

前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金  
2024 年中期报告

2024 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：2024 年 08 月 30 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 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	7
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
3.2	基金净值表现	8
§ 4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	15
6.3	净资产变动表	16
6.4	报表附注	17
§ 7	投资组合报告	38
7.1	期末基金资产组合情况	38
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	54
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	54
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	54
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12	投资组合报告附注	54

§ 8	基金份额持有人信息 .....	55
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
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 .....	56
§ 9	开放式基金份额变动 .....	57
§ 10	重大事件揭示 .....	57
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	57
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
10.4	基金投资策略的改变 .....	57
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
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 .....	57
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.8	其他重大事件 .....	59
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
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 .....	60
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
§ 12	备查文件目录 .....	60
12.1	备查文件目录 .....	60
12.2	存放地点 .....	60
12.3	查阅方式 .....	60

## § 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	28,616,526.78 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	10,512,112.28 份	18,104,414.50 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> <p>本基金的投资策略主要有以下八个方面内容：</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）股票投资组合构建</p> <p>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</p>

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

	<p>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> <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	0755-88601888
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com
客户服务电话	4001-666-998	400-61-95555
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址	www.qhkyfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

### 2.5 其他相关资料

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 01 月 01 日至 2024 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	-789,469.58	-1,848,059.54
本期利润	29,591.21	106,069.55
加权平均基金份额本期利润	0.0028	0.0044
本期加权平均净值利润率	0.24%	0.38%
本期基金份额净值增长率	0.23%	0.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 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
期末可供分配利润	1,653,545.40	2,610,612.43
期末可供分配基金份额利润	0.1573	0.1442
期末基金资产净值	12,165,657.68	20,715,026.93
期末基金份额净值	1.1573	1.1442
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 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
基金份额累计净值增长率	26.90%	25.48%

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	-3.03%	0.48%	-3.69%	0.49%	0.66%	-0.01%
过去三个月	-1.72%	0.75%	-2.47%	0.75%	0.75%	0.00%

过去六个月	0.23%	0.93%	0.04%	0.93%	0.19%	0.00%
过去一年	-9.32%	0.86%	-9.85%	0.86%	0.53%	0.00%
过去三年	-31.53%	0.98%	-32.06%	0.99%	0.53%	-0.01%
自基金合同生效起至今	26.90%	1.11%	17.95%	1.12%	8.95%	-0.01%

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	-3.05%	0.48%	-3.69%	0.49%	0.64%	-0.01%
过去三个月	-1.77%	0.75%	-2.47%	0.75%	0.70%	0.00%
过去六个月	0.13%	0.93%	0.04%	0.93%	0.09%	0.00%
过去一年	-9.50%	0.86%	-9.85%	0.86%	0.35%	0.00%
过去三年	-31.94%	0.98%	-32.06%	0.99%	0.12%	-0.01%
自基金合同生效起至今	25.48%	1.11%	17.95%	1.12%	7.53%	-0.01%

### 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



前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C



## § 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投资合伙企业(有限合伙)各持股 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 96 只开放式基金，资产管理规模超过 949 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁溥森	本基金的基金经理	2020 年 12 月 18 日	-	10 年	梁溥森先生，中山大学硕士。曾任职于招商基金基金核算部；

					2015 年 6 月加盟前海开源基金管理有限公司，历任交易员、研究员，现任公司基金经理。
--	--	--	--	--	--

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的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

## 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

经历了三年的持续回调后，上半年市场行情继续胶着，尤其是去年表现相当坚挺的小市值个股走势更是承压。自从一季度大量资金涌入以沪深 300 为代表的宽基 ETF 以后，市场流动性风险得到了较大程度的释放，大中市值个股已经站稳了阵脚，但信心的重整还需要得到基本面的支撑。展望

后市，美国经济的不确定性增加，将驱动美联储逐渐开启降息周期，这将有利于新兴市场的整体表现。同时，伴随着国内政策端的持续发力，经济有望逐步恢复，投资者信心也将持续修复，叠加处于历史较低位置的估值，我们对于后续行情仍然保持乐观。MSCI 中国 A 股指数上半年基本收平，本基金 A 类份额上涨 0.23%，C 类份额上涨 0.13%，表现均优于业绩比较基准。从估值来看，截止 2024 年 6 月 28 日，MSCI 中国 A 股指数 PE（TTM）仅为 12.12 倍，处于上市以来历史分位值约为 31.8%，其相对于十年期国债收益率的风险溢价高达 6.05%，相对吸引力比历史上 93.88% 的时期更高，股息率攀升至了 3.28%，处于历史分位值 100% 的极高水平。投资的机会和风险，不仅取决于我们挑选的投资标的，与我们买入的价格也是息息相关的，当前 MSCI 中国 A 股指数的投资性价比依然较高。

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，并通过参与转债套利、期现套利等方式获得超额收益。本基金将持续关注成份股的基本面变化情况，通过监控成份股负面信息及其影响，在不影响本基金投资运作的情况下及时对潜在“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 MSCI 中国 A 股指数 A 基金份额净值为 1.1573 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.23%，同期业绩比较基准收益率为 0.04%；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 1.1442 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.13%，同期业绩比较基准收益率为 0.04%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从上半年来看，经济在一季度先小幅回升，二季度再度走弱，上半年 GDP 同比增长 5%，地产低位运行和金融防空转要求下，第三产业增速回落较多，财富效应回落叠加地产后周期消费拖累，居民消费恢复仍然偏慢，经济整体压力仍存，出口则表现出了较强的韧性。4 月底举行的政治局会议对经济形势进行了积极评价，认为经济运行中的积极因素增多，社会预期改善，但也指出了有效需求不足、企业经营压力大、风险隐患等挑战，指出要靠前发力有效落实已经确定的宏观政策，实施好积极的财政政策和稳健的货币政策；要积极扩大国内需求；要创造更多消费场景；要深入推进以人为本的新型城镇化，持续释放消费和投资潜力。上半年政策温和发力，517 新一轮地产政策放松力度较大，但 3000 亿的收储力度偏克制。尽管疤痕效应之下，基本面的修复还是比较缓慢的，

但政策端的持续发力，尤其是二季度基本面走弱后，政策支持力度有望得到加强，经济基本面有望得到进一步修复。6月11日世界银行发布最新一期《全球经济展望》报告，预计中国2024年的增长率为4.8%，比1月份的预测高出0.3个百分点，主要是2024年年初的经济活动，尤其是出口，强于预期。资本市场政策方面，四月份发布的新“国九条”体现了高层对资本市场的高度重视，强调了进一步完善发行上市制度，严把发行上市准入关，进一步严格强制退市标准，畅通“出口关”；加大对分红优质公司的激励力度，多措并举推动提高股息率。多管齐下有望推动资本市场实现高质量发展。此外，尽管美联储开启降息的准确时点仍不确定，但降息周期开启是大势所趋，我国权益资产估值在全球横向对比中具有明显的估值优势，在全球资金再分配的过程中，中国资产性价比逐渐凸显。

