

前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 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:招商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年01月01日起至2022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	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	9
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	10
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	23
§7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	70
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	70
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	70
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	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
7.12 投资组合报告附注	71
§8 基金份额持有人信息	72
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	73
§9 开放式基金份额变动	73
§10 重大事件揭示	74
10.1 基金份额持有人大会决议	74
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	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
10.4 基金投资策略的改变	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
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	74
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
10.8 其他重大事件	76
§11 影响投资者决策的其他重要信息	79
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	79
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	79
§12 备查文件目录	79
12.1 备查文件目录	79
12.2 存放地点	79
12.3 查阅方式	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金	
基金简称	前海开源MSCI中国A股指数	
基金主代码	006524	
基金运作方式	契约型普通开放式	
基金合同生效日	2018年11月27日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	7,746,863.21份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海开源MSCI中国A 股指数A	前海开源MSCI中国A 股指数C
下属分级基金的交易代码	006524	006525
报告期末下属分级基金的份额总额	4,012,155.99份	3,734,707.22份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，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，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p>

本基金的投资策略主要有以下八个方面内容：

1、大类资产配置

本基金管理人主要按照MSCI中国A股指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

2、股票投资策略

(1) 股票投资组合构建

本基金采用完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。由于跟踪组合构建与标的指数组合构建存在差异，若出现较为特殊的情况（例如成份股停牌、股票流动性不足以及其他影响指数复制效果的因素），本基金将采用包括替代、抽样等技术手段在内的优化复制法来构建组合，使得跟踪组合尽可能近似于全复制组合，以减少对标的指数的跟踪误差。本基金所采用替代法调整的股票组合应符合投资于股票的资产比例不低于基金资产的80%的比例限制，并符合投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%的投资比例限制。

(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MSCI中国A股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、申购赎回变动情况等，对其进行适时调整，以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

3、债券投资策略

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资，通过主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收

益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。

4、权证投资策略

本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。

5、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。

6、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

7、现金管理策略

为保持基金的资产流动性，本基金可适当投资于货币市场工具。具体而言，本基金将根据基金资产组合中的现金存量水平、申购赎回情况及基金跟踪误差控制情况，在确定总体流动性要求的基础上，综合考虑宏观经济形势、市场资金面走向、交易对手的信用资质以及各类资产收益率水平等，确定各类货币市场工具的配置比例，并定期对组合的平均剩余期限及投资品种比例进行适当调整，在保证基金资产安全性和流动性的基础上力争创造稳定的收益。

	<p>8、其他</p> <p>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	MSCI中国A股指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金紧密跟踪标的指数表现，具有与标的指数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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙辰健
	联系电话	0755-83182300
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com
客户服务电话	4001-666-998	95555
传真	0755-83181169	0755-83195201
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	518040	518040
法定代表人	李强	缪建民

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	www.qhkyfund.com

址	
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日-2022年06月30日)	
	前海开源MSCI中国 A股指数A	前海开源MSCI中国 A股指数C
本期已实现收益	-94,830.88	-92,958.73
本期利润	-624,686.29	-573,237.91
加权平均基金份额本期利润	-0.1509	-0.1499
本期加权平均净值利润率	-10.56%	-10.54%
本期基金份额净值增长率	-8.53%	-8.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	1,964,778.51	1,787,810.42
期末可供分配基金份额利润	0.4897	0.4787
期末基金资产净值	5,976,934.50	5,522,517.64
期末基金份额净值	1.4897	1.4787
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	63.35%	62.16%

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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

前海开源MSCI中国A股指数A

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	9.47%	1.00%	8.90%	1.01%	0.57%	-0.01%
过去三个月	6.98%	1.39%	6.29%	1.39%	0.69%	0.00%
过去六个月	-8.53%	1.39%	-8.57%	1.39%	0.04%	0.00%
过去一年	-11.86%	1.18%	-11.72%	1.18%	-0.14%	0.00%
过去三年	36.73%	1.21%	27.31%	1.20%	9.42%	0.01%
自基金合同生效起至今	63.35%	1.22%	53.26%	1.24%	10.09%	-0.02%

前海开源MSCI中国A股指数C

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	9.45%	1.00%	8.90%	1.01%	0.55%	-0.01%
过去三个月	6.93%	1.40%	6.29%	1.39%	0.64%	0.01%
过去六个月	-8.62%	1.39%	-8.57%	1.39%	-0.05%	0.00%
过去一年	-12.04%	1.18%	-11.72%	1.18%	-0.32%	0.00%
过去三年	35.87%	1.21%	27.31%	1.20%	8.56%	0.01%

自基金合同生效起至今	62.16%	1.22%	53.26%	1.24%	8.90%	-0.02%
------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

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MSCI中国A股指数A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年11月27日-2022年06月30日)



前海开源MSCI中国A股指数C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年11月27日-2022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1474亿元。

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	2020-12-18	-	8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

上半年前四个月A股被突如其来的内外“黑天鹅”事件冲击，市场出现了极度悲观情绪的集中宣泄。投资者对地缘政治冲突、大宗商品价格暴涨导致的通胀压力、美联储加息等因素反应过度，同时受国内各地疫情反复影响，市场出现了明显的超跌。五月以来A股无视海外资本市场动荡展开了强势反攻。本基金标的指数MSCI中国A股指数自四月底以来触底反弹超过20%，但综合来看上半年仍然表现不佳。本基金A类份额上半年累计下跌8.53%，C类份额累计下跌8.62%。为了对抗高企的通胀，美联储于6月份历史性加息75BP，并在FOMC会议纪要中新增了“坚定致力于让通胀回到2%的目标”的相关描述。我们判断，在当前通胀高企的背景下，鹰派的立场更有利于美国以较小的代价降低通胀，后续美联储大概率仍将维持强硬的鹰派政策立场，但美联储货币政策对市场影响最大的预期发酵阶段已经过去，对国内资产价格的影响将让位于国内基本面，近两个月中美股市截然相反的走势也验证了我们的观点。站在当前时点展望，俄乌冲突长期化，升级的可能性小，对市场冲击高点可能已经过去。伴随着疫情的显著缓解，常态化核酸检测等措施下，预计未来疫情持续可控，市场信心得到明显修复，经济发展和疫情防控将更协调。国内货币政策“以我为主”依然宽松，财政方面一揽子纾困政策在二季度已加速落地，下半年稳就业政策不断出台，国内经济有望在下半年加速复苏。经过持续回调，本指数的估值压力得到了进一步的释放，投资性价比持续提升。我们建议投资者树立正确的长期投资理念以对抗短期市场的不确定性。对于长期投资者来说，持有期间或许会有剧烈的波动，这些波动可能耐人寻味，但却如同千里之外的暴风雨和大海的落潮一样，对长期投资者来说无关紧要。一般的投资理论认为随着持有期的变长，投资的不确定性变大，风险是更大的，但是对于绝大多数普通投资者来说，随着持有期的延长，尽管期间经历股灾或者黑天鹅的机会可能会更大，但投资者获得正收益的概率却更大了。因此我们希望本基金的持有人都能沉下心来，淡忘市场短期波动，摒弃交易冲动，通过长期投资经过充分多元化的指数基金从而分享中国繁荣发展的时代红利。

