
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

2020 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:2021 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2021年3月22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2020年01月01日起至2020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	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
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	75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	77
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	78
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	78
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	78
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	78
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	78

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	79
8.12 投资组合报告附注	80
§9 基金份额持有人信息	81
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	81
9.2 期末上市基金前十名持有人	81
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	82
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	82
§10 开放式基金份额变动	82
§11 重大事件揭示	82
11.1 基金份额持有人大会决议	82
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	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	83
11.4 基金投资策略的改变	83
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	83
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	83
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	84
11.8 其他重大事件	85
§12 影响投资者决策的其他重要信息	88
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	88
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	89
§13 备查文件目录	89
13.1 备查文件目录	89
13.2 存放地点	89
13.3 查阅方式	89

§ 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	500ETF5W
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	42,113,665.00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	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。 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。 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

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

	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。 4、融资及转融通证券出借业务的投资策略 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。 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。
业绩比较基准	中证500等权重指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		前海开源基金管理有限公司	中国银河证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	傅成斌	李淼
	联系电话	0755-88601888	010-80927827
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	yhqz_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	中国北京西城区金融大街35

	一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	号2-6层
办公地址	深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦2206	北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦
邮政编码	518040	100073
法定代表人	王兆华	陈共炎

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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）黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11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	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	86,204,037.29	2,092,835.87
本期利润	53,528,059.69	39,731,884.94

加权平均基金份额本期利润	0.3449	0.0523
本期加权平均净值利润率	30.67%	5.16%
本期基金份额净值增长率	29.42%	5.23%
3.1.2 期末数据和指标	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	15,240,00 2.28	2,092,835.87
期末可供分配基金份额利润	0.3619	0.0028
期末基金资产净值	57,353,66 7.28	799,845,549.94
期末基金份额净值	1.3619	1.0523
3.1.3 累计期末指标	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	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。

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	3.45%	1.11%	1.84%	1.10%	1.61%	0.01%
过去六个月	17.11%	1.38%	8.97%	1.41%	8.14%	-0.03%
过去一年	29.42%	1.51%	17.20%	1.55%	12.22%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	36.19%	1.43%	26.83%	1.48%	9.36%	-0.05%

注：本基金的业绩比较基准为：中证500等权重指数收益率。

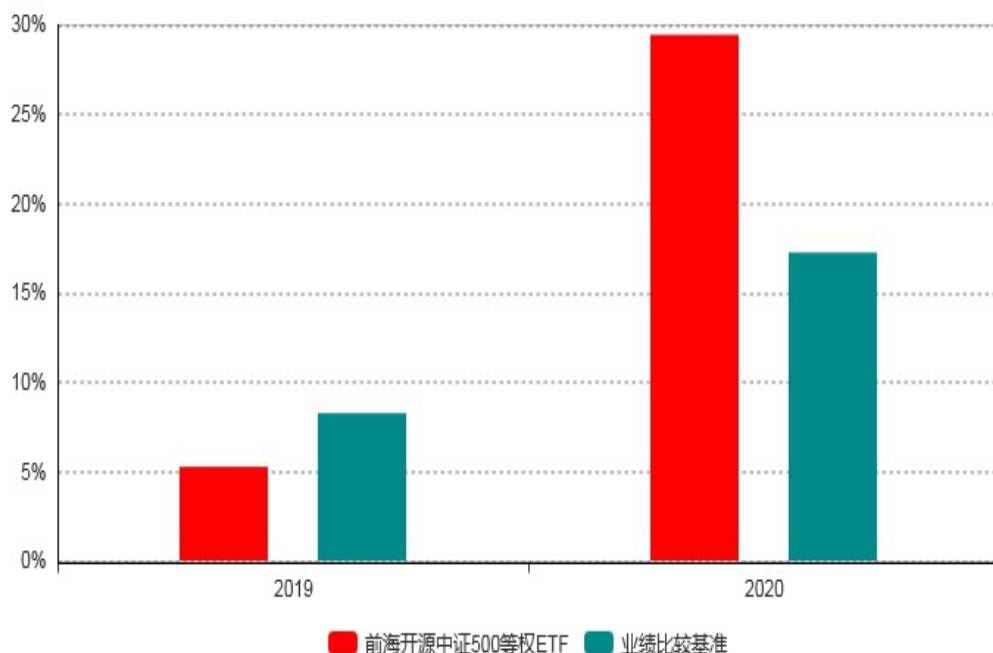
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



注：本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。截至2020年12月31日，本基金距建仓结束日未满一年。

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



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、上海设立分公司。经中国证监会批准，前海开源基金全资控股子公司——前海开源资产管理有限公司（以下简称“前海开源资管”）已于2013年9月5日在深圳市注册成立，并于2013年9月18日取得中国证监会核发的《特定客户资产管理业务资格证书》，截至报告期末，注册资本为1.8亿元人民币。

截至报告期末，前海开源基金旗下管理91只开放式基金，资产管理规模超过897亿元。

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		
陶曙斌	本基金的基金经理、公司 投资副总监	2019- 11-14	2020- 12-18	12 年	陶曙斌先生，经济学硕士，曾任职于德勤会计师事务所、南方基金管理有限公司。2016年1月加盟前海开源基金管理有限公司，曾任公司投资副总监。
梁溥森	本基金的基金经理	2020- 05-07	-	6 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，现任公司权益投资本部基金经理。

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

午夜钟声响起，2020年挥手自辞去，只留下了这足以载入史册的2020庚子年。这一年人类与新冠疫情不期而遇，截止12月31日，全球累计确诊人数超过了8300万人次，累计死亡超过180万人。然而就是这样混乱的一年，却是投资者盆满钵满的一年。在这一年里，创业板指上涨了64.96%，500等权指数也上涨了17.2%，白酒指数更是暴涨了137.47%。权益型公募基金连续两年出现了涨幅破百的基金。在这种情况下，市场上又出现了两种极端的声音，乐观的声音认为放水无熊市，接着奏乐接着舞；悲观的声音则认为连续两年牛市之后，随着2021年整体金融条件的边际收紧，牛年无牛市。对我们来说，我们很难判断短期内A股是否能够继续凯歌高奏，也很难判断“没有泡沫”的白酒是否已经过度繁荣。但历史告诉我们，所有过度繁荣的市场最终均将屈服于引力定律。在市场上屡屡输钱的人，正是那些未能抵制被郁金香球茎热一类事件冲突头脑的人。对于投资者而言，真正困难的事是受到诱惑时情不自禁地将自己的资金投向短期快速致富的投机盛宴之中，并在随后的泡沫破灭中损失惨重。我们希望基金持有人能够建立适合其投资技能和经验、财务状况及风险偏好的投资方案，实现自己切合实际的长期目标，

在长期投资这条适合自己的雪道上以适合自己的速度滑行，不受贪婪与恐惧的驱使，都能度过一段美妙的投资时光。投资与投机的区别通常就在于对投资回报期的定义和投资回报的可预期性。投机者买入股票或基金，期望在接下来的几天或几周内获得一笔短期回报；投资者则期望股票或基金在未来会产生可靠的现金流回报，在几年或几十年里带来资本利得。投机很有趣却困难重重，投资很枯燥却是大多数普通投资者在长期投资中取胜最简单的法门。化用卡耐基的一句话就是：投机很有趣，但那不适合你。况且投机的波段操作很有趣，但绝不简单，操作失败的成本却异常高。以 500 等权指数为例，以基日至 2020 年 12 月 31 日，期间近 3900 个交易日 500 等权指数累计涨幅约为 630%，假如我们错过了其中涨幅最高的 20 个交易日，累计涨幅将降至不足 200%，假设我们错过了其中涨幅最大的 40 个交易日，累计涨幅更是仅剩不足 80%。谚语有云：闪电来袭的那一刻，你一定要站在那里。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，对你来说无关紧要。

