

前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:前海开源基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月24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01月01日起至2021年06月30日止。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 7 |
| 2.4 信息披露方式 | 8 |
| 2.5 其他相关资料 | 8 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 8 |
| 3.2 基金净值表现 | 9 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 13 |
| §5 托管人报告 | 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 | 14 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 14 |
| §6 中期财务会计报告(未经审计) | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 16 |
| 6.3 所有者权益(基金净值)变动表 | 17 |
| 6.4 报表附注 | 19 |
| §7 投资组合报告 | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 40 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 40 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 41 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 42 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 44 |
| 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 | 45 |
| 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 | 45 |
| 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 | 45 |
| 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 | 45 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 45 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 45 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 45 |
| §8 基金份额持有人信息 | 46 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 46 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 47 |

| | |
|---|----|
| 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..... | 47 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 47 |
| §10 重大事件揭示..... | 47 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 47 |
| 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..... | 47 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 48 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 48 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 48 |
| 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..... | 48 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 48 |
| 10.8 其他重大事件..... | 50 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 52 |
| §12 备查文件目录..... | 53 |
| 12.1 备查文件目录..... | 53 |
| 12.2 存放地点..... | 53 |
| 12.3 查阅方式..... | 53 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------------|
| 基金名称 | 前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 前海开源沪港深乐享生活 |
| 基金主代码 | 004320 |
| 基金运作方式 | 契约型普通开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017年05月12日 |
| 基金管理人 | 前海开源基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 30,257,779.57份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | <p>本基金主要通过精选投资于乐享生活主题相关证券，挖掘中国居民消费升级和生活服务业升级中带来的投资机会，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。</p> |
| 投资策略 | <p>本基金的投资策略主要有以下六方面内容：</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在沪深A股、港股、债券、现金等大类资产之间的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 乐享生活主题的定义</p> <p>随着居民人均收入水平的提升以及生活服务业的发展，居民的各方面需求将逐步释放，尤其是对于健康生活和文娱娱乐的要求会逐步提高，由此带来对相关产品和服务需求的增加，并推动提供此类产品和服务的上市公司的快速成长。本基金将围绕健康生活与</p> |

文化娱乐两个方面，重点关注有利于提升民众健康生活及文化娱乐质量方面的行业和个股。本基金所指的乐享生活主题相关证券是指向居民提供优质产品及服务以满足居民健康生活及文化娱乐方面需求的上市公司发行的股票。

(2) 个股投资策略

在个股选择上，除了筛选出与乐享生活主题相关的上市公司外，本基金还将根据上市公司所处行业特点，综合考虑公司质地和业绩弹性等因素，寻找基本面健康、业绩向上弹性较大、估值有优势的公司进行投资。

(3) 港股通标的股票投资策略

本基金可通过沪港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将精选乐享生活主题相关行业的公司，并优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。

3、债券投资策略

在债券投资策略方面，本基金将在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。在宏观环境分析方面，结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定不同类属资产的最优权重。在微观市场定价分析方面，本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。具体投资策略有收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。

4、权证投资策略

本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益

| | |
|--------|--|
| | <p>的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金通过对资产支持证券发行条款的分析、违约概率和提前偿付比率的预估，借用必要的数量模型来谋求对资产支持证券的合理定价，在严格控制风险、充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下，谨慎选择风险调整后收益较高的品种进行投资。</p> <p>本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。</p> <p>本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。</p> |
| 业绩比较基准 | $\text{沪深300指数收益率} \times 50\% + \text{恒生指数收益率} \times 20\% + \text{中证全债指数收益率} \times 30\%$ |
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。</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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 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 |
| | | 李申 |
| | | 021-60637102 |
| | | lishen.zh@ccb.com |

| | | |
|--------|---|-------------------|
| 客户服务电话 | 4001666998 | 021-60637111 |
| 传真 | 0755-83181169 | 021-60635778 |
| 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） | 北京市西城区金融大街25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 | 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 |
| 邮政编码 | 518040 | 100033 |
| 法定代表人 | 王兆华 | 田国立 |

