
前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行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	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
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	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	18
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	55
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	55
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	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§9 开放式基金份额变动	57
§10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源沪深300指数型证券投资基金
基金简称	前海开源沪深300指数
基金主代码	000656
基金运作方式	契约型普通开放式
基金合同生效日	2014年06月17日
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	135,183,187.11份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪沪深300指数，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。
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，并根据标的指数变动而进行相应调整。本基金在严格控制基金日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重变化的原因，或因基金的申购和赎回等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进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>1、大类资产配置：本基金管理人主要按照沪深300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90%，投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的85%；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</p>

	<p>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。</p> <p>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。若出现特殊情况，本基金将采用替代性的方法构建组合，以减少跟踪误差。（2）股票投资组合的调整：本基金股票投资组合根据沪深300指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，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。在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免误差进一步扩大。</p> <p>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，主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。</p> <p>4、权证投资策略：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；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。</p> <p>5、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。运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，以达到降低投资组合的整体风险的目的。基金管理人将建立股指期货投资决策部门或小组，经董事会批准后执行。若相关法律法规发生变化时，基金管理人从其最新规定。</p>
业绩比较基准	$\text{沪深300指数收益率} \times 95\% + \text{银行活期存款利率 (税后)} \times 5\%$
风险收益特征	<p>本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金。</p>

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	中国农业银行股份有限公司
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	95599
传真	0755-83181169	010-68121816
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址	深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦2206	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	王兆华	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.qhkyfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020年01月01日- 2020年06月30日）
本期已实现收益	11,258,372.55
本期利润	12,924,295.02
加权平均基金份额本期利润	0.0949
本期加权平均净值利润率	7.22%
本期基金份额净值增长率	7.13%
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	53,989,178.96
期末可供分配基金份额利润	0.3994
期末基金资产净值	189,172,366.07
期末基金份额净值	1.399
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	92.54%

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	8.87%	0.85%	7.29%	0.85%	1.58%	0.00%
过去三个月	16.00%	0.85%	12.29%	0.85%	3.71%	0.00%
过去六个月	7.13%	1.42%	1.64%	1.45%	5.49%	-0.03%
过去一年	17.34%	1.14%	8.50%	1.16%	8.84%	-0.02%

过去三年	32.63%	1.14%	13.21%	1.19%	19.42%	-0.05%
自基金合同生效起至今	92.54%	1.41%	87.50%	1.44%	5.04%	-0.03%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(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

前海开源沪深300指数型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

前海开源基金管理有限公司（以下简称“前海开源基金”）于2012年12月27日经中国证监会批准，2013年1月23日注册成立，截至报告期末，注册资本为2亿元人民币。其中，开源证券股份有限公司、北京市中盛金期投资管理有限公司、北京长和世纪资产管理有限公司和深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)各持股权25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海设立分公司。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		
黄玥	本基金的基金经理、公司投资副总监、量化投资部负责人	2019-11-04	-	17年	黄玥先生，物理学硕士。2003年7月加入南方基金管理有限公司，曾任风控策略部高级经理，数量化投资部总监助理，负责量化平台搭建，数量化研究和投资。2015年11月加盟前海开源基金管理有限公司，任投资副总监、量化投资部负责人。

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。

③自2020年8月12日起，基金管理人增聘梁溥森为基金经理，与黄玥共同管理本基金。

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規及基金合同的规定。

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

报告期间基金运行平稳，跟踪误差控制在较小范围。本基金目前规模可以进行科创板打新，期间积极参与新股申购，力争获得无风险收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源沪深300指数基金份额净值为1.399元，本报告期内，基金份额净值增长率为7.13%，同期业绩比较基准收益率为1.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一季度受新冠疫情的影响，中国经济大幅下挫，GDP同比跌幅达到了6.8%；但中国在疫情中展示出了强大的全民组织能力和执行能力，在较短的时间内控制了疫情，经济率先恢复，二季度GDP已经实现3.2%的正增长。A股市场也随经济的恢复逐渐企稳反弹，由于全球流动性非常充裕，所以多国出现了“经济弱，股市强”的局面。A股中一些行业在上半年已经积累了较大的涨幅，以消费和TMT为代表。我们认为未来疫情的发展有较大的不确定性，全球经济龙头的美国新增感染人数仍呈失控的状态，随着复工复产的推进，多国多地出现二次疫情，所以在有效疫苗正式推出前，全球疫情很难得到有效的控制。流动性充裕带来的资产泡沫现象也值得我们警惕，多数国家股市上涨并没有基本面的支撑，而纯粹是估值的上涨。A股中部分行业的估值也已经处于历史高位，经历了2015年的暴涨暴跌后，管理层对于资产泡沫的管控应该也更具前瞻性和重视程度，所以对于部分上涨过快、涨幅过大的行业和个股，我们持谨慎的态度。

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

本报告期内实施利润分配一次，本基金每10份基金份额分配1.20元，共分配利润15,488,375.12元。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-前海开源基金管理有限公司2020年1月1日至2020年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，前海开源基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害

基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，前海开源基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：前海开源沪深300指数型证券投资基金

