

前海开源 MSCI 中国 A 股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:招商银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	9
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	10
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	16
§6 中期财务会计报告(未经审计)	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	64
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	64
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	64
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	64
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
7.12 投资组合报告附注	65
§8 基金份额持有人信息	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67

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	67
§9 开放式基金份额变动	68
§10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议	68
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	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
10.4 基金投资策略的改变	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
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	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
10.8 其他重大事件	70
§11 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§12 备查文件目录	73
12.1 备查文件目录	73
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金	
基金简称	前海开源MSCI中国A股指数	
基金主代码	006524	
基金运作方式	契约型普通开放式	
基金合同生效日	2018年11月27日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	8,827,742.51份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海开源MSCI中国A 股指数A	前海开源MSCI中国A 股指数C
下属分级基金的交易代码	006524	006525
报告期末下属分级基金的份额总额	4,606,920.38份	4,220,822.13份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，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>

本基金的投资策略主要有以下八个方面内容：

1、大类资产配置

本基金管理人主要按照MSCI中国A股指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

2、股票投资策略

（1）股票投资组合构建

本基金采用完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。由于跟踪组合构建与标的指数组合构建存在差异，若出现较为特殊的情况（例如成份股停牌、股票流动性不足以及其他影响指数复制效果的因素），本基金将采用包括替代、抽样等技术手段在内的优化复制法来构建组合，使得跟踪组合尽可能近似于全复制组合，以减少对标的指数的跟踪误差。本基金所采用替代法调整的股票组合应符合投资于股票的资产比例不低于基金资产的80%的比例限制，并符合投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%的投资比例限制。

（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MSCI中国A股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、申购赎回变动情况等，对其进行适时调整，以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

3、债券投资策略

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资，通过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构建债券投资组合。

4、权证投资策略

本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。

5、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券发行条款的分析、违约概率和提前偿付比率的预估，借用必要的数量模型来谋求对资产支持证券的合理定价，在严格控制风险、充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下，谨慎选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

6、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

7、现金管理策略

为保持基金的资产流动性，本基金可适当投资于货币市场工具。具体而言，本基金将根据基金资产组合中的现金存量水平、申购赎回情况及基金跟踪误差控制情况，在确定总体流动性要求的基础上，综合考虑宏观经济形势、市场资金面走向、交易对手的信用资质以及各类资产收益率水平等，确定各类货币市场工具的配置比例，并定期对组合的平均剩余期限及投资品种比例进行适当调整，在保证基金资产安全性和流动性的基础上力争创造稳定的收益。

	<p>8、其他</p> <p>未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>
业绩比较基准	MSCI中国A股指数收益率×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、债券型基金及货币市场基金。本基金紧密跟踪标的指数表现，具有与标的指数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	招商银行股份有限公司
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	95555
传真	0755-83181169	0755-83195201
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦2206	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	518040	518040
法定代表人	王兆华	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网	www.qhkyfund.com

址	
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22楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	前海开源MSCI中国A股指数A	前海开源MSCI中国A股指数C
本期已实现收益	737,886.53	566,877.75
本期利润	433,398.59	372,480.14
加权平均基金份额本期利润	0.0877	0.0977
本期加权平均净值利润率	5.34%	5.96%
本期基金份额净值增长率	5.09%	4.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	3,179,866.24	2,874,670.13
期末可供分配基金份额利润	0.6902	0.6811
期末基金资产净值	7,786,786.62	7,095,492.26
期末基金份额净值	1.6902	1.6811
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	85.34%	84.36%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海开源MSCI中国A股指数A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.36%	0.81%	-0.52%	0.80%	0.88%	0.01%
过去三个月	7.93%	0.93%	6.51%	0.93%	1.42%	0.00%
过去六个月	5.09%	1.30%	3.27%	1.26%	1.82%	0.04%
过去一年	31.50%	1.32%	26.96%	1.27%	4.54%	0.05%
自基金合同生效起至今	85.34%	1.24%	73.60%	1.26%	11.74%	-0.02%

前海开源MSCI中国A股指数C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.35%	0.81%	-0.52%	0.80%	0.87%	0.01%
过去三个月	7.88%	0.93%	6.51%	0.93%	1.37%	0.00%
过去六个月	4.99%	1.30%	3.27%	1.26%	1.72%	0.04%
过去一年	31.23%	1.32%	26.96%	1.27%	4.27%	0.05%

自基金合同生效起至今	84.36%	1.24%	73.60%	1.26%	10.76%	-0.02%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

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

前海开源MSCI中国A股指数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
(2018年11月27日-2021年06月30日)



前海开源MSCI中国A股指数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
(2018年11月27日-2021年06月30日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至报告期末，前海开源基金旗下管理95只开放式基金，资产管理规模超过1283亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）	证券	说明
----	----	---------------	----	----

		期限		从业年限	
		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年上半年本基金的跟踪指数表现良好呈现了稳步上行的态势，本基金A类份额在上半年取得了5.09%的涨幅，相对于基准指数超额收益超过1.8%。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。相对于沪深300指数，本基金的跟踪指数纳入了更多成长性更强的创业板权重股，具有更高的成长属性。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会更大，但投资者获得正收益的概率也更大。因此我们希望本基金的持有人都能沉下心来，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MSCI中国A股指数A基金份额净值为1.6902元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为5.09%，同期业绩比较基准收益率为3.27%；截至报告期末前海开源MSCI中国A股指数C基金份额净值为1.6811元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.99%，同期业绩比较基准收益率为3.27%。

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的情形。

本基金本报告期内，从2021年01月04日至2021年06月30日连续118个工作日基金资产净值低于五千万元，我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：前海开源MSCI中国A股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	821,210.84	1,081,172.86
结算备付金		4,748.77	-
存出保证金		1,525.10	19,965.69
交易性金融资产	6.4.7.2	14,401,882.04	13,533,396.48
其中：股票投资		14,025,165.13	13,532,396.48
基金投资		-	-
债券投资		376,716.91	1,000.00
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		-	206,461.58
应收利息	6.4.7.5	7,681.78	117.60
应收股利		-	-

应收申购款		159,503.06	82,827.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		15,396,551.59	14,923,941.43
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		31.10	48,847.82
应付赎回款		489,079.54	522,747.67
应付管理人报酬		5,888.90	5,826.05
应付托管费		1,177.80	1,165.21
应付销售服务费		1,084.80	992.46
应付交易费用	6.4.7.7	1,814.49	2,096.11
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	15,196.08	80,592.79
负债合计		514,272.71	662,268.11
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	8,827,742.51	8,884,358.67
未分配利润	6.4.7.10	6,054,536.37	5,377,314.65
所有者权益合计		14,882,278.88	14,261,673.32
负债和所有者权益总计		15,396,551.59	14,923,941.43

