
前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金

2020 年中期报告

2020 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:2020 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2020年8月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年01月01日起至2020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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	63
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	63
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	63
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末上市基金前十名持有人	65

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
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.....	66
§9 开放式基金份额变动.....	66
§10 重大事件揭示.....	66
10.1 基金份额持有人大会决议.....	66
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.....	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
10.4 基金投资策略的改变.....	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
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.....	71
§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	500ETFEW
基金主代码	515590
基金运作方式	契约型普通开放式
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	102, 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	2020-01-20

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	傅成斌	李淼
	联系电话	0755-88601888	010-66568780
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	yhqz_tggz@chinastock.com.cn
客户服务电话		4001666998	95551; 400-888-8888
传真		0755-83181169	010-66568532
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾	中国北京西城区金融大街35

	一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	号2-6层
办公地址	深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦2206	中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座
邮政编码	518040	100033
法定代表人	王兆华	陈共炎

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（2020年01月01日- 2020年06月30日）
本期已实现收益	62,471,833.91
本期利润	32,549,886.19
加权平均基金份额本期利润	0.1260
本期加权平均净值利润率	11.80%
本期基金份额净值增长率	10.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2020年06月30日）
期末可供分配利润	16,633,218.58

期末可供分配基金份额利润	0.1629
期末基金资产净值	118,746,883.58
期末基金份额净值	1.1629
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2020年06月30日）
基金份额累计净值增长率	16.29%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.13%	0.83%	7.34%	0.84%	1.79%	-0.01%
过去三个月	17.00%	1.01%	14.05%	1.04%	2.95%	-0.03%
过去六个月	10.51%	1.63%	7.55%	1.69%	2.96%	-0.06%
自基金合同生效起至今	16.29%	1.46%	16.38%	1.54%	-0.09%	-0.08%

注：本基金的业绩比较基准为：中证500等权重指数收益率。

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



注：①本基金的基金合同于2019年11月14日生效，截至2020年6月30日止，本基金成立未滿一年。

②本基金的建仓期为6个月，截至2020年6月30日，本基金距建仓结束日未滿一年。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

前海开源基金管理有限公司（以下简称“前海开源基金”）于2012年12月27日经中国证监会批准，2013年1月23日注册成立，截至报告期末，注册资本为2亿元人民币。其中，开源证券股份有限公司、北京市中盛金期投资管理有限公司、北京长和世纪资产管理有限公司和深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)各持股权25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海设立分公司。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90只开放式基金，资产管理规模超过672.48亿元。

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		
陶曙 斌	本基金的基金经理、公司 投资副总监	2019- 11-14	-	12 年	陶曙斌先生，经济学硕士，曾任职于德勤会计师事务所、南方基金管理有限公司。2016年1月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司投资副总监。
梁溥 森	本基金的基金经理	2020- 05-07	-	6 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，现任公司权益投资本部基金经理。

注：①对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》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、本基金《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

本基金通过科学的投资管理流程、精确的数量化计算，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、现金流管理、期现套利等获得部分超额收益。

对比中证500等权指数，本基金上半年取得了2.96%的超额回报。

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1.1629元，本报告期内，基金份额净值增长率为10.51%，同期业绩比较基准收益率为7.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，中国经济将持续恢复，预计货币政策将从宽松逐渐步入结构性宽松。下半年市场的主要矛盾将转为企业盈利逐步改善与流动性边际变化的矛盾。前期由流动性带来的部分行业和个股的高估值在下半年将面临压力。

本基金将依然遵循一贯的投资逻辑，实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。并通过参与新股、现金流管理、期现套利等获得部分超额收益。

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。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

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，由其按约定提供估值定价服务。

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，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、托管协议的有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支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2020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，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：2020年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,046,360.31	75,716,365.64
结算备付金		160,632.48	4,708,529.08
存出保证金		529,291.25	329,855.59
交易性金融资产	6.4.7.2	116,597,466.92	719,851,782.02
其中：股票投资		116,577,666.92	719,851,782.02
基金投资		-	-
债券投资		19,800.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		744,917.97	-
应收利息	6.4.7.5	509.51	20,593.92
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		120,079,178.44	800,627,126.25
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,073,730.70	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		15,851.88	98,999.01
应付托管费		5,283.98	32,999.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.6	88,995.09	609,819.38
应交税费		0.79	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	148,432.42	39,758.25
负债合计		1,332,294.86	781,576.31
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.8	102,113,665.00	760,113,665.00
未分配利润	6.4.7.9	16,633,218.58	39,731,884.94
所有者权益合计		118,746,883.58	799,845,549.94
负债和所有者权益总计		120,079,178.44	800,627,126.25

注：截至2020年06月30日，前海开源中证500等权重交易型基金份额总额102,113,665.00份，基金份额净值为1.1629元。

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：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年06月30日
一、收入		33,890,450.39
1. 利息收入		68,485.11
其中：存款利息收入	6.4.7.10	68,457.62
债券利息收入		27.49
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）		61,719,208.07
其中：股票投资收益	6.4.7.11	60,597,294.12
基金投资收益	6.4.7.12	-
债券投资收益	6.4.7.13	47,076.14
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	1,074,837.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-29,921,947.72
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,024,704.93
减：二、费用		1,340,564.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	209,646.39
2. 托管费	6.4.10.2.2	69,882.13
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	887,603.17
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.09
7. 其他费用	6.4.7.20	173,432.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		32,549,886.19
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		32,549,886.19

6.3 所有者权益（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：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	760,113,665.00	39,731,884.94	799,845,549.94
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	32,549,886.19	32,549,886.19
三、本期基金份额交 易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	-658,000,000.00	-55,648,552.55	-713,648,552.55
其中：1. 基金申购款	28,000,000.00	1,565,778.29	29,565,778.29
2. 基金赎回 款	-686,000,000.00	-57,214,330.84	-743,214,330.84
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)	102,113,665.00	16,633,218.58	118,746,883.58