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，力争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，及时对“地雷股”进行出清，并通过新股申购及现金管理等较低风险的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MSCI中国A股指数A基金份额净值为1.4897元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.53%，同期业绩比较基准收益率为-8.57%；截至报告期末

前海开源MSCI中国A股指数C基金份额净值为1.4787元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.62%，同期业绩比较基准收益率为-8.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

为了对抗高企的通胀，美联储于6月份历史性加息75BP，并在FOMC会议纪要中新增了“坚定致力于让通胀回到2%的目标”的相关描述。在当前通胀高企的背景下，美联储面临两难的抉择，继续保持鹰派的立场将更有利于美国以相对较小的代价降低通胀，因此我们判断短期之内美联储鹰派立场将难以转向。美联储加息周期下A股市场和其他主要资产波动明显加剧。但我们判断加息预期充分反应后，美联储货币政策对资产价格的影响将让位于A股基本面，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。如6月底易纲行长就表示货币政策将继续从总量上发力以支持经济复苏。财政政策方面，下半年狭义财政（赤字率、专项债、特别国债）变动的可能性不大，更多通过广义财政来发力，例如结构化货币政策工具定向支持一些长期发展领域。疫情政策方面，在执行层面上，从5月份以来已经在进行优化，减少疫情对人口流动的限制，减少疫情对经济的冲击。伴随疫情常态化控制，国内经济的逐步企稳以及促消费政策的逐渐见效，叠加信贷需求逐步改善，下半年部分行业业绩有望触及底部，同时下游需求旺盛、产业景气高企的新能源相关产业高景气有望继续延续。与此同时，伴随全球经济增长动能的回落以及国内地产投资的低迷，上半年业绩维持高增的上游资源品行业景气度或趋于回落，房地产以及地产投资链条相关行业业绩修复的不确定性仍存。

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，但下半年有可能会触底反弹。市场驱动力或从业绩转向估值，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股受益于实体经济的韧性、国内合理充裕的流动性、有利的长期资金流入条件等利好因素的影响，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。

4.7 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。

本基金从2020年07月06日至2022年06月30日连续483个工作日基金资产净值低于五千万元，我公司已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

§ 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	530,040.98	406,878.80
结算备付金		704.62	2,101.25
存出保证金		680.36	861.31
交易性金融资产	6.4.7.2	11,094,063.60	12,833,149.13
其中：股票投资		10,692,219.10	12,286,948.63
基金投资		-	-
债券投资		401,844.50	546,200.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		51,043.11	148,127.40

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	4,799.01
资产总计		11,676,532.67	13,395,916.90
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		124,112.22	124,845.13
应付管理人报酬		4,509.23	5,641.61
应付托管费		901.85	1,128.31
应付销售服务费		857.69	1,064.24
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	46,699.54	33,221.04
负债合计		177,080.53	165,900.33
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	7,746,863.21	8,148,276.80
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	3,752,588.93	5,081,739.77
净资产合计		11,499,452.14	13,230,016.57
负债和净资产总计		11,676,532.67	13,395,916.90

注：报告截止日2022年6月30日，前海开源MSCI中国A股指数基金份额总额7,746,863.21份，其中，前海开源MSCI中国A股指数A类基金份额净值1.4897元，基金份额总额4,012,155.99份；前海开源MSCI中国A股指数C类基金份额净值1.4787元，基金份额总额3,734,707.22份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		-1,079,237.09	946,663.43
1. 利息收入		597.98	5,528.26
其中：存款利息收入	6.4.7.9	597.98	1,182.78
债券利息收入		-	4,345.48
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）		-74,636.64	1,427,268.70
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-177,760.80	1,331,245.21
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	9,237.47	3,483.06
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	93,886.69	92,540.43
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,010,134.59	-498,885.55
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	4,936.16	12,752.02
减：二、营业总支出		118,687.11	140,784.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	28,244.98	35,734.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,649.01	7,147.03
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,415.68	6,206.09
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.20	79,377.44	91,696.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,197,924.20	805,878.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,197,924.20	805,878.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,197,924.20	805,878.73

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：前海开源MSCI中国A股指数量型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收 益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	8,148,276.80	-	5,081,739.77	13,230,016.57
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	8,148,276.80	-	5,081,739.77	13,230,016.57
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	-401,413.59	-	-1,329,150.84	-1,730,564.43
(一)、综合收益总 额	-	-	-1,197,924.20	-1,197,924.20
(二)、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)	-401,413.59	-	-131,226.64	-532,640.23
其中：1. 基金申购款	6,058,202.02	-	2,822,366.16	8,880,568.18
2. 基金赎回 款	-6,459,615.61	-	-2,953,592.80	-9,413,208.41
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	7,746,863.21	-	3,752,588.93	11,499,452.14

(基金净值)				4
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收 益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	8,884,358.67	-	5,377,314.65	14,261,673.3 2
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	8,884,358.67	-	5,377,314.65	14,261,673.3 2
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	-56,616.16	-	677,221.72	620,605.56
(一)、综合收益总 额	-	-	805,878.73	805,878.73
(二)、本期基金份 额交易产生的基金 净值变动数(净值减 少以“-”号填列)	-56,616.16	-	-128,657.01	-185,273.17
其中：1. 基金申购款	8,813,737.95	-	5,871,517.21	14,685,255.1 6
2. 基金赎回 款	-8,870,354.1 1	-	-6,000,174.2 2	-14,870,528. 33
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产 (基金净值)	8,827,742.51	-	6,054,536.37	14,882,278.8 8
---------------------	--------------	---	--------------	-------------------

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MSCI中国A股指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]708号《关于准予前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金注册的批复》核准,由前海开源基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币228,326,970.88元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2018]01210012号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金基金合同》于2018年11月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为228,418,283.18份基金份额,其中认购资金利息折合91,312.30份基金份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用、而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用、但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要包括标的指数成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于非成份股(包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债的纯

债部分)等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括定期存款、协议存款及其他银行存款)、货币市场工具、金融衍生品(包括权证、股指期货)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:投资于股票的资产比例不低于基金资产的80%,投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%。每个交易日日终,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,将持有不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:MSCI中国A股指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率(税后) \times 5%。

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MSCI中国A股指数型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的其他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净资产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

除下文6.4.5.1会计政策变更的说明中涉及的变更外,本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

财政部于2017年颁布了修订后的《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》及《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”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外,

中国证监会于2022年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年上半年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

1. 会计政策变更的性质、内容和原因

(a) 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

(b) 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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

(c) 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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息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相关交易费用及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。

2. 当期报表中受影响的项目名称和调整金额

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于2022年1月1日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为406,878.80元、2,101.25元、861.31元、4,799.01元和148,127.40元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为406,915.27元、2,102.35元、861.75元、0.00元和148,127.60元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为12,833,149.13元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为12,837,909.93元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为124,845.13元、5,641.61元、1,128.31元、1,064.24元、3,178.26元和42.78元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、

应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为124,845.13元、5,641.61元、1,128.31元、1,064.24元、3,178.26元和42.78元。

