
前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金

2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人:前海开源基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2021 年 03 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年3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。

本报告中的财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2020年01月01日起至2020年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	9
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 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	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
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	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	20
§6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20
§7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表	23
7.2 利润表	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	26
7.4 报表附注	28
§8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	75
8.6 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	75
8.7 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	75
8.8 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	75
8.9 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	76
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	76

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	76
8.12 投资组合报告附注.....	76
§9 基金份额持有人信息.....	77
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	77
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	78
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	78
§10 开放式基金份额变动.....	79
§11 重大事件揭示.....	79
11.1 基金份额持有人大会决议.....	79
11.2 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.....	79
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	80
11.4 基金投资策略的改变.....	80
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	80
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	80
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	80
11.8 其他重大事件.....	81
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	84
12.1 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.....	84
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	84
§13 备查文件目录.....	84
13.1 备查文件目录.....	85
13.2 存放地点.....	85
13.3 查阅方式.....	85

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金	
基金简称	前海开源MSCI中国A股指数	
基金主代码	006524	
基金运作方式	契约型普通开放式	
基金合同生效日	2018年11月27日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	8,884,358.67份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海开源MSCI中国A 股指数A	前海开源MSCI中国A 股指数C
下属分级基金的交易代码	006524	006525
报告期末下属分级基金的份额总额	5,092,910.26份	3,791,448.41份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p>

本基金的投资策略主要有以下八个方面内容：

1、大类资产配置

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

2、股票投资策略

（1）股票投资组合构建

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

（2）股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合将根据MSCI中国A股指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况等，对其进行适时调整，以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

3、债券投资策略

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资，通过主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收

收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。

4、权证投资策略

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

5、资产支持证券投资策略

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

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

6、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

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

7、现金管理策略

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

	<p>8、其他</p> <p>未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>
业绩比较基准	MSCI中国A股指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金紧密跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	前海开源基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌
	联系电话	0755-88601888
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com
客户服务电话	4001666998	95555
传真	0755-83181169	0755-83195201
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦2206	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	518040	518040
法定代表人	王兆华	缪建民

2.4 信息披露方式

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

址	
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国(上海)黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼
注册登记机构	前海开源基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦22楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2020年		2019年		2018年11月27日(基金合同生效日)-2018年12月31日	
	前海开源MSCI中国A股指数A	前海开源MSCI中国A股指数C	前海开源MSCI中国A股指数A	前海开源MSCI中国A股指数C	前海开源MSCI中国A股指数A	前海开源MSCI中国A股指数C
本期已实现收益	5,792,334.00	4,279,565.64	913,451.99	1,766,190.90	9,190.19	99,864.31
本期利润	3,477,210.00	6,526,373.11	3,610,829.64	4,845,508.76	-150,215.96	-2,323,544.75
加权平均基金份额本期利润	0.3769	0.8055	0.2184	0.2693	-0.0107	-0.0108
本期加权平均净值利润率	29.57%	63.86%	19.09%	24.47%	-1.07%	-1.09%
本期基金份额净值	35.55%	35.26%	31.51%	31.24%	-1.07%	-1.08%

增长率						
3.1.2 期末数据和指标	2020年末		2019年末		2018年末	
期末可供分配利润	3,097,976.01	2,279,338.64	2,083,428.99	446,975.58	-150,215.96	-2,323,544.75
期末可供分配基金份额利润	0.6083	0.6012	0.0569	0.0543	-0.0107	-0.0108
期末基金资产净值	8,190,886.27	6,070,787.05	43,476,113.72	9,747,040.25	13,945,329.26	211,999,193.21
期末基金份额净值	1.6083	1.6012	1.1865	1.1838	0.9893	0.9892
3.1.3 累计期末指标	2020年末		2019年末		2018年末	
基金份额累计净值增长率	76.36%	75.60%	30.11%	29.82%	-1.07%	-1.08%

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

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

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

④本基金的基金合同于2018年11月27日生效，截至2018年12月31日，本基金成立未满1年，故2018年年度数据与指标为不完整会计年度数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海开源MSCI中国A股指数A

阶段	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	13.16%	1.02%	12.44%	0.96%	0.72%	0.06%
过去六个月	25.13%	1.35%	22.94%	1.28%	2.19%	0.07%
过去一年	35.55%	1.36%	29.80%	1.36%	5.75%	0.00%
自基金合同生效起至今	76.36%	1.22%	68.11%	1.26%	8.25%	-0.04%

前海开源MSCI中国A股指数C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.10%	1.02%	12.44%	0.96%	0.66%	0.06%
过去六个月	25.00%	1.35%	22.94%	1.28%	2.06%	0.07%
过去一年	35.26%	1.35%	29.80%	1.36%	5.46%	-0.01%
自基金合同生效起至今	75.60%	1.22%	68.11%	1.26%	7.49%	-0.04%

注：本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国 A 股指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%

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

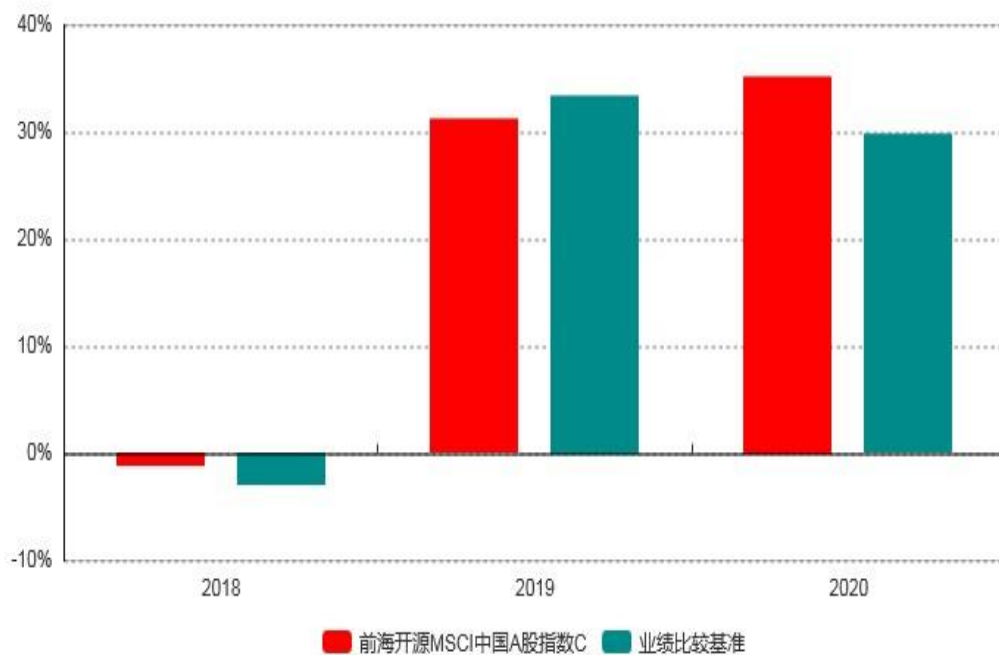
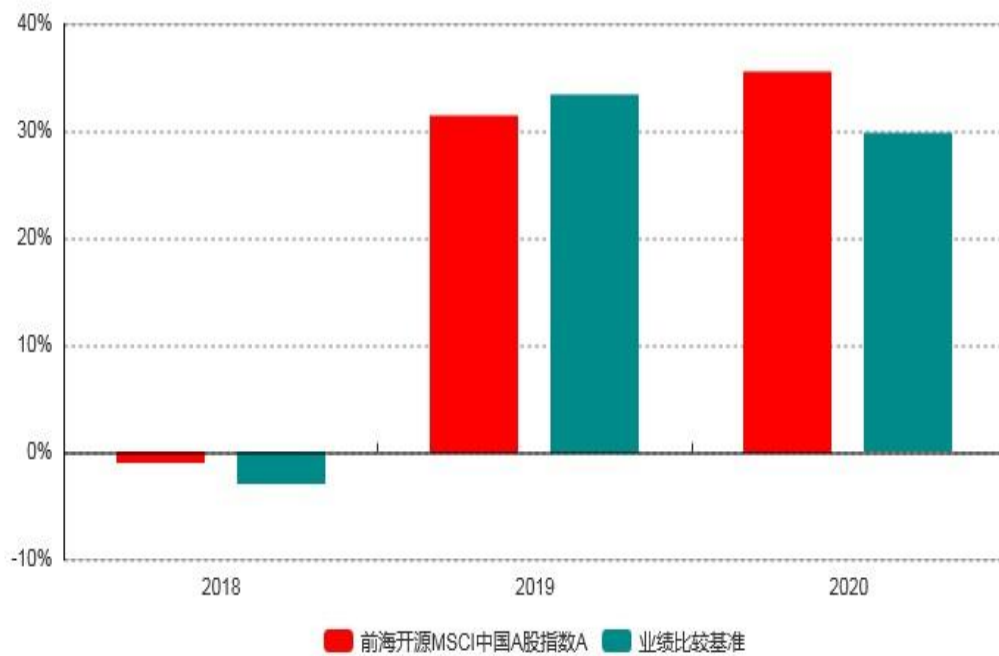
前海开源MSCI中国A股指数A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年11月27日-2020年12月31日)