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	10,704,093.88	11,492,024.14
结算备付金		12,860.28	15,507.94
存出保证金		52,513.05	44,024.95
交易性金融资产	6.4.7.2	178,464,798.33	172,432,471.46
其中：股票投资		178,464,798.33	172,432,471.46
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		26,227.44	-
应收利息	6.4.7.5	1,956.73	3,095.37
应收股利		-	-

应收申购款		1,291,167.02	233,637.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		190,553,616.73	184,220,761.54
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		-	-
应付赎回款		1,045,782.14	824,866.79
应付管理人报酬		75,014.27	76,462.93
应付托管费		15,002.84	15,292.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	17,122.05	59,506.65
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	228,329.36	192,951.57
负债合计		1,381,250.66	1,169,080.53
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	135,183,187.11	128,498,394.85
未分配利润	6.4.7.10	53,989,178.96	54,553,286.16
所有者权益合计		189,172,366.07	183,051,681.01
负债和所有者权益总计		190,553,616.73	184,220,761.54

注：报告截止日2020年6月30日，前海开源沪深300指数基金份额净值1.399元，基金份额总额135,183,187.11份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源沪深300指数型证券投资基金

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	上年度可比期间2019年01月01日至2019年06月30日
一、收入		13,878,545.86	6,492,438.03
1. 利息收入		49,058.58	20,927.37
其中：存款利息收入	6.4.7.11	49,058.58	11,961.15
债券利息收入		-	8,966.22
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）		12,083,104.84	4,043,943.40
其中：股票投资收益	6.4.7.12	10,313,216.22	3,599,941.85
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.14.	-	-
收益	5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	1,769,888.62	444,001.55
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,665,922.47	2,277,139.65
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 19	80, 459. 97	150, 427. 61
减：二、费用		954, 250. 84	440, 440. 46
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	445, 652. 31	112, 798. 76
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	89, 130. 35	20, 146. 12
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-	-
4. 交易费用	6. 4. 7. 20	253, 342. 19	203, 288. 68
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6. 4. 7. 21	166, 125. 99	104, 206. 90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12, 924, 295. 02	6, 051, 997. 57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12, 924, 295. 02	6, 051, 997. 57

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源沪深300指数型证券投资基金

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）	128, 498, 394. 85	54, 553, 286. 16	183, 051, 681. 01
二、本期经营活动产生的基金净值变动	-	12, 924, 295. 02	12, 924, 295. 02

数(本期利润)			
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)	6,684,792.26	1,999,972.90	8,684,765.16
其中:1.基金申购款	51,976,341.47	15,999,280.92	67,975,622.39
2.基金赎回款	-45,291,549.21	-13,999,308.02	-59,290,857.23
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)	-	-15,488,375.12	-15,488,375.12
五、期末所有者权益(基金净值)	135,183,187.11	53,989,178.96	189,172,366.07
项 目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019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)	13,496,433.96	-190,436.61	13,305,997.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,051,997.57	6,051,997.57
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)	23,918,208.96	5,402,764.14	29,320,973.10
其中:1.基金申购款	110,575,816.60	18,680,249.80	129,256,066.40
2.基金赎回款	-86,657,607.64	-13,277,485.66	-99,935,093.30
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)	37,414,642.92	11,264,325.10	48,678,968.02

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

何璁

傅智

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

前海开源沪深300指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]494号《关于核准前海开源沪深300指数型证券投资基金募集的批复》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《前海开源沪深300指数型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币234,687,022.67元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2014]02030017号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源沪深300指数型证券投资基金基金合同》于2014年6月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为234,720,620.35份基金份额,其中认购资金利息折合33,597.68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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源沪深300指数型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以沪深300指数的成份股及其备选成份股(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票)为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。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90%,投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的85%;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,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《前海开源沪深300指数型证券投资基金基金合同》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关

问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在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	10,704,093.88
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	10,704,093.88

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	165,118,644.46	178,464,798.33	13,346,153.87
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	165,118,644.46	178,464,798.33	13,346,153.87

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	1,930.27
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	5.22
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	21.24
合计	1,956.73

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	17,122.05
银行间市场应付交易费用	-
合计	17,122.05

6.4.7.8 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	3,794.00

应付证券出借违约金	-
预提费用	184,535.36
其他应付	40,000.00
合计	228,329.36

6.4.7.9 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	128,498,394.85	128,498,394.85
本期申购	51,976,341.47	51,976,341.47
本期赎回（以“-”号填列）	-45,291,549.21	-45,291,549.21
本期末	135,183,187.11	135,183,187.11

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	266,663,578.82	-212,110,292.66	54,553,286.16
本期利润	11,258,372.55	1,665,922.47	12,924,295.02
本期基金份额交易产生的变动数	13,356,981.38	-11,357,008.48	1,999,972.90
其中：基金申购款	105,224,365.47	-89,225,084.55	15,999,280.92
基金赎回款	-91,867,384.09	77,868,076.07	-13,999,308.02
本期已分配利润	-15,488,375.12	-	-15,488,375.12
本期末	275,790,557.63	-221,801,378.67	53,989,178.96

6.4.7.11 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06月30日
活期存款利息收入	47,287.11
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	1,226.47
其他	545.00
合计	49,058.58

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	91,431,920.42
减：卖出股票成本总额	81,118,704.20
买卖股票差价收入	10,313,216.22

