

# 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 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:前海开源基金管理有限公司

基金托管人:中国银河证券股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2021年01月01日起至2021年12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	85
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	87
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	88
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	88
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	88
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	88

8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	88
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	89
8.12	投资组合报告附注	90
§9	基金份额持有人信息	91
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	91
9.2	期末上市基金前十名持有人	91
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	92
9.4	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	92
§10	开放式基金份额变动	92
§11	重大事件揭示	92
11.1	基金份额持有人大会决议	92
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	92
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	93
11.4	基金投资策略的改变	93
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	93
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	93
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	93
11.8	其他重大事件	94
§12	影响投资者决策的其他重要信息	98
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	98
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	98
§13	备查文件目录	99
13.1	备查文件目录	99
13.2	存放地点	99
13.3	查阅方式	99

## § 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	500等权ETF
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	26,113,665.00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	王兆华	祁坤
	联系电话	0755-88601888	010-80927827
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	yhzq_tggz@chinastock.com.cn
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	北京市丰台区西营街8号院1

	一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	号楼7至18层101
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.qhkyfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年	2020年	2019年11月14日（基金合同生效日）-2019年12月31日
本期已实现收益	11,143,432.64	86,204,037.29	2,092,835.87
本期利润	8,437,710.00	53,528,000.00	39,731,884.94



	2.91	59.69	
加权平均基金份额本期利润	0.2815	0.3449	0.0523
本期加权平均净值利润率	19.01%	30.67%	5.16%
本期基金份额净值增长率	21.10%	29.42%	5.23%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2021年末	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	16,955,150.19	15,240,002.28	2,092,835.87
期末可供分配基金份额利润	0.6493	0.3619	0.0028
期末基金资产净值	43,068,815.19	57,353,667.28	799,845,549.94
期末基金份额净值	1.6493	1.3619	1.0523
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2021年末	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	64.93%	36.19%	5.23%

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。

④本基金的基金合同于2019年11月14日生效，截止2019年12月31日成立不满1年，故2019年年度数据与指标为不完整会计年度数据。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.82%	0.75%	3.98%	0.75%	-0.16%	0.00%
过去六个月	10.53%	0.93%	9.84%	0.94%	0.69%	-0.01%
过去一年	21.10%	0.92%	17.06%	0.92%	4.04%	0.00%
自基金合同	64.93%	1.21%	48.46%	1.25%	16.47%	-0.04%

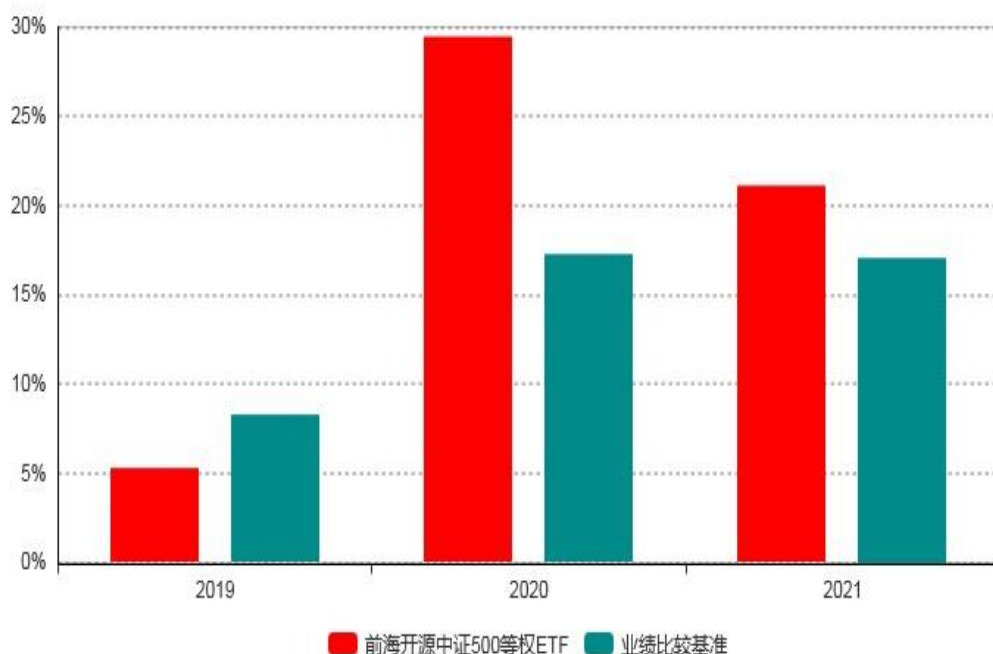
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

### 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



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金的基金合同于2019年11月14日生效，2019年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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97只开放式基金，资产管理规模超过1587亿元。

#### 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		
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，现任公司指数化投资团队基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订）的规定，针对股票市场、债券市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节，制定了《前海开源基金管理有限公司公平交易管理办法》、《前海开源基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公平交易相关

的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合投资策略需要，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价出现2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年以来受益于成份股中的周期股表现抢眼，成长股占比较高，且指数相对估值水平较低，中证500等权重指数表现强势，全年上涨超过17%，明显优于其他大盘指数。本基金通过配置部分IC期货进行指数跟踪，既可以获取期货的负基差收益，又能降低频繁操作的风险，还能够有效避免尾盘赎回的头寸风险，后续我们将继续根据期货的基差情况和两个指数的偏离情况，审慎评估是否继续使用IC期货进行基准指数的跟踪。另外我们还通过参加新股网下申购获得了不错的收益增厚。基于当前的经济形势，我们判断2022年稳增长政策有望持续发力，预计2022年整体流动性氛围将处于偏宽松，成长属性更强的中证500等权重指数具有较高的投资性价比。由于2021年周期股业绩的高基数，2022年指数整体的业绩增速或不尽如人意，但考虑到中下游成份股业绩会出现一定的修复，且中下游成份股可以获得比上游周期股更高的市场估值溢价，我们判断业绩扰动相对有限。

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，并通过参与新股申购、现金管理、期现套利等方式获得超额收益。本基金将持续关注成份股的基本面变化情况，通过监控成份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1.6493元，本报告期内，基金份额净值增长率为21.10%，同期业绩比较基准收益率为17.06%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美联储在3月份议息会议上如期加息25个基点并可能于5月份开启缩表。根据历史数据，美联储货币政策对市场影响最大的往往是预期发酵阶段，在预期重新锚定的过程中，资产价格必然会出现波动，甚至由于叠加交易和情绪因素导致剧烈的动荡。这也是2022年年初A股市场和其他主要资产剧烈波动的主要原因。一旦预期充分反应后，对资产价格的影响将让位于基本面，例如2017年美联储加息和缩表的过程中，国内股市表现同样可圈可点，资金照样回流中国和新兴市场。

考虑到前期我国货币政策已经率先正常化，为当下的稳增长预留了政策空间，我国紧随美联储紧缩的概率极低，稳增长仍是2022年货币政策的主基调。从2022年年初各省份披露的2022年的经济增长目标、年度主要任务来看，各地均设定了较高的投资与社零目标，反映出了稳增长的态度和决心。价格上则有望出现PPI-CPI的收敛，随着PPI同比增速见顶回落，原材料上涨的压力有所减轻，制造业企业盈利空间走扩，有助于制造业投资增速的走高。下半年随着地产阶段性企稳，制造业、消费和服务有望推动经济回升，出口增速高位回落但仍有韧性。总体来看2022年宏观经济压力下A股业绩增速可能会出现一定的回落，市场驱动力从业绩转向估值，而估值受资金和情绪面影响更大，A股波动率可能会出现明显增大。

尽管波动可能会加剧，但我们认为A股受益于中国经济率先企稳反弹、国内流动性合理充裕、有利的长期资金流入条件、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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益的角度出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 本年度，我公司采取外聘律师和内部专业人士相结合的方式，对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训，进一步提高了我公司从业人员的合规素质和职业道德修养。

