前海开源优质企业 6 个月持有期混合型证券投资基金

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:中国工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。

基金托管人中国工商银行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08日（基金合同生效日）起至2020年12月31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 8
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 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遵规守信情况的说明 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 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
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 14
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见 15
§6 中期财务会计报告(未经审计) 15
6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 18
6.4 报表附注 19
§7 投资组合报告 52
7.1 期末基金资产组合情况 52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 53
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 59
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 59
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 59
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 59
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 60
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 60
7.12 投资组合报告附注 60
§8 基金份额持有人信息 61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 62

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 62
§9 开放式基金份额变动 63
§10 重大事件揭示 63
10.1 基金份额持有人大会决议 63
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 63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 64
10.4 基金投资策略的改变 64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 64
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 64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 64
10.8 其他重大事件 68
§11 影响投资者决策的其他重要信息 70
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 70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 70
§12 备查文件目录 71
12.1 备查文件目录 71
12.2 存放地点 71
12.3 查阅方式 71

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	前海开源优质企业6个月持有混合	
基金主代码	010717	
基金运作方式	契约型其他开放式	
基金合同生效日	2021年01月08日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,589,962,926.63份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海开源优质企业6个月持有混合A	前海开源优质企业6个月持有混合C
下属分级基金的交易代码	010717	010718
报告期末下属分级基金的份额总额	9,300,109,303.10份	1,289,853,623.53份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在深入研究的基础上，重点投资增长性良好的优质企业，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略主要有以下七方面内容： （一）大类资产配置 本基金将综合运用定性和定量的分析方法，在对宏观经济进行深入研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段及变化趋势，并结合估值水平、政策取向等因素，综合评估各大类资产的预期收益率和风险，合理确定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例，以最大限度降低投资组合的风险、提高投资组合的收益。 （二）股票投资策略 本基金力图对公司及行业所处的基本面进行深入

	分析和把握，自下而上地精选增长性良好的优质企业构建投资组合。 本基金将采取"自下而上"为主、"自上而下"为辅的研究方法，重点关注符合经济发展趋势、产业转型升级方向，具有巨大成长空间的行业，同时充分挖掘市场中公司治理结构优良、在细分行业中具有较高行业地位，具备市场竞争优势的优质公司。 1、个股选择 本基金将主要采用"自下而上"的研究方法，通过定量与定性相结合的分析方法选筛选个股。 2、股票投资组合的构建 本基金将结合定性分析和定量分析等研究成果，综合考量企业家精神、公司治理、竞争优势、核心壁垒、产业地位、过往业绩等方面，通过深入的基本面研究分析，精选出增长性良好的优质企业，并在产业竞争中掌握核心竞争优势的优质上市公司形成股票投资组合，并根据行业趋势等因素进行动态调整。 另外，本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。本基金将遵循优质企业投资思路，优先将基本面健康、业绩增长潜力大、具有市场竞争优势的港股纳入本基金的股票投资组合。 （三）债券投资策略 在债券投资策略方面，本基金将在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，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。在宏观环境分析方面，结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定不同类属资产的最优权重。 在微观市场定价分析方面，本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，重

	点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。 （四）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。 （五）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。 （六）证券公司短期公司债券投资策略 本基金将通过对证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等调查研究，分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平，对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。 （七）可转换债券、可交换债券投资策略 本基金将通过相对价值分析、基本面研究、估值分析、可转换债券条款分析，选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资。另外，可交换公司债方面，对于考虑债性因素而投资的可交换债券，需重点考察抵押股票的充足度、提前赎回条款等；对于考虑股性因素而投资的可交换债券，则需重点考虑转股价、转股价下修条款等因素。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+恒生指数收益率×15%+银行活期存款利率（税后）×15%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人

名称		前海开源基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌	郭明
	联系电话	0755-88601888	010-66105799
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4001666998	95588
传真		0755-83181169	010-66105798
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦2206	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		王兆华	陈四清