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：

蔡颖

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”)[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》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,首次设立募集扣除认购费用后的募集资金共计人民币760,113,665.00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(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份基金份额,其中网上现金方式认购募集的资本为人民币736,008,000.00元;以网下股票方式认购募集的资本为人民币24,105,665.00元。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。

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》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。

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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

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和托管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

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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、资产支持证券和私募债券除外)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、资产支持证券和私募债券除外)，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[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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起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 2020年06月30日
----	--------------------

活期存款	2,046,360.31
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	2,046,360.31

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	108,860,565.57	116,577,666.92	7,717,101.35
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	19,800.00	19,800.00
	银行间市场	-	-
	合计	19,800.00	19,800.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	108,880,365.57	116,597,466.92	7,717,101.35

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 2020年06月30日
应收活期存款利息	197.79
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	72.30
应收债券利息	1.22
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	238.20
合计	509.51

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	88,995.09
银行间市场应付交易费用	-
合计	88,995.09

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020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	113,432.42
应付指数使用费	35,000.00
合计	148,432.42

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	760,113,665.00	760,113,665.00
本期申购	28,000,000.00	28,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-686,000,000.00	-686,000,000.00
本期末	102,113,665.00	102,113,665.00

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,092,835.87	37,639,049.07	39,731,884.94
本期利润	62,471,833.91	-29,921,947.72	32,549,886.19
本期基金份额交易产生的变动数	-42,357,653.35	-13,290,899.20	-55,648,552.55
其中：基金申购款	3,271,703.03	-1,705,924.74	1,565,778.29
基金赎回款	-45,629,356.38	-11,584,974.46	-57,214,330.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,207,016.43	-5,573,797.85	16,633,218.58

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	53,191.56
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	9,433.52
其他	5,832.54
合计	68,457.62

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	44,069,396.35
股票投资收益——赎回差价收入	16,527,897.77
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	60,597,294.12

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	420,979,472.44
减：卖出股票成本总额	376,910,076.09
买卖股票差价收入	44,069,396.35

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
赎回基金份额对价总额	743,214,330.84
减：现金支付赎回款总额	378,251,644.84
减：赎回股票成本总额	348,434,788.23
赎回差价收入	16,527,897.77

6.4.7.11.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12 基金投资收益

无。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020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	47,076.14
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	47,076.14

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	169,303.24
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	122,200.00
减：应收利息总额	27.10
买卖债券差价收入	47,076.14

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

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

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,074,837.81
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,074,837.81

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	-29,921,947.72
——股票投资	-29,921,947.72
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-29,921,947.72

注：本基金本期公允价值变动损益-股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益为0.00元。

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	2,024,704.93
合计	2,024,704.93

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	887,603.17
银行间市场交易费用	-
合计	887,603.17

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	43,760.08
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	70,000.00
合计	173,432.42

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、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 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中国银河证券股份有限公司（“银河证券”）	556,264,703.61	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 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
中国银河证券股份有限公司（“银河证券”）	169,303.24	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 2020年01月01日至2020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
中国银河证券股份有限公司（“银河证券”）	406,802.14	100.00%	88,995.09	100.00%

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 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	209,646.39
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
----	-------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	69,882.13
----------------	-----------

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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 2020年06月30日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国银河证券	2,127,546.00	2.08%	0.00	0.00%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

无。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2020年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新股流通受限	12.04	12.04	6,530	78,621.20	78,621.20	-
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新股流通受限	11.33	11.33	6,044	68,478.52	68,478.52	-
002500	山西证券	2020-06-29	2020-07-10	新股流通受限	5.00	6.54	10,200	51,000.00	66,708.00	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股流通受限	16.42	16.42	3,703	60,803.26	60,803.26	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新股流通受限	15.50	15.50	3,873	60,031.50	60,031.50	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股流通受限	36.18	36.18	1,509	54,595.62	54,595.62	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新股流通受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-

300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
128115	巨星转债	2020-06-24	2020-07-16	新债流通受限	100.00	100.00	198	19,800.00	19,800.00	老股东配债

注：1. 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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2. 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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002470	*ST金正	2020-06-30	重大事项停牌	2.27	2020-07-01	2.16	76,100	197,629.89	172,747.00	-

601880	大连港	2020-06-22	重大事项停牌	1.72	2020-07-08	1.89	94,100	187,203.12	161,852.00	-
--------	-----	------------	--------	------	------------	------	--------	------------	------------	---

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于股票、债券等金融工具，在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部、金融工程部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金融工程部负责，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同责任，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

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	19,800.00	-
未评级	-	-
合计	19,800.00	-

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。

6.4.13.2.5 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。

于2020年6月30日，除卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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2020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%。

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2020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	2,046,360.31	-	-	-	2,046,360.31
结算备付金	160,632.48	-	-	-	160,632.48
存出保证金	529,291.25	-	-	-	529,291.25
交易性金融资产	19,800.00	-	-	116,577,666.92	116,597,466.92
应收证券清算款	-	-	-	812,168.70	812,168.70
应收利息	-	-	-	509.51	509.51
资产总计	2,756,084.04	-	-	117,390,345.13	120,146,429.17
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,140,981.43	1,140,981.43
应付管理人报酬	-	-	-	15,851.88	15,851.88
应付托	-	-	-	5,283.98	5,283.98

管费					
应付交易费用	-	-	-	88,995.09	88,995.09
应交税费	-	-	-	0.79	0.79
其他负债	-	-	-	148,432.42	148,432.42
负债总计	-	-	-	1,399,545.59	1,399,545.59
利率敏感度缺口	2,756,084.04	-	-	115,990,799.54	118,746,883.58
上年度末2019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	75,716,365.64	-	-	-	75,716,365.64
结算备付金	4,708,529.08	-	-	-	4,708,529.08
存出保证金	329,855.59	-	-	-	329,855.59
交易性金融资产	-	-	-	719,851,782.02	719,851,782.02
应收利息	-	-	-	20,593.92	20,593.92
资产总计	80,754,750.31	-	-	719,872,375.94	800,627,126.25
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	98,999.01	98,999.01
应付托管费	-	-	-	32,999.67	32,999.67
应付交易费用	-	-	-	609,819.38	609,819.38
其他负债	-	-	-	39,758.25	39,758.25
负债总计	-	-	-	781,576.31	781,576.31
利率敏感度缺口	80,754,750.31	-	-	719,090,799.63	799,845,549.94