于2021年12月31日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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 2022年06月30日
活期存款	530,040.98
等于：本金	530,002.89
加：应计利息	38.09
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	530,040.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	10,172,615.23	-	10,692,219.10	519,603.87	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	400,219.00	1,424.50	401,844.50	201.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	400,219.00	1,424.50	401,844.50	201.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	10,572,834.23	1,424.50	11,094,063.60	519,804.87	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	13.82
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,809.33
其中：交易所市场	1,809.33
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	44,876.39
合计	46,699.54

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 前海开源MSCI中国A股指数A

金额单位：人民币元

项目 (前海开源MSCI中国A股指数 A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	4,311,136.11	4,311,136.11
本期申购	590,086.71	590,086.71
本期赎回(以“-”号填列)	-889,066.83	-889,066.83
本期末	4,012,155.99	4,012,155.99

6.4.7.7.2 前海开源MSCI中国A股指数C

金额单位：人民币元

项目 (前海开源MSCI中国A股指数 C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	3,837,140.69	3,837,140.69
本期申购	5,468,115.31	5,468,115.31
本期赎回(以“-”号填列)	-5,570,548.78	-5,570,548.78
本期末	3,734,707.22	3,734,707.22

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 前海开源MSCI中国A股指数A

单位：人民币元

项目 (前海开源MSCI中国A 股指数A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	3,741,498.25	-1,031,588.12	2,709,910.13
本期利润	-94,830.88	-529,855.41	-624,686.29
本期基金份额交易产生的变动数	-257,583.85	137,138.52	-120,445.33
其中：基金申购款	506,083.64	-237,246.31	268,837.33
基金赎回款	-763,667.49	374,384.83	-389,282.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,389,083.52	-1,424,305.01	1,964,778.51

6.4.7.8.2 前海开源MSCI中国A股指数C

单位：人民币元

项目 (前海开源MSCI中国A 股指数C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	3,285,105.85	-913,276.21	2,371,829.64
本期利润	-92,958.73	-480,279.18	-573,237.91
本期基金份额交易产生的变动数	-85,797.54	75,016.23	-10,781.31

生的变动数			
其中：基金申购款	4,626,320.14	-2,072,791.31	2,553,528.83
基金赎回款	-4,712,117.68	2,147,807.54	-2,564,310.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,106,349.58	-1,318,539.16	1,787,810.42

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	568.51
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	19.71
其他	9.76
合计	597.98

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	2,480,746.55
减：卖出股票成本总额	2,651,441.36
减：交易费用	7,065.99
买卖股票差价收入	-177,760.80

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	4,317.48
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,919.99
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	9,237.47

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	574,449.02
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	560,880.30
减：应计利息总额	8,647.69
减：交易费用	1.04
买卖债券差价收入	4,919.99

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	93,886.69

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	93,886.69

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-1,010,134.59
——股票投资	-1,011,015.39
——债券投资	880.80
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,010,134.59

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	4,796.81
转换费收入	139.35
合计	4,936.16

6.4.7.19 信用减值损失

无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	750.00
指数使用费	63,751.05
合计	79,377.44

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

伙)	
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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至202 2年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	28,244.98	35,734.91
其中：支付销售机构的客户维护费	11,239.57	13,008.28

注：支付基金管理人前海开源基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022年06月30日	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,649.01	7,147.03

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源MSCI中国A股指数A	前海开源MSCI中国A股指数C	合计
招商银行	0.00	454.99	454.99
前海开源基金	0.00	15.87	15.87
合计	0.00	470.86	470.86
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源MSCI中国A股指数A	前海开源MSCI中国A股指数C	合计
招商银行	0.00	696.61	696.61
前海开源基金	0.00	26.11	26.11
合计	0.00	722.72	722.72

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给前海开源基金，再由前海开源基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	530,040.98	568.51	821,210.84	1,100.58

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于2022年6月30日，本基金持有5,189股托管人招商银行的A股普通股，成本总额为人民币220,210.24元，估值总额为人民币218,975.80元，占基金资产净值的比例为1.90%(2021年12月31日，本基金持有5,589股托管人招商银行的A股普通股，成本总额为人民币232,688.14元，估值总额为人民币272,240.19元，占基金资产净值的比例为2.06%)。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2022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：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
127064	杭氧转债	2022-05-19	1-6个月（含）	配债未上市	100.00	100.02	3	300.00	300.06	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于股票、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。

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	401,544.44	532,200.50
合计	401,544.44	532,200.50

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	14,000.00
AAA以下	300.06	-
未评级	-	-
合计	300.06	14,000.00

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。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2022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2022年6月30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。

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 2022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	530,040.98	-	-	-	530,040.98
结算备付金	704.62	-	-	-	704.62
存出保证金	680.36	-	-	-	680.36
交易性金融资产	401,544.44	-	300.06	10,692,219.10	11,094,063.60
应收申购款	1.20	-	-	51,041.91	51,043.11
资产总计	932,971.60	-	300.06	10,743,261.01	11,676,532.67
负债					
应付赎回款	-	-	-	124,112.22	124,112.22
应付管理人报酬	-	-	-	4,509.23	4,509.23
应付托管费	-	-	-	901.85	901.85
应付销售服务费	-	-	-	857.69	857.69
其他负债	-	-	-	46,699.54	46,699.54
负债总计	-	-	-	177,080.53	177,080.53

利率敏感度缺口	932,971.60	-	300.06	10,566,180.48	11,499,452.14
上年度末 2021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	406,878.80	-	-	-	406,878.80
结算备付金	2,101.25	-	-	-	2,101.25
存出保证金	861.31	-	-	-	861.31
交易性金融资产	532,200.50	-	14,000.00	12,286,948.63	12,833,149.13
应收利息	-	-	-	4,799.01	4,799.01
应收申购款	300.00	-	-	147,827.40	148,127.40
资产总计	942,341.86	-	14,000.00	12,439,575.04	13,395,916.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	124,845.13	124,845.13
应付管理人报酬	-	-	-	5,641.61	5,641.61
应付托管费	-	-	-	1,128.31	1,128.31
应付销售服务费	-	-	-	1,064.24	1,064.24
应付交易费用	-	-	-	3,178.26	3,178.26
其他负债	-	-	-	30,042.78	30,042.78
负债总计	-	-	-	165,900.33	165,900.33
利率敏感度缺口	942,341.86	-	14,000.00	12,273,674.71	13,230,016.57

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率增加0.25%	-808.08	-736.77
	市场利率减少0.25%	811.35	738.80

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。

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2022年06月30日		2021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	10,692,219.10	92.98	12,286,948.63	92.87
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	10,692,219.10	92.98	12,286,948.63	92.87

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	575,379.36	696,611.36
	业绩比较基准下降5%	-575,379.36	-696,611.36

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	10,692,219.10	12,286,948.63
第二层次	401,844.50	546,200.50
第三层次	-	-
合计	11,094,063.60	12,833,149.13

