

**新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金**

**2021 年中期报告**

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:新疆前海联合基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2021 年 08 月 30 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年1月1日起至6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 .....	6
2.1 基金基本情况 .....	6
2.2 基金产品说明 .....	6
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 .....	8
§ 3 主要财务指标和基金净值表现 .....	8
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	8
3.2 基金净值表现 .....	9
3.3 其他指标 .....	11
§ 4 管理人报告 .....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
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 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
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 .....	15
§ 5 托管人报告 .....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	16
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 .....	16

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 .....	16
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计) .....	16
6.1 资产负债表 .....	16
6.2 利润表 .....	18
6.3 所有者权益(基金净值)变动表 .....	20
6.4 报表附注 .....	22
§ 7 投资组合报告 .....	46
7.1 期末基金资产组合情况 .....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	47
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 .....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
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 .....	62
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
7.12 投资组合报告附注 .....	62
§ 8 基金份额持有人信息 .....	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	64
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 .....	65
§ 9 开放式基金份额变动 .....	65
§ 10 重大事件揭示 .....	65
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	66
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	66
10.4 基金投资策略的改变 .....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
10.8 其他重大事件.....	71
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
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.....	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
§ 12 备查文件目录.....	73
12.1 备查文件目录.....	73
12.2 存放地点.....	73
12.3 查阅方式.....	74

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金	
基金简称	前海联合沪深 300	
基金主代码	003475	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 30 日	
基金管理人	新疆前海联合基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,942,436.53 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海联合沪深 300A	前海联合沪深 300C
下属分级基金的交易代码	003475	007039
报告期末下属分级基金的份 额总额	4,315,320.10 份	6,627,116.43 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式投资策略，通过紧密跟踪标的指数，力争控制本基金的份额净值增长率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%，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采用复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。

	本基金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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，是股票型基金中处于中等风险水平的基金产品。

### 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		新疆前海联合基金管理有限 公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负 责人	姓名	邱张斌	郭明
	联系电话	0755-82780666	010-66105799
	电子邮箱	service@qhlhfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-640-0099	95588
传真		0755-82780000	010-66105798
注册地址		新疆乌鲁木齐经济技术开发 区维泰南路 1 号维泰大厦 1506 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市南山区桂湾四路 197 号前海华润金融中心 T1 栋第 28 和 29 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518057	100140
法定代表人		吴昱村	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的 管理人互联网网址	www. qh1hfund. com
基金中期报告备置地点	基金管理人、托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	新疆前海联合基金管理有限 公司	深圳市南山区桂湾四路 197 号前海华 润金融中心 T1 栋第 28 和 29 层

## § 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（2021 年 01 月 01 日-2021 年 06 月 30 日）	
	前海联合沪深 300A	前海联合沪深 300C
本期已实现收益	305,329.55	426,262.27
本期利润	25,652.46	-49,022.82
加权平均基金份额本期利润	0.0056	-0.0072
本期加权平均净值利润率	0.32%	-0.42%
本期基金份额净值增长率	0.34%	0.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2021 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	1,939,331.84	3,550,282.74
期末可供分配基金份额利润	0.4494	0.5357
期末基金资产净值	7,413,093.30	11,283,681.82
期末基金份额净值	1.7179	1.7027
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2021 年 06 月 30 日）	



基金份额累计净值增长率	71.79%	55.58%
-------------	--------	--------

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

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

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

4、本基金自 2019 年 2 月 26 日起，增加 C 类基金份额并设置相应的基金代码。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 前海联合沪深 300A 净值表现

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	-1.73%	0.75%	-1.91%	0.76%	0.18%	-0.01%
过去三个月	3.49%	0.93%	3.32%	0.93%	0.17%	0.00%
过去六个月	0.34%	1.26%	0.29%	1.25%	0.05%	0.01%
过去一年	24.08%	1.26%	24.19%	1.27%	-0.11%	-0.01%
过去三年	65.15%	1.31%	46.42%	1.30%	18.73%	0.01%
自基金合同生效起至今	71.79%	1.15%	44.49%	1.15%	27.30%	0.00%

#### 前海联合沪深 300C 净值表现

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	-1.77%	0.75%	-1.91%	0.76%	0.14%	-0.01%
过去三个 月	3.39%	0.93%	3.32%	0.93%	0.07%	0.00%
过去六个 月	0.15%	1.26%	0.29%	1.25%	-0.14%	0.01%
过去一年	23.59%	1.26%	24.19%	1.27%	-0.60%	-0.01%
自基金合 同生效起 至今	55.58%	1.28%	38.12%	1.25%	17.46%	0.03%

注：1、本基金的业绩比较基准为： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 95\% + \text{银行活期存款利率（税后）} \times 5\%$ 。

2、本基金自 2019 年 2 月 26 日起，增加 C 类基金份额并设置相应的基金代码。

### 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

前海联合沪深300A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年11月30日-2021年06月30日)



前海联合沪深300C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年02月26日-2021年06月30日)



注：本基金自 2019 年 2 月 26 日起，增加 C 类基金份额并设置相应的基金代码；前海联合沪深 300C 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起始日为 2019 年 2 月 26 日。

### 3.3 其他指标

无。

## § 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

新疆前海联合基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监许可【2015】1842 号文批准，于 2015 年 8 月 7 日成立。公司注册资本 2 亿元人民币，股东结构为：深圳市钜盛华股份有限公司（30%）、深圳粤商物流有限公司（25%）、深圳市深粤控股股份有限公司（25%）、凯信恒有限公司（20%）。本公司总部位于广东省深圳市，已设立上海分公司、北京分公司、深圳分公司。本公司经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，本公司旗下共管理 34 只开放式基金，包括 2 只货币市场基金、18 只债券型基金、12 只混合型基金、1 只指数型基金和 1 只基金中基金（FOF），另管理 12 只专户理财产品，管理资产总规模超过 364 亿元人民币。

#### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张磊	本基金的基金经理	2020-07-07	-	7 年	张磊先生，硕士研究生，7 年证券投资基金投资研究经验，先后从事 TMT、医药等行业研究。2013 年 7 月至 2017 年 2 月任华润元大基金管理有限公司投资管理部研究员。2017 年 2 月加入前海联合基金，现任新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金基金经理（自 2020 年 6 月 8 日起任职）、新疆前海联合新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2020 年 7 月 7 日起任职）、新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金基金经理（自 2020 年 7 月 7 日起任职）和新疆前海联合泳隆灵活配置混合

					型证券投资基金的基金经理 (自 2021 年 3 月 5 日起任 职)。
--	--	--	--	--	--

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”根据公司对外公告的解聘日期填写；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别根据公司对外公告的聘任日期和解聘日期填写。

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。

**4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况**  
无。

#### 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《证券投资基金法》等有关法律法规和基金合同的规定，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，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

#### 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》，完善了相应的制度和流程，通过系统和人工等各种方式在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个业务环节保证公平交易制度的严格执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，保护投资者合法权益。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内，未发生有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 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

回顾 2021 年上半年，主要指数在一季度走出过山车走势后，在二季度逐步企稳反弹，震荡上行。年初化工等周期性行业延续了去年下半年的强势，后面大盘回调后，新能源率先走出调整，屡创新高。半导体相关行业也走势较强。

由于我国新冠疫情防控措施得力，再加上去年低基数的原因，上半年国内经济延续去年下半年走势，同比快速增长，出口也不断走高。与此相对比，海外疫情不断反复。由于海外供给恢复较慢，原材料价格快速上涨，由于产能供给有限，芯片也出现了紧缺，这些也导致 PPI 快速上涨、部分中游缺货停产等现象，但与此同时，非食品 CPI 并未大幅上涨，价格传导不畅，中游受损。国家及时采取了相关政策，预计后面相关现象将逐步环节。

本基金紧密跟踪指数，并在一定程度优化。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海联合沪深 300A 基金份额净值为 1.7179 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.34%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%；截至报告期末前海联合沪深 300C 基金份额净值为 1.7027 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.15%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年我们认为，由于去年下半年基数较高，经济增速会逐步放缓。而国内经济较好，在货币政策上仍保持定力。海外为了应对疫情，大幅货币宽松，而至今生产都未有效恢复，近半年来 CPI 快速上涨，虽然后续不会快速收紧货币，但边际上宽松力度会有所缩减，可能会一定程度抑制海外需求。从流动性角度，会制约权益市场的估值扩张。总体来说，下半年的不确定性增加。

我们对下半年市场总体走势持谨慎态度，但科技行业的机会会伴随国内的科技进步而层数不穷，除了国产替代，部分强势龙头也走出国门，参与全球竞争，我们依然看好科技龙头的中长期趋势。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定, 本基金管理人严格按照企业会计准则、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。

本基金管理人的基金估值由基金会计负责, 基金会计以基金为会计核算主体, 独立建账、独立核算, 保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及账务处理; 每日按时接收成交数据及权益数据, 进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管人双人同步独立核算、相互核对的方式, 每日就基金的会计核算、基金估值等与托管人进行核对; 每日估值结果必须与托管人核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外, 还设有基金会计复核岗位, 负责基金会计核算的日常事后复核工作, 确保基金净值核算无误。配备的基金会计具备基金从业资格, 在基金核算与估值方面掌握了较为丰富的知识和经验, 熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务, 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(估值处理标准另有规定的除外)的估值数据。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展, 建立了负责估值工作决策的估值小组, 由研究发展部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部负责人及其他指定相关人员组成, 分别具有投资研究、风险管理、估值核算等方面的专业经验。基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议, 但不参与最终决策和日常估值工作。

本报告期内, 参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内, 本基金从 2020 年 1 月 22 日起至 2021 年 6 月 30 日止, 连续 347 个工作日基金资产净值低于 5000 万元。本基金管理人已经于 2020 年 4 月 24 日向证监会申请持续营

销。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金的管理人——新疆前海联合基金管理有限公司在新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,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

本托管人依法对新疆前海联合基金管理有限公司编制和披露的新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体:新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金

报告截止日:2021 年 06 月 30 日

单位:人民币元



资 产	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资 产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,070,597.48	724,645.99
结算备付金		-	6,486.97
存出保证金		1,743.39	1,725.57
交易性金融资产	6.4.7.2	18,235,365.54	19,126,134.02
其中：股票投资		17,535,365.54	18,427,044.02
基金投资		-	-
债券投资		700,000.00	699,090.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	14,546.18	7,057.35
应收股利		-	-
应收申购款		36,779.76	54,738.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		19,359,032.35	19,920,788.64
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>			
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		411,312.34	62,691.60
应付管理人报酬		9,985.21	10,356.99
应付托管费		2,304.27	2,390.08
应付销售服务费		3,765.12	3,415.58
应付交易费用	6.4.7.7	5,852.90	1,735.43
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	229,037.39	150,086.84
负债合计		662,257.23	230,676.52
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	10,942,436.53	11,544,296.08
未分配利润	6.4.7.10	7,754,338.59	8,145,816.04
所有者权益合计		18,696,775.12	19,690,112.12
负债和所有者权益总计		19,359,032.35	19,920,788.64

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 10,942,436.53 份，其中前海联合沪深 300 指数 A 基金份额净值 1.7179 元，份额总额 4,315,320.10 份；前海联合沪深 300 指数 C 基金份额净值 1.7027 元，份额总额 6,627,116.43 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
一、收入		210,099.62	1,719,919.98

1. 利息收入		9,140.76	16,748.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,677.61	8,054.41
债券利息收入		7,463.15	8,526.04
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	168.22
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		942,799.91	6,643,115.69
其中：股票投资收益	6.4.7.12	818,097.72	6,501,860.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-11,780.87
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	124,702.19	153,035.86
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-754,962.18	-4,948,770.37
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17.1	13,121.13	8,825.99
<b>减：二、费用</b>		233,469.98	457,825.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	63,152.75	75,796.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	14,573.69	17,491.64
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	23,006.31	18,518.65

4. 交易费用	6.4.7.18	17,751.79	196,308.71
5. 利息支出		27.05	-
其中：卖出回购金融资产支出		27.05	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	114,958.39	149,709.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-23,370.36	1,262,094.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-23,370.36	1,262,094.43