注：报告截止日2021年6月30日，前海开源MSCI中国A股指数基金份额总额8,827,742.51份，其中前海开源MSCI中国A股指数A类基金份额净值1.6902元，基金份额4,606,920.38份；前海开源MSCI中国A股指数C类基金份额净值1.6811元，基金份额4,220,822.13份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源MSCI中国A股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06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
一、收入		946,663.43	4,192,800.86
1. 利息收入		5,528.26	7,993.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,182.78	7,993.25
债券利息收入		4,345.48	-
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）		1,427,268.70	4,713,190.66
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,331,245.21	4,554,009.70
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.6	3,483.06	-
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	92,540.43	159,180.96
3. 公允价值变动收益（损	6.4.7.18	-498,885.55	-649,969.92

失以“-”号填列)			
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	12,752.02	121,586.87
减: 二、费用		140,784.70	411,211.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	35,734.91	70,644.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,147.03	14,128.88
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	6,206.09	12,829.85
4. 交易费用	6.4.7.20	11,573.58	188,848.39
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.21	80,123.09	124,759.40
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		805,878.73	3,781,589.83
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		805,878.73	3,781,589.83

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 前海开源MSCI中国A股指数量型证券投资基金

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	8,884,358.67	5,377,314.65	14,261,673.32

(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	805,878.73	805,878.73
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)	-56,616.16	-128,657.01	-185,273.17
其中: 1. 基金申购款	8,813,737.95	5,871,517.21	14,685,255.16
2. 基金赎回款	-8,870,354.11	-6,000,174.22	-14,870,528.33
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)	8,827,742.51	6,054,536.37	14,882,278.88
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	44,877,546.81	8,345,607.16	53,223,153.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,781,589.83	3,781,589.83
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)	-3,823,242.09	-544,318.79	-4,367,560.88
其中: 1. 基金申购款	76,176,415.56	13,795,102.18	89,971,517.74
2. 基金赎回款	-79,999,657.65	-14,339,420.97	-94,339,078.62

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）	41,054,304.72	11,582,878.20	52,637,182.92

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MSCI中国A股指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]708号《关于准予前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金注册的批复》核准,由前海开源基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币228,326,970.88元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2018]01210012号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金基金合同》于2018年11月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为228,418,283.18份基金份额,其中认购资金利息折合91,312.30份基金份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用、而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用、但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要包括标的指数成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成份股(包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括定期存款、协议存款及其他银行存款)、货币市场工具、金融衍生品(包括权证、股指期货)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：投资于股票的资产比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，将持有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、应收申购款等；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为： $MSCI中国A股指数收益率 \times 95\% + 银行人民币活期存款利率(税后) \times 5\%$ 。

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MSCI中国A股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	821,210.84
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	821,210.84

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	11,399,443.82	14,025,165.13	2,625,721.31	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	375,760.00	376,716.91	956.91
	银行间市场	-	-	-
	合计	375,760.00	376,716.91	956.91
资产支持证券	-	-	-	

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	11,775,203.82	14,401,882.04	2,626,678.22

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	49.37
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	2.10
应收债券利息	7,628.61
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	1.00
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	0.70
合计	7,681.78

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	1,814.49
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,814.49

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	319.69
应付证券出借违约金	-
预提费用	14,876.39
合计	15,196.08

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 前海开源MSCI中国A股指数A

金额单位：人民币元

项目 (前海开源MSCI中国A股指数 A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,092,910.26	5,092,910.26
本期申购	1,917,854.48	1,917,854.48
本期赎回(以“-”号填列)	-2,403,844.36	-2,403,844.36
本期末	4,606,920.38	4,606,920.38

6.4.7.9.2 前海开源MSCI中国A股指数C

金额单位：人民币元

项目 (前海开源MSCI中国A股指数 C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	3,791,448.41	3,791,448.41
本期申购	6,895,883.47	6,895,883.47
本期赎回(以“-”号填列)	-6,466,509.75	-6,466,509.75
本期末	4,220,822.13	4,220,822.13

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 前海开源MSCI中国A股指数A

单位：人民币元

项目 (前海开源MSCI中国A 股指数A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,320,335.42	-222,359.41	3,097,976.01
本期利润	737,886.53	-304,487.94	433,398.59
本期基金份额交易产生的变动数	-393,091.31	41,582.95	-351,508.36
其中：基金申购款	1,343,184.47	-61,560.13	1,281,624.34
基金赎回款	-1,736,275.78	103,143.08	-1,633,132.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,665,130.64	-485,264.40	3,179,866.24

6.4.7.10.2 前海开源MSCI中国A股指数C

单位：人民币元

项目 (前海开源MSCI中国A 股指数C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,443,932.86	-164,594.22	2,279,338.64
本期利润	566,877.75	-194,397.61	372,480.14
本期基金份额交易产生的变动数	306,230.02	-83,378.67	222,851.35

其中：基金申购款	4,894,016.01	-304,123.14	4,589,892.87
基金赎回款	-4,587,785.99	220,744.47	-4,367,041.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,317,040.63	-442,370.50	2,874,670.13

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	1,100.58
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	46.34
其他	35.86
合计	1,182.78

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	4,131,268.30
减：卖出股票成本总额	2,800,023.09
买卖股票差价收入	1,331,245.21

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	3,483.06
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	3,483.06

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	148,671.46
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	142,640.00
减：应收利息总额	2,548.40
买卖债券差价收入	3,483.06

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	92,540.43
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	92,540.43

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	-498,885.55
——股票投资	-499,842.46
——债券投资	956.91
——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	-498,885.55

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	12,476.63
转换费收入	275.39
合计	12,752.02

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	11,573.58
银行间市场交易费用	-
合计	11,573.58

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	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	745.00

指数使用费	64,501.70
合计	80,123.09

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
开源证券股份有限公司（“开源证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
北京市中盛金期投资管理有限公司	基金管理人的股东
北京长和世纪资产管理有限公司	基金管理人的股东
深圳市和合投信资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
前海开源资产管理有限公司	基金管理人的子公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	35,734.91	70,644.51
其中：支付销售机构的客户维护费	13,008.28	2,335.79

注：支付基金管理人前海开源基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%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×0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,147.03	14,128.88