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期 |
|---------------|----------------------------|
| | (2021年01月01日- 2021年06月30日) |
| 本期已实现收益 | 3,074,872.85 |
| 本期利润 | 8,941,054.98 |

| | |
|----------------------|-----------------------|
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2924 |
| 本期加权平均净值利润率 | 17.26% |
| 本期基金份额净值增长率 | 11.71% |
| 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 | 23,914,991.61 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.7904 |
| 期末基金资产净值 | 55,959,242.48 |
| 期末基金份额净值 | 1.8494 |
| 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 | 84.94% |

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 2.93% | 1.65% | -1.16% | 0.51% | 4.09% | 1.14% |
| 过去三个月 | 18.26% | 1.62% | 2.53% | 0.61% | 15.73% | 1.01% |
| 过去六个月 | 11.71% | 2.03% | 2.25% | 0.83% | 9.46% | 1.20% |
| 过去一年 | 49.24% | 1.76% | 17.45% | 0.82% | 31.79% | 0.94% |
| 过去三年 | 75.85% | 1.35% | 29.59% | 0.87% | 46.26% | 0.48% |
| 自基金合同 | 84.94% | 1.20% | 39.07% | 0.81% | 45.87% | 0.39% |

| | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|

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

前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合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
(2017年05月12日-2021年06月30日)



§ 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、广州设立分公司。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95只开放式基金，资产管理规模超过1283亿元。

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 | | |
| 吴国清 | 本基金的基金经理、公司执行投资总监 | 2017-05-12 | - | 14年 | 吴国清先生，清华大学博士研究生。历任南方基金管理有限公司研究员、基金经理助理、投资经理。2015年8月加入前海开源基金管理有限公司，现任公司执行投资总监。 |

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合投资策略需要，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价出现1次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况，基金经理按规定履行了审批程序。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年上半年，受去年疫情爆发的影响下，有一个较大幅度的低基数推升效应，中国经济增长在一季度达到了同比 18.3%的历史高位。从全球经济来看，上半年美欧中日等主要经济体制造业 PMI 指数连续多月站上荣枯线，约占世界经济总量40%的中美经济高增长奠定了世界经济整体走势，因此世界经济复苏在二季度迎来高点，中国经济增长在二季度也达到了 7.9%的高速增长。

1-6月规模以上工业增加值同比增长15.9%，两年平均增长7.0%。6月出口（美元计价，下同）同比增长32.2%（5月同比27.9%），进口同比增长36.7%（5月同比51.1%），主要得益于大宗商品价格持续上行，并且世界经济恢复略有放缓，但中国出口仍然受到全球经济恢复的持续拉动。1-6月固定资产投资（不含农户）同比增12.6%，比2019年1-6月增长9.1%，两年平均增长4.4%。6月社会消费品零售总额同比增长12.1%，比2019年6月增长10.0%，两年平均增速为4.9%。今年上半年与2019年同期相比均实现较快增长，从环比增速看，保持基本稳定；从两年平均增速看，多数生产需求指标还有所加快；与此同时，就业形势总体稳定，市场活力逐步提升，发展预期向好，内生动力加强。

流动性方面，央行决定于7月15日下调金融机构存款准备金率0.5个百分点。央行表示，货币政策在今年上半年已经基本回到疫情前的常态，稳健货币政策取向没有改变，此次降准是货币政策回归常态后的常规操作。

市场方面，上半年三大指数均有涨幅，其中：创业板指上涨最多为17.22%，中小100上涨3.66%，上证指数上涨3.40%。分行业来看：电气设备、钢铁、化工涨幅居于前三，分别为23.83%、23.62%、21.46%；传媒、农林牧渔、国防军工、房地产、非银金融、家用电器表现垫底，跌幅依次在-7%~-16%之间。

上半年，本基金维持高仓位运作，基于对宏观经济、市场流动性，行业景气以及估值的综合考虑，主要配置了医药、食品饮料等板块，获得了一定的收益。

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港深乐享生活基金份额净值为1.8494元，本报告期内，基金份额净值增长率为11.71%，同期业绩比较基准收益率为2.25%。