(2) 本年度，我公司按照证监会的要求对公司治理、投资、研究、交易、基金会计、注册登记、人力资源、基金销售等主要业务进行定期稽核工作。同时，对信息技术、用户权限、通信管理与视频监控、基金直销、后台运营、内幕交易防控等相关业务开展了专项稽核工作，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性等。

(3) 通过事前合规防范、事中系统控制、事后完善纠偏的方式，全面加强了对公司产品日常投资运作的管理与监控，保证投资符合既定的投资决策程序与业务流程，基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

(4) 全面参与新产品设计、新业务拓展工作，负责日常合同审查，监督客户投诉处理。积极参与证监会新规定出台前的讨论并提出修改建议。

(5) 完成各基金及公司的各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；重视媒体监督和投资者关系管理工作。

(6) 按照规定向人民银行报送反洗钱相关报表和报告，按监管要求制定客户洗钱风险划分的标准，并升级了客户洗钱风险划分系统。

本基金管理人承诺将依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引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，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。估值委员会主席由总经理办公会指定，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，并具有丰富的基金行业实践经验。

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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

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

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

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07月12日连续37个工作日、从2021年07月14日至2021年09月01日连续36个工作日、从2021年09月03日至2021年11月03日连续37个工作日、从2021年11月05日至2021年12月24日连续36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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配、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 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第25982号



## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容 我们审计了前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“前海开源中证500等权ETF基金”)的财务报表,包括2021年12月31日的资产负债表,2021年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二) 我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了前海开源中证500等权ETF基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于前海开源中证500等权ETF基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>前海开源中证500等权ETF基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反</p>

	<p>映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估前海开源中证500等权ETF基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算前海开源中证500等权ETF基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督前海开源中证500等权ETF基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对前海开源中证500等权ETF基金持续经营能力产生重大疑虑的事项</p>

	或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致前海开源中证500等权ETF基金不能持续经营。（五）评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	陈熹 施翊洲
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
审计报告日期	2022-03-29

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,222,789.88	3,182,313.18
结算备付金		166,775.79	538,423.79
存出保证金		243,707.55	608,107.83
交易性金融资产	7.4.7.2	41,581,232.79	53,908,009.69
其中：股票投资		40,973,132.79	53,103,489.69
基金投资		-	-

债券投资		608,100.00	804,520.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		9,077.62	10,306.76
应收利息	7.4.7.5	5,600.71	17,915.39
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		43,229,184.34	58,265,076.64
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		70,062.21	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,452.15	7,780.96
应付托管费		1,817.40	2,593.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	28,697.86	18,200.76
应交税费		10,415.38	0.04
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	43,924.15	882,833.97

负债合计		160,369.15	911,409.36
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	26,113,665.00	42,113,665.00
未分配利润	7.4.7.10	16,955,150.19	15,240,002.28
所有者权益合计		43,068,815.19	57,353,667.28
负债和所有者权益总计		43,229,184.34	58,265,076.64

注：报告截止日2021年12月31日，前海开源中证500等权ETF基金份额净值1.6493元，基金份额总额26,113,665.00份。

## 7.2 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12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年12月31日
<b>一、收入</b>		8,796,967.09	55,259,385.97
1. 利息收入		23,415.42	82,967.05
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,569.21	74,373.43
债券利息收入		17,846.21	8,334.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	259.40
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,389,697.74	85,674,675.12
其中：股票投资收益	7.4.7.12	10,195,911.81	84,150,657.19
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-634.36	81,569.01

资产支持证券投资 收益	7.4.7.14. 5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	594,180.59	-66,500.00
股利收益	7.4.7.17	600,239.70	1,508,948.92
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.18	-2,705,719.73	-32,675,977.60
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.19	89,573.66	2,177,721.40
<b>减：二、费用</b>		359,254.18	1,731,326.28
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	66,419.42	269,826.16
2. 托管费	7.4.10.2. 2	22,139.85	89,942.02
3. 销售服务费	7.4.10.2. 3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	175,271.73	1,056,557.96
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		2,139.25	0.14
7. 其他费用	7.4.7.21	93,283.93	315,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		8,437,712.91	53,528,059.69
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		8,437,712.91	53,528,059.69

### 7.3 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12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	8,437,712.91	8,437,712.91
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)	-16,000,000.00	-6,722,565.00	-22,722,565.00
其中：1. 基金申购款	50,000,000.00	25,385,070.04	75,385,070.04
2. 基金赎回款	-66,000,000.00	-32,107,635.04	-98,107,635.04
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)	26,113,665.00	16,955,150.19	43,068,815.19
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	760,113,665.00	39,731,884.94	799,845,549.94
二、本期经营活动	-	53,528,059.69	53,528,059.69

产生的基金净值变动数(本期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-718,000,000.00	-78,019,942.35	-796,019,942.35
其中: 1. 基金申购款	34,000,000.00	3,711,642.97	37,711,642.97
2. 基金赎回款	-752,000,000.00	-81,731,585.32	-833,731,585.32
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)	42,113,665.00	15,240,002.28	57,353,667.28

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

本财务报表由本基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司于审计报告日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2021年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

##### (2) 金融负债的分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和

报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，可进行收益分配。收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的非标的指数成份股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号—收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

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

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

对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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	1,222,789.88	3,182,313.18
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	1,222,789.88	3,182,313.18

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	38,743,801.05	40,973,132.79	2,229,331.74	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	607,800.00	608,100.00	300.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	607,800.00	608,100.00	300.00
资产支持证券	-	-	-	

基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		39,351,601.05	41,581,232.79	2,229,631.74
项目	上年度末 2020年12月31日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		48,212,893.60	53,103,489.69	4,890,596.09
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	804,224.62	804,520.00	295.38
	银行间市场	-	-	-
	合计	804,224.62	804,520.00	295.38
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		49,017,118.22	53,908,009.69	4,890,891.47

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,401,840.00	-	-	-
股指期货	1,401,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,401,840.00	-	-	-
项目	上年度末 2020年12月31日			



	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,667,340.00	-	-	-
股指期货	3,667,340.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,667,340.00	-	-	-

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12月31日，本基金持有1手中证500股指期货IC2206买入合约，合约市值1,429,560.00元，公允价值变动27,720.00元。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	172.84	264.39
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	46.86	3.30
应收债券利息	5,359.45	17,605.90
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-

应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	21.56	41.80
合计	5,600.71	17,915.39

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	28,697.86	18,200.76
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	28,697.86	18,200.76

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31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	30,000.00	175,000.00
应付指数使用费	3,080.95	35,000.00
可退替代款	10,843.20	-
应付替代款	-	672,833.97
合计	43,924.15	882,833.97

#### 7.4.7.9 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12月31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	50,000,000.00	50,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-66,000,000.00	-66,000,000.00
本期末	26,113,665.00	26,113,665.00

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,347,318.58	-8,107,316.30	15,240,002.28
本期利润	11,143,432.64	-2,705,719.73	8,437,712.91
本期基金份额交易产生的变动数	-10,383,880.35	3,661,315.35	-6,722,565.00
其中：基金申购款	37,814,729.49	-12,429,659.45	25,385,070.04
基金赎回款	-48,198,609.84	16,090,974.80	-32,107,635.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,106,870.87	-7,151,720.68	16,955,150.19

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
活期存款利息收入	3,836.12	56,235.63
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,004.60	10,708.66
其他	728.49	7,429.14
合计	5,569.21	74,373.43

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 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20 21年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至20 20年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,562,631.99	61,534,242.50
股票投资收益——赎回差价收入	3,633,279.82	22,616,414.69
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	10,195,911.81	84,150,657.19

## 7.4.7.12.2 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	68,403,319.77	494,730,211.04
减：卖出股票成本总额	61,840,687.78	433,195,968.54
买卖股票差价收入	6,562,631.99	61,534,242.50

