

前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金

2022 年中期报告

2022 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:中国银河证券股份有限公司

送出日期:2022 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。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月26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2022年01月01日起至2022年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	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	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	70
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	70
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	70
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	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
7.12 投资组合报告附注	71
§8 基金份额持有人信息	72
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
8.2 期末上市基金前十名持有人	72

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	73
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	73
§9 开放式基金份额变动.....	73
§10 重大事件揭示.....	73
10.1 基金份额持有人大会决议.....	73
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.....	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
10.4 基金投资策略的改变.....	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
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.....	74
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
10.8 其他重大事件.....	75
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	78
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.....	78
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	79
§12 备查文件目录.....	79
12.1 备查文件目录.....	79
12.2 存放地点.....	79
12.3 查阅方式.....	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	前海开源中证500等权ETF
场内简称	500等权ETF
基金主代码	515590
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019年11月14日
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	中国银河证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	30,113,665.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020年01月20日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以采取包括抽样复制在内的其他指数投资技术适当对投资组合管理进行变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> <p>在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。如</p>

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

1、股票投资策略

(1) 股票投资组合的构建

本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

(2) 股票投资组合的调整

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

2、金融衍生品投资策略

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

3、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

	<p>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。</p> <p>4、融资及转融通证券出借业务的投资策略</p> <p>本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。</p> <p>5、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	中证500等权重指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场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	中国银河证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙辰健
	联系电话	0755-83182300
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com
客户服务电话	4001-666-998	95551; 400-888-8888
传真	0755-83181169	010-80928078
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾	北京市丰台区西营街8号院1

	一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	号楼7至18层101
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	北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦
邮政编码	518040	100073
法定代表人	李强	陈亮

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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日- 2022年06月30日)
本期已实现收益	-1,691,154.86
本期利润	-4,058,988.94
加权平均基金份额本期利润	-0.1471
本期加权平均净值利润率	-10.09%
本期基金份额净值增长率	-9.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末

	(2022年06月30日)
期末可供分配利润	14,721,645.41
期末可供分配基金份额利润	0.4889
期末基金资产净值	44,835,310.41
期末基金份额净值	1.4889
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率	48.89%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.73%	0.96%	6.15%	0.96%	0.58%	0.00%
过去三个月	2.11%	1.65%	0.82%	1.65%	1.29%	0.00%
过去六个月	-9.73%	1.57%	-10.52%	1.58%	0.79%	-0.01%
过去一年	-0.22%	1.28%	-1.72%	1.29%	1.50%	-0.01%
自基金合同生效起至今	48.89%	1.29%	32.84%	1.32%	16.05%	-0.03%

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

前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至报告期末，前海开源基金旗下管理97只开放式基金，资产管理规模超过1474亿元。

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	2020-05-07	-	8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，现任公司指数化投资团队基金经理。

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

上半年前四个月A股被突如其来的内外“黑天鹅”事件冲击，市场出现了极度悲观情绪的集中宣泄。投资者对地缘政治冲突、大宗商品价格暴涨导致的通胀压力、美联储加息等因素反应过度，同时受国内各地疫情反复影响，市场出现了明显的超跌。五月以来A股无视海外资本市场动荡展开了强势反攻。本基金标的指数中证500等权重指数自四月底以来触底反弹超过22%，但上半年累计跌幅仍然高达10.52%。站在当前时点展望，地缘政治方面，俄乌冲突长期化，事态继续升级的可能性较小，事件对市场冲击高点可能已经过去。海外流动方面，在当前通胀高企的背景下，鹰派的立场更有利于美国以较小的代价降低通胀，后续美联储大概率仍将维持强硬的鹰派政策立场，但美联储货币政策对市场影响最大的预期发酵阶段已经过去，对国内资产价格的影响将让位于国内基本面。伴随着疫情的显著缓解，常态化核酸检测等措施下预计未来疫情持续可控。产业链复工情况好转带动6月工业增加值明显改善，市场信心得到了明显的修复。国内货币政策继续“以我为主”保持宽松，财政方面一揽子纾困政策在二季度已加速落地，下半年稳就业政策不断出台，国内经济有望在下半年加速复苏。考虑到2022年国内流动性仍然将处于偏宽松状况，成长属性更强的中证500等权重指数当前整体估值仍然较低，滚动市盈率略高于20倍，约为近十年历史分位的11%，中长期来看仍然具有较高的配置价值。

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，力争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，并通过参与新股申购、现金管理、期现套利等方式获得超额收益。本基金将持续关注成份股的基本面变化情况，通过监控成份股负面信息及其影响，在不影响本基金投资运作的情况下及时对“地雷股”进行出清，并力争通过多种方式对基金业绩进行一定的增厚，积跬步以致千里，力争在紧密跟踪业绩比较基准并追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的同时，能够为持有人贡献一定的业绩正偏离。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源中证500等权ETF基金份额净值为1.4889元，本报告期内，基金份额净值增长率为-9.73%，同期业绩比较基准收益率为-10.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

为了对抗高企的通胀，美联储于6月份历史性加息75BP，并在FOMC会议纪要中新增了“坚定致力于让通胀回到2%的目标”的相关描述。在当前通胀高企的背景下，美联储面临两难的抉择，继续保持鹰派的立场将更有利于美国以相对较小的代价降低通胀，因此我们判断短期之内美联储鹰派立场将难以转向。美联储加息周期下A股市场和其他主要资产波动明显加剧。但我们判断加息预期充分反应后，美联储货币政策对资产价格的

影响将让位于A股基本面，例如2017年美联储加息和缩表的过程中，国内股市表现同样可圈可点，资金照样回流中国和新兴市场。

考虑到前期我国货币政策已经率先正常化，为当下的稳增长预留了政策空间，我国紧随美联储紧缩的概率极低，稳增长仍是2022年货币政策的主基调。如6月底易纲行长就表示货币政策将继续从总量上发力以支持经济复苏。财政政策方面，下半年狭义财政（赤字率、专项债、特别国债）变动的可能性不大，更多通过广义财政来发力，例如结构化货币政策工具定向支持一些长期发展领域。疫情政策方面，在执行层面上，从5月份以来已经在进行优化，减少疫情对人口流动的限制，减少疫情对经济的冲击。伴随疫情常态化控制，国内经济的逐步企稳以及促消费政策的逐渐见效，叠加信贷需求逐步改善，下半年部分行业业绩有望触及底部，同时下游需求旺盛、产业景气高企的新能源相关产业高景气有望继续延续。与此同时，伴随全球经济增长动能的回落以及国内地产投资的低迷，上半年业绩维持高增的上游资源品行业景气度或趋于回落，房地产以及地产投资链条相关行业业绩修复的不确定性仍存。

总体来看2022年宏观经济压力下A股业绩增速可能会出现一定的回落，但下半年有可能会触底反弹。市场驱动力或从业绩转向估值，而估值受资金和情绪面影响更大，A股波动率可能会出现明显增大。尽管波动可能会加剧，但我们认为A股受益于实体经济的韧性、国内合理充裕的流动性、有利的长期资金流入条件等利好因素的影响，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、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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

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

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本基金从2021年12月28日至2022年02月23日连续36个工作日、从2022年02月25日至2022年04月20日连续37个工作日、从2022年04月22日至2022年06月17日连续37个工作日基金资产净值低于五千万元。

§ 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，中国银河证券股份有限公司在本基金的托管过程中，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，本托管人按照《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法复核前海开源基金管理有限公司编制和披露的前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金2022年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告、投资组合报告等内容，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	788,078.41	1,222,789.88