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点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年01月08日（基金合同生效日）-2021年06月30日）	
	前海开源优质企业6个月持有混合A	前海开源优质企业6个月持有混合C
本期已实现收益	-826,390,372.56	-115,059,727.55
本期利润	-384,786,415.99	-51,415,045.41
加权平均基金份额本期利润	-0.0426	-0.0433
本期加权平均净值利润率	-4.42%	-4.51%
本期基金份额净值增长率	-4.42%	-4.78%
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	-840,325,256.73	-120,947,457.51
期末可供分配基金份额利润	-0.0904	-0.0938
期末基金资产净值	8,888,872,130.92	1,228,160,612.42
期末基金份额净值	0.9558	0.9522
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	-4.42%	-4.78%

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。

④本基金合同于2021年1月8日生效，截止2021年6月30日，本基金成立不满半年，本报告期不是完整报告期（半年）。

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

前海开源优质企业6个月持有混合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	-0.94%	1.05%	-1.56%	0.63%	0.62%	0.42%
过去三个月	2.39%	1.03%	2.74%	0.77%	-0.35%	0.26%
自基金合同生效起至今	-4.42%	1.31%	-2.79%	1.04%	-1.63%	0.27%

前海开源优质企业6个月持有混合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	-1.01%	1.05%	-1.56%	0.63%	0.55%	0.42%
过去三个月	2.19%	1.03%	2.74%	0.77%	-0.55%	0.26%
自基金合同生效起至今	-4.78%	1.31%	-2.79%	1.04%	-1.99%	0.27%

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

注：①本基金的基金合同于 2021 年 1 月 8 日生效，截至 2021 年 6 月 30 日止，本基金成立未满 1 年。

②本基金的建仓期为 6 个月，截至 2021 年 6 月 30 日，本基金建仓期尚未结束。

§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		
曲扬	本基金的基金经理、公司副总经理、投资决策委员会主席	2021-01-08	-	13年	曲扬先生，清华大学博士研究生。历任南方基金管理有限公司研究员、基金经理助理、南方全球精选基金经理，2009年11月至2013年1月担任南方基金香港子公司投资经理助理、投资经理。2014年7月加入前海开源基金管理有限公司，现任公司副总经理、投资决策委员会主席。

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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，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，疫情影响逐步减弱，全球经济逐渐回升，通胀上行并在二季度维持在较高水平，加息预期上升。春节前后市场风格发生变化，弱周期行业在春节后出现较大回调，受益通胀上行的顺周期行业跑赢市场。上半年市场整体横盘震荡，结构分化，沪深300指数上涨0.24%，恒生指数上涨5.86%。本基金一月份成立后逐步建仓，重点配置了A股和港股中互联网、消费、医药、高端制造等方向的标的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源优质企业6个月持有混合A基金份额净值为0.9558元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.42%，同期业绩比较基准收益率为-2.79%；截至报

告期末前海开源优质企业6个月持有混合C基金份额净值为0.9522元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.78%，同期业绩比较基准收益率为-2.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济处于转型阶段，经济结构逐渐改善，宏观政策较为温和。展望2021年下半年，疫情对宏观经济造成的影响逐步减弱，通胀预期可能是影响市场风格及表现的重要因素。预计市场整体震荡概率较大，以结构性机会为主。本基金持仓将聚焦A股和港股中朝阳行业的优质公司，力争获得持续稳定的超额回报。

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

本报告期内，本基金托管人在对前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金的管理人--前海开源基金管理有限公司在前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对前海开源基金管理有限公司编制和披露的前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金2021年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金

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
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	1,606,766,295.46
结算备付金		50,036,754.04
存出保证金		2,916,212.94
交易性金融资产	6.4.7.2	8,646,095,006.96
其中：股票投资		8,646,095,006.96
基金投资		-
债券投资		-
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		334,050.23
应收利息	6.4.7.5	165,327.05
应收股利		2,532,211.20
应收申购款		4,938,698.82
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		10,313,784,556.70
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2021年06月30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		177,817,878.19
应付赎回款		-
应付管理人报酬		12,160,249.79
应付托管费		2,026,708.28
应付销售服务费		780,368.29
应付交易费用	6.4.7.7	3,824,601.33
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	142,007.48
负债合计		196,751,813.36
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	10,589,962,926.63
未分配利润	6.4.7.10	-472,930,183.29
所有者权益合计		10,117,032,743.34
负债和所有者权益总计		10,313,784,556.70

