

前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金
2024 年年度报告

2024 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	6
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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
3.3	过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4	管理人报告	10
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遵规守信情况的说明	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	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	15
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6	审计报告	15
6.1	审计报告基本信息	15
6.2	审计报告的基本内容	15
§ 7	年度财务报表	17
7.1	资产负债表	17
7.2	利润表	19
7.3	净资产变动表	20
7.4	报表附注	21
§ 8	投资组合报告	48
8.1	期末基金资产组合情况	48
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	51
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	62

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	62
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	62
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	62
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
8.12	投资组合报告附注	63
§ 9	基金份额持有人信息	64
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
9.3	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	64
§ 10	开放式基金份额变动	65
§ 11	重大事件揭示	65
11.1	基金份额持有人大会决议	65
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	65
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
11.4	基金投资策略的改变	65
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.8	其他重大事件	67
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	69
§ 13	备查文件目录	69
13.1	备查文件目录	69
13.2	存放地点	70
13.3	查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	前海开源量化优选	
基金主代码	002495	
基金运作方式	契约型普通开放式	
基金合同生效日	2017 年 07 月 03 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	44,570,158.14 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海开源量化优选 A	前海开源量化优选 C
下属分级基金的交易代码	002495	002496
报告期末下属分级基金的份额总额	24,078,754.66 份	20,491,403.48 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要根据数量化模型，精选个股，优化资产权重配置，构建投资组合；在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下六方面内容：</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过定性与定量相结合的策略精选沪深两市蓝筹个股，遵循数量化模型优化权重配置，构建投资组合。</p> <p>实证研究表明，低波动率股票在市场风险集聚或有放大趋势时，表现出更强的抗跌性能；在市场风险出清或趋势向上时，存在超越市场平均的涨幅。本产品以控风险为主轴，基于规避风险间接创造价值的理念，兼顾市场风险集聚与风险出清两种环境，旨在发掘低波动率股票的上述投资机会。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>在债券投资策略方面，本基金将在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，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。在宏观环境分析方面，结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定不同类属资产的最优权重。</p> <p>在微观市场定价分析方面，本基金以中长期利率趋势分析为基</p>

	<p>础，结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。具体投资策略有收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略，来构建债券投资组合。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>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。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 \times 70% + 中证全债指数收益率 \times 30%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。

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	张姗
	联系电话	400-61-95555
	电子邮箱	zhangshan_1027@cmbchina.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	上海证券报
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	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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、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	2024 年		2023 年		2022 年	
	前海开源量 化优选 A	前海开源量 化优选 C	前海开源量 化优选 A	前海开源量 化优选 C	前海开源量 化优选 A	前海开源量 化优选 C
本期已实现 收益	1,174,020. 54	1,096,642. 35	— 4,071,377. 84	— 2,355,369. 19	— 7,698,177. 53	— 8,578,003. 45
本期利润	1,013,921. 18	859,282.92	— 3,057,435. 82	— 1,880,030. 47	— 8,678,169. 39	— 9,642,202. 63
加权平均基 金份额本期 利润	0.0455	0.0405	-0.1301	-0.1375	-0.4157	-0.6038
本期加权平 均净值利润 率	3.88%	3.52%	-10.31%	-11.16%	-29.48%	-42.60%
本期基金份 额净值增长 率	4.22%	4.14%	-10.36%	-10.50%	-29.64%	-29.73%
3.1.2 期末 数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
	前海开源量 化优选 A	前海开源量 化优选 C	前海开源量 化优选 A	前海开源量 化优选 C	前海开源量 化优选 A	前海开源量 化优选 C
期末可供分 配利润	5,026,891. 54	3,708,072. 92	3,662,349. 27	1,893,536. 35	7,175,530. 98	4,184,651. 15

期末可供分配基金份额利润	0.2088	0.1810	0.1597	0.1343	0.2939	0.2666	
期末基金资产净值	29,105,646 .20	24,199,476 .40	26,600,255 .91	15,993,319 .36	31,593,815 .26	19,881,885 .90	
期末基金份额净值	1.209	1.181	1.160	1.134	1.294	1.267	
3.1.3 累计 期末指标		2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	前海开源量化优选 A	前海开源量化优选 C	前海开源量化优选 A	前海开源量化优选 C	前海开源量化优选 A	前海开源量化优选 C	
基金份额累计净值增长率	20.90%	18.10%	16.00%	13.40%	29.40%	26.70%	

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

前海开源量化优选 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
过去三个月	-5.91%	1.54%	-0.36%	1.21%	-5.55%	0.33%
过去六个月	4.13%	1.57%	11.19%	1.15%	-7.06%	0.42%
过去一年	4.22%	1.45%	13.43%	0.93%	-9.21%	0.52%
过去三年	-34.26%	1.23%	-9.28%	0.82%	-24.98%	0.41%
过去五年	-1.79%	1.27%	7.07%	0.86%	-8.86%	0.41%
自基金合同生效起至今	20.90%	1.21%	21.53%	0.85%	-0.63%	0.36%

前海开源量化优选 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
过去三个月	-5.97%	1.54%	-0.36%	1.21%	-5.61%	0.33%
过去六个月	4.05%	1.57%	11.19%	1.15%	-7.14%	0.42%
过去一年	4.14%	1.45%	13.43%	0.93%	-9.29%	0.52%

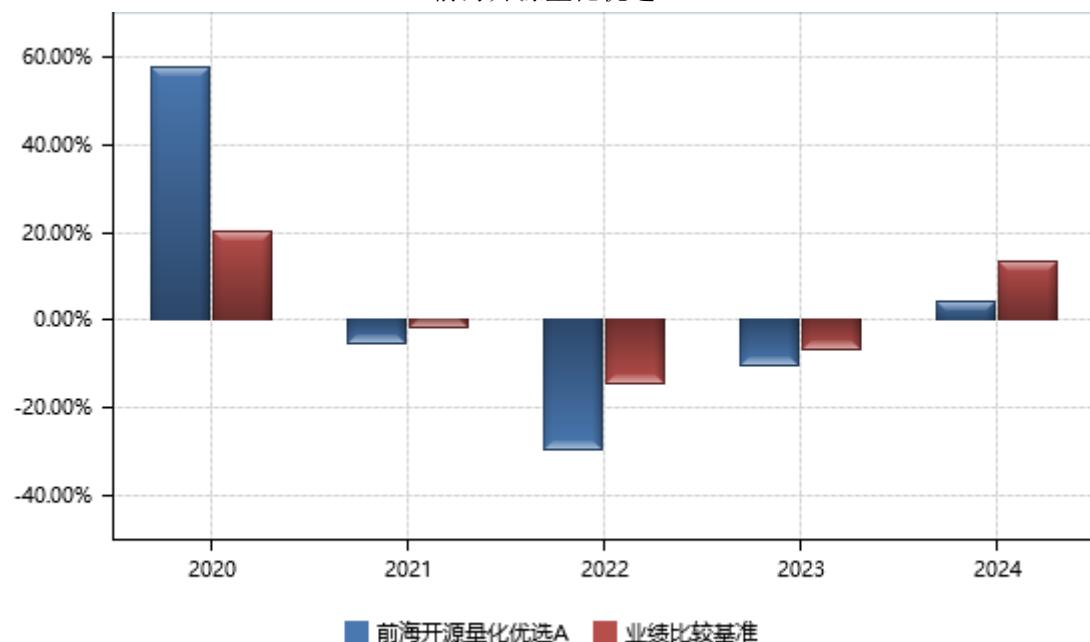
过去三年	-34.50%	1.23%	-9.28%	0.82%	-25.22%	0.41%
过去五年	-2.32%	1.27%	7.07%	0.86%	-9.39%	0.41%
自基金合同生效起至今	18.10%	1.21%	21.53%	0.85%	-3.43%	0.36%