结算备付金		465,788.22	166,775.79
存出保证金		216,441.44	243,707.55
交易性金融资产	6.4.7.2	43,488,981.10	41,581,232.79
其中：股票投资		42,883,563.86	40,973,132.79
基金投资		-	-
债券投资		605,417.24	608,100.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	9,077.62
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	5,600.71
资产总计		44,959,289.17	43,229,184.34
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.04	70,062.21
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,149.01	5,452.15
应付托管费		1,716.30	1,817.40
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.01	10,415.38
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	117,113.40	72,622.01
负债合计		123,978.76	160,369.15
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	30,113,665.00	26,113,665.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	14,721,645.41	16,955,150.19
净资产合计		44,835,310.41	43,068,815.19
负债和净资产总计		44,959,289.17	43,229,184.34

注：报告截止日2022年6月30日，前海开源中证500等权ETF基金份额净值1.4889元，基金份额总额30,113,665.00份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		-3,973,779.32	4,284,942.20
1. 利息收入		2,518.33	8,645.48
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,518.33	2,913.96

债券利息收入		-	5,731.52
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）		-1,725,773.76	6,587,491.40
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,064,420.03	5,932,149.32
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	11,962.54	5,017.68
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-159,224.40	284,200.01
股利收益	6.4.7.16	485,908.13	366,124.39
以摊余成本计量的			
金融资产终止确认			
产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损	6.4.7.17	-2,367,834.08	-2,377,291.14
失以“-”号填列）			
4. 汇兑收益（损失以“-”			
号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	6.4.7.18	117,310.19	66,096.46
号填列）			
减：二、营业总支出		85,209.62	201,096.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	29,698.71	33,765.51
2. 托管费	6.4.10.2. 2	9,899.58	11,255.16

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	1,023.22
8. 其他费用	6.4.7.20	45,611.33	155,052.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,058,988.94	4,083,846.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,058,988.94	4,083,846.20
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4,058,988.94	4,083,846.20

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	26,113,665.00	-	16,955,150.19	43,068,815.19
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产 (基金净值)	26,113,665.0 0	-	16,955,150.1 9	43,068,815.1 9
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	4,000,000.00	-	-2,233,504.7 8	1,766,495.22
(一)、综合收益总 额	-	-	-4,058,988.9 4	-4,058,988.9 4
(二)、本期基金份 额交易产生的基金 净值变动数(净值减 少以“-”号填列)	4,000,000.00	-	1,825,484.16	5,825,484.16
其中: 1. 基金申购款	32,000,000.0 0	-	13,733,783.3 3	45,733,783.3 3
2. 基金赎回 款	-28,000,000. 00	-	-11,908,299. 17	-39,908,299. 17
(三)、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的基金净值 变动(净值减少以 “-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	30,113,665.0 0	-	14,721,645.4 1	44,835,310.4 1
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收 益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	42,113,665.0 0	-	15,240,002.2 8	57,353,667.2 8
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	42,113,665.0 0	-	15,240,002.2 8	57,353,667.2 8
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	-12,000,000. 00	-	-417,750.56	-12,417,750. 56
(一)、综合收益总 额	-	-	4,083,846.20	4,083,846.20
(二)、本期基金份 额交易产生的基金 净值变动数(净值减 少以“-”号填列)	-12,000,000. 00	-	-4,501,596.7 6	-16,501,596. 76
其中: 1. 基金申购款	20,000,000.0 0	-	8,117,841.29	28,117,841.2 9
2. 基金赎回 款	-32,000,000. 00	-	-12,619,438. 05	-44,619,438. 05
(三)、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的基金净值 变动(净值减少以 “-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	30,113,665.0 0	-	14,822,251.7 2	44,935,916.7 2

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

秦亚峰

何隽

傅智

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金(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[2019]1538号《关于准予前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,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《前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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760,113,665.00元(含募集股票市值),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(2019)第0649号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2019年11月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为760,113,665.00份,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,基金托管人为中国银河证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]10号审核同意,本基金760,113,665.00份基金份额于2020年1月20日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股。为更好的实现投资目标,可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、政府支持机构债券、政府支持债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:在完成建仓后,投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%。本基金的业绩比较基准为:中证500等权重指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的其他有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

除下文6.4.5.1会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》及《企业会计准则第37号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于2022年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年上半年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

1. 会计政策变更的性质、内容和原因

(a) 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有

的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

(b) 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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失

计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

(c) 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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息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扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，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。

2. 当期报表中受影响的项目名称和调整金额

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021年度的比较财务报表未重

列。于2021年12月31日及2022年1月1日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于2022年1月1日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款，金额分别为1,222,789.88元、166,775.79元、243,707.55元、5,600.71元和9,077.62元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为1,222,962.72元、166,822.65元、243,729.11元、0.00元和9,077.62元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为41,581,232.79元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为41,586,592.24元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为70,062.21元、5,452.15元、1,817.40元、28,697.86元和13,924.15元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为70,062.21元、5,452.15元、1,817.40元、28,697.86元和13,924.15元。

于2021年12月31日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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 2022年06月30日	
	活期存款	788,078.41
等于：本金	787,937.53	
加：应计利息	140.88	
减：坏账准备	-	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
合计	788,078.41	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	43,048,977.20	-	42,883,563.86	-165,413.34	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	603,029.00	2,137.24	605,417.24	251.00
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	603,029.00	2,137.24	605,417.24	251.00
	资产支持证券	-	-	-	-
	基金	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	43,652,006.20	2,137.24	43,488,981.10	-165,162.34

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,218,120.00	-	-	-
股指期货	1,218,120.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,218,120.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2209	中证500股指期货2 209合约	1.00	1,272,800.00	54,680.00
合计				54,680.00
减：可抵销 期货暂收 款				54,680.00
净额				-

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	30,558.07
其中：交易所市场	30,558.07
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	69,671.58
应付指数使用费	5,939.75
可退替代款	10,944.00
合计	117,113.40

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,113,665.00	26,113,665.00
本期申购	32,000,000.00	32,000,000.00

本期赎回（以“-”号填列）	-28,000,000.00	-28,000,000.00
本期末	30,113,665.00	30,113,665.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	24,106,870.87	-7,151,720.68	16,955,150.19
本期利润	-1,691,154.86	-2,367,834.08	-4,058,988.94
本期基金份额交易产生的变动数	3,927,291.18	-2,101,807.02	1,825,484.16
其中：基金申购款	28,984,105.64	-15,250,322.31	13,733,783.33
基金赎回款	-25,056,814.46	13,148,515.29	-11,908,299.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,343,007.19	-11,621,361.78	14,721,645.41

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	1,610.19
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	557.11
其他	351.03
合计	2,518.33

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,159,891.44

股票投资收益——赎回差价收入	-904,528.59
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-2,064,420.03

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	28,046,745.69
减：卖出股票成本总额	29,130,034.43
减：交易费用	76,602.70
买卖股票差价收入	-1,159,891.44

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
赎回基金份额对价总额	39,908,299.17
减：现金支付赎回款总额	17,844,038.17
减：赎回股票成本总额	22,968,789.59
减：交易费用	-
赎回差价收入	-904,528.59

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	5,372.34
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,590.20
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	11,962.54

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,151,634.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,126,850.00
减：应计利息总额	18,191.25
减：交易费用	2.98
买卖债券差价收入	6,590.20