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源MSCI中国A股指数A	前海开源MSCI中国A股指数C	合计
招商银行	0.00	696.61	696.61
前海开源基金	0.00	26.11	26.11
合计	0.00	722.72	722.72
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源MSCI中国A股指数A	前海开源MSCI中国A股指数C	合计
招商银行	0.00	832.95	832.95
前海开源基金	0.00	6,007.16	6,007.16
开源证券	0.00	18.05	18.05
合计	0.00	6,858.16	6,858.16

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0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给前海开源基金，再由前海开源基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值× 0.20%/ 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	821,210.84	1,100.58	2,306,872.83	7,173.72

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于2021年6月30日，本基金持有6,389股招商银行的A股普通股，成本总额为人民币261,254.57元，估值总额为人民币346,219.91元，占基金资产净值的比例为2.33%（2020年12月31日，本基金持有7,089股托管人招商银行的A股普通股，成本总额为人民币272,871.63元，估值总额为人民币311,561.55元，占基金资产净值的比例为2.18%）。

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：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
113050	南银转债	2021-06-15	2021-07-01	配债未上市	100.00	100.00	40	4,000.00	4,000.00	-
113049	长汽转债	2021-06-	2021-07-	配债未上	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

		10	08	市						
127038	国微转债	2021-06-10	2021-07-14	配债未上市	100.00	100.00	5	500.00	500.00	-
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	配债未上市	100.00	100.00	3	300.00	300.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021-06-30	重大事项	56.35	2021-07-01	59.49	400	6,031.90	22,540.00	-
002024	苏宁易购	2021-06-16	重大事项	5.59	2021-07-06	6.15	1,600	14,702.41	8,944.00	-

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	370,000.00	-
合计	370,000.00	-

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	5,000.00	-
AAA以下	1,716.91	1,000.00
未评级	-	-
合计	6,716.91	1,000.00

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	821,210.84	-	-	-	821,210.84
结算备付金	4,748.77	-	-	-	4,748.77
存出保证金	1,525.10	-	-	-	1,525.10
交易性金融资产	370,000.00	-	6,716.91	14,025,165.13	14,401,882.04
应收利息	-	-	-	7,681.78	7,681.78
应收申购款	-	-	-	159,503.06	159,503.06
资产总计	1,197,484.71	-	6,716.91	14,192,349.97	15,396,551.59
负债					
应付证券清算款	-	-	-	31.10	31.10

应付赎回款	-	-	-	489,079.54	489,079.54
应付管理人报酬	-	-	-	5,888.90	5,888.90
应付托管费	-	-	-	1,177.80	1,177.80
应付销售服务费	-	-	-	1,084.80	1,084.80
应付交易费用	-	-	-	1,814.49	1,814.49
其他负债	-	-	-	15,196.08	15,196.08
负债总计	-	-	-	514,272.71	514,272.71
利率敏感度缺口	1,197,484.71	-	6,716.91	13,678,077.26	14,882,278.88
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	1,081,172.86	-	-	-	1,081,172.86
存出保证金	19,965.69	-	-	-	19,965.69
交易性金融资产	-	-	1,000.00	13,532,396.48	13,533,396.48
应收证券清算款	-	-	-	206,461.58	206,461.58
应收利息	-	-	-	117.60	117.60
应收申购款	-	-	-	82,827.22	82,827.22
资产总计	1,101,138.55	-	1,000.00	13,821,802.88	14,923,941.43
负债					
应付证券清算款	-	-	-	48,847.82	48,847.82
应付赎回款	-	-	-	522,747.67	522,747.67

回款					
应付管理人报酬	-	-	-	5,826.05	5,826.05
应付托管费	-	-	-	1,165.21	1,165.21
应付销售服务费	-	-	-	992.46	992.46
应付交易费用	-	-	-	2,096.11	2,096.11
其他负债	-	-	-	80,592.79	80,592.79
负债总计	-	-	-	662,268.11	662,268.11
利率敏感度缺口	1,101,138.55	-	1,000.00	13,159,534.77	14,261,673.32

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%	-41.35	0.00
	市场利率减少0.25%	41.35	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	14,025,165.13	94.24	13,532,396.48	94.89
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	14,025,165.13	94.24	13,532,396.48	94.89

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%	841,811.52	708,857.83
	业绩比较基准下降5%	-841,811.52	-708,857.83

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	14,025,165.13	91.09
	其中：股票	14,025,165.13	91.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	376,716.91	2.45
	其中：债券	376,716.91	2.45
	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	825,959.61	5.36
8	其他各项资产	168,709.94	1.10
9	合计	15,396,551.59	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	151,192.20	1.02
B	采矿业	314,596.08	2.11
C	制造业	8,675,643.50	58.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	212,831.80	1.43
E	建筑业	151,428.00	1.02
F	批发和零售业	186,970.44	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	350,794.10	2.36
H	住宿和餐饮业	11,390.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	465,302.28	3.13
J	金融业	2,495,925.07	16.77
K	房地产业	264,541.76	1.78
L	租赁和商务服务业	246,829.00	1.66
M	科学研究和技术服务业	198,237.80	1.33
N	水利、环境和公共设施管理业	10,838.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	10,445.00	0.07
Q	卫生和社会工作	212,012.10	1.42
R	文化、体育和娱乐业	66,188.00	0.44
S	综合	-	-
	合计	14,025,165.13	94.24

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
无。

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	600519	贵州茅台	400	822,680.00	5.53
2	300750	宁德时代	700	374,360.00	2.52
3	000858	五粮液	1,200	357,468.00	2.40
4	600036	招商银行	6,389	346,219.91	2.33
5	601318	中国平安	3,400	218,552.00	1.47
6	300760	迈瑞医疗	400	192,020.00	1.29
7	601888	中国中免	600	180,060.00	1.21
8	688185	康希诺	200	155,554.00	1.05
9	002594	比亚迪	600	150,600.00	1.01
10	601012	隆基股份	1,652	146,763.68	0.99
11	600900	长江电力	6,700	138,288.00	0.93
12	603288	海天味业	1,066	137,460.70	0.92
13	000001	平安银行	6,000	135,720.00	0.91
14	600809	山西汾酒	300	134,400.00	0.90
15	600276	恒瑞医药	1,939	131,793.83	0.89
16	601166	兴业银行	6,274	128,930.70	0.87
17	000568	泸州老窖	500	117,970.00	0.79
18	603259	药明康德	720	112,744.80	0.76
19	300015	爱尔眼科	1,575	111,793.50	0.75
20	600309	万华化学	1,000	108,820.00	0.73
21	300059	东方财富	3,192	104,665.68	0.70
22	002304	洋河股份	502	104,014.40	0.70
23	002714	牧原股份	1,610	97,920.20	0.66