注：1、报告截止日2021年6月30日，前海开源优质企业6个月持有混合基金份额总额10,589,962,926.63份，其中前海开源优质企业6个月持有混合A类基金份额净值0.9558元，基金份额9,300,109,303.10份；前海开源优质企业6个月持有混合C类基金份额净值0.9522元，基金份额1,289,853,623.53份。

2、本财务报表的实际编制期间为2021年1月8日(基金合同生效日)至2021年6月30日止期间。

6.2 利润表

会计主体：前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月08日（基金合同生效日）至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月08日(基金合同生效日）至2021年06月30日
一、收入		-329,295,514.14
1.利息收入		10,239,956.30
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,977,926.04
债券利息收入		2,391,263.73
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,870,766.53
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-844,784,109.15
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-872,660,401.18
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	7.4.7.6	4,900.00
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	27,871,392.03
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.18	505,248,638.71

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	-
减：二、费用		106,905,947.26
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	70,243,983.82
2．托管费	6.4.10.2.2	11,707,330.67
3．销售服务费	6.4.10.2.3	4,341,588.28
4．交易费用	6.4.7.20	20,468,684.08
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	144,360.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-436,201,461.40
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-436,201,461.40

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月08日（基金合同生效日）至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月08日（基金合同生效日）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)	9,999,999,779.50	-	9,999,999,779.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-436,201,461.40	-436,201,461.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以	589,963,147.13	-36,728,721.89	553,234,425.24

“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	589,963,147.13	-36,728,721.89	553,234,425.24
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	10,589,962,926.63	-472,930,183.29	10,117,032,743.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

秦亚峰	何璁	傅智
————————	————————	————————
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金(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[2020]2759号《关于准予前海开源优质企业6个月持有期混合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《前海开源优质企业6个月持有期混合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9,999,999,779.50元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0039号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于2021年1月8日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为9,999,999,779.50份基金份额，无认购资金利息折份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金对投资者持有的每份基金份额设定6个月的最短持有期，最短持有期起始日指基金合同生效日(对认购份额而言)或基金份额申购申请确认日(对申购份额而言)或基金份额转换转入确认日(对转换转入份额而言)最短持有期到期日指最短持有期起始日次6个月的月度对日的前一日。在最短持有期内，基金份额持有人不能对该基金份额

提出赎回或转换申请，最短持有期届满后的下一个工作日(含该日)起可以提出赎回或转换申请。

本基金根据认购/申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/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《前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称"港股通标的股票")、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、永续债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转换债券、证券公司发行的短期公司债券等)、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为60%-95%(投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的50%)；每个交易日日终，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金(含股指期货合约需缴纳的交易保证金等)和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+恒生指数收益率×15%+银行活期存款利率(税后)×15%。

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》、《前海开源优质企业6个月持有期混合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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2021年1月8日(基金合同生效日)至2021年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若投资者选择红利再投资方式进行收益分配，基金管理人将按除权除息日的各类基金份额净值将投资者的现金红利转为相应类别的基金份额进行再投资，红利再投资的基金份额最短持有期到期日与原基金份额的最短持有期到期日保持一致；

(3)基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值；即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)本基金的同一类别的每份基金份额享有同等分配权，由于本基金各类基金份额收取费用情况不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称"指引")，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中国结算")提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	1,606,766,295.46
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-

存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	1,606,766,295.46

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		8,140,846,368.25	8,646,095,006.96	505,248,638.71
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		8,140,846,368.25	8,646,095,006.96	505,248,638.71

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	141,862.10
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	22,837.92
应收债券利息	-
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	627.03
合计	165,327.05

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	3,824,601.33
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,824,601.33

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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	140,588.88
其他应付	1,418.60
合计	142,007.48

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 前海开源优质企业6个月持有混合A

金额单位：人民币元

项目（前海开源优质企业6个月持有混合A）	本期 2021年01月08日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	8,872,305,502.72	8,872,305,502.72
本期申购	427,803,800.38	427,803,800.38
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	9,300,109,303.10	9,300,109,303.10