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2021年12月31日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 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	10,692,219.10	91.57
	其中：股票	10,692,219.10	91.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	401,844.50	3.44
	其中：债券	401,844.50	3.44
	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	530,745.60	4.55
8	其他各项资产	51,723.47	0.44
9	合计	11,676,532.67	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	127,365.70	1.11
B	采矿业	382,812.30	3.33
C	制造业	6,384,576.28	55.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	314,509.40	2.73
E	建筑业	164,870.00	1.43
F	批发和零售业	88,693.08	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	298,587.60	2.60
H	住宿和餐饮业	15,060.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	448,303.87	3.90

J	金融业	1,784,624.12	15.52
K	房地产业	188,887.60	1.64
L	租赁和商务服务业	147,624.00	1.28
M	科学研究和技术服务业	185,986.80	1.62
N	水利、环境和公共设施管理业	22,306.00	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	92,047.95	0.80
R	文化、体育和娱乐业	37,870.40	0.33
S	综合	8,094.00	0.07
	合计	10,692,219.10	92.98

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
无。

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	600519	贵州茅台	200	409,000.00	3.56
2	300750	宁德时代	600	320,400.00	2.79
3	002594	比亚迪	700	233,443.00	2.03
4	600036	招商银行	5,189	218,975.80	1.90
5	000858	五粮液	1,000	201,930.00	1.76

6	600900	长江电力	5,700	131,784.00	1.15
7	601012	隆基绿能	1,893	126,130.59	1.10
8	601318	中国平安	2,600	121,394.00	1.06
9	601888	中国中免	500	116,465.00	1.01
10	601166	兴业银行	5,174	102,962.60	0.90
11	000568	泸州老窖	400	98,616.00	0.86
12	300760	迈瑞医疗	300	93,960.00	0.82
13	603288	海天味业	953	86,113.08	0.75
14	300059	东方财富	3,230	82,042.00	0.71
15	300751	迈为股份	160	78,544.00	0.68
16	600309	万华化学	800	77,592.00	0.67
17	601398	工商银行	15,900	75,843.00	0.66
18	002304	洋河股份	402	73,626.30	0.64
19	000001	平安银行	4,900	73,402.00	0.64
20	002714	牧原股份	1,310	72,403.70	0.63
21	600809	山西汾酒	220	71,456.00	0.62
22	600436	片仔癀	200	71,346.00	0.62
23	600030	中信证券	3,150	68,229.00	0.59
24	688202	美迪西	200	67,922.00	0.59
25	603259	药明康德	620	64,473.80	0.56
26	688188	柏楚电子	280	61,611.20	0.54
27	300015	爱尔眼科	1,375	61,558.75	0.54
28	002352	顺丰控股	1,100	61,391.00	0.53
29	600000	浦发银行	7,500	60,075.00	0.52
30	300896	爱美客	100	60,001.00	0.52
31	600438	通威股份	1,000	59,860.00	0.52
32	600887	伊利股份	1,501	58,463.95	0.51
33	002142	宁波银行	1,613	57,761.53	0.50
34	600276	恒瑞医药	1,539	57,081.51	0.50
35	002475	立讯精密	1,685	56,936.15	0.50
36	601088	中国神华	1,700	56,610.00	0.49

37	601668	中国建筑	10,600	56,392.00	0.49
38	601288	农业银行	18,200	54,964.00	0.48
39	601816	京沪高铁	10,700	53,714.00	0.47
40	000002	万科A	2,600	53,300.00	0.46
41	600048	保利发展	3,000	52,380.00	0.46
42	601328	交通银行	10,400	51,792.00	0.45
43	300014	亿纬锂能	531	51,772.50	0.45
44	601225	陕西煤业	2,400	50,832.00	0.44
45	002812	恩捷股份	200	50,090.00	0.44
46	300124	汇川技术	750	49,402.50	0.43
47	600406	国电南瑞	1,800	48,600.00	0.42
48	601899	紫金矿业	5,200	48,516.00	0.42
49	600905	三峡能源	7,500	47,175.00	0.41
50	002129	TCL中环	800	47,112.00	0.41
51	600690	海尔智家	1,700	46,682.00	0.41
52	002460	赣锋锂业	300	44,610.00	0.39
53	300122	智飞生物	400	44,404.00	0.39
54	002459	晶澳科技	560	44,184.00	0.38
55	601919	中远海控	3,170	44,063.00	0.38
56	601601	中国太保	1,800	42,354.00	0.37
57	300661	圣邦股份	225	40,954.50	0.36
58	300769	德方纳米	100	40,868.00	0.36
59	600031	三一重工	2,100	40,026.00	0.35
60	688185	康希诺	200	39,816.00	0.35
61	688111	金山办公	200	39,424.00	0.34
62	000725	京东方A	10,000	39,400.00	0.34
63	300274	阳光电源	400	39,300.00	0.34
64	603444	吉比特	100	38,800.00	0.34
65	603290	斯达半导	100	38,590.00	0.34
66	002049	紫光国微	200	37,944.00	0.33
67	002493	荣盛石化	2,450	37,705.50	0.33

68	000625	长安汽车	2,158	37,376.56	0.33
69	603799	华友钴业	390	37,291.80	0.32
70	601658	邮储银行	6,700	36,113.00	0.31
71	600028	中国石化	8,600	35,088.00	0.31
72	600019	宝钢股份	5,800	34,916.00	0.30
73	601066	中信建投	1,200	34,692.00	0.30
74	603501	韦尔股份	200	34,606.00	0.30
75	300498	温氏股份	1,600	34,064.00	0.30
76	600104	上汽集团	1,900	33,839.00	0.29
77	002709	天赐材料	540	33,512.40	0.29
78	600346	恒力石化	1,500	33,360.00	0.29
79	688298	东方生物	280	31,962.00	0.28
80	300763	锦浪科技	150	31,950.00	0.28
81	601390	中国中铁	5,200	31,928.00	0.28
82	600893	航发动力	700	31,857.00	0.28
83	603986	兆易创新	224	31,855.04	0.28
84	600585	海螺水泥	900	31,752.00	0.28
85	601818	光大银行	10,500	31,605.00	0.27
86	601766	中国中车	6,000	31,200.00	0.27
87	601857	中国石油	5,800	30,740.00	0.27
88	603659	璞泰来	360	30,384.00	0.26
89	601009	南京银行	2,800	29,176.00	0.25
90	601669	中国电建	3,700	29,119.00	0.25
91	601988	中国银行	8,900	29,014.00	0.25
92	002821	凯莱英	100	28,900.00	0.25
93	601211	国泰君安	1,900	28,880.00	0.25
94	688363	华熙生物	200	28,436.00	0.25
95	600010	包钢股份	12,100	28,435.00	0.25
96	601688	华泰证券	2,000	28,400.00	0.25
97	600999	招商证券	1,960	28,243.60	0.25
98	600111	北方稀土	800	28,128.00	0.24