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 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）	11,544,296.08	8,145,816.04	19,690,112.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-23,370.36	-23,370.36
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）	-601,859.55	-368,107.09	-969,966.64
其中：1. 基金申购款	6,993,411.97	5,194,614.17	12,188,026.14
2. 基金赎回款	-7,595,271.52	-5,562,721.26	-13,157,992.78

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)	10,942,436.53	7,754,338.59	18,696,775.12
项 目	上年度可比期间 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)	68,664,828.38	18,023,522.05	86,688,350.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,262,094.43	1,262,094.43
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)	-56,504,082.71	-14,652,907.04	-71,156,989.75
其中：1. 基金申购款	27,543,862.66	7,870,169.02	35,414,031.68
2. 基金赎回款	-84,047,945.37	-22,523,076.06	-106,571,021.43
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)	12,160,745.67	4,632,709.44	16,793,455.11

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：

吴昱村

吴昱村

陈艳

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

新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1861 号《关于准予新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金注册的批复》进行募集,由新疆前海联合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《新疆前海联合沪深 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 200,202,657.90 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1557 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,202,690.71 份基金份额,其中认购资金利息折合 32.81 份基金份额。本基金的基金管理人为新疆前海联合基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《关于新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金增加 C 类基金份额并相应修订基金合同的公告》和《新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》,自 2019 年 2 月 26 日起,本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费并根据持有期限收取赎回费,但不收取销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资人申购时不收取申购费,但收取销售服务费并根据持有期限收取赎回费,称为 C 类基金份额。本基金增加 C 类基金份额后,分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。原有的基金份额在增加收取销售服务费的 C 类基金份额后,全部自动转换为本基金 A 类基金份额。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《新疆前海联合沪深 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为主要投资对象。此外,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,包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票、存托凭证)、权证、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:本基金持有的股票资产占基金

资产的比例不低于 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 80%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司于 2021 年 8 月 26 日批准报出。

#### 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》、《基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持



有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
活期存款	1,070,597.48
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	1,070,597.48

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	14,920,323.66	17,535,365.54	2,615,041.88
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	696,740.00	700,000.00	3,260.00
交易所市场			

	银行间市场	-	-	-
	合计	696,740.00	700,000.00	3,260.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		15,617,063. 66	18,235,365.54	2,618,301.88

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
应收活期存款利息	113.95
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	-
应收债券利息	14,431.51
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	0.72
合计	14,546.18

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
交易所市场应付交易费用	5,852.90
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,852.90

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	161.00
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	28,876.39
其他应付	200,000.00
合计	229,037.39

#### 6.4.7.9 实收基金

前海联合沪深 300A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,360,812.26	5,360,812.26
本期申购	2,518,119.75	2,518,119.75
本期赎回（以“-”号填列）	-3,563,611.91	-3,563,611.91
本期末	4,315,320.10	4,315,320.10

## 前海联合沪深 300C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,183,483.82	6,183,483.82
本期申购	4,475,292.22	4,475,292.22
本期赎回（以“-”号填列）	-4,031,659.61	-4,031,659.61
本期末	6,627,116.43	6,627,116.43

注：申购含红利再投、转换入份（金）额；赎回含转换出份（金）额。

## 6.4.7.10 未分配利润

## 前海联合沪深 300A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,045,211.06	1,771,508.84	3,816,719.90
本期利润	305,329.55	-279,677.09	25,652.46
本期基金份额交易产生的变动数	-411,208.77	-333,390.39	-744,599.16
其中：基金申购款	1,025,286.86	865,320.63	1,890,607.49
基金赎回款	-1,436,495.63	-1,198,711.02	-2,635,206.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,939,331.84	1,158,441.36	3,097,773.20

## 前海联合沪深 300C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,916,740.24	1,412,355.90	4,329,096.14
本期利润	426,262.27	-475,285.09	-49,022.82
本期基金份额交易产生的变动数	207,280.23	169,211.84	376,492.07
其中：基金申购款	2,204,050.88	1,099,955.80	3,304,006.68
基金赎回款	-1,996,770.65	-930,743.96	-2,927,514.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,550,282.74	1,106,282.65	4,656,565.39

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	1,613.96
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	51.56
其他	12.09
合计	1,677.61

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	6,351,919.32
减：卖出股票成本总额	5,533,821.60
买卖股票差价收入	818,097.72

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

##### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	124,702.19
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	124,702.19

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-754,962.18
——股票投资	-755,872.18
——债券投资	910.00
——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	-754,962.18

#### 6.4.7.17.1 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	12,847.85
转换费收入	273.28
合计	13,121.13

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
交易所市场交易费用	17,751.79
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
合计	17,751.79

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	82.00
指数使用费	100,000.00
合计	114,958.39

注：本基金指数许可使用费分为许可使用固定费和许可使用基点费，其中许可使用基点费由基金财产承担。指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累



计，每季支付一次。许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 5 万元。

#### 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
新疆前海联合基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

##### 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

无。

###### 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

无。

### 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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	63,152.75	75,796.99
其中：支付销售机构的客户 维护费	10,933.21	11,706.83

注：支付基金管理人新疆前海联合的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.65% 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 × 0.65% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托 管费	14,573.69	17,491.64

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的费率计提，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  $\times$  0.15% / 当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合沪深 300A	前海联合沪深 300C	合计
新疆前海联合基金管理有限公司	-	18,346.96	18,346.96
合计	-	18,346.96	18,346.96
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海联合沪深 300A	前海联合沪深 300C	合计
新疆前海联合基金管理有限公司	-	10,405.53	10,405.53
合计	-	10,405.53	10,405.53

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给新疆前海联合，再由新疆前海联合计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值  $\times$  0.40% / 当年天数。

2、本基金自 2019 年 2 月 26 日起，增加 C 类基金份额并设置相应的基金代码。

### 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

## 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

## 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

## 前海联合沪深 300C

份额单位：份

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2016 年 11 月 30 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	5,286,210.54	-
报告期间申购/买入总份额	-	5,286,210.54
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,286,210.54	5,286,210.54
报告期末持有的基金份额占 基金总份额比例	48.31%	43.4695%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投、转入。