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

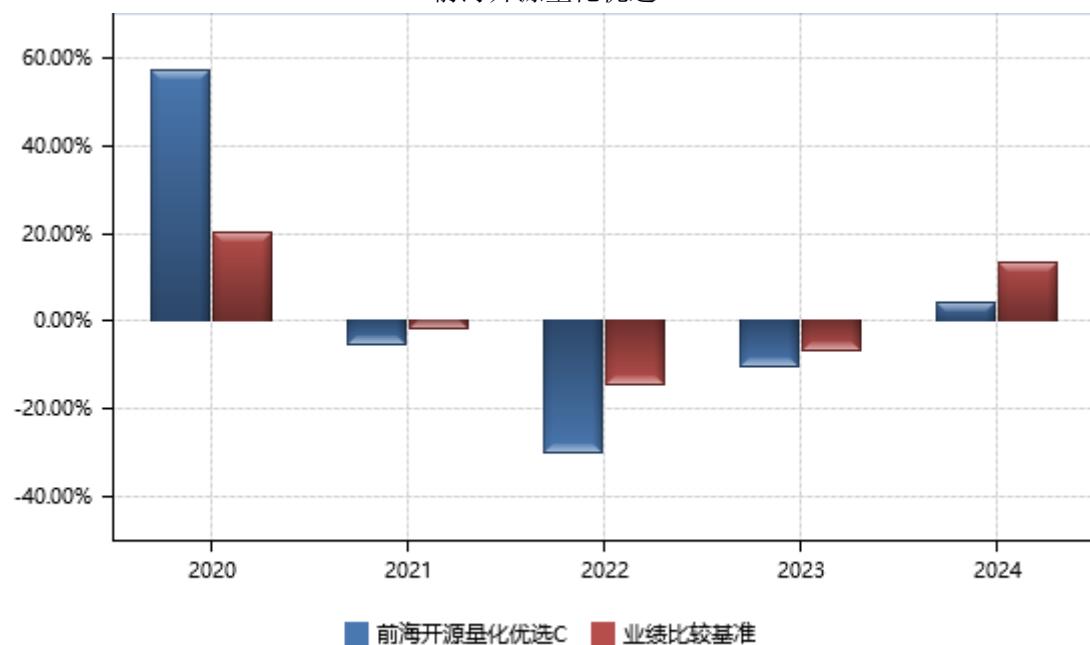


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海开源量化优选 A



前海开源量化优选 C



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投资合伙企业(有限合伙)各持股权 25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海、广州设立分公司。经中国证监会批准，前海开源基金全资控股子公司—前海开源资产管理有限公司已于 2013 年 9 月 5 日在深圳市注册成立，截至报告期末，注册资本为 1.8 亿元人民币。

截至报告期末，前海开源基金旗下管理 97 只开放式基金，资产管理规模超过 970 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		
陆琦	本基金的基金经理、公司金融工程部负责人	2021 年 02 月 23 日	-	13 年	陆琦先生，南京大学硕士。2011 年至 2015 年任南方基金管理股份有限公司风险管理部量化分析高级经理；2015 年 10 月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司金融工程部负责人、基金经理。
林巧亮	本基金的基金经理	2022 年 08 月 18 日	-	6 年	林巧亮先生，吉林大学硕士。2018 年 6 月至 2020 年 6 月任长城证券股份有限公司投资经理助理；2020 年 6 月加盟前海开源基金管理有限公司，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，本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超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 1 次。

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

回顾全年，2024年初小盘股受流动性衰竭影响经历极端下跌，期间红利类资产表现突出。2024年春节前后，市场信心开始修复，市场情绪亦有所转暖，AI、人形机器人、低空经济等主题性机会交相演绎。反弹过后，市场受内需预期偏悲观及政策预期不明朗影响，权益市场各板块跌多涨少。2024年九月底在美联储降息及国内货币、财政均具备政策空间的背景下，国内适时出台系列利好政策，市场风险偏好得到明显改善并随后开始走出分化。2024年四季度上半段市场较为亢奋，基本面因子、量价类因子均有所回撤，同期微盘策略创出新高。后续伴随市场降温并回归理性，各类因子超额收益均有明显修复。年末大小盘收益差大幅收敛。

本组合采用定量方式优选投资标的，并持续更新迭代模型以适应市场变化，组合收益率 4.22%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源量化优选 A 基金份额净值为 1.209 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.22%，同期业绩比较基准收益率为 13.43%；截至报告期末前海开源量化优选 C 基金份额净值为 1.181 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.14%，同期业绩比较基准收益率为 13.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，权益市场经历预期修复后，已逐步回归理性。宏观经济的修复有待进一步观察，但伴随科技的发展，新技术引领的生产效率的提升和新业态的出现或将促进资本市场涌现出系列投资机会。总体而言权益市场机遇仍大于风险，因此，本基金后续会保持高仓位运作，并根据策略及时动态调整投资组合。

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，公司采取外聘律师、内外部专业人士相结合的方式，对各业务部门进行了多维

度、多层次的法律法规培训和职业道德培训，进一步提高了公司从业人员的合规素质和职业道德修养，持续夯实公司合规文化体系基础。

(2) 本年度，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，开展数据治理，优化可疑交易监测指标，加强反洗钱系统建设，确保反洗钱工作运行正常。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本基金从 2023 年 12 月 07 日至 2024 年 03 月 14 日连续 64 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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、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 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	安永华明 (2025) 审字第 70048283_H06 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	前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金全体基金份

	额持有人
审计意见	<p>我们审计了前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认</p>

	<p>为错报是重大的。</p> <p>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：</p> <p>(1) 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。</p> <p>(2) 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。</p> <p>(3) 评价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。</p> <p>(4) 对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量化优选灵活配置混合型证券投资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量化优选灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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。</p> <p>我们与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。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	高鹤 邓雯
会计师事务所的地址	北京市东城区长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
审计报告日期	2025 年 03 月 24 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7. 4. 7. 1	7, 148, 477. 49	4, 180, 090. 14
结算备付金		363, 065. 57	131, 463. 88

存出保证金		31,839.05	16,518.95
交易性金融资产	7. 4. 7. 2	48,302,544.19	38,885,507.49
其中：股票投资		48,302,544.19	38,885,507.49
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	7. 4. 7. 3	—	—
买入返售金融资产	7. 4. 7. 4	—	—
应收清算款		116,421.96	—
应收股利		—	—
应收申购款		1,672.54	324.53
递延所得税资产		—	—
其他资产	7. 4. 7. 5	—	—
资产总计		55,964,020.80	43,213,904.99
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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		—	—
应付清算款		2,357,263.93	358,022.94
应付赎回款		29,788.38	6,549.93
应付管理人报酬		53,874.78	46,399.43
应付托管费		8,979.12	7,733.22
应付销售服务费		2,159.48	1,602.30
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	7. 4. 7. 6	206,832.51	200,021.90
负债合计		2,658,898.20	620,329.72
净资产：			
实收基金	7. 4. 7. 7	44,570,158.14	37,037,689.65
未分配利润	7. 4. 7. 8	8,734,964.46	5,555,885.62
净资产合计		53,305,122.60	42,593,575.27
负债和净资产总计		55,964,020.80	43,213,904.99

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，前海开源量化优选基金份额总额 44,570,158.14 份，其中，前海开源量化优选 A 类基金份额净值 1.209 元，基金份额总额 24,078,754.66 份；前海开源量化优选 C 类基金份额净值 1.181 元，基金份额总额 20,491,403.48 份。

