
前海开源沪深 300 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:中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年3月22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	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、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
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	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
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	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
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	74
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	75
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	75

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.....	78
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	78
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.....	78
§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.....	79
11.4 基金投资策略的改变.....	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	79
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.....	79
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.....	82
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	85
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.....	85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	86
§13 备查文件目录.....	86
13.1 备查文件目录.....	86
13.2 存放地点.....	86
13.3 查阅方式.....	86

§ 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	187,623,840.49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	<p>沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。</p>
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

注：中国农业银行股份有限公司法定代表人已于2021年2月9日变更为谷澍。

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.qhkyfund.com
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2206

§ 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
本期已实现收益	40,769,335.03	9,473,481.66	167,716.41
本期利润	91,059,001.54	22,315,739.73	-1,823,009.79
加权平均基金份额本期利润	0.5888	0.3201	-0.1517
本期加权平均净值利润率	38.41%	24.28%	-13.37%
本期基金份额净值增长率	44.34%	44.52%	-20.36%
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	166,119,877.31	54,553,286.16	-190,436.61
期末可供分配基金份额利润	0.8854	0.4245	-0.0141
期末基金资产净值	353,743,717.80	183,051,681.01	13,305,997.35
期末基金份额净值	1.885	1.425	0.986
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	159.42%	79.73%	24.36%

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
过去三个月	15.36%	0.95%	12.90%	0.94%	2.46%	0.01%
过去六个月	34.74%	1.23%	23.83%	1.28%	10.91%	-0.05%

过去一年	44.34%	1.32%	25.86%	1.36%	18.48%	-0.04%
过去三年	66.15%	1.23%	28.11%	1.28%	38.04%	-0.05%
过去五年	88.53%	1.12%	38.11%	1.18%	50.42%	-0.06%
自基金合同生效起至今	159.42%	1.40%	132.19%	1.43%	27.23%	-0.03%

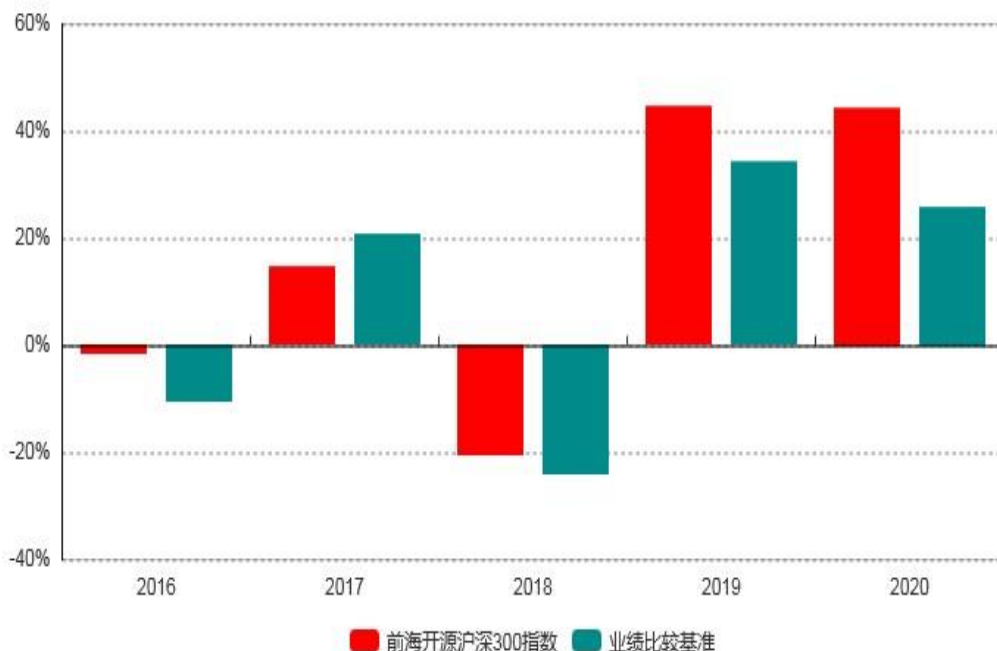
注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

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



3.2.3 过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

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
2020年	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	-

§ 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。
梁溥森	本基金的基金经理	2020-08-12	-	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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

2020年A股在全球疫情及流动性极其充裕的情况下大幅波动，最终走出了结构性牛市。本基金全年净值增长率44.34%，相对业绩比较基准取得了18.5%的超额收益，跟踪误差3%，相对控制在较低水平。本基金报告期间积极参与新股申购，力争增强组合收益。

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1.885元，本报告期内，基金份额净值增长率为44.34%，同期业绩比较基准收益率为25.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入到2021年，全球疫情在疫苗开始全面接种后进入尾声，但经济复苏的同时可能伴随货币政策的边际收紧。全球主要股市过去一年在流动性的推动下普遍经历了显著的上涨，估值普遍较高的情况下可能面临大幅波动的风险。

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

本基金本报告期内实时利润分配一次，2020年2月18日每10份基金份额分配1.20元，分配利润15,488,375.12元。

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《中华人民共和国证券投资基金法》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12月31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合规守信、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《中华人民共和国证券投资基金法》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年度报告中的财务指标、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,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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22268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	前海开源沪深300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沪深300指数型证券投资基金(以下简称“前海开源沪深300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沪深300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。
形成审计意见的基础	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沪深300指数基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
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	前海开源沪深300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沪深300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沪深300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沪深300指数基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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，就可能对前海开源沪深300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沪深300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：前海开源沪深300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	10,375,870.37	11,492,024.14
结算备付金		3,085,850.30	15,507.94
存出保证金		970,867.17	44,024.95
交易性金融资产	7.4.7.2	339,400,882.58	172,432,471.46
其中：股票投资		330,328,765.68	172,432,471.46
基金投资		-	-
债券投资		9,072,116.90	-
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		692,241.03	-
应收利息	7.4.7.5	196,440.05	3,095.37
应收股利		-	-
应收申购款		230,388.13	233,637.68
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		354,952,539.63	184,220,761.54
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		-	-
应付赎回款		734,627.18	824,866.79
应付管理人报酬		141,915.14	76,462.93
应付托管费		28,383.05	15,292.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	39,546.87	59,506.65
应交税费		1,830.67	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	262,518.92	192,951.57
负债合计		1,208,821.83	1,169,080.53
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	187,623,840.49	128,498,394.85
未分配利润	7.4.7.10	166,119,877.31	54,553,286.16
所有者权益合计		353,743,717.80	183,051,681.01
负债和所有者权益总计		354,952,539.63	184,220,761.54