2、本基金管理人投资的费率标准与其他相同条件者适用一致。

## 6.4.10.5.2 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。

## 6.4.10.6 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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 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
中国工商银行股份有限公司	1,070,597.4 8	1,613.96	1,285,427.0 1	7,090.26

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

无。

## 6.4.12 期末（2021 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

无。

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021-06-16	重大资产重组事项	5.59	2021-07-06	6.15	3,300	22,771.83	18,447.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。本基金在日常经营活动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从事风险管理的主要目标是进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人建立了由董事会风险控制委员会、经营层投资风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设

立投资风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等问题向总经理提供咨询意见和建议；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部和风险管理部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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之内。

#### 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行。对于定期银行存款，本基金通过选择具备适当信用水平的银行作为交易对手、平衡信用风险与投资收益率、综合参考内外部信用评级信息评价及调整投资限额，管理相关信用风险并定期评估减值损失。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	700,000.00	699,090.00
合计	700,000.00	699,090.00

注：1、短期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债。

#### 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随时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 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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期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股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的市值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 2021 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未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2021 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	1,070,597.48	-	-	-	1,070,597.48
存出保证金	1,743.39	-	-	-	1,743.39
交易性金融	700,000.00	-	-	17,535,365.	18,235,365.

资产				54	54
应收利息	-	-	-	14,546.18	14,546.18
应收申购款	-	-	-	36,779.76	36,779.76
资产总计	1,772,340.87	-	-	17,586,691.48	19,359,032.35
负债					
应付赎回款	-	-	-	411,312.34	411,312.34
应付管理人报酬	-	-	-	9,985.21	9,985.21
应付托管费	-	-	-	2,304.27	2,304.27
应付销售服务费	-	-	-	3,765.12	3,765.12
应付交易费用	-	-	-	5,852.90	5,852.90
其他负债	-	-	-	229,037.39	229,037.39
负债总计	-	-	-	662,257.23	662,257.23
利率敏感度缺口	1,772,340.87	-	-	16,924,434.25	18,696,775.12
上年度末 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	724,645.99	-	-	-	724,645.99
结算备付金	6,486.97	-	-	-	6,486.97
存出保证金	1,725.57	-	-	-	1,725.57
交易性金融资产	699,090.00	-	-	18,427,044.02	19,126,134.02
应收利息	-	-	-	7,057.35	7,057.35
应收申购款	-	-	-	54,738.74	54,738.74

资产总计	1,431,948.53	-	-	18,488,840.11	19,920,788.64
负债					
应付赎回款	-	-	-	62,691.60	62,691.60
应付管理人报酬	-	-	-	10,356.99	10,356.99
应付托管费	-	-	-	2,390.08	2,390.08
应付销售服务费	-	-	-	3,415.58	3,415.58
应付交易费用	-	-	-	1,735.43	1,735.43
其他负债	-	-	-	150,086.84	150,086.84
负债总计	-	-	-	230,676.52	230,676.52
利率敏感度缺口	1,431,948.53	-	-	18,258,163.59	19,690,112.12

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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 3.74% (2020 年 12 月 31 日：3.55%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020 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 沪深 300 指数的成份股及其备选成份股，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，采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金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。

本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于 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 80%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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 2021 年 06 月 30 日		上年度末 2020 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	17,535,365.54	93.79	18,427,044.02	93.59
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	17,535,365.54	93.79	18,427,044.02	93.59
----	---------------	-------	---------------	-------

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	898,893.31	951,385.18
	沪深 300 指数下降 5%	-898,893.31	-951,385.18

#### 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	17,535,365.54	90.58
	其中: 股票	17,535,365.54	90.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	700,000.00	3.62
	其中: 债券	700,000.00	3.62

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售 金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,070,597.48	5.53
8	其他各项资产	53,069.33	0.27
9	合计	19,359,032.3	100.00
		5	

## 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	186,906.20	1.00
B	采矿业	383,120.52	2.05
C	制造业	9,520,885.62	50.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应 业	319,097.00	1.71
E	建筑业	215,295.00	1.15
F	批发和零售业	122,917.00	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	549,344.40	2.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	531,555.20	2.84
J	金融业	4,246,610.96	22.71
K	房地产业	374,756.64	2.00
L	租赁和商务服务业	350,526.68	1.87
M	科学研究和技术服务业	234,217.80	1.25

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	31,335.00	0.17
Q	卫生和社会工作	393,165.52	2.10
R	文化、体育和娱乐业	75,632.00	0.40
S	综合	-	-
	合计	17,535,365.5	93.79
		4	

### 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

本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

## 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	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	500	1,028,350.00	5.50
2	601318	中国平安	9,200	591,376.00	3.16
3	600036	招商银行	10,500	568,995.00	3.04
4	000858	五粮液	1,600	476,624.00	2.55
5	601012	隆基股份	3,542	314,671.28	1.68
6	000333	美的集团	4,200	299,754.00	1.60



7	601888	中国中免	900	270,090.00	1.44
8	600276	恒瑞医药	3,840	261,004.80	1.40
9	002415	海康威视	3,900	251,550.00	1.35
10	601166	兴业银行	12,100	248,655.00	1.33
11	300059	东方财富	7,156	234,645.24	1.26
12	603259	药明康德	1,420	222,357.80	1.19
13	000651	格力电器	4,100	213,610.00	1.14
14	600900	长江电力	9,700	200,208.00	1.07
15	601939	建设银行	28,600	190,190.00	1.02
16	600887	伊利股份	5,100	187,833.00	1.00
17	000001	平安银行	8,300	187,746.00	1.00
18	002475	立讯精密	4,000	184,000.00	0.98
19	000725	京东方 A	28,900	180,336.00	0.96
20	600030	中信证券	7,200	179,568.00	0.96
21	002594	比亚迪	700	175,700.00	0.94
22	000568	泸州老窖	700	165,158.00	0.88
23	300015	爱尔眼科	2,274	161,408.52	0.86
24	600031	三一重工	5,100	148,257.00	0.79
25	603288	海天味业	1,118	144,166.10	0.77
26	000002	万科 A	6,000	142,860.00	0.76
27	600309	万华化学	1,300	141,466.00	0.76
28	600809	山西汾酒	300	134,400.00	0.72
29	002714	牧原股份	2,180	132,587.60	0.71
30	603501	韦尔股份	400	128,800.00	0.69
31	601919	中远海控	4,100	125,214.00	0.67
32	002142	宁波银行	3,000	116,910.00	0.63
33	000661	长春高新	300	116,100.00	0.62
34	601899	紫金矿业	11,900	115,311.00	0.62
35	601328	交通银行	23,000	112,700.00	0.60