7.2 利润表

会计主体：前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业收入		2,715,810.23	-4,077,736.71
1. 利息收入		23,270.22	17,504.54
其中：存款利息收入	7.4.7.9	23,270.22	17,504.54
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）		3,040,004.06	-5,730,944.98
其中：股票投资收益	7.4.7.10	1,442,580.54	-6,315,827.50
基金投资收益	7.4.7.11	—	—
债券投资收益	7.4.7.12	—	—
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	—	—
贵金属投资收益	7.4.7.14	—	—
衍生工具收益	7.4.7.15	—	—
股利收益	7.4.7.16	1,597,423.52	584,882.52
其他投资收益		—	—
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-397,458.79	1,489,280.74
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	49,994.74	146,422.99
减：二、营业总支出		842,606.13	859,729.58
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	606,370.72	634,891.35
2. 托管费	7.4.10.2.2	101,061.76	105,815.27
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	24,406.34	16,828.94
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	7.4.7.19	—	—
7. 税金及附加		—	—
8. 其他费用	7.4.7.20	110,767.31	102,194.02
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,873,204.10	-4,937,466.29
减：所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,873,204.10	-4,937,466.29
五、其他综合收益的税后净额		—	—
六、综合收益总额		1,873,204.10	-4,937,466.29

7.3 净资产变动表

会计主体：前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	37,037,689.65	5,555,885.62	42,593,575.27
二、本期期初净资产	37,037,689.65	5,555,885.62	42,593,575.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,532,468.49	3,179,078.84	10,711,547.33
（一）、综合收益总额	-	1,873,204.10	1,873,204.10
（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）	7,532,468.49	1,305,874.74	8,838,343.23
其中：1. 基金申购款	47,411,631.21	7,631,934.12	55,043,565.33
2. 基金赎回款	-39,879,162.72	-6,326,059.38	-46,205,222.10
（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	44,570,158.14	8,734,964.46	53,305,122.60
项目	上年度可比期间		
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
实收基金	未分配利润	净资产合计	
一、上期期末净资产	40,115,519.03	11,360,182.13	51,475,701.16
二、本期期初净资产	40,115,519.03	11,360,182.13	51,475,701.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,077,829.38	-5,804,296.51	-8,882,125.89
（一）、综合收益总额	-	-4,937,466.29	-4,937,466.29
（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）	-3,077,829.38	-866,830.22	-3,944,659.60
其中：1. 基金申购款	26,412,726.10	5,298,911.31	31,711,637.41
2. 基金赎回款	-29,490,555.48	-6,165,741.53	-35,656,297.01
（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	37,037,689.65	5,555,885.62	42,593,575.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

秦亚峰

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金(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[2016]312 号《关于准予前海开源量化优选灵活配置混合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《前海开源量化优选灵活配置混合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 210,954,512.49 元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2017]01300021 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 7 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 210,989,974.74 份基金份额,其中认购资金利息折合 35,462.25 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。

本基金根据是否收取销售服务费,将基金份额分为不同的类别。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;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《前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货以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)。基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 0-95%。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、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 70%+中证全债指数收益率 \times 30%。

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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定声明

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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1)赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2)该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3)该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4)除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5)该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1)现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2)实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩且回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

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净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。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

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 本基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

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等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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

本基金同一类别的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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

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证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

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

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

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

(1) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债券利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，按照实际缴纳增值税额的适

用比例计算缴纳。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4）印花税（如适用）

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、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》的规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税

[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
活期存款	7,148,477.49	4,180,090.14
等于：本金	7,148,000.17	4,179,663.99
加：应计利息	477.32	426.15
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	7,148,477.49	4,180,090.14

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	50,171,415.44	—	48,302,544.19	-1,868,871.25
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	50,171,415.44	—	48,302,544.19	-1,868,871.25
项目	上年度末			
	2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票	40,356,919.95	-	38,885,507.49	-1,471,412.46
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	40,356,919.95	-	38,885,507.49	-1,471,412.46

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

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 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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	-	-
应付交易费用	194,332.51	65,521.90
其中：交易所市场	194,332.51	65,521.90
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	12,500.00	134,500.00
合计	206,832.51	200,021.90

7.4.7.7 实收基金

前海开源量化优选 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	22,937,906.64	22,937,906.64
本期申购	3,531,595.09	3,531,595.09
本期赎回(以“-”号填列)	-2,390,747.07	-2,390,747.07
本期末	24,078,754.66	24,078,754.66

前海开源量化优选 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	14,099,783.01	14,099,783.01
本期申购	43,880,036.12	43,880,036.12
本期赎回(以“-”号填列)	-37,488,415.65	-37,488,415.65
本期末	20,491,403.48	20,491,403.48

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

前海开源量化优选 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	6,733,561.81	-3,071,212.54	3,662,349.27
本期期初	6,733,561.81	-3,071,212.54	3,662,349.27
本期利润	1,174,020.54	-160,099.36	1,013,921.18
本期基金份额交易产生的变动数	527,276.03	-176,654.94	350,621.09
其中：基金申购款	1,148,648.40	-349,036.50	799,611.90
基金赎回款	-621,372.37	172,381.56	-448,990.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,434,858.38	-3,407,966.84	5,026,891.54

前海开源量化优选 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	3,739,872.33	-1,846,335.98	1,893,536.35
本期期初	3,739,872.33	-1,846,335.98	1,893,536.35
本期利润	1,096,642.35	-237,359.43	859,282.92
本期基金份额交易产生的变动数	1,706,354.57	-751,100.92	955,253.65
其中：基金申购款	9,387,095.45	-2,554,773.23	6,832,322.22
基金赎回款	-7,680,740.88	1,803,672.31	-5,877,068.57
本期已分配利润	-	-	-

本期末	6,542,869.25	-2,834,796.33	3,708,072.92
-----	--------------	---------------	--------------

7.4.7.9 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12 月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日
活期存款利息收入	17,349.02	14,818.01
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	5,535.72	2,455.37
其他	385.48	231.16
合计	23,270.22	17,504.54

7.4.7.10 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12 月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日
卖出股票成交总额	623,624,622.76	249,624,867.63
减：卖出股票成本总额	621,041,730.09	255,319,115.30
减：交易费用	1,140,312.13	621,579.83
买卖股票差价收入	1,442,580.54	-6,315,827.50

7.4.7.11 基金投资收益

无。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.12.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

无。

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益—买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益—其他投资收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,597,423.52	584,882.52
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	1,597,423.52	584,882.52

7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	—397,458.79	1,489,280.74
—股票投资	—397,458.79	1,489,280.74
—债券投资	—	—
—资产支持证券投资	—	—
—基金投资	—	—
—贵金属投资	—	—
—其他	—	—
2. 衍生工具	—	—

—权证投资	—	—
3. 其他	—	—
减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—	—
合计	—397,458.79	1,489,280.74

7.4.7.18 其他收入

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 12 月 31 日	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	47,688.72	136,656.84
转换费收入	2,306.02	9,766.15
合计	49,994.74	146,422.99

7.4.7.19 信用减值损失

无。

7.4.7.20 其他费用

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 12 月 31 日	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	8,000.00	30,000.00
信息披露费	80,000.00	50,000.00
证券出借违约金	—	—
汇划手续费	4,767.31	4,194.02
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	110,767.31	102,194.02

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

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
北京长和世纪资产管理有限公司	基金管理人的股东
北京市中盛金期投资管理有限公司	基金管理人的股东
深圳市和合投信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
前海开源资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 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）已于 2024 年 1 月更名为深圳市和合投信投资合伙企业（有限合伙）。

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

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	606,370.72	634,891.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	165,866.68	164,155.67
应支付基金管理人的净管理费	440,504.04	470,735.68

注：本期及上年度可比期间，截至 2023 年 7 月 9 日止，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的 1.50%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

根据《前海开源基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同和托管协议的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，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的 1.20%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	101,061.76	105,815.27

注：本期及上年度可比期间，截至 2023 年 7 月 9 日止，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的 0.25%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

根据《前海开源基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同和托管协议的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，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的 0.20%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费	前海开源量化 优选 A	前海开源量化 优选 C
前海开源基金	-	2,312.98	2,312.98
招商银行	-	2,126.29	2,126.29
开源证券	-	1,262.17	1,262.17
合计	-	5,701.44	5,701.44
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费	前海开源量化	前海开源量化
			合计