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

无。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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 2020年06月30日		上年度末 2019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	116,577,666.92	98.17	719,851,782.02	90.00

产—股票投资				
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	116,577,666.92	98.17	719,851,782.02	90.00

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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准上升5%	6,129,173.98	41,012,578.27
	业绩比较基准下降5%	-6,129,173.98	-41,012,578.27

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	116,577,666.92	97.03
	其中：股票	116,577,666.92	97.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,800.00	0.02

	其中：债券	19,800.00	0.02
	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	2,206,992.79	1.84
8	其他各项资产	1,274,718.73	1.12
9	合计	120,079,178.44	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	901,159.00	0.76
B	采矿业	3,615,576.50	3.04
C	制造业	64,957,765.30	54.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,480,744.91	2.93
E	建筑业	2,253,248.00	1.90
F	批发和零售业	7,321,545.94	6.17
G	交通运输、仓储和邮政业	4,024,175.80	3.39
H	住宿和餐饮业	467,878.00	0.39
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,978,437.48	8.40
J	金融业	5,421,168.23	4.57
K	房地产业	5,374,263.05	4.53
L	租赁和商务服务业	2,137,290.00	1.80
M	科学研究和技术服务业	596,451.00	0.50
N	水利、环境和公共设施管理业	1,222,132.70	1.03

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	303,048.00	0.26
Q	卫生和社会工作	518,880.00	0.44
R	文化、体育和娱乐业	2,620,580.00	2.21
S	综合	909,886.00	0.77
	合计	116,104,229.91	97.77

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	448,573.12	0.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
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	12,097.57	0.01
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	473,437.01	0.40

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	603444	吉比特	900	494,109.00	0.42
2	600859	王府井	9,600	437,280.00	0.37
3	600884	杉杉股份	34,815	410,468.85	0.35
4	600298	安琪酵母	8,001	395,889.48	0.33
5	600079	人福医药	13,500	367,470.00	0.31
6	002030	达安基因	13,201	360,123.28	0.30
7	600827	百联股份	24,300	351,135.00	0.30
8	600195	中牧股份	21,600	350,568.00	0.30
9	600315	上海家化	7,300	349,670.00	0.29
10	600718	东软集团	30,400	349,600.00	0.29
11	002382	蓝帆医疗	11,600	349,276.00	0.29
12	600143	金发科技	26,500	349,005.00	0.29
13	600645	中源协和	12,300	347,475.00	0.29
14	600521	华海药业	10,150	344,389.50	0.29
15	600216	浙江医药	17,700	340,902.00	0.29
16	603233	大参林	4,180	339,499.60	0.29

17	002507	涪陵榨菜	9,400	338,494.00	0.29
18	002223	鱼跃医疗	9,100	331,240.00	0.28
19	600699	均胜电子	13,800	328,578.00	0.28
20	600418	江淮汽车	37,200	328,476.00	0.28
21	600648	外高桥	23,100	326,634.00	0.28
22	300010	立思辰	16,500	322,905.00	0.27
23	002399	海普瑞	12,800	320,512.00	0.27
24	000988	华工科技	13,100	320,033.00	0.27
25	300274	阳光电源	22,000	316,580.00	0.27
26	002690	美亚光电	6,000	315,600.00	0.27
27	603338	浙江鼎力	4,120	312,172.40	0.26
28	600779	水井坊	5,000	312,100.00	0.26
29	002375	亚厦股份	30,300	309,666.00	0.26
30	600875	东方电气	34,900	308,865.00	0.26
31	600350	山东高速	50,300	308,842.00	0.26
32	600765	中航重机	30,200	308,644.00	0.26
33	600380	健康元	19,000	308,560.00	0.26
34	002648	卫星石化	18,900	307,503.00	0.26
35	000513	丽珠集团	6,400	307,264.00	0.26
36	002867	周大生	13,800	305,946.00	0.26
37	002414	高德红外	10,440	305,683.20	0.26
38	000813	德展健康	49,300	305,660.00	0.26
39	002709	天赐材料	9,000	304,110.00	0.26
40	603377	东方时尚	18,300	303,048.00	0.26
41	002818	富森美	24,600	302,580.00	0.25
42	600845	宝信软件	5,100	301,308.00	0.25
43	600885	宏发股份	7,500	300,900.00	0.25
44	300253	卫宁健康	13,090	300,284.60	0.25
45	000975	银泰黄金	19,100	299,488.00	0.25
46	600060	海信视像	24,600	298,890.00	0.25
47	000959	首钢股份	69,400	298,420.00	0.25