一切投资回报都不同程度地取决于未来事件。也有部分投资者希冀于通过预测未来来获取更高的投资收益，但是准确预测未来却基本上是不可能的。如查尔斯·埃利斯在《赢得输家的游戏》中所言：粗略的预测股市并不难，但是准确地预测股市却是不可能的。同样，大致预测股市的长期走势并不难，但是预计今后几个月的趋势却几乎是不可能的，也没有意义。短期投资结果难以预料，但投资中的长期规律却是有迹可循的。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会更大，但投资者获得正收益的概率却更大了。这也正是我们希望本基金的持有人都能沉下心来，长期投资经过充分多元化的指数基金的原因之所在。专注于某些具体公司的表现，就像身临山涧，云雾缭绕，或许风景奇绝，却可能云深不知处。指数投资则能以最简单的方式，紧紧锚定投资者的核心价值。投资者只需关注最重要的投资原则和符合自身的长期投资目标，从而回归投资本质，而无须限于市场的短期波动、企业的一时成败和市场环境的朝夕变化，从而取得不俗的业绩。

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，并努力通过参与新股申购、现金管理、期现套利等获得超额收益。2020 年 1 月 20 日本基金开始于上海证券交易所上市交易，上市至今本基金运行平稳，期间指数多次进行调整并纳入了科创板个股。受此影响，本基金在指数调整生效日前后随之进行了调整，多种因素影响之下一揽子创设单位净值对应的现金差额出现过较大的变动，但对投资人的实际影响较小，对本基金的投资运作影响也较小。本基金在 2020 年取得了 29.42% 的涨幅，超越业绩比较基准约 12%。2020 年本基金的跟踪误差主要来源于新股收益增厚导致的正偏离。本基金将持续关注成分股的基本面变化情况，通过监控成分股负面信息及其影响，在不影响本基金投资运作的情况下及时对地雷股进行出清，并力争通过多种方式对基金业绩进行一定的增厚，积跬步以致千里，力争

在紧密跟踪业绩比较基准并追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的同时，能够为持有人贡献一定的业绩正偏离。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源中证500等权ETF基金份额净值为1.3619元，本报告期内，基金份额净值增长率为29.42%，同期业绩比较基准收益率为17.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020年下半年，随着海外市场平稳，资金面相对宽松，局部行业热点事件等因素的带动下，投资者风险偏好提升，A股投资度过了一段蜜月期。随着上证指数、沪深300等关键指数近期纷纷创下阶段性新高，市场整体估值已经回升至历史中等偏上水平，但行业间的分化依然明显。

展望2021年，复苏或是全球经济的大背景。全球及中国经济随着疫苗逐步落地继续复苏，但节奏并不均衡，中国经济增长率已经率先恢复至疫情前水平，虽然疫情局部有所反复，但整体可控，宏观经济数据继续向好，出口仍然维持较高增长，物价继续修复。但中国货币政策回归常态也将意味着宽松政策将逐渐退出，投资者须关注政策退出节奏对A股造成的影响。总体来看，我们认为A股受益于中国经济率先企稳反弹、全球经济基本面渐次向好、强劲的盈利增长、有利的资金流入条件、人民币汇率升值预期等利好因素叠加的影响，中长期配置价值仍然较高。

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将遵循一贯的投资逻辑，通过紧密跟踪指数，为持有人提供与之相近的收益，并努力通过参与新股、现金流管理、期现套利等多种方式获得部分超额收益。

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、基金业协会相关规定和基金合同关于估值的约定, 对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会, 负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序, 指导和监督整个估值流程。估值委员会由督察长、基金核算部、监察稽核部、金融工程部、交易部、投资研究部门负责人及其他指定相关人员组成。估值委员会成员均具备专业胜任能力和相关从业资格, 精通各自领域的理论知识, 熟悉相关政策法规, 并具有丰富的实践经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论, 但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

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或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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、托管协议的有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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2020年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 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(2021)第22310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	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2020年12月31日和2019年12月31日的财务状况以及2020年度和2019年11月14日(基金合同生效日)至2019年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。
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	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。

注册会计师对财务报表审计的责任

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)黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼
审计报告日期	2021-03-26

§ 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：2020年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	3,182,313.18	75,716,365.64
结算备付金		538,423.79	4,708,529.08
存出保证金		608,107.83	329,855.59
交易性金融资产	7.4.7.2	53,908,009.69	719,851,782.02
其中：股票投资		53,103,489.69	719,851,782.02
基金投资		—	—
债券投资		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		10,306.76	—
应收利息	7.4.7.5	17,915.39	20,593.92

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		58,265,076.64	800,627,126.25
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
负 债:			
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,780.96	98,999.01
应付托管费		2,593.63	32,999.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	18,200.76	609,819.38
应交税费		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	882,833.97	39,758.25
负债合计		911,409.36	781,576.31
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	42,113,665.00	760,113,665.00
未分配利润	7.4.7.10	15,240,002.28	39,731,884.94
所有者权益合计		57,353,667.28	799,845,549.94
负债和所有者权益总计		58,265,076.64	800,627,126.25

注：

1. 报告截止日2020年12月31日，前海开源中证500等权ETF基金份额净值1.3619元，基金份额总额42,113,665.00份。于2019年12月31日，基金份额净值1.0523元，基金份额总额760,113,665.00份。
2. 本财务报表的实际编制期间为2020年度和2019年11月14日（基金合同生效日）至2019年12月31日止期间。

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：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2020年01月01日 至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年11月14日（基金合同生效日）至2019年12月31日
一、收入		55,259,385.97	40,743,398.84
1. 利息收入		82,967.05	267,481.62
其中：存款利息收入	7.4.7.11	74,373.43	267,481.62
债券利息收入		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）		85,674,675.12	2,627,263.39
其中：股票投资收益	7.4.7.12	84,150,657.19	2,553,886.22
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	81,569.01	-
资产支持证券投资	7.4.7.14.	-	-
收益	5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-

衍生工具收益	7.4.7.16	-66,500.00	-
股利收益	7.4.7.17	1,508,948.92	73,377.17
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-32,675,977.60	37,639,049.07
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	2,177,721.40	209,604.76
减：二、费用		1,731,326.28	1,011,513.90
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	269,826.16	148,791.22
2. 托管费	7.4.10.2.2	89,942.02	49,597.08
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	1,056,557.96	772,967.35
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.14	-
7. 其他费用	7.4.7.21	315,000.00	40,158.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		53,528,059.69	39,731,884.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		53,528,059.69	39,731,884.94

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：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期
-----	----

	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、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	53,528,059.69	53,528,059.69
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
项 目	上年度可比期间		
	2019年11月14日(基金合同生效日)至2019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	-	760,113,665.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	39,731,884.94	39,731,884.94

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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	760, 113, 665. 00	39, 731, 884. 94	799, 845, 549. 94

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：

王兆华

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所列示的其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2020年度和2019年11月14日(基金合同生效日)至2019年12月31日止期间的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2020年12月31日和2019年12月31日的财务状况以及2020年度和2019年11月14日(基金合同生效日)至2019年12月31日止期间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。本财务报表的实际编制期间为2020年度和2019年11月14日(基金合同生效日)至2019年12月31日。

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。

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。

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和债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。

(2) 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、可交换债券和私募债券除外)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、可交换债券和私募债券除外)，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

无。

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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
----	--------------------	---------------------

活期存款	3, 182, 313. 18	75, 716, 365. 64
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	3, 182, 313. 18	75, 716, 365. 64

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末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
项目		上年度末2019年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		682, 212, 732. 95	719, 851, 782. 02	37, 639, 049. 07
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	682,212,732.95	719,851,782.02	37,639,049.07

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末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	-	-	-
项目	上年度末2019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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

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2020年12月31日，本基金持有1手中证500股指期货IC2101买入合约，合约市值1,268,760.00元，公允价值变动28,960.00元；1手中证500股指期货IC2103买入合约，合约市值1,250,280.00元，公允价值变动23,860.00元；1手中证500股指期货IC2106买入合约，合约市值1,220,480.00元，公允价值变动19,360.00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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	264.39	18,099.89
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	3.30	2,330.68
应收债券利息	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	41.80	163.35
合计	17,915.39	20,593.92

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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	18,200.76	609,819.38
银行间市场应付交易费用	-	-

合计	18,200.76	609,819.38
----	-----------	------------

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019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	175,000.00	10,000.00
应付指数使用费	35,000.00	29,758.25
应付替代款	672,833.97	-
合计	882,833.97	39,758.25

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	760,113,665.00	760,113,665.00
本期申购	34,000,000.00	34,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-752,000,000.00	-752,000,000.00
本期末	42,113,665.00	42,113,665.00