6.4.7.9.2 前海开源优质企业6个月持有混合C

金额单位：人民币元

项目（前海开源优质企业6个月持有混合C）	本期 2021年01月08日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,127,694,276.78	1,127,694,276.78
本期申购	162,159,346.75	162,159,346.75
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,289,853,623.53	1,289,853,623.53

注：本基金于2021年1月6日公开发售，共募集有效净认购资金人民币9,999,999,779.50元，折合为9,999,999,779.50份基金份额（其中A类基金份额为8,872,305,502.72，C类基金份额为1,127,694,276.78）。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 前海开源优质企业6个月持有混合A

单位：人民币元

项目（前海开源优质企业6个月持有混合A）	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-826,390,372.56	441,603,956.57	-384,786,415.99
本期基金份额交易产生的变动数	-13,934,884.17	-12,515,872.02	-26,450,756.19
其中：基金申购款	-13,934,884.17	-12,515,872.02	-26,450,756.19
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-840,325,256.73	429,088,084.55	-411,237,172.18

6.4.7.10.2 前海开源优质企业6个月持有混合C

单位：人民币元

项目（前海开源优质企业6个月持有混合C）	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-115,059,727.55	63,644,682.14	-51,415,045.41
本期基金份额交易产生的变动数	-5,887,729.96	-4,390,235.74	-10,277,965.70
其中：基金申购款	-5,887,729.96	-4,390,235.74	-10,277,965.70
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-120,947,457.51	59,254,446.40	-61,693,011.11

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月08日（基金合同生效日）至2021年06月30日
活期存款利息收入	5,741,325.80
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	183,300.89
其他	53,299.35
合计	5,977,926.04

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08日（基金合同生效日）至2021年06月30日
卖出股票成交总额	3,062,710,169.60
减：卖出股票成本总额	3,935,370,570.78
买卖股票差价收入	-872,660,401.18

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08日（基金合同生效日）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	4,900.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-

合计	4,900.00

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08日（基金合同生效日）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	500,000,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	497,550,100.00
减：应收利息总额	2,445,000.00
买卖债券差价收入	4,900.00

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08日（基金合同生效日）至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	27,871,392.03
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	27,871,392.03

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08日（基金合同生效日）至2021年06月30日
1.交易性金融资产	505,248,638.71
——股票投资	505,248,638.71
——债券投资	-
——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	505,248,638.71

6.4.7.19 其他收入

无。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月08日（基金合同生效日）至2021年06月30日
交易所市场交易费用	20,466,384.08
银行间市场交易费用	2,300.00
合计	20,468,684.08

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月08日（基金合同生效日）至2021年06月30日
审计费用	82,625.64
信息披露费	53,463.24
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,871.53
账户维护费	6,000.00
其他费用	400.00
合计	144,360.41

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司(“前海开源基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月08日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
开源证券股份有限公司	2,640,242,521.22	17.45%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月08日（基金合同生效日）至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
开源证券股份有限公司	1,954,251.66	17.36%	824,299.07	21.55%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月08日（基金合同生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	70,243,983.82
其中：支付销售机构的客户维护费	30,465,228.08

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1.50%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×1.50%/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08日（基金合同生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	11,707,330.67

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25%/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08日（基金合同生效日）至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源优质企业6个月持有混合A	前海开源优质企业6个月持有混合C	合计
中国工商银行	0.00	255,105.74	255,105.74
前海开源基金	0.00	13,741.81	13,741.81
开源证券	0.00	1,839.96	1,839.96
合计	0.00	270,687.51	270,687.51

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0.80%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×　0.80%/　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08日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,606,766,295.46	5,741,325.80

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	可流	流通	认购	期末	数量	期末	期末	备注

代码	名称	认购日	通日	受限类型	价格	估值单价	（单位：股）	成本总额	估值总额	
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	创业板打新限售	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
688316	青云科技	2021-03-05	2021-09-16	科创板打新限售	63.70	65.00	1,428	90,963.60	92,820.00	-
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	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	创业板打新限售	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
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	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	创业板打新限售	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
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	-

