

前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金

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:中国银河证券股份有限公司

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银河证券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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	64
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	64
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	64
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	64
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
7.12 投资组合报告附注	65
§8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 期末上市基金前十名持有人	67

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
8.4 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.....	68
§9 开放式基金份额变动.....	68
§10 重大事件揭示.....	68
10.1 基金份额持有人大会决议.....	68
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.....	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
10.4 基金投资策略的改变.....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
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.....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
10.8 其他重大事件.....	69
§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.....	72
§12 备查文件目录.....	72
12.1 备查文件目录.....	72
12.2 存放地点.....	73
12.3 查阅方式.....	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	前海开源中证500等权ETF
场内简称	500ETFEW
基金主代码	515590
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019年11月14日
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	中国银河证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	30,113,665.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020-01-20

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以采取包括抽样复制在内的其他指数投资技术适当对投资组合管理进行变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> <p>在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。如</p>

因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

1、股票投资策略

(1) 股票投资组合的构建

本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

(2) 股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况，对其进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。

2、金融衍生品投资策略

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

3、资产支持证券投资策略

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

	<p>选择风险调整后收益较高的品种进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>4、融资及转融通证券出借业务的投资策略</p> <p>本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。</p> <p>5、未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>
业绩比较基准	中证500等权重指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法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。

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	中国银河证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌
	联系电话	0755-88601888
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com
客户服务电话	4001666998	95551；400-888-8888
传真	0755-83181169	010-80928078
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾	中国北京西城区金融大街35

	一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	号2-6层
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	北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦
邮政编码	518040	100073
法定代表人	王兆华	陈共炎

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 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	6,461,137.34
本期利润	4,083,846.20
加权平均基金份额本期利润	0.1254
本期加权平均净值利润率	8.98%
本期基金份额净值增长率	9.57%

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	14,822,251.72
期末可供分配基金份额利润	0.4922
期末基金资产净值	44,935,916.72
期末基金份额净值	1.4922
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	49.22%

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	1.49%	0.64%	0.27%	0.61%	1.22%	0.03%
过去三个月	9.25%	0.61%	6.80%	0.61%	2.45%	0.00%
过去六个月	9.57%	0.90%	6.58%	0.90%	2.99%	0.00%
过去一年	28.32%	1.17%	16.14%	1.19%	12.18%	-0.02%
自基金合同生效起至今	49.22%	1.29%	35.17%	1.33%	14.05%	-0.04%

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

前海开源中证500等权重交易型开放式指数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
(2019年11月14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）	证券	说明

		期限		从业年限	
		任职日期	离任日期		
梁溥森	本基金的基金经理	2020-05-07	-	7年	梁溥森先生，金融学硕士。曾任招商基金基金核算部基金会计，2015年6月加入前海开源基金，现任公司量化投资部基金经理。

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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年上半年本基金的跟踪指数表现良好呈现了稳步上行的态势，本基金在上半年取得了9.57%的涨幅，相对于基准指数超额收益2.99%。受基准指数半年度调整影响，本基金对持仓成分股随之进行了调整。伴随着宏观数据转弱，市场情绪在一季度的亢奋之后逐渐回归理性。这种情况下成长属性更强的500等权指数由于业绩弹性更大，相对估值水平更低（PE-TTM在历史分位较低），具有较高的相对投资价值。

作为一个被动指数基金，本基金将依然遵循一贯的投资逻辑，实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。本基金将持续关注成分股的基本面变化情况，通过监控成分股负面信息及其影响，在不影响本基金投资运作的情况下及时对地雷股进行出清，并力争通过多种方式对基金业绩进行一定的增厚，积跬步以致千里，力争在紧密跟踪业绩比较基准并追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的同时，能够为持有人贡献一定的业绩正偏离。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源中证500等权ETF基金份额净值为1.4922元，本报告期内，基金份额净值增长率为9.57%，同期业绩比较基准收益率为6.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021年上半年各国加快推进新冠疫苗接种，疫情对经济的边际影响逐步减弱，国内经济继续保持稳定恢复，虽然疫情偶有反复，但整体上经济恢复态势良好。站在当前时点进行展望，从近期社融、信贷数据来看，市场对经济前景的看法不如此前乐观，尤其是社融存量同比增速的回落更是值得引起警惕。在这种市场对国内经济增长的预期已经触顶回落的情况下，带动股指上涨的盈利因子开始转弱。受此影响，A股在上半年迎来了一波过山车行情，但局部热点层出不穷。

总体来看，我们认为A股受益于中国经济率先企稳反弹、全球经济基本面渐次向好、强劲的盈利增长、有利的资金流入条件、人民币汇率升值预期等利好因素叠加的影响，中长期配置价值仍然较高。

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01月21日至2021年03月17日连续35个工作日、从2021年03月23日至2021年05月18日连续37个工作日、从2021年05月20日至2021年06月30日连续29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

本报告期内，中国银河证券股份有限公司在本基金的托管过程中，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，本托管人按照《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支以及利润分配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。

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

本托管人依法复核前海开源基金管理有限公司编制和披露的前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金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，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金

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	1,060,855.96	3,182,313.18
结算备付金		790,187.63	538,423.79
存出保证金		411,560.67	608,107.83
交易性金融资产	6.4.7.2	42,828,332.26	53,908,009.69
其中：股票投资		41,810,032.26	53,103,489.69
基金投资		-	-
债券投资		1,018,300.00	804,520.00
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		-	10,306.76
应收利息	6.4.7.5	4,693.81	17,915.39
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		45,095,630.33	58,265,076.64
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		51,274.09	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,467.90	7,780.96
应付托管费		1,822.62	2,593.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	25,534.29	18,200.76
应交税费		4,394.88	0.04
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	71,219.83	882,833.97
负债合计		159,713.61	911,409.36
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	30,113,665.00	42,113,665.00
未分配利润	6.4.7.10	14,822,251.72	15,240,002.28
所有者权益合计		44,935,916.72	57,353,667.28
负债和所有者权益总计		45,095,630.33	58,265,076.64

注：报告截止日2021年6月30日，前海开源中证500等权ETF基金份额净值1.4922元，基金份额总额30,113,665.00份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金

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		4,284,942.20	33,890,450.39
1. 利息收入		8,645.48	68,485.11

其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,913.96	68,457.62
债券利息收入		5,731.52	27.49
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）		6,587,491.40	61,719,208.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,932,149.32	60,597,294.12
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.6	5,017.68	47,076.14
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	284,200.01	-
股利收益	6.4.7.17	366,124.39	1,074,837.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-2,377,291.14	-29,921,947.72
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	66,096.46	2,024,704.93
减：二、费用		201,096.00	1,340,564.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	33,765.51	209,646.39
2. 托管费	6.4.10.2. 2	11,255.16	69,882.13
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	83,832.28	887,603.17