注：报告截止日2020年12月31日，前海开源沪深300指数基金份额净值1.885元，基金份额总额187,623,840.49份。

7.2 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		93,308,781.10	23,616,522.25
1. 利息收入		169,548.65	78,036.58
其中：存款利息收入	7.4.7.11	100,299.76	58,697.68
债券利息收入		66,447.79	19,338.90
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,801.10	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		42,669,263.88	10,425,436.64
其中：股票投资收益	7.4.7.12	38,560,037.92	9,361,869.84
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	45,632.63	-4,250.61
资产支持证券投资 收益	7.4.7.14. 5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	54,466.02	-
股利收益	7.4.7.17	4,009,127.31	1,067,817.41
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	50,289,666.51	12,842,258.07
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	180,302.06	270,790.96
减：二、费用		2,249,779.56	1,300,782.52

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,176,749.32	485,704.99
2. 托管费	7.4.10.2.2	235,349.75	94,727.40
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	552,693.21	498,717.17
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		196.19	-
7. 其他费用	7.4.7.21	284,791.09	221,632.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		91,059,001.54	22,315,739.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		91,059,001.54	22,315,739.73

7.3 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数(本期利润)	-	91,059,001.54	91,059,001.54
三、本期基金份额	59,125,445.64	35,995,964.73	95,121,410.37

交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	142,292,172.57	74,604,740.21	216,896,912.78
2. 基金赎回款	-83,166,726.93	-38,608,775.48	-121,775,502.41
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)	187,623,840.49	166,119,877.31	353,743,717.80
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)	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)	-	22,315,739.73	22,315,739.73
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)	115,001,960.89	32,427,983.04	147,429,943.93
其中: 1. 基金申购款	272,552,676.58	70,070,496.25	342,623,172.83
2. 基金赎回款	-157,550,715.69	-37,642,513.21	-195,193,228.90

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）	128,498,394.85	54,553,286.16	183,051,681.01

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%。

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》、《前海开源沪深300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。

本财务报表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、债券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以

衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

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、债券投资和衍生工具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和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，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。

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	10,375,870.37	11,492,024.14
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	10,375,870.37	11,492,024.14

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		268,780,257.07	330,328,765.68	61,548,508.61
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	9,069,467.60	9,072,116.90	2,649.30
	银行间市场	-	-	-
	合计	9,069,467.60	9,072,116.90	2,649.30
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		277,849,724.67	339,400,882.58	61,551,157.91
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		160,752,240.06	172,432,471.46	11,680,231.40
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		160,752,240.06	172,432,471.46	11,680,231.40

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末2020年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	5,822,100.00	-	-	-
—股指期货	5,822,100.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,822,100.00	-	-	-
项目	上年度末2019年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则（试行）》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。于本年度末，本基金持有3手沪深300股指期货2103合约，合约市值为4,386,960.00元，公允价值变动为303,480.00元；本基金持有1手沪深300股指期货2106合约，合约市值为1,435,140.00元，公允价值变动为115,260.00元。

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	1,848.66	3,068.57
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	215.43	7.00
应收债券利息	194,360.36	-
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	15.60	19.80
合计	196,440.05	3,095.37

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	39,546.87	59,506.65
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	39,546.87	59,506.65

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	2,518.92	2,951.57
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	220,000.00	150,000.00
应付指数使用费	40,000.00	40,000.00
合计	262,518.92	192,951.57

7.4.7.9 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12月31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	142,292,172.57	142,292,172.57
本期赎回（以“-”号填列）	-83,166,726.93	-83,166,726.93
本期末	187,623,840.49	187,623,840.49

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	40,769,335.03	50,289,666.51	91,059,001.54
本期基金份额交易产生的变动数	124,492,348.90	-88,496,384.17	35,995,964.73
其中：基金申购款	297,064,149.03	-222,459,408.82	74,604,740.21
基金赎回款	-172,571,800.13	133,963,024.65	-38,608,775.48
本期已分配利润	-15,488,375.12	-	-15,488,375.12
本期末	416,436,887.63	-250,317,010.32	166,119,877.31

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	93,932.83	48,580.00
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	5,035.29	3,290.99
其他	1,331.64	6,826.69
合计	100,299.76	58,697.68

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	170,676,215.25	137,650,247.59
减：卖出股票成本总额	132,116,177.33	128,288,377.75
买卖股票差价收入	38,560,037.92	9,361,869.84

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

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
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	45,632.63	-4,250.61
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-

债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	45,632.63	-4,250.61

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	185,149.40	2,203,170.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	139,500.00	2,143,250.61
减：应收利息总额	16.77	64,170.00
买卖债券差价收入	45,632.63	-4,250.61

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间收益金额 2019年01月01日至2019年 12月31日
期货投资	54,466.02	-

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	4,009,127.31	1,067,817.41
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	4,009,127.31	1,067,817.41

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	49,870,926.51	12,842,258.07

——股票投资	49,868,277.21	12,842,258.07
——债券投资	2,649.30	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	418,740.00	-
——权证投资	-	-
——期货投资	418,740.00	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	50,289,666.51	12,842,258.07

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	163,365.12	174,503.25
其他	69.19	-
基金转换费收入	16,867.75	96,287.71
合计	180,302.06	270,790.96

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。

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	552,279.35	498,717.17
银行间市场交易费用	-	-
期货市场交易费用	413.86	-
合计	552,693.21	498,717.17

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	50,000.00	50,000.00
信息披露费	70,000.00	-
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	4,791.09	3,632.96
指数使用费	160,000.00	160,000.00
律师费	-	8,000.00
合计	284,791.09	221,632.96

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
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

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

金额单位：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	
	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	383,475,320.38	98.00%	75,663,907.31	18.58%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例
开源证券	9,012,617.00	100.00%	-	-

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2020年01月01日至2020年12月31日		2019年01月01日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
开源证券	4,000,000.00	100.00%	-	-

7.4.10.1.5 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12月31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	280,421.43	98.00%	33,837.76	85.56%
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	55,325.98	18.58%	55,325.98	92.97%

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。

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2020年01月01日至2020年12月31日	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	1,176,749.32	485,704.99
其中：支付销售机构的客户维护费	138,846.84	98,351.72

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	235,349.75	94,727.40

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

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	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2020年01月01日至2020年12月31日		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
中国农业 银行	10,375,870.37	93,932.83	11,492,024.14	48,580.00

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。

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

无。

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

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	7,697,62 9.44	7,790,74 5.68	15,488,37 5.12	-
合计			1.200	7,697,62 9.44	7,790,74 5.68	15,488,37 5.12	-

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 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
6019 95	中金 公司	2020 -10-	2021 -05-	新股 流通	28.7 8	68.7 1	24,951	718, 089.	1,71 4,38	-

