

前海开源中证健康产业指数型证券投资基金

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:国信证券股份有限公司

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。本年度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。

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月24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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§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	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	12
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	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	56
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	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58

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.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	58
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
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.....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
§12 备查文件目录.....	63
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	64
12.3 查阅方式.....	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源中证健康产业指数型证券投资基金
基金简称	前海开源中证健康指数
场内简称	中证健康
基金主代码	164401
基金运作方式	契约型普通开放式
基金合同生效日	2020年12月18日
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	国信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	365,205,863.61份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金紧密跟踪标的指数——中证健康产业指数，通过严谨数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过【0.35%】，年跟踪误差不超过【4%】。</p>
投资策略	<p>本基金采用动态复制标的指数的投资方法，参照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。</p> <p>当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>本基金力争份额净值增长率与同期业绩比较基准的增长率之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%，年跟</p>

跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

1、资产配置策略

为实现跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值的90%的比例投资于标的指数成份股及其备选成份股，并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。

2、股票投资策略

(1) 股票投资组合的构建

本基金在建仓期内，将参照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

(2) 股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化，对其进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。

3、债券投资策略

本基金可以根据流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资

	金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。
业绩比较基准	中证健康产业指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

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	国信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌
	联系电话	0755-88601888
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com
客户服务电话	4001666998	0755-22940701
传真	0755-83181169	0755-22940165
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）	广东省深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
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	深圳市南山区学府路85号软件产业基地1栋A座22楼
邮政编码	518040	518000
法定代表人	王兆华	何如

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	基金管理人、基金托管人处

点	
---	--

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 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)	
	本期已实现收益	35,028,229.48
本期利润	23,138,275.80	
加权平均基金份额本期利润	0.0559	
本期加权平均净值利润率	5.17%	
本期基金份额净值增长率	4.74%	
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	204,318,294.23
	期末可供分配基金份额利润	0.5595
	期末基金资产净值	405,174,352.46
	期末基金份额净值	1.1094
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	4.37%

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

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	-1.94%	0.83%	-2.99%	0.80%	1.05%	0.03%
过去三个月	4.27%	0.86%	2.03%	0.86%	2.24%	0.00%
过去六个月	4.74%	1.12%	2.26%	1.12%	2.48%	0.00%
自基金合同生效起至今	4.37%	1.10%	1.70%	1.10%	2.67%	0.00%

3.2.2 自基金转型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

前海开源中证健康产业指数型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年12月18日-2021年06月30日)



注：①2020年12月18日（含当日）起，本基金转型为“前海开源中证健康产业指数型证券投资基金”，截至2021年06月30日，本基金转型后未满1年。

②本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。截至2021年6月30日，本基金建仓期结束未满1年。

§ 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		
梁溥森	本基金的基金经理	2020-12-18	-	7年	梁溥森先生，金融学硕士。曾任招商基金基金核算部基金会计，2015年6月加入前海开源基金，现任公司量化投资部基金经理。

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《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

2021年上半年市场整体行情向好，本基金的跟踪指数随之水涨船高。本基金在上半年取得了4.74%的涨幅，相对于业绩比较基准指数超额收益超过2.4%。受基准指数半年度调整影响，本基金对持仓成分股随之进行了调整。伴随着宏观数据转弱，市场情绪在一季度的亢奋之后逐渐回归理性。对于长期投资者来说，持有期间或许会有剧烈的波动，这些波动可能耐人寻味，但却如同千里之外的暴风雨和大海的落潮一样，对你来说无需过于关注。一般的投资理论认为随着持有期的变长，投资的不确定性变大，风险是更大的，但是对于绝大多数普通投资者来说，随着持有期的延长，尽管期间经历股灾或者黑天鹅的机会更大，但投资者获得正收益的概率也更大。这也正是我们希望本基金的持有人都能沉下心来，长期投资经过充分多元化的指数基金的原因之所在。专注于某些具体公司的表现，就像身临山涧，云雾缭绕，或许风景奇绝，却可能云深不知处。指数投资则能以最简单的方式，紧紧锚定投资者的核心价值。投资者只需关注最重要的投资原则和符合自身的长期投资目标，从而回归投资本质，而无须限于市场的短期波动、企业的一时成败和市场环境的朝夕变化，从而取得不俗的业绩。因此我们希望本基金的持有