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2021年下半年，全球经济复苏分化，中、美、欧等经济体陆续恢复，但印度、拉美、东南亚等部分新兴经济体仍深陷疫情。美国经济进入复苏的中后段，要警惕美联储货币政策转向，全球流动性拐点渐行渐近，大宗商品价格快速上涨阶段或已结束，短期可能会继续高位盘整。

中国经济周期正从复苏转入过热和滞胀，2021年一季度前后是经济顶，随后回归潜在增长率，增速前高后低。房地产和出口是疫后支撑经济增长的主要力量，当前均面临下行压力；消费、制造业投资持续恢复，但受居民收入、就业形势不佳、成本抬升压制利润等影响，难以对冲。上半年政府专项债发放进度缓慢，或在四季度加快发行托底经济。政策层面，货币政策正常化、财政扩张力度放缓、房地产金融政策收紧。下半年中国经济复苏面临下行压力，但韧性较强。与此同时，随着经济放缓和通胀高点已过，市场对货币政策收紧的预期也将逐步缓解。

基于上述背景，我们认为下半年中国股市将以震荡为主，结构性机会更多一些。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会、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。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本基金本报告期内，从2021年02月19日至2021年03月23日连续23个工作日基金资产净值低于五千万元。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合型证券投资基金

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 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 5,907,200.26 | 8,723,365.98 |
| 结算备付金 | | 148,665.27 | 8,867.35 |
| 存出保证金 | | 18,346.83 | 26,385.02 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 50,580,127.20 | 50,589,530.62 |
| 其中：股票投资 | | 50,580,127.20 | 50,589,530.62 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - |

| | | | |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 投资 | | | |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 518.97 | 668.13 |
| 应收股利 | | 6.00 | - |
| 应收申购款 | | 187,017.00 | 2,294.05 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 56,841,881.53 | 59,351,111.15 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021年06月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 2,352,910.87 |
| 应付赎回款 | | 704,305.86 | 2,118,481.56 |
| 应付管理人报酬 | | 67,347.34 | 69,551.56 |
| 应付托管费 | | 11,224.56 | 11,591.92 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 43,610.80 | 33,416.76 |
| 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 | 56,150.49 | 174,886.92 |
| 负债合计 | | 882,639.05 | 4,760,839.59 |
| 所有者权益: | | | |

| | | | |
|------------|----------|---------------|---------------|
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 30,257,779.57 | 32,972,850.17 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 25,701,462.91 | 21,617,421.39 |
| 所有者权益合计 | | 55,959,242.48 | 54,590,271.56 |
| 负债和所有者权益总计 | | 56,841,881.53 | 59,351,111.15 |

注：报告截止日2021年6月30日，前海开源沪港深乐享生活基金份额净值1.8494元，基金份额总额30,257,779.57份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合型证券投资基金

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202 0年06月30日 |
|-------------------|----------------|-----------------------------------|--|
| 一、收入 | | 9,569,904.87 | 12,926,621.15 |
| 1. 利息收入 | | 12,801.73 | 50,315.09 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 12,801.73 | 50,315.09 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 3,523,159.14 | 15,660,728.92 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 3,395,798.20 | 15,161,754.81 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产支持证券投资 收益 | 6.4.7.14. 5 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|--------------|---------------|
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.17 | 127,360.94 | 498,974.11 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 5,866,182.13 | -3,166,337.53 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.19 | 167,761.87 | 381,914.67 |
| 减：二、费用 | | 628,849.89 | 1,180,729.69 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 384,960.42 | 537,775.76 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 64,160.13 | 89,629.21 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.20 | 122,988.38 | 465,252.93 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | - | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.21 | 56,740.96 | 88,071.79 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 8,941,054.98 | 11,745,891.46 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 8,941,054.98 | 11,745,891.46 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合型证券投资基金