		22	06	受限				78	3.21	
600919	江苏银行	2020-12-17	2021-01-14	配股未上市	4.59	5.46	47,370	217,428.30	258,640.20	-
688356	键凯科技	2020-08-17	2021-02-26	科创板打新限售	41.18	105.06	2,433	100,190.94	255,610.98	-
688788	科思科技	2020-10-13	2021-04-22	科创板打新限售	106.04	109.59	1,741	184,615.64	190,796.19	-
688136	科兴制药	2020-12-03	2021-06-15	科创板打新限售	22.33	34.59	4,337	96,845.21	150,016.83	-
300862	蓝盾光电	2020-08-07	2021-03-04	创业板打新限售	33.95	38.54	3,617	122,797.15	139,399.18	-
688579	山大地纬	2020-07-08	2021-01-18	科创板打新限售	8.12	14.38	8,976	72,885.12	129,074.88	-
688313	仕佳光子	2020-08-04	2021-02-18	科创板打新限售	10.82	22.92	5,312	57,475.84	121,751.04	-
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-01-07	新股未上市	74.46	74.46	1,405	104,616.30	104,616.30	-
300869	康泰医学	2020-08-12	2021-02-24	创业板打新限售	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	-

				售						
688550	瑞联新材	2020-08-24	2021-03-02	科创板打新限售	113.72	84.08	1,118	127,138.96	94,001.44	-
688338	赛科希德	2020-07-27	2021-02-08	科创板打新限售	50.35	54.59	1,310	65,958.50	71,512.90	-
300896	爱美客	2020-09-21	2021-03-29	创业板打新限售	118.27	603.36	114	13,482.78	68,783.04	-
688590	新致软件	2020-11-27	2021-06-07	科创板打新限售	10.73	15.79	4,171	44,754.83	65,860.09	-
688577	浙海德曼	2020-09-08	2021-03-16	科创板打新限售	33.13	42.01	1,503	49,794.39	63,141.03	-
688308	欧科亿	2020-12-03	2021-06-10	科创板打新限售	23.99	23.41	2,457	58,943.43	57,518.37	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	10.76	10.76	3,584	38,563.84	38,563.84	-
300870	欧陆通	2020-08-13	2021-02-24	创业板打新限售	36.81	65.67	478	17,595.18	31,390.26	-
300900	广联航空	2020-10-	2021-04-	创业板打	17.87	33.16	879	15,707.7	29,147.6	-

		19	29	新限售				3	4	
300927	江天化学	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	13.39	13.39	2,163	28,962.57	28,962.57	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-06-23	创业板打新限售	24.60	61.51	412	10,135.20	25,342.12	-
300877	金春股份	2020-08-17	2021-03-03	创业板打新限售	30.54	50.85	461	14,078.94	23,441.85	-
300894	火星人	2020-12-24	2021-07-01	创业板打新限售	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-
300872	天阳科技	2020-08-14	2021-02-25	创业板打新限售	21.34	37.84	561	11,971.74	21,228.24	-
300871	回盛生物	2020-08-13	2021-02-24	创业板打新限售	33.61	38.70	494	16,603.34	19,117.80	-
300891	惠云钛业	2020-09-10	2021-03-17	创业板打新限售	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300878	维康药业	2020-08-17	2021-03-03	创业板打新限售	41.34	48.72	344	14,220.96	16,759.68	-
3008	狄耐	2020	2021	创业	24.8	33.5	499	12,4	16,7	-

84	克	-11-05	-05-12	板打 新限售	7	1		10.1 3	21.4 9	
3008 98	熊猫 乳品	2020 -10-09	2021 -04-16	创业 板打 新限售	10.7 8	33.0 3	496	5,34 6.88	16,3 82.8 8	-
3009 08	仲景 食品	2020 -11-13	2021 -05-24	创业 板打 新限售	39.7 4	60.4 4	271	10,7 69.5 4	16,3 79.2 4	-
3008 92	品渥 食品	2020 -09-11	2021 -03-30	创业 板打 新限售	26.6 6	60.0 1	272	7,25 1.52	16,3 22.7 2	-
3009 09	汇创 达	2020 -11-11	2021 -05-18	创业 板打 新限售	29.5 7	40.6 7	386	11,4 14.0 2	15,6 98.6 2	-
3008 87	谱尼 测试	2020 -09-09	2021 -03-16	创业 板打 新限售	44.4 7	74.5 2	210	9,33 8.70	15,6 49.2 0	-
3008 73	海晨 股份	2020 -08-14	2021 -03-02	创业 板打 新限售	30.7 2	41.3 2	356	10,9 36.3 2	14,7 09.9 2	-
3008 68	杰美 特	2020 -08-12	2021 -02-24	创业 板打 新限售	41.2 6	43.2 8	318	13,1 20.6 8	13,7 63.0 4	-
3008 89	爱克 股份	2020 -09-09	2021 -03-16	创业 板打 新限售	27.9 7	30.1 2	440	12,3 06.8 0	13,2 52.8 0	-

				售						
3009 25	法本 信息	2020 -12- 21	2021 -06- 30	创业 板打 新限 售	20.0 8	37.3 3	353	7,08 8.24	13,1 77.4 9	-
3008 95	铜牛 信息	2020 -09- 17	2021 -03- 24	创业 板打 新限 售	12.6 5	45.3 0	283	3,57 9.95	12,8 19.9 0	-
3008 76	蒙泰 高新	2020 -08- 14	2021 -02- 25	创业 板打 新限 售	20.0 9	36.6 2	350	7,03 1.50	12,8 17.0 0	-
3009 07	康平 科技	2020 -11- 11	2021 -05- 18	创业 板打 新限 售	14.3 0	26.8 5	473	6,76 3.90	12,7 00.0 5	-
3008 79	大叶 股份	2020 -08- 25	2021 -03- 01	创业 板打 新限 售	10.5 8	27.1 2	466	4,93 0.28	12,6 37.9 2	-
3008 82	万胜 智能	2020 -08- 27	2021 -03- 10	创业 板打 新限 售	10.3 3	25.7 9	440	4,54 5.20	11,3 47.6 0	-
3009 11	亿田 智能	2020 -11- 24	2021 -06- 03	创业 板打 新限 售	24.3 5	33.0 6	309	7,52 4.15	10,2 15.5 4	-
3008 93	松原 股份	2020 -09- 17	2021 -03- 24	创业 板打 新限 售	13.4 7	35.0 8	276	3,71 7.72	9,68 2.08	-
3008	盛德	2020	2021	创业	14.1	32.3	291	4,12	9,40	-