99	000776	广发证券	1,500	28,050.00	0.24
100	605117	德业股份	100	27,989.00	0.24
101	600016	民生银行	7,494	27,877.68	0.24
102	002371	北方华创	100	27,712.00	0.24
103	600089	特变电工	1,000	27,390.00	0.24
104	002241	歌尔股份	800	26,880.00	0.23
105	601985	中国核电	3,900	26,754.00	0.23
106	001979	招商蛇口	1,980	26,591.40	0.23
107	688599	天合光能	400	26,100.00	0.23
108	688005	容百科技	200	25,888.00	0.23
109	600919	江苏银行	3,630	25,845.60	0.22
110	603993	洛阳钼业	4,500	25,785.00	0.22
111	600745	闻泰科技	300	25,533.00	0.22
112	000063	中兴通讯	1,000	25,530.00	0.22
113	000538	云南白药	420	25,363.80	0.22
114	000596	古井贡酒	100	24,966.00	0.22
115	600989	宝丰能源	1,700	24,905.00	0.22
116	002027	分众传媒	3,700	24,901.00	0.22
117	601628	中国人寿	800	24,864.00	0.22
118	002230	科大讯飞	600	24,732.00	0.22
119	600050	中国联通	7,000	24,220.00	0.21
120	000166	申万宏源	5,600	24,024.00	0.21
121	002311	海大集团	400	24,004.00	0.21
122	601229	上海银行	3,640	23,842.00	0.21
123	600188	兖矿能源	600	23,688.00	0.21
124	601169	北京银行	5,200	23,608.00	0.21
125	000895	双汇发展	800	23,440.00	0.20
126	688012	中微公司	200	23,350.00	0.20
127	000661	长春高新	100	23,342.00	0.20
128	603605	珀莱雅	140	23,125.20	0.20
129	600886	国投电力	2,200	23,100.00	0.20

130	601138	工业富联	2,300	22,632.00	0.20
131	600837	海通证券	2,300	22,563.00	0.20
132	603392	万泰生物	145	22,518.50	0.20
133	600926	杭州银行	1,500	22,470.00	0.20
134	600196	复星医药	500	22,045.00	0.19
135	603185	上机数控	140	21,838.60	0.19
136	300957	贝泰妮	100	21,753.00	0.19
137	300999	金龙鱼	400	21,608.00	0.19
138	000338	潍柴动力	1,700	21,199.00	0.18
139	600660	福耀玻璃	500	20,905.00	0.18
140	600150	中国船舶	1,100	20,878.00	0.18
141	002001	新和成	912	20,802.72	0.18
142	600460	士兰微	400	20,800.00	0.18
143	600600	青岛啤酒	200	20,784.00	0.18
144	601689	拓普集团	300	20,529.00	0.18
145	600563	法拉电子	100	20,516.00	0.18
146	600029	南方航空	2,800	20,468.00	0.18
147	600233	圆通速递	1,000	20,390.00	0.18
148	601615	明阳智能	600	20,280.00	0.18
149	300316	晶盛机电	300	20,277.00	0.18
150	002180	纳思达	400	20,248.00	0.18
151	688099	晶晨股份	200	20,200.00	0.18
152	603806	福斯特	308	20,180.16	0.18
153	600795	国电电力	5,100	19,941.00	0.17
154	300142	沃森生物	400	19,356.00	0.17
155	601336	新华保险	600	19,314.00	0.17
156	600015	华夏银行	3,700	19,277.00	0.17
157	300759	康龙化成	200	19,044.00	0.17
158	000799	酒鬼酒	100	18,581.00	0.16
159	601111	中国国航	1,600	18,576.00	0.16
160	601633	长城汽车	500	18,520.00	0.16

161	600522	中天科技	800	18,480.00	0.16
162	688122	西部超导	200	18,440.00	0.16
163	600741	华域汽车	800	18,400.00	0.16
164	000876	新希望	1,200	18,360.00	0.16
165	002074	国轩高科	400	18,240.00	0.16
166	603737	三棵树	140	18,120.20	0.16
167	603833	欧派家居	120	18,081.60	0.16
168	300408	三环集团	600	18,060.00	0.16
169	300413	芒果超媒	540	18,014.40	0.16
170	601877	正泰电器	500	17,890.00	0.16
171	688036	传音控股	200	17,846.00	0.16
172	601100	恒立液压	288	17,775.36	0.15
173	600588	用友网络	813	17,650.23	0.15
174	600763	通策医疗	100	17,444.00	0.15
175	002648	卫星化学	672	17,371.20	0.15
176	000786	北新建材	500	17,310.00	0.15
177	300782	卓胜微	128	17,280.00	0.15
178	000100	TCL科技	3,600	17,244.00	0.15
179	000963	华东医药	380	17,160.80	0.15
180	601799	星宇股份	100	17,100.00	0.15
181	000301	东方盛虹	1,000	16,910.00	0.15
182	603345	安井食品	100	16,787.00	0.15
183	000938	紫光股份	864	16,761.60	0.15
184	300433	蓝思科技	1,500	16,605.00	0.14
185	600570	恒生电子	381	16,588.74	0.14
186	601618	中国中冶	4,700	16,450.00	0.14
187	600584	长电科技	600	16,200.00	0.14
188	600011	华能国际	2,300	16,192.00	0.14
189	601727	上海电气	3,900	16,029.00	0.14
190	603127	昭衍新药	140	15,932.00	0.14
191	600176	中国巨石	914	15,912.74	0.14

192	002850	科达利	100	15,900.00	0.14
193	600845	宝信软件	290	15,834.00	0.14
194	300207	欣旺达	500	15,800.00	0.14
195	000069	华侨城 A	2,400	15,576.00	0.14
196	002192	融捷股份	100	15,370.00	0.13
197	601360	三六零	1,800	15,336.00	0.13
198	002736	国信证券	1,600	15,312.00	0.13
199	603369	今世缘	300	15,300.00	0.13
200	601155	新城控股	600	15,258.00	0.13
201	601865	福莱特	400	15,240.00	0.13
202	300628	亿联网络	200	15,230.00	0.13
203	002756	永兴材料	100	15,221.00	0.13
204	601600	中国铝业	3,200	15,200.00	0.13
205	300850	新强联	170	15,135.10	0.13
206	002938	鹏鼎控股	500	15,105.00	0.13
207	688180	君实生物	200	15,068.00	0.13
208	002841	视源股份	200	15,064.00	0.13
209	600426	华鲁恒升	510	14,892.00	0.13
210	002555	三七互娱	700	14,861.00	0.13
211	600547	山东黄金	800	14,848.00	0.13
212	002920	德赛西威	100	14,800.00	0.13
213	600383	金地集团	1,100	14,784.00	0.13
214	603816	顾家家居	260	14,723.80	0.13
215	600132	重庆啤酒	100	14,660.00	0.13
216	600958	东方证券	1,432	14,620.72	0.13
217	601006	大秦铁路	2,200	14,498.00	0.13
218	300601	康泰生物	320	14,457.60	0.13
219	601117	中国化学	1,500	14,115.00	0.12
220	601377	兴业证券	2,000	14,100.00	0.12
221	000983	山西焦煤	1,050	14,059.50	0.12
222	002601	龙佰集团	700	14,035.00	0.12