## 7.4.7.12.3 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
赎回基金份额对价总额	98,107,635.04	833,731,585.32
减：现金支付赎回款总额	43,558,917.04	423,236,104.32
减：赎回股票成本总额	50,915,438.18	387,879,066.31
赎回差价收入	3,633,279.82	22,616,414.69

## 7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.13 基金投资收益

无。

## 7.4.7.14 债券投资收益

## 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	-634.36	81,569.01
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	-634.36	81,569.01

## 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月 31日
卖出债券(、债转 股及债券到期兑 付)成交总额	6,103,833.18	898,316.21
减：卖出债券(、 债转股及债券到期 兑付)成本总额	6,041,735.87	806,365.38
减：应收利息总额	62,731.67	10,381.82
买卖债券差价收入	-634.36	81,569.01

## 7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

无。

## 7.4.7.15 贵金属投资收益

## 7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.16 衍生工具收益

## 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间收益金额 2020年01月01日至2020年 12月31日
股指期货投资	594,180.59	-66,500.00

## 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
股票投资产生的股利收益	600,239.70	1,508,948.92
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	600,239.70	1,508,948.92

## 7.4.7.18 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12 月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12 月31日
1. 交易性金融资产	-2,661,259.73	-32,748,157.60
——股票投资	-2,661,264.35	-32,748,452.98
——债券投资	4.62	295.38
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-44,460.00	72,180.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-44,460.00	-
——股指期货投资	-	72,180.00
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	-2,705,719.73	-32,675,977.60

## 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	-	-
ETF基金替代损益	89,573.66	2,177,717.39
其他	-	4.01
合计	89,573.66	2,177,721.40

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	175,271.73	1,056,557.96
银行间市场交易费用	-	-
合计	175,271.73	1,056,557.96

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	30,000.00	55,000.00
信息披露费	50,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	13,283.93	140,000.00
合计	93,283.93	315,000.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明



**7.4.8.1 或有事项**

无。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**7.4.9 关联方关系**

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金”）	基金管理人、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
北京市中盛金期投资管理有限公司	基金管理人的股东
北京长和世纪资产管理有限公司	基金管理人的股东
深圳市和合投信资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
前海开源资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
中国银河 证券股份 有限公司	129,669,628.79	100.00%	657,603,561.63	100.00%

**7.4.10.1.2 权证交易**

无。

## 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例
中国银河 证券股份 有限公司	10,958,101.00	100.00%	2,187,380.87	100.00%

## 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
中国银河 证券股份 有限公司	-	-	400,000.00	100.00%

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例

		例		
中国银河 证券股份 有限公司	94,827.37	100.00%	28,697.86	100.00%
关联方名 称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
中国银河 证券股份 有限公司	480,910.80	100.00%	18,200.76	100.00%

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

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至202 1年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	66,419.42	269,826.16
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	22,139.85	89,942.02

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年12月31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	771,809.00	2.96%	914,540.00	2.17%

##### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

无。

##### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

##### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

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

无。

#### 7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	231	3,818.43	3,818.43	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
110084	贵燃转债	2021-12-27	2022-01-18	配债未上市	100.00	100.00	70	7,000.00	7,000.00	-
113634	珀莱转债	2021-12-08	2022-01-04	配债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.00	-

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。

#### 7.4.12.2 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
002683	广东宏大	2021-1-1 2021-2-2 2021-2-0	重大事项	30.12	2021-2-0 2021-1-0 2021-4	31.00	2,300	68,227.72	69,276.00	-

注：本基金截至2021年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理团队和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理团队负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-

A-1以下	-	-
未评级	599,100.00	799,920.00
合计	599,100.00	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。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资  
无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资  
无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	9,000.00	4,600.00
未评级	-	-
合计	9,000.00	4,600.00

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资  
无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资  
无。

### 7.4.13.3 流动性风险

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



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

于2021年12月31日，除卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2021年12月31日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2021年12月31日，本基金组合资产中经确认的当日净赎回金额未超过7个工作日可变现资产的账面价值。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年1 2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	1,222,789.88	-	-	-	1,222,789.88
结算备付金	94,630.63	-	-	72,145.16	166,775.79
存出保证金	43,569.15	-	-	200,138.40	243,707.55
交易性金融资产	599,100.00	-	9,000.00	40,973,132.79	41,581,232.79
应收证券清算款	-	-	-	9,077.62	9,077.62
应收利息	-	-	-	5,600.71	5,600.71
资产总计	1,960,089.66	-	9,000.00	41,260,094.68	43,229,184.34
负债					
应付证券清算款	-	-	-	80,905.41	80,905.41
应付管	-	-	-	5,452.15	5,452.15

理人报酬					
应付托管费	-	-	-	1,817.40	1,817.40
应付交易费用	-	-	-	28,697.86	28,697.86
应交税费	-	-	-	10,415.38	10,415.38
其他负债	-	-	-	33,080.95	33,080.95
负债总计	-	-	-	160,369.15	160,369.15
利率敏感度缺口	1,960,089.66	-	9,000.00	41,099,725.53	43,068,815.19
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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	7,780.96	7,780.96
应付托	-	-	-	2,593.63	2,593.63

管费					
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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率增加0.25%	-829.39	-61.51
	市场利率减少0.25%	831.67	61.52

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变化而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	40,973,132.79	95.13	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	40,973,132.79	95.13	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7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)

		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	1,697,175.21	2,579,874.23
	业绩比较基准下降5%	-1,697,175.21	-2,579,874.23

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于2021年度，本基金申购基金份额的对价总额为75,385,070.04元(2020年度：37,711,642.97元)，其中包括以股票支付的申购款40,906,164.45元和以现金支付的申购款34,478,905.59元(2020年度：其中包括以股票支付的申购款17,501,632.00元和以现金支付的申购款20,210,010.97元)。

##### (2) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为40,900,038.36元，属于第二层次的余额为681,194.43元，无属于第三层次的余额(2020年12月31日：第一层次52,505,329.22元，第二层次1,402,680.47元，无第三层次)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

###### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(3) 根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	40,973,132.79	94.78
	其中：股票	40,973,132.79	94.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	608,100.00	1.41
	其中：债券	608,100.00	1.41
	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	1,389,565.67	3.21
8	其他各项资产	258,385.88	0.60
9	合计	43,229,184.34	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	475,623.80	1.10
B	采矿业	1,797,107.70	4.17
C	制造业	22,113,740.94	51.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,766,164.02	4.10
E	建筑业	900,311.00	2.09
F	批发和零售业	1,695,069.54	3.94
G	交通运输、仓储和邮政业	1,707,620.52	3.96
H	住宿和餐饮业	163,677.00	0.38
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,267,791.40	7.59
J	金融业	3,064,144.78	7.11
K	房地产业	1,836,933.43	4.27
L	租赁和商务服务业	634,956.00	1.47
M	科学研究和技术服务业	135,641.00	0.31
N	水利、环境和公共设施管理业	420,497.23	0.98
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	67,140.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	752,511.00	1.75



S	综合	170,385.00	0.40
	合计	40,969,314.36	95.13

### 8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,818.43	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
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	3,818.43	0.01