注：

1. 本基金自2019年10月28日至2019年11月8日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币760,113,665.00元，折合为760,113,665.00份基金份额。本基金设立募集期内无认购资金产生的利息收入。
2. 根据《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》、《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》及《前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》的相关规定，本基金于2019年11月14日（基金合同生效日）至2020年1月19日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购和赎回业务自2020年1月20日起开始办理。

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	2,092,835.87	37,639,049.07	39,731,884.94
本期利润	86,204,037.29	-32,675,977.60	53,528,059.69
本期基金份额交易产生的变动数	-64,949,554.58	-13,070,387.77	-78,019,942.35
其中：基金申购款	5,769,426.15	-2,057,783.18	3,711,642.97
基金赎回款	-70,718,980.73	-11,012,604.59	-81,731,585.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,347,318.58	-8,107,316.30	15,240,002.28

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年11月14日（基金合同生效日）至2019年12月31日
活期存款利息收入	56,235.63	260,906.50
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	10,708.66	6,144.59
其他	7,429.14	430.53
合计	74,373.43	267,481.62

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2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年11月14日（基金合同生效日）至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	61,534,242.50	2,553,886.22
股票投资收益——赎回差价收入	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	84,150,657.19	2,553,886.22

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 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年11月14日（基金合同生效 日）至2019年12月31日
卖出股票成交总额	494,730,211.04	89,168,407.51
减：卖出股票成本总额	433,195,968.54	86,614,521.29
买卖股票差价收入	61,534,242.50	2,553,886.22

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 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年11月14日（基金合同生效 日）至2019年12月31日
赎回基金份额对价总额	833,731,585.32	-
减：现金支付赎回款总额	423,236,104.32	-
减：赎回股票成本总额	387,879,066.31	-
赎回差价收入	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 2020年01月01日至2	上年度可比期间 2019年11月14日（基金合同生效
----	---------------------	-------------------------------

	020年12月31日	日) 至2019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	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	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 2020年01月01日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年11月14日（基金合同生效日） 至2019年12月31日
卖出债券（、债转 股及债券到期兑 付）成交总额	898,316.21	—
减：卖出债券（、 债转股及债券到期 兑付）成本总额	806,365.38	—
减：应收利息总额	10,381.82	—
买卖债券差价收入	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 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间收益金额 2019年11月14日（基金合同生效 日）至2019年12月31日
股指期货投资	-66,500.00	-

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年11月14日（基金合同生 效日）至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,508,948.92	73,377.17
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	1,508,948.92	73,377.17

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至20 20年12月31日	上年度可比期间 2019年11月14日（基金合同生效日） 至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	-32,748,157.60	37,639,049.07
——股票投资	-32,748,452.98	37,639,049.07
——债券投资	295.38	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	72,180.00	-
——权证投资	-	-
——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	-32,675,977.60	37,639,049.07

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年11月14日（基金合同生效 日）至2019年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益收入	2,177,717.39	-
其他	4.01	209,604.76
合计	2,177,721.40	209,604.76

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 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年11月14日（基金合同生效 日）至2019年12月31日
交易所市场交易费用	1,056,557.96	772,967.35
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,056,557.96	772,967.35

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年11月14日（基金合同生效 日）至2019年12月31日
审计费用	55,000.00	-
信息披露费	120,000.00	10,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	140,000.00	29,758.25
其他	-	400.00
合计	315,000.00	40,158.25

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、登记机构、基金销售机构

中国银河证券股份有限公司(“中国银河证券”)	基金托管人、基金销售机构
开源证券股份有限公司(“开源证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
北京市中盛金期投资管理有限公司	基金管理人的股东
北京长和世纪资产管理有限公司	基金管理人的股东
深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
前海开源资产管理有限公司	基金管理人的子公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年11月14日(基金合同生效日) 至2019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(“银河证券”)	657,603,561.63	100.00%	833,889,994.75	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 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年11月14日(基金合同生效日) 至2019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 （“银河 证券”）	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 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年11月14日（基金合同生效日） 至2019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 （“银河 证券”）	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 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（“银河证券”）	480,910.80	100.00%	18,200.76	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2019年11月14日（基金合同生效日）至2019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（“银河证券”）	609,819.38	100.00%	609,819.38	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 2020年01月01日 至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年11月14日（基金合同 生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	269,826.16	148,791.22
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 2020年01月01日 至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年11月14日（基金合同生 效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	89,942.02	49,597.08

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 2020年12月31日		上年度末 2019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	914,540.00	2.17%	114,540.00	0.02%

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（2020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
688277	天智航	2020-06-24	2021-01-07	科创板打新限售	12.04	37.53	6,530	78,621.20	245,070.90	-
688556	高测股份	2020-07-29	2021-02-08	科创板打新限售	14.41	26.93	4,615	66,502.15	124,281.95	-
688286	敏芯股份	2020-07-31	2021-02-10	科创板打新限售	62.67	117.33	710	44,495.70	83,304.30	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2021-01-04	科创板打新限售	15.50	17.06	3,873	60,031.50	66,073.38	-
6052	新亚	2020	2021	新股	16.9	16.9	431	7,30	7,30	-

77	电子	-12-25	-01-06	未上市	5	5		5.45	5.45	
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
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
128142	新乳转债	2020-12-18	2021-01-19	配债未上市	100.00	100.00	46	4,600.00	4,600.00	-

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. 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。

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
300182	捷成股份	2020-12-30	拟披露重大事项	3.23	2021-01-07	3.40	20,500	86,940.53	66,215.00	-

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。

7.4.13 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与绩效评估。

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

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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	799,920.00	-
合计	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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	4,600.00	-
未评级	-	-
合计	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2020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2020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2020年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值未超过经确认的当日净赎回金额。

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

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
应付托管费	-	-	-	2,593.63	2,593.63
应付交易费用	-	-	-	18,200.76	18,200.76
应交税费	-	-	-	0.04	0.04
其他负债	-	-	-	882,833.97	882,833.97
负债总计	-	-	-	911,409.36	911,409.36
利率敏感度缺口	4,073,519.23	0.00	4,600.00	53,275,548.05	57,353,667.28
上年度末2019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	75,716,365.64	-	-	-	75,716,365.64
结算备付金	4,708,529.08	-	-	-	4,708,529.08
存出保证金	329,855.59	-	-	-	329,855.59
交易性金融资产	-	-	-	719,851,782.02	719,851,782.02
应收利	-	-	-	20,593.92	20,593.92

息					
资产总计	80,754,750.31	0.00	0.00	719,872,375.94	800,627,126.25
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	98,999.01	98,999.01
应付托管费	-	-	-	32,999.67	32,999.67
应付交易费用	-	-	-	609,819.38	609,819.38
其他负债	-	-	-	39,758.25	39,758.25
负债总计	-	-	-	781,576.31	781,576.31
利率敏感度缺口	80,754,750.31	0.00	0.00	719,090,799.63	799,845,549.94

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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	市场利率增加0.25%	-61.51	0.00
	市场利率减少0.25%	61.52	0.00

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

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 2020年12月31日		上年度末 2019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	53,103,489.69	92.59	719,851,782.02	90.00
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	53,103,489.69	92.59	719,851,782.02	90.00

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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准上升5%	2,579,874.23	41,012,578.27
	业绩比较基准下降5%	-2,579,874.23	-41,012,578.27

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2020年度，本基金申购基金份额的对价总额为37,711,642.97元(2019年11月14日(基金合同生效日)至2019年12月31日止期间：0.00元)，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(2019年11月14日(基金合同生效日)至2019年12月31日止期间：其中包括以股票支付的申购款0.00元和以现金支付的申购款0.00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2020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52,505,329.22元，属于第二层次的余额为1,402,680.47元，无属于第三层次的余额(2019年12月31日：第一层次719,851,782.02元，无第二或第三层次)。

(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2020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(2019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) 除基金申购款和公允价值外，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	53,103,489.69	91.14
	其中：股票	53,103,489.69	91.14
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	804,520.00	1.38
	其中：债券	804,520.00	1.38
	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	3,720,736.97	6.39
8	其他各项资产	636,329.98	1.09
9	合计	58,265,076.64	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	506,118.00	0.88
B	采矿业	2,246,744.40	3.92
C	制造业	31,027,049.77	54.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,839,073.92	3.21
E	建筑业	1,049,395.00	1.83
F	批发和零售业	2,307,694.58	4.02
G	交通运输、仓储和邮政业	1,797,048.20	3.13
H	住宿和餐饮业	239,473.00	0.42
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,653,876.12	6.37
J	金融业	2,936,828.13	5.12
K	房地产业	2,242,424.71	3.91
L	租赁和商务服务业	735,756.00	1.28
M	科学研究和技术服务业	219,621.00	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	536,072.73	0.93
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	102,608.00	0.18
Q	卫生和社会工作	207,864.00	0.36
R	文化、体育和娱乐业	682,372.00	1.19
S	综合	192,454.00	0.34
	合计	52,522,473.56	91.58