223	688006	杭可科技	200	14,012.00	0.12
224	300450	先导智能	220	13,899.60	0.12
225	688126	沪硅产业	600	13,788.00	0.12
226	002080	中材科技	500	13,750.00	0.12
227	600115	中国东航	2,500	13,725.00	0.12
228	600256	广汇能源	1,300	13,702.00	0.12
229	601916	浙商银行	4,100	13,612.00	0.12
230	000733	振华科技	100	13,597.00	0.12
231	600183	生益科技	800	13,592.00	0.12
232	603267	鸿远电子	100	13,433.00	0.12
233	603568	伟明环保	400	13,348.00	0.12
234	600486	扬农化工	100	13,328.00	0.12
235	600219	南山铝业	3,600	13,284.00	0.12
236	601838	成都银行	800	13,264.00	0.12
237	600875	东方电气	800	13,160.00	0.11
238	002236	大华股份	800	13,136.00	0.11
239	002414	高德红外	1,019	13,114.53	0.11
240	300496	中科创达	100	13,048.00	0.11
241	600803	新奥股份	700	13,013.00	0.11
242	688187	时代电气	200	12,998.00	0.11
243	002791	坚朗五金	100	12,972.00	0.11
244	002202	金风科技	875	12,950.00	0.11
245	603613	国联股份	145	12,847.00	0.11
246	600018	上港集团	2,200	12,826.00	0.11
247	600332	白云山	401	12,667.59	0.11
248	601607	上海医药	700	12,656.00	0.11
249	601788	光大证券	800	12,608.00	0.11
250	600754	锦江酒店	200	12,580.00	0.11
251	002176	江特电机	500	12,520.00	0.11
252	300919	中伟股份	100	12,390.00	0.11
253	300144	宋城演艺	800	12,280.00	0.11

254	603486	科沃斯	100	12,189.00	0.11
255	688008	澜起科技	200	12,116.00	0.11
256	002120	韵达股份	710	12,112.60	0.11
257	601901	方正证券	1,800	12,078.00	0.11
258	002600	领益智造	2,400	12,048.00	0.10
259	600674	川投能源	1,000	11,920.00	0.10
260	002007	华兰生物	520	11,856.00	0.10
261	688396	华润微	200	11,814.00	0.10
262	603260	合盛硅业	100	11,796.00	0.10
263	603589	口子窖	200	11,722.00	0.10
264	600885	宏发股份	280	11,718.00	0.10
265	601699	潞安环能	800	11,696.00	0.10
266	000519	中兵红箭	400	11,660.00	0.10
267	603517	绝味食品	200	11,564.00	0.10
268	000683	远兴能源	1,100	11,561.00	0.10
269	603707	健友股份	407	11,477.40	0.10
270	300347	泰格医药	100	11,445.00	0.10
271	603939	益丰药房	216	11,411.28	0.10
272	600009	上海机场	200	11,340.00	0.10
273	002916	深南电路	120	11,245.20	0.10
274	000738	航发控制	400	11,240.00	0.10
275	603899	晨光股份	200	11,216.00	0.10
276	002602	世纪华通	2,320	11,182.40	0.10
277	002013	中航机电	900	11,115.00	0.10
278	002064	华峰化学	1,300	10,972.00	0.10
279	601966	玲珑轮胎	429	10,883.73	0.09
280	300146	汤臣倍健	500	10,825.00	0.09
281	002508	老板电器	300	10,809.00	0.09
282	000977	浪潮信息	408	10,803.84	0.09
283	600362	江西铜业	600	10,698.00	0.09
284	300223	北京君正	100	10,625.00	0.09

285	600039	四川路桥	1,000	10,530.00	0.09
286	600160	巨化股份	800	10,520.00	0.09
287	600153	建发股份	800	10,456.00	0.09
288	600872	中炬高新	300	10,383.00	0.09
289	300454	深信服	100	10,378.00	0.09
290	601077	渝农商行	2,800	10,360.00	0.09
291	603456	九洲药业	200	10,340.00	0.09
292	601939	建设银行	1,700	10,302.00	0.09
293	300595	欧普康视	180	10,294.20	0.09
294	002223	鱼跃医疗	400	10,264.00	0.09
295	600487	亨通光电	700	10,178.00	0.09
296	002372	伟星新材	420	10,096.80	0.09
297	002326	永太科技	300	9,879.00	0.09
298	002078	太阳纸业	800	9,848.00	0.09
299	603233	大参林	312	9,765.60	0.08
300	000723	美锦能源	800	9,760.00	0.08
301	600298	安琪酵母	200	9,750.00	0.08
302	300033	同花顺	100	9,615.00	0.08
303	600521	华海药业	420	9,534.00	0.08
304	601233	桐昆股份	600	9,528.00	0.08
305	300037	新宙邦	180	9,460.80	0.08
306	603712	七一二	300	9,450.00	0.08
307	002430	杭氧股份	300	9,378.00	0.08
308	000831	五矿稀土	300	9,375.00	0.08
309	300003	乐普医疗	500	9,285.00	0.08
310	002738	中矿资源	100	9,261.00	0.08
311	600779	水井坊	100	9,254.00	0.08
312	002384	东山精密	400	9,172.00	0.08
313	002532	天山铝业	1,400	9,142.00	0.08
314	002340	格林美	1,000	9,100.00	0.08
315	300073	当升科技	100	9,034.00	0.08

316	000999	华润三九	200	9,000.00	0.08
317	300724	捷佳伟创	100	8,935.00	0.08
318	601995	中金公司	200	8,898.00	0.08
319	002153	石基信息	560	8,887.20	0.08
320	000703	恒逸石化	840	8,828.40	0.08
321	300390	天华超净	100	8,740.00	0.08
322	601555	东吴证券	1,261	8,738.73	0.08
323	000513	丽珠集团	240	8,690.40	0.08
324	000066	中国长城	800	8,656.00	0.08
325	300529	健帆生物	170	8,651.30	0.08
326	600549	厦门钨业	400	8,648.00	0.08
327	600380	健康元	700	8,645.00	0.08
327	000830	鲁西化工	500	8,645.00	0.08
329	002625	光启技术	500	8,635.00	0.08
330	002268	卫士通	200	8,582.00	0.07
331	002294	信立泰	300	8,430.00	0.07
332	002463	沪电股份	570	8,413.20	0.07
333	000800	一汽解放	900	8,406.00	0.07
334	600998	九州通	700	8,337.00	0.07
335	002405	四维图新	550	8,288.50	0.07
336	600026	中远海能	800	8,264.00	0.07
337	002603	以岭药业	340	8,262.00	0.07
338	603882	金城医学	100	8,255.00	0.07
339	002030	达安基因	480	8,251.20	0.07
340	002531	天顺风能	500	8,245.00	0.07
341	601108	财通证券	1,040	8,184.80	0.07
342	002138	顺络电子	300	8,175.00	0.07
343	000009	中国宝安	600	8,094.00	0.07
344	002353	杰瑞股份	200	8,060.00	0.07
345	600516	方大炭素	1,052	7,995.20	0.07
346	000050	深天马 A	800	7,976.00	0.07