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300751	迈为股份	300	192,690.00	0.45
2	688536	思瑞浦	200	153,600.00	0.36
3	000723	美锦能源	8,500	137,955.00	0.32
4	002249	大洋电机	15,400	135,366.00	0.31
5	600039	四川路桥	10,700	128,828.00	0.30
6	002013	中航机电	7,000	127,260.00	0.30
7	600021	上海电力	9,700	124,354.00	0.29
8	002434	万里扬	8,400	123,816.00	0.29
9	000970	中科三环	7,600	121,980.00	0.28
10	300026	红日药业	15,500	121,365.00	0.28
11	601969	海南矿业	10,000	120,100.00	0.28
12	688099	晶晨股份	915	119,133.00	0.28
13	600160	巨化股份	9,150	118,126.50	0.27
14	688188	柏楚电子	300	115,638.00	0.27
15	600171	上海贝岭	4,500	115,470.00	0.27
16	300058	蓝色光标	10,700	114,811.00	0.27
17	002180	纳思达	2,400	114,624.00	0.27
18	002002	鸿达兴业	18,900	114,534.00	0.27
19	603290	斯达半导	300	114,300.00	0.27
20	601117	中国化学	9,500	114,000.00	0.26
21	003022	联泓新科	3,100	112,964.00	0.26
22	600906	财达证券	8,800	112,288.00	0.26
23	600027	华电国际	20,900	111,815.00	0.26
24	002010	传化智联	12,800	111,360.00	0.26

25	002985	北摩高科	920	110,823.20	0.26
26	688065	凯赛生物	600	110,568.00	0.26
27	603568	伟明环保	2,961	108,165.33	0.25
28	000629	攀钢钒钛	27,700	107,753.00	0.25
29	002505	鹏都农牧	28,100	107,342.00	0.25
30	600500	中化国际	12,400	106,144.00	0.25
31	600516	方大炭素	9,800	106,036.00	0.25
32	002191	劲嘉股份	7,000	105,910.00	0.25
33	600764	中国海防	2,600	105,716.00	0.25
34	002266	浙富控股	14,800	105,376.00	0.24
35	000998	隆平高科	4,500	104,670.00	0.24
36	600885	宏发股份	1,400	104,496.00	0.24
37	603198	迎驾贡酒	1,500	104,175.00	0.24
38	600259	广晟有色	2,100	103,404.00	0.24
39	000738	航发控制	3,400	102,952.00	0.24
40	600131	国网信通	4,700	102,695.00	0.24
41	300088	长信科技	7,700	102,256.00	0.24
42	600566	济川药业	3,600	102,024.00	0.24
43	600549	厦门钨业	4,500	101,835.00	0.24
44	300037	新宙邦	900	101,700.00	0.24
45	603077	和邦生物	29,800	101,618.00	0.24
46	601611	中国核建	10,100	100,697.00	0.23
47	600732	爱旭股份	4,300	100,448.00	0.23
48	601689	拓普集团	1,895	100,435.00	0.23
49	600970	中材国际	8,700	99,441.00	0.23
50	002815	崇达技术	5,900	99,415.00	0.23
51	300182	捷成股份	15,700	99,381.00	0.23
52	600623	华谊集团	10,900	99,190.00	0.23
53	002424	贵州百灵	12,900	98,040.00	0.23
54	600435	北方导航	9,140	97,615.20	0.23
55	601880	辽港股份	56,400	97,572.00	0.23

56	300296	利亚德	9,500	97,375.00	0.23
57	001914	招商积余	4,800	97,248.00	0.23
58	002408	齐翔腾达	9,240	97,020.00	0.23
59	002203	海亮股份	7,800	96,954.00	0.23
60	600580	卧龙电驱	5,300	96,937.00	0.23
61	000009	中国宝安	6,700	96,681.00	0.22
62	600862	中航高科	2,700	96,552.00	0.22
63	600038	中直股份	1,200	96,360.00	0.22
64	300212	易华录	2,720	96,152.00	0.22
65	000630	铜陵有色	27,500	95,700.00	0.22
66	002945	华林证券	7,000	95,620.00	0.22
67	002572	索菲亚	4,300	95,460.00	0.22
68	000729	燕京啤酒	11,200	94,864.00	0.22
69	002372	伟星新材	3,900	94,848.00	0.22
70	600329	中新药业	3,000	94,230.00	0.22
71	600985	淮北矿业	8,400	93,912.00	0.22
72	600718	东软集团	6,900	93,564.00	0.22
73	300376	易事特	9,300	93,465.00	0.22
74	002155	湖南黄金	9,000	93,240.00	0.22
75	000937	冀中能源	16,900	93,119.00	0.22
76	600956	新天绿能	5,400	92,934.00	0.22
77	300133	华策影视	13,700	92,749.00	0.22
78	300763	锦浪科技	400	92,620.00	0.22
79	600637	东方明珠	9,800	92,610.00	0.22
80	002056	横店东磁	4,900	92,463.00	0.21
81	603707	健友股份	2,200	92,400.00	0.21
82	600699	均胜电子	4,200	92,274.00	0.21
83	600466	蓝光发展	45,000	91,800.00	0.21
84	002603	以岭药业	4,676	91,649.60	0.21
85	002138	顺络电子	2,400	91,632.00	0.21
86	300724	捷佳伟创	800	91,440.00	0.21

87	600348	华阳股份	7,700	91,245.00	0.21
88	000883	湖北能源	17,400	91,176.00	0.21
89	600808	马钢股份	24,700	91,143.00	0.21
90	601179	中国西电	16,400	91,020.00	0.21
91	002368	太极股份	3,300	90,882.00	0.21
92	002183	怡亚通	13,700	90,694.00	0.21
93	002416	爱施德	7,963	90,618.94	0.21
94	601869	长飞光纤	2,765	90,526.10	0.21
95	002273	水晶光电	5,189	90,236.71	0.21
96	600563	法拉电子	387	89,938.80	0.21
97	600282	南钢股份	24,300	89,910.00	0.21
98	603883	老百姓	1,820	89,871.60	0.21
99	601608	中信重工	20,150	89,869.00	0.21
100	601555	东吴证券	10,140	89,840.40	0.21
101	603267	鸿远电子	500	89,720.00	0.21
102	600372	中航电子	4,000	89,560.00	0.21
103	002268	卫士通	1,600	89,504.00	0.21
104	002299	圣农发展	3,700	89,429.00	0.21
105	600376	首开股份	15,800	89,428.00	0.21
106	002506	协鑫集成	23,500	89,300.00	0.21
107	000898	鞍钢股份	23,800	89,250.00	0.21
108	600642	申能股份	12,100	89,177.00	0.21
109	000537	广宇发展	3,700	89,170.00	0.21

9					
11 0	000999	华润三九	2,600	89,024.00	0.21
11 1	002244	滨江集团	19,100	89,006.00	0.21
11 2	300146	汤臣倍健	3,300	88,968.00	0.21
11 3	000156	华数传媒	10,500	88,830.00	0.21
11 4	000028	国药一致	2,400	88,752.00	0.21
11 5	603885	吉祥航空	5,000	88,750.00	0.21
11 6	600195	中牧股份	6,774	88,536.18	0.21
11 7	000513	丽珠集团	2,200	88,462.00	0.21
11 8	603786	科博达	1,100	88,330.00	0.21
11 9	601139	深圳燃气	10,000	88,300.00	0.21
12 0	600728	佳都科技	10,600	88,298.00	0.21
12 1	600582	天地科技	20,100	88,038.00	0.20
12 2	600657	信达地产	23,600	88,028.00	0.20
12 3	600754	锦江酒店	1,500	87,900.00	0.20
12 4	300630	普利制药	1,597	87,898.88	0.20
12 5	000960	锡业股份	4,500	87,885.00	0.20

12 6	002128	电投能源	5,900	87,615.00	0.20
12 7	000717	韶钢松山	18,400	87,400.00	0.20
12 8	600839	四川长虹	26,400	87,384.00	0.20
12 9	600787	中储股份	14,000	87,360.00	0.20
13 0	000959	首钢股份	15,200	87,096.00	0.20
13 1	000997	新大陆	4,800	86,976.00	0.20
13 2	002223	鱼跃医疗	2,300	86,940.00	0.20
13 3	002004	华邦健康	12,000	86,880.00	0.20
13 4	600863	内蒙华电	22,000	86,680.00	0.20
13 5	603712	七一二	2,000	86,600.00	0.20
13 6	002048	宁波华翔	4,000	86,520.00	0.20
13 7	603858	步长制药	4,100	86,469.00	0.20
13 8	601615	明阳智能	3,300	86,130.00	0.20
13 9	300251	光线传媒	6,700	86,095.00	0.20
14 0	002557	洽洽食品	1,400	85,904.00	0.20
14 1	600765	中航重机	1,700	85,833.00	0.20
14	300257	开山股份	5,400	85,752.00	0.20