6.4.7.13 基金投资收益

无。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,769,888.62
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	1,769,888.62

6.4.7.18 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06月30日
1. 交易性金融资产	1,665,922.47
——股票投资	1,665,922.47

——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	1,665,922.47

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	78,187.39
转换费收入	2,272.58
合计	80,459.97

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%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，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	253,342.19
银行间市场交易费用	-
合计	253,342.19

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,590.63
指数使用费	80,000.00
合计	166,125.99

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司(“前海开源基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人
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		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
开源证券	171,580,151.79	100.00%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
开源证券	125,462.16	100.00%	17,122.05	100.00%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	445,652.31	112,798.76
其中：支付销售机构的客户维护费	54,475.06	29,125.87

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	89,130.35	20,146.12

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

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

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	10,704,093.88	47,287.11	1,202,033.92	9,786.95

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	本期利润分配合计	备注
1	2020-02-18	2020-02-18	1.200	7,697,629.44	7,790,745.68	15,488,375.12	-
合计			1.200	7,697,629.44	7,790,745.68	15,488,375.12	-

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
688169	石头科技	2020-02-13	2020-08-21	新股流通受限	271.12	365.14	897	243,194.64	327,530.58	-
688200	华峰测控	2020-02-11	2020-08-18	新股流通受限	107.41	270.02	1,092	117,291.72	294,861.84	-
688566	吉贝尔	2020-05-08	2020-11-18	新股流通受限	23.69	38.43	4,588	108,689.72	176,316.84	-
688189	南新制药	2020-03-18	2020-09-28	新股流通受限	34.94	50.21	2,484	86,790.96	124,721.64	-
688096	京源环保	2020-03-31	2020-10-09	新股流通受限	14.34	21.42	4,485	64,314.90	96,068.70	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股流通受限	16.42	16.42	5,457	89,603.94	89,603.94	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股流通受限	36.18	36.18	2,405	87,012.90	87,012.90	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新股流通受限	15.50	15.50	5,286	81,933.00	81,933.00	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新股流通受限	12.04	12.04	5,852	70,458.08	70,458.08	-
6885	秦川	2020	2020	新股	11.3	11.3	5,054	57,2	57,2	-

28	物联	-06- 19	-07- 01	流通 受限	3	3		61.8 2	61.8 2	
3008 45	捷安 高科	2020 -06- 24	2020 -07- 03	新股 流通 受限	17.6 3	17.6 3	470	8,28 6.10	8,28 6.10	-
3008 43	胜蓝 股份	2020 -06- 23	2020 -07- 02	新股 流通 受限	10.0 1	10.0 1	751	7,51 7.51	7,51 7.51	-
3008 40	酷特 智能	2020 -06- 30	2020 -07- 08	新股 流通 受限	5.94	5.94	1,185	7,03 8.90	7,03 8.90	-
3008 46	首都 在线	2020 -06- 22	2020 -07- 01	新股 流通 受限	3.37	3.37	1,131	3,81 1.47	3,81 1.47	-

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

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部、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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或其他国内大中型商业银行处，因而与银行存款相关的信用风险不重大。在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在开放期每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流

通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于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%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末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	10,704,093.88	-	-	-	10,704,093.88
结算备付金	12,860.28	-	-	-	12,860.28
存出保证金	52,513.05	-	-	-	52,513.05
交易性金融资产	-	-	-	178,464,798.33	178,464,798.33
应收证券清算款	-	-	-	26,227.44	26,227.44
应收利息	-	-	-	1,956.73	1,956.73
应收申购款	1,110.00	-	-	1,290,057.02	1,291,167.02
资产总计	10,770,577.21	-	-	179,783,039.52	190,553,616.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,045,782.14	1,045,782.14
应付管理人报酬	-	-	-	75,014.27	75,014.27
应付托管费	-	-	-	15,002.84	15,002.84
应付交易费用	-	-	-	17,122.05	17,122.05
其他负债	-	-	-	228,329.36	228,329.36
负债总计	-	-	-	1,381,250.66	1,381,250.66
利率敏感度缺口	10,770,577.21	-	-	178,401,788.86	189,172,366.07
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	11,492,024.14	-	-	-	11,492,024.14
结算备付金	15,507.94	-	-	-	15,507.94
存出保证金	44,024.95	-	-	-	44,024.95
交易性金融资产	-	-	-	172,432,471.46	172,432,471.46
应收利息	-	-	-	3,095.37	3,095.37
应收申购款	1,600.00	-	-	232,037.68	233,637.68
资产总计	11,553,157.03	-	-	172,667,604.51	184,220,761.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	824,866.79	824,866.79
应付管理人报酬	-	-	-	76,462.93	76,462.93
应付托管费	-	-	-	15,292.59	15,292.59
应付交易费用	-	-	-	59,506.65	59,506.65
其他负债	-	-	-	192,951.57	192,951.57
负债总计	-	-	-	1,169,080.53	1,169,080.53
利率敏感度缺口	11,553,157.03	-	-	171,498,523.98	183,051,681.01

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2020年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2019年12月31日：同)，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)。

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。

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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 (%)
交易性金融资产—股票投资	178,464,798.33	94.34	172,432,471.46	94.20
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	178,464,798.33	94.34	172,432,471.46	94.20
----	----------------	-------	----------------	-------