前海开源MSCI中国A股指数C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年11月27日-2020年12月31日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金的基金合同于 2018 年 11 月 27 日生效，2018 年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金各类基金份额实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

前海开源MSCI中国A股指数A

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2019年	1.000	466,859.44	38,315.01	505,174.45	-
合计	1.000	466,859.44	38,315.01	505,174.45	-

前海开源MSCI中国A股指数C

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2019年	1.000	1,984,957.21	196,586.91	2,181,544.12	-
合计	1.000	1,984,957.21	196,586.91	2,181,544.12	-

§ 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91只开放式基金，资产管理规模超过897亿元。

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	说明

		任职日期	离任日期	业年限	
陶曙斌	本基金的基金经理、公司投资副总监	2018-11-27	2020-12-18	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，曾任公司投资副总监。
梁溥森	本基金的基金经理	2020-12-18	-	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》、《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 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订）的规定，针对股票市场、债券市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节，制定了《前海开源基金管理有限公司公平交易管理办法》、《前海开源基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公平交易相关

的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 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

午夜钟声响起，2020年挥手自辞去，只留下了这足以载入史册的2020庚子年。这一年人类与新冠疫情不期而遇，截止12月31日，全球累计确诊人数超过了8300万人次，累计死亡超过180万人。然而就是这样混乱的一年，却是投资者盆满钵满的一年。在这一年里，创业板指上涨了64.96%，MSCI中国A股指数上涨了超过29%，白酒指数更是暴涨了137.47%。权益型公募基金连续两年出现了涨幅破百的基金。在这种情况下，市场上又出现了两种极端的声音，乐观的声音认为放水无熊市，接着奏乐接着舞；悲观的声音则认为连续两年牛市之后，随着2021年整体金融条件的边际收紧，牛年无牛市。对我们来说，我们很难判断短期内A股是否能够继续凯歌高奏，也很难判断“没有泡沫”的白酒是否已经过度繁荣。但历史告诉我们，所有过度繁荣的市场最终均将屈服于引力定律。在市场上屡屡输钱的人，正是那些未能抵制被郁金香球茎热一类事件冲突头脑的人。对于投资者而言，真正困难的事是受到诱惑时情不自禁地将自己的资金投向短期快速致富的投机盛宴之中，并在随后的泡沫破灭中损失惨重。我们希望基金持有人能够建立适合其投资技能和经验、财务状况及风险偏好的投资方案，实现自己切合实际的长期目标，在长期投资这条适合自己的雪道上以适合自己的速度滑行，不受贪婪与恐惧的驱使，都能度过一段美妙的投资时光。投资与投机的区别通常就在于对投资回报期的定义和投资回报的可预期性。投机者买入股票或基金，期望在接下来的几天或几周内获得一笔短期

回报；投资者则期望股票或基金在未来会产生可靠的现金流回报，在几年或几十年里带来资本利得。投机很有趣却困难重重，投资很枯燥却是大多数普通投资者在长期投资中取胜最简单的法门。化用卡耐基的一句话就是：投机很有趣，但那不适合你。况且投机的波段操作很有趣，但绝不简单，操作失败的成本却异常高。谚语有云：闪电来袭的那一刻，你一定要站在那里。对于长期投资者来说，持有期间或许会有剧烈的波动，这些波动可能耐人寻味，但却如同千里之外的暴风雨和大海的落潮一样，对你来说无关紧要。

一切投资回报都不同程度地取决于未来事件。也有部分投资者希冀于通过预测未来来获取更高的投资收益，但是准确预测未来却基本上是不可能的。如查尔斯·埃利斯在《赢得输家的游戏》中所言：粗略的预测股市并不难，但是准确地预测股市却是不可能的。同样，大致预测股市的长期走势并不难，但是预计今后几个月的趋势却几乎是不可能的，也没有意义。短期投资结果难以预料，但投资中的长期规律却是有迹可循的。一般的投资理论认为随着持有期的变长，投资的不确定性变大，风险是更大的，但是对于绝大多数普通投资者来说，随着持有期的延长，尽管期间经历股灾或者黑天鹅的机会会更大，但投资者获得正收益的概率却更大了。这也正是我们希望本基金的持有人都能沉下心来，长期投资经过充分多元化的指数基金的原因之所在。专注于某些具体公司的表现，就像身临山涧，云雾缭绕，或许风景奇绝，却可能云深不知处。指数投资则能以最简单的方式，紧紧锚定投资者的核心价值。投资者只需关注最重要的投资原则和符合自身的长期投资目标，从而回归投资本质，而无须限于市场的短期波动、企业的一时成败和市场环境的朝夕变化，从而取得不俗的业绩。

2020年本基金A类份额净值累计上涨35.55%，超过业绩比较基准约为5.75%。四季度本基金跟踪的标的指数进行了年度的调整，成分股中剔除了部分经营情况恶化的个股，但总体来看剔除个股权重较低，累计占比不足1%。受此影响，本基金在指数调整生效日前后随之进行了微调。总体来说指数调整对本基金投资运作影响较小。本基金持续关注成分股的基本面变化情况，从行业中选取具有比较优势的高质量稳定增长标的进行长期配置，通过监控成分股负面信息及其影响，及时对地雷股进行出清，并通过新股申购及现金管理等较低风险的方式对基金业绩进行一定的增厚，积硅步以致千里，力争在紧密跟踪业绩比较基准并追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的同时，能够为持有人贡献一定的业绩正偏离。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源MSCI中国A股指数A基金份额净值为1.6083元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为35.55%，同期业绩比较基准收益率为29.80%；截至报告期末前海开源MSCI中国A股指数C基金份额净值为1.6012元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为35.26%，同期业绩比较基准收益率为29.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020年下半年，随着海外市场平稳，资金面相对宽松，局部行业热点事件等因素的带动下，投资者风险偏好提升，A股投资度过了一段蜜月期。随着上证指数、沪深300等关键指数近期纷纷创下阶段性新高，市场整体估值已经回升至历史中等偏上水平，但行业间的分化依然明显。

展望2021年，复苏或是全球经济的大背景。全球及中国经济随着疫苗逐步落地继续复苏，但节奏并不均衡，中国经济增长率已经率先恢复至疫情前水平，虽然疫情局部有所反复，但整体可控，宏观经济数据继续向好，出口仍然维持较高增长，物价继续修复。但中国货币政策回归常态也将意味着宽松政策将逐渐退出，投资者须关注政策退出节奏对A股造成的影响。总体来看，我们认为A股受益于中国经济率先企稳反弹、全球经济基本面渐次向好、强劲的盈利增长、有利的资金流入条件、人民币汇率升值预期等利好因素叠加的影响，中长期配置价值仍然较高。

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将遵循一贯的投资逻辑，通过紧密跟踪指数，为持有人提供与之相近的收益，并努力通过参与新股和现金流管理等多种方式获得部分超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益的角度出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 本年度，我公司采取外聘律师和内部专业人士相结合的方式，对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训，进一步提高了我公司从业人员的合规素质和职业道德修养。

(2) 本年度，我公司按照证监会的要求对公司治理、投资、研究、交易、基金会、会计、注册登记、人力资源、基金销售等主要业务进行定期稽核工作。同时，对信息技术、用户权限、通信管理与视频监控、基金直销、后台运营、内幕交易防控等相关业务开展了专项稽核工作，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性等。

(3) 通过事前合规防范、事中系统控制、事后完善纠偏的方式，全面加强了对公司产品日常投资运作的管理与监控，保证投资符合既定的投资决策程序与业务流程，基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