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) | 32,972,850.17 | 21,617,421.39 | 54,590,271.56 |
| 二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润) | - | 8,941,054.98 | 8,941,054.98 |
| 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) | -2,715,070.60 | -4,857,013.46 | -7,572,084.06 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 26,670,318.16 | 16,984,061.11 | 43,654,379.27 |
| 2. 基金赎回 款 | -29,385,388.76 | -21,841,074.57 | -51,226,463.33 |
| 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) | 30,257,779.57 | 25,701,462.91 | 55,959,242.48 |
| 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) | 102,285,671.83 | 10,560,067.79 | 112,845,739.62 |
| 二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润) | - | 11,745,891.46 | 11,745,891.46 |
| 三、本期基金份额交 易产生的基金净值 变动数(净值减少以 | -42,323,943.73 | -7,962,153.14 | -50,286,096.87 |

| | | | |
|--|-----------------|----------------|-----------------|
| “-”号填列) | | | |
| 其中: 1. 基金申购款 | 72,799,789.56 | 11,244,240.15 | 84,044,029.71 |
| 2. 基金赎回款 | -115,123,733.29 | -19,206,393.29 | -134,330,126.58 |
| 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) | 59,961,728.10 | 14,343,806.11 | 74,305,534.21 |

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:

秦亚峰

何璁

傅智

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合型证券投资基金(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[2016]1819号《关于准予前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由前海开源基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合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254,540,858.87元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2017]01300015号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年5月12日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为254,581,067.40份基金份额,其中认购资金利息折合40,208.53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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交

易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以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:股票投资占基金资产的比例为0-95%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0-95%,投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-95%),投资于乐享生活主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%。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 \times 50%+恒生指数收益率 \times 20%+中证全债指数收益率 \times 30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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的转让收入免征增值税。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，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 | 5,907,200.26 |
| 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 | 5,907,200.26 |

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 | 38,241,947.59 | 50,580,127.20 | 12,338,179.61 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债 交易所市 | - | - | - |

| | | | | |
|--------|-------|---------------|---------------|---------------|
| 券 | 场 | | | |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 38,241,947.59 | 50,580,127.20 | 12,338,179.61 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年06月30日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息 | 451.21 |
| 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 | 60.29 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |

| | |
|----------|--------|
| 应收出借证券利息 | - |
| 其他 | 7.47 |
| 合计 | 518.97 |

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 43,610.80 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 43,610.80 |

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 | 1,602.52 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 54,547.97 |
| 合计 | 56,150.49 |

6.4.7.9 实收基金

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 | 32,972,850.17 | 32,972,850.17 |
| 本期申购 | 26,670,318.16 | 26,670,318.16 |

| | | |
|---------------|----------------|----------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -29,385,388.76 | -29,385,388.76 |
| 本期末 | 30,257,779.57 | 30,257,779.57 |

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末 | 21,953,769.09 | -336,347.70 | 21,617,421.39 |
| 本期利润 | 3,074,872.85 | 5,866,182.13 | 8,941,054.98 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,113,650.33 | -3,743,363.13 | -4,857,013.46 |
| 其中：基金申购款 | 20,603,041.67 | -3,618,980.56 | 16,984,061.11 |
| 基金赎回款 | -21,716,692.00 | -124,382.57 | -21,841,074.57 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 23,914,991.61 | 1,786,471.30 | 25,701,462.91 |

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 | 11,883.92 |
| 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 | 556.62 |
| 其他 | 361.19 |
| 合计 | 12,801.73 |

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年01月01日至2021年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 49,658,389.84 |
| 减：卖出股票成本总额 | 46,262,591.64 |

| | |
|----------|--------------|
| 买卖股票差价收入 | 3,395,798.20 |
|----------|--------------|

6.4.7.13 基金投资收益

无。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|-------------------------|
| | 2021年01月01日至2021年06月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 127,360.94 |
| 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 | 127,360.94 |

6.4.7.18 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 | 5,866,182.13 |
| ——股票投资 | 5,866,182.13 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 5,866,182.13 |

6.4.7.19 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 | 166,791.67 |
| 转换费收入 | 970.20 |
| 合计 | 167,761.87 |