24	601919	中远海控	3,200	97,728.00	0.66
25	300782	卓胜微	180	96,750.00	0.65
26	603501	韦尔股份	300	96,600.00	0.65
27	600000	浦发银行	9,600	96,000.00	0.65
28	601398	工商银行	18,400	95,128.00	0.64
29	300122	智飞生物	500	93,365.00	0.63
30	002475	立讯精密	1,985	91,310.00	0.61
31	600436	片仔癀	200	89,660.00	0.60
32	002352	顺丰控股	1,300	88,010.00	0.59
33	600031	三一重工	2,900	84,303.00	0.57
34	600030	中信证券	3,300	82,302.00	0.55
35	600887	伊利股份	2,201	81,062.83	0.54
36	000333	美的集团	1,100	78,507.00	0.53
37	601328	交通银行	14,700	72,030.00	0.48
38	002142	宁波银行	1,830	71,315.10	0.48
39	601288	农业银行	23,200	70,296.00	0.47
40	002812	恩捷股份	300	70,230.00	0.47
41	000002	万科 A	2,900	69,049.00	0.46
42	601668	中国建筑	14,500	67,425.00	0.45
43	600104	上汽集团	3,000	65,910.00	0.44
44	601899	紫金矿业	6,800	65,892.00	0.44
45	000725	京东方 A	10,000	62,400.00	0.42
46	601816	京沪高铁	11,700	61,893.00	0.42
47	600438	通威股份	1,400	60,578.00	0.41
48	000538	云南白药	500	57,860.00	0.39
49	600585	海螺水泥	1,400	57,470.00	0.39
50	603799	华友钴业	500	57,100.00	0.38
51	601818	光大银行	15,000	56,700.00	0.38
52	300433	蓝思科技	1,900	55,879.00	0.38
53	300124	汇川技术	750	55,695.00	0.37
54	002371	北方华创	200	55,476.00	0.37

55	300014	亿纬锂能	531	55,186.83	0.37
56	601601	中国太保	1,900	55,043.00	0.37
57	600048	保利地产	4,500	54,180.00	0.36
58	002230	科大讯飞	800	54,064.00	0.36
59	600019	宝钢股份	7,000	53,480.00	0.36
60	603444	吉比特	100	53,000.00	0.36
61	002027	分众传媒	5,500	51,755.00	0.35
62	600690	海尔智家	1,900	49,229.00	0.33
63	002493	荣盛石化	2,850	49,219.50	0.33
64	002460	赣锋锂业	400	48,436.00	0.33
65	601211	国泰君安	2,800	47,992.00	0.32
66	600016	民生银行	10,694	47,160.54	0.32
67	002241	歌尔股份	1,100	47,014.00	0.32
68	000063	中兴通讯	1,400	46,522.00	0.31
69	300274	阳光电源	400	46,024.00	0.31
70	300751	迈为股份	100	45,470.00	0.31
71	300601	康泰生物	300	44,700.00	0.30
72	600660	福耀玻璃	800	44,680.00	0.30
73	600346	恒力石化	1,700	44,608.00	0.30
74	601688	华泰证券	2,800	44,240.00	0.30
75	300759	康龙化成	200	43,398.00	0.29
76	600196	复星医药	600	43,278.00	0.29
77	600028	中国石化	9,900	43,164.00	0.29
78	600893	航发动力	800	42,552.00	0.29
79	600837	海通证券	3,700	42,550.00	0.29
80	603986	兆易创新	224	42,089.60	0.28
81	601100	恒立液压	488	41,928.96	0.28
82	600763	通策医疗	100	41,100.00	0.28
83	002311	海大集团	500	40,800.00	0.27
84	601390	中国中铁	7,600	39,824.00	0.27
85	000166	申万宏源	8,500	39,780.00	0.27

86	601658	邮储银行	7,900	39,658.00	0.27
87	600406	国电南瑞	1,700	39,508.00	0.27
88	002709	天赐材料	370	39,434.60	0.26
89	601633	长城汽车	900	39,231.00	0.26
90	600745	闻泰科技	400	38,760.00	0.26
91	000661	长春高新	100	38,700.00	0.26
92	603659	璞泰来	280	38,248.00	0.26
93	300661	圣邦股份	150	37,909.50	0.25
94	601066	中信建投	1,200	37,716.00	0.25
95	600999	招商证券	1,960	37,279.20	0.25
96	002821	凯莱英	100	37,260.00	0.25
97	300413	芒果超媒	540	37,044.00	0.25
98	300142	沃森生物	600	37,020.00	0.25
99	000625	长安汽车	1,400	36,792.00	0.25
100	601336	新华保险	800	36,728.00	0.25
101	601989	中国重工	8,700	35,844.00	0.24
102	000338	潍柴动力	2,000	35,740.00	0.24
103	601229	上海银行	4,340	35,588.00	0.24
104	600703	三安光电	1,100	35,255.00	0.24
105	603993	洛阳钼业	6,800	35,088.00	0.24
106	601857	中国石油	6,600	34,914.00	0.23
107	600600	青岛啤酒	300	34,695.00	0.23
108	300999	金龙鱼	400	33,984.00	0.23
109	300033	同花顺	300	33,834.00	0.23
110	600760	中航沈飞	560	33,768.00	0.23
111	000100	TCL科技	4,400	33,660.00	0.23
112	603806	福斯特	320	33,641.60	0.23
113	601155	新城控股	800	33,280.00	0.22
114	601088	中国神华	1,700	33,184.00	0.22
115	601988	中国银行	10,700	32,956.00	0.22
116	603369	今世缘	600	32,496.00	0.22