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	562,299.89	0.98
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	18,716.24	0.03
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	581,016.13	1.01

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	300274	阳光电源	3,400	245,752.00	0.43
2	600006	东风汽车	22,400	211,456.00	0.37
3	601966	玲珑轮胎	5,789	203,599.13	0.35
4	603486	科沃斯	2,200	194,678.00	0.34
5	600765	中航重机	7,500	187,500.00	0.33
6	002709	天赐材料	1,800	186,840.00	0.33
7	600409	三友化工	16,800	172,200.00	0.30
8	601865	福莱特	4,300	171,570.00	0.30
9	300618	寒锐钴业	1,800	170,838.00	0.30
10	600563	法拉电子	1,587	170,681.85	0.30
11	600316	洪都航空	3,000	170,610.00	0.30
12	002080	中材科技	7,000	169,260.00	0.30
13	300207	欣旺达	5,400	165,834.00	0.29
14	300496	中科创达	1,400	163,800.00	0.29
15	002625	光启技术	7,300	162,425.00	0.28
16	600862	中航高科	5,300	159,530.00	0.28
17	601016	节能风电	46,100	158,123.00	0.28
18	000738	航发控制	6,800	155,924.00	0.27
19	603317	天味食品	1,875	154,200.00	0.27
20	002500	山西证券	17,200	153,940.00	0.27
21	601689	拓普集团	3,995	153,527.85	0.27
22	600426	华鲁恒升	4,100	152,930.00	0.27
23	600885	宏发股份	2,800	151,816.00	0.26
24	600884	杉杉股份	8,415	151,722.45	0.26
25	002920	德赛西威	1,800	151,452.00	0.26
26	601717	郑煤机	13,600	148,648.00	0.26

27	688029	南微医学	800	147,208.00	0.26
28	601866	中远海发	49,500	147,015.00	0.26
29	300001	特锐德	5,000	146,800.00	0.26
30	002595	豪迈科技	4,900	145,285.00	0.25
31	603806	福斯特	1,700	145,180.00	0.25
32	300285	国瓷材料	3,200	144,352.00	0.25
33	603198	迎驾贡酒	4,100	143,090.00	0.25
34	000547	航天发展	5,200	143,000.00	0.25
35	600985	淮北矿业	12,700	142,113.00	0.25
36	600418	江淮汽车	11,600	141,868.00	0.25
37	000012	南玻 A	19,182	141,563.16	0.25
38	600779	水井坊	1,700	141,134.00	0.25
39	600707	彩虹股份	20,900	139,194.00	0.24
40	000039	中集集团	9,260	138,807.40	0.24
41	000983	山西焦煤	24,550	138,462.00	0.24
42	603712	七一二	3,300	137,445.00	0.24
43	601615	明阳智能	7,200	136,656.00	0.24
44	002507	涪陵榨菜	3,200	135,360.00	0.24
45	600460	士兰微	5,400	135,000.00	0.24
46	000878	云南铜业	9,300	134,571.00	0.23
47	601233	桐昆股份	6,500	133,835.00	0.23
48	300482	万孚生物	1,500	133,815.00	0.23
49	002444	巨星科技	4,300	133,773.00	0.23
50	002064	华峰化学	13,200	133,188.00	0.23
51	600549	厦门钨业	7,900	133,115.00	0.23
52	002390	信邦制药	15,600	132,288.00	0.23
53	300012	华测检测	4,800	131,376.00	0.23
54	600132	重庆啤酒	1,100	130,889.00	0.23
55	002294	信立泰	4,600	130,318.00	0.23
56	002124	天邦股份	8,900	129,940.00	0.23
57	002078	太阳纸业	9,000	129,870.00	0.23

58	603225	新凤鸣	9,289	129,117.10	0.23
59	002074	国轩高科	3,300	129,096.00	0.23
60	002013	中航机电	11,200	128,240.00	0.22
61	300115	长盈精密	5,200	128,180.00	0.22
62	002648	卫星石化	4,900	127,988.00	0.22
63	002867	周大生	4,800	127,920.00	0.22
64	603444	吉比特	300	127,800.00	0.22
64	000830	鲁西化工	10,000	127,800.00	0.22
66	002340	格林美	18,200	127,218.00	0.22
67	000877	天山股份	8,400	126,840.00	0.22
68	600143	金发科技	7,400	126,836.00	0.22
69	600733	北汽蓝谷	14,600	126,582.00	0.22
70	300316	晶盛机电	4,200	126,336.00	0.22
71	300463	迈克生物	2,700	125,820.00	0.22
72	600827	百联股份	8,600	125,560.00	0.22
73	600160	巨化股份	15,450	125,299.50	0.22
74	600497	驰宏锌锗	26,100	125,280.00	0.22
75	000750	国海证券	21,330	124,993.80	0.22
76	000027	深圳能源	20,520	124,966.80	0.22
77	000690	宝新能源	17,100	124,830.00	0.22
78	600348	华阳股份	22,200	124,542.00	0.22
79	002092	中泰化学	20,200	124,230.00	0.22
80	603650	彤程新材	4,000	124,000.00	0.22
81	600835	上海机电	6,350	123,571.00	0.22
82	600598	北大荒	6,400	123,200.00	0.21
83	600089	特变电工	12,100	122,815.00	0.21
84	002250	联化科技	5,100	122,349.00	0.21
85	600515	*ST基础	18,100	122,175.00	0.21
86	000869	张裕A	2,800	122,080.00	0.21
87	600739	辽宁成大	5,000	121,600.00	0.21
88	002372	伟星新材	6,500	121,550.00	0.21

89	002056	横店东磁	8,000	121,520.00	0.21
90	601127	小康股份	7,100	121,268.00	0.21
91	600258	首旅酒店	5,700	120,954.00	0.21
92	000528	柳 工	16,400	120,704.00	0.21
93	601598	中国外运	27,400	120,560.00	0.21
94	603290	斯达半导	500	120,450.00	0.21
95	601799	星宇股份	600	120,300.00	0.21
96	002030	达安基因	3,501	120,084.30	0.21
97	603816	顾家家居	1,700	119,867.00	0.21
98	300168	万达信息	5,500	119,295.00	0.21
99	600038	中直股份	1,900	119,149.00	0.21
100	600507	方大特钢	17,131	118,889.14	0.21
101	600339	中油工程	38,600	118,888.00	0.21
102	300474	景嘉微	1,700	118,847.00	0.21
103	600486	扬农化工	900	118,800.00	0.21
104	000739	普洛药业	5,100	118,728.00	0.21
105	600580	卧龙电驱	7,600	118,560.00	0.21
106	600754	锦江酒店	2,300	118,519.00	0.21
107	000301	东方盛虹	12,500	118,500.00	0.21
108	002670	国盛金控	8,600	118,250.00	0.21
109	600967	内蒙一机	9,700	117,952.00	0.21
110	000636	风华高科	3,500	117,950.00	0.21
111	601099	太平洋	28,900	117,912.00	0.21
112	601168	西部矿业	9,500	117,610.00	0.21
113	002926	华西证券	9,400	117,312.00	0.20
114	600859	王府井	3,600	117,288.00	0.20
115	002408	齐翔腾达	14,000	117,040.00	0.20
116	300376	易事特	14,700	117,012.00	0.20
117	600282	南钢股份	37,500	117,000.00	0.20
118	600970	中材国际	17,000	116,960.00	0.20
119	000998	隆平高科	5,900	116,879.00	0.20