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,023.22	0.09
7. 其他费用	6.4.7.21	71,219.83	173,432.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,083,846.20	32,549,886.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,083,846.20	32,549,886.19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金

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）	42,113,665.00	15,240,002.28	57,353,667.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,083,846.20	4,083,846.20
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）	-12,000,000.00	-4,501,596.76	-16,501,596.76
其中：1. 基金申购款	20,000,000.00	8,117,841.29	28,117,841.29
2. 基金赎回款	-32,000,000.00	-12,619,438.05	-44,619,438.05
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)	30,113,665.00	14,822,251.72	44,935,916.72
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)	760,113,665.00	39,731,884.94	799,845,549.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	32,549,886.19	32,549,886.19
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)	-658,000,000.00	-55,648,552.55	-713,648,552.55
其中: 1. 基金申购款	28,000,000.00	1,565,778.29	29,565,778.29
2. 基金赎回款	-686,000,000.00	-57,214,330.84	-743,214,330.84
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)	102,113,665.00	16,633,218.58	118,746,883.58

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

何隽

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

前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金(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[2019]1538号《关于准予前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,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《前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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760,113,665.00元(含募集股票市值),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(2019)第0649号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2019年11月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为760,113,665.00份,无认购资金利息折份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司,基金托管人为中国银河证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]10号审核同意,本基金760,113,665.00份基金份额于2020年1月20日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股。为更好的实现投资目标,可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、政府支持机构债券、政府支持债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:在完成建仓后,投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%。本基金的业绩比较基准为:中证500等权重指数收益率。

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》、《前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

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

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

对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	1,060,855.96
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	1,060,855.96	

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	39,294,831.93	41,810,032.26	2,515,200.33

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,017,400.00	1,018,300.00	900.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,017,400.00	1,018,300.00	900.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		40,312,231.93	42,828,332.26	2,516,100.33

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,538,800.00	-	-	-
股指期货	2,538,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,538,800.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。于2021年6月30日，本基金持有2手中证500股指期货IC2112买入合约，合约市值2,608,480.00元，公允价值变动69,680.00元。

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	96.49
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	49.60
应收债券利息	4,526.82
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	20.90
合计	4,693.81

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	25,534.29
银行间市场应付交易费用	-
合计	25,534.29

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	-	
应付证券出借违约金	-	
预提费用	64,466.77	
应付指数使用费	6,753.06	
合计	71,219.83	

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	42,113,665.00	42,113,665.00
本期申购	20,000,000.00	20,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-32,000,000.00	-32,000,000.00
本期末	30,113,665.00	30,113,665.00

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	23,347,318.58	-8,107,316.30	15,240,002.28
本期利润	6,461,137.34	-2,377,291.14	4,083,846.20
本期基金份额交易产生的变动数	-7,078,100.12	2,576,503.36	-4,501,596.76
其中：基金申购款	12,872,577.80	-4,754,736.51	8,117,841.29
基金赎回款	-19,950,677.92	7,331,239.87	-12,619,438.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,730,355.80	-7,908,104.08	14,822,251.72

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	2,040.82
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	548.11
其他	325.03
合计	2,913.96

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,071,182.12
股票投资收益——赎回差价收入	1,860,967.20
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	5,932,149.32

6.4.7.12.2 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	33,509,459.33
减：卖出股票成本总额	29,438,277.21
买卖股票差价收入	4,071,182.12

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
赎回基金份额对价总额	44,619,438.05
减：现金支付赎回款总额	19,930,735.05
减：赎回股票成本总额	22,827,735.80
赎回差价收入	1,860,967.20

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

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**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	5,017.68
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,017.68

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,347,010.21
减：卖出债券（、	3,297,437.13

债转股及债券到期 兑付) 成本总额	
减: 应收利息总额	44,555.40
买卖债券差价收入	5,017.68

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

单位: 人民币元

项目	本期收益金额
----	--------

	2021年01月01日至2021年06月30日
期货投资	284,200.01

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	366,124.39
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	366,124.39

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	-2,374,791.14
——股票投资	-2,375,395.76
——债券投资	604.62
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-2,500.00
——权证投资	-
——期货投资	-2,500.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,377,291.14

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	-
ETF基金替代损益	66,096.46
合计	66,096.46

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	83,832.28
银行间市场交易费用	-
合计	83,832.28

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	24,795.19
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
指数使用费	6,753.06
合计	71,219.83

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、基金销售机构
中国银河证券股份有限公司（“中国银河证券”）	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**

金额单位：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	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
中国银河 证券股份 有限公司	60,857,297.94	100.00%	556,264,703.61	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
中国银河 证券股份 有限公司	5,989,581.80	100.00%	169,303.24	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
中国银河 证券股份 有限公司	44,505.78	100.00%	25,534.29	100.00%
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			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
中国银河	406,802.14	100.00%	88,995.09	100.00%

证券股份 有限公司				
--------------	--	--	--	--

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	33,765.51	209,646.39
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

注：支付基金管理人前海开源基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.15%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×0.15%/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	11,255.16	69,882.13

注：支付基金托管人中国银河证券的托管费按前一日基金资产净值0.05%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×0.05%/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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国银河证券	994,367.00	3.3%	800,000.00	1.9%

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

无。

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	283	8,931.48	8,931.48	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113051	节能转债	2021-06-21	2021-07-22	配债未上市	100.00	100.00	180	18,000.00	18,000.00	-

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

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
600	士	202	重	56.	202	59.	2,000	49,717.18	112,700.0	-

460	兰 微	1-0 6-3 0	大 事 项	35	1-0 7-0 1	49			0	
600 811	东 方 集 团	202 1-0 6-3 0	重 大 事 项	3.0 5	202 1-0 7-1 4	3.3 6	24,400	81,921.28	74,420.00	-

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。

6.4.13 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。

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	1,000,300.00	799,920.00
合计	1,000,300.00	799,920.00

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

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
--------	--------------------	---------------------

AAA	-	-
AAA以下	18,000.00	4,600.00
未评级	-	-
合计	18,000.00	4,600.00

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

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	1,060,855.96	-	-	-	1,060,855.96
结算备付金	110,298.24	-	-	679,889.39	790,187.63
存出保	46,373.47	-	-	365,187.20	411,560.67

证金					
交易性金融资产	1,000,300.00	-	18,000.00	41,810,032.26	42,828,332.26
应收利息	-	-	-	4,693.81	4,693.81
资产总计	2,217,827.67	0.00	18,000.00	42,859,802.66	45,095,630.33
负债					
应付证券清算款	-	-	-	51,274.09	51,274.09
应付管理人报酬	-	-	-	5,467.90	5,467.90
应付托管费	-	-	-	1,822.62	1,822.62
应付交易费用	-	-	-	25,534.29	25,534.29
应交税费	-	-	-	4,394.88	4,394.88
其他负债	-	-	-	71,219.83	71,219.83
负债总计	-	-	-	159,713.61	159,713.61
利率敏感度缺口	2,217,827.67	0.00	18,000.00	42,700,089.05	44,935,916.72
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	3,182,313.18	-	-	-	3,182,313.18
结算备付金	6,711.02	-	-	531,712.77	538,423.79
存出保证金	84,575.03	-	-	523,532.80	608,107.83
交易性金融资产	799,920.00	-	4,600.00	53,103,489.69	53,908,009.69
应收证券清算款	-	-	-	10,306.76	10,306.76