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%	9,246,018.53	8,952,176.91
	业绩比较基准下降5%	-9,246,018.53	-8,952,176.91

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	178,464,798.33	93.66
	其中：股票	178,464,798.33	93.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,716,954.16	5.62

8	其他各项资产	1,371,864.24	0.72
9	合计	190,553,616.73	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	2,385,192.00	1.26
B	采矿业	3,884,778.54	2.05
C	制造业	88,817,312.58	46.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,382,791.77	1.79
E	建筑业	3,501,042.28	1.85
F	批发和零售业	1,646,745.63	0.87
G	交通运输、仓储和邮政业	3,967,594.04	2.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,942,680.82	3.14
J	金融业	47,587,932.84	25.16
K	房地产业	5,992,080.36	3.17
L	租赁和商务服务业	2,431,105.60	1.29
M	科学研究和技术服务业	1,062,986.40	0.56
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	210,900.00	0.11
Q	卫生和社会工作	1,787,825.60	0.95
R	文化、体育和娱乐业	905,438.00	0.48
S	综合	-	-
	合计	173,506,406.46	91.72

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	3,617,282.28	1.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	179,164.89	0.09
E	建筑业	141,480.00	0.07
F	批发和零售业	133,131.60	0.07
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	399,046.78	0.21
J	金融业	67,239.92	0.04
K	房地产业	114,342.00	0.06
L	租赁和商务服务业	141,706.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	164,998.40	0.09
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	4,958,391.87	2.62

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	8,965	13,114,719.20	6.93
2	601318	中国平安	149,092	10,645,168.80	5.63
3	600276	恒瑞医药	70,428	6,500,504.40	3.44
4	600036	招商银行	149,003	5,024,381.16	2.66
5	601012	隆基股份	123,250	5,019,972.50	2.65
6	000725	京东方 A	874,903	4,085,797.01	2.16
7	002475	立讯精密	75,750	3,889,762.50	2.06
8	000858	五粮液	22,201	3,799,035.12	2.01
9	000333	美的集团	57,202	3,420,107.58	1.81
10	000651	格力电器	54,500	3,083,065.00	1.63
11	600585	海螺水泥	52,246	2,764,335.86	1.46
12	601166	兴业银行	169,397	2,673,084.66	1.41
13	600887	伊利股份	69,126	2,151,892.38	1.14
14	600030	中信证券	88,563	2,135,253.93	1.13
15	000661	长春高新	4,800	2,089,440.00	1.10
16	600900	长江电力	100,991	1,912,769.54	1.01
17	601888	中国中免	11,260	1,734,377.80	0.92
18	000002	万科 A	65,800	1,720,012.00	0.91
19	600016	民生银行	288,935	1,638,261.45	0.87
20	601328	交通银行	317,735	1,629,980.55	0.86
21	600000	浦发银行	137,550	1,455,279.00	0.77
22	000001	平安银行	111,939	1,432,819.20	0.76
23	603288	海天味业	11,280	1,403,232.00	0.74

24	601668	中国建筑	285,646	1,362,531.42	0.72
25	002714	牧原股份	15,912	1,304,784.00	0.69
26	300059	东方财富	64,260	1,298,052.00	0.69
27	601398	工商银行	250,145	1,245,722.10	0.66
28	600031	三一重工	66,225	1,242,381.00	0.66
29	002415	海康威视	39,928	1,211,814.80	0.64
30	600048	保利地产	81,335	1,202,131.30	0.64
31	600837	海通证券	91,065	1,145,597.70	0.61
32	300498	温氏股份	49,560	1,080,408.00	0.57
33	603259	药明康德	11,004	1,062,986.40	0.56
34	601601	中国太保	36,873	1,004,789.25	0.53
35	000063	中兴通讯	24,601	987,238.13	0.52
36	600570	恒生电子	8,810	948,837.00	0.50
37	601688	华泰证券	49,357	927,911.60	0.49
38	601211	国泰君安	51,424	887,578.24	0.47
39	600309	万华化学	17,673	883,473.27	0.47
40	002142	宁波银行	32,153	844,659.31	0.45
41	601169	北京银行	169,954	832,774.60	0.44
42	601988	中国银行	238,791	830,992.68	0.44
43	600009	上海机场	11,279	812,877.53	0.43
44	000100	TCL科技	124,598	772,507.60	0.41
45	300015	爱尔眼科	17,744	770,976.80	0.41
46	000568	泸州老窖	8,305	756,751.60	0.40
47	300142	沃森生物	14,300	748,748.00	0.40
48	000338	潍柴动力	54,304	745,050.88	0.39
49	600690	海尔智家	41,266	730,408.20	0.39
50	002304	洋河股份	6,900	725,466.00	0.38
51	600588	用友网络	16,449	725,400.90	0.38
52	002241	歌尔股份	24,210	710,805.60	0.38
53	000876	新希望	23,800	709,240.00	0.37
54	600999	招商证券	31,659	694,915.05	0.37