#### 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，估值委员会成员包含投资、研究、会计和风控等岗位资深人员，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2023年12月11日至2024年03月05日连续55个工作日、从2024年03月13日至2024年06月28日连续72个工作日基金资产净值低于五千万元，本基金管理人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：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	907,934.96	3,747,072.08
结算备付金		106,821.13	262,790.42
存出保证金		129,317.89	132,869.92
交易性金融资产	6.4.7.2	31,826,912.80	44,007,866.84
其中：股票投资		30,205,060.20	42,397,539.72
基金投资		-	-
债券投资		1,621,852.60	1,610,327.12
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	-	-

应收清算款		-	47,684.91
应收股利		-	-
应收申购款		12,595.83	2,383.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		32,983,582.61	48,200,667.51
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		8,643.57	47,087.25
应付赎回款		24,732.43	2,544,148.38
应付管理人报酬		13,766.21	20,587.15
应付托管费		2,753.23	4,117.43
应付销售服务费		3,466.01	6,183.18
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	49,536.55	121,728.29
负债合计		102,898.00	2,743,851.68
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	28,616,526.78	39,669,476.38
未分配利润	6.4.7.8	4,264,157.83	5,787,339.45
净资产合计		32,880,684.61	45,456,815.83
负债和净资产总计		32,983,582.61	48,200,667.51

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，前海开源 MSCI 中国 A 股指数基金份额总额 28,616,526.78 份，其中，前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A 类基金份额净值 1.1573 元，基金份额总额 10,512,112.28 份；前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C 类基金份额净值 1.1442 元，基金份额总额 18,104,414.50 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：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		395,375.19	-938,998.69
1. 利息收入		3,388.39	4,321.15
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,388.39	4,321.15
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,385,662.81	811,854.42
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,755,096.38	246,359.43
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	15,596.82	12,015.47
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	2,153.63	-32.78
股利收益	6.4.7.16	351,683.12	553,512.30
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	2,773,189.88	-1,785,143.57
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	4,459.73	29,969.31
<b>减：二、营业总支出</b>		259,714.43	229,359.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	99,326.96	98,098.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,865.40	19,619.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	27,498.28	27,311.60
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		65.23	-
8. 其他费用	6.4.7.20	112,958.56	84,329.68
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		135,660.76	-1,168,358.18
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		135,660.76	-1,168,358.18
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		135,660.76	-1,168,358.18

### 6.3 净资产变动表

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：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	39,669,476.38	5,787,339.45	45,456,815.83
二、本期期初净资产	39,669,476.38	5,787,339.45	45,456,815.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-11,052,949.60	-1,523,181.62	-12,576,131.22
（一）、综合收益总额	-	135,660.76	135,660.76
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-11,052,949.60	-1,658,842.38	-12,711,791.98
其中：1. 基金申购款	9,738,716.91	1,641,754.89	11,380,471.80
2. 基金赎回款	-20,791,666.51	-3,300,597.27	-24,092,263.78
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	28,616,526.78	4,264,157.83	32,880,684.61
	上年度可比期间		
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
项目	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	20,106,316.32	5,852,025.60	25,958,341.92
二、本期期初净资产	20,106,316.32	5,852,025.60	25,958,341.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	21,066,481.46	5,157,422.37	26,223,903.83
（一）、综合收益总额	-	-1,168,358.18	-1,168,358.18
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	21,066,481.46	6,325,780.55	27,392,262.01
其中：1. 基金申购款	46,730,842.06	14,969,037.93	61,699,879.99
2. 基金赎回款	-25,664,360.60	-8,643,257.38	-34,307,617.98
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	41,172,797.78	11,009,447.97	52,182,245.75

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

王厚琼

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、《资产管理产品相关会计处理规定》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

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

无。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税

[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
活期存款	907,934.96

等于：本金	907,852.22
加：应计利息	82.74
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	907,934.96

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	32,990,353.39	-	30,205,060.20	-2,785,293.19	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,595,004.00	20,302.60	1,621,852.60	6,546.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,595,004.00	20,302.60	1,621,852.60	6,546.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	34,585,357.39	20,302.60	31,826,912.80	-2,778,747.19	

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,031,820.00	-	-	-
其中：股指期货投资	1,031,820.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	1,031,820.00	-	-	-
----	--------------	---	---	---

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2409	沪深 300 股指期货 2409 合约	1.00	1,027,080.00	-4,740.00
合计				-4,740.00
减：可抵销期货暂收款				-4,740.00
净额				0.00

#### 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 2024 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	9,754.99
其中：交易所市场	9,754.99
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	39,781.56
合计	49,536.55

#### 6.4.7.7 实收基金

前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
----	--

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,536,698.11	10,536,698.11
本期申购	253,314.66	253,314.66
本期赎回（以“-”号填列）	-277,900.49	-277,900.49
本期末	10,512,112.28	10,512,112.28

前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,132,778.27	29,132,778.27
本期申购	9,485,402.25	9,485,402.25
本期赎回（以“-”号填列）	-20,513,766.02	-20,513,766.02
本期末	18,104,414.50	18,104,414.50

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

前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A

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	8,663,419.95	-7,033,965.19	1,629,454.76
本期期初	8,663,419.95	-7,033,965.19	1,629,454.76
本期利润	-789,469.58	819,060.79	29,591.21
本期基金份额交易产生的变动数	-16,524.40	11,023.83	-5,500.57
其中：基金申购款	197,679.33	-157,210.41	40,468.92
基金赎回款	-214,203.73	168,234.24	-45,969.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,857,425.97	-6,203,880.57	1,653,545.40

前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,471,475.34	-19,313,590.65	4,157,884.69
本期期初	23,471,475.34	-19,313,590.65	4,157,884.69
本期利润	-1,848,059.54	1,954,129.09	106,069.55
本期基金份额交易产生的变动数	-8,396,712.75	6,743,370.94	-1,653,341.81
其中：基金申购款	7,379,037.14	-5,777,751.17	1,601,285.97
基金赎回款	-15,775,749.89	12,521,122.11	-3,254,627.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,226,703.05	-10,616,090.62	2,610,612.43

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	2,112.51
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	1,221.05
其他	54.83
合计	3,388.39

#### 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
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	20,896,177.48
减：卖出股票成本总额	23,616,906.41
减：交易费用	34,367.45
买卖股票差价收入	-2,755,096.38

#### 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
	2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益—利息收入	13,861.18
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,735.64
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	15,596.82

##### 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
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	351,011.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	342,610.04
减：应计利息总额	6,663.57
减：交易费用	1.75

买卖债券差价收入	1,735.64
----------	----------

#### 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。

#### 6.4.7.14 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。

#### 6.4.7.15 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

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	2,153.63

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	351,683.12
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	351,683.12