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	-
688659	元琛科技	2021-03-24	2021-10-08	科创板打新限售	6.50	10.46	3,671	23,861.50	38,398.66	-
688367	工大高科	2021-06-21	2021-12-28	科创板打新限售	11.53	17.94	1,717	19,797.01	30,802.98	-
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	2021-06-04	2021-12-16	科创板打新限售	9.56	14.54	1,661	15,879.16	24,150.94	-
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	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	创业板打新限售	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	创业板打新限售	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	创业板打新限售	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-

300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	创业板打新限售	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	创业板打新限售	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	创业板打新限售	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	创业板打新限售	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	创业板打新限售	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
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	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-

				售						
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	创业板打新限售	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
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	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	创业板打新限售	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	创业板打新限售	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
3009	商络	2021	2021	创业	5.48	13.0	463	2,53	6,03	-

75	电子	-04-14	-10-21	板打新限售		3		7.24	2.89	
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	创业板打新限售	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	创业板打新限售	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	创业板打新限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	创业板打新限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	创业板打新限售	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	创业板打新限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
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	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-

				售						
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	-

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

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。

于2021年6月30日，本基金未持有债券、资产支持证券和同业存单投资。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

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

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在开放期每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎

回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2021年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,606,766,295.46	-	-	-	1,606,766,295.46
结算备付金	50,036,754.04	-	-	-	50,036,754.04
存出保证金	2,916,212.94	-	-	-	2,916,212.94
交易性金融资产	-	-	-	8,646,095,006.96	8,646,095,006.96
应收证券清算款	-	-	-	334,050.23	334,050.23
应收利息	-	-	-	165,327.05	165,327.05
应收股利	-	-	-	2,532,211.20	2,532,211.20
应收申购款	-	-	-	4,938,698.82	4,938,698.82
资产总计	1,659,719,262.44	-	-	8,654,065,294.26	10,313,784,556.70
负债					
应付证券清算	-	-	-	177,817,878.19	177,817,878.19

款					
应付管理人报酬	-	-	-	12,160,249.79	12,160,249.79
应付托管费	-	-	-	2,026,708.28	2,026,708.28
应付销售服务费	-	-	-	780,368.29	780,368.29
应付交易费用	-	-	-	3,824,601.33	3,824,601.33
其他负债	-	-	-	142,007.48	142,007.48
负债总计	-	-	-	196,751,813.36	196,751,813.36
利率敏感度缺口	1,659,719,262.44	-	-	8,457,313,480.90	10,117,032,743.34

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

于2021年6月30日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	3,549,416,19	-	3,549,416,19

		5.45		5.45
应收股利	-	2,532,211.20	-	2,532,211.20
资产合计	-	3,551,948,406.65	-	3,551,948,406.65
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	3,551,948,406.65	-	3,551,948,406.65

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外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
	港币对人民币升值5%	177,597,420.33
	港币对人民币贬值5%	-177,597,420.33

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	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产－股票投资	8,646,095,006.96	85.46
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	8,646,095,006.96	85.46

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
	业绩比较基准上升5%	644,093,491.50
	业绩比较基准下降5%	-644,093,491.50

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	8,646,095,006.96	83.83
	其中：股票	8,646,095,006.96	83.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,656,803,049.50	16.06
8	其他各项资产	10,886,500.24	0.11
9	合计	10,313,784,556.70	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为3,549,416,195.45元，占资产净值比例35.08%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,265,283,622.89	42.16
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	0.00
F	批发和零售业	82,094.47	0.00
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	115,227.83	0.00
J	金融业	34,721.10	0.00

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	831,074,432.50	8.21
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	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,096,678,811.51	50.38

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	343,133,150.40	3.39
金融	81,960,395.89	0.81
医疗保健	926,705,760.16	9.16
信息技术	305,993,259.60	3.02
电信服务	899,951,101.44	8.9
地产业	991,672,527.96	9.8
合计	3,549,416,195.45	35.08