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2022年01月01日至2022年06月30日
期货投资	-159,224.40

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	485,908.13
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	485,908.13

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-2,394,794.08
——股票投资	-2,394,745.08
——债券投资	-49.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	26,960.00
——权证投资	-
——期货投资	26,960.00
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	-2,367,834.08

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	117,310.19
合计	117,310.19

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.19 信用减值损失

无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
指数使用费	5,939.75
合计	45,611.33

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国银河证券股份有限公司（“中国银河证券”）	基金托管人、基金销售机构
开源证券股份有限公司（“开源证券”）	基金管理人的股东
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
银河证券	59,490,630.38	100.00%	60,857,297.94	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交	成交金额	占当期 债券买 卖成交

		总额的 比例		总额的 比例
银河证券	2,233,527.13	100.00%	5,989,581.80	100.00%

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 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
银河证券	43,508.52	100.00%	30,558.07	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01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
银河证券	44,505.78	100.00%	25,534.29	100.00%

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 2022年01月01日至202	上年度可比期间 2021年01月01日至202

	2年06月30日	1年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	29,698.71	33,765.51
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

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0.15%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×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022年06月30日	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,899.58	11,255.16

注：支付基金托管人中国银河证券的托管费按前一日基金资产净值0.05%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×0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2022年06月30日		2021年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份

		额的比例		额的比例
中国银河 证券	2,185,309.00	7.26%	771,809.00	2.96%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

无。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2022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	受限期	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
127064	杭氧转债	2022-05-19	1-6个月（含）	配债未上市	100.00	100.02	31	3,100.00	3,100.58	-

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	复牌日期	复牌开盘单	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

				价		价				
002 670	国 盛 金 控	202 2-0 6-0 1	重 大 事 项	9.6 0	202 2-0 7-1 4	9.9 9	8,800	83,130.82	84,480.00	-

注：本基金截至2022年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于股票、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。

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	602,316.66	599,100.00
合计	602,316.66	599,100.00

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	3,100.58	9,000.00
未评级	-	-
合计	3,100.58	9,000.00

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 2022 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 2022 年 6 月 30 日，本基金组合资产中经确认的当日净赎回金额未超过 7 个工作日可变现资产的账面价值。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 0	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----------------	-------	-------	-------	-----	----

6 月 30 日					
资产					
银行存款	788,078.41	-	-	-	788,078.41
结算备付金	465,788.22	-	-	-	465,788.22
存出保证金	38,249.44	-	-	178,192.00	216,441.44
交易性金融资产	602,316.66	-	3,100.58	42,883,563.86	43,488,981.10
资产总计	1,894,432.73	-	3,100.58	43,061,755.86	44,959,289.17
负债					
应付清算款	-	-	-	0.04	0.04
应付管理人报酬	-	-	-	5,149.01	5,149.01
应付托管费	-	-	-	1,716.30	1,716.30
应交税费	-	-	-	0.01	0.01
其他负债	-	-	-	117,113.40	117,113.40
负债总计	-	-	-	123,978.76	123,978.76
利率敏感度缺口	1,894,432.73	-	3,100.58	42,937,777.10	44,835,310.41
上年度末 2021 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	1,222,789.88	-	-	-	1,222,789.88
结算备付金	94,630.63	-	-	72,145.16	166,775.79
存出保证金	43,569.15	-	-	200,138.40	243,707.55
交易性金融资	599,100.00	-	9,000.00	40,973,132.79	41,581,232.79

产					
应收证 券清算 款	-	-	-	9,077.62	9,077.62
应收利 息	-	-	-	5,600.71	5,600.71
资产总 计	1,960,089.66	-	9,000.00	41,260,094.68	43,229,184.34
负债					
应付证 券清算 款	-	-	-	70,062.21	70,062.21
应付管 理人报 酬	-	-	-	5,452.15	5,452.15
应付托 管费	-	-	-	1,817.40	1,817.40
应付交 易费用	-	-	-	28,697.86	28,697.86
应交税 费	-	-	-	10,415.38	10,415.38
其他负 债	-	-	-	43,924.15	43,924.15
负债总 计	-	-	-	160,369.15	160,369.15
利率敏 感度缺 口	1,960,089.66	-	9,000.00	41,099,725.53	43,068,815.19

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率增加0.25%	-1,212.12	-829.39
	市场利率减少0.25%	1,217.02	831.67

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。

本基金采用完全复制法，跟踪中证500等权重指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，中证500等权重指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的90%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

本基金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 2022年06月30日		上年度末 2021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	42,883,563.86	95.65	40,973,132.79	95.13
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	42,883,563.86	95.65	40,973,132.79	95.13

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	2,410,064.87	1,697,175.21
	业绩比较基准下降5%	-2,410,064.87	-1,697,175.21

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	42,799,083.86	40,900,038.36
第二层次	689,897.24	681,194.43
第三层次	-	-
合计	43,488,981.10	41,581,232.79

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	42,883,563.86	95.38
	其中：股票	42,883,563.86	95.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	605,417.24	1.35
	其中：债券	605,417.24	1.35
	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	1,253,866.63	2.79
8	其他各项资产	216,441.44	0.48
9	合计	44,959,289.17	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	437,544.40	0.98
B	采矿业	1,730,914.10	3.86
C	制造业	23,801,103.39	53.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,538,032.80	3.43
E	建筑业	596,060.00	1.33
F	批发和零售业	1,906,854.98	4.25
G	交通运输、仓储和邮政业	1,812,309.08	4.04
H	住宿和餐饮业	79,360.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,275,279.08	7.31
J	金融业	3,684,591.31	8.22
K	房地产业	1,657,585.44	3.70
L	租赁和商务服务业	626,199.00	1.40
M	科学研究和技术服务业	324,365.00	0.72
N	水利、环境和公共设施管理业	415,749.17	0.93
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	90,190.00	0.20

R	文化、体育和娱乐业	719,178.00	1.60
S	综合	156,452.00	0.35
	合计	42,851,767.75	95.58

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	31,796.11	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	31,796.11	0.07

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	300769	德方纳米	700	286,076.00	0.64
2	605117	德业股份	700	195,923.00	0.44
3	000970	中科三环	7,280	136,718.40	0.30
4	002180	纳思达	2,700	136,674.00	0.30
5	688390	固德威	420	131,464.20	0.29
6	601615	明阳智能	3,700	125,060.00	0.28
7	002155	湖南黄金	10,200	123,828.00	0.28
8	000729	燕京啤酒	12,800	123,648.00	0.28
9	002756	永兴材料	800	121,768.00	0.27
10	600563	法拉电子	587	120,428.92	0.27
11	002390	信邦制药	17,400	120,234.00	0.27
12	688185	康希诺	600	119,448.00	0.27
13	603444	吉比特	300	116,400.00	0.26
14	600171	上海贝岭	4,600	115,138.00	0.26
15	002511	中顺洁柔	9,100	113,932.00	0.25
16	688180	君实生物	1,500	113,010.00	0.25
17	603568	伟明环保	3,361	112,156.57	0.25
18	002468	申通快递	9,400	112,048.00	0.25
19	603198	迎驾贡酒	1,700	110,738.00	0.25
20	601958	金钼股份	12,400	109,616.00	0.24
21	300558	贝达药业	1,800	109,440.00	0.24
22	600582	天地科技	22,700	108,506.00	0.24