347	688002	睿创微纳	200	7,944.00	0.07
348	601577	长沙银行	1,000	7,930.00	0.07
349	000933	神火股份	600	7,848.00	0.07
350	002385	大北农	1,000	7,810.00	0.07
351	002156	通富微电	500	7,700.00	0.07
352	603606	东方电缆	100	7,660.00	0.07
353	300253	卫宁健康	870	7,638.60	0.07
354	603218	日月股份	300	7,620.00	0.07
355	300251	光线传媒	800	7,576.00	0.07
356	600655	豫园股份	800	7,552.00	0.07
357	000425	徐工机械	1,400	7,546.00	0.07
358	000591	太阳能	900	7,515.00	0.07
359	002422	科伦药业	400	7,480.00	0.07
360	600161	天坛生物	308	7,478.24	0.07
361	002152	广电运通	800	7,416.00	0.06
362	000423	东阿阿胶	200	7,390.00	0.06
363	000401	冀东水泥	700	7,364.00	0.06
364	601456	国联证券	600	7,362.00	0.06
365	300383	光环新网	700	7,294.00	0.06
366	600109	国金证券	800	7,200.00	0.06
367	002624	完美世界	500	7,185.00	0.06
368	300676	华大基因	100	7,170.00	0.06
369	002128	电投能源	500	7,160.00	0.06
370	300373	扬杰科技	100	7,125.00	0.06
371	601198	东兴证券	800	7,120.00	0.06
372	000783	长江证券	1,200	7,116.00	0.06
373	002568	百润股份	236	7,089.44	0.06
374	000988	华工科技	300	6,951.00	0.06
375	600699	均胜电子	440	6,912.40	0.06
376	002507	涪陵榨菜	200	6,904.00	0.06
377	000893	亚钾国际	200	6,882.00	0.06

378	601216	君正集团	1,400	6,832.00	0.06
379	601881	中国银河	700	6,769.00	0.06
380	605358	立昂微	100	6,738.00	0.06
381	000937	冀中能源	900	6,714.00	0.06
382	002456	欧菲光	1,000	6,710.00	0.06
383	603858	步长制药	340	6,701.40	0.06
384	000728	国元证券	1,070	6,655.40	0.06
385	000825	太钢不锈	1,200	6,540.00	0.06
386	603198	迎驾贡酒	100	6,514.00	0.06
387	300418	昆仑万维	400	6,400.00	0.06
388	002465	海格通信	700	6,363.00	0.06
389	600895	张江高科	500	6,225.00	0.05
390	600056	中国医药	420	6,224.40	0.05
391	600711	盛屯矿业	800	6,208.00	0.05
391	002092	中泰化学	800	6,208.00	0.05
393	000739	普洛药业	300	6,192.00	0.05
394	300726	宏达电子	100	6,117.00	0.05
395	000932	华菱钢铁	1,200	6,108.00	0.05
396	603338	浙江鼎力	120	6,084.00	0.05
397	300558	贝达药业	100	6,080.00	0.05
398	000975	银泰黄金	620	6,038.80	0.05
399	002240	盛新锂能	100	6,036.00	0.05
400	002252	上海莱士	1,000	5,930.00	0.05
401	600598	北大荒	400	5,904.00	0.05
402	300699	光威复材	100	5,887.00	0.05
403	000630	铜陵有色	1,800	5,868.00	0.05
404	600801	华新水泥	300	5,853.00	0.05
405	601990	南京证券	700	5,838.00	0.05
406	600498	烽火通信	400	5,792.00	0.05
407	002299	圣农发展	300	5,754.00	0.05
408	600143	金发科技	600	5,712.00	0.05

409	002557	洽洽食品	100	5,693.00	0.05
410	601058	赛轮轮胎	500	5,635.00	0.05
411	002032	苏泊尔	100	5,634.00	0.05
412	002185	华天科技	600	5,628.00	0.05
413	002409	雅克科技	100	5,551.00	0.05
414	002926	华西证券	700	5,488.00	0.05
415	000027	深圳能源	840	5,384.40	0.05
416	000860	顺鑫农业	200	5,364.00	0.05
417	600177	雅戈尔	800	5,304.00	0.05
418	002673	西部证券	800	5,232.00	0.05
419	300357	我武生物	100	5,203.00	0.05
420	600705	中航产融	1,500	5,190.00	0.05
421	002925	盈趣科技	240	5,164.80	0.04
422	600170	上海建工	1,700	5,151.00	0.04
423	002010	传化智联	800	5,144.00	0.04
424	600704	物产中大	1,000	5,130.00	0.04
425	002797	第一创业	800	5,128.00	0.04
426	002939	长城证券	500	5,080.00	0.04
427	002065	东华软件	800	5,056.00	0.04
428	000998	隆平高科	300	4,998.00	0.04
429	000807	云铝股份	500	4,940.00	0.04
430	000686	东北证券	700	4,893.00	0.04
431	002407	多氟多	100	4,891.00	0.04
432	601016	节能风电	1,000	4,800.00	0.04
432	600079	人福医药	300	4,800.00	0.04
434	002044	美年健康	860	4,790.20	0.04
435	002266	浙富控股	1,000	4,790.00	0.04
436	603866	桃李面包	288	4,766.40	0.04
437	002563	森马服饰	800	4,736.00	0.04
438	600027	华电国际	1,200	4,716.00	0.04
439	002500	山西证券	800	4,592.00	0.04

440	600583	海油工程	1,100	4,565.00	0.04
441	300677	英科医疗	180	4,564.80	0.04
442	000629	攀钢钒钛	1,200	4,560.00	0.04
443	601319	中国人保	900	4,554.00	0.04
444	688009	中国通号	1,000	4,530.00	0.04
445	600392	盛和资源	200	4,520.00	0.04
445	600038	中直股份	100	4,520.00	0.04
447	300832	新产业	100	4,511.00	0.04
448	000750	国海证券	1,240	4,501.20	0.04
449	002506	协鑫集成	1,200	4,464.00	0.04
450	600141	兴发集团	100	4,399.00	0.04
451	600369	西南证券	1,100	4,367.00	0.04
452	300568	星源材质	150	4,356.00	0.04
453	002541	鸿路钢构	130	4,342.00	0.04
454	603077	和邦生物	1,000	4,260.00	0.04
455	002157	正邦科技	700	4,242.00	0.04
456	300070	碧水源	800	4,168.00	0.04
457	601992	金隅集团	1,500	4,155.00	0.04
458	600688	上海石化	1,300	4,134.00	0.04
459	000709	河钢股份	1,800	4,068.00	0.04
460	601696	中银证券	300	3,990.00	0.03
461	601598	中国外运	1,000	3,880.00	0.03
462	002558	巨人网络	400	3,660.00	0.03
463	002028	思源电气	100	3,566.00	0.03
464	000651	格力电器	100	3,372.00	0.03
465	002497	雅化集团	100	3,265.00	0.03
466	000656	金科股份	1,100	3,146.00	0.03
467	300308	中际旭创	100	3,105.00	0.03
468	000157	中联重科	500	3,080.00	0.03
469	601238	广汽集团	200	3,048.00	0.03
470	601866	中远海发	1,000	3,000.00	0.03