55	601229	上海银行	82,200	682,260.00	0.36
56	601818	光大银行	188,290	674,078.20	0.36
57	600104	上汽集团	39,460	670,425.40	0.35
58	002594	比亚迪	9,133	655,749.40	0.35
59	601899	紫金矿业	148,661	654,108.40	0.35
60	002027	分众传媒	116,340	648,013.80	0.34
61	601766	中国中车	114,207	636,132.99	0.34
62	002230	科大讯飞	16,532	618,792.76	0.33
63	600703	三安光电	24,645	616,125.00	0.33
64	600028	中国石化	155,032	606,175.12	0.32
65	001979	招商蛇口	36,801	605,008.44	0.32
66	600919	江苏银行	106,300	602,721.00	0.32
67	603986	兆易创新	2,520	594,493.20	0.31
68	002007	华兰生物	11,796	591,097.56	0.31
69	300347	泰格医药	5,500	560,340.00	0.30
70	000538	云南白药	5,900	553,479.00	0.29
71	600406	国电南瑞	26,916	545,049.00	0.29
72	601088	中国神华	37,551	539,232.36	0.29
73	600436	片仔癀	3,100	527,775.00	0.28
74	601628	中国人寿	19,349	526,486.29	0.28
75	000166	申万宏源	103,513	522,740.65	0.28
76	600050	中国联通	107,054	518,141.36	0.27
77	002410	广联达	7,400	515,780.00	0.27
78	002352	顺丰控股	9,400	514,180.00	0.27
79	002555	三七互娱	10,900	510,120.00	0.27
80	000895	双汇发展	11,006	507,266.54	0.27
81	601009	南京银行	68,954	505,432.82	0.27
82	300122	智飞生物	5,000	500,750.00	0.26
83	601939	建设银行	77,432	488,595.92	0.26
84	601006	大秦铁路	69,244	487,477.76	0.26
85	601390	中国中铁	96,090	482,371.80	0.25

86	601857	中国石油	111,933	468,999.27	0.25
87	600019	宝钢股份	102,675	468,198.00	0.25
88	000776	广发证券	32,804	463,192.48	0.24
89	002044	美年健康	31,680	456,508.80	0.24
90	300136	信维通信	8,600	455,972.00	0.24
91	601186	中国铁建	53,342	447,005.96	0.24
92	300003	乐普医疗	12,200	445,544.00	0.24
93	300124	汇川技术	11,501	436,922.99	0.23
94	600015	华夏银行	71,011	434,587.32	0.23
95	601989	中国重工	107,893	431,572.00	0.23
96	002311	海大集团	9,000	428,310.00	0.23
97	601336	新华保险	9,627	426,283.56	0.23
98	600547	山东黄金	11,498	421,056.76	0.22
99	002050	三花智控	18,629	407,975.10	0.22
100	600809	山西汾酒	2,800	406,000.00	0.21
101	002001	新和成	13,800	401,580.00	0.21
102	002271	东方雨虹	9,700	394,111.00	0.21
103	600196	复星医药	11,597	392,558.45	0.21
104	601933	永辉超市	41,238	386,812.44	0.20
105	600958	东方证券	40,599	385,284.51	0.20
106	002456	欧菲光	20,800	382,512.00	0.20
107	002460	赣锋锂业	7,100	380,347.00	0.20
108	002602	世纪华通	24,800	379,688.00	0.20
109	000157	中联重科	59,002	379,382.86	0.20
110	600352	浙江龙盛	29,469	376,908.51	0.20
111	002236	大华股份	19,600	376,516.00	0.20
112	002024	苏宁易购	42,401	371,856.77	0.20
113	603501	韦尔股份	1,800	363,510.00	0.19
114	601377	兴业证券	52,685	360,892.25	0.19
115	600183	生益科技	12,200	357,094.00	0.19
116	601788	光大证券	21,940	352,356.40	0.19

117	603019	中科曙光	9,156	351,590.40	0.19
118	000938	紫光股份	8,176	351,404.48	0.19
119	600741	华域汽车	16,724	347,691.96	0.18
120	300413	芒果超媒	5,320	346,864.00	0.18
121	600383	金地集团	25,057	343,280.90	0.18
122	002008	大族激光	9,300	334,335.00	0.18
123	600438	通威股份	19,200	333,696.00	0.18
124	601225	陕西煤业	46,090	332,308.90	0.18
125	601155	新城控股	10,600	331,144.00	0.18
126	600522	中天科技	28,300	324,035.00	0.17
127	600340	华夏幸福	14,079	321,845.94	0.17
128	600346	恒力石化	22,980	321,720.00	0.17
129	002624	完美世界	5,500	317,020.00	0.17
130	601901	方正证券	44,763	316,922.04	0.17
131	600660	福耀玻璃	15,164	316,472.68	0.17
132	000425	徐工机械	53,396	315,570.36	0.17
133	002202	金风科技	31,480	313,855.60	0.17
134	002736	国信证券	27,403	309,653.90	0.16
135	300408	三环集团	11,100	307,470.00	0.16
136	601877	正泰电器	11,600	305,660.00	0.16
137	600886	国投电力	38,856	305,408.16	0.16
138	300144	宋城演艺	17,640	305,172.00	0.16
139	600109	国金证券	26,554	302,981.14	0.16
140	601669	中国电建	87,547	302,912.62	0.16
141	601138	工业富联	19,900	301,485.00	0.16
142	000783	长江证券	43,707	294,585.18	0.16
143	601985	中国核电	71,750	293,457.50	0.16
144	600089	特变电工	43,073	291,604.21	0.15
145	000069	华侨城 A	47,901	290,280.06	0.15
146	601108	财通证券	28,100	288,025.00	0.15
147	600867	通化东宝	16,504	287,664.72	0.15