(4) 全面参与新产品设计、新业务拓展工作，负责日常合同审查，监督客户投诉处理。积极参与证监会新规定出台前的讨论并提出修改建议。

(5) 完成各基金及公司的各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；重视媒体监督和投资者关系管理工作。

(6) 按照规定向人民银行报送反洗钱相关报表和报告，按监管要求制定客户洗钱风险划分的标准，并升级了客户洗钱风险划分系统。

本基金管理人承诺将依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会、基金业协会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会由督察长、基金核算部、监察稽核部、金融工程部、交易部、投资研究部门负责人及其他指定相关人员组成。估值委员会成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本基金本报告期内，从2020年01月03日至2020年03月30日连续56个工作日、从2020年04月08日至2020年06月29日连续54个工作日、从2020年07月06日至2020年12月31日连续123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

托管人声明：

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第22263号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金(以下简称“前海开源MSCI中国A股指数基金”)的财务报表,包括2020年12月31日的资产负债表,2020年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表

	<p>附注。(二) 我们的意见 我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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, 公允反映了前海开源MSCI中国A股指数基金2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于前海开源MSCI中国A股指数基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>前海开源MSCI中国A股指数基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时, 基金管理人管理层负责评估前海开源MSCI中国A股指数基金的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项(如适用), 并运用持续经营假设, 除非基金管理人管理层计划清算前海开源MSCI中国A股指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督前海开源MSCI中国A股指数基金的财务</p>

	报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对前海开源MSCI中国A股指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致前海开源MSCI中国A股指数基金不能持续经营。（五）评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反</p>

	映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	陈熹 施翊洲
会计师事务所的地址	中国(上海)黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼
审计报告日期	2021-03-26

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金

报告截止日：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,081,172.86	3,684,219.75
结算备付金		-	125,633.41
存出保证金		19,965.69	50,403.62
交易性金融资产	7.4.7.2	13,533,396.48	50,439,076.84
其中：股票投资		13,532,396.48	50,439,076.84
基金投资		-	-
债券投资		1,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		206,461.58	-

应收利息	7.4.7.5	117.60	870.67
应收股利		-	-
应收申购款		82,827.22	1,265,532.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		14,923,941.43	55,565,737.05
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		48,847.82	436,436.60
应付赎回款		522,747.67	1,532,287.86
应付管理人报酬		5,826.05	24,596.10
应付托管费		1,165.21	4,919.21
应付销售服务费		992.46	1,841.63
应付交易费用	7.4.7.7	2,096.11	46,083.97
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	80,592.79	296,417.71
负债合计		662,268.11	2,342,583.08
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	8,884,358.67	44,877,546.81
未分配利润	7.4.7.10	5,377,314.65	8,345,607.16
所有者权益合计		14,261,673.32	53,223,153.97
负债和所有者权益总计		14,923,941.43	55,565,737.05

注：报告截止日2020年12月31日，前海开源MSCI中国A股指数基金份额总额8,884,358.67份，其中前海开源MSCI中国A股指数A类基金份额净值1.6083元，基金份额5,092,910.26份；前海开源MSCI中国A股指数C类基金份额净值1.6012元，基金份额3,791,448.41份。

7.2 利润表

会计主体：前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年12月31日
一、收入		10,674,733.16	9,463,408.11
1. 利息收入		12,107.27	127,991.27
其中：存款利息收入	7.4.7.11	12,107.25	49,386.19
债券利息收入		0.02	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	78,605.08
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,400,476.08	3,312,446.34
其中：股票投资收益	7.4.7.12	10,135,306.65	2,910,663.93
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.14.	-	-
收益	5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	265,169.43	401,782.41
3. 公允价值变动收益（损	7.4.7.18	-68,316.53	5,776,695.51

失以“-”号填列)			
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.19	330,466.34	246,274.99
减: 二、费用		671,150.05	1,007,069.71
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	111,334.50	194,127.45
2. 托管费	7.4.10.2.2	22,266.94	38,825.55
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	20,571.54	39,773.77
4. 交易费用	7.4.7.20	296,782.42	438,763.81
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.21	220,194.65	295,579.13
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		10,003,583.11	8,456,338.40
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		10,003,583.11	8,456,338.40

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 前海开源MSCI中国A股指数量型证券投资基金

本报告期: 2020年01月01日至2020年12月31日

单位: 人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权	44,877,546.81	8,345,607.16	53,223,153.97

益(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,003,583.11	10,003,583.11
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)	-35,993,188.14	-12,971,875.62	-48,965,063.76
其中：1. 基金申购款	91,309,065.07	20,412,125.51	111,721,190.58
2. 基金赎回款	-127,302,253.21	-33,384,001.13	-160,686,254.34
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	8,884,358.67	5,377,314.65	14,261,673.32
项 目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31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)	228,418,283.18	-2,473,760.71	225,944,522.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,456,338.40	8,456,338.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值	-183,540,736.37	5,049,748.04	-178,490,988.33

减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	199,736,795.48	31,975,133.02	231,711,928.50
2. 基金赎回款	-383,277,531.85	-26,925,384.98	-410,202,916.83
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)	-	-2,686,718.57	-2,686,718.57
五、期末所有者权益(基金净值)	44,877,546.81	8,345,607.16	53,223,153.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

王兆华

何璁

傅智

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用、而不从本类别基金资产中计提销售服

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要包括标的指数成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成份股(包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括定期存款、协议存款及其他银行存款)、货币市场工具、金融衍生品(包括权证、股指期货)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：投资于股票的资产比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，将持有不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：MSCI中国A股指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率(税后) \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司于审计报告日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于2020年12月31日，本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形，本基金

的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2020年度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2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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扣除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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额

为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

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。

7.4.4.12 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。

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	1,081,172.86	3,684,219.75
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	1,081,172.86	3,684,219.75

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	10,406,832.71	13,532,396.48	3,125,563.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,000.00	1,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	1,000.00	1,000.00
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	10,407,832.71	13,533,396.48	3,125,563.77
项目	上年度末2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	47,245,196.54	50,439,076.84	3,193,880.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	47,245,196.54	50,439,076.84	3,193,880.30

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	107.65	783.55
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	-	62.15
应收债券利息	0.02	-
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	0.03	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	9.90	24.97
合计	117.60	870.67

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,096.11	46,083.97
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,096.11	46,083.97

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	592.79	5,131.21
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	80,000.00	153,000.00
应付指数使用费	-	138,286.50
合计	80,592.79	296,417.71

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 前海开源MSCI中国A股指数A

金额单位：人民币元

项目 (前海开源MSCI中国A股指数A)	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	36,643,734.62	36,643,734.62
本期申购	10,522,991.23	10,522,991.23
本期赎回(以“-”号填列)	-42,073,815.59	-42,073,815.59
本期末	5,092,910.26	5,092,910.26

7.4.7.9.2 前海开源MSCI中国A股指数C

金额单位：人民币元

项目 (前海开源MSCI中国A股指数C)	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	8,233,812.19	8,233,812.19
本期申购	80,786,073.84	80,786,073.84
本期赎回(以“-”号填列)	-85,228,437.62	-85,228,437.62
本期末	3,791,448.41	3,791,448.41

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 前海开源MSCI中国A股指数A

单位：人民币元

项目 (前海开源MSCI中国A股指数A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,083,428.99	4,748,950.11	6,832,379.10
本期利润	5,792,334.00	-2,315,124.00	3,477,210.00
本期基金份额交易产	-4,555,427.57	-2,656,185.52	-7,211,613.09

生的变动数			
其中：基金申购款	3,054,951.40	-88,312.34	2,966,639.06
基金赎回款	-7,610,378.97	-2,567,873.18	-10,178,252.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,320,335.42	-222,359.41	3,097,976.01

7.4.7.10.2 前海开源MSCI中国A股指数C

单位：人民币元

项目 (前海开源MSCI中国A 股指数C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	446,975.58	1,066,252.48	1,513,228.06
本期利润	4,279,565.64	2,246,807.47	6,526,373.11
本期基金份额交易产 生的变动数	-2,282,608.36	-3,477,654.17	-5,760,262.53
其中：基金申购款	20,926,145.73	-3,480,659.28	17,445,486.45
基金赎回款	-23,208,754.09	3,005.11	-23,205,748.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,443,932.86	-164,594.22	2,279,338.64