81	鑫泰	-08-25	-03-05	板打 新限售	7	1		3.47	2.21	
3009 22	天秦 装备	2020 -12- 18	2021 -06- 25	创业 板打 新限售	16.0 5	31.5 8	287	4,60 6.35	9,06 3.46	-
3009 17	特发 服务	2020 -12- 14	2021 -06- 21	创业 板打 新限售	18.7 8	31.9 4	281	5,27 7.18	8,97 5.14	-
6052 77	新亚 电子	2020 -12- 25	2021 -01- 06	新股 未上 市	16.9 5	16.9 5	507	8,59 3.65	8,59 3.65	-
3008 86	华业 香料	2020 -09- 08	2021 -03- 16	创业 板打 新限售	18.5 9	45.6 7	147	2,73 2.73	6,71 3.49	-
0030 31	中瓷 电子	2020 -12- 24	2021 -01- 04	新股 未上 市	15.2 7	15.2 7	387	5,90 9.49	5,90 9.49	-
3009 26	博俊 科技	2020 -12- 29	2021 -07- 07	新股 未上 市	10.7 6	10.7 6	359	3,86 2.84	3,86 2.84	-
3009 27	江天 化学	2020 -12- 29	2021 -07- 07	新股 未上 市	13.3 9	13.3 9	217	2,90 5.63	2,90 5.63	-
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
1130 44	大秦 转债	2020 -12-	2021 -01-	配债 未上	100. 00	100. 00	2,220	222, 000.	222, 000.	-

		14	15	市				00	00	
1136 16	韦尔 转债	2020 -12- 28	2021 -01- 22	配债 未上 市	100. 00	100. 00	200	20,0 00.0 0	20,0 00.0 0	-

注：①根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

②根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

③基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	8,830,116.90	-
合计	8,830,116.90	-

注：未评级债券为国债、央票及政策性金融债等。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

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	222,000.00	-
AAA以下	20,000.00	-
未评级	-	-
合计	242,000.00	-

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同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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

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	10,375,870.37	-	-	-	10,375,870.37
结算备付金	3,085,850.30	-	-	-	3,085,850.30
存出保证金	34,741.17	-	-	936,126.00	970,867.17
交易性金融资产	8,830,116.90	-	242,000.00	330,328,765.68	339,400,882.58
应收证券清算款	-	-	-	692,241.03	692,241.03
应收利息	-	-	-	196,440.05	196,440.05
应收申购款	-	-	-	230,388.13	230,388.13
资产总计	22,326,578.74	0.00	242,000.00	332,383,960.89	354,952,539.63

负债					
应付证券清算款	-	-	-	418,740.00	418,740.00
应付赎回款	-	-	-	734,627.18	734,627.18
应付管理人报酬	-	-	-	141,915.14	141,915.14
应付托管费	-	-	-	28,383.05	28,383.05
应付交易费用	-	-	-	39,546.87	39,546.87
应交税费	-	-	-	1,830.67	1,830.67
其他负债	-	-	-	262,518.92	262,518.92
负债总计	-	-	-	1,627,561.83	1,627,561.83
利率敏感度缺口	22,326,578.74	0.00	242,000.00	330,756,399.06	353,324,977.80
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	0.00	0.00	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	0.00	0.00	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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	市场利率增加0.25%	-679.04	0.00
	市场利率减少0.25%	679.14	0.00

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	330,328,765.68	93.38	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	330,328,765.68	93.38	172,432,471.46	94.20

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

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%	17,690,161.58	8,952,176.91
	业绩比较基准下降5%	-17,690,161.58	-8,952,176.91

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326,447,870.35元，属于第二层次的余额为12,953,012.23元，无属于第三层次的余额(2019年12月31日：第一层次170,560,620.62元，第二层次1,871,850.84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	330,328,765.68	93.06
	其中：股票	330,328,765.68	93.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,072,116.90	2.56
	其中：债券	9,072,116.90	2.56
	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	13,461,720.67	3.79
8	其他各项资产	2,089,936.38	0.59
9	合计	354,952,539.63	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	3,897,615.00	1.10
B	采矿业	7,408,486.90	2.09
C	制造业	171,993,420.50	48.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,168,495.15	1.46
E	建筑业	4,948,703.84	1.40

F	批发和零售业	2,376,842.75	0.67
G	交通运输、仓储和邮政业	8,524,808.65	2.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,397,805.91	2.66
J	金融业	86,880,310.22	24.56
K	房地产业	9,606,055.35	2.72
L	租赁和商务服务业	6,546,619.80	1.85
M	科学研究和技术服务业	2,437,122.88	0.69
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	411,021.00	0.12
Q	卫生和社会工作	5,062,221.56	1.43
R	文化、体育和娱乐业	1,611,274.80	0.46
S	综合	-	-
	合计	326,270,804.31	92.23

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

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	2,010,669.76	0.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	19,072.88	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	14,709.92	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术	266,685.42	0.08

	术服务业		
J	金融业	1,721,308.05	0.49
K	房地产业	9,866.14	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15,649.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,057,961.37	1.15

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	8,465	16,913,070.00	4.78
2	601318	中国平安	181,992	15,829,664.16	4.47
3	000858	五粮液	32,101	9,368,676.85	2.65
4	600036	招商银行	200,703	8,820,896.85	2.49
5	000333	美的集团	82,602	8,131,340.88	2.30
6	600276	恒瑞医药	61,777	6,885,664.42	1.95

7	000651	格力电器	83,800	5,190,572.00	1.47
8	601166	兴业银行	240,597	5,021,259.39	1.42
9	601888	中国中免	16,960	4,790,352.00	1.35
10	600887	伊利股份	105,326	4,673,314.62	1.32
11	600030	中信证券	147,463	4,335,412.20	1.23
12	002475	立讯精密	73,450	4,122,014.00	1.17
13	601012	隆基股份	42,050	3,877,010.00	1.10
14	300059	东方财富	119,260	3,697,060.00	1.05
15	600031	三一重工	103,525	3,621,304.50	1.02
16	000002	万科A	117,300	3,366,510.00	0.95
17	000001	平安银行	168,139	3,251,808.26	0.92
18	603288	海天味业	16,080	3,224,683.20	0.91
19	002415	海康威视	65,528	3,178,763.28	0.90
20	002594	比亚迪	16,033	3,115,211.90	0.88
21	601398	工商银行	606,745	3,027,657.55	0.86
22	000568	泸州老窖	12,905	2,918,594.80	0.83
23	600900	长江电力	152,291	2,917,895.56	0.82
24	000725	京东方A	477,403	2,864,418.00	0.81
25	002352	顺丰控股	30,300	2,673,369.00	0.76
26	002304	洋河股份	10,600	2,501,494.00	0.71
27	600309	万华化学	27,355	2,490,399.20	0.70
28	002714	牧原股份	31,812	2,452,705.20	0.69
29	603259	药明康德	17,804	2,398,554.88	0.68
30	601899	紫金矿业	243,461	2,261,752.69	0.64
31	601601	中国太保	57,473	2,206,963.20	0.62
32	000661	长春高新	4,900	2,199,659.00	0.62
33	601328	交通银行	475,535	2,130,396.80	0.60
34	600585	海螺水泥	41,146	2,123,956.52	0.60
35	300015	爱尔眼科	27,344	2,047,792.16	0.58
36	600048	保利地产	124,835	1,974,889.70	0.56
37	601818	光大银行	489,490	1,953,065.10	0.55