	优选 A	优选 C	
前海开源基金	—	80.99	80.99
招商银行	—	237.30	237.30
合计	—	318.29	318.29

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 0.10%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×0.10%/当年天数。

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 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

前海开源量化优选 A

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2017 年 07 月 03 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	14,156,351.44	14,156,351.44
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	14,156,351.44	14,156,351.44
报告期末持有的基金份额占基金总 份额比例	58.79%	61.72%

前海开源量化优选 C

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2017 年 07 月 03 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	5,665,722.38	-
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	5,665,722.38	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	27.65%	-

注：期间申购/买入总份额含转换入份额。基金管理人前海开源基金申购本基金的交易委托前海开源基金直销中心办理，适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

7.4.10.5.2 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

前海开源量化优选 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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
前海开源资 产管理有限 公司	2,427,184.47	10.08%	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的认（申）购/赎回费按照本基金招募说明书的规定执行。

7.4.10.6 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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 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	7,148,477.49	17,349.02	4,180,090.14	14,818.01

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末 2024 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

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系建设，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管理分析。

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总，参见附注 7.4.13.2.1 至 7.4.13.2.6。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

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

无。

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。

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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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 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%。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。

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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	7,148,477.49	-	-	-	7,148,477.49
结算备付金	363,065.57	-	-	-	363,065.57

存出保证金	31,839.05	-	-	-	31,839.05
交易性金融资产	-	-	-	48,302,544.19	48,302,544.19
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	116,421.96	116,421.96
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,672.54	1,672.54
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,543,382.11	-	-	48,420,638.69	55,964,020.80
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	-	-	-	2,357,263.93	2,357,263.93
应付赎回款	-	-	-	29,788.38	29,788.38
应付管理人报酬	-	-	-	53,874.78	53,874.78
应付托管费	-	-	-	8,979.12	8,979.12
应付销售服务费	-	-	-	2,159.48	2,159.48
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	-	-	-	206,832.51	206,832.51
负债总计	-	-	-	2,658,898.20	2,658,898.20
利率敏感度缺口	7,543,382.11	-	-	45,761,740.49	53,305,122.60
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	4,180,090.14	-	-	-	4,180,090.14
结算备付金	131,463.88	-	-	-	131,463.88
存出保证金	16,518.95	-	-	-	16,518.95
交易性金融资产	-	-	-	38,885,507.49	38,885,507.49
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	-	-	-	324.53	324.53

递延所得税资产	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,328,072.97	-	-	38,885,832.02	43,213,904.99	
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	-	-	-	358,022.94	358,022.94	
应付赎回款	-	-	-	6,549.93	6,549.93	
应付管理人报酬	-	-	-	46,399.43	46,399.43	
应付托管费	-	-	-	7,733.22	7,733.22	
应付销售服务费	-	-	-	1,602.30	1,602.30	
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	-	-	-	200,021.90	200,021.90	
负债总计	-	-	-	620,329.72	620,329.72	
利率敏感度缺口	4,328,072.97	-	-	38,265,502.30	42,593,575.27	

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

本报告期末，本基金未持有交易性债券投资（不含可转换债券和可交换债券）和资产支持证券投资（上年末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金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。

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 2024年12月31日		上年度末 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	48,302,544.19	90.62	38,885,507.49	91.29
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	48,302,544.19	90.62	38,885,507.49	91.29

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（2024年12月31日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	2,290,379.45	2,131,823.19
	业绩比较基准下降 5%	-2,290,379.45	-2,131,823.19

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	48,302,544.19	38,885,507.49
第二层次	—	—
第三层次	—	—
合计	48,302,544.19	38,885,507.49

7.4.14.2.2 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证券，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证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，确定相关证券公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 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(2023 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	48,302,544.19	86.31
	其中：股票	48,302,544.19	86.31
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	7,511,543.06	13.42
8	其他各项资产	149,933.55	0.27
9	合计	55,964,020.80	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	604,730.00	1.13
C	制造业	25,193,531.19	47.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,578,504.00	2.96
E	建筑业	477,416.00	0.90
F	批发和零售业	1,503,408.00	2.82
G	交通运输、仓储和邮政业	5,771,129.00	10.83
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,012,225.00	1.90
J	金融业	8,143,338.00	15.28
K	房地产业	997,938.00	1.87
L	租赁和商务服务业	502,125.00	0.94

M	科学研究和技术服务业	1,507,926.00	2.83
N	水利、环境和公共设施管理业	1,010,274.00	1.90
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	48,302,544.19	90.62

8.2.2 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

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	000726	鲁泰 A	144,800	944,096.00	1.77
2	600496	精工钢构	308,500	931,670.00	1.75
3	301056	森赫股份	110,900	907,162.00	1.70
4	601956	东贝集团	186,700	901,761.00	1.69
5	002228	合兴包装	298,800	896,400.00	1.68
6	600350	山东高速	60,100	617,828.00	1.16
7	601018	宁波港	158,500	610,225.00	1.14
8	601825	沪农商行	71,600	609,316.00	1.14
9	600925	苏能股份	114,100	604,730.00	1.13
10	600167	联美控股	105,000	601,650.00	1.13
11	600409	三友化工	110,500	596,700.00	1.12
12	601577	长沙银行	66,400	590,296.00	1.11
13	002634	棒杰股份	147,300	553,848.00	1.04
14	600548	深高速	38,500	518,980.00	0.97
15	002282	博深股份	69,200	512,772.00	0.96
16	688657	浩辰软件	12,900	511,614.00	0.96
17	000429	粤高速 A	34,700	510,090.00	0.96
18	688057	金达莱	45,700	507,270.00	0.95
19	600020	中原高速	120,100	506,822.00	0.95
20	601333	广深铁路	147,700	506,611.00	0.95
21	603700	宁水集团	50,600	506,506.00	0.95
22	603183	建研院	131,500	506,275.00	0.95
23	605288	凯迪股份	14,900	506,153.00	0.95

24	688211	中科微至	17,300	506,025.00	0.95
25	301223	中荣股份	31,400	505,540.00	0.95
26	001213	中铁特货	121,200	505,404.00	0.95
27	002753	永东股份	80,600	505,362.00	0.95
28	600059	古越龙山	56,900	505,272.00	0.95
29	000910	大亚圣象	64,200	505,254.00	0.95
30	002342	巨力索具	156,300	504,849.00	0.95
31	601963	重庆银行	54,400	504,832.00	0.95
32	601665	齐鲁银行	90,300	504,777.00	0.95
33	603086	先达股份	117,900	504,612.00	0.95
34	600308	华泰股份	138,600	504,504.00	0.95
35	000601	韶能股份	124,200	504,252.00	0.95
36	603778	国晟科技	166,400	504,192.00	0.95
37	600035	楚天高速	109,600	504,160.00	0.95
38	600125	铁龙物流	85,000	504,050.00	0.95
39	002365	永安药业	63,000	503,370.00	0.94
40	000632	三木集团	137,100	503,157.00	0.94
41	688113	联测科技	17,797	503,121.19	0.94
42	002627	三峡旅游	100,200	503,004.00	0.94
43	688511	天微电子	32,300	502,911.00	0.94
44	300132	青松股份	102,000	502,860.00	0.94
45	688199	久日新材	33,400	502,670.00	0.94
46	601177	杭齿前进	60,700	502,596.00	0.94
47	002206	海利得	117,100	502,359.00	0.94
48	600908	无锡银行	85,000	502,350.00	0.94
49	601997	贵阳银行	83,700	502,200.00	0.94
50	600790	轻纺城	133,900	502,125.00	0.94
51	601860	紫金银行	176,100	501,885.00	0.94
52	603017	中衡设计	62,500	501,875.00	0.94
53	300095	华伍股份	73,900	501,781.00	0.94
54	600883	博闻科技	76,600	501,730.00	0.94
55	002839	张家港行	114,800	501,676.00	0.94
56	688330	宏力达	19,100	501,184.00	0.94
57	688350	富淼科技	39,700	501,014.00	0.94
58	601077	渝农商行	82,800	500,940.00	0.94
59	000026	飞亚达	48,300	500,871.00	0.94
60	688078	龙软科技	19,100	500,611.00	0.94
61	301081	严牌股份	59,000	500,320.00	0.94
62	300305	裕兴股份	91,800	500,310.00	0.94
62	600261	阳光照明	153,000	500,310.00	0.94
64	002084	海鸥住工	173,700	500,256.00	0.94