应收利息	-	-	-	17,915.39	17,915.39
资产总计	4,073,519.23	0.00	4,600.00	54,186,957.41	58,265,076.64
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	0.00
应付管理人报酬	-	-	-	7,780.96	7,780.96
应付托管费	-	-	-	2,593.63	2,593.63
应付交易费用	-	-	-	18,200.76	18,200.76
应交税费	-	-	-	0.04	0.04
其他负债	-	-	-	882,833.97	882,833.97
负债总计	-	-	-	911,409.36	911,409.36
利率敏感度缺口	4,073,519.23	0.00	4,600.00	53,275,548.05	57,353,667.28

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率增加0.25%	-1,995.62	-61.51
	市场利率减少0.25%	2,003.58	61.52

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化而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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。

本基金采用完全复制法，跟踪中证500等权重指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，中证500等权重指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的90%。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。

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	41,810,032.26	93.04	53,103,489.69	92.59
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	41,810,032.26	93.04	53,103,489.69	92.59
----	---------------	-------	---------------	-------

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

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%	1,741,050.94	2,579,874.23
	业绩比较基准下降5%	-1,741,050.94	-2,579,874.23

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	41,810,032.26	92.71
	其中：股票	41,810,032.26	92.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,018,300.00	2.26
	其中：债券	1,018,300.00	2.26
	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	1,851,043.59	4.10
8	其他各项资产	416,254.48	0.92
9	合计	45,095,630.33	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	375,947.00	0.84
B	采矿业	1,836,896.90	4.09
C	制造业	23,493,294.78	52.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,559,895.04	3.47
E	建筑业	943,808.00	2.10
F	批发和零售业	1,710,010.49	3.81
G	交通运输、仓储和邮政业	1,459,628.36	3.25
H	住宿和餐饮业	175,553.00	0.39
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,373,181.68	7.51
J	金融业	2,461,257.34	5.48
K	房地产业	1,908,825.13	4.25
L	租赁和商务服务业	738,704.00	1.64
M	科学研究和技术服务业	155,489.00	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	474,322.33	1.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	88,299.40	0.20
Q	卫生和社会工作	84,260.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	685,455.00	1.53
S	综合	215,662.00	0.48
	合计	41,740,489.45	92.89

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	27,797.51	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,356.64	0.01
E	建筑业	8,931.48	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	8,064.00	0.02
J	金融业	21,393.18	0.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	69,542.81	0.15

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	600171	上海贝岭	5,100	155,193.00	0.35
2	601969	海南矿业	12,100	140,723.00	0.31
3	000009	中国宝安	7,700	140,679.00	0.31
4	603893	瑞芯微	1,000	139,460.00	0.31
5	688099	晶晨股份	1,200	134,640.00	0.30
6	600329	中新药业	4,600	129,214.00	0.29
7	603290	斯达半导	400	128,000.00	0.28
8	600315	上海家化	2,100	126,294.00	0.28
9	000983	山西焦煤	15,050	125,065.50	0.28
10	688029	南微医学	400	124,676.00	0.28
11	002444	巨星科技	3,600	122,688.00	0.27
12	300316	晶盛机电	2,400	121,200.00	0.27
13	600348	华阳股份	16,300	120,946.00	0.27
14	600089	特变电工	9,400	120,790.00	0.27
15	600808	马钢股份	28,100	120,549.00	0.27
16	000830	鲁西化工	6,400	119,872.00	0.27
17	000898	鞍钢股份	26,600	118,370.00	0.26
18	002080	中材科技	4,500	117,765.00	0.26
19	300474	景嘉微	1,200	117,504.00	0.26
20	000158	常山北明	10,200	117,198.00	0.26
21	600884	杉杉股份	5,015	116,949.80	0.26
22	600039	四川路桥	18,500	115,995.00	0.26
23	601117	中国化学	13,100	114,756.00	0.26
24	000739	普洛药业	3,900	114,660.00	0.26

25	603077	和邦生物	55,100	114,608.00	0.26
26	603486	科沃斯	500	114,040.00	0.25
27	000960	锡业股份	7,100	113,813.00	0.25
28	003022	联泓新科	3,700	113,590.00	0.25
29	002074	国轩高科	2,600	113,256.00	0.25
30	600060	海信视像	6,700	113,230.00	0.25
31	601233	桐昆股份	4,700	113,223.00	0.25
32	600460	士兰微	2,000	112,700.00	0.25
33	601016	节能风电	30,000	112,200.00	0.25
34	600500	中化国际	14,200	111,612.00	0.25
35	600307	酒钢宏兴	47,900	111,128.00	0.25
36	002010	传化智联	14,400	111,024.00	0.25
37	002028	思源电气	3,600	110,844.00	0.25
38	600956	新天绿能	9,400	110,074.00	0.24
39	600188	兖州煤业	7,100	109,056.00	0.24
40	601880	辽港股份	63,500	108,585.00	0.24
41	002138	顺络电子	2,800	108,556.00	0.24
42	600623	华谊集团	12,300	108,363.00	0.24
43	603260	合盛硅业	1,400	107,674.00	0.24
44	600699	均胜电子	4,200	107,184.00	0.24
45	600418	江淮汽车	8,600	106,898.00	0.24
46	601127	小康股份	1,600	106,672.00	0.24
47	600549	厦门钨业	5,100	106,233.00	0.24
48	603444	吉比特	200	106,000.00	0.24
49	002709	天赐材料	970	103,382.60	0.23
50	000488	晨鸣纸业	12,700	103,378.00	0.23
51	000932	华菱钢铁	15,600	102,960.00	0.23
52	002223	鱼跃医疗	2,700	102,951.00	0.23
53	300285	国瓷材料	2,100	102,375.00	0.23
54	000799	酒鬼酒	400	102,240.00	0.23
55	601866	中远海发	27,200	102,000.00	0.23