人淡忘市场短期波动，摒弃交易冲动，通过长期投资经过充分多元化的指数基金从而分享国家发展与繁荣的成果。

作为一个被动指数基金，本基金将依然遵循一贯的投资逻辑，实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。本基金持续关注成分股的基本面变化情况，通过监控成分股负面信息及其影响，及时对地雷股进行出清，并通过新股申购及现金管理等较低风险的方式对基金业绩进行一定的增厚，积跬步以致千里，力争在紧密跟踪业绩比较基准并追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的同时，能够为持有人贡献一定的业绩正偏离。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源中证健康指数基金份额净值为1.1094元，本报告期内，基金份额净值增长率为4.74%，同期业绩比较基准收益率为2.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021年上半年各国加快推进新冠疫苗接种，疫情对经济的边际影响逐步减弱，国内经济继续保持稳定恢复，虽然疫情偶有反复，但整体上经济恢复态势良好。站在当前时点进行展望，从近期社融、信贷数据来看，市场对经济前景的看法不如此前乐观，尤其是社融存量同比增速的回落更是值得引起警惕。在这种市场对国内经济增长的预期已经触顶回落的情况下，带动股指上涨的盈利因子开始转弱。受此影响，A股在上半年迎来了一波过山车行情，但局部热点层出不穷。

总体来看，我们认为A股受益于中国经济率先企稳反弹、全球经济基本面渐次向好、强劲的盈利增长、有利的资金流入条件、人民币汇率升值预期等利好因素叠加的影响，中长期配置价值仍然较高。

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，在本报告期间，本基金托管人——国信证券股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，遵守了《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

基金管理人本半年度报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容真实、准确和完整，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：前海开源中证健康产业指数型证券投资基金

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
资 产：			

银行存款	6.4.7.1	9,493,978.41	82,667,492.47
结算备付金		1,179.50	2,345.13
存出保证金		228,754.63	388,922.61
交易性金融资产	6.4.7.2	400,653,421.70	496,095,966.13
其中：股票投资		383,600,521.70	495,979,966.13
基金投资		-	-
债券投资		17,052,900.00	116,000.00
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		841,613.91	413,433.58
应收利息	6.4.7.5	352,505.01	14,401.30
应收股利		-	-
应收申购款		125,601.08	363,187.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		411,697,054.24	579,945,748.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		5,754,732.66	51,746,641.40
应付管理人报酬		340,743.13	479,298.59
应付托管费		68,148.64	95,859.73
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.7.7	158,660.92	467,418.86
应交税费		0.09	0.34
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	200,416.34	544,757.69
负债合计		6,522,701.78	53,333,976.61
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	200,856,058.23	273,429,120.48
未分配利润	6.4.7.10	204,318,294.23	253,182,651.32
所有者权益合计		405,174,352.46	526,611,771.80
负债和所有者权益总计		411,697,054.24	579,945,748.41

注：报告截止日2021年06月30日，前海开源中证健康产业指数基金份额净值1.1094元，基金份额总额365,205,863.61份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源中证健康产业指数型证券投资基金

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0 6月30日
一、收入		26,509,992.38
1. 利息收入		246,395.30
其中：存款利息收入	6.4.7.11	42,581.68
债券利息收入		202,195.82
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,617.80
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		37,905,266.54

其中：股票投资收益	6.4.7.12	35,260,574.87
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	7.4.7.6	53,314.07
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	2,591,377.60
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-11,889,953.68
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	248,284.22
减：二、费用		3,371,716.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,226,636.25
2. 托管费	6.4.10.2.2	445,327.26
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.20	520,565.89
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.23
7. 其他费用	6.4.7.21	179,186.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,138,275.80
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,138,275.80

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源中证健康产业指数型证券投资基金

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)	273,429,120.48	253,182,651.32	526,611,771.80
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	23,138,275.80	23,138,275.80
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)	-72,573,062.25	-72,002,632.89	-144,575,695.14
其中: 1. 基金申购款	21,489,655.47	20,903,900.13	42,393,555.60
2. 基金赎回 款	-94,062,717.72	-92,906,533.02	-186,969,250.74
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)	200,856,058.23	204,318,294.23	405,174,352.46

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

何隽

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

前海开源中证健康产业指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金(以下简称“前海开源健康分级基金”)转型而来。根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)[2020]1995号《关于准予前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金变更注册的批复》以及本基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司于2020年11月19日发布的《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，前海开源基金管理有限公司于