2					
14 3	603228	景旺电子	2,480	85,634.40	0.20
14 4	300017	网宿科技	12,800	85,632.00	0.20
14 5	603650	彤程新材	1,700	85,544.00	0.20
14 6	600325	华发股份	14,200	85,484.00	0.20
14 7	600959	江苏有线	25,900	85,211.00	0.20
14 8	000623	吉林敖东	4,610	85,146.70	0.20
14 9	000090	天健集团	14,500	85,115.00	0.20
15 0	688029	南微医学	400	85,068.00	0.20
15 1	600037	歌华有线	9,800	85,064.00	0.20
15 2	603708	家家悦	5,100	84,864.00	0.20
15 3	603379	三美股份	3,720	84,741.60	0.20
15 4	002701	奥瑞金	12,100	84,700.00	0.20
15 5	300699	光威复材	1,000	84,480.00	0.20
15 6	603444	吉比特	200	84,370.00	0.20
15 7	002831	裕同科技	2,500	84,225.00	0.20
15 8	000598	兴蓉环境	13,300	84,056.00	0.20



159	002384	东山精密	3,100	84,010.00	0.20
160	000031	大悦城	22,500	83,925.00	0.19
161	603317	天味食品	3,130	83,915.30	0.19
162	002399	海普瑞	4,900	83,790.00	0.19
163	600859	王府井	3,100	83,700.00	0.19
164	603000	人民网	5,800	83,636.00	0.19
164	600755	厦门国贸	11,600	83,636.00	0.19
166	000988	华工科技	3,000	83,580.00	0.19
167	600529	山东药玻	1,900	83,410.00	0.19
168	300418	昆仑万维	3,600	83,340.00	0.19
169	300115	长盈精密	4,200	83,328.00	0.19
170	603605	珀莱雅	400	83,324.00	0.19
171	002152	广电运通	7,000	83,300.00	0.19
172	600158	中体产业	5,500	83,160.00	0.19
173	002390	信邦制药	11,200	83,104.00	0.19
174	002946	新乳业	5,200	82,888.00	0.19
17	002385	大北农	7,900	82,871.00	0.19

5					
17 6	603983	丸美股份	2,600	82,862.00	0.19
17 7	002302	西部建设	10,300	82,709.00	0.19
17 8	002065	东华软件	10,600	82,680.00	0.19
17 9	601991	大唐发电	25,500	82,620.00	0.19
18 0	603868	飞科电器	1,900	82,498.00	0.19
18 1	300072	三聚环保	10,400	82,472.00	0.19
18 2	600998	九州通	5,600	82,432.00	0.19
18 3	600256	广汇能源	12,600	82,404.00	0.19
18 4	002038	双鹭药业	7,600	82,156.00	0.19
18 5	300253	卫宁健康	4,900	82,124.00	0.19
18 6	002092	中泰化学	8,600	82,044.00	0.19
18 7	600835	上海机电	5,150	81,988.00	0.19
18 8	600022	山东钢铁	45,800	81,982.00	0.19
18 9	600511	国药股份	2,600	81,978.00	0.19
19 0	600201	生物股份	5,000	81,750.00	0.19
19 1	000039	中集集团	4,760	81,681.60	0.19

19 2	600271	航天信息	6,100	81,679.00	0.19
19 3	600446	金证股份	5,700	81,624.00	0.19
19 4	300383	光环新网	5,500	81,620.00	0.19
19 5	600879	航天电子	9,900	81,576.00	0.19
19 6	600062	华润双鹤	6,100	81,557.00	0.19
19 7	300024	机器人	7,300	81,541.00	0.19
19 8	000930	中粮科技	7,500	81,525.00	0.19
19 9	600875	东方电气	3,800	81,396.00	0.19
20 0	600917	重庆燃气	9,700	81,383.00	0.19
20 1	600008	首创环保	23,864	81,376.24	0.19
20 2	601016	节能风电	12,500	81,375.00	0.19
20 3	600266	城建发展	18,044	81,198.00	0.19
20 4	000415	渤海租赁	27,900	81,189.00	0.19
20 5	002409	雅克科技	1,000	81,170.00	0.19
20 6	002563	森马服饰	10,500	81,165.00	0.19
20 7	300482	万孚生物	2,060	81,122.80	0.19
20	601828	美凯龙	9,200	81,052.00	0.19

8					
20 8	002019	亿帆医药	4,600	81,052.00	0.19
21 0	000062	深圳华强	4,700	80,981.00	0.19
21 1	000400	许继电气	3,100	80,910.00	0.19
21 2	300285	国瓷材料	1,900	80,883.00	0.19
21 3	603056	德邦股份	7,900	80,817.00	0.19
21 4	002174	游族网络	5,300	80,772.00	0.19
21 5	002926	华西证券	8,200	80,770.00	0.19
21 6	600909	华安证券	14,920	80,717.20	0.19
21 7	600648	外高桥	6,100	80,703.00	0.19
21 8	601200	上海环境	6,410	80,701.90	0.19
21 9	000887	中鼎股份	3,700	80,697.00	0.19
22 0	002221	东华能源	6,400	80,576.00	0.19
22 1	002440	闰土股份	8,400	80,556.00	0.19
22 2	000559	万向钱潮	12,640	80,516.80	0.19
22 3	600528	中铁工业	9,800	80,458.00	0.19
22 4	600006	东风汽车	11,800	80,358.00	0.19

22 5	600056	中国医药	6,800	80,308.00	0.19
22 6	601168	西部矿业	5,900	80,299.00	0.19
22 7	600167	联美控股	8,900	80,189.00	0.19
22 8	300618	寒锐钴业	1,000	80,180.00	0.19
22 9	600487	亨通光电	5,300	80,136.00	0.19
23 0	600597	光明乳业	5,519	80,135.88	0.19
23 1	600598	北大荒	5,500	80,080.00	0.19
23 2	601860	紫金银行	23,900	80,065.00	0.19
23 3	000519	中兵红箭	3,000	80,010.00	0.19
23 4	600026	中远海能	13,500	79,920.00	0.19
23 5	601000	唐山港	29,000	79,750.00	0.19
23 6	002925	盈趣科技	2,340	79,630.20	0.18
23 7	601456	国联证券	5,700	79,629.00	0.18
23 8	000877	天山股份	5,200	79,612.00	0.18
23 9	600141	兴发集团	2,100	79,548.00	0.18
24 0	000540	中天金融	30,100	79,464.00	0.18
24	000563	陕国投 A	24,600	79,458.00	0.18

1					
24 2	000050	深天马 A	6,100	79,422.00	0.18
24 3	688208	道通科技	1,000	79,400.00	0.18
24 4	601106	中国一重	22,800	79,344.00	0.18
24 5	600649	城投控股	19,300	79,323.00	0.18
24 6	600663	陆家嘴	7,300	79,278.00	0.18
24 7	600177	雅戈尔	11,500	79,235.00	0.18
24 8	600782	新钢股份	15,000	79,200.00	0.18
24 8	600170	上海建工	22,000	79,200.00	0.18
25 0	601975	招商南油	39,400	79,194.00	0.18
25 1	002281	光迅科技	3,400	79,186.00	0.18
25 2	600801	华新水泥	4,100	79,130.00	0.18
25 3	600498	烽火通信	4,400	79,112.00	0.18
25 4	600643	爱建集团	11,700	79,092.00	0.18
25 5	600556	天下秀	6,400	79,040.00	0.18
25 5	002705	新宝股份	3,200	79,040.00	0.18
25 5	002081	金螳螂	13,000	79,040.00	0.18