6.4.7.20 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 | 122,988.38 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 122,988.38 |

6.4.7.21 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 | 39,671.58 |
| 证券出借违约金 | - |
| 汇划手续费 | 1,832.99 |
| 其他费用 | 360.00 |
| 合计 | 56,740.96 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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 | 384,960.42 | 537,775.76 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 75,356.75 | 187,689.49 |

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1.50%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 × 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 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 | 64,160.13 | 89,629.21 |

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 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 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 5,907,200.26 | 11,883.92 | 10,752,738.06 | 45,332.96 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|----------|----------|----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 605287 | 德才股份 | 2021-06-28 | 2021-07-06 | 新股未上市 | 31.56 | 31.56 | 349 | 11,014.4 | 11,014.4 | - |

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。

④基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

于2021年6月30日，本基金未持有债券、资产支持证券和同业存单投资（2020年12月31日：同）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2021年6月30日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变

现价值。于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未超过经确认的当日净赎回金额。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2021年0 6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 | 5,907,200.26 | - | - | - | 5,907,200.26 |
| 结算备付金 | 148,665.27 | - | - | - | 148,665.27 |
| 存出保证金 | 18,346.83 | - | - | - | 18,346.83 |
| 交易性 | - | - | - | 50,580,127.20 | 50,580,127.20 |

| | | | | | |
|---------------------|--------------|------|------|---------------|---------------|
| 金融资产 | | | | | |
| 应收利息 | - | - | - | 518.97 | 518.97 |
| 应收股利 | - | - | - | 6.00 | 6.00 |
| 应收申购款 | 100.00 | - | - | 186,917.00 | 187,017.00 |
| 资产总计 | 6,074,312.36 | - | - | 50,767,569.17 | 56,841,881.53 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 704,305.86 | 704,305.86 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 67,347.34 | 67,347.34 |
| 应付托管费 | - | - | - | 11,224.56 | 11,224.56 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 43,610.80 | 43,610.80 |
| 其他负债 | - | - | - | 56,150.49 | 56,150.49 |
| 负债总计 | - | - | - | 882,639.05 | 882,639.05 |
| 利率敏感度缺口 | 6,074,312.36 | - | - | 49,884,930.12 | 55,959,242.48 |
| 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 | 8,723,365.98 | - | - | - | 8,723,365.98 |
| 结算备付金 | 8,867.35 | - | - | - | 8,867.35 |
| 存出保证金 | 26,385.02 | - | - | - | 26,385.02 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 50,589,530.62 | 50,589,530.62 |
| 应收利息 | - | - | - | 668.13 | 668.13 |
| 应收申购款 | - | - | - | 2,294.05 | 2,294.05 |

| | | | | | |
|---------|--------------|---|---|---------------|---------------|
| 资产总计 | 8,758,618.35 | - | - | 50,592,492.80 | 59,351,111.15 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 2,352,910.87 | 2,352,910.87 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 2,118,481.56 | 2,118,481.56 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 69,551.56 | 69,551.56 |
| 应付托管费 | - | - | - | 11,591.92 | 11,591.92 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 33,416.76 | 33,416.76 |
| 其他负债 | - | - | - | 174,886.92 | 174,886.92 |
| 负债总计 | - | - | - | 4,760,839.59 | 4,760,839.59 |
| 利率敏感度缺口 | 8,758,618.35 | - | - | 45,831,653.21 | 54,590,271.56 |

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，本基金未持有交易性债券投资(2020年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年06月30日 |
|----|--------------------|
| | |

| | 美元折合人民币 | 港币折合人民币 | 其他币种折合人民币 | 合计 |
|---------------|---------------------|----------|-----------|----------|
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 应收股利 | - | 6.00 | - | 6.00 |
| 资产合计 | - | 6.00 | - | 6.00 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 6.00 | - | 6.00 |
| 项目 | 上年度末 2020年12月31日 | | | |
| | 美元折合人民币 | 港币折合人民币 | 其他币种折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 交易性金融资产 | - | 2,259.80 | - | 2,259.80 |
| 资产合计 | - | 2,259.80 | - | 2,259.80 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 2,259.80 | - | 2,259.80 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率外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 |
| | 港币对人民币升值5% | 0.30 | 112.99 |
| | 港币对人民币贬值5% | -0.30 | -112.99 |