120	600166	福田汽车	37,100	116,865.00	0.20
121	000937	冀中能源	27,900	116,064.00	0.20
122	002985	北摩高科	600	115,980.00	0.20
123	600879	航天电子	15,500	115,940.00	0.20
124	600372	中航电子	5,900	115,935.00	0.20
125	600039	四川路桥	25,700	115,907.00	0.20
126	600597	光明乳业	7,119	115,754.94	0.20
127	000630	铜陵有色	44,900	115,393.00	0.20
128	600529	山东药玻	2,300	115,345.00	0.20
129	603882	金域医学	900	115,308.00	0.20
130	600079	人福医药	3,400	115,192.00	0.20
131	000729	燕京啤酒	13,500	115,020.00	0.20
132	000887	中鼎股份	9,800	114,758.00	0.20
133	002568	百润股份	1,100	114,719.00	0.20
134	600141	兴发集团	10,400	114,712.00	0.20
135	300595	欧普康视	1,400	114,688.00	0.20
136	600435	北方导航	12,740	114,660.00	0.20
137	002506	协鑫集成	26,800	113,900.00	0.20
138	002745	木林森	7,800	113,802.00	0.20
139	600219	南山铝业	36,000	113,760.00	0.20
140	000898	鞍钢股份	37,400	113,696.00	0.20
141	601200	上海环境	10,410	113,469.00	0.20
142	600511	国药股份	2,300	113,413.00	0.20
143	603338	浙江鼎力	1,120	113,332.80	0.20
144	001872	招商港口	7,100	113,032.00	0.20
145	000488	晨鸣纸业	17,600	112,992.00	0.20
146	000686	东北证券	11,500	112,930.00	0.20
147	600312	平高电气	15,700	112,098.00	0.20
148	600699	均胜电子	4,400	111,584.00	0.19
149	600546	山煤国际	13,100	111,481.00	0.19
150	002572	索菲亚	4,300	111,370.00	0.19

151	000400	许继电气	7,700	111,342.00	0.19
152	000519	中兵红箭	11,100	111,222.00	0.19
153	688002	睿创微纳	1,000	111,000.00	0.19
154	000060	中金岭南	23,000	110,860.00	0.19
155	600008	首创股份	39,164	110,834.12	0.19
156	002797	第一创业	11,100	110,445.00	0.19
157	601778	晶科科技	15,200	110,352.00	0.19
158	600392	盛和资源	12,404	110,271.56	0.19
159	603589	口子窖	1,600	110,240.00	0.19
160	601003	柳钢股份	21,200	110,028.00	0.19
161	600155	华创阳安	8,300	109,477.00	0.19
162	600903	贵州燃气	8,600	109,220.00	0.19
163	002563	森马服饰	10,900	109,218.00	0.19
164	600158	中体产业	8,900	109,114.00	0.19
165	600516	方大炭素	15,400	108,878.00	0.19
166	600875	东方电气	10,900	108,673.00	0.19
167	603786	科博达	1,600	108,192.00	0.19
168	601699	潞安环能	16,600	107,900.00	0.19
169	601298	青岛港	16,700	107,381.00	0.19
170	002081	金螳螂	11,400	107,046.00	0.19
171	600867	通化东宝	8,000	107,040.00	0.19
172	002423	中粮资本	11,000	106,480.00	0.19
173	000959	首钢股份	27,800	106,474.00	0.19
174	603866	桃李面包	1,800	106,380.00	0.19
175	601128	常熟银行	14,400	106,272.00	0.19
176	002249	大洋电机	23,600	106,200.00	0.19
177	000807	云铝股份	14,100	106,173.00	0.19
178	002128	露天煤业	9,700	106,118.00	0.19
179	600056	中国医药	7,400	106,042.00	0.18
180	600811	东方集团	29,000	105,850.00	0.18
181	600338	西藏珠峰	10,100	105,848.00	0.18

182	603355	莱克电气	3,500	105,805.00	0.18
183	002221	东华能源	10,400	105,456.00	0.18
184	002382	蓝帆医疗	5,000	105,450.00	0.18
185	002385	大北农	10,900	105,294.00	0.18
186	000932	华菱钢铁	22,000	105,160.00	0.18
187	300212	易华录	3,420	104,823.00	0.18
188	000883	湖北能源	27,000	104,760.00	0.18
189	600195	中牧股份	8,174	104,708.94	0.18
190	002948	青岛银行	17,600	104,368.00	0.18
191	600291	西水股份	18,400	104,328.00	0.18
192	002429	兆驰股份	16,800	104,160.00	0.18
193	002831	裕同科技	3,400	104,108.00	0.18
194	300459	金科文化	32,600	103,994.00	0.18
195	600908	无锡银行	17,100	103,968.00	0.18
196	600415	小商品城	18,800	103,588.00	0.18
197	603379	三美股份	5,420	103,522.00	0.18
198	603638	艾迪精密	1,500	103,410.00	0.18
199	002901	大博医疗	1,400	103,222.00	0.18
200	600649	城投控股	19,000	103,170.00	0.18
201	002818	富森美	7,300	103,149.00	0.18
202	002925	盈趣科技	1,600	102,928.00	0.18
203	603868	飞科电器	2,200	102,916.00	0.18
204	300113	顺网科技	6,000	102,900.00	0.18
205	603377	东方时尚	5,300	102,608.00	0.18
205	600737	中粮糖业	10,600	102,608.00	0.18
207	600782	新钢股份	22,300	102,357.00	0.18
208	000061	农产品	14,500	102,225.00	0.18
209	601000	唐山港	41,200	102,176.00	0.18
210	002242	九阳股份	3,188	102,143.52	0.18
211	600664	哈药股份	32,000	102,080.00	0.18
212	600535	天士力	6,900	102,051.00	0.18

213	000988	华工科技	4,400	102,036.00	0.18
214	601228	广州港	30,300	101,808.00	0.18
215	002701	奥瑞金	20,600	101,764.00	0.18
216	600639	浦东金桥	8,200	101,680.00	0.18
217	600869	远东股份	25,459	101,581.41	0.18
218	002191	劲嘉股份	11,000	101,530.00	0.18
219	600717	天津港	21,240	101,527.20	0.18
220	002505	鹏都农牧	40,100	101,453.00	0.18
221	601880	辽港股份	52,500	101,325.00	0.18
222	601958	金钼股份	16,300	101,223.00	0.18
223	300296	利亚德	15,900	101,124.00	0.18
224	002244	滨江集团	22,000	100,980.00	0.18
225	000997	新大陆	6,600	100,848.00	0.18
226	002791	坚朗五金	700	100,800.00	0.18
227	601608	中信重工	25,450	100,782.00	0.18
228	600022	山东钢铁	70,300	100,529.00	0.18
229	600823	世茂股份	21,800	100,498.00	0.18
230	000717	韶钢松山	23,500	100,345.00	0.17
231	000718	苏宁环球	29,233	100,269.19	0.17
232	000050	深天马 A	6,800	100,232.00	0.17
233	603927	中科软	2,500	100,225.00	0.17
234	600820	隧道股份	18,500	100,085.00	0.17
235	601718	际华集团	33,000	99,990.00	0.17
236	300072	三聚环保	17,600	99,968.00	0.17
237	000999	华润三九	4,000	99,760.00	0.17
238	300357	我武生物	1,300	99,710.00	0.17
239	603515	欧普照明	3,300	99,693.00	0.17
240	000960	锡业股份	8,900	99,680.00	0.17
241	300058	蓝色光标	16,600	99,600.00	0.17
242	002155	湖南黄金	11,700	99,567.00	0.17
243	000930	中粮科技	11,800	99,356.00	0.17

244	600881	亚泰集团	32,000	99,200.00	0.17
245	601005	重庆钢铁	67,000	99,160.00	0.17
246	002396	星网锐捷	4,300	99,158.00	0.17
247	601611	中国核建	13,600	99,008.00	0.17
248	600273	嘉化能源	10,700	98,868.00	0.17
249	002212	天融信	4,700	98,747.00	0.17
250	000600	建投能源	17,600	98,736.00	0.17
251	600064	南京高科	9,600	98,592.00	0.17
252	603328	依顿电子	12,400	98,580.00	0.17
253	002503	搜于特	44,000	98,560.00	0.17
254	600073	上海梅林	9,550	98,269.50	0.17
255	600729	重庆百货	3,400	98,260.00	0.17
256	002839	张家港行	16,100	98,210.00	0.17
257	600388	龙净环保	11,051	98,132.88	0.17
258	002353	杰瑞股份	2,800	98,000.00	0.17
259	300699	光威复材	1,100	97,955.00	0.17
260	000009	中国宝安	13,000	97,890.00	0.17
261	000975	银泰黄金	11,340	97,637.40	0.17
262	603077	和邦生物	68,700	97,554.00	0.17
263	002936	郑州银行	21,870	97,540.20	0.17
264	000758	中色股份	19,200	97,536.00	0.17
265	002302	西部建设	11,100	97,458.00	0.17
266	000581	威孚高科	4,200	97,398.00	0.17
267	601801	皖新传媒	20,500	97,375.00	0.17
268	000970	中科三环	10,300	97,335.00	0.17
269	002544	杰赛科技	5,800	97,324.00	0.17
270	000563	陕国投 A	25,800	97,266.00	0.17
271	600446	金证股份	6,000	97,260.00	0.17
272	601860	紫金银行	23,100	97,251.00	0.17
273	002705	新宝股份	2,300	97,175.00	0.17
274	600776	东方通信	8,200	97,170.00	0.17