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间2019年01月 01日至2019年12月31日
活期存款利息收入	10,679.32	43,537.84
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	882.87	5,089.72
其他	545.06	758.63
合计	12,107.25	49,386.19

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
卖出股票成交总额	116,016,230.66	174,320,806.65
减：卖出股票成本总额	105,880,924.01	171,410,142.72
买卖股票差价收入	10,135,306.65	2,910,663.93

7.4.7.13 基金投资收益

无。

7.4.7.14 债券投资收益**7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成**

无。

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.15 贵金属投资收益**7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年12月31日
股票投资产生的股利收益	265,169.43	401,782.41
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	265,169.43	401,782.41

7.4.7.18 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12 月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12 月31日
1. 交易性金融资产	-68,316.53	5,776,695.51
——股票投资	-68,316.53	5,776,695.51
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-

——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-68,316.53	5,776,695.51

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
基金赎回费收入	65,210.69	175,362.45
转换费收入	265,255.65	70,912.54
合计	330,466.34	246,274.99

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，其中，A类基金份额将不低于赎回费总额的25%归入基金资产，C类基金份额将赎回费收入全额归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中，A类基金份额将不低于赎回费总额的25%归入基金资产，C类基金份额将赎回费收入全额归入基金资产。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
交易所市场交易费用	296,782.42	438,763.81
银行间市场交易费用	-	-
合计	296,782.42	438,763.81

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
审计费用	30,000.00	33,000.00
信息披露费	50,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	4,256.36	4,270.94
指数使用费	135,938.29	138,308.19
合计	220,194.65	295,579.13

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	111,334.50	194,127.45
其中：支付销售机构的客户维护费	39,224.29	70,055.50

注：支付基金管理人前海开源基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	22,266.94	38,825.55

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源MSCI中国A股指数A	前海开源MSCI中国A股指数C	合计
前海开源基金	0.00	7,803.87	7,803.87
开源证券	0.00	18.65	18.65
招商银行	0.00	1,314.97	1,314.97
合计	0.00	9,137.49	9,137.49
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源MSCI中国A股指数A	前海开源MSCI中国A股指数C	合计
前海开源基金	0.00	5,377.57	5,377.57
开源证券	0.00	56.21	56.21
招商银行	0.00	2,931.87	2,931.87
合计	0.00	8,365.65	8,365.65

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给前海开源基金，再由前海开源基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：
日销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	1,081,172.86	10,679.32	3,684,219.75	43,537.84

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按适用利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于2020年12月31日，本基金持有7,089股托管人招商银行的A股普通股，成本总额为人民币272,871.63元，估值总额为人民币311,561.55元，占基金资产净值的比例为2.18%(2019年12月31日：本基金持有40,089股招商银行的A股普通股，成本总额为人民币1,428,882.39元，估值总额为人民币1,506,544.62元，占基金资产净值的比例为2.83%)。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

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

代码	名称	认购日	通日	受限类型	价格	估值单价	(单位:股)	成本总额	估值总额	
600919	江苏银行	2020-12-17	2021-01-14	配股未上市	4.59	5.46	630	2,891.70	3,439.80	-
7.4.12.1.2 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
113616	韦尔转债	2020-12-28	2021-01-22	配债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,建立了以监察及风险控制委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理团队和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会,负

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 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12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	1,000.00	-
未评级	-	-
合计	1,000.00	-

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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12月31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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金

组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。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12月31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2020年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值未超过经确认的当日净赎回金额。

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

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中

浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,081,172.86	-	-	-	1,081,172.86
存出保证金	19,965.69	-	-	-	19,965.69
交易性金融资产	-	-	1,000.00	13,532,396.48	13,533,396.48
应收证券清算款	-	-	-	206,461.58	206,461.58
应收利息	-	-	-	117.60	117.60
应收申购款	-	-	-	82,827.22	82,827.22
资产总计	1,101,138.55	-	1,000.00	13,821,802.88	14,923,941.43
负债					
应付证券清算款	-	-	-	48,847.82	48,847.82
应付赎回款	-	-	-	522,747.67	522,747.67
应付管理人报酬	-	-	-	5,826.05	5,826.05
应付托管费	-	-	-	1,165.21	1,165.21
应付销售服务费	-	-	-	992.46	992.46

应付交易费用	-	-	-	2,096.11	2,096.11
其他负债	-	-	-	80,592.79	80,592.79
负债总计	-	-	-	662,268.11	662,268.11
利率敏感度缺口	1,101,138.55	-	1,000.00	13,159,534.77	14,261,673.32
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	3,684,219.75	-	-	-	3,684,219.75
结算备付金	125,633.41	-	-	-	125,633.41
存出保证金	50,403.62	-	-	-	50,403.62
交易性金融资产	-	-	-	50,439,076.84	50,439,076.84
应收利息	-	-	-	870.67	870.67
应收申购款	99.40	-	-	1,265,433.36	1,265,532.76
资产总计	3,860,356.18	-	-	51,705,380.87	55,565,737.05
负债					
应付证券清算款	-	-	-	436,436.60	436,436.60
应付赎回款	-	-	-	1,532,287.86	1,532,287.86
应付管理人报酬	-	-	-	24,596.10	24,596.10
应付托管费	-	-	-	4,919.21	4,919.21
应付销售服务费	-	-	-	1,841.63	1,841.63
应付交易费用	-	-	-	46,083.97	46,083.97

其他负债	-	-	-	296,417.71	296,417.71
负债总计	-	-	-	2,342,583.08	2,342,583.08
利率敏感度缺口	3,860,356.18	-	-	49,362,797.79	53,223,153.97

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2020年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.01%(2019年12月31日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019年12月31日：同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31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 (%)
交易性金融资产—股票投资	13,532,396.48	94.89	50,439,076.84	94.77
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	13,532,396.48	94.89	50,439,076.84	94.77

7.4.13.4.3.2 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12月31日	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准上升5%	708,857.83	2,603,819.91
	业绩比较基准下降5%	-708,857.83	-2,603,819.91

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2020年12月31日，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中属于第一层次的余额为13,517,490.68元，属于第二层次的余额为15,905.80元，无属于第三层次的余额(2019年12月31日：第一层次48,484,624.01元，第二层次1,954,452.83元，无第三层次)。

(ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2020年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	13,532,396.48	90.68
	其中：股票	13,532,396.48	90.68
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	1,000.00	0.01
	其中：债券	1,000.00	0.01
	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	1,081,172.86	7.24
8	其他各项资产	309,372.09	2.07
9	合计	14,923,941.43	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	130,677.00	0.92
B	采矿业	186,881.39	1.31
C	制造业	8,749,529.03	61.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	130,138.60	0.91
E	建筑业	110,215.00	0.77
F	批发和零售业	242,318.20	1.70
G	交通运输、仓储和邮政业	311,635.00	2.19
H	住宿和餐饮业	25,765.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	587,001.81	4.12
J	金融业	1,968,114.53	13.80
K	房地产业	260,588.77	1.83
L	租赁和商务服务业	263,373.00	1.85
M	科学研究和技术服务业	170,764.00	1.20

N	水利、环境和公共设施管理业	6,120.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	17,565.00	0.12
Q	卫生和社会工作	266,608.15	1.87
R	文化、体育和娱乐业	101,078.00	0.71
S	综合	4,024.00	0.03
	合计	13,532,396.48	94.89

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合
无。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	500	999,000.00	7.00
2	000858	五粮液	1,400	408,590.00	2.86
3	601318	中国平安	3,800	330,524.00	2.32
4	600036	招商银行	7,089	311,561.55	2.18
5	300750	宁德时代	800	280,888.00	1.97
6	601888	中国中免	800	225,960.00	1.58
7	600276	恒瑞医药	1,716	191,265.36	1.34
8	603288	海天味业	920	184,496.80	1.29