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上

市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 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 | 50,580,127.20 | 90.39 | 50,589,530.62 | 92.67 |
| 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 | 50,580,127.20 | 90.39 | 50,589,530.62 | 92.67 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | |
|----|----------------------|
| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 |
|----|----------------------|

| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
|----|------------|-----------------------------|---------------------|
| | | 本期末 2021年06月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
| | 业绩比较基准上升5% | 2,871,320.18 | 2,495,329.68 |
| | 业绩比较基准下降5% | -2,871,320.18 | -2,495,329.68 |

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 | 50,580,127.20 | 88.98 |
| | 其中：股票 | 50,580,127.20 | 88.98 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 6,055,865.53 | 10.65 |
| 8 | 其他各项资产 | 205,888.80 | 0.36 |
| 9 | 合计 | 56,841,881.53 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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 | 35,802,358.33 | 63.98 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,200.24 | 0.01 |
| E | 建筑业 | 11,014.44 | 0.02 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,502,092.40 | 2.68 |
| J | 金融业 | 32,338.89 | 0.06 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,156,818.70 | 3.85 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 5,367,244.20 | 9.59 |
| 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 | 5,704,060.00 | 10.19 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 50,580,127.20 | 90.39 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 | 300896 | 爱美客 | 6,160 | 4,859,500.80 | 8.68 |
| 2 | 300760 | 迈瑞医疗 | 8,500 | 4,080,425.00 | 7.29 |
| 3 | 688363 | 华熙生物 | 12,921 | 3,590,229.06 | 6.42 |
| 4 | 603259 | 药明康德 | 20,280 | 3,175,645.20 | 5.67 |
| 5 | 688366 | 昊海生科 | 15,157 | 3,172,360.10 | 5.67 |
| 6 | 600763 | 通策医疗 | 7,200 | 2,959,200.00 | 5.29 |
| 7 | 600519 | 贵州茅台 | 1,400 | 2,879,380.00 | 5.15 |
| 8 | 300347 | 泰格医药 | 14,200 | 2,744,860.00 | 4.91 |
| 9 | 000858 | 五粮液 | 9,200 | 2,740,588.00 | 4.90 |
| 10 | 688169 | 石头科技 | 1,846 | 2,327,806.00 | 4.16 |
| 11 | 688029 | 南微医学 | 7,158 | 2,231,077.02 | 3.99 |
| 12 | 600809 | 山西汾酒 | 4,900 | 2,195,200.00 | 3.92 |
| 13 | 300759 | 康龙化成 | 10,100 | 2,191,599.00 | 3.92 |
| 14 | 601888 | 中国中免 | 7,187 | 2,156,818.70 | 3.85 |
| 15 | 300957 | 贝泰妮 | 7,700 | 2,092,013.00 | 3.74 |
| 16 | 600436 | 片仔癀 | 4,400 | 1,972,520.00 | 3.52 |
| 17 | 688016 | 心脉医疗 | 3,841 | 1,746,157.01 | 3.12 |
| 18 | 300496 | 中科创达 | 9,500 | 1,492,070.00 | 2.67 |
| 19 | 603392 | 万泰生物 | 4,480 | 1,161,126.40 | 2.07 |
| 20 | 002511 | 中顺洁柔 | 26,100 | 719,055.00 | 1.28 |
| 21 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,077 | 32,338.89 | 0.06 |
| 22 | 001207 | 联科科技 | 648 | 21,455.28 | 0.04 |
| 23 | 001208 | 华菱线缆 | 1,742 | 13,465.66 | 0.02 |
| 24 | 605287 | 德才股份 | 349 | 11,014.44 | 0.02 |
| 25 | 603171 | 税友股份 | 522 | 10,022.40 | 0.02 |
| 26 | 605011 | 杭州热电 | 473 | 4,200.24 | 0.01 |