148	600010	包钢股份	264,204	285,340.32	0.15
149	601555	东吴证券	34,666	282,874.56	0.15
150	000768	中航飞机	15,700	278,518.00	0.15
151	002493	荣盛石化	22,500	276,750.00	0.15
152	603160	汇顶科技	1,200	267,480.00	0.14
153	603993	洛阳钼业	72,601	266,445.67	0.14
154	600606	绿地控股	42,746	264,170.28	0.14
155	000963	华东医药	10,380	262,614.00	0.14
156	600029	南方航空	49,372	255,253.24	0.13
157	300033	同花顺	1,900	252,852.00	0.13
158	600795	国电电力	136,127	251,834.95	0.13
159	603799	华友钴业	6,430	249,869.80	0.13
160	002179	中航光电	6,080	249,340.80	0.13
161	600705	中航资本	61,898	245,116.08	0.13
162	600487	亨通光电	14,900	244,509.00	0.13
163	002120	韵达股份	9,750	238,387.50	0.13
164	600177	雅戈尔	39,968	238,209.28	0.13
165	600498	烽火通信	8,200	237,062.00	0.13
166	600061	国投资本	18,453	234,906.69	0.12
167	002916	深南电路	1,400	234,528.00	0.12
168	600018	上港集团	55,739	234,103.80	0.12
169	601607	上海医药	12,629	232,121.02	0.12
170	600111	北方稀土	24,811	231,238.52	0.12
171	000625	长安汽车	20,603	226,633.00	0.12
172	601111	中国国航	34,256	226,432.16	0.12
173	603899	晨光文具	4,100	223,860.00	0.12
174	600011	华能国际	52,100	219,862.00	0.12
175	300433	蓝思科技	7,800	218,712.00	0.12
176	600115	东方航空	51,750	218,385.00	0.12
177	600176	中国巨石	23,400	214,110.00	0.11
178	601997	贵阳银行	29,860	213,797.60	0.11

179	601727	上海电气	41,873	211,039.92	0.11
180	002607	中公教育	7,600	210,900.00	0.11
181	601600	中国铝业	75,880	209,428.80	0.11
182	601618	中国中冶	83,026	208,395.26	0.11
183	600637	东方明珠	21,452	207,011.80	0.11
184	600926	杭州银行	23,200	206,944.00	0.11
185	601800	中国交建	27,984	205,402.56	0.11
186	002466	天齐锂业	8,818	202,373.10	0.11
187	002422	科伦药业	9,500	199,500.00	0.11
188	600271	航天信息	12,238	198,745.12	0.11
189	000786	北新建材	9,300	198,369.00	0.10
190	000656	金科股份	24,300	198,288.00	0.10
191	600332	白云山	6,125	198,021.25	0.10
192	000596	古井贡酒	1,300	195,312.00	0.10
193	600893	航发动力	8,249	193,686.52	0.10
194	002601	龙鳞佰利	10,400	192,400.00	0.10
195	600674	川投能源	20,306	188,236.62	0.10
196	000728	国元证券	22,359	187,815.60	0.10
197	600068	葛洲坝	31,543	187,680.85	0.10
198	000961	中南建设	20,900	186,010.00	0.10
199	601066	中信建投	4,700	185,086.00	0.10
200	601998	中信银行	35,674	183,721.10	0.10
201	600004	白云机场	11,900	181,356.00	0.10
202	600066	宇通客车	14,770	180,194.00	0.10
203	002252	上海莱士	21,080	178,336.80	0.09
204	600489	中金黄金	19,500	178,230.00	0.09
205	600118	中国卫星	5,754	177,395.82	0.09
206	601881	中国银河	14,700	168,609.00	0.09
207	601198	东兴证券	15,292	166,682.80	0.09
208	600516	方大炭素	26,475	166,263.00	0.09
209	600085	同仁堂	6,129	166,218.48	0.09

210	601018	宁波港	46,467	165,887.19	0.09
211	601838	成都银行	20,700	164,772.00	0.09
212	600219	南山铝业	81,000	164,430.00	0.09
213	002146	荣盛发展	20,200	163,620.00	0.09
214	002508	老板电器	5,200	161,772.00	0.09
215	600760	中航沈飞	4,900	160,818.00	0.09
216	002673	西部证券	19,704	160,784.64	0.08
217	600655	豫园股份	18,100	160,366.00	0.08
218	600170	上海建工	51,783	158,973.81	0.08
219	600362	江西铜业	11,740	158,020.40	0.08
220	601919	中远海控	45,538	158,016.86	0.08
221	600221	海航控股	102,146	153,219.00	0.08
222	600208	新湖中宝	50,628	150,871.44	0.08
223	603833	欧派家居	1,300	150,670.00	0.08
224	601021	春秋航空	4,250	149,770.00	0.08
225	000703	恒逸石化	16,380	149,549.40	0.08
226	601878	浙商证券	14,900	147,659.00	0.08
227	601117	中国化学	26,600	145,768.00	0.08
228	002773	康弘药业	2,920	144,832.00	0.08
229	600369	西南证券	31,417	144,204.03	0.08
230	002739	万达电影	9,200	140,484.00	0.07
231	002938	鹏鼎控股	2,800	140,168.00	0.07
232	002153	石基信息	3,500	136,605.00	0.07
233	600038	中直股份	3,325	136,557.75	0.07
234	600027	华电国际	38,600	132,012.00	0.07
235	603156	养元饮品	5,976	128,484.00	0.07
236	002032	苏泊尔	1,800	127,800.00	0.07
237	600482	中国动力	7,900	124,030.00	0.07
238	000627	天茂集团	22,800	118,788.00	0.06
239	600998	九州通	6,300	117,306.00	0.06
240	000671	阳光城	18,400	116,656.00	0.06