2020年10月20日起至2020年11月16日以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议通过了《关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》。根据本基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司于2020年12月17日发布的《前海开源基金管理有限公司关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金转型后基金名称、基金简称变更的公告》及2020年12月21日发布的《前海开源基金管理有限公司关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金份额转换结果的公告》，前海开源健康分级基金以2020年12月17日为基金份额转换基准日，前海开源健康A份额、前海开源健康B份额以前海开源健康分级基础份额在基金份额转换基准日日终的基金份额净值为基准，按照各自的基金份额参考净值转换成本基金基金份额的场内份额，前海开源健康分级份额之场内份额和场外份额自动转换成本基金之场内份额和场外份额。前海开源健康分级基金自2020年12月18日起转型为本基金，经与基金托管人协商一致，基金管理人将《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金合同》修订为《前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金合同》。自2020年12月18日起《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金合同》失效，《前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金合同》自同一起生效。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司，基金托管人为国信证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源中证健康产业指数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，包括中证健康产业指数的成份股、备选成份股、固定收益资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、质押及买断式回购、银行存款等)、资产支持证券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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：投资于中证健康产业指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%，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：中证健康产业指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率(税后) \times 5%。

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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、

《前海开源中证健康产业指数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。

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

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

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

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

(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	9,493,978.41
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	9,493,978.41

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		371,847,579.48	383,600,521.70	11,752,942.22
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	17,044,825.00	17,052,900.00	8,075.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	17,044,825.00	17,052,900.00	8,075.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		388,892,404.48	400,653,421.70	11,761,017.22

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	1,919.38
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	0.50
应收债券利息	350,482.23
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	102.90
合计	352,505.01

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	158,660.92
银行间市场应付交易费用	-
合计	158,660.92

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	21,237.39
应付证券出借违约金	-
预提费用	99,178.95
应付指数使用费	80,000.00
合计	200,416.34

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	497,162,034.91	273,429,120.48
本期申购	39,073,562.16	21,489,655.47
本期赎回（以“-”号填列）	-171,029,733.46	-94,062,717.72
本期末	365,205,863.61	200,856,058.23

6.4.7.10 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
上年度末	290,242,364.37	-37,059,713.05	253,182,651.32
本期利润	35,028,229.48	-11,889,953.68	23,138,275.80
本期基金份额交易产生的变动数	-79,803,129.70	7,800,496.81	-72,002,632.89
其中：基金申购款	23,489,054.13	-2,585,154.00	20,903,900.13
基金赎回款	-103,292,183.83	10,385,650.81	-92,906,533.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	245,467,464.15	-41,149,169.92	204,318,294.23

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	36,010.94
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	2,115.00	
其他	4,455.74	

合计	42,581.68
----	-----------

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	233,100,820.30
减：卖出股票成本总额	197,840,245.43
买卖股票差价收入	35,260,574.87

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	53,314.07
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	53,314.07

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	3,658,552.97
减：卖出债券（、债转股及债券到期	3,545,875.00

兑付) 成本总额	
减: 应收利息总额	59,363.90
买卖债券差价收入	53,314.07

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	2,591,377.60
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	2,591,377.60

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	-11,889,953.68
——股票投资	-11,898,028.68
——债券投资	8,075.00
——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	-11,889,953.68

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	244,256.16
转换费收入	4,028.06
合计	248,284.22

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	520,565.89
银行间市场交易费用	-
合计	520,565.89

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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	8.00
指数使用费	80,000.00
合计	179,186.95

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、基金销售机构
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	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
当期发生的基金应支付的管理费	2,226,636.25
其中：支付销售机构的客户维护费	166,860.64

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 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	445,327.26

注：支付基金托管人国信证券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 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

无。

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

无。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688696	极米科技	2021-02-23	2021-09-03	科创板打新限售	133.73	780.24	1,037	138,678.01	809,108.88	-
688538	和辉光电	2021-05-20	2021-11-29	科创板打新限售	2.65	3.38	115,397	305,802.05	390,041.86	-
688079	美迪凯	2021-02-23	2021-09-02	科创板打新限售	10.19	18.40	10,622	108,238.18	195,444.80	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	创业板打新限售	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688533	上声电子	2021-04-09	2021-10-19	科创板打新限售	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-