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,757,709.88
-- 股票投资	2,753,943.88
-- 债券投资	3,766.00
-- 资产支持证券投资	-
-- 基金投资	-
-- 贵金属投资	-
-- 其他	-
2. 衍生工具	15,480.00
-- 权证投资	-
-- 期货投资	15,480.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,773,189.88

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	4,452.89
转换费收入	6.84
合计	4,459.73

#### 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
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	14,918.54
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
汇划手续费	987.40
指数使用费	72,189.60
合计	112,958.56

#### 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”）	基金销售机构、基金管理人的股东

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 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日

当期发生的基金应支付的管理费	99,326.96	98,098.53
其中：应支付销售机构的客户维护费	41,677.31	38,313.68
应支付基金管理人的净管理费	57,649.65	59,784.85

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
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	19,865.40	19,619.68

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		
	2024 年 01 月 01 日至 2024 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
前海开源基金	-	101.28	101.28
招商银行	-	14,415.40	14,415.40
开源证券	-	152.90	152.90
合计	-	14,669.58	14,669.58
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 01 月 01 日至 2023 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
前海开源基金	-	831.98	831.98
招商银行	-	16,766.64	16,766.64
合计	-	17,598.62	17,598.62

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2018 年 11 月 27 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	1,440,299.58	1,440,299.58
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	1,440,299.58	1,440,299.58
报告期末持有的基金份额占基金总 份额比例	13.70%	13.56%

##### 6.4.10.5.2 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。

#### 6.4.10.6 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	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

	2024 年 01 月 01 日至 2024 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	907,934.96	2,112.51	2,739,281.84	3,447.23

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有 17,189 股托管人招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 571,574.55 元，估值总额为人民币 587,691.91 元，占基金资产净值的比例为 1.79% (于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有 23,589 股托管人招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 784,389.55 元，估值总额为人民币 656,245.98 元，占基金资产净值的比例为 1.44%)。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末 2024 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

无。

##### 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级风险管理架构体系。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，参见附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6。

##### 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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,320,299.59	1,306,802.74
合计	1,320,299.59	1,306,802.74

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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	301,553.01	303,524.38
合计	301,553.01	303,524.38

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。

#### 6.4.13.2.5 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随时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。

本报告期末，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(净资产)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。

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年06月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	907,934.96	-	-	-	907,934.96
结算备付金	106,821.13	-	-	-	106,821.13
存出保证金	6,068.29	-	-	123,249.60	129,317.89
交易性金融资产	1,621,852.60	-	-	30,205,060.20	31,826,912.80
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	0.04	-	-	12,595.79	12,595.83
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,642,677.02	-	-	30,340,905.59	32,983,582.61
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	8,643.57	8,643.57

应付赎回款	-	-	-	24,732.43	24,732.43
应付管理人报酬	-	-	-	13,766.21	13,766.21
应付托管费	-	-	-	2,753.23	2,753.23
应付销售服务费	-	-	-	3,466.01	3,466.01
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	-	-	-	49,536.55	49,536.55
负债总计	-	-	-	102,898.00	102,898.00
利率敏感度缺口	2,642,677.02	-	-	30,238,007.59	32,880,684.61
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,747,072.08	-	-	-	3,747,072.08
结算备付金	262,790.42	-	-	-	262,790.42
存出保证金	8,461.12	-	-	124,408.80	132,869.92
交易性金融资产	1,610,327.12	-	-	42,397,539.72	44,007,866.84
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	47,684.91	47,684.91
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	0.04	-	-	2,383.30	2,383.34
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,628,650.78	-	-	42,572,016.73	48,200,667.51
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	47,087.25	47,087.25
应付赎回款	-	-	-	2,544,148.38	2,544,148.38
应付管理人报酬	-	-	-	20,587.15	20,587.15
应付托管费	-	-	-	4,117.43	4,117.43
应付销售服务费	-	-	-	6,183.18	6,183.18
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	-	-	-	121,728.29	121,728.29
负债总计	-	-	-	2,743,851.68	2,743,851.68
利率敏感度缺口	5,628,650.78	-	-	39,828,165.05	45,456,815.83

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（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	964.06	2,188.55
市场利率上升 25 个基点	-960.54	-2,182.60	

#### 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
----	-----	------

	2024 年 06 月 30 日		2023 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	30,205,060.20	91.86	42,397,539.72	93.27
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	30,205,060.20	91.86	42,397,539.72	93.27

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

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 06 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	1,403,587.32	2,159,616.14
	业绩比较基准下降 5%	-1,403,587.32	-2,159,616.14

#### 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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	30,205,060.20	42,397,539.72
第二层次	1,621,852.60	1,610,327.12

第三层次	-	-
合计	31,826,912.80	44,007,866.84

#### 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 2024 年 06 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(2023 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	30,205,060.20	91.58
	其中：股票	30,205,060.20	91.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,621,852.60	4.92
	其中：债券	1,621,852.60	4.92
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,014,756.09	3.08
8	其他各项资产	141,913.72	0.43

9	合计	32,983,582.61	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	328,861.00	1.00
B	采矿业	1,967,726.30	5.98
C	制造业	16,214,039.19	49.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,580,863.00	4.81
E	建筑业	635,164.80	1.93
F	批发和零售业	198,961.42	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	1,270,296.70	3.86
H	住宿和餐饮业	18,384.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,086,891.54	3.31
J	金融业	6,020,074.41	18.31
K	房地产业	289,046.40	0.88
L	租赁和商务服务业	229,767.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	119,958.80	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	28,812.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	91,392.64	0.28
R	文化、体育和娱乐业	104,405.00	0.32
S	综合	20,416.00	0.06
	合计	30,205,060.20	91.86