241	002558	巨人网络	6,700	116,580.00	0.06
242	601992	金隅集团	37,900	115,974.00	0.06
243	600297	广汇汽车	36,260	115,669.40	0.06
244	600977	中国电影	8,600	112,918.00	0.06
245	600583	海油工程	24,338	110,737.90	0.06
246	601633	长城汽车	13,602	105,007.44	0.06
247	000709	河钢股份	49,603	101,190.12	0.05
248	601216	君正集团	38,945	98,920.30	0.05
249	600848	上海临港	4,600	98,762.00	0.05
250	601238	广汽集团	10,400	93,600.00	0.05
251	601577	长沙银行	11,700	92,898.00	0.05
252	600398	海澜之家	15,100	87,882.00	0.05
253	000723	美锦能源	14,000	87,640.00	0.05
254	600188	兖州煤业	9,991	87,521.16	0.05
255	600233	圆通速递	6,000	87,360.00	0.05
256	601236	红塔证券	4,400	85,360.00	0.05
257	601808	中海油服	6,400	84,096.00	0.04
258	601360	三六零	4,400	80,564.00	0.04
259	601898	中煤能源	21,100	80,180.00	0.04
260	600025	华能水电	20,900	79,211.00	0.04
261	600989	宝丰能源	9,400	79,148.00	0.04
262	600372	中航电子	5,865	78,121.80	0.04
263	601319	中国人保	12,100	77,924.00	0.04
264	601698	中国卫通	3,900	70,239.00	0.04
265	002841	视源股份	700	69,664.00	0.04
266	600968	海油发展	23,900	55,687.00	0.03
267	002468	申通快递	3,200	52,512.00	0.03
268	601828	美凯龙	4,600	48,714.00	0.03
269	601162	天风证券	7,980	48,358.80	0.03
270	002939	长城证券	3,800	46,816.00	0.02
271	601212	白银有色	17,000	43,350.00	0.02

272	002945	华林证券	3,100	42,811.00	0.02
273	600299	安迪苏	3,200	39,104.00	0.02
274	603260	合盛硅业	1,420	38,822.80	0.02
275	600390	五矿资本	5,400	38,124.00	0.02
276	601298	青岛港	5,700	32,376.00	0.02
277	002958	青农商行	6,800	30,124.00	0.02
278	600928	西安银行	5,600	29,456.00	0.02

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	688169	石头科技	897	327,530.58	0.17
2	688200	华峰测控	1,092	294,861.84	0.16
3	688505	复旦张江	7,762	264,140.86	0.14
4	688518	联赢激光	7,902	218,332.26	0.12
5	688555	泽达易盛	2,574	200,772.00	0.11
6	600100	同方股份	25,970	189,321.30	0.10
7	000423	东阿阿胶	5,200	186,212.00	0.10
8	300017	网宿科技	21,929	186,177.21	0.10
9	688566	吉贝尔	4,588	176,316.84	0.09
10	600023	浙能电力	47,407	166,398.57	0.09
11	300070	碧水源	20,320	164,998.40	0.09
12	600535	天士力	9,988	162,005.36	0.09
13	300024	机器人	11,621	158,859.07	0.08
14	002294	信立泰	4,800	142,368.00	0.08
15	002081	金螳螂	18,000	141,480.00	0.07
16	000630	铜陵有色	72,024	139,006.32	0.07