48	603650	彤程新材	12,800	297,856.00	0.25
49	002242	九阳股份	7,988	297,712.76	0.25
50	600529	山东药玻	5,100	295,800.00	0.25
51	002074	国轩高科	11,000	295,240.00	0.25
52	600728	佳都科技	32,400	295,164.00	0.25
53	000869	张裕 A	8,600	293,690.00	0.25
54	000878	云南铜业	27,600	292,836.00	0.25
55	600511	国药股份	7,200	292,824.00	0.25
56	002368	太极股份	6,700	292,723.00	0.25
57	002946	新乳业	16,800	291,480.00	0.25
58	002353	杰瑞股份	9,400	291,400.00	0.25
59	600062	华润双鹤	22,000	290,840.00	0.24
60	002155	湖南黄金	36,600	288,408.00	0.24
61	002745	木林森	18,700	288,167.00	0.24
62	601865	福莱特	15,300	287,640.00	0.24
63	600325	华发股份	40,700	287,342.00	0.24
64	002004	华邦健康	53,400	287,292.00	0.24
65	002387	维信诺	20,100	287,028.00	0.24
66	600811	东方集团	64,900	286,858.00	0.24
67	002603	以岭药业	9,183	286,417.77	0.24
68	600316	洪都航空	18,100	285,980.00	0.24
69	603712	七一二	7,400	284,012.00	0.24
70	603486	科沃斯	9,400	283,974.00	0.24
71	002500	山西证券	43,400	283,836.00	0.24
72	600064	南京高科	29,200	283,824.00	0.24
73	002174	游族网络	10,800	281,664.00	0.24
74	600073	上海梅林	29,650	281,378.50	0.24
75	002407	多氟多	26,400	280,896.00	0.24
76	603858	步长制药	9,700	279,845.00	0.24
77	300496	中科创达	3,600	279,720.00	0.24
78	603806	福斯特	5,600	279,496.00	0.24

79	000519	中兵红箭	29,600	278,832.00	0.23
80	603786	科博达	3,700	278,795.00	0.23
81	300009	安科生物	15,546	278,273.40	0.23
82	601928	凤凰传媒	40,800	277,440.00	0.23
83	000636	风华高科	9,500	277,305.00	0.23
84	603868	飞科电器	5,600	276,248.00	0.23
85	601689	拓普集团	9,895	276,070.50	0.23
86	002920	德赛西威	4,500	275,985.00	0.23
87	600549	厦门钨业	23,300	275,872.00	0.23
88	002372	伟星新材	23,700	275,631.00	0.23
89	000729	燕京啤酒	40,100	274,685.00	0.23
90	603816	顾家家居	6,100	274,561.00	0.23
91	002583	海能达	36,100	273,999.00	0.23
92	600138	中青旅	27,700	273,399.00	0.23
93	600373	中文传媒	23,200	273,296.00	0.23
94	603379	三美股份	12,720	273,098.40	0.23
95	002423	中粮资本	31,300	272,310.00	0.23
96	600037	歌华有线	17,900	272,080.00	0.23
97	000158	常山北明	26,000	271,440.00	0.23
98	002503	搜于特	96,500	271,165.00	0.23
99	600126	杭钢股份	26,060	271,024.00	0.23
100	002572	索菲亚	11,200	270,704.00	0.23
101	000547	航天发展	19,800	270,666.00	0.23
102	300482	万孚生物	2,600	270,400.00	0.23
103	600804	鹏博士	30,100	270,298.00	0.23
104	600801	华新水泥	11,400	270,294.00	0.23
105	603883	老百姓	2,700	270,108.00	0.23
106	600155	华创阳安	22,500	269,775.00	0.23
107	300459	金科文化	78,100	269,445.00	0.23
108	002815	崇达技术	13,300	269,059.00	0.23
109	600056	中国医药	19,000	268,850.00	0.23

109	002941	新疆交建	19,000	268,850.00	0.23
111	000999	华润三九	9,200	268,548.00	0.23
112	000564	供销大集	59,800	268,502.00	0.23
113	300244	迪安诊断	7,600	268,280.00	0.23
114	002926	华西证券	25,200	267,876.00	0.23
115	000009	中国宝安	31,400	267,214.00	0.23
116	600039	四川路桥	69,900	267,018.00	0.22
117	600338	西藏珠峰	26,700	267,000.00	0.22
118	300618	寒锐钴业	4,300	266,686.00	0.22
119	000501	鄂武商 A	17,000	266,560.00	0.22
120	603225	新凤鸣	26,689	266,356.22	0.22
121	600260	凯乐科技	19,600	264,992.00	0.22
122	300180	华峰超纤	30,900	264,504.00	0.22
123	002544	杰赛科技	20,100	264,315.00	0.22
124	600598	北大荒	16,400	264,040.00	0.22
125	300001	特锐德	12,600	263,844.00	0.22
126	001872	招商港口	18,100	263,355.00	0.22
127	002385	大北农	28,900	263,279.00	0.22
128	600312	平高电气	35,300	261,926.00	0.22
129	300285	国瓷材料	7,800	261,378.00	0.22
130	600094	大名城	43,900	261,205.00	0.22
131	603025	大豪科技	35,900	260,993.00	0.22
132	601811	新华文轩	25,600	260,352.00	0.22
133	300026	红日药业	47,100	259,992.00	0.22
134	600258	首旅酒店	16,900	259,753.00	0.22
135	002281	光迅科技	7,900	259,594.00	0.22
136	002191	劲嘉股份	29,100	259,281.00	0.22
137	002373	千方科技	10,804	259,187.96	0.22
138	002831	裕同科技	9,400	258,594.00	0.22
139	300115	长盈精密	11,300	258,205.00	0.22
140	000930	中粮科技	37,600	256,808.00	0.22

141	002439	启明星辰	6,100	256,627.00	0.22
142	600201	生物股份	9,200	256,128.00	0.22
143	600282	南钢股份	79,200	255,816.00	0.22
144	600132	重庆啤酒	3,500	255,500.00	0.22
145	600167	联美控股	17,700	253,818.00	0.21
146	300168	万达信息	11,500	253,805.00	0.21
147	002444	巨星科技	21,300	253,044.00	0.21
148	600563	法拉电子	4,087	252,576.60	0.21
149	300558	贝达药业	1,800	251,964.00	0.21
150	002038	双鹭药业	19,600	251,076.00	0.21
151	002957	科瑞技术	10,500	250,950.00	0.21
152	600707	彩虹股份	55,000	250,800.00	0.21
153	603882	金域医学	2,800	250,600.00	0.21
154	002152	广电运通	19,300	249,742.00	0.21
155	600835	上海机电	14,750	249,717.50	0.21
156	300595	欧普康视	3,600	249,624.00	0.21
157	300418	昆仑万维	10,000	249,600.00	0.21
158	600566	济川药业	9,800	249,508.00	0.21
159	600329	中新药业	14,400	249,408.00	0.21
160	600161	天坛生物	5,500	249,315.00	0.21
161	300012	华测检测	12,600	248,976.00	0.21
162	300113	顺网科技	9,800	248,920.00	0.21
163	600053	九鼎投资	8,300	247,672.00	0.21
164	603517	绝味食品	3,500	247,590.00	0.21
165	300088	长信科技	22,100	247,520.00	0.21
166	002653	海思科	9,300	247,473.00	0.21
167	601958	金钼股份	40,000	247,200.00	0.21
168	002010	传化智联	45,400	246,976.00	0.21
169	600729	重庆百货	7,900	246,638.00	0.21
170	002075	沙钢股份	19,700	246,250.00	0.21
171	601717	郑煤机	41,800	246,202.00	0.21