23	002372	伟星新材	4,500	108,180.00	0.24
24	600064	南京高科	9,800	107,800.00	0.24
25	002244	滨江集团	12,400	107,260.00	0.24
26	000738	航发控制	3,800	106,780.00	0.24
27	600486	扬农化工	800	106,624.00	0.24
28	600259	广晟有色	2,100	106,365.00	0.24
29	603317	天味食品	3,730	106,193.10	0.24
30	600141	兴发集团	2,400	105,576.00	0.24
31	300390	天华超净	1,200	104,880.00	0.23
32	688029	南微医学	1,200	104,640.00	0.23
33	002572	索菲亚	3,800	104,500.00	0.23
34	002508	老板电器	2,900	104,487.00	0.23
35	688088	虹软科技	3,300	104,247.00	0.23
36	600415	小商品城	18,700	104,159.00	0.23
37	603077	和邦生物	24,400	103,944.00	0.23
38	600096	云天化	3,300	103,884.00	0.23
39	000031	大悦城	25,900	103,600.00	0.23
40	002156	通富微电	6,700	103,180.00	0.23
41	002268	卫士通	2,400	102,984.00	0.23
42	603885	吉祥航空	5,700	102,543.00	0.23
43	002373	千方科技	9,204	102,348.48	0.23
44	600623	华谊集团	12,300	102,090.00	0.23
45	603026	石大胜华	700	101,745.00	0.23
46	000883	湖北能源	19,900	101,689.00	0.23
47	002203	海亮股份	8,800	101,640.00	0.23
48	600499	科达制造	4,900	101,136.00	0.23
49	000630	铜陵有色	31,000	101,060.00	0.23
50	603650	彤程新材	3,100	100,998.00	0.23
51	601717	郑煤机	7,000	100,870.00	0.22
52	000012	南玻 A	13,582	100,778.44	0.22
53	603345	安井食品	600	100,722.00	0.22

54	002174	游族网络	10,300	100,631.00	0.22
55	300182	捷成股份	18,200	100,100.00	0.22
56	600062	华润双鹤	3,900	100,074.00	0.22
57	002506	协鑫集成	26,800	99,696.00	0.22
58	002939	长城证券	9,800	99,568.00	0.22
59	603233	大参林	3,180	99,534.00	0.22
60	600418	江淮汽车	5,800	99,528.00	0.22
61	300251	光线传媒	10,500	99,435.00	0.22
62	300073	当升科技	1,100	99,374.00	0.22
63	601128	常熟银行	13,000	99,320.00	0.22
64	000519	中兵红箭	3,400	99,110.00	0.22
65	600755	厦门国贸	13,200	99,000.00	0.22
65	000999	华润三九	2,200	99,000.00	0.22
67	001914	招商积余	5,500	98,835.00	0.22
68	603613	国联股份	1,115	98,789.00	0.22
69	000975	银泰黄金	10,140	98,763.60	0.22
70	300026	红日药业	12,800	98,560.00	0.22
71	603868	飞科电器	1,300	98,475.00	0.22
72	002399	海普瑞	5,600	98,448.00	0.22
73	603517	绝味食品	1,700	98,294.00	0.22
74	300724	捷佳伟创	1,100	98,285.00	0.22
75	002124	天邦食品	14,620	98,246.40	0.22
76	603456	九洲药业	1,900	98,230.00	0.22
77	601456	国联证券	8,000	98,160.00	0.22
78	688006	杭可科技	1,400	98,084.00	0.22
79	600233	圆通速递	4,800	97,872.00	0.22
80	601869	长飞光纤	3,165	97,861.80	0.22
81	600536	中国软件	2,410	97,821.90	0.22
82	002407	多氟多	2,000	97,820.00	0.22
83	603658	安图生物	2,000	97,780.00	0.22
84	002925	盈趣科技	4,540	97,700.80	0.22

85	600056	中国医药	6,580	97,515.60	0.22
86	002128	电投能源	6,800	97,376.00	0.22
87	600959	江苏有线	29,700	96,822.00	0.22
88	002507	涪陵榨菜	2,800	96,656.00	0.22
89	000089	深圳机场	12,500	96,500.00	0.22
90	000156	华数传媒	12,100	96,437.00	0.22
91	603379	三美股份	4,320	96,120.00	0.21
92	300482	万孚生物	2,360	96,075.60	0.21
93	002690	美亚光电	4,430	96,042.40	0.21
94	002078	太阳纸业	7,800	96,018.00	0.21
95	002221	东华能源	10,300	95,893.00	0.21
96	601611	中国核建	11,400	95,646.00	0.21
97	002195	二三四五	42,500	95,625.00	0.21
98	300009	安科生物	9,455	95,590.05	0.21
99	002326	永太科技	2,900	95,497.00	0.21
100	601228	广州港	26,000	95,420.00	0.21
101	600546	山煤国际	4,900	95,354.00	0.21
102	600648	外高桥	7,000	95,200.00	0.21
103	600529	山东药玻	3,400	95,030.00	0.21
104	600820	隧道股份	15,500	94,860.00	0.21
105	601696	中银证券	7,100	94,430.00	0.21
106	000656	金科股份	33,000	94,380.00	0.21
107	000513	丽珠集团	2,600	94,146.00	0.21
108	600315	上海家化	2,200	94,050.00	0.21
109	603267	鸿远电子	700	94,031.00	0.21
110	000402	金融街	15,800	94,010.00	0.21
111	600027	华电国际	23,900	93,927.00	0.21
112	600572	康恩贝	21,200	93,916.00	0.21
113	600885	宏发股份	2,240	93,744.00	0.21
113	600316	洪都航空	3,100	93,744.00	0.21
115	300363	博腾股份	1,200	93,588.00	0.21

116	601990	南京证券	11,200	93,408.00	0.21
117	300676	华大基因	1,300	93,210.00	0.21
118	300888	稳健医疗	1,400	93,100.00	0.21
119	600598	北大荒	6,300	92,988.00	0.21
120	601928	凤凰传媒	13,000	92,950.00	0.21
121	300257	开山股份	6,200	92,752.00	0.21
122	600392	盛和资源	4,104	92,750.40	0.21
123	600699	均胜电子	5,900	92,689.00	0.21
124	603638	艾迪精密	4,520	92,660.00	0.21
125	603858	步长制药	4,700	92,637.00	0.21
126	601992	金隅集团	33,400	92,518.00	0.21
127	300037	新宙邦	1,760	92,505.60	0.21
128	600732	爱旭股份	2,800	92,456.00	0.21
129	600500	中化国际	13,900	92,435.00	0.21
130	688188	柏楚电子	420	92,416.80	0.21
131	688099	晶晨股份	915	92,415.00	0.21
132	600522	中天科技	4,000	92,400.00	0.21
133	300474	景嘉微	1,350	92,326.50	0.21
134	300463	迈克生物	4,500	92,205.00	0.21
135	600718	东软集团	8,000	92,080.00	0.21
136	600022	山东钢铁	52,900	92,046.00	0.21
137	600863	内蒙华电	25,200	91,980.00	0.21
138	600801	华新水泥	4,700	91,697.00	0.20
139	603719	良品铺子	3,200	91,616.00	0.20
140	002497	雅化集团	2,800	91,420.00	0.20
141	600160	巨化股份	6,950	91,392.50	0.20
142	600556	天下秀	11,100	91,353.00	0.20
143	603983	丸美股份	3,400	91,120.00	0.20
144	002557	洽洽食品	1,600	91,088.00	0.20
145	603127	昭衍新药	800	91,040.00	0.20
145	600787	中储股份	16,000	91,040.00	0.20