9	300760	迈瑞医疗	400	170,400.00	1.19
10	002304	洋河股份	602	142,065.98	1.00
11	002594	比亚迪	700	136,010.00	0.95
12	000568	泸州老窖	600	135,696.00	0.95
13	000661	长春高新	300	134,673.00	0.94
14	002352	顺丰控股	1,400	123,522.00	0.87
15	002475	立讯精密	2,185	122,622.20	0.86
16	603259	药明康德	900	121,248.00	0.85
17	600809	山西汾酒	300	112,587.00	0.79
18	002415	海康威视	2,300	111,573.00	0.78
19	600309	万华化学	1,200	109,248.00	0.77
20	601012	隆基股份	1,180	108,796.00	0.76
21	600000	浦发银行	10,500	101,640.00	0.71
22	300015	爱尔眼科	1,315	98,480.35	0.69
23	300122	智飞生物	600	88,746.00	0.62
24	000596	古井贡酒	300	81,600.00	0.57
25	000001	平安银行	4,200	81,228.00	0.57
26	600436	片仔癀	300	80,253.00	0.56
27	601100	恒立液压	688	77,744.00	0.55
28	000002	万科A	2,700	77,490.00	0.54
29	600585	海螺水泥	1,400	72,268.00	0.51
30	300059	东方财富	2,260	70,060.00	0.49
31	603501	韦尔股份	300	69,330.00	0.49
32	300014	亿纬锂能	831	67,726.50	0.47
33	300450	先导智能	800	67,192.00	0.47
34	600900	长江电力	3,500	67,060.00	0.47
35	002714	牧原股份	850	65,535.00	0.46
36	300124	汇川技术	700	65,310.00	0.46
37	002142	宁波银行	1,830	64,672.20	0.45
38	300347	泰格医药	400	64,644.00	0.45
39	300413	芒果超媒	840	60,900.00	0.43

40	601799	星宇股份	300	60,150.00	0.42
41	002821	凯莱英	200	59,828.00	0.42
42	000860	顺鑫农业	800	58,032.00	0.41
43	601166	兴业银行	2,774	57,893.38	0.41
44	300782	卓胜微	100	57,054.00	0.40
45	000538	云南白药	500	56,800.00	0.40
46	002812	恩捷股份	400	56,712.00	0.40
47	603833	欧派家居	420	56,490.00	0.40
48	600763	通策医疗	200	55,304.00	0.39
49	002371	北方华创	300	54,222.00	0.38
50	002049	紫光国微	400	53,524.00	0.38
51	603605	珀莱雅	300	53,400.00	0.37
52	600887	伊利股份	1,201	53,288.37	0.37
53	300661	圣邦股份	200	52,760.00	0.37
54	300601	康泰生物	300	52,350.00	0.37
55	300529	健帆生物	770	52,221.40	0.37
56	603986	兆易创新	260	51,350.00	0.36
57	002460	赣锋锂业	500	50,600.00	0.35
58	601601	中国太保	1,300	49,920.00	0.35
59	300454	深信服	200	49,602.00	0.35
60	600570	恒生电子	472	49,512.80	0.35
61	600031	三一重工	1,400	48,972.00	0.34
62	600893	航发动力	800	47,480.00	0.33
63	000063	中兴通讯	1,400	47,110.00	0.33
64	600030	中信证券	1,600	47,040.00	0.33
65	600760	中航沈飞	600	46,908.00	0.33
66	603939	益丰药房	520	46,898.80	0.33
67	603160	汇顶科技	300	46,665.00	0.33
68	002271	东方雨虹	1,200	46,560.00	0.33
69	601336	新华保险	800	46,376.00	0.33
70	002311	海大集团	700	45,850.00	0.32

71	600999	招商证券	1,960	45,746.40	0.32
72	603899	晨光文具	500	44,280.00	0.31
73	603658	安图生物	300	43,554.00	0.31
74	600196	复星医药	800	43,192.00	0.30
75	603444	吉比特	100	42,600.00	0.30
76	601398	工商银行	8,400	41,916.00	0.29
77	300408	三环集团	1,100	40,975.00	0.29
78	603799	华友钴业	500	39,650.00	0.28
79	600745	闻泰科技	400	39,600.00	0.28
79	600486	扬农化工	300	39,600.00	0.28
81	002410	广联达	500	39,370.00	0.28
82	300676	华大基因	300	38,568.00	0.27
83	600660	福耀玻璃	800	38,440.00	0.27
84	603882	金域医学	300	38,436.00	0.27
85	002179	中航光电	490	38,362.10	0.27
86	600009	上海机场	500	37,830.00	0.27
87	000895	双汇发展	800	37,552.00	0.26
88	300033	同花顺	300	37,194.00	0.26
89	600132	重庆啤酒	300	35,697.00	0.25
90	600588	用友网络	813	35,666.31	0.25
91	600690	海尔智家	1,200	35,052.00	0.25
92	600048	保利地产	2,200	34,804.00	0.24
93	002007	华兰生物	820	34,636.80	0.24
94	002916	深南电路	320	34,579.20	0.24
95	002841	视源股份	300	34,509.00	0.24
96	600845	宝信软件	500	34,490.00	0.24
97	603369	今世缘	600	34,428.00	0.24
98	601288	农业银行	10,900	34,226.00	0.24
99	600104	上汽集团	1,400	34,216.00	0.24
100	600161	天坛生物	808	33,693.60	0.24
101	600346	恒力石化	1,200	33,564.00	0.24

102	600872	中炬高新	500	33,325.00	0.23
103	300595	欧普康视	400	32,768.00	0.23
104	002230	科大讯飞	800	32,696.00	0.23
105	603338	浙江鼎力	320	32,380.80	0.23
106	300558	贝达药业	300	32,211.00	0.23
107	601877	正泰电器	800	31,328.00	0.22
108	002032	苏泊尔	400	31,196.00	0.22
109	600438	通威股份	800	30,752.00	0.22
110	601628	中国人寿	800	30,712.00	0.22
111	002493	荣盛石化	1,100	30,371.00	0.21
112	002241	歌尔股份	800	29,856.00	0.21
113	600600	青岛啤酒	300	29,820.00	0.21
114	600703	三安光电	1,100	29,711.00	0.21
115	601066	中信建投	700	29,400.00	0.21
116	000768	中航西飞	800	29,344.00	0.21
117	300628	亿联网络	400	29,248.00	0.21
118	600426	华鲁恒升	777	28,982.10	0.20
119	300146	汤臣倍健	1,200	28,980.00	0.20
120	002600	领益智造	2,400	28,776.00	0.20
121	000963	华东医药	1,080	28,684.80	0.20
122	000725	京东方 A	4,700	28,200.00	0.20
123	000786	北新建材	700	28,035.00	0.20
124	601155	新城控股	800	27,864.00	0.20
125	601021	春秋航空	500	27,715.00	0.19
126	603589	口子窖	400	27,560.00	0.19
127	300433	蓝思科技	900	27,549.00	0.19
128	601668	中国建筑	5,500	27,335.00	0.19
129	600885	宏发股份	500	27,110.00	0.19
130	300142	沃森生物	700	26,992.00	0.19
131	002001	新和成	800	26,944.00	0.19
132	000876	新希望	1,200	26,880.00	0.19

133	300482	万孚生物	300	26,763.00	0.19
134	300699	光威复材	300	26,715.00	0.19
135	600406	国电南瑞	1,000	26,570.00	0.19
136	603883	老百姓	420	26,388.60	0.19
137	601899	紫金矿业	2,800	26,012.00	0.18
138	600547	山东黄金	1,100	25,982.00	0.18
139	600754	锦江酒店	500	25,765.00	0.18
140	300308	中际旭创	500	25,430.00	0.18
141	601328	交通银行	5,600	25,088.00	0.18
142	600038	中直股份	400	25,084.00	0.18
143	600016	民生银行	4,794	24,928.80	0.17
144	600779	水井坊	300	24,906.00	0.17
145	600536	中国软件	300	23,628.00	0.17
146	002624	完美世界	800	23,600.00	0.17
147	603233	大参林	300	23,505.00	0.16
148	002074	国轩高科	600	23,472.00	0.16
149	300496	中科创达	200	23,400.00	0.16
150	603517	绝味食品	300	23,262.00	0.16
151	600741	华域汽车	800	23,056.00	0.16
152	300357	我武生物	300	23,010.00	0.16
153	002027	分众传媒	2,300	22,701.00	0.16
154	300285	国瓷材料	500	22,555.00	0.16
155	600183	生益科技	800	22,528.00	0.16
156	600118	中国卫星	700	22,526.00	0.16
157	603659	璞泰来	200	22,478.00	0.16
158	300253	卫宁健康	1,270	22,225.00	0.16
159	601966	玲珑轮胎	629	22,121.93	0.16
160	300498	温氏股份	1,200	21,876.00	0.15
161	002555	三七互娱	700	21,861.00	0.15
162	000977	浪潮信息	808	21,719.04	0.15
163	002414	高德红外	520	21,710.00	0.15