### 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所有股票投资明细

### 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	1,100	1,614,129.00	4.91

2	300750	宁德时代	3,740	673,312.20	2.05
3	600900	长江电力	20,700	598,644.00	1.82
4	600036	招商银行	17,189	587,691.91	1.79
5	000858	五粮液	3,300	422,532.00	1.29
6	002594	比亚迪	1,500	375,375.00	1.14
7	601318	中国平安	9,000	372,240.00	1.13
8	601288	农业银行	71,100	309,996.00	0.94
9	601166	兴业银行	17,374	306,129.88	0.93
10	601138	工业富联	11,100	304,140.00	0.92
11	601899	紫金矿业	17,200	302,204.00	0.92
12	601398	工商银行	52,600	299,820.00	0.91
13	300760	迈瑞医疗	1,000	290,910.00	0.88
14	601328	交通银行	32,800	245,016.00	0.75
15	601088	中国神华	5,500	244,035.00	0.74
16	002475	立讯精密	5,985	235,270.35	0.72
17	601816	京沪高铁	41,000	220,170.00	0.67
18	600809	山西汾酒	1,020	215,097.60	0.65
19	600309	万华化学	2,600	210,236.00	0.64
20	601225	陕西煤业	8,100	208,737.00	0.63
21	600276	恒瑞医药	5,339	205,337.94	0.62
22	600000	浦发银行	24,500	201,635.00	0.61
23	002714	牧原股份	4,510	196,636.00	0.60
24	000333	美的集团	2,900	187,050.00	0.57
25	601668	中国建筑	35,000	185,850.00	0.57
26	601857	中国石油	18,000	185,760.00	0.56
27	600030	中信证券	10,150	185,034.50	0.56
28	000568	泸州老窖	1,200	172,188.00	0.52
29	601985	中国核电	15,800	168,428.00	0.51
30	600406	国电南瑞	6,700	167,232.00	0.51
31	600028	中国石化	26,400	166,848.00	0.51
32	601919	中远海控	10,670	165,278.30	0.50
33	000001	平安银行	16,200	164,430.00	0.50
34	601601	中国太保	5,700	158,802.00	0.48
35	601766	中国中车	20,300	152,453.00	0.46
36	600150	中国船舶	3,700	150,627.00	0.46
37	600690	海尔智家	5,300	150,414.00	0.46
38	688041	海光信息	2,100	147,672.00	0.45
39	002352	顺丰控股	4,100	146,329.00	0.45
40	300059	东方财富	13,236	139,772.16	0.43
41	600887	伊利股份	5,301	136,977.84	0.42
42	601988	中国银行	29,300	135,366.00	0.41

43	300308	中际旭创	980	135,122.40	0.41
44	603288	海天味业	3,863	133,157.61	0.40
45	002371	北方华创	400	127,956.00	0.39
46	000725	京东方 A	30,900	126,381.00	0.38
47	603993	洛阳钼业	14,800	125,800.00	0.38
48	600050	中国联通	26,600	125,020.00	0.38
49	601658	邮储银行	24,300	123,201.00	0.37
50	600019	宝钢股份	18,500	123,025.00	0.37
51	601818	光大银行	38,800	122,996.00	0.37
52	002142	宁波银行	5,513	121,616.78	0.37
53	601127	赛力斯	1,300	118,456.00	0.36
54	600031	三一重工	7,100	117,150.00	0.36
55	600919	江苏银行	15,330	113,901.90	0.35
56	600886	国投电力	6,200	113,088.00	0.34
57	300274	阳光电源	1,820	112,894.60	0.34
58	600016	民生银行	29,594	112,161.26	0.34
59	601390	中国中铁	17,200	112,144.00	0.34
60	300498	温氏股份	5,600	110,992.00	0.34
61	601006	大秦铁路	14,800	105,968.00	0.32
62	600989	宝丰能源	6,100	105,713.00	0.32
63	002304	洋河股份	1,302	105,123.48	0.32
64	600905	三峡能源	23,900	104,204.00	0.32
65	600436	片仔癀	500	103,585.00	0.32
66	601169	北京银行	17,700	103,368.00	0.31
67	601888	中国中免	1,600	99,984.00	0.30
68	603501	韦尔股份	970	96,388.90	0.29
69	000063	中兴通讯	3,400	95,098.00	0.29
70	000338	潍柴动力	5,700	92,568.00	0.28
71	000625	长安汽车	6,858	92,102.94	0.28
72	688111	金山办公	400	91,000.00	0.28
73	000651	格力电器	2,300	90,206.00	0.27
74	601009	南京银行	8,600	89,354.00	0.27
75	600795	国电电力	14,900	89,251.00	0.27
76	600104	上汽集团	6,400	88,704.00	0.27
77	601012	隆基绿能	6,293	88,227.86	0.27
78	600048	保利发展	10,000	87,600.00	0.27
79	601229	上海银行	11,940	86,684.40	0.26
80	688036	传音控股	1,120	85,724.80	0.26
81	600999	招商证券	6,160	85,685.60	0.26
82	601211	国泰君安	6,300	85,365.00	0.26
83	688012	中微公司	600	84,756.00	0.26

84	601600	中国铝业	11,000	83,930.00	0.26
85	603259	药明康德	2,120	83,082.80	0.25
86	600346	恒力石化	5,900	82,305.00	0.25
87	600547	山东黄金	3,000	82,140.00	0.25
88	002493	荣盛石化	8,450	81,627.00	0.25
89	002230	科大讯飞	1,900	81,605.00	0.25
90	600660	福耀玻璃	1,700	81,430.00	0.25
91	000166	申万宏源	18,800	81,028.00	0.25
92	300015	爱尔眼科	7,802	80,516.64	0.24
93	601669	中国电建	14,400	80,496.00	0.24
94	600893	航发动力	2,200	80,410.00	0.24
95	002938	鹏鼎控股	2,000	79,520.00	0.24
96	688256	寒武纪	400	79,468.00	0.24
97	000792	盐湖股份	4,500	78,525.00	0.24
98	688169	石头科技	200	78,520.00	0.24
99	600585	海螺水泥	3,300	77,847.00	0.24
100	000538	云南白药	1,520	77,748.00	0.24
101	688271	联影医疗	700	76,790.00	0.23
102	300433	蓝思科技	4,200	76,650.00	0.23
103	601688	华泰证券	6,100	75,579.00	0.23
104	600011	华能国际	7,700	74,074.00	0.23
105	002027	分众传媒	12,100	73,326.00	0.22
106	600188	兖矿能源	3,200	72,736.00	0.22
107	600438	通威股份	3,800	72,618.00	0.22
108	601111	中国国航	9,700	71,586.00	0.22
109	601628	中国人寿	2,300	71,415.00	0.22
110	600674	川投能源	3,800	71,250.00	0.22
111	600015	华夏银行	11,100	71,040.00	0.22
112	000425	徐工机械	9,900	70,785.00	0.22
113	600837	海通证券	8,100	69,336.00	0.21
114	601066	中信建投	3,600	69,264.00	0.21
115	300014	亿纬锂能	1,731	69,101.52	0.21
116	000895	双汇发展	2,900	68,933.00	0.21
117	000100	TCL 科技	15,670	67,694.40	0.21
118	001979	招商蛇口	7,580	66,628.20	0.20
119	601881	中国银河	6,100	66,246.00	0.20
120	600023	浙能电力	9,300	66,123.00	0.20
121	002311	海大集团	1,400	65,870.00	0.20
122	600926	杭州银行	5,000	65,250.00	0.20
123	605499	东鹏饮料	300	64,725.00	0.20
124	300502	新易盛	600	63,330.00	0.19