38	600000	浦发银行	201,450	1,950,036.00	0.55
39	600690	海尔智家	65,566	1,915,182.86	0.54
40	600016	民生银行	364,835	1,897,142.00	0.54
41	002142	宁波银行	52,053	1,839,553.02	0.52
42	601688	华泰证券	101,557	1,829,041.57	0.52
43	601668	中国建筑	365,446	1,816,266.62	0.51
44	002027	分众传媒	177,940	1,756,267.80	0.50
45	300124	汇川技术	18,801	1,754,133.30	0.50
46	600809	山西汾酒	4,600	1,726,334.00	0.49
47	600837	海通证券	134,065	1,724,075.90	0.49
48	600438	通威股份	44,400	1,706,736.00	0.48
49	300122	智飞生物	11,500	1,700,965.00	0.48
50	000100	TCL科技	234,998	1,663,785.84	0.47
51	603501	韦尔股份	7,100	1,640,810.00	0.46
52	000063	中兴通讯	47,101	1,584,948.65	0.45
53	600570	恒生电子	14,410	1,511,609.00	0.43
54	600999	招商证券	64,457	1,504,426.38	0.43
55	002241	歌尔股份	39,410	1,470,781.20	0.42
56	600104	上汽集团	60,060	1,467,866.40	0.41
57	300347	泰格医药	9,000	1,454,490.00	0.41
58	300498	温氏股份	79,260	1,444,909.80	0.41
59	600436	片仔癀	5,300	1,417,803.00	0.40
60	002460	赣锋锂业	13,700	1,386,440.00	0.39
61	601211	国泰君安	78,124	1,369,513.72	0.39
62	300014	亿纬锂能	16,800	1,369,200.00	0.39
63	601229	上海银行	170,800	1,339,072.00	0.38
64	000338	潍柴动力	83,004	1,310,633.16	0.37
65	600926	杭州银行	87,300	1,302,516.00	0.37
66	600009	上海机场	16,879	1,277,065.14	0.36
67	601169	北京银行	256,254	1,240,269.36	0.35
68	600588	用友网络	27,649	1,212,961.63	0.34

69	002410	广联达	15,400	1,212,596.00	0.34
70	603986	兆易创新	5,920	1,169,200.00	0.33
71	600660	福耀玻璃	24,064	1,156,275.20	0.33
72	601988	中国银行	359,491	1,143,181.38	0.32
73	601628	中国人寿	29,549	1,134,386.11	0.32
74	601766	中国中车	212,207	1,126,819.17	0.32
75	600196	复星医药	20,797	1,122,830.03	0.32
76	600919	江苏银行	205,270	1,120,774.20	0.32
77	600893	航发动力	18,549	1,100,883.15	0.31
78	002271	东方雨虹	28,300	1,098,040.00	0.31
79	600406	国电南瑞	40,816	1,084,481.12	0.31
80	002230	科大讯飞	26,032	1,063,927.84	0.30
81	600703	三安光电	38,345	1,035,698.45	0.29
82	300142	沃森生物	26,600	1,025,696.00	0.29
83	600763	通策医疗	3,700	1,023,124.00	0.29
84	600346	恒力石化	36,480	1,020,345.60	0.29
85	601919	中远海控	83,238	1,016,335.98	0.29
86	601088	中国神华	56,351	1,014,881.51	0.29
87	300601	康泰生物	5,800	1,012,100.00	0.29
88	000538	云南白药	8,900	1,011,040.00	0.29
89	002812	恩捷股份	7,000	992,460.00	0.28
90	002493	荣盛石化	35,400	977,394.00	0.28
91	002049	紫光国微	7,100	950,051.00	0.27
92	603799	华友钴业	11,730	930,189.00	0.26
93	600019	宝钢股份	155,175	923,291.25	0.26
94	600028	中国石化	228,432	920,580.96	0.26
95	000157	中联重科	92,402	914,779.80	0.26
96	000876	新希望	40,440	905,856.00	0.26
97	000625	长安汽车	40,603	888,393.64	0.25
98	002311	海大集团	13,400	877,700.00	0.25
99	300413	芒果超媒	12,020	871,450.00	0.25

100	000768	中航西飞	23,600	865,648.00	0.24
101	601009	南京银行	102,954	831,868.32	0.24
102	002129	中环股份	32,600	831,300.00	0.24
103	601336	新华保险	14,227	824,739.19	0.23
104	000776	广发证券	50,604	823,833.12	0.23
105	000166	申万宏源	155,513	821,108.64	0.23
106	601100	恒立液压	7,244	818,572.00	0.23
107	000895	双汇发展	17,306	812,343.64	0.23
108	002007	华兰生物	18,696	789,719.04	0.22
109	600584	长电科技	18,500	787,545.00	0.22
110	601633	长城汽车	20,702	782,742.62	0.22
111	600741	华域汽车	27,124	781,713.68	0.22
112	603993	洛阳钼业	122,101	763,131.25	0.22
113	002371	北方华创	4,200	759,108.00	0.21
114	002050	三花智控	30,229	745,144.85	0.21
115	600547	山东黄金	31,537	744,903.94	0.21
116	601939	建设银行	118,532	744,380.96	0.21
117	601390	中国中铁	139,890	737,220.30	0.21
118	601901	方正证券	70,663	732,775.31	0.21
119	002001	新和成	21,600	727,488.00	0.21
120	002179	中航光电	9,280	726,531.20	0.21
121	001979	招商蛇口	54,501	724,318.29	0.20
122	600958	东方证券	62,099	722,211.37	0.20
123	600050	中国联通	160,454	715,624.84	0.20
124	601877	正泰电器	18,000	704,880.00	0.20
125	601377	兴业证券	80,985	702,949.80	0.20
126	300433	蓝思科技	22,700	694,847.00	0.20
127	600176	中国巨石	34,800	694,608.00	0.20
128	600109	国金证券	42,054	684,218.58	0.19
129	000860	顺鑫农业	9,400	681,876.00	0.19
130	300408	三环集团	18,300	681,675.00	0.19