147	600528	中铁工业	11,300	90,965.00	0.20
148	600859	王府井	3,500	90,930.00	0.20
148	000537	广宇发展	7,000	90,930.00	0.20
150	601778	晶科科技	16,826	90,860.40	0.20
151	600497	驰宏锌锗	17,500	90,825.00	0.20
151	600350	山东高速	17,300	90,825.00	0.20
153	600521	华海药业	4,000	90,800.00	0.20
154	002430	杭氧股份	2,900	90,654.00	0.20
155	002240	盛新锂能	1,500	90,540.00	0.20
156	002056	横店东磁	3,400	90,508.00	0.20
157	002444	巨星科技	4,800	90,432.00	0.20
158	300677	英科医疗	3,560	90,281.60	0.20
159	300244	迪安诊断	2,900	90,190.00	0.20
160	600970	中材国际	9,300	90,117.00	0.20
161	600906	财达证券	10,000	89,900.00	0.20
162	600376	首开股份	18,300	89,853.00	0.20
163	600827	百联股份	6,800	89,828.00	0.20
164	002223	鱼跃医疗	3,500	89,810.00	0.20
165	002422	科伦药业	4,800	89,760.00	0.20
166	600566	济川药业	3,300	89,628.00	0.20
167	601718	际华集团	28,800	89,280.00	0.20
168	000987	越秀金控	12,690	89,210.70	0.20
169	600372	中航电子	4,600	89,194.00	0.20
170	600195	中牧股份	7,274	89,179.24	0.20
171	600377	宁沪高速	10,400	89,128.00	0.20
172	688521	芯原股份	1,800	88,920.00	0.20
172	000563	陕国投 A	28,500	88,920.00	0.20
174	603218	日月股份	3,500	88,900.00	0.20
175	600177	雅戈尔	13,400	88,842.00	0.20
176	600487	亨通光电	6,100	88,694.00	0.20
177	002353	杰瑞股份	2,200	88,660.00	0.20

178	300699	光威复材	1,500	88,305.00	0.20
179	688256	寒武纪	1,363	88,186.10	0.20
180	600348	华阳股份	5,700	88,122.00	0.20
181	000686	东北证券	12,600	88,074.00	0.20
182	300072	海新能科	17,400	88,044.00	0.20
183	002966	苏州银行	14,420	87,962.00	0.20
184	000629	攀钢钒钛	23,100	87,780.00	0.20
185	300630	普利制药	2,497	87,769.55	0.20
186	001965	招商公路	11,500	87,745.00	0.20
187	300166	东方国信	9,500	87,590.00	0.20
188	600765	中航重机	2,720	87,529.60	0.20
189	000831	五矿稀土	2,800	87,500.00	0.20
190	600739	辽宁成大	6,000	87,480.00	0.20
191	601608	中信重工	23,050	87,359.50	0.19
192	601077	渝农商行	23,600	87,320.00	0.19
193	688777	中控技术	1,200	87,312.00	0.19
194	000937	冀中能源	11,700	87,282.00	0.19
195	000898	鞍钢股份	27,100	87,262.00	0.19
196	000690	宝新能源	19,900	87,162.00	0.19
197	600862	中航高科	3,100	87,110.00	0.19
198	002815	崇达技术	6,800	87,108.00	0.19
199	601179	中国西电	18,600	87,048.00	0.19
200	600663	陆家嘴	8,400	87,024.00	0.19
201	601298	青岛港	15,900	86,973.00	0.19
202	000559	万向钱潮	14,640	86,961.60	0.19
203	300376	易事特	10,700	86,884.00	0.19
204	600867	通化东宝	8,400	86,856.00	0.19
205	002191	劲嘉股份	8,100	86,832.00	0.19
206	601607	上海医药	4,800	86,784.00	0.19
207	300024	机器人	8,600	86,688.00	0.19
208	600208	新湖中宝	31,400	86,664.00	0.19

209	600580	卧龙电驱	6,000	86,520.00	0.19
210	000540	中天金融	44,800	86,464.00	0.19
211	600256	广汇能源	8,200	86,428.00	0.19
212	600282	南钢股份	27,400	86,310.00	0.19
213	600673	东阳光	9,600	86,304.00	0.19
214	002408	齐翔腾达	10,640	86,290.40	0.19
215	000869	张裕A	2,900	86,246.00	0.19
216	600782	新钢股份	17,100	86,184.00	0.19
217	601000	唐山港	33,400	86,172.00	0.19
218	002416	爱施德	9,263	86,145.90	0.19
219	600021	上海电力	8,400	86,100.00	0.19
220	002242	九阳股份	4,688	86,071.68	0.19
221	600399	抚顺特钢	4,800	85,920.00	0.19
222	300832	新产业	1,900	85,709.00	0.19
223	002831	裕同科技	2,900	85,695.00	0.19
224	688321	微芯生物	3,400	85,646.00	0.19
225	600120	浙江东方	21,358	85,645.58	0.19
226	300212	易华录	4,920	85,608.00	0.19
227	000960	锡业股份	5,100	85,527.00	0.19
228	600297	广汇汽车	32,700	85,347.00	0.19
229	000998	隆平高科	5,100	84,966.00	0.19
230	002384	东山精密	3,700	84,841.00	0.19
231	000778	新兴铸管	17,600	84,832.00	0.19
232	000553	安道麦A	7,000	84,770.00	0.19
233	000959	首钢股份	17,800	84,728.00	0.19
234	603883	老百姓	2,496	84,564.48	0.19
235	002670	国盛金控	8,800	84,480.00	0.19
236	300146	汤臣倍健	3,900	84,435.00	0.19
237	000990	诚志股份	7,707	84,391.65	0.19
238	000750	国海证券	23,230	84,324.90	0.19
239	002294	信立泰	3,000	84,300.00	0.19

240	002985	北摩高科	1,436	84,120.88	0.19
241	600435	北方导航	9,740	83,958.80	0.19
242	601333	广深铁路	38,500	83,930.00	0.19
243	600060	海信视像	6,700	83,750.00	0.19
244	002705	新宝股份	3,800	83,562.00	0.19
245	000028	国药一致	2,800	83,412.00	0.19
246	002739	万达电影	6,100	83,265.00	0.19
247	600823	世茂股份	27,900	83,142.00	0.19
248	600390	五矿资本	17,000	83,130.00	0.19
249	688122	西部超导	900	82,980.00	0.19
250	600373	中文传媒	8,300	82,917.00	0.18
251	601005	重庆钢铁	43,400	82,894.00	0.18
252	300144	宋城演艺	5,400	82,890.00	0.18
253	600298	安琪酵母	1,700	82,875.00	0.18
254	000581	威孚高科	4,300	82,775.00	0.18
255	600380	健康元	6,700	82,745.00	0.18
256	601555	东吴证券	11,940	82,744.20	0.18
257	600126	杭钢股份	16,160	82,739.20	0.18
258	600901	江苏租赁	16,100	82,593.00	0.18
259	603605	珀莱雅	500	82,590.00	0.18
260	002185	华天科技	8,800	82,544.00	0.18
261	600325	华发股份	10,900	82,513.00	0.18
262	002299	圣农发展	4,300	82,474.00	0.18
263	600597	光明乳业	6,519	82,334.97	0.18
264	000401	冀东水泥	7,800	82,056.00	0.18
265	603589	口子窖	1,400	82,054.00	0.18
266	002603	以岭药业	3,376	82,036.80	0.18
267	300869	康泰医学	2,900	81,954.00	0.18
268	002250	联化科技	5,000	81,850.00	0.18
269	002505	鹏都农牧	24,100	81,699.00	0.18
270	300058	蓝色光标	12,500	81,625.00	0.18