56	002511	中顺洁柔	3,700	101,935.00	0.23
57	600219	南山铝业	28,300	101,880.00	0.23
58	600862	中航高科	3,300	101,574.00	0.23
59	000807	云铝股份	8,500	101,150.00	0.23
60	000039	中集集团	5,560	101,080.80	0.22
61	601828	美凯龙	8,400	100,800.00	0.22
62	603885	吉祥航空	6,600	100,716.00	0.22
63	002092	中泰化学	9,800	100,646.00	0.22
64	600885	宏发股份	1,600	100,320.00	0.22
65	688002	睿创微纳	1,000	99,830.00	0.22
66	300001	特锐德	3,300	99,363.00	0.22
67	300115	长盈精密	4,800	98,880.00	0.22
68	300146	汤臣倍健	3,000	98,700.00	0.22
68	002294	信立泰	3,000	98,700.00	0.22
70	603605	珀莱雅	500	98,355.00	0.22
71	600006	东风汽车	13,400	97,820.00	0.22
72	000959	首钢股份	17,400	97,788.00	0.22
73	300207	欣旺达	3,000	97,680.00	0.22
74	600282	南钢股份	27,300	97,188.00	0.22
75	002372	伟星新材	4,700	97,149.00	0.22
76	600754	锦江酒店	1,700	96,815.00	0.22
77	300166	东方国信	7,800	96,408.00	0.21
78	600732	爱旭股份	6,900	96,048.00	0.21
79	002203	海亮股份	9,000	95,760.00	0.21
80	002563	森马服饰	8,000	95,600.00	0.21
81	600765	中航重机	4,200	95,130.00	0.21
82	603737	三棵树	540	95,040.00	0.21
83	600782	新钢股份	17,000	94,860.00	0.21
83	002250	联化科技	3,400	94,860.00	0.21
85	300618	寒锐钴业	1,200	94,608.00	0.21
86	300482	万孚生物	1,460	94,447.40	0.21

87	002408	齐翔腾达	7,600	94,392.00	0.21
88	000825	太钢不锈	12,600	94,374.00	0.21
89	300630	普利制药	1,797	94,162.80	0.21
90	600409	三友化工	9,300	94,023.00	0.21
91	002416	爱施德	9,363	93,910.89	0.21
92	002353	杰瑞股份	2,100	93,870.00	0.21
93	002048	宁波华翔	4,800	93,600.00	0.21
94	600970	中材国际	10,200	93,534.00	0.21
95	603355	莱克电气	1,500	93,345.00	0.21
96	300182	捷成股份	18,700	93,313.00	0.21
97	002648	卫星石化	2,380	93,272.20	0.21
98	000062	深圳华强	5,500	93,005.00	0.21
99	600563	法拉电子	587	92,957.32	0.21
100	600166	福田汽车	26,900	92,805.00	0.21
101	605358	立昂微	800	92,464.00	0.21
102	002249	大洋电机	17,600	92,400.00	0.21
103	600316	洪都航空	2,400	92,352.00	0.21
104	601106	中国一重	27,200	92,208.00	0.21
105	002867	周大生	4,650	91,930.50	0.20
106	000883	湖北能源	20,000	91,800.00	0.20
107	600582	天地科技	23,500	91,650.00	0.20
108	600985	淮北矿业	7,500	91,575.00	0.20
109	600160	巨化股份	10,350	91,494.00	0.20
110	601003	柳钢股份	15,500	91,450.00	0.20
111	603650	彤程新材	1,900	91,390.00	0.20
112	600022	山东钢铁	52,900	90,988.00	0.20
113	300223	北京君正	900	90,828.00	0.20
114	600707	彩虹股份	9,600	90,336.00	0.20
115	600755	厦门国贸	11,000	90,310.00	0.20
116	002180	纳思达	2,800	90,160.00	0.20
117	000513	丽珠集团	1,800	90,036.00	0.20

118	002183	怡亚通	15,700	89,961.00	0.20
119	000718	苏宁环球	10,833	89,805.57	0.20
120	600704	物产中大	11,400	89,718.00	0.20
121	002985	北摩高科	920	89,700.00	0.20
122	600486	扬农化工	800	89,416.00	0.20
123	000887	中鼎股份	7,400	89,392.00	0.20
124	000528	柳工	10,900	89,380.00	0.20
125	002185	华天科技	5,800	89,262.00	0.20
126	300376	易事特	11,100	89,244.00	0.20
127	002690	美亚光电	1,600	89,216.00	0.20
128	688088	虹软科技	1,600	89,200.00	0.20
129	300257	开山股份	6,200	89,094.00	0.20
130	600917	重庆燃气	10,900	89,053.00	0.20
131	300009	安科生物	5,955	88,729.50	0.20
132	601200	上海环境	7,410	88,697.70	0.20
133	600516	方大炭素	11,900	88,536.00	0.20
134	600410	华胜天成	11,400	88,464.00	0.20
135	300463	迈克生物	2,100	88,389.00	0.20
136	603377	东方时尚	8,260	88,299.40	0.20
137	000553	安道麦A	9,500	88,065.00	0.20
138	002506	协鑫集成	25,300	88,044.00	0.20
139	001872	招商港口	5,200	87,984.00	0.20
140	002273	水晶光电	5,989	87,978.41	0.20
141	688321	微芯生物	1,900	87,761.00	0.20
142	601615	明阳智能	5,400	87,426.00	0.19
143	600787	中储股份	16,400	87,412.00	0.19
144	002625	光启技术	4,200	87,402.00	0.19
145	002375	亚厦股份	11,000	87,120.00	0.19
146	688208	道通科技	1,000	86,990.00	0.19
147	002603	以岭药业	2,983	86,984.28	0.19
148	000012	南玻A	8,482	86,855.68	0.19

149	300296	利亚德	11,100	86,802.00	0.19
150	603888	新华网	4,100	86,797.00	0.19
151	600875	东方电气	7,900	86,663.00	0.19
152	603712	七一二	2,400	86,640.00	0.19
153	600642	申能股份	14,100	86,574.00	0.19
154	600879	航天电子	11,500	86,480.00	0.19
155	000630	铜陵有色	31,700	86,224.00	0.19
156	002075	沙钢股份	7,900	86,189.00	0.19
157	002831	裕同科技	2,900	86,101.00	0.19
158	601689	拓普集团	2,295	85,901.85	0.19
159	002266	浙富控股	17,200	85,828.00	0.19
160	002004	华邦健康	13,800	85,698.00	0.19
161	002595	豪迈科技	3,200	85,440.00	0.19
162	002030	达安基因	4,021	85,406.04	0.19
163	002191	劲嘉股份	8,000	85,120.00	0.19
164	600737	中粮糖业	8,500	85,085.00	0.19
165	603225	新凤鸣	4,189	85,036.70	0.19
166	600645	中源协和	3,700	84,915.00	0.19
167	000709	河钢股份	34,500	84,870.00	0.19
168	002635	安洁科技	5,800	84,854.00	0.19
169	600216	浙江医药	5,300	84,853.00	0.19
170	600141	兴发集团	4,500	84,735.00	0.19
171	300271	华宇软件	4,400	84,700.00	0.19
172	002152	广电运通	6,500	84,695.00	0.19
173	000519	中兵红箭	7,900	84,688.00	0.19
174	000988	华工科技	3,600	84,672.00	0.19
175	600827	百联股份	4,200	84,630.00	0.19
176	000636	风华高科	2,800	84,616.00	0.19
177	600256	广汇能源	25,400	84,582.00	0.19
178	600259	广晟有色	2,500	84,525.00	0.19
179	300244	迪安诊断	2,200	84,260.00	0.19