131	601857	中国石油	163, 133	677, 001. 95	0. 19
132	002555	三七互娱	21, 600	674, 568. 00	0. 19
133	002736	国信证券	48, 903	667, 036. 92	0. 19
134	601006	大秦铁路	103, 144	666, 310. 24	0. 19
135	600015	华夏银行	106, 311	664, 443. 75	0. 19
136	002202	金风科技	46, 080	656, 640. 00	0. 19
137	601989	中国重工	155, 993	653, 610. 67	0. 18
138	002008	大族激光	14, 900	636, 975. 00	0. 18
139	601225	陕西煤业	67, 990	635, 026. 60	0. 18
140	601788	光大证券	33, 840	626, 716. 80	0. 18
141	600745	闻泰科技	6, 300	623, 700. 00	0. 18
142	688008	澜起科技	7, 500	621, 600. 00	0. 18
143	002236	大华股份	30, 900	614, 601. 00	0. 17
144	600872	中炬高新	9, 200	613, 180. 00	0. 17
145	600352	浙江龙盛	44, 669	608, 391. 78	0. 17
146	601186	中国铁建	76, 742	606, 261. 80	0. 17
147	603369	今世缘	10, 500	602, 490. 00	0. 17
148	603019	中科曙光	17, 556	600, 941. 88	0. 17
149	000066	中国长城	31, 200	592, 488. 00	0. 17
150	300003	乐普医疗	21, 500	584, 370. 00	0. 17
151	000786	北新建材	14, 400	576, 720. 00	0. 16
152	600600	青岛啤酒	5, 800	576, 520. 00	0. 16
153	600760	中航沈飞	7, 300	570, 714. 00	0. 16
154	603899	晨光文具	6, 400	566, 784. 00	0. 16
155	600183	生益科技	20, 000	563, 200. 00	0. 16
156	002601	龙麟佰利	18, 300	563, 091. 00	0. 16
157	601108	财通证券	44, 500	562, 925. 00	0. 16
158	002600	领益智造	46, 600	558, 734. 00	0. 16
159	688012	中微公司	3, 500	551, 565. 00	0. 16
160	601155	新城控股	15, 800	550, 314. 00	0. 16
161	000596	古井贡酒	2, 000	544, 000. 00	0. 15

162	000783	长江证券	64,107	538,498.80	0.15
163	002044	美年健康	47,380	536,815.40	0.15
164	600383	金地集团	39,057	527,269.50	0.15
165	002024	苏宁易购	67,501	520,432.71	0.15
166	002841	视源股份	4,500	517,635.00	0.15
167	002384	东山精密	19,800	514,800.00	0.15
168	601555	东吴证券	52,166	514,356.76	0.15
169	601985	中国核电	102,950	506,514.00	0.14
170	601669	中国电建	129,447	502,254.36	0.14
171	603160	汇顶科技	3,200	497,760.00	0.14
172	000069	华侨城 A	69,101	489,926.09	0.14
173	000938	紫光股份	23,906	488,877.70	0.14
174	300136	信维通信	13,400	480,792.00	0.14
175	600111	北方稀土	36,711	480,546.99	0.14
176	002624	完美世界	16,200	477,900.00	0.14
177	601878	浙商证券	30,600	468,180.00	0.13
178	601933	永辉超市	64,838	465,536.84	0.13
179	300144	宋城演艺	26,140	463,200.80	0.13
180	300033	同花顺	3,700	458,726.00	0.13
181	601138	工业富联	33,300	455,877.00	0.13
182	600795	国电电力	202,527	455,685.75	0.13
183	000977	浪潮信息	16,800	451,584.00	0.13
184	600522	中天科技	41,400	448,776.00	0.13
185	600010	包钢股份	377,604	441,796.68	0.12
186	601800	中国交建	60,684	440,565.84	0.12
187	002414	高德红外	10,500	438,375.00	0.12
188	002456	欧菲光	32,900	433,622.00	0.12
189	600029	南方航空	72,372	431,337.12	0.12
190	000425	徐工机械	79,096	424,745.52	0.12
191	002821	凯莱英	1,400	418,796.00	0.12
192	601600	中国铝业	114,980	417,377.40	0.12

193	002607	中公教育	11,700	411,021.00	0.12
194	000703	恒逸石化	31,880	408,064.00	0.12
195	600705	中航资本	91,898	402,513.24	0.11
196	601838	成都银行	37,700	402,259.00	0.11
197	600061	国投资本	28,953	400,419.99	0.11
198	603833	欧派家居	2,960	398,120.00	0.11
199	688036	传音控股	2,600	395,564.00	0.11
200	000728	国元证券	43,627	390,897.92	0.11
201	600886	国投电力	44,956	388,419.84	0.11
202	000963	华东医药	14,480	384,588.80	0.11
203	002463	沪电股份	20,200	379,558.00	0.11
204	601111	中国国航	50,456	377,915.44	0.11
205	601607	上海医药	19,529	374,956.80	0.11
206	600606	绿地控股	63,146	368,141.18	0.10
207	002157	正邦科技	21,600	368,064.00	0.10
208	600066	宇通客车	21,570	364,964.40	0.10
209	002602	世纪华通	51,260	364,458.60	0.10
210	600115	东方航空	77,450	362,466.00	0.10
211	601727	上海电气	64,873	350,314.20	0.10
212	601066	中信建投	8,300	348,600.00	0.10
213	600362	江西铜业	16,940	337,953.00	0.10
214	600340	华夏幸福	26,003	336,218.79	0.10
215	600177	雅戈尔	46,668	335,542.92	0.09
216	002422	科伦药业	17,200	334,368.00	0.09
217	603658	安图生物	2,300	333,914.00	0.09
218	600011	华能国际	74,500	333,760.00	0.09
219	601021	春秋航空	5,950	329,808.50	0.09
220	300628	亿联网络	4,500	329,040.00	0.09
221	600118	中国卫星	10,154	326,755.72	0.09
222	002508	老板电器	8,000	326,240.00	0.09
223	601162	天风证券	53,380	325,618.00	0.09