275	002440	闰土股份	10,400	96,928.00	0.17
276	600909	华安证券	12,100	96,800.00	0.17
277	600466	蓝光发展	20,900	96,767.00	0.17
278	300146	汤臣倍健	4,000	96,600.00	0.17
279	600256	广汇能源	34,100	96,503.00	0.17
280	603345	安井食品	500	96,435.00	0.17
281	000089	深圳机场	11,800	96,406.00	0.17
282	600648	外高桥	6,900	96,393.00	0.17
283	000825	太钢不锈	26,700	96,387.00	0.17
284	603000	人民网	5,700	96,330.00	0.17
285	002028	思源电气	4,800	96,288.00	0.17
286	000685	中山公用	11,600	96,280.00	0.17
287	601997	贵阳银行	12,100	96,195.00	0.17
288	000553	安道麦A	12,300	96,186.00	0.17
289	000028	国药一致	2,100	96,180.00	0.17
290	002511	中顺洁柔	4,600	96,002.00	0.17
291	002223	鱼跃医疗	3,400	95,914.00	0.17
292	002156	通富微电	3,800	95,912.00	0.17
293	600787	中储股份	20,800	95,888.00	0.17
294	300418	昆仑万维	4,800	95,760.00	0.17
295	000623	吉林敖东	5,810	95,690.70	0.17
296	600325	华发股份	15,400	95,634.00	0.17
297	600126	杭钢股份	18,060	95,537.40	0.17
298	603885	吉祥航空	8,400	95,508.00	0.17
299	603883	老百姓	1,520	95,501.60	0.17
300	600871	石化油服	48,700	95,452.00	0.17
301	000543	皖能电力	22,800	95,304.00	0.17
302	600060	海信视像	8,300	95,284.00	0.17
303	603888	新华网	5,000	95,000.00	0.17
304	002038	双鹭药业	9,400	94,940.00	0.17
305	000559	万向钱潮	17,740	94,909.00	0.17

306	600307	酒钢宏兴	57,500	94,875.00	0.17
307	600026	中远海能	14,200	94,856.00	0.17
308	300009	安科生物	6,446	94,627.28	0.16
309	000629	攀钢钒钛	43,600	94,612.00	0.16
310	600329	中新药业	5,400	94,608.00	0.16
311	600380	健康元	6,800	94,588.00	0.16
312	600673	东阳光	18,800	94,564.00	0.16
313	600623	华谊集团	16,300	94,540.00	0.16
314	600928	西安银行	17,000	94,520.00	0.16
315	688099	晶晨股份	1,200	94,476.00	0.16
316	002233	塔牌集团	7,400	94,276.00	0.16
317	601179	中国西电	20,400	94,044.00	0.16
318	300180	华峰超纤	15,900	93,969.00	0.16
319	002131	利欧股份	31,000	93,930.00	0.16
320	002603	以岭药业	3,683	93,916.50	0.16
321	600808	马钢股份	35,300	93,898.00	0.16
322	601106	中国一重	31,400	93,886.00	0.16
323	600315	上海家化	2,700	93,771.00	0.16
324	002273	水晶光电	8,089	93,751.51	0.16
325	600188	兖州煤业	9,300	93,651.00	0.16
326	600556	天下秀	7,400	93,610.00	0.16
327	600153	建发股份	11,400	93,594.00	0.16
328	000402	金 融 街	14,500	93,525.00	0.16
329	002683	宏大爆破	2,600	93,470.00	0.16
330	600633	浙数文化	11,476	93,414.64	0.16
331	000156	华数传媒	10,900	93,304.00	0.16
332	002266	浙富控股	20,700	93,150.00	0.16
332	000513	丽珠集团	2,300	93,150.00	0.16
334	601928	凤凰传媒	14,700	93,051.00	0.16
335	600575	淮河能源	40,100	93,032.00	0.16
336	601118	海南橡胶	19,300	93,026.00	0.16

337	002690	美亚光电	2,100	92,988.00	0.16
338	002966	苏州银行	12,100	92,928.00	0.16
339	600642	申能股份	17,800	92,916.00	0.16
340	603228	景旺电子	3,080	92,862.00	0.16
341	600755	厦门国贸	13,900	92,852.00	0.16
342	000537	广宇发展	14,800	92,796.00	0.16
343	600718	东软集团	8,900	92,649.00	0.16
344	002185	华天科技	6,800	92,616.00	0.16
345	300244	迪安诊断	2,700	92,556.00	0.16
346	600171	上海贝岭	6,600	92,532.00	0.16
347	600398	海澜之家	14,400	92,448.00	0.16
348	600839	四川长虹	31,800	92,220.00	0.16
349	002957	科瑞技术	4,500	92,025.00	0.16
350	601139	深圳燃气	12,700	91,948.00	0.16
351	002048	宁波华翔	5,900	91,863.00	0.16
352	002217	合力泰	22,400	91,840.00	0.16
353	601456	国联证券	4,300	91,719.00	0.16
354	002946	新乳业	5,200	91,572.00	0.16
355	002368	太极股份	3,500	91,385.00	0.16
356	002635	安洁科技	5,300	91,319.00	0.16
357	002807	江阴银行	21,300	91,164.00	0.16
358	300026	红日药业	19,900	91,142.00	0.16
359	600021	上海电力	12,800	91,136.00	0.16
360	600216	浙江医药	6,700	91,120.00	0.16
361	600566	济川药业	4,500	91,035.00	0.16
362	601869	长飞光纤	3,365	90,989.60	0.16
363	002465	海格通信	8,400	90,972.00	0.16
364	002419	天虹股份	11,900	90,916.00	0.16
365	603737	三棵树	600	90,900.00	0.16
366	002203	海亮股份	12,300	90,897.00	0.16
367	688088	虹软科技	1,300	90,896.00	0.16

367	601969	海南矿业	15,200	90,896.00	0.16
369	600582	天地科技	29,500	90,860.00	0.16
370	002110	三钢闽光	13,500	90,855.00	0.16
371	000709	河钢股份	40,500	90,720.00	0.16
372	600259	广晟有色	3,000	90,510.00	0.16
373	001914	招商积余	4,200	90,426.00	0.16
374	002281	光迅科技	3,100	90,024.00	0.16
375	600863	内蒙华电	35,000	89,950.00	0.16
376	600062	华润双鹤	7,500	89,925.00	0.16
377	600917	重庆燃气	13,100	89,866.00	0.16
378	600959	江苏有线	27,100	89,701.00	0.16
379	600410	华胜天成	10,100	89,486.00	0.16
380	600517	国网英大	14,700	89,376.00	0.16
381	000031	大悦城	20,300	89,320.00	0.16
382	300324	旋极信息	21,100	89,253.00	0.16
383	600037	歌华有线	9,700	89,240.00	0.16
384	600657	信达地产	22,000	89,100.00	0.16
385	600567	山鹰国际	29,500	89,090.00	0.16
386	603605	珀莱雅	500	89,000.00	0.16
387	603983	丸美股份	1,700	88,757.00	0.15
388	600901	江苏租赁	16,100	88,711.00	0.15
389	600801	华新水泥	4,300	88,709.00	0.15
390	002152	广电运通	8,300	88,644.00	0.15
391	600895	张江高科	5,200	88,608.00	0.15
392	600500	中化国际	16,800	88,536.00	0.15
393	002268	卫 士 通	5,300	88,510.00	0.15
394	600170	上海建工	29,400	88,494.00	0.15
395	601512	中新集团	8,900	88,466.00	0.15
396	600094	大名城	22,000	88,440.00	0.15
397	000062	深圳华强	7,100	88,324.00	0.15
398	601068	中铝国际	24,800	88,288.00	0.15