65	002968	新大正	54,300	500,103.00	0.94
66	001227	兰州银行	203,200	499,872.00	0.94
67	688133	泰坦科技	27,400	499,776.00	0.94
68	603055	台华新材	45,100	499,708.00	0.94
69	600128	苏豪弘业	61,500	499,380.00	0.94
70	603385	惠达卫浴	78,500	499,260.00	0.94
71	688718	唯赛勃	49,900	499,000.00	0.94
72	300871	回盛生物	49,600	498,976.00	0.94
73	688393	安必平	28,800	498,528.00	0.94
74	300710	万隆光电	27,900	498,294.00	0.93
75	688310	迈得医疗	46,100	497,880.00	0.93
76	603506	南都物业	58,500	497,835.00	0.93
77	600269	赣粤高速	88,300	495,363.00	0.93
78	002948	青岛银行	127,400	494,312.00	0.93
79	600033	福建高速	126,700	491,596.00	0.92
80	601128	常熟银行	64,800	490,536.00	0.92
81	002966	苏州银行	60,400	489,844.00	0.92
82	600448	华纺股份	183,600	486,540.00	0.91
83	002890	弘宇股份	49,200	485,112.00	0.91
84	603323	苏农银行	91,500	484,035.00	0.91
85	601528	瑞丰银行	85,900	483,617.00	0.91
86	002807	江阴银行	111,000	482,850.00	0.91
87	300877	金春股份	34,300	481,915.00	0.90
88	600820	隧道股份	66,400	477,416.00	0.90
89	000856	冀东装备	69,000	476,100.00	0.89
90	600642	申能股份	49,800	472,602.00	0.89
91	688011	新光光电	28,900	442,748.00	0.83

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	601318	中国平安	5,334,204.00	12.52
2	601899	紫金矿业	5,213,221.00	12.24
3	000960	锡业股份	3,735,424.00	8.77
4	600547	山东黄金	3,594,184.00	8.44
5	600900	长江电力	3,457,471.00	8.12
6	600019	宝钢股份	3,075,579.00	7.22
7	000932	华菱钢铁	3,048,126.00	7.16
8	600519	贵州茅台	3,037,195.00	7.13

9	600031	三一重工	2,890,222.00	6.79
10	601288	农业银行	2,840,454.00	6.67
11	601658	邮储银行	2,756,538.00	6.47
12	600985	淮北矿业	2,577,324.00	6.05
13	601898	中煤能源	2,568,659.00	6.03
14	601398	工商银行	2,550,808.00	5.99
15	600406	国电南瑞	2,520,749.20	5.92
16	601088	中国神华	2,469,861.00	5.80
17	601229	上海银行	2,380,466.00	5.59
18	000333	美的集团	2,366,942.00	5.56
19	300760	迈瑞医疗	2,359,308.00	5.54
20	002714	牧原股份	2,293,260.00	5.38
21	002601	龙佰集团	2,239,347.00	5.26
22	601666	平煤股份	2,229,804.00	5.24
23	600497	驰宏锌锗	2,220,766.00	5.21
24	601939	建设银行	2,214,062.00	5.20
25	601166	兴业银行	2,182,347.00	5.12
26	601818	光大银行	2,140,104.00	5.02
27	601169	北京银行	2,132,281.00	5.01
28	000683	远兴能源	2,099,072.00	4.93
29	600660	福耀玻璃	2,088,454.00	4.90
30	000975	山金国际	2,063,847.00	4.85
31	601168	西部矿业	1,999,508.00	4.69
32	601077	渝农商行	1,988,725.00	4.67
33	600548	深高速	1,984,116.00	4.66
34	000869	张裕 A	1,975,295.00	4.64
35	000858	五粮液	1,968,225.00	4.62
36	601009	南京银行	1,958,900.40	4.60
37	600028	中国石化	1,938,152.00	4.55
38	601988	中国银行	1,934,060.00	4.54
39	601328	交通银行	1,903,965.00	4.47
40	601577	长沙银行	1,861,757.00	4.37
41	601390	中国中铁	1,861,023.00	4.37
42	601006	大秦铁路	1,825,252.00	4.29
43	600350	山东高速	1,806,660.00	4.24
44	600346	恒力石化	1,764,968.00	4.14
45	600585	海螺水泥	1,747,744.00	4.10
46	601728	中国电信	1,732,227.00	4.07
47	601669	中国电建	1,730,750.00	4.06
48	000651	格力电器	1,718,970.00	4.04
49	600887	伊利股份	1,718,467.00	4.03

50	300132	青松股份	1,685,290.00	3.96
51	601985	中国核电	1,672,626.00	3.93
52	601628	中国人寿	1,659,984.00	3.90
53	002027	分众传媒	1,656,185.00	3.89
54	601916	浙商银行	1,648,363.00	3.87
55	601186	中国铁建	1,639,118.00	3.85
56	601958	金钼股份	1,625,875.00	3.82
57	603323	苏农银行	1,611,371.00	3.78
58	601816	京沪高铁	1,607,377.00	3.77
59	600309	万华化学	1,564,015.00	3.67
60	600919	江苏银行	1,563,074.00	3.67
61	600741	华域汽车	1,555,027.00	3.65
62	600016	民生银行	1,553,792.00	3.65
63	600096	云天化	1,547,844.00	3.63
64	600000	浦发银行	1,546,987.40	3.63
65	000001	平安银行	1,543,327.00	3.62
66	002001	新和成	1,516,471.00	3.56
67	600141	兴发集团	1,513,252.00	3.55
68	601838	成都银行	1,499,172.10	3.52
69	600219	南山铝业	1,476,427.00	3.47
70	688133	泰坦科技	1,456,786.36	3.42
71	601101	昊华能源	1,452,104.00	3.41
72	603156	养元饮品	1,422,685.00	3.34
73	600352	浙江龙盛	1,389,262.00	3.26
74	601601	中国太保	1,386,415.00	3.25
75	600803	新奥股份	1,378,281.00	3.24
76	600507	方大特钢	1,361,749.00	3.20
77	688302	海创药业	1,360,323.90	3.19
78	600873	梅花生物	1,352,127.00	3.17
79	688310	迈得医疗	1,349,665.05	3.17
80	688167	炬光科技	1,347,929.01	3.16
81	688220	翱捷科技	1,340,772.02	3.15
82	002155	湖南黄金	1,339,178.00	3.14
83	600023	浙能电力	1,334,240.00	3.13
84	600489	中金黄金	1,327,596.00	3.12
85	601600	中国铝业	1,320,088.00	3.10
86	600690	海尔智家	1,313,580.00	3.08
87	000792	盐湖股份	1,303,094.00	3.06
88	600926	杭州银行	1,298,268.00	3.05
89	002729	好利科技	1,298,228.00	3.05
90	605507	国邦医药	1,278,850.00	3.00