36	300122	智飞生物	600	112,038.00	0.60
37	002304	洋河股份	500	103,600.00	0.55
38	002352	顺丰控股	1,500	101,550.00	0.54
39	002230	科大讯飞	1,500	101,370.00	0.54
40	600000	浦发银行	9,800	98,000.00	0.52
41	300347	泰格医药	500	96,650.00	0.52
42	600438	通威股份	2,200	95,194.00	0.51
43	002812	恩捷股份	400	93,640.00	0.50
44	300014	亿纬锂能	900	93,537.00	0.50
45	600837	海通证券	8,100	93,150.00	0.50
46	300124	汇川技术	1,250	92,825.00	0.50
47	300274	阳光电源	800	92,048.00	0.49
48	000100	TCL 科技	11,900	91,035.00	0.49
49	600436	片仔癀	200	89,660.00	0.48
50	601816	京沪高铁	16,500	87,285.00	0.47
51	000063	中兴通讯	2,600	86,398.00	0.46
52	002241	歌尔股份	2,000	85,480.00	0.46
53	002460	赣锋锂业	700	84,763.00	0.45
54	601601	中国太保	2,900	84,013.00	0.45
55	002271	东方雨虹	1,500	82,980.00	0.44
56	600690	海尔智家	3,200	82,912.00	0.44
57	600763	通策医疗	200	82,200.00	0.44
58	600585	海螺水泥	2,000	82,100.00	0.44
59	601668	中国建筑	17,520	81,468.00	0.44
60	002027	分众传媒	8,548	80,436.68	0.43
61	300142	沃森生物	1,300	80,210.00	0.43
62	600196	复星医药	1,100	79,343.00	0.42
63	600016	民生银行	17,900	78,939.00	0.42
64	600703	三安光电	2,300	73,715.00	0.39

65	603986	兆易创新	392	73,656.80	0.39
66	601288	农业银行	24,200	73,326.00	0.39
67	603799	华友钴业	642	73,316.40	0.39
68	600048	保利地产	5,976	71,951.04	0.38
69	000338	潍柴动力	3,900	69,693.00	0.37
70	600919	江苏银行	9,800	69,580.00	0.37
71	601229	上海银行	8,299	68,051.80	0.36
72	601688	华泰证券	4,300	67,940.00	0.36
73	600050	中国联通	15,700	67,824.00	0.36
74	600660	福耀玻璃	1,200	67,020.00	0.36
75	600104	上汽集团	3,000	65,910.00	0.35
76	002129	中环股份	1,700	65,620.00	0.35
77	600570	恒生电子	700	65,275.00	0.35
78	601211	国泰君安	3,700	63,418.00	0.34
79	601766	中国中车	10,300	62,624.00	0.33
80	002049	紫光国微	400	61,676.00	0.33
81	601169	北京银行	12,400	60,388.00	0.32
82	600999	招商证券	3,100	58,962.00	0.32
83	000538	云南白药	500	57,860.00	0.31
84	600019	宝钢股份	7,500	57,300.00	0.31
85	002311	海大集团	700	57,120.00	0.31
86	600406	国电南瑞	2,400	55,776.00	0.30
87	002371	北方华创	200	55,476.00	0.30
88	601088	中国神华	2,800	54,656.00	0.29
89	002410	广联达	800	54,560.00	0.29
90	601988	中国银行	17,700	54,516.00	0.29
91	300498	温氏股份	3,780	54,318.60	0.29
92	601818	光大银行	13,900	52,542.00	0.28
93	000625	长安汽车	1,900	49,932.00	0.27

94	600028	中国石化	11,300	49,268.00	0.26
95	600745	闻泰科技	500	48,450.00	0.26
96	300450	先导智能	800	48,112.00	0.26
97	600893	航发动力	900	47,871.00	0.26
98	601628	中国人寿	1,400	47,446.00	0.25
99	600346	恒力石化	1,800	47,232.00	0.25
100	600588	用友网络	1,400	46,564.00	0.25
101	601658	邮储银行	9,100	45,682.00	0.24
102	002493	荣盛石化	2,600	44,902.00	0.24
103	300601	康泰生物	300	44,700.00	0.24
104	601009	南京银行	4,240	44,604.80	0.24
105	601390	中国中铁	8,500	44,540.00	0.24
106	601633	长城汽车	1,000	43,590.00	0.23
107	601377	兴业证券	4,500	43,470.00	0.23
108	600009	上海机场	900	43,317.00	0.23
109	601857	中国石油	8,100	42,849.00	0.23
110	300595	欧普康视	400	41,420.00	0.22
111	300413	芒果超媒	600	41,160.00	0.22
112	002179	中航光电	500	39,510.00	0.21
113	601225	陕西煤业	3,300	39,105.00	0.21
114	002001	新和成	1,340	38,431.20	0.21
115	300408	三环集团	900	38,178.00	0.20
116	002601	龙佰集团	1,100	38,038.00	0.20
117	000776	广发证券	2,500	37,850.00	0.20
118	600584	长电科技	1,000	37,680.00	0.20
119	002841	视源股份	300	37,287.00	0.20
120	600111	北方稀土	1,800	37,260.00	0.20
121	002821	凯莱英	100	37,260.00	0.20
122	600426	华鲁恒升	1,200	37,140.00	0.20