301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	创业板打新限售	33.22	87.50	597	19,832.34	52,237.50	-
688685	迈信林	2021-04-30	2021-11-15	科创板打新限售	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	创业板打新限售	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	创业板打新限售	48.59	90.39	365	17,735.35	32,992.35	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
688681	科汇股份	2021-06-	2021-12-	科创板打	9.56	14.54	1,661	15,879.1	24,150.9	-

		04	16	新限售				6	4	
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	创业板打新限售	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	创业板打新限售	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	创业板打新限售	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	创业板打新限售	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	创业板打新限售	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	创业板打新限售	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	创业板打新限售	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
3010	崧盛	2021	2021	创业	18.7	57.6	201	3,76	11,5	-

02	股份	-05- 27	-12- 07	板打 新限 售	1	2		0.71	81.6 2	
6052 87	德才 股份	2021 -06- 28	2021 -07- 06	新股 未上 市	31.5 6	31.5 6	349	11,0 14.4 4	11,0 14.4 4	-
3009 55	嘉亨 家化	2021 -03- 16	2021 -09- 24	创业 板打 新限 售	16.5 3	46.0 7	232	3,83 4.96	10,6 88.2 4	-
3009 96	普联 软件	2021 -05- 26	2021 -12- 03	创业 板打 新限 售	20.8 1	42.2 3	241	5,01 5.21	10,1 77.4 3	-
3009 56	英力 股份	2021 -03- 16	2021 -09- 27	创业 板打 新限 售	12.8 5	25.8 0	371	4,76 7.35	9,57 1.80	-
3010 16	雷尔 伟	2021 -06- 23	2021 -12- 30	创业 板打 新限 售	13.7 5	32.9 8	275	3,78 1.25	9,06 9.50	-
3009 66	共同 药业	2021 -03- 31	2021 -10- 11	创业 板打 新限 售	8.24	31.5 4	286	2,35 6.64	9,02 0.44	-
3009 45	曼卡 龙	2021 -02- 03	2021 -08- 10	创业 板打 新限 售	4.56	18.8 8	474	2,16 1.44	8,94 9.12	-
3009 48	冠中 生态	2021 -02- 18	2021 -08- 25	创业 板打 新限 售	8.67	27.4 2	324	2,80 8.00	8,88 4.08	-

300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	创业板打新限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	创业板打新限售	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	创业板打新限售	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	创业板打新限售	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	创业板打新限售	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	创业板打新限售	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	创业板打新限售	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	创业板打新限售	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-

				售						
3010 18	申菱 环境	2021 -06- 28	2022 -01- 07	创业 板打 新限 售	8.29	8.29	782	6,48 2.78	6,48 2.78	-
3009 63	中洲 特材	2021 -03- 30	2021 -10- 11	创业 板打 新限 售	12.1 3	22.4 9	283	3,43 2.79	6,36 4.67	-
3009 75	商络 电子	2021 -04- 14	2021 -10- 21	创业 板打 新限 售	5.48	13.0 3	463	2,53 7.24	6,03 2.89	-
3010 11	华立 科技	2021 -06- 09	2021 -12- 17	创业 板打 新限 售	14.2 0	33.8 4	175	2,48 5.00	5,92 2.00	-
3009 67	晓鸣 股份	2021 -04- 02	2021 -10- 13	创业 板打 新限 售	4.54	11.5 4	507	2,30 1.78	5,85 0.78	-
3009 72	万辰 生物	2021 -04- 08	2021 -10- 19	创业 板打 新限 售	7.19	12.6 5	430	3,09 1.70	5,43 9.50	-
3009 60	通业 科技	2021 -03- 22	2021 -09- 29	创业 板打 新限 售	12.0 8	23.0 6	234	2,82 6.72	5,39 6.04	-
3010 17	漱玉 平民	2021 -06- 23	2022 -01- 05	创业 板打 新限 售	8.86	8.86	555	4,91 7.30	4,91 7.30	-
3009	奇德	2021	2021	创业	14.7	23.3	191	2,81	4,45	-

95	新材	-05-17	-11-26	板打 新限售	2	2		1.52	4.12	
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	创业 板打 新限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	创业 板打 新限售	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	创业 板打 新限售	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	创业 板打 新限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	创业 板打 新限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	创业 板打 新限售	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	配债未上市	100.00	100.00	529	52,900.00	52,900.00	-