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

1	06098	碧桂园服务	14,205,000	991,672,527.96	9.80
2	300750	宁德时代	1,791,857	958,285,123.60	9.47
3	600519	贵州茅台	442,003	909,067,570.10	8.99
4	00700	腾讯控股	1,852,000	899,951,101.44	8.90
5	02269	药明生物	7,396,500	875,782,464.16	8.66
6	300014	亿纬锂能	8,047,070	836,331,985.10	8.27
7	601888	中国中免	2,769,325	831,074,432.50	8.21
8	000858	五 粮 液	2,742,005	816,815,869.45	8.07
9	01211	比亚迪股份	1,500,000	289,813,464.00	2.86
9	002594	比亚迪	900,000	225,900,000.00	2.23
10	03888	金山软件	7,900,000	305,993,259.60	3.02
11	300760	迈瑞医疗	637,294	305,932,984.70	3.02
12	600563	法拉电子	1,337,541	211,812,992.76	2.09
13	06030	中信证券	5,056,500	81,960,395.89	0.81
14	03690	美团－W	200,000	53,319,686.40	0.53
15	06078	海吉亚医疗	600,000	50,923,296.00	0.50
16	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
17	688316	青云科技	1,428	92,820.00	0.00
18	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
19	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
20	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.00
21	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
22	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
23	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
24	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
25	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.00
26	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
27	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
28	688659	元琛科技	3,671	38,398.66	0.00
29	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
30	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.00

31	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
32	688681	科汇股份	1,661	24,150.94	0.00
33	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
34	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
35	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
36	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
37	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
38	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
39	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
40	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
41	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
42	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
43	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
44	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
45	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
46	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
47	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
48	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
49	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
50	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
51	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
52	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
53	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
54	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
55	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
56	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
57	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
58	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
59	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
60	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
61	300991	创益通	254	6,733.54	0.00

62	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
63	300975	商络电子	463	6,032.89	0.00
64	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
65	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
66	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
67	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
68	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
69	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
70	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
71	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
72	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
73	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
74	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

注：所用证券代码采用当地市场代码。

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	1,097,847,671.57	10.85
2	000858	五 粮 液	1,036,653,995.16	10.25
3	00700	腾讯控股	1,020,419,627.70	10.09
4	600519	贵州茅台	986,560,228.52	9.75
5	601888	中国中免	971,568,949.05	9.60
6	300677	英科医疗	873,649,699.81	8.64
7	02269	药明生物	837,482,732.68	8.28
8	06098	碧桂园服务	827,331,723.95	8.18
9	300014	亿纬锂能	821,568,768.15	8.12
10	01211	比亚迪股	284,121,169.48	2.81

		份		
10	002594	比亚迪	223,594,044.32	2.21
11	000661	长春高新	415,419,907.12	4.11
12	03888	金山软件	377,912,854.31	3.74
13	00027	银河娱乐	352,678,450.50	3.49
14	06969	思摩尔国际	314,447,862.57	3.11
15	300760	迈瑞医疗	289,928,063.46	2.87
16	00941	中国移动	278,759,154.19	2.76
17	600436	片仔癀	197,177,642.67	1.95
18	600563	法拉电子	188,547,604.43	1.86
19	000860	顺鑫农业	124,347,080.64	1.23
20	06030	中信证券	122,143,775.20	1.21

注：①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。
②所用证券代码采用当地市场代码。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000661	长春高新	365,535,673.05	3.61
2	300677	英科医疗	341,842,741.18	3.38
3	00027	银河娱乐	304,930,329.62	3.01
4	300750	宁德时代	268,507,493.30	2.65
5	00941	中国移动	256,772,555.30	2.54
6	06969	思摩尔国际	207,665,941.67	2.05
7	600436	片仔癀	206,759,650.20	2.04
8	000858	五 粮 液	195,554,990.92	1.93
9	601888	中国中免	183,888,331.63	1.82
10	00700	腾讯控股	126,628,948.40	1.25

11	000860	顺鑫农业	103,878,403.47	1.03
12	000568	泸州老窖	91,240,721.10	0.90
13	02269	药明生物	90,846,299.48	0.90
14	300015	爱尔眼科	76,825,209.80	0.76
15	600519	贵州茅台	58,670,329.00	0.58
16	02313	申洲国际	51,867,475.70	0.51
17	06030	中信证券	49,685,630.01	0.49
18	002241	歌尔股份	46,447,187.12	0.46
19	300014	亿纬锂能	10,807,772.00	0.11
20	600529	山东药玻	2,557,447.00	0.03