123	000963	华东医药	800	36,808.00	0.20
124	600926	杭州银行	2,480	36,580.00	0.20
125	002050	三花智控	1,500	35,970.00	0.19
126	300003	乐普医疗	1,100	35,332.00	0.19
127	000786	北新建材	900	35,325.00	0.19
128	300433	蓝思科技	1,200	35,292.00	0.19
129	000166	申万宏源	7,500	35,100.00	0.19
130	000895	双汇发展	1,100	34,980.00	0.19
131	600958	东方证券	3,500	34,965.00	0.19
132	601872	招商轮船	7,520	34,742.40	0.19
133	600600	青岛啤酒	300	34,695.00	0.19
134	601100	恒立液压	400	34,368.00	0.18
135	600741	华域汽车	1,300	34,151.00	0.18
136	600760	中航沈飞	560	33,768.00	0.18
137	601155	新城控股	800	33,280.00	0.18
138	002007	华兰生物	900	33,012.00	0.18
139	603369	今世缘	600	32,496.00	0.17
140	000157	中联重科	3,500	32,340.00	0.17
141	601006	大秦铁路	4,900	32,242.00	0.17
142	601336	新华保险	700	32,137.00	0.17
143	603882	金城医学	200	31,954.00	0.17
144	600015	华夏银行	5,160	31,940.40	0.17
145	601901	方正证券	3,400	31,824.00	0.17
146	002236	大华股份	1,500	31,650.00	0.17
147	000768	中航西飞	1,200	31,536.00	0.17
148	002607	中公教育	1,500	31,335.00	0.17
149	601989	中国重工	7,600	31,312.00	0.17
150	600029	南方航空	5,200	31,304.00	0.17
151	600143	金发科技	1,500	31,290.00	0.17

152	601138	工业富联	2,500	31,025.00	0.17
153	603993	洛阳钼业	6,000	30,960.00	0.17
154	600176	中国巨石	1,972	30,585.72	0.16
155	600352	浙江龙盛	2,200	30,228.00	0.16
156	601877	正泰电器	900	30,042.00	0.16
157	600010	包钢股份	19,360	30,008.00	0.16
158	601600	中国铝业	5,600	29,680.00	0.16
159	600547	山东黄金	1,516	29,137.52	0.16
160	601788	光大证券	1,600	28,624.00	0.15
161	001979	招商蛇口	2,600	28,470.00	0.15
162	002008	大族激光	700	28,273.00	0.15
163	601186	中国铁建	3,800	28,234.00	0.15
164	002202	金风科技	2,300	27,968.00	0.15
165	000876	新希望	1,900	27,873.00	0.15
166	601916	浙商银行	7,000	27,790.00	0.15
167	000938	紫光股份	1,240	27,131.20	0.15
168	002555	三七互娱	1,100	26,422.00	0.14
169	003816	中国广核	9,800	26,166.00	0.14
170	000069	华侨城 A	3,500	26,040.00	0.14
171	600989	宝丰能源	1,900	25,992.00	0.14
172	603160	汇顶科技	200	25,926.00	0.14
173	300529	健帆生物	300	25,908.00	0.14
174	002736	国信证券	2,400	25,800.00	0.14
175	603833	欧派家居	180	25,552.80	0.14
176	600109	国金证券	2,000	25,380.00	0.14
177	603899	晨光文具	300	25,368.00	0.14
178	000977	浪潮信息	900	25,317.00	0.14
179	601066	中信建投	800	25,144.00	0.13
180	603019	中科曙光	900	24,849.00	0.13

181	000425	徐工机械	3,900	24,843.00	0.13
182	300136	信维通信	800	24,704.00	0.13
183	601669	中国电建	6,300	24,381.00	0.13
184	600795	国电电力	9,900	24,057.00	0.13
185	000596	古井贡酒	100	23,950.00	0.13
186	002624	完美世界	1,000	23,910.00	0.13
187	000783	长江证券	3,200	23,424.00	0.13
188	600183	生益科技	1,000	23,410.00	0.13
189	601238	广汽集团	1,800	23,310.00	0.12
190	002414	高德红外	840	23,167.20	0.12
191	002384	东山精密	1,100	22,924.00	0.12
192	601838	成都银行	1,800	22,752.00	0.12
193	600079	人福医药	800	22,616.00	0.12
194	601799	星宇股份	100	22,572.00	0.12
195	300033	同花顺	200	22,556.00	0.12
196	688008	澜起科技	357	22,269.66	0.12
197	601985	中国核电	4,400	22,264.00	0.12
198	600886	国投电力	2,300	22,103.00	0.12
199	002600	领益智造	2,400	22,056.00	0.12
200	601108	财通证券	2,100	22,029.00	0.12
201	601360	三六零	1,800	21,978.00	0.12
202	000066	中国长城	1,500	21,900.00	0.12
203	300144	宋城演艺	1,300	21,840.00	0.12
204	601555	东吴证券	2,600	21,684.00	0.12
205	002938	鹏鼎控股	600	21,528.00	0.12
206	000703	恒逸石化	1,800	21,510.00	0.12
207	601607	上海医药	1,000	21,130.00	0.11
208	000860	顺鑫农业	500	21,090.00	0.11
209	603806	福斯特	200	21,026.00	0.11

210	600872	中炬高新	500	21,010.00	0.11
211	002252	上海莱士	2,800	20,972.00	0.11
212	002044	美年健康	2,300	20,953.00	0.11
213	601077	渝农商行	5,200	20,748.00	0.11
214	600161	天坛生物	600	20,550.00	0.11
215	600085	同仁堂	500	20,425.00	0.11
216	600362	江西铜业	900	20,142.00	0.11
217	600522	中天科技	2,000	20,000.00	0.11
218	000728	国元证券	2,500	19,925.00	0.11
219	002602	世纪华通	3,100	19,902.00	0.11
220	600132	重庆啤酒	100	19,795.00	0.11
221	600383	金地集团	1,900	19,456.00	0.10
222	601111	中国国航	2,500	19,450.00	0.10
223	600115	中国东航	3,700	18,796.00	0.10
224	601800	中国交建	2,900	18,792.00	0.10
225	000708	中信特钢	900	18,756.00	0.10
226	002508	老板电器	400	18,600.00	0.10
227	002024	苏宁易购	3,300	18,447.00	0.10
228	600845	宝信软件	360	18,324.00	0.10
229	600061	国投资本	2,128	18,066.72	0.10
230	601618	中国中冶	6,000	17,880.00	0.10
231	601727	上海电气	4,200	17,808.00	0.10
232	601162	天风证券	3,600	17,496.00	0.09
233	601021	春秋航空	300	17,070.00	0.09
234	600705	中航产融	4,400	17,028.00	0.09
235	601878	浙商证券	1,300	17,004.00	0.09
236	600332	白云山	500	16,925.00	0.09
237	600606	绿地控股	3,100	16,895.00	0.09
238	603517	绝味食品	200	16,858.00	0.09