399	600704	物产中大	20,200	88,274.00	0.15
400	600645	中源协和	4,500	88,245.00	0.15
401	000078	海王生物	22,000	88,220.00	0.15
402	601975	招商南油	35,100	88,101.00	0.15
403	002458	益生股份	7,900	88,085.00	0.15
404	002373	千方科技	4,604	88,028.48	0.15
405	603719	良品铺子	1,500	88,005.00	0.15
406	000778	新兴铸管	23,900	87,952.00	0.15
407	000008	神州高铁	34,600	87,884.00	0.15
408	300630	普利制药	2,097	87,843.33	0.15
409	002075	沙钢股份	8,000	87,760.00	0.15
410	002416	爱施德	11,763	87,751.98	0.15
411	601098	中南传媒	9,200	87,676.00	0.15
412	000540	中天金融	27,800	87,570.00	0.15
413	300017	网宿科技	12,700	87,503.00	0.15
414	600968	海油发展	36,600	87,474.00	0.15
415	603256	宏和科技	9,900	87,417.00	0.15
416	300257	开山股份	6,400	87,360.00	0.15
417	601992	金隅集团	29,400	87,318.00	0.15
418	002051	中工国际	12,300	87,207.00	0.15
419	600260	凯乐科技	8,000	87,200.00	0.15
420	002019	亿帆医药	4,600	87,078.00	0.15
421	000158	常山北明	14,000	86,800.00	0.15
422	002434	万里扬	9,700	86,524.00	0.15
423	002004	华邦健康	15,600	86,424.00	0.15
424	000401	冀东水泥	6,100	86,315.00	0.15
425	002557	洽洽食品	1,600	86,160.00	0.15
426	002399	海普瑞	5,000	86,100.00	0.15
427	000826	启迪环境	12,700	85,852.00	0.15
428	300002	神州泰岳	16,800	85,848.00	0.15
428	002653	海思科	4,900	85,848.00	0.15

430	002138	顺络电子	3,500	85,820.00	0.15
431	000021	深科技	4,500	85,545.00	0.15
432	601333	广深铁路	38,500	85,470.00	0.15
433	300166	东方国信	7,800	85,410.00	0.15
434	603858	步长制药	3,700	85,359.00	0.15
435	002424	贵州百灵	10,900	85,347.00	0.15
436	600675	中华企业	25,400	85,344.00	0.15
437	600350	山东高速	13,800	85,284.00	0.15
438	603056	德邦股份	6,700	85,023.00	0.15
439	600748	上实发展	17,300	84,943.00	0.15
440	002299	圣农发展	3,200	84,928.00	0.15
441	002589	瑞康医药	16,200	84,726.00	0.15
442	600266	城建发展	16,644	84,551.52	0.15
443	002195	二三四五	37,300	84,298.00	0.15
444	002085	万丰奥威	12,800	83,968.00	0.15
445	600131	国网信通	5,900	83,957.00	0.15
446	300010	豆神教育	8,600	83,936.00	0.15
447	002317	众生药业	7,600	83,752.00	0.15
448	600373	中文传媒	8,300	83,747.00	0.15
449	300024	机器人	6,800	83,640.00	0.15
450	300271	华宇软件	3,500	83,545.00	0.15
451	601828	美凯龙	9,800	83,202.00	0.15
452	600667	太极实业	8,800	83,160.00	0.14
452	000090	天健集团	14,000	83,160.00	0.14
454	000598	兴蓉环境	17,300	83,040.00	0.14
455	600167	联美控股	7,300	82,855.00	0.14
456	600376	首开股份	14,100	82,767.00	0.14
457	002468	申通快递	8,200	82,656.00	0.14
458	300070	碧水源	10,800	82,620.00	0.14
459	600572	康恩贝	17,500	82,425.00	0.14
460	300223	北京君正	900	82,341.00	0.14

461	000415	渤海租赁	34,300	82,320.00	0.14
462	000967	盈峰环境	10,100	82,214.00	0.14
463	600528	中铁工业	9,400	82,156.00	0.14
464	002387	维信诺	7,200	82,080.00	0.14
465	000681	视觉中国	6,300	81,900.00	0.14
466	002375	亚厦股份	11,000	81,840.00	0.14
467	002174	游族网络	6,200	81,592.00	0.14
468	000501	鄂武商 A	7,000	81,550.00	0.14
469	002941	新疆交建	7,400	81,400.00	0.14
470	600120	浙江东方	13,629	81,365.13	0.14
471	600277	亿利洁能	27,200	81,328.00	0.14
472	002010	传化智联	17,200	81,012.00	0.14
473	603708	家家悦	3,800	80,940.00	0.14
474	000990	诚志股份	6,807	80,731.02	0.14
475	002183	怡亚通	18,500	80,660.00	0.14
476	300134	大富科技	7,800	80,574.00	0.14
477	600643	爱建集团	10,700	80,464.00	0.14
478	002583	海能达	13,100	80,434.00	0.14
479	002640	跨境通	15,600	80,184.00	0.14
480	600053	九鼎投资	4,100	80,155.00	0.14
481	600804	鹏博士	11,900	79,968.00	0.14
482	000564	*ST大集	30,800	79,772.00	0.14
483	600640	号百控股	6,500	79,625.00	0.14
484	603893	瑞芯微	1,100	79,585.00	0.14
485	300133	华策影视	12,800	79,104.00	0.14
486	603568	伟明环保	4,161	78,767.73	0.14
487	002093	国脉科技	10,800	78,732.00	0.14
488	002815	崇达技术	5,400	77,976.00	0.14
489	688321	微芯生物	2,100	77,721.00	0.14
490	600545	卓郎智能	22,200	77,700.00	0.14
491	600201	生物股份	3,700	77,293.00	0.13

492	603260	合盛硅业	2,300	76,912.00	0.13
493	002002	鸿达兴业	25,300	75,900.00	0.13
494	300088	长信科技	8,500	75,565.00	0.13
495	600728	佳都科技	9,900	75,141.00	0.13
496	000046	泛海控股	22,100	72,488.00	0.13
497	300315	掌趣科技	14,000	71,540.00	0.12
498	000813	德展健康	15,900	70,437.00	0.12
499	000732	泰禾集团	20,700	67,689.00	0.12
500	300182	捷成股份	20,500	66,215.00	0.12

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	688277	天智航	6,530	245,070.90	0.43
2	688556	高测股份	4,615	124,281.95	0.22
3	688286	敏芯股份	710	83,304.30	0.15
4	688600	皖仪科技	3,873	66,073.38	0.12
5	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.03
6	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.03
7	605179	一鸣食品	699	12,344.34	0.02
8	605277	新亚电子	431	7,305.45	0.01
9	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.01

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	002030	达安基因	2,555,466.00	0.32
2	002821	凯莱英	2,078,984.97	0.26
3	300529	健帆生物	1,260,208.00	0.16
4	603983	丸美股份	978,437.00	0.12
5	603883	老百姓	965,175.00	0.12
6	600486	扬农化工	949,404.00	0.12
7	603338	浙江鼎力	915,427.00	0.11
8	688981	中芯国际	888,413.38	0.11
9	300088	长信科技	841,662.86	0.11
10	600161	天坛生物	753,450.00	0.09
11	603659	璞泰来	716,795.00	0.09
12	603605	珀莱雅	702,434.00	0.09
13	002268	卫 士 通	702,251.00	0.09
14	600779	水井坊	637,735.00	0.08
15	600754	锦江酒店	631,464.21	0.08
16	603882	金域医学	628,442.00	0.08
17	603939	益丰药房	621,220.00	0.08
18	002635	安洁科技	615,083.00	0.08
19	600694	大商股份	595,736.00	0.07
20	002242	九阳股份	595,655.00	0.07

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	002030	达安基因	4,753,120.22	0.59
2	002821	凯莱英	4,049,357.00	0.51
3	300529	健帆生物	3,094,842.40	0.39
4	002414	高德红外	3,019,375.40	0.38