25 8	000983	山西焦煤	9,550	78,978.50	0.18
25 9	600803	新奥股份	4,300	78,948.00	0.18
25 9	002739	万达电影	5,100	78,948.00	0.18
26 1	600867	通化东宝	7,200	78,912.00	0.18
26 2	603515	欧普照明	3,800	78,888.00	0.18
26 3	002028	思源电气	1,600	78,736.00	0.18
26 4	600118	中国卫星	2,900	78,735.00	0.18
26 5	300315	掌趣科技	16,200	78,732.00	0.18
26 6	600823	世茂股份	24,000	78,720.00	0.18
26 6	600486	扬农化工	600	78,720.00	0.18
26 8	600155	华创阳安	7,900	78,684.00	0.18
26 9	688002	睿创微纳	1,000	78,570.00	0.18
26 9	600415	小商品城	16,200	78,570.00	0.18
27 1	601298	青岛港	13,800	78,522.00	0.18
27 2	000089	深圳机场	10,700	78,324.00	0.18
27 3	600895	张江高科	5,200	78,312.00	0.18
27	002382	蓝帆医疗	4,800	78,192.00	0.18

4					
27 5	600316	洪都航空	2,000	78,120.00	0.18
27 5	300168	万达信息	6,000	78,120.00	0.18
27 7	600739	辽宁成大	4,000	78,080.00	0.18
27 8	003035	南网能源	9,400	77,926.00	0.18
27 9	600126	杭钢股份	15,160	77,770.80	0.18
28 0	002670	国盛金控	8,100	77,760.00	0.18
28 1	000401	冀东水泥	6,500	77,740.00	0.18
28 2	002595	豪迈科技	2,800	77,728.00	0.18
28 3	600871	石化油服	36,300	77,682.00	0.18
28 4	600390	五矿资本	14,600	77,672.00	0.18
28 5	600188	兖矿能源	3,300	77,649.00	0.18
28 6	000402	金融街	13,700	77,542.00	0.18
28 7	601997	贵阳银行	11,900	77,469.00	0.18
28 8	600350	山东高速	15,000	77,400.00	0.18
28 9	688521	芯原股份	1,000	77,360.00	0.18
29 0	002127	南极电商	11,200	77,280.00	0.18



29 1	603638	艾迪精密	2,420	77,246.40	0.18
29 2	601568	北元集团	9,500	77,235.00	0.18
29 3	002958	青农商行	20,000	77,200.00	0.18
29 4	000046	泛海控股	41,000	77,080.00	0.18
29 5	000961	中南建设	18,600	77,004.00	0.18
29 6	002078	太阳纸业	6,700	76,983.00	0.18
29 7	600928	西安银行	17,900	76,970.00	0.18
29 8	601005	重庆钢铁	36,800	76,912.00	0.18
29 9	601699	潞安环能	6,800	76,908.00	0.18
30 0	600216	浙江医药	4,500	76,860.00	0.18
30 1	601928	凤凰传媒	9,500	76,855.00	0.18
30 2	002429	兆驰股份	15,800	76,788.00	0.18
30 3	600399	抚顺特钢	3,100	76,787.00	0.18
30 4	600377	宁沪高速	8,900	76,718.00	0.18
30 5	688289	圣湘生物	1,300	76,700.00	0.18
30 5	001965	招商公路	10,000	76,700.00	0.18
30	600060	海信视像	5,700	76,665.00	0.18

7					
30 8	600373	中文传媒	6,200	76,632.00	0.18
30 9	002340	格林美	7,400	76,590.00	0.18
31 0	600418	江淮汽车	4,400	76,560.00	0.18
31 0	300741	华宝股份	1,600	76,560.00	0.18
31 2	600517	国网英大	10,500	76,545.00	0.18
31 3	002966	苏州银行	11,300	76,501.00	0.18
31 4	600967	内蒙一机	6,400	76,480.00	0.18
31 5	600901	江苏租赁	15,000	76,350.00	0.18
31 6	600522	中天科技	4,500	76,320.00	0.18
31 7	002242	九阳股份	3,288	76,281.60	0.18
31 8	603355	莱克电气	2,600	76,232.00	0.18
31 9	600968	海油发展	26,000	76,180.00	0.18
32 0	002233	塔牌集团	7,200	76,176.00	0.18
32 1	601778	晶科科技	8,926	76,138.78	0.18
32 2	002146	荣盛发展	17,500	76,125.00	0.18
32 3	300474	景嘉微	500	76,100.00	0.18

32 4	000990	诚志股份	4,807	76,046.74	0.18
32 5	600066	宇通客车	6,900	76,038.00	0.18
32 6	000825	太钢不锈	10,800	76,032.00	0.18
32 6	000021	深科技	4,800	76,032.00	0.18
32 8	000488	晨鸣纸业	10,500	76,020.00	0.18
32 9	002353	杰瑞股份	1,900	76,000.00	0.18
33 0	600827	百联股份	5,700	75,981.00	0.18
33 1	002901	大博医疗	1,500	75,930.00	0.18
33 2	300463	迈克生物	2,600	75,894.00	0.18
33 3	600258	首旅酒店	2,900	75,777.00	0.18
33 4	600704	物产中大	12,800	75,776.00	0.18
33 5	601598	中国外运	16,900	75,712.00	0.18
33 6	002131	利欧股份	30,700	75,522.00	0.18
33 7	002250	联化科技	4,200	75,474.00	0.18
33 8	601866	中远海发	23,200	75,400.00	0.18
33 9	600497	驰宏锌锗	15,100	75,349.00	0.17
34	002423	中粮资本	9,300	75,330.00	0.17

0					
34 1	603613	国联股份	700	75,250.00	0.17
34 2	600507	方大特钢	9,631	75,121.80	0.17
34 3	600297	广汇汽车	28,100	75,027.00	0.17
34 4	002430	杭氧股份	2,500	75,025.00	0.17
34 5	600707	彩虹股份	11,000	75,020.00	0.17
34 6	002532	天山铝业	9,200	74,980.00	0.17
34 7	601228	广州港	22,500	74,925.00	0.17
34 8	000778	新兴铸管	17,300	74,909.00	0.17
34 9	600536	中国软件	1,500	74,895.00	0.17
35 0	000027	深圳能源	9,220	74,682.00	0.17
35 1	002797	第一创业	10,200	74,664.00	0.17
35 2	600392	盛和资源	3,804	74,634.48	0.17
35 3	002075	沙钢股份	12,800	74,624.00	0.17
35 4	001872	招商港口	4,400	74,580.00	0.17
35 5	000733	振华科技	600	74,568.00	0.17
35 6	600903	贵州燃气	7,700	74,536.00	0.17

35 7	601187	厦门银行	10,800	74,520.00	0.17
35 8	600535	天士力	4,700	74,495.00	0.17
35 9	300357	我武生物	1,300	74,490.00	0.17
36 0	601958	金钼股份	10,800	73,980.00	0.17
36 1	000728	国元证券	9,600	73,920.00	0.17
36 1	000656	金科股份	16,500	73,920.00	0.17
36 3	001203	大中矿业	4,900	73,892.00	0.17
36 4	600705	中航产融	18,600	73,842.00	0.17
36 5	000709	河钢股份	30,000	73,800.00	0.17
36 6	600673	东阳光	8,300	73,704.00	0.17
36 7	601333	广深铁路	32,900	73,696.00	0.17
36 8	600521	华海药业	3,400	73,644.00	0.17
36 9	002468	申通快递	8,100	73,629.00	0.17
37 0	600667	太极实业	9,100	73,528.00	0.17
37 1	688321	微芯生物	2,100	73,521.00	0.17
37 2	002673	西部证券	9,100	73,437.00	0.17
37	300136	信维通信	2,900	73,428.00	0.17