239	300628	亿联网络	200	16,760.00	0.09
240	002157	正邦科技	1,400	16,730.00	0.09
241	002456	欧菲光	1,800	15,984.00	0.09
242	601990	南京证券	1,500	15,780.00	0.08
243	000656	金科股份	2,700	15,633.00	0.08
244	600011	华能国际	3,700	15,614.00	0.08
245	002463	沪电股份	1,000	15,470.00	0.08
246	601933	永辉超市	3,200	15,136.00	0.08
247	600655	豫园股份	1,300	15,067.00	0.08
248	600489	中金黄金	1,700	14,654.00	0.08
249	600118	中国卫星	500	14,630.00	0.08
250	600521	华海药业	700	14,616.00	0.08
251	601696	中银证券	700	14,413.00	0.08
252	601216	君正集团	2,800	14,252.00	0.08
253	600018	上港集团	2,900	13,833.00	0.07
254	603659	璞泰来	100	13,660.00	0.07
255	002120	韵达股份	1,000	13,530.00	0.07
256	002558	巨人网络	1,000	13,300.00	0.07
257	600848	上海临港	720	12,888.00	0.07
258	601998	中信银行	2,500	12,750.00	0.07
259	002739	万达电影	800	12,632.00	0.07
260	300677	英科医疗	100	12,480.00	0.07
261	002673	西部证券	1,500	12,375.00	0.07
262	688009	中国通号	2,174	12,370.06	0.07
263	601995	中金公司	200	12,300.00	0.07
264	601319	中国人保	2,000	11,860.00	0.06
265	300676	华大基因	100	11,860.00	0.06
266	601881	中国银河	1,100	11,858.00	0.06
267	603939	益丰药房	200	11,218.00	0.06

268	002916	深南电路	100	11,113.00	0.06
269	600233	圆通速递	1,100	11,011.00	0.06
270	300558	贝达药业	100	10,824.00	0.06
271	600482	中国动力	600	10,452.00	0.06
272	601231	环旭电子	600	10,086.00	0.05
273	002153	石基信息	420	9,874.20	0.05
274	603658	安图生物	130	9,850.10	0.05
275	688126	沪硅产业-U	335	9,775.30	0.05
276	002939	长城证券	800	8,904.00	0.05
277	600025	华能水电	1,500	8,685.00	0.05
278	601236	红塔证券	600	8,136.00	0.04
279	000800	一汽解放	700	7,574.00	0.04
280	600918	中泰证券	700	7,574.00	0.04
281	600340	华夏幸福	1,390	7,283.60	0.04
282	601808	中海油服	500	7,180.00	0.04
283	002773	康弘药业	300	6,939.00	0.04
284	601698	中国卫通	400	6,476.00	0.03
285	002032	苏泊尔	100	6,379.00	0.03
286	603338	浙江鼎力	100	5,869.00	0.03
287	603233	大参林	100	5,111.00	0.03
288	600299	安迪苏	300	3,588.00	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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	136,733.00	0.69
2	601816	京沪高铁	95,998.00	0.49
3	000725	京东方 A	81,324.00	0.41
4	601166	兴业银行	81,232.00	0.41
5	600036	招商银行	80,046.00	0.41
6	300274	阳光电源	78,918.00	0.40
7	002415	海康威视	69,871.00	0.35
8	601919	中远海控	68,546.00	0.35
9	603259	药明康德	68,090.00	0.35
10	600900	长江电力	61,617.00	0.31
11	600763	通策医疗	59,349.00	0.30
12	000333	美的集团	57,182.00	0.29
13	002812	恩捷股份	53,335.00	0.27
14	601658	邮储银行	52,325.00	0.27
15	300450	先导智能	50,626.00	0.26
16	002049	紫光国微	49,863.00	0.25
17	600276	恒瑞医药	49,668.00	0.25
18	601939	建设银行	49,054.00	0.25
19	601012	隆基股份	48,077.00	0.24
20	600176	中国巨石	42,788.00	0.22

注：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	359,743.00	1.83
2	002415	海康威视	216,669.00	1.10
3	600519	贵州茅台	204,600.00	1.04
4	601166	兴业银行	203,987.00	1.04
5	000858	五粮液	188,796.00	0.96
6	601288	农业银行	167,554.00	0.85
7	002241	歌尔股份	163,949.00	0.83
8	603501	韦尔股份	158,400.00	0.80
9	600009	上海机场	140,107.00	0.71
10	600276	恒瑞医药	137,876.00	0.70
11	600036	招商银行	128,705.00	0.65
12	000651	格力电器	122,829.00	0.62
13	601336	新华保险	121,808.00	0.62
14	000333	美的集团	118,965.00	0.60
15	601628	中国人寿	117,243.00	0.60
16	600016	民生银行	110,193.00	0.56
17	300059	东方财富	109,945.40	0.56
18	601808	中海油服	109,199.00	0.55
19	601012	隆基股份	97,744.00	0.50
20	601138	工业富联	87,110.00	0.44

注：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	21,155,005.18
卖出股票收入（成交）总额	6,351,919.32

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	700,000.00	3.74
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	700,000.00	3.74

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019640	20 国债 10	7,000	700,000.00	3.74

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 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受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现在本报告期内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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

### 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	1,743.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,546.18
5	应收申购款	36,779.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,069.33

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

### 7.12.6 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资股票中不存在流通受限的情况。

### 7.12.7 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
前海联合沪深 300A	1,582	2,727.76	-	-	4,315,320.10	100.00%
前海联合沪深 300C	1,300	5,097.78	5,286,210.54	79.77%	1,340,905.89	20.23%
合计	2,823	3,876.17	5,286,210.54	48.31%	5,656,225.99	51.69%

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

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	前海联合沪深 300A	147,659.18	3.4217%
	前海联合沪深 300C	6,327.89	0.0955%
	合计	153,987.07	1.4072%