5	688981	中芯国际	2,710,094.52	0.34
6	002074	国轩高科	2,689,644.13	0.34
7	002603	以岭药业	2,600,951.00	0.33
8	300088	长信科技	2,572,598.00	0.32
9	002635	安洁科技	2,550,177.19	0.32
10	002371	北方华创	2,536,735.00	0.32
11	002385	大北农	2,427,166.00	0.30
12	002709	天赐材料	2,417,885.21	0.30
13	300010	豆神教育	2,371,915.70	0.30
14	000021	深科技	2,371,394.00	0.30
15	002056	横店东磁	2,362,591.00	0.30
16	300274	阳光电源	2,331,724.59	0.29
17	300316	晶盛机电	2,324,836.27	0.29
18	002129	中环股份	2,316,385.95	0.29
19	300418	昆仑万维	2,287,474.00	0.29
20	300253	卫宁健康	2,277,966.06	0.28

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	169,642,363.50
卖出股票收入（成交）总额	494,730,211.04

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	799,920.00	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)	4,600.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	804,520.00	1.40

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	019627	20国债01	8,000	799,920.00	1.39
2	128142	新乳转债	46	4,600.00	0.01

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/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
----	----	----------	------	--------	------

IC2101	中证500股指期货2101合约	1	1, 268, 760.00	28, 960. 00	—
IC2103	中证500股指期货2103合约	1	1, 250, 280.00	23, 860. 00	—
IC2106	中证500股指期货2106合约	1	1, 220, 480.00	19, 360. 00	—
公允价值变动总额合计（元）					72, 180. 00
股指期货投资本期收益（元）					-66, 500. 00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					72, 180. 00

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	608,107.83
2	应收证券清算款	10,306.76
3	应收股利	—
4	应收利息	17,915.39
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	636,329.98

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	688277	天智航	245,070.90	0.43	科创板打新限售
2	688556	高测股份	124,281.95	0.22	科创板打新限售
3	688286	敏芯股份	83,304.30	0.15	科创板打新限售
4	688600	皖仪科技	66,073.38	0.12	非公开发行限售

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
1,217	34,604.49	4,440,859.00	10.54%	37,672,806.00	89.46%

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	中信建投证券股份有限公司	3,075,054.00	7.30
2	黄丽萍	1,000,000.00	2.37
3	中国银河证券股份有限公司	914,540.00	2.17
4	董保国	759,000.00	1.80
5	辛明蕾	739,013.00	1.75
6	韩英	500,000.00	1.19
7	刘百荣	500,000.00	1.19

8	梁小琴	500,000.00	1.19
9	陆可	490,000.00	1.16
10	杨建中	422,500.00	1.00

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	760,113,665.00
本报告期基金总申购份额	34,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	752,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	42,113,665.00

§ 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，基金管理人重大人事变动如下：

1、本基金管理人于2020年5月6日发布公告，秦亚峰先生担任前海开源基金管理有限公司固定收益投资决策委员会主席；

2、本基金管理人于2020年9月12日发布公告，前海开源基金管理有限公司总理由蔡颖女士变更为贾红波先生；

3、本基金管理人于2020年11月25日发布公告，何隽先生担任前海开源基金管理有限公司首席信息官。

上述事项经前海开源基金管理有限公司董事会审议通过，并已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时报送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告已在中国证监会规定的全国性报刊及规定互联网网站等媒介披露。

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2020年9月16日发布《中国银河证券股份有限公司托管部负责人变更公告》，陈秀清自2020年9月14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5.5万元。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及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情形。

本报告期内，基金托管人中国银河证券股份有限公司及其高级管理人员受到监管部门稽查或处罚的情形如下：

（1）公司收到北京证监局下发的《关于对中国银河证券股份有限公司采取责令改正行政监管措施的决定》（〔2020〕64号）

2020年4月22日，北京证监局向公司下发《关于对中国银河证券股份有限公司采取责令改正行政监管措施的决定》（〔2020〕64号），针对公司持有一种非权益类证券超规模；作为私募股权投资基金托管人，根据基金管理人提供的单方说明变更收款账户，将基金财产划至管理人账户等行为出具行政监管处罚措施，责令公司限期改正，要求公司完善内部控制，加强风险控制指标监控，及时发现并报告相关情况；作为私募股权投

资基金托管人，尽职履责，切实履行义务，并于收到决定书之日起30日内向北京证监局提交书面整改报告。

对于上述事项，公司高度重视并责成相关部门全面、深入查找分析问题根源，采取了有效、有针对性的整改措施，进一步加强风险控制指标监控工作，做好相关系统的升级完善，加强对风险控制指标的跨部门协同管理，并采取有效措施建立长效机制；进一步加强托管业务管理流程，完成对非标产品划款审批流程和合同范本的修订工作，完善对管理人和产品的引入尽调及评审的相关流程，从源头上杜绝私募股权基金托管的风险。公司于2020年5月22日向北京证监局报送了《公司就〈关于对中国银河证券股份有限公司采取责令改正措施的决定〉整改情况的报告》。

(2) 公司收到北京证监局下发的《关于对中国银河证券股份有限公司采取责令改正行政监管措施的决定》（〔2020〕169号）

2020年12月7日，北京证监局向公司下发《关于对中国银河证券股份有限公司采取责令改正行政监管措施的决定》（〔2020〕169号），针对公司作为公募基金托管人，未对个别基金的投资范围和投资比例进行设置和有效监督等行为出具行政监管处罚措施，责令公司限期改正。

公司对此事项高度重视，采取有效措施积极整改。公司完善了相关业务监控流程，强化职责履行，优化管理模式，健全风控机制等措施，防范类似事项再次发生。同时，公司对相关责任人员进行问责处理。

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	657,603,561.63	100.00%	480,910.80	100.00%	-

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	成交金额	占当期	成	占当期权	成	占当期基

		债券成交总额的比例		债券回购成交总额的比例	成交额	证成交总额的比例	成交额	金成交总额的比例
银河证券	2,187,380.87	100.00%	400,000.00	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	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会规定媒介	2020-01-15
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招募说明书摘要（20200115更新）	中国证监会规定媒介	2020-01-15
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开放日常申购、赎回业务的公告	中国证监会规定媒介	2020-01-15
4	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（20200115更新）	中国证监会规定媒介	2020-01-15
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更新的公告	中国证监会规定媒介	2020-01-15
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上市交易公告书提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-01-15
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上市交易提示性公告	中国证监会规定媒介	2020-01-20
8	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	2020-03-13

	金招募说明书（20200313更新）		
9	关于前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金增加扩位证券简称的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-13
10	关于调整前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金指数许可使用费收取下限的公告	中国证监会规定媒介	2020-03-13
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招募说明书摘要（20200313更新）	中国证监会规定媒介	2020-03-13
12	前海开源基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）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	2020-03-30
13	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1季度报告	中国证监会规定媒介	2020-04-22
14	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摘要（20200508更新）	中国证监会规定媒介	2020-05-08
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招募说明书（20200508更新）	中国证监会规定媒介	2020-05-08
16	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金变更基金经理的公告	中国证监会规定媒介	2020-05-08
17	前海开源基金管理有限公司关于暂停扬州国信嘉利基金	中国证监会规定媒介	2020-05-28

	销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告		
18	前海开源基金管理有限公司关于旗下上交所ETF申购赎回清单版本更新的公告	中国证监会规定媒介	2020-06-19
19	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摘要（20200619更新）	中国证监会规定媒介	2020-06-19
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招募说明书（20200619更新）	中国证监会规定媒介	2020-06-19
21	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2季度报告	中国证监会规定媒介	2020-07-21
22	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2季度报告更正公告	中国证监会规定媒介	2020-07-22
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基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2020-08-27
24	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年中期报告	中国证监会规定媒介	2020-08-31
25	前海开源基金管理有限公司关于终止深圳信诚基金销售有限公司代理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2020-09-05
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2020年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2020-10-28

27	前海开源基金管理有限公司关于终止大泰金石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	2020-11-05
28	前海开源基金管理有限公司关于终止北京电盈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	2020-12-09
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基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2020-12-19
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招募说明书（20201221更新）	中国证监会规定媒介	2020-12-21
31	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（20201221更新）	中国证监会规定媒介	2020-12-21
32	前海开源基金管理有限公司关于终止与部分代销机构合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2020-12-31

§ 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	20200602 - 20200802	0.00	27,912,900.00	27,912,900.00	0.00	0.00%
产品特有风险							
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；

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；

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；

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 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、营业执照和公司章程

(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（免长途话费）

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

前海开源基金管理有限公司

二〇二一年三月三十一日