117	603882	金域医学	200	31,954.00	0.21
118	300496	中科创达	200	31,412.00	0.21
119	600426	华鲁恒升	1,010	31,259.50	0.21
120	603833	欧派家居	220	31,231.20	0.21
121	002049	紫光国微	200	30,838.00	0.21
122	600919	江苏银行	4,330	30,743.00	0.21
123	002007	华兰生物	820	30,077.60	0.20
124	601009	南京银行	2,800	29,456.00	0.20
125	300595	欧普康视	280	28,994.00	0.19
126	601138	工业富联	2,300	28,543.00	0.19
127	002001	新和成	960	27,532.80	0.19
128	601966	玲珑轮胎	629	27,512.46	0.18
129	000786	北新建材	700	27,475.00	0.18
130	001979	招商蛇口	2,480	27,156.00	0.18
131	601628	中国人寿	800	27,112.00	0.18
132	600588	用友网络	813	27,040.38	0.18
133	002129	中环股份	700	27,020.00	0.18
134	601877	正泰电器	800	26,704.00	0.18
135	000963	华东医药	580	26,685.80	0.18
136	002074	国轩高科	600	26,136.00	0.18
137	300454	深信服	100	25,948.00	0.17
138	603160	汇顶科技	200	25,926.00	0.17
139	000799	酒鬼酒	100	25,560.00	0.17
140	002032	苏泊尔	400	25,516.00	0.17
141	300408	三环集团	600	25,452.00	0.17
142	000895	双汇发展	800	25,440.00	0.17
143	603345	安井食品	100	25,402.00	0.17
144	603899	晨光文具	300	25,368.00	0.17
145	600570	恒生电子	272	25,364.00	0.17
146	603517	绝味食品	300	25,287.00	0.17
147	600779	水井坊	200	25,270.00	0.17

148	002841	视源股份	200	24,858.00	0.17
149	603737	三棵树	140	24,640.00	0.17
150	002916	深南电路	220	24,448.60	0.16
151	300285	国瓷材料	500	24,375.00	0.16
152	601901	方正证券	2,600	24,336.00	0.16
153	002601	龙佰集团	700	24,206.00	0.16
154	600009	上海机场	500	24,065.00	0.16
155	000596	古井贡酒	100	23,950.00	0.16
156	600332	白云山	701	23,728.85	0.16
157	300676	华大基因	200	23,720.00	0.16
158	603939	益丰药房	416	23,333.44	0.16
159	300529	健帆生物	270	23,317.20	0.16
160	600989	宝丰能源	1,700	23,256.00	0.16
161	002508	老板电器	500	23,250.00	0.16
162	600150	中国船舶	1,400	23,114.00	0.16
163	002179	中航光电	290	22,915.80	0.15
164	603486	科沃斯	100	22,808.00	0.15
165	300207	欣旺达	700	22,792.00	0.15
166	300699	光威复材	300	22,785.00	0.15
167	601985	中国核电	4,500	22,770.00	0.15
168	000977	浪潮信息	808	22,729.04	0.15
169	600584	长电科技	600	22,608.00	0.15
170	601799	星宇股份	100	22,572.00	0.15
171	600460	士兰微	400	22,540.00	0.15
172	300003	乐普医疗	700	22,484.00	0.15
173	600486	扬农化工	200	22,354.00	0.15
174	002353	杰瑞股份	500	22,350.00	0.15
175	600010	包钢股份	14,300	22,165.00	0.15
176	002600	领益智造	2,400	22,056.00	0.15
177	002736	国信证券	2,000	21,500.00	0.14
178	601600	中国铝业	4,000	21,200.00	0.14

179	600547	山东黄金	1,100	21,142.00	0.14
180	600038	中直股份	400	21,096.00	0.14
181	000768	中航西飞	800	21,024.00	0.14
182	600741	华域汽车	800	21,016.00	0.14
183	600111	北方稀土	1,000	20,700.00	0.14
184	300253	卫宁健康	1,270	20,662.90	0.14
185	603589	口子窖	300	20,307.00	0.14
186	300316	晶盛机电	400	20,200.00	0.14
187	002414	高德红外	728	20,078.24	0.13
188	688002	睿创微纳	200	19,966.00	0.13
189	600845	宝信软件	390	19,851.00	0.13
190	600132	重庆啤酒	100	19,795.00	0.13
191	603658	安图生物	260	19,700.20	0.13
192	603605	珀莱雅	100	19,671.00	0.13
193	002791	坚朗五金	100	19,405.00	0.13
194	300347	泰格医药	100	19,330.00	0.13
195	601233	桐昆股份	800	19,272.00	0.13
196	300308	中际旭创	500	19,260.00	0.13
197	002050	三花智控	803	19,255.94	0.13
198	300450	先导智能	320	19,244.80	0.13
199	300357	我武生物	300	19,236.00	0.13
200	002156	通富微电	800	19,232.00	0.13
201	002624	完美世界	800	19,128.00	0.13
202	002223	鱼跃医疗	500	19,065.00	0.13
203	000938	紫光股份	864	18,904.32	0.13
204	002507	涪陵榨菜	500	18,830.00	0.13
205	600885	宏发股份	300	18,810.00	0.13
206	600183	生益科技	800	18,728.00	0.13
207	603233	大参林	360	18,399.60	0.12
208	603127	昭衍新药	100	18,375.00	0.12
209	002080	中材科技	700	18,319.00	0.12

210	000776	广发证券	1,200	18,168.00	0.12
211	600362	江西铜业	800	17,904.00	0.12
212	603185	上机数控	100	17,895.00	0.12
213	600926	杭州银行	1,200	17,700.00	0.12
214	000876	新希望	1,200	17,604.00	0.12
215	002603	以岭药业	600	17,496.00	0.12
216	300498	温氏股份	1,200	17,244.00	0.12
217	601021	春秋航空	300	17,070.00	0.11
218	688006	杭可科技	200	17,000.00	0.11
219	002236	大华股份	800	16,880.00	0.11
220	603883	老百姓	320	16,857.60	0.11
221	300482	万孚生物	260	16,819.40	0.11
222	002555	三七互娱	700	16,814.00	0.11
223	300628	亿联网络	200	16,760.00	0.11
224	002690	美亚光电	300	16,728.00	0.11
225	601225	陕西煤业	1,400	16,590.00	0.11
226	002153	石基信息	700	16,457.00	0.11
227	300146	汤臣倍健	500	16,450.00	0.11
227	002294	信立泰	500	16,450.00	0.11
229	600699	均胜电子	640	16,332.80	0.11
230	603707	健友股份	390	16,282.50	0.11
231	601916	浙商银行	4,100	16,277.00	0.11
232	002409	雅克科技	200	16,200.00	0.11
233	002180	纳思达	500	16,100.00	0.11
234	601878	浙商证券	1,200	15,696.00	0.11
235	601169	北京银行	3,200	15,584.00	0.10
236	300136	信维通信	500	15,440.00	0.10
237	002602	世纪华通	2,320	14,894.40	0.10
238	002372	伟星新材	720	14,882.40	0.10
239	601607	上海医药	700	14,791.00	0.10
240	600549	厦门钨业	700	14,581.00	0.10