注：①根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

②根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

③基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

④基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

⑤本报告期，“冠中生态”（股票代码：300948）新股申购持有数量为216股，根据《青岛冠中生态股份有限公司2020年年度权益分派实施公告》，送股108股，报告期末本基金持有“冠中生态”限售股票数量合计为324股，认购价格为除权后的价格。

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。

6.4.13 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	17,000,000.00	-
合计	17,000,000.00	-

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	-	-
AAA以下	52,900.00	116,000.00
未评级	-	-
合计	52,900.00	116,000.00

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	9,493,978.41	-	-	-	9,493,978.41
结算备付金	1,179.50	-	-	-	1,179.50
存出保证金	228,754.63	-	-	-	228,754.63
交易性金融资产	17,000,000.00	-	52,900.00	383,600,521.70	400,653,421.70
应收证券清算款	-	-	-	841,613.91	841,613.91
应收利息	-	-	-	352,505.01	352,505.01
应收申购款	-	-	-	125,601.08	125,601.08
资产总计	26,723,912.54	-	52,900.00	384,920,241.70	411,697,054.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,754,732.66	5,754,732.66
应付管理人报酬	-	-	-	340,743.13	340,743.13

应付托管费	-	-	-	68,148.64	68,148.64
应付交易费用	-	-	-	158,660.92	158,660.92
应交税费	-	-	-	0.09	0.09
其他负债	-	-	-	200,416.34	200,416.34
负债总计	-	-	-	6,522,701.78	6,522,701.78
利率敏感度缺口	26,723,912.54	-	52,900.00	378,397,539.92	405,174,352.46
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	82,667,492.47	-	-	-	82,667,492.47
结算备付金	2,345.13	-	-	-	2,345.13
存出保证金	388,922.61	-	-	-	388,922.61
交易性金融资产	-	-	116,000.00	495,979,966.13	496,095,966.13
应收证券清算款	-	-	-	413,433.58	413,433.58
应收利息	-	-	-	14,401.30	14,401.30
应收申购款	100.00	-	-	363,087.19	363,187.19
资产总计	83,058,860.21	-	116,000.00	496,770,888.20	579,945,748.41
负债					
应付赎回款	-	-	-	51,746,641.40	51,746,641.40
应付管理人报酬	-	-	-	479,298.59	479,298.59
应付托管费	-	-	-	95,859.73	95,859.73
应付交	-	-	-	467,418.86	467,418.86

易费用					
应交税费	-	-	-	0.34	0.34
其他负债	-	-	-	544,757.69	544,757.69
负债总计	-	-	-	53,333,976.61	53,333,976.61
利率敏感度缺口	83,058,860.21	-	116,000.00	443,436,911.59	526,611,771.80

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%	-1,899.67	0.00
	市场利率减少0.25%	1,900.08	0.00

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 (%)
交易性金融资产—股票投资	383,600,521.70	94.68	495,979,966.13	94.18
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	383,600,521.70	94.68	495,979,966.13	94.18

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%	17,433,826.85	21,594,127.67
	业绩比较基准下降5%	-17,433,826.85	-21,594,127.67

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	383,600,521.70	93.18
	其中：股票	383,600,521.70	93.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,052,900.00	4.14
	其中：债券	17,052,900.00	4.14
	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	9,495,157.91	2.31
8	其他各项资产	1,548,474.63	0.38
9	合计	411,697,054.24	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（指数投资）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	40,999,875.78	10.12
B	采矿业	-	-
C	制造业	220,474,021.22	54.41

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,447,020.30	2.83
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,924,486.11	2.70
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	12,176,153.84	3.01
N	水利、环境和公共设施管理业	64,820,438.68	16.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	20,190,799.27	4.98
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	381,032,795.20	94.04

7.2.2 报告期末（积极投资）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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,339,790.38	0.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	82,094.47	0.02

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	22,407.83	0.01
J	金融业	34,721.10	0.01
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	39,030.68	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,567,726.50	0.63

7.2.3 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股票投资明细

7.3.1 期末指数投资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	300896	爱美客	6,200	4,891,056.00	1.21
2	688363	华熙生物	17,246	4,791,973.56	1.18
3	600763	通策医疗	11,015	4,527,165.00	1.12
4	300759	康龙化成	20,799	4,513,175.01	1.11