125	000596	古井贡酒	300	63,321.00	0.19
126	003816	中国广核	13,100	60,653.00	0.18
127	603986	兆易创新	624	59,666.88	0.18
128	000776	广发证券	4,900	59,633.00	0.18
129	601995	中金公司	2,000	59,220.00	0.18
130	600489	中金黄金	4,000	59,200.00	0.18
130	601939	建设银行	8,000	59,200.00	0.18
132	600845	宝信软件	1,838	58,687.34	0.18
133	603392	万泰生物	883	58,172.04	0.18
134	600089	特变电工	4,190	58,115.30	0.18
135	601872	招商轮船	6,800	57,460.00	0.17
136	601868	中国能建	27,100	57,452.00	0.17
137	600115	中国东航	14,300	57,343.00	0.17
138	002463	沪电股份	1,570	57,305.00	0.17
139	688008	澜起科技	1,000	57,160.00	0.17
140	002241	歌尔股份	2,900	56,579.00	0.17
141	000002	万科 A	8,100	56,133.00	0.17
142	300122	智飞生物	2,000	56,060.00	0.17
143	600160	巨化股份	2,300	55,499.00	0.17
144	600029	南方航空	9,400	55,366.00	0.17
145	601825	沪农商行	8,100	54,432.00	0.17
146	300124	汇川技术	1,050	53,865.00	0.16
147	601689	拓普集团	1,000	53,610.00	0.16
148	601901	方正证券	6,900	53,337.00	0.16
149	601633	长城汽车	2,100	53,130.00	0.16
150	600010	包钢股份	37,900	53,060.00	0.16
151	000938	紫光股份	2,364	52,835.40	0.16
152	300033	同花顺	500	51,850.00	0.16
153	600111	北方稀土	3,000	51,600.00	0.16
154	002648	卫星化学	2,841	51,081.18	0.16
155	601336	新华保险	1,700	51,051.00	0.16
156	601100	恒立液压	1,088	50,679.04	0.15
157	002001	新和成	2,600	49,920.00	0.15
158	688223	晶科能源	7,000	49,700.00	0.15
159	601916	浙商银行	17,960	49,569.60	0.15
160	600027	华电国际	7,100	49,274.00	0.15
161	600703	三安光电	4,200	49,224.00	0.15
162	601838	成都银行	3,200	48,608.00	0.15
163	600039	四川路桥	6,120	48,286.80	0.15
164	601788	光大证券	3,300	48,246.00	0.15
165	600426	华鲁恒升	1,810	48,218.40	0.15

166	300896	爱美客	280	48,188.00	0.15
167	000983	山西焦煤	4,650	47,941.50	0.15
168	600584	长电科技	1,500	47,565.00	0.14
169	600958	东方证券	6,232	47,363.20	0.14
170	300832	新产业	700	47,208.00	0.14
171	002736	国信证券	5,400	46,926.00	0.14
172	300408	三环集团	1,600	46,704.00	0.14
173	600066	宇通客车	1,800	46,440.00	0.14
174	603369	今世缘	1,000	46,200.00	0.14
175	601618	中国中冶	14,900	46,190.00	0.14
176	601360	三六零	6,000	46,080.00	0.14
177	600803	新奥股份	2,200	45,760.00	0.14
178	600233	圆通速递	2,900	45,385.00	0.14
179	601699	潞安环能	2,500	45,325.00	0.14
180	000157	中联重科	5,900	45,312.00	0.14
181	600026	中远海能	2,900	45,269.00	0.14
182	001965	招商公路	3,800	45,068.00	0.14
183	601021	春秋航空	800	45,064.00	0.14
184	603195	公牛集团	580	44,729.60	0.14
185	002916	深南电路	420	44,423.40	0.14
186	600522	中天科技	2,800	44,380.00	0.13
187	000999	华润三九	1,040	44,283.20	0.13
188	601607	上海医药	2,300	43,953.00	0.13
189	000977	浪潮信息	1,208	43,934.96	0.13
190	000301	东方盛虹	5,500	43,835.00	0.13
191	002252	上海莱士	5,600	43,792.00	0.13
192	600600	青岛啤酒	600	43,662.00	0.13
193	002920	德赛西威	500	43,545.00	0.13
194	002236	大华股份	2,800	43,288.00	0.13
195	600741	华域汽车	2,600	42,588.00	0.13
196	600875	东方电气	2,300	42,435.00	0.13
197	600183	生益科技	2,000	42,120.00	0.13
198	600085	同仁堂	1,100	42,031.00	0.13
199	601117	中国化学	5,100	42,024.00	0.13
200	601567	三星医疗	1,200	42,000.00	0.13
201	300628	亿联网络	1,140	41,917.80	0.13
202	000786	北新建材	1,400	41,524.00	0.13
203	002600	领益智造	5,800	41,296.00	0.13
204	688396	华润微	1,100	41,184.00	0.13
205	000963	华东医药	1,480	41,158.80	0.13
206	600161	天坛生物	1,680	40,992.00	0.12

207	601319	中国人保	7,900	40,685.00	0.12
208	600362	江西铜业	1,700	40,256.00	0.12
209	002028	思源电气	600	40,140.00	0.12
210	002128	电投能源	1,900	40,090.00	0.12
211	600196	复星医药	1,800	39,852.00	0.12
212	002422	科伦药业	1,300	39,429.00	0.12
213	601727	上海电气	10,600	39,220.00	0.12
214	000807	云铝股份	2,900	39,179.00	0.12
215	000617	中油资本	7,000	38,640.00	0.12
216	000933	神火股份	1,900	38,437.00	0.12
217	300999	金龙鱼	1,400	38,290.00	0.12
218	000630	铜陵有色	10,600	38,266.00	0.12
219	000708	中信特钢	2,800	37,996.00	0.12
220	688120	华海清科	200	37,916.00	0.12
221	002460	赣锋锂业	1,320	37,818.00	0.12
222	000975	银泰黄金	2,320	37,792.80	0.11
223	600219	南山铝业	9,800	37,338.00	0.11
224	600733	北汽蓝谷	4,600	37,168.00	0.11
225	601077	渝农商行	7,400	37,148.00	0.11
226	002601	龙佰集团	2,000	37,140.00	0.11
227	300394	天孚通信	420	37,136.40	0.11
228	600256	广汇能源	5,500	36,850.00	0.11
229	600221	海航控股	36,100	36,822.00	0.11
230	600176	中国巨石	3,314	36,619.70	0.11
231	601377	兴业证券	7,200	36,432.00	0.11
232	601058	赛轮轮胎	2,600	36,400.00	0.11
233	600642	申能股份	4,100	36,203.00	0.11
234	688009	中国通号	6,000	36,000.00	0.11
235	601168	西部矿业	2,000	35,900.00	0.11
236	002466	天齐锂业	1,200	35,892.00	0.11
237	002049	紫光国微	680	35,768.00	0.11
238	688072	拓荆科技	296	35,552.56	0.11
239	605117	德业股份	476	35,385.84	0.11
240	600332	白云山	1,201	35,225.33	0.11
241	600985	淮北矿业	2,100	35,154.00	0.11
242	000876	新希望	3,800	34,732.00	0.11
243	601179	中国西电	4,300	34,572.00	0.11
244	688187	时代电气	700	34,566.00	0.11
245	603198	迎驾贡酒	600	34,500.00	0.10
246	600398	海澜之家	3,718	34,354.32	0.10
247	601877	正泰电器	1,800	34,308.00	0.10