271	600839	四川长虹	28,300	81,504.00	0.18
271	002396	星网锐捷	3,600	81,504.00	0.18
273	600038	中直股份	1,800	81,360.00	0.18
274	601106	中国一重	26,500	81,355.00	0.18
275	600988	赤峰黄金	5,100	81,345.00	0.18
276	002434	万里扬	9,500	81,225.00	0.18
277	601098	中南传媒	8,600	81,184.00	0.18
278	001872	招商港口	5,200	81,120.00	0.18
279	600329	达仁堂	3,300	81,114.00	0.18
280	000988	华工科技	3,500	81,095.00	0.18
281	600039	四川路桥	7,700	81,081.00	0.18
282	601866	中远海发	27,000	81,000.00	0.18
283	600236	桂冠电力	13,300	80,997.00	0.18
283	002110	三钢闽光	13,300	80,997.00	0.18
285	002266	浙富控股	16,900	80,951.00	0.18
286	601577	长沙银行	10,200	80,886.00	0.18
287	601997	贵阳银行	13,900	80,759.00	0.18
288	002683	广东宏大	2,900	80,707.00	0.18
289	600008	首创环保	27,764	80,515.60	0.18
290	000739	普洛药业	3,900	80,496.00	0.18
291	601168	西部矿业	6,800	80,444.00	0.18
292	000932	华菱钢铁	15,800	80,422.00	0.18
293	600511	国药股份	3,000	80,340.00	0.18
294	600871	石化油服	42,500	80,325.00	0.18
295	300296	利亚德	11,000	80,300.00	0.18
296	600642	申能股份	14,100	80,088.00	0.18
297	002146	荣盛发展	26,400	79,992.00	0.18
298	300253	卫宁健康	9,100	79,898.00	0.18
299	300017	网宿科技	14,900	79,864.00	0.18
300	000623	吉林敖东	5,410	79,851.60	0.18
301	601139	深圳燃气	11,500	79,810.00	0.18

302	601860	紫金银行	27,800	79,786.00	0.18
303	600339	中油工程	27,600	79,764.00	0.18
304	000830	鲁西化工	4,600	79,534.00	0.18
305	600728	佳都科技	12,300	79,458.00	0.18
306	300115	长盈精密	7,700	79,387.00	0.18
307	600258	首旅酒店	3,200	79,360.00	0.18
308	002948	青岛银行	21,900	79,278.00	0.18
309	002946	新乳业	6,100	79,239.00	0.18
310	603056	德邦股份	5,900	79,237.00	0.18
311	000709	河钢股份	35,000	79,100.00	0.18
312	002936	郑州银行	29,397	79,077.93	0.18
313	600667	太极实业	10,700	78,966.00	0.18
314	601118	海南橡胶	16,500	78,870.00	0.18
315	600155	华创阳安	9,300	78,864.00	0.18
316	600808	马钢股份	20,800	78,832.00	0.18
317	000598	兴蓉环境	15,400	78,694.00	0.18
318	000930	中粮科技	8,700	78,648.00	0.18
319	600167	联美控股	10,500	78,645.00	0.18
320	600985	淮北矿业	5,400	78,624.00	0.18
321	600998	九州通	6,600	78,606.00	0.18
322	000887	中鼎股份	4,300	78,432.00	0.17
323	002065	东华软件	12,400	78,368.00	0.17
324	603225	新风鸣	6,789	78,345.06	0.17
325	002901	大博医疗	2,000	78,280.00	0.17
326	600170	上海建工	25,800	78,174.00	0.17
327	002004	华邦健康	14,000	78,120.00	0.17
328	000961	中南建设	25,600	78,080.00	0.17
329	300357	我武生物	1,500	78,045.00	0.17
330	600549	厦门钨业	3,600	77,832.00	0.17
331	600507	方大特钢	11,131	77,805.69	0.17
332	600409	三友化工	9,500	77,805.00	0.17

333	601636	旗滨集团	6,100	77,775.00	0.17
334	002030	达安基因	4,521	77,715.99	0.17
335	002409	雅克科技	1,400	77,714.00	0.17
336	600271	航天信息	7,100	77,674.00	0.17
337	300308	中际旭创	2,500	77,625.00	0.17
338	002797	第一创业	12,100	77,561.00	0.17
339	601568	北元集团	12,230	77,538.20	0.17
340	600026	中远海能	7,500	77,475.00	0.17
341	002153	石基信息	4,880	77,445.60	0.17
342	000785	居然之家	17,400	77,430.00	0.17
343	002958	青农商行	23,300	77,356.00	0.17
344	601156	东航物流	3,900	77,220.00	0.17
345	002081	金螳螂	15,200	77,216.00	0.17
346	600153	建发股份	5,900	77,113.00	0.17
347	000039	中集集团	5,560	77,006.00	0.17
348	000983	山西焦煤	5,750	76,992.50	0.17
349	600811	东方集团	27,200	76,976.00	0.17
350	601003	柳钢股份	19,000	76,950.00	0.17
351	002867	周大生	4,950	76,873.50	0.17
352	002092	中泰化学	9,900	76,824.00	0.17
353	000158	常山北明	12,800	76,800.00	0.17
354	603515	欧普照明	4,400	76,780.00	0.17
355	601200	上海环境	7,510	76,301.60	0.17
356	002138	顺络电子	2,800	76,300.00	0.17
357	002945	华林证券	5,000	76,250.00	0.17
358	600835	上海机电	5,550	76,201.50	0.17
359	002926	华西证券	9,700	76,048.00	0.17
360	002152	广电运通	8,200	76,014.00	0.17
361	600895	张江高科	6,100	75,945.00	0.17
362	600717	天津港	18,908	75,821.08	0.17
363	600637	东方明珠	10,600	75,790.00	0.17

364	600705	中航产融	21,900	75,774.00	0.17
365	600764	中国海防	3,000	75,720.00	0.17
366	601187	厦门银行	12,700	75,692.00	0.17
367	603355	莱克电气	3,000	75,690.00	0.17
368	600299	安迪苏	7,900	75,682.00	0.17
369	600875	东方电气	4,600	75,670.00	0.17
370	603712	七一二	2,400	75,600.00	0.17
371	002019	亿帆医药	5,400	75,492.00	0.17
372	688002	睿创微纳	1,900	75,468.00	0.17
373	601872	招商轮船	13,100	75,456.00	0.17
374	300285	国瓷材料	2,100	75,432.00	0.17
375	600704	物产中大	14,700	75,411.00	0.17
376	600917	重庆燃气	10,430	75,304.60	0.17
377	600498	烽火通信	5,200	75,296.00	0.17
378	002048	宁波华翔	4,700	75,294.00	0.17
379	000878	云南铜业	6,600	75,174.00	0.17
380	300741	华宝股份	2,700	75,114.00	0.17
381	002183	怡亚通	10,400	74,984.00	0.17
382	000717	韶钢松山	21,400	74,900.00	0.17
383	601108	财通证券	9,500	74,765.00	0.17
384	600109	国金证券	8,300	74,700.00	0.17
385	601828	美凯龙	12,300	74,538.00	0.17
386	000060	中金岭南	16,700	74,482.00	0.17
387	002233	塔牌集团	8,400	74,340.00	0.17
388	002625	光启技术	4,300	74,261.00	0.17
389	600201	生物股份	8,100	74,196.00	0.17
390	603228	景旺电子	3,180	74,189.40	0.17
391	300136	信维通信	4,400	74,140.00	0.17
392	002653	海思科	4,600	74,106.00	0.17
393	000718	苏宁环球	20,133	74,089.44	0.17
394	300070	碧水源	14,200	73,982.00	0.17