注：①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。
②所用证券代码采用当地市场代码。

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	12,076,216,939.03
卖出股票收入（成交）总额	3,062,710,169.60

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

无。

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

无。

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	2,916,212.94
2	应收证券清算款	334,050.23
3	应收股利	2,532,211.20
4	应收利息	165,327.05
5	应收申购款	4,938,698.82

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,886,500.24

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

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
前海开源优质企业6个月持有混合A	243,483	38,196.13	38,068,338.22	0.41%	9,262,040,964.88	99.59%
前海开源优质企业6	147,574	8,740.39	3,539,268.99	0.27%	1,286,314,354.54	99.73%

个月持有混合C						
合计	391,057	27,080.36	41,607,607.21	0.39%	10,548,355,319.42	99.61%

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

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	前海开源优质企业6个月持有混合A	1,366,581.04	0.01%
	前海开源优质企业6个月持有混合C	692,443.58	0.05%
	合计	2,059,024.62	0.02%

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	前海开源优质企业6个月持有混合A	0
	前海开源优质企业6个月持有混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	前海开源优质企业6个月持有混合A	0
	前海开源优质企业	0

	6个月持有混合C	
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	前海开源优质企业6个月持有混合A	前海开源优质企业6个月持有混合C
基金合同生效日(2021年01月08日)基金份额总额	8,872,305,502.72	1,127,694,276.78
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	427,803,800.38	162,159,346.75
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	9,300,109,303.10	1,289,853,623.53

§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，何璁先生自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，基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称"本公司"） 根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	1,939,846.00	0.01%	1,418.60	0.01%	-
瑞信	1	-	-	-	-	-

方正						
申万宏源西部	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	181,479,926.02	1.20%	132,717.61	1.18%	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	1,348,212,144.45	8.91%	1,013,276.54	9.00%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	166,644,132.79	1.10%	126,681.10	1.13%	-
大同证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	858,944,591.88	5.68%	681,978.89	6.06%	-
东莞证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	3,354,889,510.41	22.17%	2,528,031.36	22.46%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

华西证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	2,640,242,521.22	17.45%	1,954,251.66	17.36%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	973,539,701.63	6.43%	517,240.63	4.59%	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	1,324,175,228.96	8.75%	1,043,732.80	9.27%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	2,464,345,150.09	16.29%	1,866,961.93	16.58%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
山西证券	3	-	-	-	-	-
华安	4	1,815,826,888.68	12.00%	1,391,854.59	12.36%	-

证券						

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

A：选择标准

1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；

2、公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；

3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；

4、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程

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

1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；

2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；

3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	3,775,600,000.00	100.00%	-	-	-	-

万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金提前结束募集并进行比例配售的提示性公告	中国证监会规定媒介	2021-01-06
2	前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金提前结束募集并进行比例配售的公告	中国证监会规定媒介	2021-01-07
3	前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金认购申请确认比例结果的公告	中国证监会规定媒介	2021-01-08
4	前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2021-01-09
5	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
6	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
7	前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金开放日常申购、转换转入及定投业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-05
8	前海开源基金关于前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金参与部分代销机构费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-06
9	前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金基	中国证监会规定媒介	2021-03-12

	金产品资料概要更新（20210312更新）		
10	前海开源优质企业6个月持有期混合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
11	前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金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
15	前海开源基金管理有限公司关于调整前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金申购等业务最低限额的公告	中国证监会规定媒介	2021-06-09

§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、为更好的满足投资者的投资需求，本公司决定自2021年6月9日起，调整本基金的首次及追加单笔申购最低金额、单笔赎回最低份额限制，自2021年6月9日起，投资人投资本基金的首次及追加单笔申购最低金额由10元调整为1元，单笔赎回最低份额由10份调整为1份。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优质企业6个月持有期混合型证券投资基金设立的文件

（2）《前海开源优质企业6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》

（3）《前海开源优质企业6个月持有期混合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）前海开源优质企业6个月持有期混合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