17	600153	建发股份	16,436	133,131.60	0.07
18	603392	万泰生物	785	129,525.00	0.07
19	688189	南新制药	2,484	124,721.64	0.07
20	600663	陆家嘴	10,200	114,342.00	0.06
21	000413	东旭光电	41,402	110,543.34	0.06
22	000629	攀钢钒钛	49,700	99,897.00	0.05
23	600733	北汽蓝谷	15,200	97,736.00	0.05
24	688096	京源环保	4,485	96,068.70	0.05
25	600566	济川药业	3,600	91,656.00	0.05
26	688377	迪威尔	5,457	89,603.94	0.05
27	688027	国盾量子	2,405	87,012.90	0.05
28	688600	皖仪科技	5,286	81,933.00	0.04
29	002010	传化智联	14,600	79,424.00	0.04
30	688277	天智航	5,852	70,458.08	0.04
31	000898	鞍钢股份	28,040	68,698.00	0.04
32	600816	*ST安信	30,844	67,239.92	0.04
33	000415	渤海租赁	20,900	62,282.00	0.03
34	603087	甘李药业	602	60,380.60	0.03
35	688528	秦川物联	5,054	57,261.82	0.03
36	002411	延安必康	7,100	47,996.00	0.03
37	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
38	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
39	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
40	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
41	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
42	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
43	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	601318	中国平安	6,456,607.00	3.53
2	600519	贵州茅台	6,039,006.00	3.30
3	601012	隆基股份	3,533,986.00	1.93
4	000725	京东方 A	3,456,745.00	1.89
5	600276	恒瑞医药	3,379,608.00	1.85
6	600036	招商银行	2,819,688.00	1.54
7	600585	海螺水泥	2,098,350.00	1.15
8	002475	立讯精密	1,652,472.61	0.90
9	000651	格力电器	1,456,507.00	0.80
10	601166	兴业银行	1,369,282.00	0.75
11	000333	美的集团	1,329,662.00	0.73
12	000858	五粮液	1,177,289.00	0.64
13	600030	中信证券	878,700.00	0.48
14	600887	伊利股份	870,972.00	0.48
15	000661	长春高新	853,878.00	0.47
16	000002	万科 A	832,517.00	0.45
17	601668	中国建筑	799,600.00	0.44
18	600900	长江电力	761,561.00	0.42
19	000001	平安银行	751,922.00	0.41
20	600016	民生银行	736,181.00	0.40

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	601318	中国平安	5,204,811.00	2.84
2	600519	贵州茅台	3,225,928.00	1.76

3	600036	招商银行	2,179,773.00	1.19
4	000651	格力电器	1,775,991.00	0.97
5	600276	恒瑞医药	1,642,556.68	0.90
6	601166	兴业银行	1,558,094.00	0.85
7	000333	美的集团	1,513,043.57	0.83
8	000858	五粮液	1,425,791.00	0.78
9	600030	中信证券	1,081,364.00	0.59
10	600887	伊利股份	1,068,153.00	0.58
11	688363	华熙生物	1,050,519.20	0.57
12	000002	万科A	1,039,977.90	0.57
13	688126	沪硅产业	995,426.28	0.54
14	600900	长江电力	927,426.00	0.51
15	000001	平安银行	862,297.00	0.47
16	600016	民生银行	860,269.00	0.47
17	601328	交通银行	857,972.00	0.47
18	000725	京东方A	840,595.00	0.46
19	002475	立讯精密	818,669.00	0.45
20	002415	海康威视	785,142.63	0.43

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	85,485,108.60
卖出股票收入（成交）总额	91,431,920.42

注：买入股票成本、卖出股票收入均按照买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	52,513.05
2	应收证券清算款	26,227.44
3	应收股利	-
4	应收利息	1,956.73
5	应收申购款	1,291,167.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,371,864.24

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	688169	石头科技	327,530.58	0.17	新股流通受限
2	688200	华峰测控	294,861.84	0.16	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
5,193	26,031.81	94,470,633.30	69.88%	40,712,553.81	30.12%

8.2 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	1,310,521.09	0.97%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	50~100
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(2014年06月17日)基金份额总额	234,720,620.35
本报告期期初基金份额总额	128,498,394.85
本报告期基金总申购份额	51,976,341.47
减：本报告期基金总赎回份额	45,291,549.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	135,183,187.11

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。

§ 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、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信	1	-	-	-	-	-

建投						
东兴 证券	2	-	-	-	-	-
方正 证券	2	-	-	-	-	-
国联 证券	2	-	-	-	-	-
华泰 证券	2	-	-	-	-	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-
开源 证券	2	171,580,151.79	100.0 0%	125,462.16	100.0 0%	-
山西 证券	2	-	-	-	-	-
西藏 东方 财富 证券	2	-	-	-	-	-
中金 公司	2	-	-	-	-	-
中泰 证券	2	-	-	-	-	-
中信 证券	2	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B: 选择流程

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

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

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	前海开源沪深300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	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一路财富费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2020-01-21
3	前海开源沪深300指数型证券投资基金2020年度第一次收益分配公告	中国证监会规定媒介	2020-02-14
4	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
5	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海通证券费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-04
6	前海开源沪深300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

7	前海开源沪深300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
8	关于前海开源沪深300指数型证券投资基金调整大额申购、定期定额投资及转换转入业务限制的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-15
9	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过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
10	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
11	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
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	前海开源沪深300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
15	前海开源沪深300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
16	前海开源基金管理有限公司旗下部分基金2019年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-04-25

17	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
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前海开源沪深300指数型证券投资基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2020-06-15

§ 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	20200101 - 20200312	27,606,595.09	0.00	0.00	27,606,595.09	20.42%
	2	20200424 - 20200608	27,606,595.09	0.00	0.00	27,606,595.09	20.42%
	3	20200610 - 20200630	27,606,595.09	0.00	0.00	27,606,595.09	20.42%
产品特有风险							
<p>1. 巨额赎回风险</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>2. 转换运作方式或终止基金合同的风险</p> <p>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；</p> <p>3. 流动性风险</p> <p>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；</p> <p>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。</p>							

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沪深300指数型证券投资基金设立的文件
- (2) 《前海开源沪深300指数型证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源沪深300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) 前海开源沪深300指数型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人前海开源基金管理有限公司，客户服务电话：4001-666-998（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