395	000997	新大陆	5,600	73,976.00	0.16
396	600131	国网信通	5,500	73,975.00	0.16
397	603939	益丰药房	1,400	73,962.00	0.16
398	603786	科博达	1,200	73,884.00	0.16
399	601198	东兴证券	8,300	73,870.00	0.16
400	600909	华安证券	16,220	73,801.00	0.16
401	601880	辽港股份	43,400	73,780.00	0.16
402	002273	水晶光电	6,089	73,737.79	0.16
403	002595	豪迈科技	3,300	73,722.00	0.16
404	002131	利欧股份	38,000	73,720.00	0.16
405	603927	中科软	3,160	73,691.20	0.16
406	603866	桃李面包	4,452	73,680.60	0.16
407	300418	昆仑万维	4,600	73,600.00	0.16
408	002382	蓝帆医疗	7,700	73,535.00	0.16
409	601016	节能风电	15,300	73,440.00	0.16
410	002563	森马服饰	12,400	73,408.00	0.16
411	600879	航天电子	11,300	73,337.00	0.16
412	603707	健友股份	2,600	73,320.00	0.16
413	000636	风华高科	3,900	73,281.00	0.16
414	002423	中粮资本	10,900	73,139.00	0.16
415	601699	潞安环能	5,000	73,100.00	0.16
416	600095	湘财股份	9,500	73,055.00	0.16
417	600369	西南证券	18,400	73,048.00	0.16
418	002368	太极股份	3,800	72,998.00	0.16
419	000528	柳工	11,200	72,912.00	0.16
420	600157	永泰能源	45,800	72,822.00	0.16
421	001227	兰州银行	14,800	72,816.00	0.16
422	002701	奥瑞金	14,000	72,800.00	0.16
423	000728	国元证券	11,700	72,774.00	0.16
424	603156	养元饮品	3,200	72,704.00	0.16
425	600956	新天绿能	5,900	72,688.00	0.16

426	601991	大唐发电	29,900	72,657.00	0.16
427	002385	大北农	9,300	72,633.00	0.16
428	600968	海油发展	28,100	72,498.00	0.16
429	000967	盈峰环境	14,300	72,358.00	0.16
430	600216	浙江医药	5,300	72,345.00	0.16
431	601665	齐鲁银行	14,800	72,224.00	0.16
432	002281	光迅科技	4,100	72,078.00	0.16
433	002010	传化智联	11,200	72,016.00	0.16
434	002624	完美世界	5,000	71,850.00	0.16
435	002249	大洋电机	11,700	71,838.00	0.16
436	600066	宇通客车	8,300	71,795.00	0.16
437	000050	深天马 A	7,200	71,784.00	0.16
438	000783	长江证券	12,100	71,753.00	0.16
439	002500	山西证券	12,500	71,750.00	0.16
440	002439	启明星辰	3,600	71,748.00	0.16
441	603000	人民网	6,400	71,680.00	0.16
442	600707	彩虹股份	15,300	71,604.00	0.16
443	600535	天士力	6,800	71,468.00	0.16
444	600516	方大炭素	9,400	71,440.00	0.16
445	002429	兆驰股份	18,600	71,424.00	0.16
446	600143	金发科技	7,500	71,400.00	0.16
447	600307	酒钢宏兴	36,800	71,392.00	0.16
448	002745	木林森	7,300	71,321.00	0.16
449	300088	长信科技	9,600	71,232.00	0.16
449	002387	维信诺	10,600	71,232.00	0.16
451	689009	九号公司-WD	1,600	71,200.00	0.16
452	600928	西安银行	19,400	71,198.00	0.16
453	000062	深圳华强	5,600	71,120.00	0.16
454	601598	中国外运	18,300	71,004.00	0.16
454	000021	深科技	6,100	71,004.00	0.16
456	000415	渤海租赁	32,700	70,959.00	0.16

457	002465	海格通信	7,800	70,902.00	0.16
458	300383	光环新网	6,800	70,856.00	0.16
459	300168	万达信息	7,500	70,800.00	0.16
460	600482	中国动力	4,500	70,695.00	0.16
461	000685	中山公用	9,200	70,656.00	0.16
462	002673	西部证券	10,800	70,632.00	0.16
463	600927	永安期货	3,500	70,595.00	0.16
464	600446	金证股份	6,800	70,584.00	0.16
465	002532	天山铝业	10,800	70,524.00	0.16
466	000488	晨鸣纸业	12,500	70,500.00	0.16
467	002127	南极电商	13,200	70,488.00	0.16
468	003035	南网能源	11,100	70,485.00	0.16
469	000547	航天发展	5,900	70,446.00	0.16
470	600967	内蒙一机	7,700	70,224.00	0.16
471	600006	东风汽车	9,300	70,215.00	0.16
472	000009	中国宝安	5,200	70,148.00	0.16
473	600567	山鹰国际	25,300	70,081.00	0.16
474	000027	深圳能源	10,920	69,997.20	0.16
475	601162	天风证券	22,000	69,960.00	0.16
476	300012	华测检测	3,000	69,630.00	0.16
477	600166	福田汽车	24,600	69,618.00	0.16
478	601969	海南矿业	8,100	69,579.00	0.16
479	300618	寒锐钴业	1,200	69,504.00	0.16
480	300001	特锐德	4,000	69,240.00	0.15
481	000825	太钢不锈	12,700	69,215.00	0.15
482	000671	阳光城	31,600	69,204.00	0.15
483	688819	天能股份	2,000	69,160.00	0.15
484	000400	许继电气	3,600	69,120.00	0.15
485	002212	天融信	6,800	69,020.00	0.15
486	001203	大中矿业	6,100	68,930.00	0.15
487	600118	中国卫星	3,400	68,272.00	0.15

488	002002	鸿达兴业	18,400	68,264.00	0.15
489	600517	国网英大	13,100	67,989.00	0.15
490	600848	上海临港	5,000	67,800.00	0.15
491	600037	歌华有线	7,200	67,608.00	0.15
492	688289	圣湘生物	2,272	67,273.92	0.15
493	600079	人福医药	4,200	67,200.00	0.15
494	688009	中国通号	14,700	66,591.00	0.15
495	600398	海澜之家	14,000	66,500.00	0.15
496	601058	赛轮轮胎	5,900	66,493.00	0.15
497	000807	云铝股份	6,700	66,196.00	0.15
498	600737	中粮糖业	8,700	65,424.00	0.15
499	688208	道通科技	1,963	64,621.96	0.14
500	002028	思源电气	1,800	64,188.00	0.14

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601089	福元医药	1,151	24,228.55	0.05
2	001268	联合精密	273	7,567.56	0.02

注：本基金本报告期末仅持有以上积极投资股票。

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	300751	迈为股份	714,224.80	1.66
2	300769	德方纳米	463,175.00	1.08
3	300763	锦浪科技	324,601.00	0.75
4	603290	斯达半导	202,577.00	0.47
5	300474	景嘉微	192,756.00	0.45