224	601618	中国中冶	115,126	314,293.98	0.09
225	600487	亨通光电	21,900	306,381.00	0.09
226	600018	上港集团	66,439	303,626.23	0.09
227	002773	康弘药业	6,220	299,493.00	0.08
228	601990	南京证券	24,300	298,161.00	0.08
229	600068	葛洲坝	45,143	297,040.94	0.08
230	601198	东兴证券	22,292	296,929.44	0.08
231	002120	韵达股份	18,850	295,945.00	0.08
232	601216	君正集团	59,745	295,737.75	0.08
233	600637	东方明珠	32,852	293,696.88	0.08
234	002673	西部证券	28,504	289,030.56	0.08
235	600369	西南证券	53,117	285,769.46	0.08
236	600004	白云机场	19,600	276,948.00	0.08
237	002739	万达电影	15,300	276,624.00	0.08
238	600498	烽火通信	11,300	272,104.00	0.08
239	002916	深南电路	2,500	270,150.00	0.08
240	601816	京沪高铁	47,700	269,982.00	0.08
241	600332	白云山	9,125	266,906.25	0.08
242	600489	中金黄金	30,200	266,062.00	0.08
243	000961	中南建设	30,100	265,783.00	0.08
244	601881	中国银河	21,200	265,212.00	0.07
245	003816	中国广核	93,500	263,670.00	0.07
246	601360	三六零	16,200	254,502.00	0.07
247	688009	中国通号	42,900	251,394.00	0.07
248	601998	中信银行	49,174	251,279.14	0.07
249	600390	五矿资本	35,700	249,186.00	0.07
250	000656	金科股份	34,200	242,478.00	0.07
251	002252	上海莱士	32,380	239,612.00	0.07
252	600233	圆通速递	20,700	238,050.00	0.07
253	601117	中国化学	40,000	234,800.00	0.07
254	002958	青农商行	45,100	229,559.00	0.06

255	600271	航天信息	18,138	228,538.80	0.06
256	600655	豫园股份	25,400	225,806.00	0.06
257	601319	中国人保	33,900	222,723.00	0.06
258	600998	九州通	12,100	219,736.00	0.06
259	603156	养元饮品	8,476	219,019.84	0.06
260	600208	新湖中宝	69,328	214,916.80	0.06
261	600085	同仁堂	8,829	211,013.10	0.06
262	601231	环旭电子	10,900	210,806.00	0.06
263	002032	苏泊尔	2,700	210,573.00	0.06
264	601658	邮储银行	43,700	208,886.00	0.06
265	002938	鹏鼎控股	4,200	208,614.00	0.06
266	603195	公牛集团	1,000	205,290.00	0.06
267	601238	广汽集团	15,300	203,337.00	0.06
268	600848	上海临港	9,800	196,196.00	0.06
269	600150	中国船舶	11,000	194,590.00	0.06
270	002939	长城证券	14,900	191,763.00	0.05
271	600482	中国动力	10,500	188,160.00	0.05
272	600297	广汇汽车	64,960	185,785.60	0.05
273	002146	荣盛发展	27,400	178,922.00	0.05
274	600027	华电国际	51,600	175,440.00	0.05
275	002558	巨人网络	9,900	172,557.00	0.05
276	000671	阳光城	26,100	170,172.00	0.05
277	002153	石基信息	5,300	164,777.00	0.05
278	600989	宝丰能源	13,300	155,610.00	0.04
279	000627	天茂集团	31,200	151,944.00	0.04
280	601577	长沙银行	15,900	151,368.00	0.04
281	601916	浙商银行	35,200	143,616.00	0.04
282	000708	中信特钢	6,000	130,740.00	0.04
283	000723	美锦能源	19,500	130,260.00	0.04
284	600025	华能水电	28,500	127,110.00	0.04
285	601698	中国卫通	6,900	125,166.00	0.04

286	601808	中海油服	9,800	125,146.00	0.04
287	601236	红塔证券	6,400	118,976.00	0.03
288	603392	万泰生物	500	100,765.00	0.03
289	601077	渝农商行	18,100	81,450.00	0.02
290	002945	华林证券	4,700	70,829.00	0.02
291	600845	宝信软件	1,000	68,980.00	0.02
292	600299	安迪苏	5,100	58,701.00	0.02
293	603087	甘李药业	400	52,888.00	0.01
294	600161	天坛生物	1,000	41,700.00	0.01
295	300676	华大基因	300	38,568.00	0.01
296	601696	中银证券	1,000	27,680.00	0.01
297	300529	健帆生物	300	20,346.00	0.01
298	600918	中泰证券	1,000	18,500.00	0.01
299	601872	招商轮船	1,000	5,650.00	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

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	601995	中金公司	25,043	1,721,308.05	0.49
2	688356	键凯科技	2,433	255,610.98	0.07
3	688788	科思科技	1,741	190,796.19	0.05
4	688136	科兴制药	4,337	150,016.83	0.04
5	300862	蓝盾光电	3,617	139,399.18	0.04
6	688579	山大地纬	8,976	129,074.88	0.04
7	688313	仕佳光子	5,312	121,751.04	0.03
8	688617	惠泰医疗	1,405	104,616.30	0.03
9	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.03

10	688550	瑞联新材	1,118	94,001.44	0.03
11	688338	赛科希德	1,310	71,512.90	0.02
12	300896	爱美客	114	68,783.04	0.02
13	605376	博迁新材	1,421	66,787.00	0.02
14	688590	新致软件	4,171	65,860.09	0.02
15	688577	浙海德曼	1,503	63,141.03	0.02
16	688308	欧科亿	2,457	57,518.37	0.02
17	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.01
18	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.01
19	300900	广联航空	882	29,283.51	0.01
20	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.01
21	300894	火星人	679	25,716.16	0.01
22	300919	中伟股份	412	25,342.12	0.01
23	300877	金春股份	461	23,441.85	0.01
24	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.01
25	300872	天阳科技	561	21,228.24	0.01
26	300884	狄耐克	585	20,477.97	0.01
27	300909	汇创达	458	19,503.82	0.01
28	300871	回盛生物	494	19,117.80	0.01
29	300892	品渥食品	314	19,072.88	0.01
30	300908	仲景食品	304	18,970.73	0.01
31	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.01
32	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01
33	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
34	300878	维康药业	344	16,759.68	0.00
35	300925	法本信息	428	16,709.99	0.00
36	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
37	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
38	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
39	300895	铜牛信息	329	15,095.98	0.00
40	300873	海晨股份	356	14,709.92	0.00

41	300868	杰美特	318	13,763.04	0.00
42	300889	爱克股份	440	13,252.80	0.00
43	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
44	300893	松原股份	356	12,803.68	0.00
45	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00
46	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
47	300922	天秦装备	363	12,008.46	0.00
48	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
49	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
50	300917	特发服务	303	9,866.14	0.00
51	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
52	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
53	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
54	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