241	600739	辽宁成大	700	14,567.00	0.10
242	603858	步长制药	640	14,393.60	0.10
243	000423	东阿阿胶	400	14,364.00	0.10
244	002299	圣农发展	600	14,328.00	0.10
245	601788	光大证券	800	14,312.00	0.10
246	600176	中国巨石	914	14,176.14	0.10
247	002422	科伦药业	700	13,965.00	0.09
248	600015	华夏银行	2,200	13,618.00	0.09
249	300144	宋城演艺	800	13,440.00	0.09
250	000999	华润三九	500	13,375.00	0.09
251	002568	百润股份	140	13,270.60	0.09
252	002925	盈趣科技	340	13,229.40	0.09
253	603866	桃李面包	420	13,104.00	0.09
254	600521	华海药业	620	12,945.60	0.09
255	002557	洽洽食品	300	12,930.00	0.09
256	600089	特变电工	1,000	12,850.00	0.09
257	603267	鸿远电子	100	12,792.00	0.09
258	600872	中炬高新	300	12,606.00	0.08
259	600143	金发科技	600	12,516.00	0.08
260	002384	东山精密	600	12,504.00	0.08
261	000738	航发控制	600	12,498.00	0.08
262	002405	四维图新	850	12,495.00	0.08
263	600886	国投电力	1,300	12,493.00	0.08
264	300677	英科医疗	100	12,480.00	0.08
265	688008	澜起科技	200	12,476.00	0.08
266	600674	川投能源	1,000	12,330.00	0.08
267	601995	中金公司	200	12,300.00	0.08
268	600801	华新水泥	700	12,299.00	0.08
269	600315	上海家化	200	12,028.00	0.08
270	000513	丽珠集团	240	12,004.80	0.08
271	600958	东方证券	1,200	11,988.00	0.08

272	601865	福莱特	300	11,859.00	0.08
273	002373	千方科技	700	11,690.00	0.08
274	000066	中国长城	800	11,680.00	0.08
275	002541	鸿路钢构	200	11,670.00	0.08
276	002138	顺络电子	300	11,631.00	0.08
277	300724	捷佳伟创	100	11,601.00	0.08
278	601377	兴业证券	1,200	11,592.00	0.08
279	600372	中航电子	700	11,585.00	0.08
280	002926	华西证券	1,200	11,556.00	0.08
281	600754	锦江酒店	200	11,390.00	0.08
282	000050	深天马 A	800	11,344.00	0.08
283	601939	建设银行	1,700	11,305.00	0.08
284	600383	金地集团	1,100	11,264.00	0.08
285	601689	拓普集团	300	11,229.00	0.08
286	000998	隆平高科	700	11,228.00	0.08
287	600498	烽火通信	600	11,178.00	0.08
288	601077	渝农商行	2,800	11,172.00	0.08
289	000157	中联重科	1,200	11,088.00	0.07
290	002511	中顺洁柔	400	11,020.00	0.07
291	002920	德赛西威	100	11,008.00	0.07
292	600352	浙江龙盛	800	10,992.00	0.07
293	002648	卫星石化	280	10,973.20	0.07
294	600298	安琪酵母	200	10,876.00	0.07
295	603712	七一二	300	10,830.00	0.07
296	002463	沪电股份	700	10,829.00	0.07
297	300558	贝达药业	100	10,824.00	0.07
298	002938	鹏鼎控股	300	10,764.00	0.07
299	600998	九州通	700	10,759.00	0.07
300	600188	兖州煤业	700	10,752.00	0.07
301	002078	太阳纸业	800	10,680.00	0.07
302	002202	金风科技	875	10,640.00	0.07

303	600161	天坛生物	308	10,549.00	0.07
304	600598	北大荒	700	10,472.00	0.07
305	000301	东方盛虹	500	10,450.00	0.07
306	002607	中公教育	500	10,445.00	0.07
307	002152	广电运通	800	10,424.00	0.07
308	000069	华侨城 A	1,400	10,416.00	0.07
309	000581	威孚高科	500	10,415.00	0.07
310	002625	光启技术	500	10,405.00	0.07
311	002430	杭氧股份	300	10,377.00	0.07
312	600061	国投资本	1,216	10,323.84	0.07
313	002444	巨星科技	300	10,224.00	0.07
314	002030	达安基因	480	10,195.20	0.07
315	600109	国金证券	800	10,152.00	0.07
316	601838	成都银行	800	10,112.00	0.07
317	300223	北京君正	100	10,092.00	0.07
318	601231	环旭电子	600	10,086.00	0.07
319	300383	光环新网	700	10,073.00	0.07
320	000703	恒逸石化	840	10,038.00	0.07
321	300037	新宙邦	100	10,010.00	0.07
322	603613	国联股份	100	9,997.00	0.07
323	600066	宇通客车	800	9,992.00	0.07
324	600511	国药股份	300	9,918.00	0.07
325	601360	三六零	800	9,768.00	0.07
326	002242	九阳股份	300	9,747.00	0.07
327	000975	银泰黄金	1,020	9,700.20	0.07
328	300212	易华录	360	9,687.60	0.07
329	601117	中国化学	1,100	9,636.00	0.06
330	600029	南方航空	1,600	9,632.00	0.06
331	600380	健康元	700	9,611.00	0.06
332	002120	韵达股份	710	9,606.30	0.06
333	000021	深科技	500	9,570.00	0.06

334	002563	森马服饰	800	9,560.00	0.06
335	600867	通化东宝	800	9,552.00	0.06
336	601699	潞安环能	800	9,448.00	0.06
337	000547	航天发展	500	9,435.00	0.06
338	000830	鲁西化工	500	9,365.00	0.06
339	002340	格林美	1,000	9,350.00	0.06
340	601111	中国国航	1,200	9,336.00	0.06
341	000623	吉林敖东	600	9,294.00	0.06
342	600655	豫园股份	800	9,272.00	0.06
343	002185	华天科技	600	9,234.00	0.06
344	600115	中国东航	1,800	9,144.00	0.06
345	600895	张江高科	500	9,135.00	0.06
346	002013	中航机电	900	9,063.00	0.06
347	000825	太钢不锈	1,200	8,988.00	0.06
348	002024	苏宁易购	1,600	8,944.00	0.06
349	000425	徐工机械	1,400	8,918.00	0.06
350	601669	中国电建	2,300	8,901.00	0.06
351	002456	欧菲光	1,000	8,880.00	0.06
352	000739	普洛药业	300	8,820.00	0.06
353	000783	长江证券	1,200	8,784.00	0.06
354	600875	东方电气	800	8,776.00	0.06
355	601198	东兴证券	800	8,744.00	0.06
356	000983	山西焦煤	1,050	8,725.50	0.06
357	300251	光线传媒	800	8,648.00	0.06
358	002019	亿帆医药	500	8,625.00	0.06
359	000728	国元证券	1,070	8,527.90	0.06
360	600079	人福医药	300	8,481.00	0.06
361	000860	顺鑫农业	200	8,436.00	0.06
362	601108	财通证券	800	8,392.00	0.06
363	002157	正邦科技	700	8,365.00	0.06
364	601618	中国中冶	2,800	8,344.00	0.06