6	605117	德业股份	175,613.00	0.41
7	300724	捷佳伟创	167,473.89	0.39
8	002603	以岭药业	161,264.00	0.37
9	300026	红日药业	155,429.00	0.36
10	000778	新兴铸管	154,640.00	0.36
11	002756	永兴材料	152,173.00	0.35
12	688180	君实生物	147,170.00	0.34
13	002985	北摩高科	143,469.00	0.33
14	688777	中控技术	141,984.00	0.33
15	002244	滨江集团	140,881.00	0.33
16	000983	山西焦煤	139,120.00	0.32
17	300223	北京君正	138,996.00	0.32
18	300037	新宙邦	138,975.00	0.32
19	000656	金科股份	137,674.00	0.32
20	000733	振华科技	137,243.54	0.32

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	300751	迈为股份	888,935.20	2.06
2	300763	锦浪科技	425,213.50	0.99
3	603290	斯达半导	304,997.00	0.71
4	000733	振华科技	210,389.00	0.49
5	000983	山西焦煤	202,744.00	0.47
6	300769	德方纳米	202,107.00	0.47
7	002244	滨江集团	195,227.00	0.45
8	002603	以岭药业	191,598.00	0.44
9	002424	贵州百灵	189,624.00	0.44

10	000090	天健集团	189,234.00	0.44
11	300026	红日药业	185,490.00	0.43
12	300223	北京君正	181,083.00	0.42
13	000723	美锦能源	167,651.00	0.39
14	601975	招商南油	166,629.00	0.39
15	003022	联泓新科	162,791.00	0.38
16	002945	华林证券	162,623.00	0.38
17	000937	冀中能源	157,443.00	0.37
18	002302	西部建设	155,313.00	0.36
19	000778	新兴铸管	153,712.00	0.36
20	300474	景嘉微	152,298.00	0.35

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	31,737,790.57
卖出股票收入（成交）总额	28,046,745.69

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	602,316.66	1.34
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)	3,100.58	0.01

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	605,417.24	1.35

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	019674	22国债09	6,000	602,316.66	1.34
2	127064	杭氧转债	31	3,100.58	0.01

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细
无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金运用股指期货交易的原则是，在流动性较好和投资期限适当的合约上安排比例适当的头寸，以降低对市场的冲击并减少交易成本，根据市场流动性状况及投资需求，分时段执行展期交易，在交易过程中，对投资组合的风险状况持续监控。具体而言，当前对股指期货交易主要用以获得股指期货的基差收敛收益，并利用股指期货的杠杆效应保留部分现金以避免跨市场ETF的尾盘赎回风险。考虑到本基金跟踪的500等权指数与IC合约跟踪的500指数存在一定的偏离，我们会根据实际情况对成分股持仓进行调整，以

达到更好的跟踪等权指数的目的。我们还会重点关注调整后的成分券数量是否满足ETF的赎回上限要求，以尽量避免赎回风险。

总体而言，本基金进行股指期货投资风险可控，并且能够利用股指期货的杠杆作用降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，或者进行低风险的套利活动，符合本基金的投资政策与投资目标。后续我们密切关注期货市场表现情况及跟踪误差情况，决定是否继续投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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	216,441.44
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	216,441.44

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

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
683	44,090.29	13,143,682.00	43.65%	16,969,983.00	56.35%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总 份额比例
1	中信建投证券股份有限公司	3,868,008.00	12.84%
2	前海开源基金—北京银行—前海开源源享1号集合资产管理计划	3,537,900.00	11.75%
3	前海开源基金—信达证券股份有限公司—前海开源信鑫单一资产管理计划	2,472,900.00	8.21%
4	中国银河证券股份有限公司	2,185,309.00	7.26%
5	中信证券股份有限公司	978,300.00	3.25%

6	辛明蕾	589,013.00	1.96%
7	梁小琴	500,000.00	1.66%
8	杨建中	422,500.00	1.40%
9	蒋祖逸	400,000.00	1.33%
10	刘百荣	400,000.00	1.33%

注：以上信息中，持有人名册及持有份额由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年11月14日)基金份额总额	760,113,665.00
本报告期期初基金份额总额	26,113,665.00
本报告期基金总申购份额	32,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	28,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	30,113,665.00

§ 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：

2022年2月25日起，孙辰健先生任督察长；

2022年6月21日起，董事长由王兆华先生变更为李强先生。

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	
银河证券	5	59,490,630.38	100.00%	43,508.52	100.00%	-

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
银河证券	2,233,527.13	100.00%	-	-	-	-	-	-

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旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-01
2	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金2021年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2022-01-24
3	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在湘财证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-26
4	前海开源基金管理有限公司关于公司固有资金拟申购旗	中国证监会规定媒介	2022-01-28

	下偏股型公募基金的公告		
5	前海开源基金管理有限公司关于公司自有资金申购旗下偏股型公募基金的进一步公告	中国证监会规定媒介	2022-02-11
6	关于增加中信百信银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022-02-17
7	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金开展申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022-02-25
8	前海开源基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2022-02-26
9	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北京雪球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	2022-02-28
10	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式证券投资基金转换业务补差费用计算方法的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-26
11	关于防范不法分子冒用前海开源基金名义进行非法活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2022-03-26
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北京中植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	2022-03-28
13	前海开源基金管理有限公司	中国证监会规定媒介	2022-03-30

	关于调整旗下部分基金通过上海中欧财富基金销售有限公司办理定投业务起点金额的公告		
14	前海开源基金关于电子直销交易平台相关业务费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-31
15	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金2021年年度报告	中国证监会规定媒介	2022-03-31
16	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在渤海证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-12
17	前海开源基金管理有限公司关于终止与深圳前海凯恩斯基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-21
18	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金2022年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2022-04-22
19	前海开源基金管理有限公司关于终止与北京唐鼎耀华基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-23
20	前海开源基金管理有限公司关于终止与北京植信基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-26
21	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金新增部分申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-24
22	前海开源基金管理有限公司	中国证监会规定媒介	2022-05-27

	关于调整旗下部分基金通过中信证券华南股份有限公司办理定投业务起点金额的公告		
23	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京东肯特瑞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	2022-06-08
24	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在东兴证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-16
25	前海开源基金管理有限公司关于终止与北京懒猫基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-17
26	前海开源基金管理有限公司关于旗下500等权ETF实施申赎业务多码合一的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-17
27	前海开源基金管理有限公司关于终止与深圳腾元基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-17
28	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过申万宏源证券、申万宏源西部证券办理定投业务起点金额的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-22
29	前海开源基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-22

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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

投资者类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220225 - 20220321	2,953,500.00	3,186,300.00	2,601,900.00	3,537,900.00	11.75%
产品特有风险							
<p>1. 大额赎回风险 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的大额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>2. 终止基金合同的风险 个别投资者大额赎回后，若本基金连续55个工作日出现基金份额持有人低于200人或基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会，其他投资者可能面临相应风险；</p> <p>3. 流动性风险 单一投资者大额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；</p> <p>4. 大额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

自2022年6月20日起，本基金将取消申赎业务相关代码，投资者可通过ETF基金的证券代码（与交易使用的证券代码相同），选择申赎相关业务类型，参与ETF申赎业务。具体情况详见基金管理人在中国证监会规定媒介发布的相关公告。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- (2) 《前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (5) 前海开源中证500等权重交易型开放式指数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

二〇二二年八月三十一日