180	002002	鸿达兴业	21,400	84,102.00	0.19
181	000970	中科三环	8,800	84,040.00	0.19
182	002131	利欧股份	35,900	84,006.00	0.19
183	601005	重庆钢铁	31,400	83,838.00	0.19
184	600567	山鹰国际	24,300	83,835.00	0.19
185	600580	卧龙电驱	6,300	83,790.00	0.19
186	600517	国网英大	12,300	83,763.00	0.19
187	601608	中信重工	22,350	83,589.00	0.19
188	300699	光威复材	1,100	83,545.00	0.19
189	603707	健友股份	2,000	83,500.00	0.19
190	002387	维信诺	8,000	83,440.00	0.19
191	600871	石化油服	42,300	83,331.00	0.19
192	601598	中国外运	16,500	83,325.00	0.19
193	000738	航发控制	4,000	83,320.00	0.19
194	600008	首创环保	27,664	83,268.64	0.19
195	002925	盈趣科技	2,140	83,267.40	0.19
196	600398	海澜之家	11,500	83,260.00	0.19
197	002670	国盛金控	7,300	83,147.00	0.19
198	603786	科博达	1,100	83,050.00	0.18
199	002212	天融信	4,200	83,034.00	0.18
200	601958	金钼股份	12,800	82,944.00	0.18
201	002013	中航机电	8,200	82,574.00	0.18
202	601717	郑煤机	7,100	82,573.00	0.18
203	002500	山西证券	12,300	82,533.00	0.18
204	002936	郑州银行	22,470	82,464.90	0.18
205	000021	深科技	4,300	82,302.00	0.18
206	600325	华发股份	12,200	82,228.00	0.18
207	600820	隧道股份	15,500	81,995.00	0.18
208	002429	兆驰股份	13,500	81,945.00	0.18
209	600639	浦东金桥	6,000	81,900.00	0.18
210	002653	海思科	3,800	81,776.00	0.18

211	002156	通富微电	3,400	81,736.00	0.18
212	000869	张裕 A	2,200	81,708.00	0.18
213	601099	太平洋	24,100	81,699.00	0.18
214	601333	广深铁路	38,500	81,620.00	0.18
215	603927	中科软	1,900	81,605.00	0.18
216	600535	天士力	5,500	81,455.00	0.18
217	600863	内蒙华电	34,900	81,317.00	0.18
218	002382	蓝帆医疗	3,900	81,315.00	0.18
219	603568	伟明环保	3,561	81,297.63	0.18
220	000997	新大陆	4,900	81,291.00	0.18
221	600648	外高桥	5,500	81,290.00	0.18
222	603589	口子窖	1,200	81,228.00	0.18
223	000975	银泰黄金	8,540	81,215.40	0.18
224	600376	首开股份	14,500	81,200.00	0.18
225	300741	华宝股份	1,600	81,152.00	0.18
226	002434	万里扬	10,000	81,100.00	0.18
227	002221	东华能源	7,400	81,030.00	0.18
228	600667	太极实业	8,900	80,990.00	0.18
229	601718	际华集团	28,700	80,934.00	0.18
230	600859	王府井	2,800	80,864.00	0.18
231	603379	三美股份	4,320	80,827.20	0.18
232	000598	兴蓉环境	15,500	80,755.00	0.18
233	300315	掌趣科技	19,000	80,750.00	0.18
234	002340	格林美	8,600	80,410.00	0.18
235	601699	潞安环能	6,800	80,308.00	0.18
236	000999	华润三九	3,000	80,250.00	0.18
237	002901	大博医疗	1,100	80,179.00	0.18
238	600068	葛洲坝	10,700	80,143.00	0.18
239	300037	新宙邦	800	80,080.00	0.18
240	600728	佳都科技	10,800	80,028.00	0.18
241	601168	西部矿业	6,700	79,931.00	0.18

242	002268	卫 士 通	4,100	79,868.00	0.18
243	000559	万向钱潮	15,040	79,862.40	0.18
244	601636	旗滨集团	4,300	79,808.00	0.18
245	600536	中国软件	1,400	79,702.00	0.18
246	600968	海油发展	30,700	79,513.00	0.18
247	601991	大唐发电	30,100	79,464.00	0.18
248	600372	中航电子	4,800	79,440.00	0.18
249	601928	凤凰传媒	11,100	79,254.00	0.18
250	600718	东软集团	8,100	79,218.00	0.18
251	600739	辽宁成大	3,800	79,078.00	0.18
252	603000	人民网	4,600	79,074.00	0.18
253	601068	中铝国际	22,900	79,005.00	0.18
254	002174	游族网络	4,600	78,982.00	0.18
255	300024	机器人	7,400	78,958.00	0.18
256	300070	碧水源	10,800	78,948.00	0.18
257	002839	张家港行	14,500	78,880.00	0.18
258	002299	圣农发展	3,300	78,804.00	0.18
259	600258	首旅酒店	3,300	78,738.00	0.18
260	002423	中粮资本	8,700	78,735.00	0.18
261	600339	中油工程	27,700	78,668.00	0.18
262	600167	联美控股	8,800	78,584.00	0.17
263	600895	张江高科	4,300	78,561.00	0.17
264	000930	中粮科技	8,700	78,387.00	0.17
265	000402	金 融 街	11,600	78,300.00	0.17
266	000937	冀中能源	19,900	78,207.00	0.17
267	000877	天山股份	6,000	78,180.00	0.17
268	300253	卫宁健康	4,800	78,096.00	0.17
269	603638	艾迪精密	1,820	78,023.40	0.17
270	601298	青岛港	12,600	77,868.00	0.17
271	300026	红日药业	18,300	77,775.00	0.17
272	002065	东华软件	9,800	77,714.00	0.17