365	002683	宏大爆破	300	8,331.00	0.06
366	601555	东吴证券	970	8,089.80	0.05
367	600522	中天科技	800	8,000.00	0.05
368	002399	海普瑞	500	7,965.00	0.05
369	000932	华菱钢铁	1,200	7,920.00	0.05
370	002212	天融信	400	7,908.00	0.05
371	600704	物产中大	1,000	7,870.00	0.05
372	002044	美年健康	860	7,834.60	0.05
373	600516	方大炭素	1,052	7,826.88	0.05
374	002127	南极电商	800	7,816.00	0.05
375	603816	顾家家居	100	7,728.00	0.05
376	000027	深圳能源	840	7,702.80	0.05
377	601933	永辉超市	1,600	7,568.00	0.05
378	601881	中国银河	700	7,546.00	0.05
379	002252	上海莱士	1,000	7,490.00	0.05
380	000401	冀东水泥	600	7,410.00	0.05
381	601990	南京证券	700	7,364.00	0.05
382	601216	君正集团	1,400	7,126.00	0.05
383	002064	华峰化学	500	7,100.00	0.05
384	600160	巨化股份	800	7,072.00	0.05
385	601098	中南传媒	800	7,056.00	0.05
385	000988	华工科技	300	7,056.00	0.05
387	603338	浙江鼎力	120	7,042.80	0.05
388	600489	中金黄金	799	6,887.38	0.05
389	001914	招商积余	400	6,872.00	0.05
390	002385	大北农	1,000	6,800.00	0.05
391	600642	申能股份	1,100	6,754.00	0.05
392	600018	上港集团	1,400	6,678.00	0.04
393	601872	招商轮船	1,440	6,652.80	0.04
394	002727	一心堂	200	6,622.00	0.04
394	002465	海格通信	700	6,622.00	0.04

396	002673	西部证券	800	6,600.00	0.04
397	300418	昆仑万维	400	6,552.00	0.04
398	002075	沙钢股份	600	6,546.00	0.04
399	600606	绿地控股	1,200	6,540.00	0.04
400	600153	建发股份	800	6,480.00	0.04
401	000656	金科股份	1,100	6,369.00	0.04
402	002065	东华软件	800	6,344.00	0.04
403	002081	金螳螂	800	6,336.00	0.04
404	600039	四川路桥	1,000	6,270.00	0.04
405	300296	利亚德	800	6,256.00	0.04
406	601696	中银证券	300	6,177.00	0.04
407	002010	传化智联	800	6,168.00	0.04
408	600862	中航高科	200	6,156.00	0.04
409	600219	南山铝业	1,700	6,120.00	0.04
410	000723	美锦能源	800	6,048.00	0.04
411	600879	航天电子	800	6,016.00	0.04
412	603638	艾迪精密	140	6,001.80	0.04
413	000807	云铝股份	500	5,950.00	0.04
414	601727	上海电气	1,400	5,936.00	0.04
415	000686	东北证券	700	5,915.00	0.04
416	300070	碧水源	800	5,848.00	0.04
417	600705	中航产融	1,500	5,805.00	0.04
418	600909	华安证券	1,040	5,792.80	0.04
419	000729	燕京啤酒	800	5,792.00	0.04
420	002797	第一创业	800	5,712.00	0.04
421	600536	中国软件	100	5,693.00	0.04
422	688009	中国通号	1,000	5,690.00	0.04
423	002146	荣盛发展	1,000	5,640.00	0.04
424	002939	长城证券	500	5,565.00	0.04
425	000402	金融街	800	5,400.00	0.04
426	002500	山西证券	800	5,368.00	0.04

427	600369	西南证券	1,100	5,357.00	0.04
428	601319	中国人保	900	5,337.00	0.04
429	002558	巨人网络	400	5,320.00	0.04
430	600177	雅戈尔	800	5,272.00	0.04
431	000750	国海证券	1,240	5,257.60	0.04
432	000671	阳光城	1,000	5,200.00	0.03
433	600011	华能国际	1,200	5,064.00	0.03
434	601598	中国外运	1,000	5,050.00	0.03
435	002266	浙富控股	1,000	4,990.00	0.03
436	600340	华夏幸福	949	4,972.76	0.03
437	600583	海油工程	1,100	4,950.00	0.03
438	600026	中远海能	800	4,928.00	0.03
439	002459	晶澳科技	100	4,900.00	0.03
440	000630	铜陵有色	1,800	4,896.00	0.03
441	600688	上海石化	1,300	4,888.00	0.03
442	603456	九洲药业	100	4,858.00	0.03
443	002572	索菲亚	200	4,840.00	0.03
444	000961	中南建设	800	4,736.00	0.03
445	600170	上海建工	1,700	4,692.00	0.03
446	000709	河钢股份	1,800	4,428.00	0.03
447	601162	天风证券	900	4,374.00	0.03
448	601128	常熟银行	700	4,340.00	0.03
449	600256	广汇能源	1,300	4,329.00	0.03
450	002151	北斗星通	100	4,307.00	0.03
451	300463	迈克生物	100	4,209.00	0.03
452	002506	协鑫集成	1,200	4,176.00	0.03
453	600027	华电国际	1,200	4,128.00	0.03
454	601099	太平洋	1,200	4,068.00	0.03
455	601992	金隅集团	1,500	4,035.00	0.03
456	601636	旗滨集团	200	3,712.00	0.02
457	000627	天茂集团	1,000	3,620.00	0.02

