	
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	581.64	581.64
合计	-	581.64	581.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合添瑞一年持有混合 A	前海联合添瑞一年持有混合 C	合计
新疆前海联合基金管理有限公司	-	1.11	1.11
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	1,275.69	1,275.69
合计	-	1,276.80	1,276.80

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 0.45% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。销售服务费的计算公式为：
日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.45% / 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

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	上年度可比期间
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月

	30 日		30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	159,320.18	613.65	2,495,498.11	3,748.03

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

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（2026 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

本基金投资于基金合同和相关法律法规及监管机构允许范围内的投资品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，通过积极主动的投资

管理，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。

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

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

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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在基金管理人已进行充分内部研究的信用等级较高的商业银行。对于定期银行存款，本基金通过选择具备适当信用水平的银行作为交易对手、平衡信用风险与投资收益率、综合参考内外部信用评级信息评价及调整投资限额，管理相关信用风险并定期评估减值损失。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,107,130.11	909,510.25
合计	1,107,130.11	909,510.25

注：1、短期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债。

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	222,119.15	343,171.91
AAA 以下	222,755.18	154,100.64
未评级	1,060,490.74	2,262,690.17
合计	1,505,365.07	2,759,962.72

注：1、长期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债。

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管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，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。

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人根据前述法规要求对基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等进行监控，以防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者

赎回需求的匹配与平衡。

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，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因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度缺口进行监控，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 2026 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	159,320.18	-	-	-	159,320.18
结算备付金	16,329.85	-	-	-	16,329.85
存出保证金	4,346.92	-	-	-	4,346.92
交易性金融资产	1,552,004.44	-	1,060,490.74	1,024,217.00	3,636,712.18
买入返售金融资产	400,000.00	-	-	-	400,000.00
应收清算款	-	-	-	19.34	19.34
应收申购款	-	-	-	147.90	147.90

资产总计	2,132,001.39	-	1,060,490.74	1,024,384.24	4,216,876.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	10.07	10.07
应付管理人报酬	-	-	-	2,737.81	2,737.81
应付托管费	-	-	-	684.48	684.48
应付销售服务费	-	-	-	453.46	453.46
应交税费	-	-	-	41.66	41.66
其他负债	-	-	-	2,382.40	2,382.40
负债总计	-	-	-	6,309.88	6,309.88
利率敏感度缺口	2,132,001.39	-	1,060,490.74	1,018,074.36	4,210,566.49
上年度末 2025 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	170,183.59	-	-	-	170,183.59
结算备付金	47,474.94	-	-	-	47,474.94
存出保证金	2,446.33	-	-	-	2,446.33
交易性金融资产	1,406,782.80	-	2,262,690.17	385,519.00	4,054,991.97
买入返售金融资产	799,897.54	-	-	-	799,897.54
应收清算款	-	-	-	20,041.78	20,041.78
应收申购款	-	-	-	139.99	139.99
资产总计	2,426,785.20	-	2,262,690.17	405,700.77	5,095,176.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	19,186.36	19,186.36
应付管理人报酬	-	-	-	3,512.45	3,512.45
应付托管费	-	-	-	878.11	878.11
应付销售服务费	-	-	-	603.86	603.86
应交税费	-	-	-	6.49	6.49
其他负债	-	-	-	2,074.43	2,074.43
负债总计	-	-	-	26,261.70	26,261.70
利率敏感度缺口	2,426,785.20	-	2,262,690.17	379,439.07	5,068,914.44

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1. 市场利率下降 25 个基点	43,736.06	68,035.89
	2. 市场利率上升 25 个基点	-41,770.26	-65,418.13

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动而发生波动的风险。本基金持有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, 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。

本基金面临的整体其他价格风险列示如下:

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 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 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	1,024,217.00	24.32	385,519.00	7.61
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	1,024,217.00	24.32	385,519.00	7.61

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1. 沪深 300 指数上升 5%	67,396.64	21,953.87
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-67,396.64	-21,953.87

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	1,469,091.33	882,791.55
第二层次	2,167,620.85	3,172,200.42
第三层次	-	-
合计	3,636,712.18	4,054,991.97