273	300168	万达信息	5,300	77,380.00	0.17
274	600663	陆家嘴	5,800	77,256.00	0.17
275	300002	神州泰岳	15,900	77,115.00	0.17
276	601869	长飞光纤	3,165	77,099.40	0.17
277	600026	中远海能	12,500	77,000.00	0.17
278	300357	我武生物	1,200	76,944.00	0.17
279	600967	内蒙一机	7,600	76,912.00	0.17
280	002373	千方科技	4,604	76,886.80	0.17
281	600729	重庆百货	2,800	76,860.00	0.17
281	002396	星网锐捷	3,600	76,860.00	0.17
283	600839	四川长虹	26,400	76,824.00	0.17
284	603256	宏和科技	8,400	76,776.00	0.17
285	002056	横店东磁	5,900	76,700.00	0.17
286	002948	青岛银行	15,400	76,538.00	0.17
287	600392	盛和资源	4,404	76,453.44	0.17
288	600572	康恩贝	17,200	76,368.00	0.17
288	300133	华策影视	12,900	76,368.00	0.17
290	000723	美锦能源	10,100	76,356.00	0.17
291	600497	驰宏锌锗	17,700	76,287.00	0.17
291	000681	视觉中国	5,900	76,287.00	0.17
293	002127	南极电商	7,800	76,206.00	0.17
294	000717	韶钢松山	16,600	76,194.00	0.17
295	600507	方大特钢	11,231	76,146.18	0.17
296	600095	湘财股份	6,500	76,115.00	0.17
297	002701	奥瑞金	14,800	76,072.00	0.17
298	600027	华电国际	22,100	76,024.00	0.17
299	600908	无锡银行	13,100	75,980.00	0.17
300	600155	华创阳安	7,100	75,970.00	0.17
301	600779	水井坊	600	75,810.00	0.17
302	601179	中国西电	18,400	75,808.00	0.17
303	600094	大名城	20,100	75,777.00	0.17

304	002458	益生股份	7,600	75,772.00	0.17
305	300058	蓝色光标	12,500	75,625.00	0.17
306	600271	航天信息	5,800	75,574.00	0.17
307	000629	攀钢钒钛	33,000	75,570.00	0.17
308	000156	华数传媒	9,800	75,558.00	0.17
309	000778	新兴铸管	20,300	75,516.00	0.17
310	000060	中金岭南	16,700	75,484.00	0.17
311	000547	航天发展	4,000	75,480.00	0.17
312	601456	国联证券	4,900	75,460.00	0.17
313	603228	景旺电子	2,880	75,456.00	0.17
314	601198	东兴证券	6,900	75,417.00	0.17
315	600643	爱建集团	10,800	75,384.00	0.17
316	000027	深圳能源	8,220	75,377.40	0.17
317	601778	晶科科技	13,800	75,348.00	0.17
318	600153	建发股份	9,300	75,330.00	0.17
319	002507	涪陵榨菜	2,000	75,320.00	0.17
320	603198	迎驾贡酒	1,700	75,310.00	0.17
321	002081	金螳螂	9,500	75,240.00	0.17
322	600566	济川药业	4,200	75,180.00	0.17
323	300088	长信科技	9,100	75,166.00	0.17
324	000050	深天马 A	5,300	75,154.00	0.17
325	600446	金证股份	5,200	75,088.00	0.17
326	000685	中山公用	9,200	75,072.00	0.17
327	002085	万丰奥威	13,400	75,040.00	0.17
328	002572	索菲亚	3,100	75,020.00	0.17
329	600673	东阳光	16,700	74,983.00	0.17
330	002683	宏大爆破	2,700	74,979.00	0.17
331	601098	中南传媒	8,500	74,970.00	0.17
332	601187	厦门银行	7,900	74,892.00	0.17
333	300017	网宿科技	12,800	74,880.00	0.17
333	002815	崇达技术	6,000	74,880.00	0.17

335	002399	海普瑞	4,700	74,871.00	0.17
336	002110	三钢闽光	11,100	74,814.00	0.17
337	603883	老百姓	1,420	74,805.60	0.17
338	600598	北大荒	5,000	74,800.00	0.17
339	002419	天虹股份	11,400	74,784.00	0.17
340	601860	紫金银行	20,600	74,778.00	0.17
341	600312	平高电气	12,800	74,752.00	0.17
342	000690	宝新能源	14,600	74,606.00	0.17
343	600260	凯乐科技	8,400	74,592.00	0.17
343	002505	鹏都农牧	33,300	74,592.00	0.17
343	000089	深圳机场	9,600	74,592.00	0.17
346	600388	龙净环保	8,751	74,558.52	0.17
347	600498	烽火通信	4,000	74,520.00	0.17
348	600717	天津港	19,008	74,511.36	0.17
349	601568	北元集团	8,700	74,472.00	0.17
350	002124	天邦股份	10,620	74,446.20	0.17
351	603515	欧普照明	2,900	74,443.00	0.17
352	600811	东方集团	24,400	74,420.00	0.17
353	002390	信邦制药	7,100	74,408.00	0.17
354	600881	亚泰集团	26,100	74,385.00	0.17
355	002242	九阳股份	2,288	74,337.12	0.17
356	000078	海王生物	22,800	74,328.00	0.17
357	603156	养元饮品	2,600	74,308.00	0.17
358	600803	新奥股份	4,500	74,295.00	0.17
359	600909	华安证券	13,320	74,192.40	0.17
360	600158	中体产业	6,500	74,165.00	0.17
361	600120	浙江东方	17,328	74,163.84	0.17
362	600733	北汽蓝谷	5,500	74,140.00	0.16
363	002195	二三四五	36,500	74,095.00	0.16
364	601992	金隅集团	27,500	73,975.00	0.16
365	600835	上海机电	4,550	73,937.50	0.16

366	600556	天下秀	7,000	73,920.00	0.16
367	002468	申通快递	9,700	73,914.00	0.16
368	002128	露天煤业	7,100	73,911.00	0.16
369	600062	华润双鹤	6,200	73,842.00	0.16
370	600195	中牧股份	6,174	73,841.04	0.16
371	600901	江苏租赁	14,200	73,840.00	0.16
372	600038	中直股份	1,400	73,836.00	0.16
373	600350	山东高速	12,000	73,800.00	0.16
373	002281	光迅科技	3,000	73,800.00	0.16
375	002465	海格通信	7,800	73,788.00	0.16
376	000998	隆平高科	4,600	73,784.00	0.16
377	600633	浙数文化	10,276	73,781.68	0.16
378	600649	城投控股	15,500	73,780.00	0.16
379	600597	光明乳业	5,119	73,764.79	0.16
380	000537	广宇发展	14,100	73,743.00	0.16
381	600126	杭钢股份	14,360	73,666.80	0.16
382	600764	中国海防	2,600	73,580.00	0.16
383	002797	第一创业	10,300	73,542.00	0.16
384	000540	中天金融	26,900	73,437.00	0.16
385	000563	陕国投 A	22,800	73,416.00	0.16
386	000671	阳光城	14,100	73,320.00	0.16
387	300212	易华录	2,720	73,195.20	0.16
388	601975	招商南油	34,200	73,188.00	0.16
388	300308	中际旭创	1,900	73,188.00	0.16
388	002958	青农商行	17,100	73,188.00	0.16
388	002926	华西证券	7,600	73,188.00	0.16
392	600776	东方通信	5,900	73,160.00	0.16
393	000758	中色股份	15,400	73,150.00	0.16
394	600369	西南证券	15,000	73,050.00	0.16
395	600037	歌华有线	7,600	73,036.00	0.16
396	002233	塔牌集团	7,100	72,988.00	0.16