164	603019	中科曙光	632	21,633.36	0.15
165	601688	华泰证券	1,200	21,612.00	0.15
165	601088	中国神华	1,200	21,612.00	0.15
167	002601	龙蟠佰利	700	21,539.00	0.15
168	300207	欣旺达	700	21,497.00	0.15
169	002507	涪陵榨菜	500	21,150.00	0.15
170	601818	光大银行	5,300	21,147.00	0.15
171	601211	国泰君安	1,200	21,036.00	0.15
172	600521	华海药业	620	20,962.20	0.15
173	600201	生物股份	1,000	20,890.00	0.15
174	600315	上海家化	600	20,838.00	0.15
175	600332	白云山	701	20,504.25	0.14
176	600298	安琪酵母	400	20,428.00	0.14
177	002508	老板电器	500	20,390.00	0.14
178	002156	通富微电	800	20,192.00	0.14
179	600460	士兰微	800	20,000.00	0.14
180	002050	三花智控	803	19,793.95	0.14
181	000776	广发证券	1,200	19,536.00	0.14
182	603345	安井食品	100	19,287.00	0.14
183	601766	中国中车	3,600	19,116.00	0.13
184	300003	乐普医疗	700	19,026.00	0.13
185	000338	潍柴动力	1,200	18,948.00	0.13
186	600050	中国联通	4,200	18,732.00	0.13
187	601658	邮储银行	3,900	18,642.00	0.13
188	601229	上海银行	2,340	18,345.60	0.13
189	300136	信维通信	500	17,940.00	0.13
190	600926	杭州银行	1,200	17,904.00	0.13
191	002129	中环股份	700	17,850.00	0.13
192	000513	丽珠集团	440	17,820.00	0.12
193	603866	桃李面包	300	17,730.00	0.12
194	000938	紫光股份	864	17,668.80	0.12

195	002607	中公教育	500	17,565.00	0.12
196	000625	长安汽车	800	17,504.00	0.12
197	002353	杰瑞股份	500	17,500.00	0.12
198	600019	宝钢股份	2,900	17,255.00	0.12
199	601919	中远海控	1,400	17,094.00	0.12
200	600739	辽宁成大	700	17,024.00	0.12
201	001979	招商蛇口	1,280	17,011.20	0.12
202	000100	TCL科技	2,400	16,992.00	0.12
203	601390	中国中铁	3,200	16,864.00	0.12
204	300677	英科医疗	100	16,815.00	0.12
205	600837	海通证券	1,300	16,718.00	0.12
206	601186	中国铁建	2,100	16,590.00	0.12
207	601988	中国银行	5,200	16,536.00	0.12
208	600028	中国石化	4,100	16,523.00	0.12
209	601233	桐昆股份	800	16,472.00	0.12
210	601138	工业富联	1,200	16,428.00	0.12
211	600699	均胜电子	640	16,230.40	0.11
212	002557	洽洽食品	300	16,155.00	0.11
213	601006	大秦铁路	2,500	16,150.00	0.11
214	600176	中国巨石	800	15,968.00	0.11
215	600362	江西铜业	800	15,960.00	0.11
216	002299	圣农发展	600	15,924.00	0.11
217	002236	大华股份	800	15,912.00	0.11
218	000799	酒鬼酒	100	15,650.00	0.11
219	603993	洛阳钼业	2,500	15,625.00	0.11
220	002384	东山精密	600	15,600.00	0.11
221	002153	石基信息	500	15,545.00	0.11
222	601169	北京银行	3,200	15,488.00	0.11
223	000423	东阿阿胶	400	15,484.00	0.11
224	000166	申万宏源	2,900	15,312.00	0.11
225	002603	以岭药业	600	15,300.00	0.11

226	000066	中国长城	800	15,192.00	0.11
227	603737	三棵树	100	15,150.00	0.11
228	600919	江苏银行	2,730	14,905.80	0.10
229	600383	金地集团	1,100	14,850.00	0.10
230	601788	光大证券	800	14,816.00	0.10
231	600511	国药股份	300	14,793.00	0.10
232	603858	步长制药	640	14,764.80	0.10
233	601989	中国重工	3,500	14,665.00	0.10
234	002439	启明星辰	500	14,605.00	0.10
235	300724	捷佳伟创	100	14,560.00	0.10
236	601009	南京银行	1,800	14,544.00	0.10
237	601901	方正证券	1,400	14,518.00	0.10
238	600498	烽火通信	600	14,448.00	0.10
239	002773	康弘药业	300	14,445.00	0.10
240	600801	华新水泥	700	14,441.00	0.10
241	002791	坚朗五金	100	14,400.00	0.10
242	300144	宋城演艺	800	14,176.00	0.10
243	002294	信立泰	500	14,165.00	0.10
244	002223	鱼跃医疗	500	14,105.00	0.10
245	600958	东方证券	1,200	13,956.00	0.10
246	000998	隆平高科	700	13,867.00	0.10
247	000738	航发控制	600	13,758.00	0.10
248	600372	中航电子	700	13,755.00	0.10
249	600015	华夏银行	2,200	13,750.00	0.10
249	000547	航天发展	500	13,750.00	0.10
251	000028	国药一致	300	13,740.00	0.10
252	603707	健友股份	390	13,700.70	0.10
253	002736	国信证券	1,000	13,640.00	0.10
254	002422	科伦药业	700	13,608.00	0.10
255	600066	宇通客车	800	13,536.00	0.09
256	600598	北大荒	700	13,475.00	0.09

257	002372	伟星新材	720	13,464.00	0.09
258	601607	上海医药	700	13,440.00	0.09
259	002373	千方科技	700	13,384.00	0.09
260	002180	纳思达	500	13,365.00	0.09
261	002690	美亚光电	300	13,284.00	0.09
262	002456	欧菲光	1,000	13,180.00	0.09
263	002463	沪电股份	700	13,153.00	0.09
264	600111	北方稀土	1,000	13,090.00	0.09
265	601225	陕西煤业	1,400	13,076.00	0.09
266	600109	国金证券	800	13,016.00	0.09
267	002572	索菲亚	500	12,950.00	0.09
268	002925	盈趣科技	200	12,866.00	0.09
269	601857	中国石油	3,100	12,865.00	0.09
270	600998	九州通	700	12,712.00	0.09
271	601360	三六零	800	12,568.00	0.09
272	603712	七一二	300	12,495.00	0.09
273	000999	华润三九	500	12,470.00	0.09
274	002202	金风科技	875	12,468.75	0.09
275	002024	苏宁易购	1,600	12,336.00	0.09
276	600340	华夏幸福	949	12,270.57	0.09
277	002405	四维图新	850	12,129.50	0.09
278	300316	晶盛机电	400	12,032.00	0.08
279	300383	光环新网	700	12,019.00	0.08
280	002157	正邦科技	700	11,928.00	0.08
281	000157	中联重科	1,200	11,880.00	0.08
282	600549	厦门钨业	700	11,795.00	0.08
283	000050	深天马 A	800	11,792.00	0.08
284	601231	环旭电子	600	11,604.00	0.08
285	000581	威孚高科	500	11,595.00	0.08
286	002078	太阳纸业	800	11,544.00	0.08
287	601689	拓普集团	300	11,529.00	0.08

288	601933	永辉超市	1,600	11,488.00	0.08
289	600004	白云机场	800	11,304.00	0.08
290	600886	国投电力	1,300	11,232.00	0.08
291	600487	亨通光电	800	11,192.00	0.08
292	002120	韵达股份	710	11,147.00	0.08
293	600061	国投资本	800	11,064.00	0.08
294	300212	易华录	360	11,034.00	0.08
295	300012	华测检测	400	10,948.00	0.08
296	002127	南极电商	800	10,944.00	0.08
297	600352	浙江龙盛	800	10,896.00	0.08
298	601985	中国核电	2,200	10,824.00	0.08
299	002683	宏大爆破	300	10,785.00	0.08
300	000703	恒逸石化	840	10,752.00	0.08
301	600867	通化东宝	800	10,704.00	0.08
302	601939	建设银行	1,700	10,676.00	0.07
303	601198	东兴证券	800	10,656.00	0.07
304	002568	百润股份	100	10,429.00	0.07
305	601377	兴业证券	1,200	10,416.00	0.07
306	002709	天赐材料	100	10,380.00	0.07
307	002013	中航机电	900	10,305.00	0.07
308	002030	达安基因	300	10,290.00	0.07
309	600089	特变电工	1,000	10,150.00	0.07
310	300037	新宙邦	100	10,140.00	0.07
311	601108	财通证券	800	10,120.00	0.07
312	000783	长江证券	1,200	10,080.00	0.07
313	600674	川投能源	1,000	10,050.00	0.07
314	000069	华侨城 A	1,400	9,926.00	0.07
315	000623	吉林敖东	600	9,882.00	0.07
316	002044	美年健康	860	9,743.80	0.07
317	600380	健康元	700	9,737.00	0.07
318	002385	大北农	1,000	9,660.00	0.07