471	600884	杉杉股份	100	2,972.00	0.03
472	600338	西藏珠峰	100	2,870.00	0.02
473	601636	旗滨集团	200	2,550.00	0.02
474	600295	鄂尔多斯	140	2,527.00	0.02
475	600258	首旅酒店	100	2,480.00	0.02
476	002408	齐翔腾达	300	2,433.00	0.02
477	601168	西部矿业	200	2,366.00	0.02
478	002958	青农商行	700	2,324.00	0.02
479	000155	川能动力	100	2,215.00	0.02
480	600499	科达制造	100	2,064.00	0.02
481	000960	锡业股份	100	1,677.00	0.01
482	600848	上海临港	120	1,627.20	0.01
483	600988	赤峰黄金	100	1,595.00	0.01
484	600348	华阳股份	100	1,546.00	0.01
485	600918	中泰证券	200	1,530.00	0.01
486	600985	淮北矿业	100	1,456.00	0.01
487	601666	平煤股份	100	1,359.00	0.01
488	000987	越秀金控	182	1,279.46	0.01
489	601868	中国能建	500	1,185.00	0.01
490	601878	浙商证券	100	1,138.00	0.01
491	600415	小商品城	200	1,114.00	0.01
492	002145	中核钛白	145	1,033.85	0.01
493	600808	马钢股份	200	758.00	0.01
494	601880	辽港股份	200	340.00	0.00

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无。

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	600519	贵州茅台	194,661.00	1.47
2	688169	石头科技	137,822.00	1.04
3	000858	五粮液	133,580.00	1.01
4	002594	比亚迪	101,537.00	0.77
5	688202	美迪西	57,598.00	0.44
6	603501	韦尔股份	56,823.00	0.43
7	300750	宁德时代	54,499.00	0.41
8	601899	紫金矿业	50,684.00	0.38
9	600905	三峡能源	44,812.00	0.34
10	600436	片仔癀	44,002.00	0.33
11	688185	康希诺	38,710.00	0.29
12	688298	东方生物	36,200.00	0.27
13	300760	迈瑞医疗	35,627.00	0.27
14	603444	吉比特	34,977.00	0.26
15	688599	天合光能	32,236.00	0.24
16	300769	德方纳米	30,847.00	0.23
17	002371	北方华创	30,040.00	0.23
18	600036	招商银行	29,960.00	0.23
19	688363	华熙生物	29,002.00	0.22
20	600809	山西汾酒	28,799.00	0.22

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	600519	贵州茅台	383,851.00	2.90
2	688169	石头科技	133,228.00	1.01

3	000858	五粮液	102,447.00	0.77
4	688202	美迪西	69,808.00	0.53
5	600809	山西汾酒	58,376.00	0.44
6	601899	紫金矿业	56,345.00	0.43
7	603501	韦尔股份	53,309.00	0.40
8	300750	宁德时代	53,142.00	0.40
9	688185	康希诺	51,730.00	0.39
10	600036	招商银行	49,402.00	0.37
11	603444	吉比特	35,834.00	0.27
12	300760	迈瑞医疗	32,119.00	0.24
13	002371	北方华创	30,260.00	0.23
14	601318	中国平安	29,887.00	0.23
15	600938	中国海油	28,760.00	0.22
16	002352	顺丰控股	28,424.00	0.21
17	000063	中兴通讯	25,000.00	0.19
18	002594	比亚迪	24,820.00	0.19
19	002812	恩捷股份	24,330.00	0.18
20	601166	兴业银行	23,788.00	0.18

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	2,067,727.22
卖出股票收入（成交）总额	2,480,746.55

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	401,544.44	3.49

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)	300.06	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	401,844.50	3.49

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	019674	22国债09	4,000	401,544.44	3.49
2	127064	杭氧转债	3	300.06	0.00

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 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期末，本基金投资的前十名证券除“招商银行（证券代码600036）”、“兴业银行（证券代码601166）”外其他证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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	680.36
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	51,043.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,723.47

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

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
前海开源MSCI中国A股指数A	637	6,298.52	0.00	0.00%	4,012,155.99	100.00%
前海开源MSCI中国A股指数C	1,267	2,947.68	0.00	0.00%	3,734,707.22	100.00%
合计	1,904	4,068.73	0.00	0.00%	7,746,863.21	100.00%

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

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数	占基金总份额比
----	------	--------	---------

		(份)	例
基金管理人所有从业人员持有本基金	前海开源MSCI中国A股指数A	9,405.40	0.2344%
	前海开源MSCI中国A股指数C	350.40	0.0094%
	合计	9,755.80	0.1259%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	前海开源MSCI中国A股指数A	0
	前海开源MSCI中国A股指数C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	前海开源MSCI中国A股指数A	0~10
	前海开源MSCI中国A股指数C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	前海开源MSCI中国A股指数A	前海开源MSCI中国A股指数C
基金合同生效日(2018年11月27日)基金份额总额	14,095,545.22	214,322,737.96
本报告期期初基金份额总额	4,311,136.11	3,837,140.69
本报告期基金总申购份额	590,086.71	5,468,115.31

减：本报告期基金总赎回份额	889,066.83	5,570,548.78
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,012,155.99	3,734,707.22

§ 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：

2022年2月25日起，孙辰健先生任督察长；

2022年6月21日起，董事长由王兆华先生变更为李强先生。

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	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	佣金	占当期佣金总量的比	

	数量		的比例		例	
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源西部	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	4,511,747.55	100.00%	4,201.92	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。

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
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	965,723.80	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旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-01
2	前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金2021年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2022-01-24
3	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在湘财证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-26
4	前海开源基金管理有限公司关于公司固有资金拟申购旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-28
5	前海开源基金管理有限公司关于公司固有资金申购旗下偏股型公募基金的进一步公告	中国证监会规定媒介	2022-02-11
6	关于增加中信百信银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022-02-17
7	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金开展申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022-02-25
8	前海开源基金管理有限公司	中国证监会规定媒介	2022-02-26

	关于基金行业高级管理人员变更的公告		
9	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过北京雪球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	2022-02-28
10	关于防范不法分子冒用前海开源基金名义进行非法活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2022-03-26
11	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式证券投资基金转换业务补差费用计算方法的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-26
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北京中植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	2022-03-28
13	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过上海中欧财富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	2022-03-30
14	前海开源基金关于电子直销交易平台相关业务费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-31
15	前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金2021年年度报告	中国证监会规定媒介	2022-03-31
16	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在渤海证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-12

17	前海开源基金管理有限公司关于终止与深圳前海凯恩斯基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-21
18	前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金2022年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2022-04-22
19	前海开源基金管理有限公司关于终止与北京唐鼎耀华基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-23
20	前海开源基金管理有限公司关于终止与北京植信基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-26
21	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分基金通过中信证券华南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	2022-05-27
22	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京东肯特瑞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	2022-06-08
23	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金在东兴证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-16
24	前海开源基金管理有限公司关于终止与深圳腾元基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-17
25	前海开源基金管理有限公司关于终止与北京懒猫基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-17

26	前海开源基金管理有限公司 关于董事长变更的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-22
27	前海开源基金管理有限公司 关于调整旗下部分基金通过 申万宏源证券、申万宏源西 部证券办理定投业务起点金 额的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-22

§ 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
无。

§ 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MSCI中国A股指数型证券投资基金设立的文件

(2) 《前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金基金合同》

(3) 《前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金托管协议》

(4) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(5) 前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

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

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

前海开源基金管理有限公司
二〇二二年八月三十一日