91	600820	隧道股份	1, 260, 569. 00	2. 96
92	600075	新疆天业	1, 251, 215. 00	2. 94
93	600018	上港集团	1, 249, 452. 00	2. 93
94	000429	粤高速 A	1, 247, 771. 00	2. 93
95	601997	贵阳银行	1, 246, 605. 00	2. 93
96	600269	赣粤高速	1, 237, 884. 00	2. 91
97	002014	永新股份	1, 233, 217. 00	2. 90
98	600426	华鲁恒升	1, 223, 308. 00	2. 87
99	600483	福能股份	1, 216, 846. 00	2. 86
100	000768	中航西飞	1, 208, 424. 00	2. 84
101	601975	招商南油	1, 206, 810. 00	2. 83
102	002191	劲嘉股份	1, 202, 501. 00	2. 82
103	002493	荣盛石化	1, 189, 674. 00	2. 79
104	000856	冀东装备	1, 186, 382. 00	2. 79
105	600436	片仔癀	1, 177, 167. 00	2. 76
106	601128	常熟银行	1, 174, 642. 60	2. 76
107	605499	东鹏饮料	1, 172, 987. 00	2. 75
108	601688	华泰证券	1, 167, 688. 00	2. 74
109	601825	沪农商行	1, 166, 468. 00	2. 74
110	600837	海通证券	1, 162, 304. 00	2. 73
111	000538	云南白药	1, 153, 452. 20	2. 71
112	601618	中国中冶	1, 145, 149. 00	2. 69
113	002252	上海莱士	1, 144, 250. 00	2. 69
114	600875	东方电气	1, 141, 642. 00	2. 68
115	600704	物产中大	1, 140, 572. 00	2. 68
116	000876	新希望	1, 135, 219. 00	2. 67
117	600438	通威股份	1, 132, 393. 00	2. 66
118	002409	雅克科技	1, 131, 661. 00	2. 66
119	688330	宏力达	1, 131, 201. 15	2. 66
120	600167	联美控股	1, 123, 558. 00	2. 64
121	600177	雅戈尔	1, 121, 325. 00	2. 63
122	000623	吉林敖东	1, 116, 214. 00	2. 62
123	600332	白云山	1, 114, 655. 00	2. 62
124	000830	鲁西化工	1, 111, 142. 00	2. 61
125	688012	中微公司	1, 091, 087. 94	2. 56
126	002142	宁波银行	1, 088, 418. 00	2. 56
127	601117	中国化学	1, 087, 687. 00	2. 55
128	002885	京泉华	1, 086, 634. 00	2. 55
129	600196	复星医药	1, 085, 895. 00	2. 55
130	600010	包钢股份	1, 084, 063. 00	2. 55
131	601001	晋控煤业	1, 077, 327. 00	2. 53

132	600886	国投电力	1,070,039.00	2.51
133	000963	华东医药	1,067,823.00	2.51
134	600546	山煤国际	1,062,922.00	2.50
135	688077	大地熊	1,059,576.11	2.49
136	002182	宝武镁业	1,055,322.00	2.48
137	600516	方大炭素	1,052,993.00	2.47
138	300383	光环新网	1,045,084.00	2.45
139	600448	华纺股份	1,043,352.00	2.45
140	002625	光启技术	1,042,372.00	2.45
141	688057	金达莱	1,034,189.23	2.43
142	600348	华阳股份	1,027,035.00	2.41
143	601336	新华保险	1,025,906.00	2.41
144	300058	蓝色光标	1,023,193.00	2.40
145	002765	蓝黛科技	1,022,977.00	2.40
146	603700	宁水集团	1,018,716.00	2.39
147	600308	华泰股份	1,017,382.00	2.39
148	002422	科伦药业	1,012,275.00	2.38
149	000601	韶能股份	1,005,521.00	2.36
150	603568	伟明环保	1,003,369.00	2.36
151	000703	恒逸石化	1,002,397.00	2.35
152	002282	博深股份	1,002,038.00	2.35
153	301223	中荣股份	1,001,484.00	2.35
154	688009	中国通号	1,001,201.32	2.35
155	600795	国电电力	998,009.00	2.34
156	600486	扬农化工	996,330.00	2.34
157	600372	中航机载	995,925.00	2.34
158	000848	承德露露	995,621.00	2.34
159	601238	广汽集团	994,131.00	2.33
160	300745	欣锐科技	989,852.00	2.32
161	600111	北方稀土	988,674.00	2.32
162	002223	鱼跃医疗	988,349.00	2.32
163	688663	新风光	985,685.07	2.31
164	603301	振德医疗	985,020.00	2.31
165	600479	千金药业	984,502.00	2.31
166	601956	东贝集团	978,965.00	2.30
167	002371	北方华创	974,274.00	2.29
168	600496	精工钢构	973,077.00	2.28
169	000726	鲁泰 A	971,509.00	2.28
170	002432	九安医疗	968,248.00	2.27
171	002890	弘宇股份	967,855.00	2.27
172	688008	澜起科技	963,897.89	2.26

173	600188	兖矿能源	961,478.00	2.26
174	300877	金春股份	961,355.00	2.26
175	000786	北新建材	959,896.00	2.25
176	600674	川投能源	958,452.54	2.25
177	600161	天坛生物	957,416.00	2.25
178	000887	中鼎股份	956,050.00	2.24
179	002028	思源电气	954,690.00	2.24
180	002228	合兴包装	954,115.00	2.24
181	301056	森赫股份	953,734.00	2.24
182	688443	智翔金泰	951,194.81	2.23
183	688031	星环科技	948,946.22	2.23
184	688390	固德威	948,709.49	2.23
185	002782	可立克	948,069.00	2.23
186	601968	宝钢包装	947,689.00	2.22
187	002648	卫星化学	942,247.00	2.21
188	600908	无锡银行	940,418.00	2.21
189	603858	步长制药	939,069.00	2.20
190	601216	君正集团	931,326.00	2.19
191	600150	中国船舶	931,169.00	2.19
192	002507	涪陵榨菜	931,069.00	2.19
193	601211	国泰君安	930,951.00	2.19
194	600521	华海药业	929,823.00	2.18
195	600529	山东药玻	927,572.00	2.18
196	002594	比亚迪	925,730.00	2.17
197	600989	宝丰能源	925,199.00	2.17
198	603609	禾丰股份	924,884.00	2.17
199	603605	珀莱雅	923,436.00	2.17
200	300054	鼎龙股份	915,373.00	2.15
201	688048	长光华芯	913,063.85	2.14
202	600655	豫园股份	911,878.00	2.14
203	688261	东微半导	908,786.26	2.13
204	603466	风语筑	900,666.00	2.11
205	688188	柏楚电子	900,518.07	2.11
206	000681	视觉中国	900,236.00	2.11
207	603260	合盛硅业	884,727.00	2.08
208	688080	映翰通	882,297.28	2.07
209	600143	金发科技	881,980.00	2.07
210	688148	芳源股份	880,859.72	2.07
211	688019	安集科技	879,409.62	2.06
212	688617	惠泰医疗	877,906.75	2.06
213	603160	汇顶科技	877,879.00	2.06

214	688410	山外山	876,894.14	2.06
215	601866	中远海发	871,735.00	2.05
216	603916	苏博特	870,926.00	2.04
217	300996	普联软件	853,768.00	2.00
218	688028	沃尔德	853,565.72	2.00
219	688369	致远互联	852,086.21	2.00

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	601899	紫金矿业	6,709,145.00	15.75
2	601318	中国平安	5,459,530.00	12.82
3	600519	贵州茅台	4,442,431.00	10.43
4	600547	山东黄金	3,819,142.00	8.97
5	000960	锡业股份	3,760,696.00	8.83
6	600019	宝钢股份	3,575,343.00	8.39
7	600900	长江电力	3,451,111.00	8.10
8	600028	中国石化	3,344,300.00	7.85
9	601898	中煤能源	3,142,980.00	7.38
10	601288	农业银行	3,076,238.00	7.22
11	000932	华菱钢铁	3,074,200.00	7.22
12	000858	五粮液	3,043,088.00	7.14
13	600031	三一重工	2,961,730.00	6.95
14	601658	邮储银行	2,790,472.00	6.55
15	601398	工商银行	2,740,346.97	6.43
16	000786	北新建材	2,577,329.00	6.05
17	600985	淮北矿业	2,555,265.00	6.00
18	601088	中国神华	2,540,493.00	5.96
19	300760	迈瑞医疗	2,505,382.00	5.88
20	600406	国电南瑞	2,472,208.52	5.80
21	002027	分众传媒	2,452,396.00	5.76
22	601229	上海银行	2,423,214.00	5.69
23	601939	建设银行	2,336,924.00	5.49
24	600497	驰宏锌锗	2,269,580.00	5.33
25	002714	牧原股份	2,250,483.00	5.28
26	000333	美的集团	2,248,938.00	5.28
27	601166	兴业银行	2,223,404.00	5.22
28	002601	龙佰集团	2,221,192.00	5.21