注：所用证券代码采用当地市场代码。

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 | 300760 | 迈瑞医疗 | 3,391,866.00 | 6.21 |
| 2 | 688366 | 昊海生科 | 2,619,231.28 | 4.80 |
| 3 | 688169 | 石头科技 | 2,253,966.00 | 4.13 |
| 4 | 300347 | 泰格医药 | 2,224,755.00 | 4.08 |
| 5 | 000661 | 长春高新 | 2,204,810.00 | 4.04 |
| 6 | 688363 | 华熙生物 | 2,151,569.86 | 3.94 |
| 7 | 600436 | 片仔癀 | 2,104,808.00 | 3.86 |
| 8 | 300759 | 康龙化成 | 2,085,087.00 | 3.82 |
| 9 | 300896 | 爱美客 | 2,081,722.00 | 3.81 |
| 10 | 300957 | 贝泰妮 | 2,079,633.00 | 3.81 |
| 11 | 688029 | 南微医学 | 1,779,013.35 | 3.26 |
| 12 | 600763 | 通策医疗 | 1,660,363.00 | 3.04 |
| 13 | 603816 | 顾家家居 | 1,627,853.00 | 2.98 |
| 14 | 688016 | 心脉医疗 | 1,625,472.81 | 2.98 |
| 15 | 000858 | 五粮液 | 1,616,525.00 | 2.96 |
| 16 | 300122 | 智飞生物 | 1,458,446.00 | 2.67 |
| 17 | 603392 | 万泰生物 | 1,168,221.00 | 2.14 |
| 18 | 603233 | 大参林 | 1,094,407.00 | 2.00 |
| 19 | 603259 | 药明康德 | 1,089,747.00 | 2.00 |
| 20 | 601888 | 中国中免 | 1,065,658.00 | 1.95 |

注：①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。

②所用证券代码采用当地市场代码。

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 | 000661 | 长春高新 | 4,488,910.00 | 8.22 |
| 2 | 300122 | 智飞生物 | 4,370,613.00 | 8.01 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 3 | 601888 | 中国中免 | 2,840,953.00 | 5.20 |
| 4 | 600809 | 山西汾酒 | 2,651,774.00 | 4.86 |
| 5 | 600276 | 恒瑞医药 | 2,253,789.80 | 4.13 |
| 6 | 002475 | 立讯精密 | 2,206,799.00 | 4.04 |
| 7 | 002027 | 分众传媒 | 2,040,690.00 | 3.74 |
| 8 | 603259 | 药明康德 | 1,786,432.00 | 3.27 |
| 9 | 300463 | 迈克生物 | 1,784,789.63 | 3.27 |
| 10 | 300760 | 迈瑞医疗 | 1,761,568.00 | 3.23 |
| 11 | 603233 | 大参林 | 1,756,404.00 | 3.22 |
| 12 | 000858 | 五粮液 | 1,716,789.00 | 3.14 |
| 13 | 603816 | 顾家家居 | 1,617,098.00 | 2.96 |
| 14 | 300639 | 凯普生物 | 1,464,653.22 | 2.68 |
| 15 | 600519 | 贵州茅台 | 1,463,010.00 | 2.68 |
| 16 | 002555 | 三七互娱 | 1,307,143.00 | 2.39 |
| 17 | 002241 | 歌尔股份 | 1,263,403.38 | 2.31 |
| 18 | 300896 | 爱美客 | 1,258,140.00 | 2.30 |
| 19 | 603658 | 安图生物 | 1,203,909.80 | 2.21 |
| 20 | 300638 | 广和通 | 1,167,127.00 | 2.14 |
| 21 | 300482 | 万孚生物 | 1,112,519.60 | 2.04 |