3					
37 4	000690	宝新能源	12,400	73,408.00	0.17
37 5	601718	际华集团	24,600	73,308.00	0.17
37 6	601198	东兴证券	6,300	73,269.00	0.17
37 7	000528	柳工	9,500	73,245.00	0.17
37 8	002444	巨星科技	2,400	73,224.00	0.17
37 9	600236	桂冠电力	11,400	73,188.00	0.17
38 0	603456	九洲药业	1,300	73,138.00	0.17
38 1	600572	康恩贝	14,600	73,000.00	0.17
38 2	300869	康泰医学	1,800	72,990.00	0.17
38 3	603927	中科软	2,660	72,777.60	0.17
38 4	600315	上海家化	1,800	72,738.00	0.17
38 5	000718	苏宁环球	15,433	72,689.43	0.17
38 6	603225	新凤鸣	4,889	72,601.65	0.17
38 7	600884	杉杉股份	2,215	72,585.55	0.17
38 8	002939	长城证券	5,600	72,520.00	0.17
38 9	002085	万丰奥威	13,200	72,468.00	0.17

39 0	600298	安琪酵母	1,200	72,432.00	0.17
39 1	002458	益生股份	6,400	72,384.00	0.17
39 2	600339	中油工程	23,500	72,380.00	0.17
39 3	000012	南玻 A	7,282	72,310.26	0.17
39 4	002195	二三四五	30,900	72,306.00	0.17
39 5	300308	中际旭创	1,700	72,250.00	0.17
39 6	601156	东航物流	3,300	72,204.00	0.17
39 7	603719	良品铺子	1,700	72,199.00	0.17
39 8	300001	特锐德	2,900	72,123.00	0.17
39 9	002465	海格通信	6,600	72,072.00	0.17
40 0	002508	老板电器	2,000	72,040.00	0.17
40 1	002867	周大生	4,050	72,009.00	0.17
40 2	601077	渝农商行	18,700	71,995.00	0.17
40 3	601636	旗滨集团	4,200	71,820.00	0.17
40 3	002507	涪陵榨菜	1,900	71,820.00	0.17
40 5	600233	圆通速递	4,300	71,724.00	0.17
40	600153	建发股份	7,900	71,653.00	0.17

6					
40 7	300363	博腾股份	800	71,560.00	0.17
40 8	600820	隧道股份	13,300	71,554.00	0.17
40 9	000636	风华高科	2,400	71,520.00	0.17
41 0	002080	中材科技	2,100	71,442.00	0.17
41 1	300166	东方国信	6,600	71,280.00	0.17
41 2	002690	美亚光电	1,900	71,174.00	0.17
41 3	300271	华宇软件	5,600	71,120.00	0.17
41 4	002294	信立泰	2,600	71,032.00	0.16
41 5	000758	中色股份	13,000	70,980.00	0.16
41 6	603589	口子窖	1,000	70,870.00	0.16
41 7	600157	永泰能源	38,900	70,798.00	0.16
41 8	002396	星网锐捷	3,000	70,710.00	0.16
41 9	601717	郑煤机	6,100	70,699.00	0.16
42 0	002387	维信诺	7,600	70,528.00	0.16
42 1	601003	柳钢股份	13,500	70,470.00	0.16
42 1	600409	三友化工	8,100	70,470.00	0.16



42 3	601665	齐鲁银行	12,600	70,308.00	0.16
42 4	002511	中顺洁柔	4,200	70,182.00	0.16
42 5	000739	普洛药业	2,000	70,180.00	0.16
42 6	601098	中南传媒	7,300	69,861.00	0.16
42 7	000987	越秀金控	8,000	69,600.00	0.16
42 8	002745	木林森	4,600	69,598.00	0.16
42 9	688005	容百科技	600	69,348.00	0.16
43 0	002500	山西证券	10,500	69,300.00	0.16
43 1	002683	广东宏大	2,300	69,276.00	0.16
43 2	000060	中金岭南	14,100	69,231.00	0.16
43 3	600811	东方集团	23,000	69,230.00	0.16
43 4	603218	日月股份	2,100	69,195.00	0.16
43 5	600208	新潮中宝	23,200	69,136.00	0.16
43 6	000685	中山公用	7,800	69,030.00	0.16
43 7	002212	天融信	3,600	69,012.00	0.16
43 8	000932	华菱钢铁	13,500	68,985.00	0.16
43	002153	石基信息	2,400	68,976.00	0.16

9					
44 0	600482	中国动力	3,500	68,950.00	0.16
44 1	002375	亚厦股份	9,200	68,908.00	0.16
44 2	600166	福田汽车	20,000	68,800.00	0.16
44 3	600567	山鹰国际	20,900	68,761.00	0.16
44 4	002030	达安基因	3,421	68,625.26	0.16
44 5	600737	中粮糖业	7,300	68,620.00	0.16
44 6	002439	启明星辰	2,400	68,472.00	0.16
44 7	603893	瑞芯微	500	68,450.00	0.16
44 8	000553	安道麦A	8,100	68,364.00	0.16
44 9	600307	酒钢宏兴	31,000	68,200.00	0.16
45 0	600546	山煤国际	8,300	68,143.00	0.16
45 1	601577	长沙银行	8,700	67,947.00	0.16
45 2	600095	湘财股份	6,700	67,804.00	0.16
45 3	600299	安迪苏	5,500	67,760.00	0.16
45 4	600639	浦东金桥	5,300	67,681.00	0.16
45 5	601872	招商轮船	16,500	67,650.00	0.16

45 6	300009	安科生物	5,155	67,478.95	0.16
45 7	300244	迪安诊断	2,000	67,140.00	0.16
45 8	600717	天津港	16,008	67,073.52	0.16
45 9	300223	北京君正	500	67,000.00	0.16
46 0	002936	郑州银行	21,197	66,982.52	0.16
46 1	000547	航天发展	4,000	66,800.00	0.16
46 2	000581	威孚高科	3,100	66,774.00	0.16
46 3	600369	西南证券	12,600	66,654.00	0.15
46 4	600064	南京高科	7,100	66,314.00	0.15
46 5	300070	碧水源	9,200	66,148.00	0.15
46 6	000671	阳光城	21,900	66,138.00	0.15
46 7	000750	国海证券	16,030	65,883.30	0.15
46 8	002373	千方科技	4,404	65,839.80	0.15
46 9	600776	东方通信	5,700	65,607.00	0.15
47 0	601992	金隅集团	23,100	65,604.00	0.15
47 1	002653	海思科	3,200	65,280.00	0.15
47	002124	天邦股份	10,120	65,172.80	0.15

2					
47 3	600120	浙江东方	14,658	64,788.36	0.15
47 4	002110	三钢闽光	9,500	64,600.00	0.15
47 5	688006	杭可科技	600	64,548.00	0.15
47 6	000975	银泰黄金	7,340	64,445.20	0.15
47 7	002422	科伦药业	3,400	64,362.00	0.15
47 8	000878	云南铜业	4,800	64,176.00	0.15
47 9	600733	北汽蓝谷	6,400	64,128.00	0.15
48 0	002156	通富微电	3,300	64,119.00	0.15
48 1	600988	赤峰黄金	4,300	64,070.00	0.15
48 2	601118	海南橡胶	12,100	63,888.00	0.15
48 3	000869	张裕 A	2,000	63,720.00	0.15
48 4	000807	云铝股份	5,700	63,669.00	0.15
48 5	002185	华天科技	5,000	63,550.00	0.15
48 6	600398	海澜之家	9,900	63,459.00	0.15
48 7	600908	无锡银行	11,100	62,937.00	0.15
48 8	000830	鲁西化工	4,100	62,566.00	0.15