319	300251	光线传媒	800	9,656.00	0.07
320	002242	九阳股份	300	9,612.00	0.07
321	000728	国元证券	1,070	9,587.20	0.07
322	601555	东吴证券	970	9,564.20	0.07
323	600029	南方航空	1,600	9,536.00	0.07
324	000021	深科技	500	9,505.00	0.07
325	002019	亿帆医药	500	9,465.00	0.07
326	300223	北京君正	100	9,149.00	0.06
327	601111	中国国航	1,200	8,988.00	0.06
328	601669	中国电建	2,300	8,924.00	0.06
329	000975	银泰黄金	1,020	8,782.20	0.06
330	601881	中国银河	700	8,757.00	0.06
331	002926	华西证券	700	8,736.00	0.06
332	600977	中国电影	700	8,722.00	0.06
333	002281	光迅科技	300	8,712.00	0.06
334	600522	中天科技	800	8,672.00	0.06
335	001914	招商积余	400	8,612.00	0.06
336	300024	机器人	700	8,610.00	0.06
336	002399	海普瑞	500	8,610.00	0.06
338	601990	南京证券	700	8,589.00	0.06
339	002152	广电运通	800	8,544.00	0.06
340	603806	福斯特	100	8,540.00	0.06
341	601838	成都银行	800	8,536.00	0.06
342	600895	张江高科	500	8,520.00	0.06
343	600967	内蒙一机	700	8,512.00	0.06
344	000401	冀东水泥	600	8,490.00	0.06
345	600115	东方航空	1,800	8,424.00	0.06
346	002212	天融信	400	8,404.00	0.06
347	002511	中顺洁柔	400	8,348.00	0.06
348	002185	华天科技	600	8,172.00	0.06
349	002673	西部证券	800	8,112.00	0.06

350	600566	济川药业	400	8,092.00	0.06
351	002563	森马服饰	800	8,016.00	0.06
352	300418	昆仑万维	400	7,980.00	0.06
353	600875	东方电气	800	7,976.00	0.06
354	002797	第一创业	800	7,960.00	0.06
355	000656	金科股份	1,100	7,799.00	0.05
356	601618	中国中冶	2,800	7,644.00	0.05
357	601098	中南传媒	800	7,624.00	0.05
358	601600	中国铝业	2,100	7,623.00	0.05
359	002465	海格通信	700	7,581.00	0.05
360	601727	上海电气	1,400	7,560.00	0.05
361	000425	徐工机械	1,400	7,518.00	0.05
362	002081	金螳螂	800	7,512.00	0.05
363	600516	方大炭素	1,052	7,437.64	0.05
364	002252	上海莱士	1,000	7,400.00	0.05
365	600010	包钢股份	6,300	7,371.00	0.05
366	000750	国海证券	1,240	7,266.40	0.05
367	600068	葛洲坝	1,100	7,238.00	0.05
368	300274	阳光电源	100	7,228.00	0.05
369	300271	华宇软件	300	7,161.00	0.05
370	002500	山西证券	800	7,160.00	0.05
371	600637	东方明珠	800	7,152.00	0.05
372	600655	豫园股份	800	7,112.00	0.05
373	000961	中南建设	800	7,064.00	0.05
374	603816	顾家家居	100	7,051.00	0.05
375	600188	兖州煤业	700	7,049.00	0.05
376	600489	中金黄金	799	7,039.19	0.05
377	600606	绿地控股	1,200	6,996.00	0.05
378	002340	格林美	1,000	6,990.00	0.05
379	000739	普洛药业	300	6,984.00	0.05
380	002558	巨人网络	400	6,972.00	0.05

381	000988	华工科技	300	6,957.00	0.05
382	601216	君正集团	1,400	6,930.00	0.05
383	603638	艾迪精密	100	6,894.00	0.05
384	000686	东北证券	700	6,874.00	0.05
385	000729	燕京啤酒	800	6,816.00	0.05
386	601872	招商轮船	1,200	6,780.00	0.05
387	002065	东华软件	800	6,640.00	0.05
388	002075	沙钢股份	600	6,582.00	0.05
389	600705	中航资本	1,500	6,570.00	0.05
390	600153	建发股份	800	6,568.00	0.05
391	601800	中国交建	900	6,534.00	0.05
392	002146	荣盛发展	1,000	6,530.00	0.05
393	000671	阳光城	1,000	6,520.00	0.05
394	600160	巨化股份	800	6,488.00	0.05
395	601117	中国化学	1,100	6,457.00	0.05
396	002939	长城证券	500	6,435.00	0.05
397	600909	华安证券	800	6,400.00	0.04
398	600018	上港集团	1,400	6,398.00	0.04
399	601878	浙商证券	400	6,120.00	0.04
399	300070	碧水源	800	6,120.00	0.04
401	600879	航天电子	800	5,984.00	0.04
402	000983	山西焦煤	1,050	5,922.00	0.04
403	600369	西南证券	1,100	5,918.00	0.04
404	601319	中国人保	900	5,913.00	0.04
405	600177	雅戈尔	800	5,752.00	0.04
406	600642	申能股份	1,100	5,742.00	0.04
407	000932	华菱钢铁	1,200	5,736.00	0.04
408	000089	深圳机场	700	5,719.00	0.04
409	002387	维信诺	500	5,700.00	0.04
410	600167	联美控股	500	5,675.00	0.04
411	601162	天风证券	900	5,490.00	0.04

412	600011	华能国际	1,200	5,376.00	0.04
413	600219	南山铝业	1,700	5,372.00	0.04
414	600026	中远海能	800	5,344.00	0.04
414	000723	美锦能源	800	5,344.00	0.04
416	601699	潞安环能	800	5,200.00	0.04
417	601128	常熟银行	700	5,166.00	0.04
418	000402	金融街	800	5,160.00	0.04
419	600170	上海建工	1,700	5,117.00	0.04
420	000027	深圳能源	840	5,115.60	0.04
421	002506	协鑫集成	1,200	5,100.00	0.04
422	601816	京沪高铁	900	5,094.00	0.04
423	002151	北斗星通	100	5,091.00	0.04
424	300296	利亚德	800	5,088.00	0.04
425	002468	申通快递	500	5,040.00	0.04
426	600529	山东药玻	100	5,015.00	0.04
427	600021	上海电力	700	4,984.00	0.03
428	600583	海油工程	1,100	4,939.00	0.03
429	601099	太平洋	1,200	4,896.00	0.03
430	000627	天茂集团	1,000	4,870.00	0.03
431	300017	网宿科技	700	4,823.00	0.03
432	600667	太极实业	500	4,725.00	0.03
433	300463	迈克生物	100	4,660.00	0.03
434	600208	新湖中宝	1,500	4,650.00	0.03
435	000630	铜陵有色	1,800	4,626.00	0.03
436	600688	上海石化	1,300	4,472.00	0.03
437	601992	金隅集团	1,500	4,455.00	0.03
438	002602	世纪华通	620	4,408.20	0.03
439	601598	中国外运	1,000	4,400.00	0.03
440	600704	物产中大	1,000	4,370.00	0.03
441	000825	太钢不锈	1,200	4,332.00	0.03
442	002705	新宝股份	100	4,225.00	0.03