172	002294	信立泰	8,300	246,178.00	0.21
173	002019	亿帆医药	10,700	245,779.00	0.21
174	300207	欣旺达	13,000	245,700.00	0.21
175	600535	天士力	15,100	244,922.00	0.21
176	300315	掌趣科技	33,400	244,822.00	0.21
177	600572	康恩贝	44,500	244,750.00	0.21
178	601005	重庆钢铁	164,000	244,360.00	0.21
179	300271	华宇软件	8,600	242,606.00	0.20
180	600597	光明乳业	16,319	242,500.34	0.20
181	603766	隆鑫通用	62,600	242,262.00	0.20
182	603355	莱克电气	9,700	241,433.00	0.20
183	002127	南极电商	11,400	241,338.00	0.20
184	000848	承德露露	34,460	241,220.00	0.20
185	300212	易华录	4,300	240,800.00	0.20
186	600446	金证股份	12,400	240,560.00	0.20
187	002505	大康农业	106,900	240,525.00	0.20
188	300017	网宿科技	28,300	240,267.00	0.20
189	002340	格林美	48,300	240,051.00	0.20
190	300316	晶盛机电	9,700	239,978.00	0.20
191	600649	城投控股	40,400	239,976.00	0.20
192	600639	浦东金桥	15,000	239,700.00	0.20
193	600415	小商品城	49,200	239,604.00	0.20
194	600640	号百控股	12,000	239,400.00	0.20
195	300324	旋极信息	35,800	238,428.00	0.20
196	600642	申能股份	40,300	238,173.00	0.20
197	002273	水晶光电	13,889	238,057.46	0.20
198	600959	江苏有线	63,200	237,632.00	0.20
199	603317	天味食品	4,275	237,604.50	0.20
200	000400	许继电气	18,000	237,600.00	0.20
201	600985	淮北矿业	30,500	237,595.00	0.20
202	603198	迎驾贡酒	10,900	237,293.00	0.20

203	300058	蓝色光标	30,400	237,120.00	0.20
204	603659	璞泰来	2,300	236,946.00	0.20
205	002396	星网锐捷	6,700	236,711.00	0.20
206	001914	招商积余	7,700	236,621.00	0.20
207	002221	东华能源	26,900	236,451.00	0.20
208	000528	柳工	37,400	235,994.00	0.20
209	300474	景嘉微	3,500	235,550.00	0.20
210	603228	景旺电子	6,680	235,069.20	0.20
211	300376	易事特	45,200	235,040.00	0.20
212	600895	张江高科	11,500	234,255.00	0.20
213	002635	安洁科技	9,400	234,060.00	0.20
214	002212	南洋股份	8,800	233,904.00	0.20
215	600967	内蒙一机	22,500	233,775.00	0.20
216	002028	思源电气	11,400	233,244.00	0.20
217	601179	中国西电	48,100	232,804.00	0.20
218	603707	健友股份	3,600	232,452.00	0.20
219	601966	玲珑轮胎	11,500	232,300.00	0.20
220	600673	东阳光	33,600	232,176.00	0.20
221	600733	北汽蓝谷	36,100	232,123.00	0.20
222	002093	国脉科技	26,200	231,870.00	0.20
223	600755	厦门国贸	35,100	231,660.00	0.20
224	600478	科力远	49,153	231,510.63	0.19
225	601860	紫金银行	54,700	231,381.00	0.19
226	300257	开山股份	17,700	231,339.00	0.19
227	603939	益丰药房	2,540	231,140.00	0.19
228	300024	机器人	16,900	231,023.00	0.19
229	600021	上海电力	31,200	230,880.00	0.19
230	601869	长飞光纤	7,465	229,996.65	0.19
231	600291	西水股份	25,400	229,870.00	0.19
232	600410	华胜天成	16,900	229,840.00	0.19
233	600160	巨化股份	33,350	229,781.50	0.19

234	000028	国药一致	5,100	229,551.00	0.19
235	300296	利亚德	37,800	229,446.00	0.19
236	000738	航发控制	16,800	229,320.00	0.19
237	002118	紫鑫药业	51,600	229,104.00	0.19
238	601801	皖新传媒	41,200	229,072.00	0.19
239	000970	中科三环	23,400	228,852.00	0.19
240	603568	伟明环保	9,861	228,775.20	0.19
241	600633	浙数文化	23,376	228,617.28	0.19
242	601799	星宇股份	1,800	228,600.00	0.19
243	002268	卫士通	10,700	228,338.00	0.19
244	600717	天津港	51,640	228,248.80	0.19
245	300072	三聚环保	53,300	228,124.00	0.19
246	000998	隆平高科	13,700	228,105.00	0.19
247	002156	通富微电	9,100	227,955.00	0.19
248	603328	依顿电子	21,800	227,374.00	0.19
249	603515	欧普照明	8,300	227,171.00	0.19
250	600862	中航高科	13,400	226,728.00	0.19
251	002901	大博医疗	1,900	226,651.00	0.19
252	002078	太阳纸业	23,800	226,576.00	0.19
253	600125	铁龙物流	40,600	226,548.00	0.19
254	600751	海航科技	72,300	226,299.00	0.19
255	000078	海王生物	54,000	226,260.00	0.19
256	603000	人民网	11,400	226,062.00	0.19
257	000830	鲁西化工	30,300	226,038.00	0.19
258	600839	四川长虹	78,600	225,582.00	0.19
259	600120	浙江东方	32,829	225,535.23	0.19
260	002839	张家港行	39,100	225,216.00	0.19
261	002465	海格通信	17,400	225,156.00	0.19
262	002056	横店东磁	20,000	225,000.00	0.19
263	600273	嘉化能源	25,700	224,618.00	0.19
264	000050	深天马 A	14,600	224,256.00	0.19