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



基金份额总额)。

### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	前海联合沪深 300A	0~10
	前海联合沪深 300C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	前海联合沪深 300A	0~10
	前海联合沪深 300C	-
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	前海联合沪深 300A	前海联合沪深 300C
基金合同生效日 (2016 年 11 月 30 日) 基金份额总额	200,202,690.71	-
本报告期期初基金份额总额	5,360,812.26	6,183,483.82
本报告期基金总申购份额	2,518,119.75	4,475,292.22
减：本报告期基金总赎回份额	3,563,611.91	4,031,659.61
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,315,320.10	6,627,116.43

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

1、本报告期内，王晓耕女士自 2021 年 4 月 15 日起不再担任公司总经理职务，张永任先生自 2021 年 4 月 15 日起代为履行公司总经理职责；吴昱村先生自 2021 年 5 月 26 日起担任公司总经理，张永任先生不再代为履行总经理职责；邹文庆先生自 2021 年 6 月 21 日起担任公司总经理助理。

2、经 2021 年 4 月 12 日召开的公司股东会 2021 年第 1 次临时会议与会股东一致审议通过，段军山先生接替孙学致先生担任公司独立董事。

3、经 2021 年 4 月 17 日召开的公司股东会 2021 年第 2 次临时会议与会股东一致审议通过，王晓耕女士辞去公司第二届董事会董事职务。

4、经 2021 年 5 月 28 日召开的公司股东会 2021 年第 3 次临时会议与会股东一致审议通过，聘任吴昱村先生担任公司第二届董事会董事。

5、经 2021 年 6 月 28 日召开的公司股东会 2021 年定期会议与会股东一致审议通过，乔宗利先生辞去公司第二届董事会董事/副董事长职务，由孙莉女士担任公司第二届董事会董事。

经 2021 年 7 月 16 日召开的公司第二届董事会 2021 年第 10 次临时会议与会董事一致审议通过，孙莉女士担任公司第二届董事会副董事长。

6、中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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

本基金于 2021 年 1 月 30 日公告投资范围新增存托凭证，投资策略相应增加“存托凭证投资

策略”，相关内容请参见 2021 年 1 月 30 日公告。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

因业务开展需要，经本公司股东会 2021 年第 3 次临时会议决议，本基金自 2021 年 5 月 28 日起，改聘致同会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，上述改聘事宜已通知基金托管人或经基金托管人同意。

## 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

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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	
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
五矿证券有限公司	1	889,385.90	7.60%	650.34	6.28%	-
兴业证券股份有限公司	1	2,187,886.37	18.71%	2,037.83	19.67%	-

公司						
华创证券 有限责任 公司	2	2,204, 699.57	18.85%	2,053. 47	19.82%	-
华泰证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华金证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券 有限责任 公司	1	1,767, 928.82	15.12%	1,292. 83	12.48%	-
安信证券 股份有限 公司	1	2,953, 021.80	25.25%	2,750. 10	26.54%	-
广发证券 股份有限 公司	1	1,692, 972.16	14.47%	1,576. 75	15.22%	-
恒泰证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-

注：1、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《交易单元及券商研究服务评价管理办法》：

（1）券商选择标准：

- 1) 实力雄厚，信誉良好；内部管理规范，严格；注册资本符合证监会相关要求；
- 2) 研究实力较强，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；

3) 券商利用其他专业研究咨询机构为公司提供研究与支持服务的, 对该券商研究方面的要求按照上述第 2 点规定执行;

(2) 券商选择程序:

1) 券商研究质量与研究服务评价;

2) 拟定租用对象。由研究发展部根据券商选择标准拟定备选的券商;

3) 上报批准。研究发展部将拟定租用对象上报分管领导批准;

4) 签约。在获得批准后, 按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

2、本报告期内, 新增交易单元: 五矿证券有限公司, 退租交易单元: 无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-	-	-

有限 公司								
兴业 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华创 证券 有限 责任 公司	-	-	500,0 00.00	100.00%	-	-	-	-
华泰 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华金 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛 证券 有限 责任 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

股份 有限 公司								
广发 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	前海联合沪深 300 指数基金 2020 年第 4 季度报告	中国证券报、中国证监会基 金电子披露网站及基金管理 人网站	2021-01-22
2	前海联合基金管理有限公司 关于旗下部分基金投资范围 增加存托凭证并修订相关法 律文件的公告	中国证券报、中国证监会基 金电子披露网站及基金管理 人网站	2021-01-30
3	前海联合基金管理有限公司 关于调整旗下部分基金在直 销柜台首次申购及追加申购 单笔最低金额的公告	中国证券报、中国证监会基 金电子披露网站及基金管理 人网站	2021-02-27
4	关于提醒投资者及时更新已 过期身份证件及其他身份基	中国证券报、中国证监会基 金电子披露网站及基金管理	2021-03-20

	本信息的公告	人网站	
5	关于前海联合沪深 300 指数基金根据指数基金指引及侧袋机制指引修改基金合同部分条款的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-03-29
6	前海联合沪深 300 指数基金 2020 年年度报告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-03-30
7	前海联合沪深 300 指数基金 2021 年第 1 季度报告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-04-22
8	前海联合基金管理有限公司基金改聘会计师事务所公告（一）	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2021-06-01

## § 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	20210101 -20210630	5,286,210.54	-	-	5,286,210.54	48.31%



**产品特有风险**

本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。

注：报告期内申购份额包含红利再投资份额。

**11.2 影响投资者决策的其他重要信息**

本报告期内，本基金管理人根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》、《公开募集投资基金侧袋机制指引（试行）》等法律法规及《新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，并报中国证券监督管理委员会备案，本管理人决定对本基金的法律文件进行修改，有关详细信息请参见本基金管理人于 2021 年 3 月 29 日发布的相关公告。

**§ 12 备查文件目录****12.1 备查文件目录**

- 1、中国证监会核准新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金募集的文件；
- 2、《新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合沪深 300 指数型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告。

**12.2 存放地点**

除上述第 6 项文件存放于基金托管人处外，其他备查文件等文本存放于基金管理人处。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。

在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

新疆前海联合基金管理有限公司

二〇二一年八月三十日