397	600373	中文传媒	7,400	72,964.00	0.16
398	000623	吉林敖东	4,710	72,957.90	0.16
399	600390	五矿资本	12,200	72,956.00	0.16
400	601611	中国核建	10,100	72,922.00	0.16
401	600528	中铁工业	9,000	72,900.00	0.16
401	600056	中国医药	6,000	72,900.00	0.16
403	600959	江苏有线	23,900	72,895.00	0.16
404	000401	冀东水泥	5,900	72,865.00	0.16
405	000061	农产品	13,200	72,864.00	0.16
406	600131	国网信通	5,500	72,820.00	0.16
407	601118	海南橡胶	14,300	72,787.00	0.16
408	601512	中新集团	7,300	72,708.00	0.16
409	600928	西安银行	15,600	72,696.00	0.16
410	600903	贵州燃气	7,900	72,680.00	0.16
411	002038	双鹭药业	6,900	72,657.00	0.16
412	000990	诚志股份	5,707	72,650.11	0.16
413	600435	北方导航	9,140	72,571.60	0.16
414	600021	上海电力	10,500	72,555.00	0.16
415	002745	木林森	5,400	72,360.00	0.16
416	600823	世茂股份	17,900	72,316.00	0.16
417	601000	唐山港	30,000	72,300.00	0.16
418	300180	华峰超纤	14,600	72,270.00	0.16
419	000826	启迪环境	13,500	72,225.00	0.16
420	600377	宁沪高速	7,400	72,224.00	0.16
421	000400	许继电气	5,700	72,162.00	0.16
422	002424	贵州百灵	9,800	72,128.00	0.16
423	600415	小商品城	14,000	72,100.00	0.16
424	600657	信达地产	20,700	72,036.00	0.16
425	603858	步长制药	3,200	71,968.00	0.16
426	600640	号百控股	5,900	71,921.00	0.16
427	000028	国药一致	1,900	71,896.00	0.16

428	002302	西部建设	9,100	71,890.00	0.16
428	000090	天健集团	13,000	71,890.00	0.16
430	000878	云南铜业	5,600	71,848.00	0.16
431	600487	亨通光电	6,300	71,820.00	0.16
432	000813	德展健康	15,800	71,732.00	0.16
433	002244	滨江集团	17,100	71,649.00	0.16
434	002583	海能达	14,200	71,568.00	0.16
435	601228	广州港	22,500	71,550.00	0.16
436	300010	豆神教育	12,600	71,442.00	0.16
437	000750	国海证券	16,830	71,359.20	0.16
438	002966	苏州银行	9,700	71,295.00	0.16
439	600170	上海建工	25,800	71,208.00	0.16
440	600066	宇通客车	5,700	71,193.00	0.16
441	300072	三聚环保	12,400	71,176.00	0.16
442	300113	顺网科技	5,500	71,170.00	0.16
443	002818	富森美	5,900	71,154.00	0.16
444	600546	山煤国际	9,900	71,082.00	0.16
445	000031	大悦城	19,700	70,920.00	0.16
446	601139	深圳燃气	10,800	70,848.00	0.16
447	600266	城建发展	14,944	70,834.56	0.16
448	601801	皖新传媒	15,000	70,800.00	0.16
449	601577	长沙银行	7,900	70,626.00	0.16
450	003035	南网能源	7,100	70,574.00	0.16
451	600208	新湖中宝	23,200	70,528.00	0.16
452	002155	湖南黄金	9,100	70,525.00	0.16
453	300383	光环新网	4,900	70,511.00	0.16
454	002146	荣盛发展	12,500	70,500.00	0.16
455	600637	东方明珠	8,600	70,434.00	0.16
456	000501	鄂武商 A	6,000	70,200.00	0.16
457	002422	科伦药业	3,500	69,825.00	0.16
458	002317	众生药业	8,100	69,741.00	0.16

459	002439	启明星辰	2,400	69,624.00	0.15
460	600511	国药股份	2,100	69,426.00	0.15
461	600804	鹏博士	14,300	69,212.00	0.15
462	002440	闰土股份	7,800	69,030.00	0.15
463	000415	渤海租赁	28,500	68,970.00	0.15
464	002557	洽洽食品	1,600	68,960.00	0.15
465	601128	常熟银行	11,100	68,820.00	0.15
466	300418	昆仑万维	4,200	68,796.00	0.15
467	603317	天味食品	2,330	68,571.90	0.15
468	002368	太极股份	3,400	68,204.00	0.15
469	002078	太阳纸业	5,100	68,085.00	0.15
470	600867	通化东宝	5,700	68,058.00	0.15
471	000729	燕京啤酒	9,400	68,056.00	0.15
472	600201	生物股份	3,900	68,055.00	0.15
473	603866	桃李面包	2,180	68,016.00	0.15
474	600529	山东药玻	2,000	67,900.00	0.15
475	600064	南京高科	7,300	67,817.00	0.15
476	603983	丸美股份	1,300	67,743.00	0.15
476	603708	家家悦	3,900	67,743.00	0.15
478	600998	九州通	4,400	67,628.00	0.15
479	603719	良品铺子	1,500	67,500.00	0.15
480	600988	赤峰黄金	4,500	67,455.00	0.15
481	000967	盈峰环境	9,800	67,326.00	0.15
482	601997	贵阳银行	9,400	67,304.00	0.15
483	603868	飞科电器	1,600	67,296.00	0.15
484	603056	德邦股份	6,100	67,039.00	0.15
485	600801	华新水泥	3,800	66,766.00	0.15
486	000686	东北证券	7,900	66,755.00	0.15
487	002946	新乳业	4,400	66,660.00	0.15
488	000581	威孚高科	3,200	66,656.00	0.15
489	600466	蓝光发展	22,400	66,080.00	0.15

490	300251	光线传媒	6,100	65,941.00	0.15
491	000961	中南建设	11,100	65,712.00	0.15
492	002705	新宝股份	2,500	65,625.00	0.15
493	002019	亿帆医药	3,800	65,550.00	0.15
494	001914	招商积余	3,800	65,284.00	0.15
495	600177	雅戈尔	9,900	65,241.00	0.15
496	002385	大北农	9,300	63,240.00	0.14
497	600380	健康元	4,400	60,412.00	0.13
498	000046	泛海控股	25,700	59,110.00	0.13
499	000732	泰禾集团	27,300	58,968.00	0.13
500	002532	天山铝业	7,000	58,730.00	0.13