265	601003	柳钢股份	50,600	224,158.00	0.19
266	300070	碧水源	27,600	224,112.00	0.19
267	300357	我武生物	3,600	224,100.00	0.19
268	603866	桃李面包	4,400	223,916.00	0.19
269	600657	信达地产	54,300	223,716.00	0.19
270	603983	丸美股份	2,600	223,678.00	0.19
271	000739	普洛药业	9,600	223,584.00	0.19
272	300166	东方国信	18,000	223,380.00	0.19
273	600466	蓝光发展	41,400	223,146.00	0.19
274	600515	海航基础	42,900	223,080.00	0.19
275	601099	太平洋	70,300	222,851.00	0.19
276	002051	中工国际	30,600	222,768.00	0.19
277	600486	扬农化工	2,700	222,750.00	0.19
278	601168	西部矿业	38,400	222,720.00	0.19
278	600557	康缘药业	16,000	222,720.00	0.19
280	002138	顺络电子	8,900	222,055.00	0.19
281	300630	普利制药	3,000	221,850.00	0.19
282	600823	世茂股份	49,600	221,712.00	0.19
283	600460	士兰微	15,100	221,668.00	0.19
284	600348	阳泉煤业	52,400	221,128.00	0.19
285	600667	太极实业	18,700	221,034.00	0.19
286	603556	海兴电力	15,300	220,932.00	0.19
287	600879	航天电子	34,300	220,892.00	0.19
288	600388	龙净环保	25,051	220,448.80	0.19
289	600409	三友化工	47,300	220,418.00	0.19
290	601019	山东出版	35,200	220,000.00	0.19
291	600643	爱建集团	27,600	219,420.00	0.18
292	600171	上海贝岭	12,600	218,988.00	0.18
293	600256	广汇能源	81,100	218,970.00	0.18
294	601228	广州港	72,000	218,880.00	0.18
295	000623	吉林敖东	13,910	218,804.30	0.18

296	002821	凯莱英	900	218,700.00	0.18
297	600567	山鹰纸业	74,100	218,595.00	0.18
298	600582	天地科技	74,600	218,578.00	0.18
299	601016	节能风电	103,100	218,572.00	0.18
300	002563	森马服饰	31,000	218,550.00	0.18
301	601200	上海环境	18,210	218,520.00	0.18
302	603256	宏和科技	19,100	218,504.00	0.18
303	600748	上实发展	42,700	218,197.00	0.18
304	601233	桐昆股份	17,100	218,196.00	0.18
305	601611	中国核建	35,300	218,154.00	0.18
306	000932	华菱钢铁	57,800	217,906.00	0.18
307	601615	明阳智能	17,500	217,875.00	0.18
308	601718	际华集团	65,600	217,792.00	0.18
309	600507	方大特钢	41,931	217,621.89	0.18
310	600376	首开股份	37,100	217,406.00	0.18
311	000967	盈峰环境	26,300	216,975.00	0.18
312	600141	兴发集团	24,200	216,590.00	0.18
313	002185	华天科技	16,000	216,480.00	0.18
314	000543	皖能电力	53,800	216,276.00	0.18
315	000021	深科技	9,900	216,117.00	0.18
316	603605	珀莱雅	1,200	216,024.00	0.18
317	600874	创业环保	32,500	215,800.00	0.18
318	600903	贵州燃气	21,900	215,496.00	0.18
319	600026	中远海能	33,300	215,118.00	0.18
320	600869	智慧能源	53,759	215,036.00	0.18
321	600435	北方导航	28,440	215,006.40	0.18
322	603888	新华网	9,600	214,656.00	0.18
323	600776	东方通信	14,200	214,278.00	0.18
324	600917	重庆燃气	30,000	214,200.00	0.18
324	600782	新钢股份	52,500	214,200.00	0.18
326	000061	农产品	28,900	214,149.00	0.18

327	600426	华鲁恒升	12,100	213,928.00	0.18
328	601512	中新集团	18,600	213,900.00	0.18
329	600787	中储股份	48,700	213,793.00	0.18
330	600694	大商股份	8,900	213,511.00	0.18
331	600996	贵广网络	29,928	213,386.64	0.18
332	002285	世联行	76,400	213,156.00	0.18
333	601975	招商南油	89,100	212,949.00	0.18
334	600901	江苏租赁	40,800	212,568.00	0.18
335	300134	大富科技	15,200	212,496.00	0.18
336	600675	中华企业	52,200	212,454.00	0.18
337	601699	潞安环能	38,100	212,217.00	0.18
338	600266	城建发展	41,844	212,149.08	0.18
339	600339	中油工程	93,400	212,018.00	0.18
340	600497	驰宏锌锗	61,600	211,904.00	0.18
341	300133	华策影视	29,200	211,700.00	0.18
342	601678	滨化股份	49,900	211,576.00	0.18
343	600006	东风汽车	52,500	211,575.00	0.18
344	601608	中信重工	61,850	211,527.00	0.18
345	002110	三钢闽光	31,700	211,122.00	0.18
346	000581	威孚高科	10,200	210,936.00	0.18
347	601598	中国外运	65,300	210,919.00	0.18
348	600058	五矿发展	34,900	210,796.00	0.18
349	601068	中铝国际	53,900	210,749.00	0.18
350	002458	益生股份	13,800	210,726.00	0.18
351	601098	中南传媒	19,900	210,542.00	0.18
352	600545	卓郎智能	44,500	210,485.00	0.18
353	600166	福田汽车	116,900	210,420.00	0.18
354	600909	华安证券	30,800	210,364.00	0.18
355	000553	安道麦A	23,300	210,166.00	0.18
356	000987	越秀金控	18,000	209,880.00	0.18
357	600565	迪马股份	75,200	209,808.00	0.18