29	601601	中国太保	2,219,413.00	5.21
30	601666	平煤股份	2,211,844.00	5.19
31	000975	山金国际	2,196,947.00	5.16
32	601169	北京银行	2,156,579.00	5.06
33	600660	福耀玻璃	2,108,399.00	4.95
34	000683	远兴能源	2,094,706.00	4.92
35	601818	光大银行	2,093,852.00	4.92
36	601988	中国银行	2,092,820.00	4.91
37	601328	交通银行	2,091,253.00	4.91
38	000869	张裕 A	2,051,853.00	4.82
39	601009	南京银行	2,013,726.00	4.73
40	601168	西部矿业	2,000,161.00	4.70
41	601336	新华保险	1,896,280.00	4.45
42	601006	大秦铁路	1,869,163.00	4.39
43	601390	中国中铁	1,825,211.00	4.29
44	600585	海螺水泥	1,822,782.00	4.28
45	000768	中航西飞	1,790,065.72	4.20
46	600346	恒力石化	1,789,053.00	4.20
47	600887	伊利股份	1,778,342.00	4.18
48	601816	京沪高铁	1,777,333.00	4.17
49	000651	格力电器	1,740,331.00	4.09
50	601985	中国核电	1,736,012.00	4.08
51	601728	中国电信	1,731,122.00	4.06
52	601186	中国铁建	1,706,528.00	4.01
53	601628	中国人寿	1,703,724.00	4.00
54	601669	中国电建	1,701,526.00	3.99
55	601916	浙商银行	1,667,069.00	3.91
56	002155	湖南黄金	1,604,880.00	3.77
57	601958	金钼股份	1,602,330.00	3.76
58	000001	平安银行	1,601,998.00	3.76
59	600548	深高速	1,596,603.00	3.75
60	688008	澜起科技	1,577,682.08	3.70
61	600016	民生银行	1,576,458.00	3.70
62	601077	渝农商行	1,568,528.00	3.68
63	600000	浦发银行	1,568,222.00	3.68
64	600489	中金黄金	1,560,942.00	3.66
65	601101	昊华能源	1,559,081.00	3.66
66	600096	云天化	1,555,045.00	3.65
67	600141	兴发集团	1,528,054.00	3.59
68	601838	成都银行	1,519,062.00	3.57
69	600309	万华化学	1,516,489.00	3.56

70	600919	江苏银行	1,507,325.00	3.54
71	002001	新和成	1,506,229.00	3.54
72	600219	南山铝业	1,495,910.00	3.51
73	600352	浙江龙盛	1,452,583.00	3.41
74	600741	华域汽车	1,451,613.00	3.41
75	600803	新奥股份	1,437,978.00	3.38
76	688012	中微公司	1,426,082.65	3.35
77	603156	养元饮品	1,421,380.00	3.34
78	600023	浙能电力	1,419,383.00	3.33
79	688302	海创药业	1,400,219.59	3.29
80	601688	华泰证券	1,380,160.00	3.24
81	601577	长沙银行	1,363,971.00	3.20
82	605507	国邦医药	1,360,776.00	3.19
83	600018	上港集团	1,351,771.00	3.17
84	600507	方大特钢	1,350,322.00	3.17
85	600926	杭州银行	1,349,778.00	3.17
86	002138	顺络电子	1,347,475.00	3.16
87	603501	韦尔股份	1,334,492.00	3.13
88	688220	翱捷科技	1,333,059.12	3.13
89	600873	梅花生物	1,331,670.00	3.13
90	601600	中国铝业	1,324,740.00	3.11
91	600075	新疆天业	1,319,868.00	3.10
92	600350	山东高速	1,318,108.00	3.09
93	600837	海通证券	1,314,102.00	3.09
94	600483	福能股份	1,312,312.00	3.08
95	601975	招商南油	1,303,338.00	3.06
96	600690	海尔智家	1,288,965.00	3.03
97	688167	炬光科技	1,279,219.55	3.00
98	600546	山煤国际	1,273,272.00	2.99
99	000792	盐湖股份	1,266,621.00	2.97
100	002014	永新股份	1,253,304.00	2.94
101	002252	上海莱士	1,250,721.00	2.94
102	002372	伟星新材	1,245,855.00	2.92
103	002729	好利科技	1,241,587.00	2.91
104	600426	华鲁恒升	1,237,337.00	2.90
105	605499	东鹏饮料	1,234,347.00	2.90
106	002625	光启技术	1,226,612.00	2.88
107	600754	锦江酒店	1,225,083.00	2.88
108	002191	劲嘉股份	1,201,552.00	2.82
109	000876	新希望	1,199,288.00	2.82
110	603323	苏农银行	1,190,696.00	2.80

111	600704	物产中大	1,188,260.00	2.79
112	300750	宁德时代	1,179,930.00	2.77
113	000623	吉林敖东	1,178,608.00	2.77
114	300132	青松股份	1,173,564.00	2.76
115	000538	云南白药	1,173,400.80	2.75
116	688663	新风光	1,164,786.81	2.73
117	002409	雅克科技	1,158,836.00	2.72
118	600438	通威股份	1,154,962.00	2.71
119	600436	片仔癀	1,148,634.00	2.70
120	000963	华东医药	1,146,459.00	2.69
121	600196	复星医药	1,139,958.00	2.68
122	300623	捷捷微电	1,137,870.00	2.67
123	600177	雅戈尔	1,134,059.00	2.66
124	600010	包钢股份	1,131,073.00	2.66
125	002493	荣盛石化	1,122,631.00	2.64
126	002422	科伦药业	1,120,867.00	2.63
127	600886	国投电力	1,113,608.00	2.61
128	600875	东方电气	1,111,088.00	2.61
129	600795	国电电力	1,103,664.00	2.59
130	600111	北方稀土	1,090,523.00	2.56
131	000830	鲁西化工	1,089,282.00	2.56
132	301308	江波龙	1,082,675.00	2.54
133	600150	中国船舶	1,081,552.00	2.54
134	600372	中航机载	1,079,754.00	2.54
135	000090	天健集团	1,079,576.00	2.53
136	600674	川投能源	1,076,761.00	2.53
137	600332	白云山	1,076,189.00	2.53
138	601618	中国中冶	1,073,813.00	2.52
139	300383	光环新网	1,058,403.00	2.48
140	600348	华阳股份	1,055,605.00	2.48
141	000568	泸州老窖	1,054,812.00	2.48
142	600486	扬农化工	1,044,188.00	2.45
143	000066	中国长城	1,044,150.00	2.45
144	300475	香农芯创	1,043,378.00	2.45
145	002182	宝武镁业	1,043,171.00	2.45
146	600188	兖矿能源	1,041,920.00	2.45
147	601117	中国化学	1,039,739.00	2.44
148	601689	拓普集团	1,034,732.00	2.43
149	601238	广汽集团	1,031,954.00	2.42
150	600584	长电科技	1,029,256.00	2.42
151	300058	蓝色光标	1,028,338.00	2.41