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601528	瑞丰银行	1,374	21,393.18	0.05
2	001207	联科科技	512	16,952.32	0.04
3	001208	华菱线缆	1,403	10,845.19	0.02
4	605287	德才股份	283	8,931.48	0.02
5	603171	税友股份	420	8,064.00	0.02
6	605011	杭州热电	378	3,356.64	0.01

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	603290	斯达半导	305,679.00	0.53
2	002791	坚朗五金	293,224.00	0.51
3	002985	北摩高科	248,301.00	0.43

4	603345	安井食品	234,252.00	0.41
5	603605	珀莱雅	216,462.00	0.38
6	601799	星宇股份	214,480.00	0.37
7	688002	睿创微纳	212,170.42	0.37
8	603737	三棵树	187,465.00	0.33
9	002568	百润股份	174,289.00	0.30
10	688099	晶晨股份	153,316.00	0.27
11	603650	彤程新材	143,531.00	0.25
12	300595	欧普康视	141,168.00	0.25
13	002340	格林美	136,288.00	0.24
14	300496	中科创达	132,746.00	0.23
15	000799	酒鬼酒	130,790.00	0.23
16	601117	中国化学	127,059.00	0.22
17	000718	苏宁环球	125,789.00	0.22
18	300699	光威复材	119,509.00	0.21
19	002444	巨星科技	117,295.00	0.20
20	000932	华菱钢铁	117,029.00	0.20

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002791	坚朗五金	424,063.00	0.74
2	300274	阳光电源	398,756.00	0.70
3	300595	欧普康视	331,467.40	0.58
4	300496	中科创达	326,315.00	0.57
5	002568	百润股份	305,162.80	0.53
6	688277	天智航	303,971.50	0.53
7	000301	东方盛虹	293,870.00	0.51

8	002920	德赛西威	290,421.00	0.51
9	002985	北摩高科	263,950.00	0.46
10	002064	华峰化学	245,845.00	0.43
11	002709	天赐材料	243,779.35	0.43
12	000718	苏宁环球	243,621.00	0.42
13	603345	安井食品	231,324.00	0.40
14	601799	星宇股份	221,604.00	0.39
15	002648	卫星石化	221,036.00	0.39
16	002340	格林美	216,783.00	0.38
17	603290	斯达半导	216,396.00	0.38
18	601127	小康股份	216,175.00	0.38
19	300012	华测检测	213,863.00	0.37
20	601966	玲珑轮胎	208,944.95	0.36

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	27,990,843.34
卖出股票收入（成交）总额	33,509,459.33

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

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	1,000,300.00	2.23
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)	18,000.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,018,300.00	2.27

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	019654	21国债06	10,000	1,000,300.00	2.23
2	113051	节能转债	180	18,000.00	0.04

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

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

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2112	中证500股指期货2112合约	2	2,608,480.00	69,680.00	-
公允价值变动总额合计(元)					69,680.00

股指期货投资本期收益（元）	284,200.01
股指期货投资本期公允价值变动（元）	-2,500.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金运用股指期货交易的原则是，在流动性较好和投资期限适当的合约上安排比例适当的头寸，以降低对市场的冲击并减少交易成本，根据市场流动性状况及投资需求，分时段执行展期交易，在交易过程中，对投资组合的风险状况持续监控。具体而言，当前对股指期货交易主要用以获得股指期货的基差收敛收益，并利用股指期货的杠杆效应保留部分现金以避免跨市场ETF的尾盘赎回风险。考虑到本基金跟踪的500等权指数与IC合约跟踪的500指数存在一定的偏离，我们会根据实际情况对成分股持仓进行调整，以达到更好的跟踪等权指数的目的。我们还会重点关注调整后的成分券数量是否满足ETF的赎回上限要求，以尽量避免赎回风险。

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

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	411,560.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,693.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	416,254.48

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	605287	德才股份	8,931.48	0.02	新股未上市

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
956	31,499.65	7,779,705.00	25.83%	22,333,960.00	74.17%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中信建投证券股份有限公司	4,134,133.00	13.73%
2	前海开源基金—北京银行—前海开源源享1号集合资产管理计划	2,085,400.00	6.93%
3	中国银河证券股份有限公司	994,367.00	3.30%
4	董保国	759,000.00	2.52%
5	辛明蕾	589,013.00	1.96%
6	梁小琴	500,000.00	1.66%
7	杨建中	422,500.00	1.40%
8	刘百荣	400,000.00	1.33%
9	蒋祖逸	400,000.00	1.33%
10	深圳德福基金管理有限公司—德福丰盈1号证券投资基金	350,000.00	1.16%

注：以上信息中，持有人名册及持有份额由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 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	0.00	0.00%

8.4 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(2019年11月14日)基金份额总额	760,113,665.00
本报告期期初基金份额总额	42,113,665.00
本报告期基金总申购份额	20,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	32,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	30,113,665.00

§ 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，何隽先生自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	
银河证券	5	60,857,297.94	100.00%	44,505.78	100.00%	-

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
银河证券	5,989,581.80	100.00%	-	-	-	-	-	-

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
2	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
3	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金2020年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2021-01-22
4	前海开源中证500等权重交易型开放式指数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
5	前海开源中证500等权重交易型开放式指数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
6	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金2020年年度报告	中国证监会规定媒介	2021-03-31
7	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同（2021年3月修订）	中国证监会规定媒介	2021-03-31
8	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新（20210331更新）	中国证监会规定媒介	2021-03-31
9	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》	中国证监会规定媒介	2021-03-31

	修改基金合同部分条款的公告		
10	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（20210331更新）	中国证监会规定媒介	2021-03-31
11	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金2021年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2021-04-22
12	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
13	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
14	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
15	关于前海开源基金管理有限公司旗下基金根据信息披露办法修改基金合同和托管协议的公告	中国证监会规定媒介	2021-06-29
16	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金托管协议（2021年6月修订）	中国证监会规定媒介	2021-06-29
17	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（20210629更新）	中国证监会规定媒介	2021-06-29

18	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同（2021年6月修订）	中国证监会规定媒介	2021-06-29
----	---	-----------	------------

§ 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、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。

2、根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金运作指引第3号—指数基金指引》等法律法规、基金合同、招募说明书及其更新等规定，经与基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，前海开源基金管理有限公司对本基金基金合同进行了修订，本次修订系因相应的法律法规发生变动而进行的修改，对基金份额持有人利益无实质性不利影响，无需召开份额持有人大会，修订将自2021年3月31日起正式生效。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。

3、根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的要求及相关规定，并经与相关基金托管人协商一致，本公司决定对本基金的基金合同、托管协议中的信息披露相关条款进行修改。此次修改系因相关法律法规发生变动对基金合同进行的修改，对基金份额持有人利益无实质性不利影响，且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化，并已履行了规定的程序，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。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中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金设立的文件

(2) 《前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

(3) 《前海开源中证500等权重交易型开放式指数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) 前海开源中证500等权重交易型开放式指数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