358	600863	内蒙华电	85,200	209,592.00	0.18
359	601127	小康股份	25,200	209,412.00	0.18
360	600757	长江传媒	41,100	209,199.00	0.18
361	600970	中材国际	39,600	209,088.00	0.18
362	600580	卧龙电驱	18,600	209,064.00	0.18
363	601128	常熟银行	27,800	208,778.00	0.18
364	000090	天健集团	30,200	208,682.00	0.18
365	600158	中体产业	25,500	208,590.00	0.18
366	600737	中粮糖业	26,800	208,504.00	0.18
367	600704	物产中大	49,500	208,395.00	0.18
368	600528	中铁工业	23,600	208,152.00	0.18
369	600754	锦江酒店	7,500	208,125.00	0.18
370	600022	山东钢铁	161,300	208,077.00	0.18
371	600777	新潮能源	136,800	207,936.00	0.18
372	600008	首创股份	69,011	207,723.11	0.17
373	600623	华谊集团	40,200	207,432.00	0.17
374	600908	无锡银行	42,100	206,711.00	0.17
375	600500	中化国际	40,800	206,448.00	0.17
376	600820	隧道股份	36,500	206,225.00	0.17
377	600307	酒钢宏兴	133,800	206,052.00	0.17
378	601139	深圳燃气	31,700	206,050.00	0.17
379	601000	唐山港	92,000	205,160.00	0.17
380	600335	国机汽车	44,400	205,128.00	0.17
381	600153	建发股份	25,300	204,930.00	0.17
382	603056	德邦股份	15,100	204,303.00	0.17
383	600259	广晟有色	6,800	204,000.00	0.17
384	600017	日照港	81,800	203,682.00	0.17
385	601333	广深铁路	90,500	203,625.00	0.17
386	002233	塔牌集团	16,900	203,307.00	0.17
387	000717	韶钢松山	53,500	203,300.00	0.17
388	300251	光线传媒	18,600	202,926.00	0.17

389	600770	综艺股份	42,200	202,560.00	0.17
390	601106	中国一重	71,900	202,039.00	0.17
391	603885	吉祥航空	22,200	202,020.00	0.17
392	600808	马钢股份	78,300	202,014.00	0.17
393	002183	怡亚通	37,600	201,536.00	0.17
394	600392	盛和资源	28,404	200,248.20	0.17
395	000089	深圳机场	26,000	199,160.00	0.17
396	601118	海南橡胶	40,800	198,288.00	0.17
397	600575	淮河能源	94,100	196,669.00	0.17
398	000012	南玻 A	38,982	195,689.64	0.16
399	000800	一汽解放	18,200	195,468.00	0.16
400	600881	亚泰集团	67,000	194,970.00	0.16
401	600664	哈药股份	63,300	194,964.00	0.16
402	000807	云铝股份	44,700	194,892.00	0.16
403	300002	神州泰岳	31,400	194,366.00	0.16
404	002416	爱施德	26,963	193,594.34	0.16
405	002390	信邦制药	42,400	193,344.00	0.16
406	600277	亿利洁能	59,000	192,340.00	0.16
407	601866	中远海发	104,500	192,280.00	0.16
408	002080	中材科技	12,400	192,200.00	0.16
409	000877	天山股份	12,700	191,770.00	0.16
410	000156	华数传媒	17,700	-	-

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	688277	天智航	6,530	78,621.20	0.07

2	688528	秦川物联	6,044	68,478.52	0.06
3	688377	迪威尔	3,703	60,803.26	0.05
4	688600	皖仪科技	3,873	60,031.50	0.05
5	688027	国盾量子	1,509	54,595.62	0.05
6	603087	甘李药业	452	45,335.60	0.04
7	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.02
8	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.02
9	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
10	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
11	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.01
12	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
13	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
14	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.01
15	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002030	达安基因	2,535,324.00	0.32
2	002821	凯莱英	1,569,657.97	0.20
3	300529	健帆生物	1,260,208.00	0.16
4	603338	浙江鼎力	915,427.00	0.11
5	603883	老百姓	851,690.00	0.11
6	600486	扬农化工	843,786.00	0.11
7	603983	丸美股份	820,688.00	0.10
8	300088	长信科技	814,322.86	0.10
9	600161	天坛生物	697,170.00	0.09
10	002268	卫士通	676,633.00	0.08
11	600779	水井坊	637,735.00	0.08

12	002242	九阳股份	583,532.00	0.07
13	600694	大商股份	582,906.00	0.07
14	600754	锦江酒店	582,207.21	0.07
15	603659	璞泰来	579,607.00	0.07
16	300009	安科生物	577,512.00	0.07
17	603233	大参林	568,361.97	0.07
18	002635	安洁科技	559,498.00	0.07
19	002603	以岭药业	545,152.95	0.07
20	300014	亿纬锂能	531,134.00	0.07