443	600027	华电国际	1,200	4,080.00	0.03
444	002459	晶澳科技	100	4,072.00	0.03
445	000709	河钢股份	1,800	4,032.00	0.03
446	600673	东阳光	800	4,024.00	0.03
447	601633	长城汽车	100	3,781.00	0.03
448	002010	传化智联	800	3,768.00	0.03
449	603027	千禾味业	100	3,738.00	0.03
450	600256	广汇能源	1,300	3,679.00	0.03
451	002131	利欧股份	1,200	3,636.00	0.03
452	002958	青农商行	700	3,563.00	0.02
453	300088	长信科技	400	3,556.00	0.02
454	600079	人福医药	100	3,388.00	0.02
455	600859	王府井	100	3,258.00	0.02
456	300026	红日药业	700	3,206.00	0.02
457	300773	拉卡拉	100	2,992.00	0.02
458	000046	泛海控股	800	2,624.00	0.02
459	000629	攀钢钒钛	1,200	2,604.00	0.02
460	002216	三全食品	100	2,595.00	0.02
461	000540	中天金融	800	2,520.00	0.02
462	002625	光启技术	100	2,225.00	0.02
463	601456	国联证券	100	2,133.00	0.01
464	600848	上海临港	100	2,002.00	0.01
465	600988	赤峰黄金	100	1,791.00	0.01
466	600143	金发科技	100	1,714.00	0.01
467	000987	越秀金控	100	1,456.00	0.01
468	000800	一汽解放	100	1,168.00	0.01
469	600233	圆通速递	100	1,150.00	0.01
470	300376	易事特	100	796.00	0.01
471	002429	兆驰股份	100	620.00	0.00
472	601077	渝农商行	100	450.00	0.00
473	601916	浙商银行	100	408.00	0.00

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

无。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600519	贵州茅台	4,252,464.00	7.99
2	601318	中国平安	2,474,642.00	4.65
3	600036	招商银行	1,783,779.00	3.35
4	000858	五粮液	1,439,575.00	2.70
5	300750	宁德时代	1,282,092.00	2.41
6	000661	长春高新	1,166,754.00	2.19
7	600276	恒瑞医药	1,127,722.20	2.12
8	300146	汤臣倍健	772,057.00	1.45
9	600900	长江电力	763,318.00	1.43
10	002475	立讯精密	732,783.00	1.38
11	000002	万科A	650,567.10	1.22
12	601166	兴业银行	645,203.00	1.21
13	600000	浦发银行	643,610.00	1.21
14	600585	海螺水泥	609,459.00	1.15
15	000001	平安银行	592,858.00	1.11
16	300760	迈瑞医疗	579,919.00	1.09
17	002415	海康威视	569,380.00	1.07
18	603288	海天味业	567,855.00	1.07
19	601398	工商银行	549,765.00	1.03
20	002600	领益智造	528,623.00	0.99

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	7,080,183.04	13.30
2	601318	中国平安	4,476,875.00	8.41
3	600036	招商银行	3,087,686.56	5.80
4	000858	五粮液	2,739,491.00	5.15
5	600276	恒瑞医药	1,928,081.40	3.62
6	300750	宁德时代	1,901,273.00	3.57
7	000661	长春高新	1,743,350.00	3.28
8	000002	万科A	1,633,815.00	3.07
9	600900	长江电力	1,390,878.00	2.61
10	002475	立讯精密	1,301,285.20	2.44
11	601166	兴业银行	1,136,090.00	2.13
12	600000	浦发银行	1,120,557.70	2.11
13	002415	海康威视	1,106,176.75	2.08
14	000001	平安银行	1,099,927.00	2.07
15	600585	海螺水泥	1,091,480.00	2.05
16	000651	格力电器	1,029,751.00	1.93
17	601398	工商银行	953,707.00	1.79
18	600030	中信证券	926,644.00	1.74
19	603288	海天味业	910,532.00	1.71
20	601916	浙商银行	901,133.48	1.69

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	69,042,560.18
卖出股票收入（成交）总额	116,016,230.66

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。

8.5 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)	1,000.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,000.00	0.01

8.6 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	113616	韦尔转债	10	1,000.00	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	19,965.69
2	应收证券清算款	206,461.58
3	应收股利	-
4	应收利息	117.60

5	应收申购款	82,827.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	309,372.09

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
前海 开源M SCI中 国A股 指数A	705	7,223.99	0.00	0.00%	5,092,910.26	100.0 0%
前海	1,33	2,835.79	0.00	0.00%	3,791,448.41	100.0

开源MSCI中国A股指数C	7					0%
合计	2,042	4,350.81	0.00	0.00%	8,884,358.67	100.00%

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

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	前海开源MSCI中国A股指数A	0.00	0.0000%
	前海开源MSCI中国A股指数C	350.40	0.0092%
	合计	350.40	0.0039%

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

	前海开源MSCI中国A股指数C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	前海开源MSCI中国A股指数A	前海开源MSCI中国A股指数C
基金合同生效日(2018年11月27日)基金份额总额	14,095,545.22	214,322,737.96
本报告期期初基金份额总额	36,643,734.62	8,233,812.19
本报告期基金总申购份额	10,522,991.23	80,786,073.84
减：本报告期基金总赎回份额	42,073,815.59	85,228,437.62
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	5,092,910.26	3,791,448.41

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，基金管理人重大人事变动如下：

- 1、本基金管理人于2020年5月6日发布公告，秦亚峰先生担任前海开源基金管理有限公司固定收益投资决策委员会主席；
- 2、本基金管理人于2020年9月12日发布公告，前海开源基金管理有限公司总理由蔡颖女士变更为贾红波先生；
- 3、本基金管理人于2020年11月25日发布公告，何隽先生担任前海开源基金管理有限公司首席信息官。

上述事项经前海开源基金管理有限公司董事会审议通过，并已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时报送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告已在中国证监会规定的全国性报刊及规定互联网网站等媒介披露。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动为：自2020年8月28日起，刘波先生担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本年度应支付的审计费用为3万元。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今，本报告期内未发生改聘会计师事务所的事项。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源西部	2	38,379,792.15	20.78%	28,066.06	17.08%	-
招商证券	2	146,346,016.37	79.22%	136,289.46	82.92%	-

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

11.8 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MSCI中国A股指数型证券投资基金2019年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2020-01-20
2	关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过珠海盈米基金销售有限公司办理定投业务起点金额的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-03
3	前海开源MSCI中国A股指数型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

4	前海开源MSCI中国A股指数型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
5	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奕丰基金办理业务最低限额的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-17
6	关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过安信证券办理定投业务起点金额的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-24
7	前海开源基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金2019年年度报告的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-24
8	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
9	前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金2020年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2020-04-22
10	前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金2019年年度报告	中国证监会规定媒介	2020-04-25
11	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加万联证券费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2020-05-06
12	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
13	前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金2020年第2	中国证监会规定媒介	2020-07-21

	季度报告		
14	前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2020-08-27
15	前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金2020年中期报告	中国证监会规定媒介	2020-08-31
16	前海开源基金管理有限公司关于终止深圳信诚基金销售有限公司代理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2020-09-05
17	前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金2020年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2020-10-28
18	前海开源基金管理有限公司关于终止大泰金石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	2020-11-05
19	前海开源基金管理有限公司关于终止北京电盈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	2020-12-09
20	前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2020-12-19
21	前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金基金产品资料概要更新(20201221更新)	中国证监会规定媒介	2020-12-21
22	前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金招募说明书(20201221更新)	中国证监会规定媒介	2020-12-21
23	前海开源基金管理有限公司关于终止与部分代销机构合	中国证监会规定媒介	2020-12-31

作关系的公告		
--------	--	--

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20200320 - 20200330	0.00	36,908,822.38	36,908,822.38	0.00	0.00%
	2	20200408 - 20200607	0.00	36,908,822.38	36,908,822.38	0.00	0.00%
	3	20200618 - 20200705	0.00	36,908,822.38	36,908,822.38	0.00	0.00%
	4	20200918 - 20200921	0.00	36,908,822.38	36,908,822.38	0.00	0.00%
	5	20200331 - 20200407	0.00	37,535,911.18	37,535,911.18	0.00	0.00%
	6	20200630 - 20200708	0.00	37,535,911.18	37,535,911.18	0.00	0.00%

产品特有风险

1. 巨额赎回风险

(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；

(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续2个开放日以上(含)发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

单一投资者巨额赎回后，若本基金连续60个工作日基金份额持有人低于200人或基金资产净值低于5000万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；

3. 流动性风险

单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

(1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金设立的文件

(2) 《前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金基金合同》

(3) 《前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金托管协议》

(4) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(5) 前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 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

二〇二一年三月三十一日