458	600392	盛和资源	200	3,472.00	0.02
459	600529	山东药玻	100	3,395.00	0.02
460	300088	长信科技	400	3,304.00	0.02
461	600803	新奥股份	200	3,302.00	0.02
462	601615	明阳智能	200	3,238.00	0.02
463	603027	千禾味业	120	3,154.80	0.02
464	002958	青农商行	700	2,996.00	0.02
465	600859	王府井	100	2,888.00	0.02
466	300773	拉卡拉	100	2,823.00	0.02
467	002131	利欧股份	1,200	2,808.00	0.02
468	000629	攀钢钒钛	1,200	2,748.00	0.02
469	603218	日月股份	100	2,708.00	0.02
470	002705	新宝股份	100	2,625.00	0.02
471	000540	中天金融	800	2,184.00	0.01
472	600848	上海临港	120	2,148.00	0.01
473	600827	百联股份	100	2,015.00	0.01
474	601058	赛轮轮胎	200	1,998.00	0.01
475	601456	国联证券	100	1,540.00	0.01
476	600988	赤峰黄金	100	1,499.00	0.01
477	000987	越秀金控	100	1,266.00	0.01
478	000800	一汽解放	100	1,082.00	0.01
479	600415	小商品城	200	1,030.00	0.01
480	600233	圆通速递	100	1,001.00	0.01
481	002429	兆驰股份	100	607.00	0.00

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无。

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	002594	比亚迪	112,266.00	0.79
2	688185	康希诺	112,188.00	0.79
3	601166	兴业银行	110,815.00	0.78
4	600900	长江电力	100,090.00	0.70
5	300760	迈瑞医疗	91,170.00	0.64
6	600031	三一重工	89,172.00	0.63
7	000333	美的集团	83,934.00	0.59
8	600036	招商银行	80,043.00	0.56
9	000001	平安银行	71,075.00	0.50
10	600030	中信证券	68,860.00	0.48
11	000858	五粮液	61,861.00	0.43
12	601816	京沪高铁	61,572.00	0.43
13	601318	中国平安	55,569.00	0.39
14	601288	农业银行	53,720.00	0.38
15	002714	牧原股份	51,703.00	0.36
16	601398	工商银行	50,500.00	0.35
17	000725	京东方 A	49,560.00	0.35
18	600887	伊利股份	49,000.00	0.34
19	300274	阳光电源	49,000.00	0.34
20	000661	长春高新	48,350.00	0.34

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	600519	贵州茅台	229,898.00	1.61
2	000661	长春高新	148,297.00	1.04

3	002594	比亚迪	146,639.00	1.03
4	002415	海康威视	145,360.00	1.02
5	000858	五粮液	133,324.00	0.93
6	600036	招商银行	125,097.00	0.88
7	688680	海优新材	112,230.00	0.79
8	601888	中国中免	97,995.00	0.69
9	601318	中国平安	90,500.00	0.63
10	300760	迈瑞医疗	84,348.00	0.59
11	300935	盈建科	83,423.00	0.58
12	300750	宁德时代	74,855.00	0.52
13	002271	东方雨虹	64,752.00	0.45
14	002304	洋河股份	63,028.00	0.44
15	300450	先导智能	56,537.00	0.40
16	300347	泰格医药	56,469.00	0.40
17	002352	顺丰控股	53,930.00	0.38
18	603259	药明康德	52,591.00	0.37
19	000596	古井贡酒	52,133.00	0.37
20	600276	恒瑞医药	51,342.00	0.36

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	3,792,634.20
卖出股票收入（成交）总额	4,131,268.30

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	370,000.00	2.49

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)	6,716.91	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	376,716.91	2.53

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	3,700	370,000.00	2.49
2	113050	南银转债	40	4,000.00	0.03
3	113049	长汽转债	10	1,000.00	0.01
4	127036	三花转债	7	916.91	0.01
5	127038	国微转债	5	500.00	0.00

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 报告期末，本基金投资的前十名证券除“招商银行（证券代码600036）”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 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	1,525.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,681.78
5	应收申购款	159,503.06
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	168,709.94

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

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
前海 开源M SCI中 国A股 指数A	732	6,293.61	0.00	0.00 0%	4,606,920.38	100.00 0%
前海 开源M SCI中	1,539	2,742.57	0.00	0.00 0%	4,220,822.13	100.00 0%

国A股 指数C						
合计	2,271	3,887.16	0.00	0.00 0%	8,827,742.51	100.00 0%

注：① 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	前海开源MSCI中国A 股指数A	-	-
	前海开源MSCI中国A 股指数C	350.40	0.0083%
	合计	350.40	0.0040%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资 和研究部门负责人持有本开放式 基金	前海开源MSCI中国 A股指数A	0
	前海开源MSCI中国 A股指数C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	前海开源MSCI中国 A股指数A	0
	前海开源MSCI中国 A股指数C	0

	合计	0
--	----	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	前海开源MSCI中国A股 指数A	前海开源MSCI中国A股 指数C
基金合同生效日(2018年11月27日)基金份额总额	14,095,545.22	214,322,737.96
本报告期期初基金份额总额	5,092,910.26	3,791,448.41
本报告期基金总申购份额	1,917,854.48	6,895,883.47
减：本报告期基金总赎回份额	2,403,844.36	6,466,509.75
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,606,920.38	4,220,822.13

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

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

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

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

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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源西部	2	2,716,528.00	34.70%	1,986.55	29.44%	-
招商证券	2	5,111,131.30	65.30%	4,760.19	70.56%	-

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
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部	134,566.50	20.86%	-	-	-	-	-	-
招商证券	510,557.95	79.14%	-	-	-	-	-	-

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MSCI中国A股指数型证券投资基金2020年第4	中国证监会规定媒介	2021-01-22

	季度报告		
4	前海开源基金管理有限公司旗下部分基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-02-08
5	前海开源MSCI中国A股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
6	前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金基金产品资料概要更新(20210312更新)	中国证监会规定媒介	2021-03-12
7	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公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	中国证监会规定媒介	2021-03-31
8	前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会规定媒介	2021-03-31
9	前海开源MSCI中国A股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MSCI中国A股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
11	前海开源MSCI中国A股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
12	前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2021-04-22
13	前海开源基金管理有限公司旗下部分基金开展赎回费率	中国证监会规定媒介	2021-04-23

	优惠活动的公告		
14	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
15	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
16	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金网下获配首次公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2021-05-12
17	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
18	前海开源基金管理有限公司旗下部分基金开展赎回费率优惠活动的公告	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%的情况无。

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MSCI中国A股指数型证券投资基金设立的文件

(2) 《前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金基金合同》

(3) 《前海开源MSCI中国A股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MSCI中国A股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、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