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	002030	达安基因	4,403,424.80	0.55
2	002821	凯莱英	3,313,533.00	0.41
3	300529	健帆生物	3,138,747.40	0.39
4	002414	高德红外	2,616,079.60	0.33
5	002371	北方华创	2,536,735.00	0.32
6	002074	国轩高科	2,473,275.87	0.31
7	002603	以岭药业	2,431,513.00	0.30
8	300088	长信科技	2,422,832.00	0.30
9	002635	安洁科技	2,417,045.36	0.30
10	002129	中环股份	2,347,885.95	0.29
11	300014	亿纬锂能	2,283,766.68	0.29
12	002385	大北农	2,253,574.00	0.28
13	000021	深科技	2,234,823.04	0.28
14	002056	横店东磁	2,229,644.88	0.28
15	300316	晶盛机电	2,176,176.22	0.27

16	300182	捷成股份	2,150,676.00	0.27
17	300010	立思辰	2,147,674.00	0.27
18	300418	昆仑万维	2,138,209.06	0.27
19	300308	中际旭创	2,135,546.00	0.27
20	002065	东华软件	2,134,731.00	0.27

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	138,539,148.94
卖出股票收入（成交）总额	420,979,472.44

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	-	-
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)	19,800.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	19,800.00	0.02

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	128115	巨星转债	198	19,800.00	0.02

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

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

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

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策
无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策
无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。

7.11.3 本期国债期货投资评价
无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	529,291.25
2	应收证券清算款	744,917.97
3	应收股利	-
4	应收利息	509.51
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,274,718.73

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688277	天智航	78,621.20	0.07	新股流通受限

2	688528	秦川物联	68,478.52	0.06	新股流通受限
3	688377	迪威尔	60,803.26	0.05	新股流通受限
4	688600	皖仪科技	60,031.50	0.05	新股流通受限
5	688027	国盾量子	54,595.62	0.05	新股流通受限

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
1,927	52,991.00	35,390,507.00	34.66%	66,723,158.00	65.34%

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	国华人寿保险股份有限公司—传统六号	27,912,900.00	27.34
2	中信建投证券股份有限公司	4,399,214.00	4.31
3	中国银河证券股份有限公司	2,127,546.00	2.08
4	刘兵	1,001,000.00	0.98
5	黄丽萍	1,000,000.00	0.98
6	李亮	802,700.00	0.79
7	董保国	759,000.00	0.74
8	张书林	640,000.00	0.63
9	李树明	634,000.00	0.62
10	辛明蕾	598,413.00	0.59

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	0.0000%

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	760,113,665.00
本报告期基金总申购份额	28,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	686,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	102,113,665.00

§ 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，经前海开源基金管理有限公司第三届董事会第五次会议审议通过，选举秦亚峰先生担任公司固定收益投资决策委员会主席；

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及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情形。

本报告期基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况如下：

2020年4月22日，北京证监局向公司下发《行政监管措施决定书（中国银河证券股份有限公司）》（〔2020〕64号），针对公司持有一种非权益类证券超规模；作为私募股权投资基金托管人，根据基金管理人提供的单方说明变更收款账户，将基金财产划至管理人账户等行为出具行政监管处罚措施，责令公司限期改正，要求公司完善内部控制，加强风险控制指标监控，及时发现并报告相关情况；作为私募股权投资基金托管人，尽职履责，切实履行义务，并于收到决定书之日起30日内向北京证监局提交书面整改报告。

对于上述事项，公司高度重视并责成相关部门全面、深入查找分析问题根源，采取了有效、有针对性的整改措施，进一步加强风险控制指标监控工作，做好金仕达系统和风险独立监控系统的升级完善工作，加强对风险控制指标的跨部门协同管理工作，并采取有效措施建立长效机制；进一步加强托管业务管理流程，完成对非标产品划款审批流程和合同范本的修订工作，完善对管理人和产品的引入尽调及评审的相关流程，从源头上杜绝私募股权基金托管的风险。公司于2020年5月22日向北京证监局报送了《公司就〈关于对中国银河证券股份有限公司采取责令改正措施的决定〉整改情况的报告》。

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	556,264,703.61	100.00%	406,802.14	100.00%	-

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	169,303.24	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	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（20200115更新）	中国证监会规定媒介	2020-01-15
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招募说明书（20200115更新）	中国证监会规定媒介	2020-01-15
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上市交易公告书提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-01-15
4	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新的公告	中国证监会规定媒介	2020-01-15
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开放日常申购、赎回业务的公告	中国证监会规定媒介	2020-01-15
6	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会规定媒介	2020-01-15
7	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基	中国证监会规定媒介	2020-01-20

	金上市交易提示性公告		
8	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增加扩位证券简称的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-13
9	关于调整前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金指数许可使用费收取下限的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-13
10	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（20200313更新）	中国证监会规定媒介	2020-03-13
11	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（20200313更新）	中国证监会规定媒介	2020-03-13
12	前海开源基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）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	2020-03-30
13	前海开源基金管理有限公司旗下部分基金2020年第一季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-04-22
14	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金2020年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2020-04-22
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招募说明书摘要（20200508更新）	中国证监会规定媒介	2020-05-08
16	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（20200508更	中国证监会规定媒介	2020-05-08

	新)		
17	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金变更基金经理的公告	中国证监会规定媒介	2020-05-08
18	前海开源基金管理有限公司关于暂停扬州国信嘉利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	2020-05-28
19	前海开源基金管理有限公司关于旗下上交所ETF申购赎回清单版本更新的公告	中国证监会规定媒介	2020-06-19
20	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要(20200619更新)	中国证监会规定媒介	2020-06-19
21	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(20200619更新)	中国证监会规定媒介	2020-06-19

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	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	20200602 - 20200630	27,912,900.00	0.00	0.00	27,912,900.00	27.34%

产品特有风险

- 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;
- 转换运作方式或终止基金合同的风险**
单一投资者大额赎回后,若本基金连续55个工作日基金份额持有人低于200人或基金资产净值低于5000万情形的,基金管理人应当向中国证监会提出解决方案,或按基金合同约定终止基金合同,其他投资者可能面临终止基金合同的风险;
- 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；

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

(1) 中国证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、营业执照和公司章程

(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（免长途话费）

(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

二〇二〇年八月三十一日