5	603882	金域医学	27,767	4,436,333.59	1.09
6	300263	隆华科技	634,700	4,360,389.00	1.08
7	300567	精测电子	70,100	4,304,140.00	1.06
8	603392	万泰生物	16,540	4,286,837.20	1.06
9	300677	英科医疗	34,300	4,280,640.00	1.06
10	600436	片仔癀	9,382	4,205,950.60	1.04
11	300347	泰格医药	21,466	4,149,377.80	1.02
12	601827	三峰环境	436,100	4,129,867.00	1.02
13	600079	人福医药	145,500	4,113,285.00	1.02
14	600196	复星医药	56,454	4,072,027.02	1.01
15	603259	药明康德	25,977	4,067,738.43	1.00
16	601200	上海环境	338,907	4,056,716.79	1.00
17	300015	爱尔眼科	57,096	4,052,674.08	1.00
18	600161	天坛生物	117,900	4,038,075.00	1.00
19	000963	华东医药	87,600	4,030,476.00	0.99
20	300595	欧普康视	38,900	4,028,095.00	0.99
21	600882	妙可蓝多	57,700	4,027,460.00	0.99
22	601330	绿色动力	451,400	4,012,946.00	0.99
23	300197	节能铁汉	1,301,500	3,995,605.00	0.99
24	600276	恒瑞医药	58,612	3,983,857.64	0.98
25	300867	圣元环保	131,400	3,982,734.00	0.98
26	300203	聚光科技	330,600	3,980,424.00	0.98
27	002458	益生股份	398,420	3,972,247.40	0.98
28	300070	碧水源	541,993	3,961,968.83	0.98
29	002266	浙富控股	793,106	3,957,598.94	0.98
30	603588	高能环境	272,310	3,943,048.80	0.97
31	002821	凯莱英	10,580	3,942,108.00	0.97
32	300498	温氏股份	274,100	3,938,817.00	0.97
33	300760	迈瑞医疗	8,185	3,929,209.25	0.97
34	002158	汉钟精机	146,300	3,928,155.00	0.97
35	600332	白云山	116,035	3,927,784.75	0.97

36	000901	航天科技	454,740	3,924,406.20	0.97
37	002252	上海莱士	523,500	3,921,015.00	0.97
38	688098	申联生物	288,000	3,919,680.00	0.97
39	300114	中航电测	257,700	3,917,040.00	0.97
40	603568	伟明环保	170,902	3,901,692.66	0.96
41	600887	伊利股份	105,896	3,900,149.68	0.96
42	600598	北大荒	258,900	3,873,144.00	0.96
43	000035	中国天楹	848,500	3,869,160.00	0.95
44	300122	智飞生物	20,696	3,864,564.08	0.95
45	000598	兴蓉环境	741,700	3,864,257.00	0.95
46	600217	中再资环	759,500	3,858,260.00	0.95
47	600388	龙净环保	452,700	3,857,004.00	0.95
48	600521	华海药业	184,300	3,848,184.00	0.95
49	000998	隆平高科	239,600	3,843,184.00	0.95
50	600195	中牧股份	320,732	3,835,954.72	0.95
51	300761	立华股份	115,500	3,826,515.00	0.94
52	000826	启迪环境	711,300	3,805,455.00	0.94
53	600008	首创环保	1,262,930	3,801,419.30	0.94
54	603279	景津环保	171,500	3,800,440.00	0.94
55	603187	海容冷链	88,360	3,788,876.80	0.94
56	300003	乐普医疗	117,800	3,783,736.00	0.93
57	000685	中山公用	463,400	3,781,344.00	0.93
58	300832	新产业	61,170	3,768,072.00	0.93
59	000735	罗牛山	476,400	3,758,796.00	0.93
60	601952	苏垦农发	358,796	3,724,302.48	0.92
61	002034	旺能环境	232,100	3,701,995.00	0.91
62	603658	安图生物	48,720	3,691,514.40	0.91
63	002007	华兰生物	100,517	3,686,963.56	0.91
64	002714	牧原股份	60,559	3,683,198.38	0.91
65	002041	登海种业	242,400	3,662,664.00	0.90
66	300572	安车检测	112,815	3,659,718.60	0.90