248	601878	浙商证券	3,200	34,304.00	0.10
249	300413	芒果超媒	1,640	34,276.00	0.10
250	600415	小商品城	4,600	34,132.00	0.10
251	600018	上港集团	5,800	33,524.00	0.10
252	300782	卓胜微	428	33,272.72	0.10
253	600487	亨通光电	2,100	33,117.00	0.10
254	600918	中泰证券	5,800	32,886.00	0.10
255	603260	合盛硅业	700	32,697.00	0.10
256	600009	上海机场	1,000	32,250.00	0.10
257	300418	昆仑万维	1,000	32,240.00	0.10
258	002078	太阳纸业	2,300	32,085.00	0.10
259	601233	桐昆股份	2,000	31,920.00	0.10
260	603806	福斯特	2,171	31,913.70	0.10
261	002459	晶澳科技	2,844	31,852.80	0.10
262	688126	沪硅产业	2,300	31,763.00	0.10
263	601238	广汽集团	4,100	31,734.00	0.10
264	002180	纳思达	1,200	31,704.00	0.10
265	002532	天山铝业	3,900	31,629.00	0.10
266	300661	圣邦股份	382	31,621.96	0.10
267	300316	晶盛机电	1,100	31,603.00	0.10
268	002353	杰瑞股份	900	31,572.00	0.10
269	000423	东阿阿胶	500	31,300.00	0.10
270	000408	藏格矿业	1,300	31,291.00	0.10
271	002625	光启技术	1,800	31,230.00	0.09
272	300765	新诺威	1,220	30,780.60	0.09
273	603799	华友钴业	1,390	30,760.70	0.09
274	688303	大全能源	1,500	30,585.00	0.09
275	002050	三花智控	1,600	30,528.00	0.09
276	688599	天合光能	1,800	30,456.00	0.09
277	002223	鱼跃医疗	800	30,080.00	0.09
278	600061	国投资本	5,300	29,945.00	0.09
279	301236	软通动力	850	29,928.50	0.09
280	600515	海南机场	9,500	29,830.00	0.09
281	002129	TCL 中环	3,425	29,626.25	0.09
282	000027	深圳能源	4,040	29,492.00	0.09
283	002064	华峰化学	4,100	29,397.00	0.09
284	600348	华阳股份	2,950	29,382.00	0.09
285	603606	东方电缆	600	29,286.00	0.09
286	600096	云天化	1,500	29,130.00	0.09
287	002156	通富微电	1,300	29,107.00	0.09
288	688777	中控技术	770	29,029.00	0.09

289	002384	东山精密	1,400	28,980.00	0.09
290	603568	伟明环保	1,400	28,812.00	0.09
291	002709	天赐材料	1,640	28,798.40	0.09
292	300442	润泽科技	1,200	28,740.00	0.09
293	002074	国轩高科	1,500	28,725.00	0.09
294	600418	江淮汽车	1,800	28,512.00	0.09
295	600745	闻泰科技	1,000	28,250.00	0.09
296	600570	恒生电子	1,595	28,167.70	0.09
297	600588	用友网络	2,813	28,130.00	0.09
298	601958	金钼股份	2,700	28,107.00	0.09
299	300866	安克创新	390	27,771.90	0.08
300	600895	张江高科	1,500	27,720.00	0.08
301	000661	长春高新	300	27,531.00	0.08
302	603160	汇顶科技	400	27,500.00	0.08
303	002340	格林美	4,300	27,391.00	0.08
304	600060	海信视像	1,100	27,214.00	0.08
305	600177	雅戈尔	3,800	27,056.00	0.08
306	601577	长沙银行	3,300	26,994.00	0.08
307	002595	豪迈科技	700	26,719.00	0.08
308	600021	上海电力	2,700	26,703.00	0.08
309	600970	中材国际	2,200	26,532.00	0.08
310	002281	光迅科技	700	26,159.00	0.08
311	601865	福莱特	1,300	26,130.00	0.08
312	601108	财通证券	3,940	26,043.40	0.08
313	300919	中伟股份	840	26,031.60	0.08
314	600282	南钢股份	5,200	25,896.00	0.08
315	601991	大唐发电	8,600	25,886.00	0.08
316	601216	君正集团	7,000	25,830.00	0.08
317	300751	迈为股份	216	25,807.68	0.08
318	000921	海信家电	800	25,792.00	0.08
319	000932	华菱钢铁	5,800	25,694.00	0.08
320	603659	璞泰来	1,807	25,532.91	0.08
321	603338	浙江鼎力	420	25,376.40	0.08
322	600566	济川药业	800	25,368.00	0.08
323	688082	盛美上海	300	25,353.00	0.08
324	000831	中国稀土	1,000	25,350.00	0.08
325	002812	恩捷股份	800	25,320.00	0.08
326	002185	华天科技	3,100	25,265.00	0.08
326	603979	金诚信	500	25,265.00	0.08
328	002409	雅克科技	400	25,164.00	0.08
329	600873	梅花生物	2,500	25,050.00	0.08

330	603899	晨光股份	800	25,024.00	0.08
331	000683	远兴能源	3,600	24,876.00	0.08
332	002465	海格通信	2,400	24,864.00	0.08
333	600546	山煤国际	1,700	24,854.00	0.08
334	002555	三七互娱	1,900	24,795.00	0.08
335	601866	中远海发	9,600	24,768.00	0.08
336	002444	巨星科技	1,000	24,700.00	0.08
337	601198	东兴证券	3,100	24,676.00	0.08
338	601555	东吴证券	4,161	24,549.90	0.07
339	600460	士兰微	1,400	24,514.00	0.07
340	600132	重庆啤酒	400	24,280.00	0.07
341	600521	华海药业	1,420	24,211.00	0.07
342	600582	天地科技	3,500	24,115.00	0.07
343	601231	环旭电子	1,500	24,075.00	0.07
344	600079	人福医药	1,400	24,038.00	0.07
345	002007	华兰生物	1,520	24,000.80	0.07
346	002294	信立泰	900	23,967.00	0.07
347	000988	华工科技	800	23,944.00	0.07
348	601990	南京证券	3,100	23,808.00	0.07
349	300003	乐普医疗	1,600	23,744.00	0.07
350	688099	晶晨股份	400	23,728.00	0.07
351	000066	中国长城	2,700	23,625.00	0.07
352	603486	科沃斯	500	23,590.00	0.07
353	601666	平煤股份	2,100	23,520.00	0.07
354	000800	一汽解放	3,000	23,490.00	0.07
355	600968	海油发展	5,700	23,484.00	0.07
356	600109	国金证券	3,100	23,405.00	0.07
357	603156	养元饮品	1,100	23,397.00	0.07
358	600352	浙江龙盛	2,700	23,193.00	0.07
359	002372	伟星新材	1,500	23,130.00	0.07
360	301269	华大九天	300	23,115.00	0.07
361	603658	安图生物	500	23,035.00	0.07
362	603939	益丰药房	938	23,027.90	0.07
363	601928	凤凰传媒	2,100	23,016.00	0.07
364	600369	西南证券	6,400	22,912.00	0.07
365	002673	西部证券	3,700	22,903.00	0.07
366	600988	赤峰黄金	1,400	22,876.00	0.07
367	002939	长城证券	3,400	22,780.00	0.07
368	300207	欣旺达	1,500	22,755.00	0.07
369	688065	凯赛生物	500	22,695.00	0.07
370	688363	华熙生物	400	22,628.00	0.07