注：①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。

②所用证券代码采用当地市场代码。

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 | 40,387,006.09 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 49,658,389.84 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 18,346.83 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 6.00 |
| 4 | 应收利息 | 518.97 |
| 5 | 应收申购款 | 187,017.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 205,888.80 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|-----------|---------------|--------|---------------|--------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 1,939 | 15,604.84 | 14,885,775.57 | 49.20% | 15,372,004.00 | 50.80% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 189.56 | 0.0006% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2017年05月12日)基金份额总额 | 254,581,067.40 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 32,972,850.17 |
| 本报告期基金总申购份额 | 26,670,318.16 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 29,385,388.76 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 30,257,779.57 |

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

(1) 本基金管理人于2021年3月13日发布公告，前海开源基金管理有限公司总经理贾红波先生离任，并由董事长王兆华先生代任总经理一职

(2) 本基金管理人于2021年5月21日发布公告，曲扬先生、邱杰先生自2021年5月19日起担任前海开源基金管理有限公司副总经理

(3) 本基金管理人于2021年5月22日发布公告，何隼先生自2021年5月21日起担任前海开源基金管理有限公司副总经理

上述事项经前海开源基金管理有限公司董事会审议通过，并已按相关法律法规的规定进行备案。具体情况详见基金管理人在中国证监会规定媒介发布的相关公告；

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 红塔证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | 42,398,499.55 | 47.41% | 31,006.46 | 47.41% | - |
| 华鑫证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞信方正 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------|---|---|---|---|---|---|
| 太平洋证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西藏东方财富证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------|---|---------------|--------|-----------|--------|---|
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | 47,022,179.59 | 52.59% | 34,387.63 | 52.59% | - |
| 海通证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源西部 | 4 | - | - | - | - | - |

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

A：选择标准

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

B：选择流程

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|------|--------|--------|
|----|------|--------|--------|

| | | | |
|---|---|-----------|------------|
| 1 | 前海开源基金管理有限公司关于暂停北京恒宇天泽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 | 2021-01-15 |
| 2 | 前海开源基金管理有限公司关于暂停北京晟视天下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 | 2021-01-15 |
| 3 | 前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-01-22 |
| 4 | 前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新（20210312更新） | 中国证监会规定媒介 | 2021-03-12 |
| 5 | 前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（20210312更新） | 中国证监会规定媒介 | 2021-03-12 |
| 6 | 前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-03-31 |
| 7 | 前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-04-22 |
| 8 | 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珠海盈米基金销售有限公司办理业务最低限额的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-04-28 |
| 9 | 前海开源基金管理有限公司关于终止与深圳市小牛基金销售有限公司合作关系的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2021-04-29 |

| | | | |
|----|---|-----------|------------|
| 10 | 关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过诺亚正行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 | 2021-06-03 |
|----|---|-----------|------------|

§ 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 | 20210429 - 20210511 | 0.00 | 6,586,088.79 | 0.00 | 6,586,088.79 | 21.77% |
| | 2 | 20210519 - 20210523 | 0.00 | 6,586,088.79 | 0.00 | 6,586,088.79 | 21.77% |
| | 3 | 20210528 - 20210630 | 0.00 | 6,586,088.79 | 0.00 | 6,586,088.79 | 21.77% |
| | 4 | 20210101 - 20210428 | 9,746,186.38 | 0.00 | 9,746,186.38 | 0.00 | 0.00% |
| | 5 | 20210106 - 20210323 | 6,241,070.81 | 0.00 | 0.00 | 6,241,070.81 | 20.63% |
| | 6 | 20210429 - 20210511 | 6,241,070.81 | 0.00 | 0.00 | 6,241,070.81 | 20.63% |
| | 7 | 20210602 - 20210607 | 6,241,070.81 | 0.00 | 0.00 | 6,241,070.81 | 20.63% |
| | 8 | 20210618 - 20210630 | 6,241,070.81 | 0.00 | 0.00 | 6,241,070.81 | 20.63% |

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据业务发展需要，并经前海开源基金管理有限公司股东会批准，本公司本报告期内设立广州分公司，具体情况详见基金管理人在中国证监会规定媒介发布的相关公告。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

(1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(2) 《前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(3) 《前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合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

(5) 前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

(2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人前海开源基金管理有限公司，客户服务电话：4001-666-998

(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

二〇二一年八月三十一日