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资, 若出现交易不活跃、新发未上市和非公开发行等情况, 本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次, 并根据估值调整中采用的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, 确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	1,024,217.00	24.29
	其中：股票	1,024,217.00	24.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,612,495.18	61.95
	其中：债券	2,612,495.18	61.95
	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	400,000.00	9.49
	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	175,650.03	4.17
8	其他各项资产	4,514.16	0.11
9	合计	4,216,876.37	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	741,504.00	17.61
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	124,615.00	2.96
J	金融业	158,098.00	3.75
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	1,024,217.00	24.32

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

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	占基金资产净值比例(%)
1	688396	华润微	1,000	97,550.00	2.32
2	002436	兴森科技	1,900	96,805.00	2.30
3	002747	埃斯顿	2,400	89,592.00	2.13
4	002371	北方华创	100	88,456.00	2.10
5	688017	绿的谐波	200	83,572.00	1.98
6	600030	中信证券	2,400	68,952.00	1.64
7	600184	光电股份	1,800	57,618.00	1.37
8	300613	富瀚微	600	48,048.00	1.14
9	002353	杰瑞股份	300	45,750.00	1.09
10	300059	东方财富	2,200	44,836.00	1.06
11	300806	斯迪克	400	44,800.00	1.06
12	600999	招商证券	2,100	44,310.00	1.05
13	300031	宝通科技	1,400	39,998.00	0.95
14	000733	振华科技	700	39,648.00	0.94
15	603063	禾望电气	700	37,023.00	0.88

16	002174	游族网络	2,900	36,569.00	0.87
17	600703	三安光电	1,500	31,830.00	0.76
18	601138	工业富联	400	28,860.00	0.69

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	603288	海天味业	198,172.00	3.91
2	600256	广汇能源	169,252.00	3.34
3	300274	阳光电源	158,038.00	3.12
4	002371	北方华创	151,760.00	2.99
5	600276	恒瑞医药	135,261.00	2.67
6	002594	比亚迪	132,112.00	2.61
7	002273	水晶光电	130,176.00	2.57
8	002597	金禾实业	100,944.00	1.99
9	603345	安井食品	98,640.00	1.95
10	300009	安科生物	98,325.00	1.94
11	603505	金石资源	98,050.00	1.93
12	688041	海光信息	96,436.00	1.90
13	300613	富瀚微	94,980.00	1.87
14	603368	柳药集团	93,850.00	1.85
15	002791	坚朗五金	91,694.00	1.81
16	002475	立讯精密	90,308.00	1.78
17	600233	圆通速递	87,900.00	1.73
18	002352	顺丰控股	86,856.00	1.71
19	603619	中曼石油	85,224.00	1.68
20	600009	上海机场	82,250.00	1.62

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	603288	海天味业	190,944.00	3.77
2	600256	广汇能源	148,764.00	2.93
3	300274	阳光电源	141,158.00	2.78
4	002594	比亚迪	127,663.00	2.52
5	300699	光威复材	126,496.00	2.50
6	600276	恒瑞医药	125,833.00	2.48

7	002371	北方华创	117,828.00	2.32
8	002273	水晶光电	117,696.00	2.32
9	002597	金禾实业	109,920.00	2.17
10	603345	安井食品	106,020.00	2.09
11	688041	海光信息	100,428.00	1.98
12	002475	立讯精密	100,070.00	1.97
13	603505	金石资源	95,450.00	1.88
14	300009	安科生物	94,810.00	1.87
15	603368	柳药集团	90,500.00	1.79
16	300661	圣邦股份	89,817.00	1.77
17	002791	坚朗五金	86,830.00	1.71
18	600233	圆通速递	84,100.00	1.66
19	002352	顺丰控股	82,852.00	1.63
20	600009	上海机场	79,500.00	1.57

注：卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	5,655,867.00
卖出股票收入（成交）总额	5,140,720.00

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

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	2,167,620.85	51.48
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)	444,874.33	10.57
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,612,495.18	62.05

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	019827	26 国债 01	11,000	1,107,130.11	26.29
2	019744	24 特国 02	8,000	846,819.29	20.11
3	113052	兴业转债	1,930	222,119.15	5.28
4	019742	24 特国 01	2,000	213,671.45	5.07
5	113659	莱克转债	670	85,073.11	2.02

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

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受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

兴业转债发债主体受到监管部门处罚情况：

(1) 2025 年 12 月 5 日，因外包机构管理不到位、企业划型不准确等，兴业银行被国家金融监管总局罚款 720 万元。

(2) 兴业银行杭州分行、重庆分行、海口分行、大连分行、广州分行等多家分支机构，因未依法履行职责、违规经营、提供虚假资料证明文件等，被当地国家金融监管局、外汇管理局、央行