371	601966	玲珑轮胎	1,229	22,576.73	0.07
372	002085	万丰奥威	1,700	22,508.00	0.07
373	002966	苏州银行	3,000	22,500.00	0.07
374	603833	欧派家居	420	22,495.20	0.07
375	600497	驰宏锌锗	4,200	22,428.00	0.07
376	601799	星宇股份	200	22,408.00	0.07
377	002821	凯莱英	340	22,372.00	0.07
378	600298	安琪酵母	800	22,344.00	0.07
379	600153	建发股份	2,500	22,325.00	0.07
380	300759	康龙化成	1,200	22,296.00	0.07
381	000783	长江证券	4,600	22,218.00	0.07
382	300223	北京君正	400	22,176.00	0.07
382	688538	和辉光电	11,200	22,176.00	0.07
384	601456	国联证券	2,300	22,172.00	0.07
385	600536	中国软件	740	22,140.80	0.07
386	000738	航发控制	1,100	22,077.00	0.07
387	002603	以岭药业	1,440	22,075.20	0.07
388	002202	金风科技	3,275	22,008.00	0.07
389	002152	广电运通	2,100	21,966.00	0.07
390	600583	海油工程	3,700	21,867.00	0.07
391	603529	爱玛科技	800	21,864.00	0.07
392	600157	永泰能源	18,500	21,830.00	0.07
393	600004	白云机场	2,300	21,804.00	0.07
394	603596	伯特利	560	21,784.00	0.07
395	002739	万达电影	1,800	21,762.00	0.07
396	002120	韵达股份	2,810	21,749.40	0.07
397	000960	锡业股份	1,400	21,686.00	0.07
398	000728	国元证券	3,570	21,634.20	0.07
399	000703	恒逸石化	3,040	21,553.60	0.07
400	002414	高德红外	3,625	21,351.25	0.06
401	002602	世纪华通	6,220	21,334.60	0.06
402	603816	顾家家居	660	21,311.40	0.06
403	600598	北大荒	1,700	21,233.00	0.06
404	600848	上海临港	2,320	21,135.20	0.06
405	002456	欧菲光	2,700	21,087.00	0.06
406	601696	中银证券	2,300	20,884.00	0.06
407	002797	第一创业	4,100	20,869.00	0.06
408	000733	振华科技	500	20,765.00	0.06
409	600998	九州通	4,254	20,759.52	0.06
410	600549	厦门钨业	1,200	20,700.00	0.06
411	002841	视源股份	700	20,671.00	0.06

412	688188	柏楚电子	112	20,669.60	0.06
413	002080	中材科技	1,600	20,640.00	0.06
414	600038	中直股份	500	20,555.00	0.06
415	002831	裕同科技	800	20,472.00	0.06
416	600673	东阳光	2,900	20,416.00	0.06
417	000729	燕京啤酒	2,300	20,309.00	0.06
418	600072	中船科技	1,500	20,280.00	0.06
419	000987	越秀资本	4,082	20,246.72	0.06
420	600839	四川长虹	4,500	20,205.00	0.06
421	300251	光线传媒	2,400	20,184.00	0.06
422	000513	丽珠集团	540	20,093.40	0.06
423	300144	宋城演艺	2,500	20,075.00	0.06
424	600637	东方明珠	3,300	20,064.00	0.06
425	002517	恺英网络	2,100	20,055.00	0.06
426	002032	苏泊尔	400	20,040.00	0.06
427	002056	横店东磁	1,600	19,952.00	0.06
428	002508	老板电器	900	19,890.00	0.06
429	603885	吉祥航空	1,800	19,782.00	0.06
430	603589	口子窖	500	19,595.00	0.06
431	600655	豫园股份	3,800	19,570.00	0.06
432	000629	钒钛股份	7,800	19,500.00	0.06
433	000937	冀中能源	2,900	19,430.00	0.06
434	300037	新宙邦	680	19,420.80	0.06
435	600977	中国电影	1,800	19,368.00	0.06
436	300957	贝泰妮	400	19,328.00	0.06
437	601880	辽港股份	15,700	19,311.00	0.06
438	002262	恩华药业	800	18,992.00	0.06
439	300146	汤臣倍健	1,400	18,970.00	0.06
440	300487	蓝晓科技	450	18,792.00	0.06
441	600704	物产中大	4,300	18,662.00	0.06
442	600511	国药股份	600	18,474.00	0.06
443	600754	锦江酒店	800	18,384.00	0.06
444	600699	均胜电子	1,240	18,376.80	0.06
445	601162	天风证券	8,400	18,312.00	0.06
446	300496	中科创达	400	18,236.00	0.06
447	002738	中矿资源	680	18,224.00	0.06
448	000009	中国宝安	2,100	18,060.00	0.05
449	603000	人民网	900	17,991.00	0.05
450	600380	健康元	1,600	17,872.00	0.05
451	600884	杉杉股份	2,200	17,864.00	0.05
452	002430	杭氧股份	800	17,800.00	0.05

453	603893	瑞芯微	300	17,751.00	0.05
454	600166	福田汽车	7,800	17,550.00	0.05
455	600378	昊华科技	600	17,340.00	0.05
456	000723	美锦能源	3,600	17,136.00	0.05
457	600702	舍得酒业	300	17,001.00	0.05
458	688728	格科微	1,400	16,954.00	0.05
459	000709	河钢股份	8,600	16,684.00	0.05
460	688122	西部超导	430	16,477.60	0.05
461	300699	光威复材	660	16,387.80	0.05
462	600486	扬农化工	290	16,370.50	0.05
463	600732	爱旭股份	1,800	16,290.00	0.05
464	000825	太钢不锈	4,800	16,224.00	0.05
465	600705	中航产融	7,300	16,206.00	0.05
466	600170	上海建工	7,400	15,910.00	0.05
467	600872	中炬高新	700	15,883.00	0.05
468	002850	科达利	200	15,276.00	0.05
469	600563	法拉电子	200	15,236.00	0.05
470	300454	深信服	300	15,159.00	0.05
471	600779	水井坊	400	15,052.00	0.05
472	002756	永兴材料	420	15,027.60	0.05
473	603345	安井食品	200	14,862.00	0.05
474	300142	沃森生物	1,300	14,794.00	0.04
475	300347	泰格医药	300	14,580.00	0.04
476	300763	锦浪科技	350	14,574.00	0.04
477	300601	康泰生物	920	14,361.20	0.04
478	688114	华大智造	300	14,223.00	0.04
479	603077	和邦生物	8,600	14,190.00	0.04
480	603233	大参林	934	13,356.20	0.04
481	603688	石英股份	450	13,324.50	0.04
482	002271	东方雨虹	1,000	12,340.00	0.04
483	603728	鸣志电器	300	12,069.00	0.04
484	603290	斯达半导	140	12,055.40	0.04
485	603882	金域医学	400	10,876.00	0.03