67	600323	瀚蓝环境	167,854	3,657,538.66	0.90
68	603718	海利生物	245,400	3,656,460.00	0.90
69	002299	圣农发展	152,800	3,648,864.00	0.90
70	002310	东方园林	1,069,200	3,645,972.00	0.90
71	300869	康泰医学	51,300	3,633,066.00	0.90
72	002973	侨银股份	227,800	3,628,854.00	0.90
73	300142	沃森生物	58,673	3,620,124.10	0.89
74	300601	康泰生物	24,200	3,605,800.00	0.89
75	300558	贝达药业	33,300	3,604,392.00	0.89
76	300676	华大基因	30,314	3,595,240.40	0.89
77	600073	上海梅林	437,400	3,582,306.00	0.88
78	300087	荃银高科	159,600	3,576,636.00	0.88
79	002980	华盛昌	99,400	3,573,430.00	0.88
80	000661	长春高新	9,229	3,571,623.00	0.88
81	000895	双汇发展	112,220	3,568,596.00	0.88
82	600597	光明乳业	247,090	3,560,566.90	0.88
83	002001	新和成	123,744	3,548,977.92	0.88
84	000538	云南白药	30,538	3,533,857.36	0.87
85	002946	新乳业	232,501	3,522,390.15	0.87
86	603939	益丰药房	61,668	3,458,958.12	0.85
87	300529	健帆生物	40,000	3,454,400.00	0.85
88	603233	大参林	67,209	3,435,051.99	0.85
89	600201	生物股份	196,620	3,431,019.00	0.85
90	605179	一鸣食品	188,900	3,386,977.00	0.84
91	002726	龙大肉食	333,980	3,379,877.60	0.83
92	300999	金龙鱼	39,700	3,372,912.00	0.83
93	000967	盈峰环境	489,800	3,364,926.00	0.83
94	002695	煌上煌	210,875	3,338,151.25	0.82
95	603087	甘李药业	31,180	3,323,164.40	0.82
96	603566	普莱柯	145,500	3,317,400.00	0.82
97	002982	湘佳股份	75,400	3,215,810.00	0.79

98	300815	玉禾田	92,000	3,204,360.00	0.79
99	300119	瑞普生物	90,100	3,047,182.00	0.75
100	002044	美年健康	332,080	3,025,248.80	0.75

7.3.2 期末积极投资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	688696	极米科技	1,037	809,108.88	0.20
2	688538	和辉光电	115,397	390,041.86	0.10
3	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.05
4	300919	中伟股份	693	112,959.00	0.03
5	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
6	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.02
7	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
8	300979	华利集团	663	59,754.90	0.01
9	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
10	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
11	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.01
12	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
13	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
14	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
15	300981	中红医疗	365	32,992.35	0.01
16	300953	震裕科技	294	29,847.30	0.01
17	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
18	688681	科汇股份	1,661	24,150.94	0.01
19	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
20	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
21	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
22	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00

23	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
24	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
25	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
26	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
27	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
28	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
29	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
30	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
31	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
32	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
33	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
34	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
35	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
36	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
37	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
38	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
39	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
40	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
41	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
42	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
43	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
44	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
45	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
46	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
47	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
48	300975	商络电子	463	6,032.89	0.00
49	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
50	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
51	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
52	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
53	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

54	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
55	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
56	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
57	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
58	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
59	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

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	300263	隆华科技	4,244,207.98	0.81
2	603187	海容冷链	4,036,223.00	0.77
3	688363	华熙生物	4,034,161.48	0.77
4	300869	康泰医学	3,998,256.00	0.76
5	300896	爱美客	3,995,085.00	0.76
6	300595	欧普康视	3,967,653.00	0.75
7	600079	人福医药	3,898,132.62	0.74
8	300677	英科医疗	3,888,844.00	0.74
9	002034	旺能环境	3,881,385.32	0.74
10	300867	圣元环保	3,814,994.77	0.72
11	300999	金龙鱼	3,531,284.00	0.67
12	605179	一鸣食品	3,475,587.10	0.66
13	600521	华海药业	1,517,335.00	0.29
14	000895	双汇发展	1,398,542.00	0.27
15	603658	安图生物	1,356,606.30	0.26
16	002973	侨银股份	1,345,106.00	0.26
17	002982	湘佳股份	1,302,534.00	0.25
18	688098	申联生物	1,233,431.72	0.23
19	300498	温氏股份	1,218,658.00	0.23