分行等监管机构处以罚款。

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

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

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	4,346.92
2	应收清算款	19.34
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	147.90
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,514.16

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	113052	兴业转债	222,119.15	5.28
2	113659	莱克转债	85,073.11	2.02
3	113633	科沃转债	40,062.31	0.95
4	118044	赛特转债	25,656.56	0.61
5	113666	爱玛转债	24,134.16	0.57
6	128134	鸿路转债	23,744.33	0.56
7	111018	华康转债	22,864.53	0.54
8	127089	晶澳转债	1,220.18	0.03

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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
前海联合添瑞一年持有混合 A	248	12,397.86	191.51	0.01%	3,074,478.29	99.99%
前海联合添瑞一年持有混合 C	821	1,592.92	194.10	0.01%	1,307,593.27	99.99%
合计	1,032	4,246.57	385.61	0.01%	4,382,071.56	99.99%

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 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	83.02%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	前海联合添瑞一年持有混合 A	10,657.47	0.3466%
	前海联合添瑞一年持有混合 C	41.00	0.0031%
	合计	10,698.47	0.2441%

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

8.4 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	前海联合添瑞一年持有混合 A	0~10
	前海联合添瑞一年持有混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	前海联合添瑞一年持有混合 A	0~10
	前海联合添瑞一年持有混合 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	前海联合添瑞一年持有混合 A	前海联合添瑞一年持有混合 C
基金合同生效日（2021 年 04 月 20 日）基金份额总额	200,926,611.15	19,264,901.43
本报告期期初基金份额总额	3,719,685.39	1,712,782.92
本报告期基金总申购份额	23,469.10	56,789.12
减：本报告期基金总赎回份额	668,484.69	461,784.67
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,074,669.80	1,307,787.37

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本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

1、本报告期内，经公司第三届董事会 2026 年第 4 次临时会议审议通过及完成相应任职程序，自 2026 年 3 月 5 日起，郑妍女士担任公司督察长。自 2026 年 3 月 5 日起，邹文庆先生不再代为履行公司督察长职责。

本报告期内，公司股东上海证券有限责任公司于 2026 年 4 月 8 日做出股东决定，任命肖林先生为公司第三届董事会董事长，任命孙宏钧先生为公司第三届董事会董事。

2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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

报告期内本基金投资策略未有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人高级管理人员及本基金基金经理无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人未因托管业务受调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人相关从业人员未受调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
国投证券股份有限公司	1	5,684,375.00	52.65%	2,648.22	52.65%	-
兴业证券股份有限公司	1	5,112,212.00	47.35%	2,381.73	47.35%	-

注：1、根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告〔2024〕3号）及有关法律法规的相关规定，我公司制定了《交易席位管理制度》：

- （1）券商选择标准：
- 1）财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究实力较强；
 - 2）有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告，行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；

3) 最近一年的分类评价等级为 C 级及 C 级以上，同时最近 2 年没有重大违法违规行为。

(2) 券商选择程序：

- 1) 公司根据以上标准进行考察后确定参与证券交易的证券公司；
- 2) 公司与被选择的证券公司签订证券交易单元租用协议。

2、本报告期内，新租交易单元：无，退租交易单元：无。

10.7.2 基金租用或者通过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
国投证券股份有限公司	7,600,811.69	99.90%	35,300,000.00	100.00%	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	7,646.81	0.10%	-	-	-	-	-	-

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	新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金 2025 年第四季度报告及提示性公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026-01-22
2	新疆前海联合基金管理有限公司基金改聘会计师事务所公告（一）	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026-02-10
3	新疆前海联合基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026-03-05
4	新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金 2025 年年度报告及提示性公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026-03-28
5	新疆前海联合基金管	上海证券报、中国证	2026-03-31

	理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	监会基金电子披露网站及基金管理人网站	
6	新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金 2026 年第一季度报告及提示性公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026-04-22
7	2025 年度新疆前海联合基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026-04-28
8	新疆前海联合基金管理有限公司关于旗下基金增加临时基金管理人等条款修改基金合同和托管协议的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026-04-30
9	新疆前海联合基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件及完善身份信息信息的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2026-05-22

§ 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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、中国证监会核准新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；

- 3、《新疆前海联合添瑞一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金净值信息及其他临时公告。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

新疆前海联合基金管理有限公司

二〇二六年八月二十九日