### 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	668,870.00	1.47
2	000333	美的集团	285,664.00	0.63
3	300750	宁德时代	150,956.00	0.33
4	688041	海光信息	148,634.49	0.33
5	000858	五粮液	125,860.00	0.28
6	600900	长江电力	119,841.00	0.26
7	600809	山西汾酒	95,732.00	0.21
8	601318	中国平安	94,655.00	0.21
9	002594	比亚迪	76,866.00	0.17
10	601288	农业银行	75,579.00	0.17
11	601166	兴业银行	71,021.00	0.16
12	601398	工商银行	70,478.00	0.16
13	688256	寒武纪	70,105.72	0.15
14	601899	紫金矿业	63,831.00	0.14
15	601138	工业富联	62,958.00	0.14
16	688036	传音控股	60,318.00	0.13
17	300760	迈瑞医疗	59,386.00	0.13
18	601225	陕西煤业	57,660.00	0.13
19	688012	中微公司	57,357.00	0.13
20	600030	中信证券	57,132.00	0.13

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	1,173,198.00	2.58
2	300750	宁德时代	409,100.00	0.90
3	600900	长江电力	300,754.00	0.66
4	000858	五粮液	286,716.00	0.63
5	601318	中国平安	223,627.00	0.49
6	600036	招商银行	209,863.00	0.46
7	002594	比亚迪	205,622.00	0.45
8	600809	山西汾酒	190,593.00	0.42
9	601288	农业银行	188,736.00	0.42
10	601899	紫金矿业	176,150.00	0.39
11	601398	工商银行	174,305.00	0.38
12	601166	兴业银行	172,861.00	0.38
13	300760	迈瑞医疗	167,484.00	0.37

14	601138	工业富联	144,168.00	0.32
15	600276	恒瑞医药	140,727.00	0.31
16	000568	泸州老窖	138,753.00	0.31
17	601088	中国神华	134,041.00	0.29
18	601328	交通银行	133,005.00	0.29
19	601225	陕西煤业	131,850.00	0.29
20	600309	万华化学	130,880.00	0.29

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	8,670,483.01
卖出股票收入（成交）总额	20,896,177.48

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,621,852.60	4.93
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,621,852.60	4.93

#### 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	019709	23 国债 16	13,000	1,320,299.59	4.02
2	019706	23 国债 13	3,000	301,553.01	0.92

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

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的金融衍生品。本基金投资股指期货主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过股指期货多头进行现货替代及赚取超额收益，并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，降低大额申购赎回对基金的影响，达到有效跟踪标的指数的目的。我们将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。考虑到本基金跟踪的 MSCI 中国 A 股指数与 IF 合约跟踪的沪深 300 指数存在一定的偏离，我们会根据实际情况对成份股持仓进行调整，以达到更好的跟踪目标指数的目的。

总体而言，本基金进行股指期货投资风险可控，并且能够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，或者进行低风险的套利活动，符合本基金的投资政策与投资目标。后续我们密切关注期货市场表现情况及跟踪误差情况，决定是否继续投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期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、处罚说明

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)”、“农业银行(证券代码 601288)”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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	129,317.89
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,595.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	141,913.72

### 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

		额	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	746	14,091.30	1,803,539.60	17.16%	8,708,572.68	82.84%
前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C	983	18,417.51	3,511,025.44	19.39%	14,593,389.06	80.61%
合计	1,729	16,550.91	5,314,565.04	18.57%	23,301,961.74	81.43%

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（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	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A	247,905.30	2.3583%
	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C	113,191.87	0.6252%
	合计	361,097.17	1.2618%

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	10~50
	前海开源 MSCI 中 国 A 股指数 C	0
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	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	10,536,698.11	29,132,778.27
本报告期基金总申购份额	253,314.66	9,485,402.25
减：本报告期基金总赎回份额	277,900.49	20,513,766.02
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	10,512,112.28	18,104,414.50

## § 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：2024 年 4 月 23 日起，王厚琼先生任副总经理。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
德邦证券	2	29,526,726.33	100.00%	22,023.83	100.00%	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中国国际金融	2	-	-	-	-	-

注：依据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》和相关业务规则，本基金管理人制定了基金租用证券公司交易单元的选择标准和程序，其中，被动股票型基金租用证券公司交易单元的选择标准和程序如下：

## A：选择标准

1. 经营能力；2. 合规建设情况；3. 专业服务能力；4. 费率优势；5. 法律法规及规范性文件所规定证券交易单元租赁服务商的其他要求。

## B：选择程序

证券公司的选择由本基金管理人交易单元管理小组决定。管理小组根据选择标准来挑选财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易能力较强的证券公司参与证券交易，并根据证券公司提供服务的情况对各往来证券公司进行评估，评估结果作为交易单元租用选择和调整的参考依据。

## 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	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期权证成	成交金额	占当期基金成

		交总额的 比例		购成交 总额的 比例		交总额的 比例		交总额的 比例
德邦证 券	644,78 4.65	100.00%	-	-	-	-	-	-
第一创 业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
联储证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万和证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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 MSCI 中国 A 股指数型证券投资 基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2024年01月22日
2	关于旗下部分基金增加贵州省贵文文化 基金销售有限公司为销售机构并参加其 费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2024年03月05日
3	关于旗下部分基金增加西部证券股份有 限公司为销售机构并参加其费率优惠活 动的公告	中国证监会规定媒介	2024年03月06日
4	前海开源基金关于电子直销平台相关业 务费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2024年03月18日
5	前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投 资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024年03月30日
6	前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投	中国证监会规定媒介	2024年04月22日

	资基金 2024 年第 1 季度报告		
7	前海开源基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2024年04月24日
8	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	2024年05月15日
9	关于旗下部分基金增加上海证券有限责任公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2024年05月23日
10	前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金基金产品资料概要更新（20240626 更新）	中国证监会规定媒介	2024年06月26日

## § 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，客户服务热线：4001-666-998

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

前海开源基金管理有限公司

2024 年 08 月 30 日