20	300567	精测电子	1,185,289.00	0.23
----	--------	------	--------------	------

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	600085	同仁堂	6,274,235.09	1.19
2	002158	汉钟精机	5,163,521.00	0.98
3	603707	健友股份	5,104,454.10	0.97
4	601607	上海医药	5,015,074.00	0.95
5	600436	片仔癀	4,797,850.00	0.91
6	300119	瑞普生物	4,731,841.00	0.90
7	603392	万泰生物	4,668,089.20	0.89
8	300759	康龙化成	4,652,086.00	0.88
9	600882	妙可蓝多	4,612,385.00	0.88
10	002901	大博医疗	4,535,588.00	0.86
11	002422	科伦药业	4,488,356.80	0.85
12	002570	贝因美	4,422,832.00	0.84
13	002717	岭南股份	4,408,371.13	0.84
14	600874	创业环保	4,375,372.00	0.83
15	300142	沃森生物	4,227,282.00	0.80
16	603259	药明康德	3,989,976.00	0.76
17	603556	海兴电力	3,888,485.10	0.74
18	002234	民和股份	3,836,443.65	0.73
19	002746	仙坛股份	3,768,422.25	0.72
20	600763	通策医疗	3,648,735.00	0.69

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	97,358,829.68
卖出股票收入（成交）总额	233,100,820.30

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	17,000,000.00	4.20
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)	52,900.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	17,052,900.00	4.21

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	019640	20国债10	170,000	17,000,000.00	4.20
2	123117	健帆转债	529	52,900.00	0.01

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

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	228,754.63

2	应收证券清算款	841,613.91
3	应收股利	-
4	应收利息	352,505.01
5	应收申购款	125,601.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,548,474.63

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688696	极米科技	809,108.88	0.20	科创板打新限售
2	688538	和辉光电	390,041.86	0.10	科创板打新限售
3	688079	美迪凯	195,444.80	0.05	科创板打新限售
4	300919	中伟股份	99,430.00	0.02	创业板打新限售
5	688499	利元亨	83,488.65	0.02	新股未上市

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
17,314	21,093.10	245,413,584.20	67.20%	119,792,279.41	32.80%

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	9.48	0.00%

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、基金投资和研发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	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年12月18日)基金份额总额	542,709,705.13
本报告期期初基金份额总额	497,162,034.91
本报告期基金总申购份额	39,073,562.16
减：本报告期基金总赎回份额	171,029,733.46
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	365,205,863.61

§ 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	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	

	量					
国信证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	323,324,294.06	100.00%	236,447.13	100.00%	-
中投证券	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		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
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

西藏东方财富证券	23,589,765.98	100.00%	4,300,000.00	100.00%	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金（原前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金转型）2020年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2021-01-22
4	前海开源中证健康产业指数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	前海开源中证健康产业指数分级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	前海开源中证健康产业指数型证券投资基金（原前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金转型）2020年年度报告	中国证监会规定媒介	2021-03-31
7	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公	中国证监会规定媒介	2021-03-31

	开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告		
8	前海开源中证健康产业指数型证券投资基金招募说明书（20210331更新）	中国证监会规定媒介	2021-03-31
9	前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金合同（2021年3月修订）	中国证监会规定媒介	2021-03-31
10	前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金产品资料概要更新（20210331更新）	中国证监会规定媒介	2021-03-31
11	前海开源中证健康产业指数型证券投资基金2021年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2021-04-22
12	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
13	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
14	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

§ 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
---	----------------	------------

投资者类别	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	20210121-20210630	94,026,350.53	0.00	0.00	94,026,350.53	25.75%
	2	20210101-20210630	130,699,766.00	0.00	0.00	130,699,766.00	35.79%
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《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运作指引第3号——指数基金指引》等法律法规、基金合同、招募说明书及其更新等规定，经与基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，前海开源基金管理有限公司对本基金基金合同进行了修订，本次修订系因相应的法律法规发生变动而进行的修改，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3月31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中证健康产业指数型证券投资基金设立的文件

(2) 《前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金合同》

- (3) 《前海开源中证健康产业指数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) 前海开源中证健康产业指数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

基金管理人或基金托管人处

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

二〇二一年八月三十一日