489	603156	养元饮品	2,200	62,502.00	0.15
490	600729	重庆百货	2,400	62,448.00	0.14
491	000158	常山北明	9,000	62,280.00	0.14
492	688088	虹软科技	1,400	61,684.00	0.14
493	601128	常熟银行	9,300	61,473.00	0.14
494	002948	青岛银行	13,000	60,190.00	0.14
495	000967	盈峰环境	8,200	60,106.00	0.14
496	605358	立昂微	500	60,005.00	0.14
497	603866	桃李面包	2,080	59,072.00	0.14
498	603127	昭衍新药	500	57,715.00	0.13
499	000686	东北证券	6,500	57,070.00	0.13
500	600380	健康元	3,600	46,224.00	0.11

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001234	泰慕士	231	3,818.43	0.01

注：本基金本报告期末仅持有以上积极投资股票。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603290	斯达半导	570,794.00	1.00
2	300751	迈为股份	518,360.00	0.90
3	000799	酒鬼酒	516,721.00	0.90
4	002985	北摩高科	432,087.00	0.75
5	300223	北京君正	334,172.00	0.58
6	300037	新宙邦	301,051.00	0.52
7	002791	坚朗五金	293,224.00	0.51
8	003022	联泓新科	284,018.00	0.50
9	688002	睿创微纳	282,158.42	0.49
10	300474	景嘉微	274,846.00	0.48
11	603605	珀莱雅	273,473.00	0.48
12	000009	中国宝安	246,995.00	0.43
13	002709	天赐材料	242,561.00	0.42
14	300699	光威复材	239,540.00	0.42
15	603737	三棵树	238,297.00	0.42
16	002340	格林美	237,658.00	0.41
17	603345	安井食品	234,252.00	0.41
18	000932	华菱钢铁	227,213.00	0.40
19	002074	国轩高科	223,796.00	0.39
20	000718	苏宁环球	220,879.00	0.39

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

## 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002709	天赐材料	529,017.15	0.92

2	000799	酒鬼酒	506,270.00	0.88
3	002985	北摩高科	450,042.00	0.78
4	000537	广宇发展	441,492.00	0.77
5	603290	斯达半导	425,880.00	0.74
6	300474	景嘉微	425,847.00	0.74
7	002791	坚朗五金	424,063.00	0.74
8	002648	卫星化学	414,538.00	0.72
9	002074	国轩高科	398,891.00	0.70
10	300274	阳光电源	398,756.00	0.70
11	300316	晶盛机电	396,312.00	0.69
12	300223	北京君正	392,146.00	0.68
13	300207	欣旺达	381,202.00	0.66
14	002268	卫士通	366,563.00	0.64
15	002080	中材科技	358,191.00	0.62
16	000519	中兵红箭	355,979.00	0.62
17	002340	格林美	332,541.00	0.58
18	300595	欧普康视	331,467.40	0.58
19	000009	中国宝安	330,016.00	0.58
20	300496	中科创达	326,315.00	0.57

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	62,380,868.96
卖出股票收入（成交）总额	68,403,319.77

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	--------------

1	国家债券	599,100.00	1.39
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)	9,000.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	608,100.00	1.41

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019658	21国债10	6,000	599,100.00	1.39
2	110084	贵燃转债	70	7,000.00	0.02
3	113634	珀莱转债	20	2,000.00	0.00

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

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

无。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买)	合约市值	公允价值	风险说明
----	----	--------	------	------	------



		/卖)		变动	
IC2206	中证500股指期货2 206合约	1	1,429,56 0.00	27,720.00	-
公允价值变动总额合计（元）					27,720.00
股指期货投资本期收益（元）					594,180.5 9
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-44,460.0 0

### 8.10.2 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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

## 8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

## 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	243,707.55
2	应收证券清算款	9,077.62
3	应收股利	-
4	应收利息	5,600.71
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	258,385.88

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

## 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	---------------	----------

1	001234	泰慕士	3,818.43	0.01	新股未上市
---	--------	-----	----------	------	-------

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
760	34,360.09	8,575,482.00	32.84%	17,538,183.00	67.16%

### 9.2 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	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	2,953,500.00	11.31%
2	中信建投证券股份有限公司	2,255,908.00	8.64%
3	前海开源基金—尤薇—前海开源黄金盛世1号单一资产管理计划	2,143,000.00	8.21%
4	中国银河证券股份有限公司	771,809.00	2.96%
5	辛明蕾	589,013.00	2.26%
6	梁小琴	500,000.00	1.91%
7	杨建中	422,500.00	1.62%
8	刘百荣	400,000.00	1.53%
9	蒋祖逸	400,000.00	1.53%
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	1.34%

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。

### 9.3 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%

### 9.4 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、基金投资和研究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

## § 10 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	50,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	66,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	26,113,665.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

2021年3月11日，总经理贾红波先生离任，董事长王兆华先生代任总经理一职；

2021年5月19日起，曲扬先生、邱杰先生任副总经理；

2021年5月21日起，何隽先生任副总经理；

2021年7月1日起，秦亚峰先生任总经理；

2021年10月25日，督察长傅成斌先生离任，董事长王兆华先生代任督察长一职。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

基金托管人于2021年9月30日发布《中国银河证券股份有限公司托管部门负责人变更公告》，罗黎明于2021年9月29日起担任托管部门负责人。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本年度应支付的审计费用为3万元。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今，本报告期内无改聘会计师事务所的事项。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	5	129,669,628.79	100.00%	94,827.37	100.00%	-

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

#### A：选择标准

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

4、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

#### B: 选择流程

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

1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座;

2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实,投资建议是否准确;

3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
银河证券	10,958,101.00	100.00%	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	前海开源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	中国证监会规定媒介	2021-03-12

	金基金产品资料概要更新(20210312更新)		
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
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2020年年度报告	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合同(2021年3月修订)	中国证监会规定媒介	2021-03-31
9	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
10	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》修改基金合同部分条款的公告	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	中国证监会规定媒介	2021-04-28

	的公告		
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	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
16	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
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
19	关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过上海联泰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	2021-07-06
20	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2季度报告	中国证监会规定媒介	2021-07-21
21	关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过天风证券	中国证监会规定媒介	2021-08-04



	股份有限公司办理定投业务起点金额的公告		
22	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与工商银行费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-08-28
23	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	中国证监会规定媒介	2021-08-31
24	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	中国证监会规定媒介	2021-09-02
25	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与建设银行费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-09-06
26	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3季度报告	中国证监会规定媒介	2021-10-27
27	关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过上海陆金所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	2021-11-11
28	关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过珠海华润银行股份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	2021-11-22
29	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（20211214更新）	中国证监会规定媒介	2021-12-14
30	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（20211214更新）	中国证监会规定媒介	2021-12-14

31	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与中国邮政储蓄银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-12-31
32	前海开源基金管理有限公司关于汇款交易业务在电子直销平台实施费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2021-12-31
33	前海开源基金管理有限公司关于开源宝赎回转认/申购基金业务在电子直销平台实施费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2021-12-31

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20211104 - 20211104	3,075,054.00	67,182,005.00	68,001,151.00	2,255,908.00	8.64%
	2	20211227 - 20211227	3,075,054.00	67,182,005.00	68,001,151.00	2,255,908.00	8.64%
产品特有风险							
<p>1. 大额赎回风险 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的大额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>2. 终止基金合同的风险 单一投资者大额赎回后，若本基金连续55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，基金管理人应当终止基金合同，其他投资者可能面临终止基金合同的风险；</p> <p>3. 流动性风险 单一投资者大额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；</p> <p>4. 大额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。</p>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、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。

2、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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

(1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源中证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

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 13.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

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

(3) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：[www.qhkyfund.com](http://www.qhkyfund.com)

前海开源基金管理有限公司

二〇二二年三月三十一日