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	601318	中国平安	12,305,236.00	6.72
2	600519	贵州茅台	9,448,449.00	5.16
3	600036	招商银行	7,197,117.09	3.93
4	000725	京东方A	7,001,327.00	3.82
5	600276	恒瑞医药	4,424,978.00	2.42
6	002475	立讯精密	4,008,691.61	2.19
7	000858	五粮液	3,890,303.91	2.13
8	601012	隆基股份	3,813,261.00	2.08
9	000333	美的集团	3,725,935.00	2.04
10	600585	海螺水泥	3,587,374.00	1.96
11	000651	格力电器	3,480,823.00	1.90

12	600030	中信证券	2,822,799.00	1.54
13	601166	兴业银行	2,704,741.00	1.48
14	601398	工商银行	2,451,696.00	1.34
15	000002	万科A	2,338,092.00	1.28
16	600887	伊利股份	2,230,129.00	1.22
17	600309	万华化学	2,163,900.00	1.18
18	600837	海通证券	1,801,485.00	0.98
19	600900	长江电力	1,793,641.00	0.98
20	300059	东方财富	1,740,646.00	0.95

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	601318	中国平安	8,421,189.92	4.60
2	600519	贵州茅台	7,352,837.00	4.02
3	000725	京东方A	6,387,807.00	3.49
4	601012	隆基股份	5,538,192.00	3.03
5	600036	招商银行	4,417,959.00	2.41
6	688981	中芯国际	4,202,456.19	2.30
7	600276	恒瑞医药	3,488,574.67	1.91
8	002475	立讯精密	3,181,010.00	1.74
9	600585	海螺水泥	2,839,864.00	1.55
10	000333	美的集团	2,102,658.57	1.15
11	000651	格力电器	2,100,380.00	1.15
12	000858	五粮液	1,975,326.00	1.08
13	600309	万华化学	1,773,668.02	0.97
14	601166	兴业银行	1,630,223.00	0.89
15	600016	民生银行	1,205,221.00	0.66

16	600030	中信证券	1,175,474.00	0.64
17	600837	海通证券	1,173,622.00	0.64
18	600887	伊利股份	1,142,949.00	0.62
19	000002	万科 A	1,105,297.90	0.60
20	688363	华熙生物	1,050,519.20	0.57

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	240,144,194.34
卖出股票收入（成交）总额	170,676,215.25

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	8,830,116.90	2.50
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)	242,000.00	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,072,116.90	2.56

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	019627	20国债01	88,310	8,830,116.90	2.50
2	113044	大秦转债	2,220	222,000.00	0.06
3	113616	韦尔转债	200	20,000.00	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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2103	沪深300股指期货2103合约	3	4,690,440.00	303,480.00	-
IF2106	沪深300股指期货2106合约	1	1,550,400.00	115,260.00	-
公允价值变动总额合计（元）					418,740.00
股指期货投资本期收益（元）					54,466.02
股指期货投资本期公允价值变动（元）					418,740.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同，为了更好地实现投资目标，本基金可少量投资于股指期货。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，主要通过多头套期保值策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本基金将在流动性较好和投资期限适当的合约上安排比例适当的头寸，以降低对市场的冲击并减少交易成本，根据市场流动性状况及投资需求，分时段执行展期交易，在交易过程中，对投资组合的风险状况持续监控。

具体而言，当前对股指期货交易主要用以获得股指期货的基差收敛收益，并将剩余资金进行现金管理获得部分收益，我们还会在期货保证金账户中预留足够多的保证金以进行期货投资风险的控制。考虑到股指期货结算规则等特性，使用期货进行指数跟踪可能会存在一定的偏离，我们会根据市场实际情况评估跟踪偏离及获得超额收益的性价比，选择最有利于持有人的期货投资策略。

总体而言，本基金投资股指期货风险可控的同时能够帮助基金获得超越基准指数的超额收益，符合本基金的投资政策与投资目标。后续我们将密切关注期货市场表现情况及跟踪误差情况，决定是否继续投资股指期货。

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 报告期末，本基金投资的前十名证券除“兴业银行（证券代码601166）”外其他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。本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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	970,867.17
2	应收证券清算款	692,241.03
3	应收股利	-
4	应收利息	196,440.05
5	应收申购款	230,388.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,089,936.38

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

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	601995	中金公司	1,714,383.21	0.48	新股流通受限
2	688356	键凯科技	255,610.98	0.07	科创板打新限售
3	688788	科思科技	190,796.19	0.05	科创板打新限售
4	688136	科兴制药	150,016.83	0.04	科创板打新限售
5	300862	蓝盾光电	139,399.18	0.04	创业板打新限售

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

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
16,062	11,681.23	133,327,956.12	71.06%	54,295,884.37	28.94%

9.2 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	1,966,872.49	1.05%

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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 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	142,292,172.57
减：本报告期基金总赎回份额	83,166,726.93
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	187,623,840.49

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：2020年8月，中国农业银行总行决定刘琳任托管业务部副总裁。

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5万元。该事务所自2019年11月23日起为本基金提供审计服务至今，本报告期内无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	
东吴证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	383,475,320.38	98.00%	280,421.43	98.00%	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方	2	-	-	-	-	-

财富证券						
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	7,806,652.82	2.00%	5,709.11	2.00%	-
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。

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	9,012,617.00	100.00%	4,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	2020-02-15
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	2020-03-16
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	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
11	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
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
14	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

15	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
16	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
17	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
18	前海开源沪深300指数型证券投资基金2020年第2季度报告	中国证监会规定媒介	2020-07-21
19	前海开源沪深300指数型证券投资基金招募说明书摘要（20200814更新）	中国证监会规定媒介	2020-08-14
20	前海开源沪深300指数型证券投资基金招募说明书（20200814更新）	中国证监会规定媒介	2020-08-14
21	前海开源沪深300指数型证券投资基金变更基金经理的公告	中国证监会规定媒介	2020-08-14
22	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	2020-08-18
23	前海开源沪深300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
24	前海开源沪深300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
25	前海开源基金管理有限公司	中国证监会规定媒介	2020-09-05

	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		
26	前海开源沪深300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
27	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
28	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
29	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	2020-12-28
30	前海开源基金管理有限公司关于终止与部分代销机构合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2020-12-31

§ 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	20200101 - 20200312	27,606,595.09	6,108,124.62	0.00	33,714,719.71	17.97%
	2	20200424 - 20200608	27,606,595.09	6,108,124.62	0.00	33,714,719.71	17.97%
	3	20200610 - 20200708	27,606,595.09	6,108,124.62	0.00	33,714,719.71	17.97%

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

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