152	300745	欣锐科技	1,025,495.00	2.41
153	002142	宁波银行	1,005,358.00	2.36
154	603568	伟明环保	1,002,180.00	2.35
155	002223	鱼跃医疗	1,000,450.00	2.35
156	600479	千金药业	999,764.00	2.35
157	601001	晋控煤业	999,534.00	2.35
158	002432	九安医疗	996,006.00	2.34
159	002885	京泉华	994,506.00	2.33
160	600655	豫园股份	984,127.00	2.31
161	688077	大地熊	983,148.28	2.31
162	002765	蓝黛科技	978,891.00	2.30
163	600143	金发科技	977,167.00	2.29
164	000848	承德露露	975,404.00	2.29
165	000703	恒逸石化	966,923.00	2.27
166	600521	华海药业	964,811.00	2.27
167	601866	中远海发	960,572.00	2.26
168	688009	中国通号	959,787.90	2.25
169	603260	合盛硅业	959,510.00	2.25
170	000887	中鼎股份	958,496.00	2.25
171	002028	思源电气	945,969.00	2.22
172	603301	振德医疗	945,110.00	2.22
173	688443	智翔金泰	944,733.92	2.22
174	600161	天坛生物	944,671.00	2.22
175	600989	宝丰能源	944,101.00	2.22
176	601211	国泰君安	941,432.00	2.21
177	600516	方大炭素	940,152.00	2.21
178	601968	宝钢包装	937,903.00	2.20
179	603609	禾丰股份	931,234.00	2.19
180	603605	珀莱雅	930,834.00	2.19
181	601216	君正集团	921,158.00	2.16
182	000685	中山公用	918,615.00	2.16
183	002371	北方华创	918,185.00	2.16
184	688133	泰坦科技	917,289.52	2.15
185	603858	步长制药	915,167.54	2.15
186	002683	广东宏大	913,329.00	2.14
187	688031	星环科技	906,460.12	2.13
188	688148	芳源股份	902,536.83	2.12
189	002507	涪陵榨菜	901,864.00	2.12
190	688390	固德威	900,906.35	2.12
191	688617	惠泰医疗	898,449.62	2.11
192	688410	山外山	896,893.04	2.11

193	603160	汇顶科技	892,055.00	2.09
194	000429	粤高速 A	890,629.00	2.09
195	002648	卫星化学	884,749.00	2.08
196	688019	安集科技	875,291.34	2.05
197	300054	鼎龙股份	872,831.00	2.05
198	300275	梅安森	870,599.00	2.04
199	600529	山东药玻	870,492.00	2.04
200	688261	东微半导	869,524.46	2.04
201	600030	中信证券	869,042.00	2.04
202	688188	柏楚电子	865,840.95	2.03
203	600269	赣粤高速	863,748.00	2.03
204	600015	华夏银行	859,360.00	2.02
205	603195	公牛集团	853,144.00	2.00

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	630,856,225.58
卖出股票收入（成交）总额	623,624,622.76

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

无。

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

无。

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 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

报告期内，本基金投资的前十名证券除“沪农商行（证券代码 601825）”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。

8.12.2 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。

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	31,839.05
2	应收清算款	116,421.96
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,672.54
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	149,933.55

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

无。

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

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构				份额单位：份	
			机构投资者		个人投资者			
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例		
前海开源量化优选 A	1,266	19,019.55	16,583,535.91	68.87%	7,495,218.75	31.13%		
前海开源量化优选 C	2,674	7,663.20	5,665,864.05	27.65%	14,825,539.43	72.35%		
合计	3,940	11,312.22	22,249,399.96	49.92%	22,320,758.18	50.08%		

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。

9.2 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	前海开源量化优选 A	609,540.02	2.5314%
	前海开源量化优选 C	339.23	0.0017%
	合计	609,879.25	1.3684%

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)。

9.3 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	前海开源量化优选 A	10^50
	前海开源量化优选 C	0
	合计	10^50
本基金基金经理持有本开放式基金	前海开源量化优选 A	10^50
	前海开源量化优选 C	0
	合计	10^50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	前海开源量化优选 A	前海开源量化优选 C
基金合同生效日（2017 年 07 月 03 日）基金份额总额	10,182,205.88	200,807,768.86
本报告期期初基金份额总额	22,937,906.64	14,099,783.01
本报告期基金总申购份额	3,531,595.09	43,880,036.12
减：本报告期基金总赎回份额	2,390,747.07	37,488,415.65
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	24,078,754.66	20,491,403.48

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人的重大人事变动：2024 年 4 月 23 日起，王厚琼先生任副总经理；2024 年 11 月 20 日，董事长李强先生离任，总经理秦亚峰先生代任董事长。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及影响基金管理人经营管理或基金运作业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、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

本基金管理人于 2024 年 09 月 27 日发布了《前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告》的公告，自 2024 年 09 月 25 日起，旗下部分基金（包含本基金）的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)变更为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。

本报告期应支付给所聘任会计师事务所的审计费为 8,000.00 元。截至本报告期末，该事务所已提供审计服务的连续年限：未满 1 年。

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

11.6.1 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。

11.6.2 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。

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	
德邦证券	2	266,761,625.66	21.26%	198,981.33	26.60%	
第一创业 证券	2	-	-	-	-	
东北证券	2	-	-	-	-	
海通证券	2	872,988,640.08	69.59%	484,785.01	64.81%	
华西证券	2	-	-	-	-	
汇丰前海 证券	2	-	-	-	-	本报告期 新增 2 个
联储证券	2	-	-	-	-	
山西证券	2	-	-	-	-	本报告期 退租 2 个
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	
万和证券	2	-	-	-	-	

五矿证券	2	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-
中金公司	2	114,730,582.60	9.15%	64,296.84	8.60%

注：1、依据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称《规定》）等有关要求，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，除被动股票型基金以外的其他类型基金租用证券公司交易单元的选择标准和程序如下：

选择标准：（1）分类评价结果；（2）研究所人数及成立时间；（3）研究所行业覆盖度；（4）近1年研究及经纪业务未受到重大行政处罚，或受到重大行政处罚时间已满1年并且完成整改；（5）其他可增强资质的情况及特色。

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、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易，并根据证券公司提供研究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。

2、根据《规定》的要求，本基金管理人已与提供证券交易服务的证券公司签订协议，约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式等。《规定》自2024年7月1日起实施，2024年7月1日至2024年12月31日期间，本基金管理人旗下所有基金的股票交易佣金费率均符合《规定》第四条要求，其中，除被动股票型基金以外的其他类型基金的股票交易佣金费率未超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且未通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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

无。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	前海开源基金管理有限公司关于终止与北京增财基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2024年01月05日
2	前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2024年01月22日
3	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
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	前海开源量化优选灵活配置混合型证券	中国证监会规定媒介	2024年03月30日

	投资基金 2023 年年度报告		日
6	前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 04 月 22 日
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	前海开源基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示公告	中国证监会规定媒介	2024 年 06 月 03 日
11	前海开源量化优选灵活配置混合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
12	前海开源基金管理有限公司关于终止与喜鹊财富基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 07 月 18 日
13	前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 07 月 19 日
14	前海开源基金管理有限公司关于终止北京中植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	2024 年 07 月 19 日
15	前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会规定媒介	2024 年 08 月 30 日
16	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 09 月 27 日
17	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金限制大额申购、转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 10 月 08 日
18	前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金恢复大额申购、转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 10 月 09 日
19	前海开源基金管理有限公司关于暂停海银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	2024 年 10 月 23 日
20	前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 10 月 25 日
21	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 11 月 22 日
22	前海开源基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示公告	中国证监会规定媒介	2024 年 12 月 04 日
23	前海开源量化优选灵活配置混合型证券	中国证监会规定媒介	2024 年 12 月 11

	投资基金招募说明书（20241211 更新）		日
24	前海开源量化优选灵活配置混合型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	2024 年 12 月 11 日

§ 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	20240101-20241231	14,156,351.44	5,665,722.38	-	19,822,073.82	44.47%
产品特有风险							
<p>1. 巨额赎回风险</p> <p>(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可根据基金合同约定决定延缓支付赎回款项、部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务的办理；</p> <p>2. 转换运作方式或终止基金合同的风险</p> <p>个别投资者大额赎回后，若本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决，其他投资者可能面临相应风险；</p> <p>3. 流动性风险</p> <p>单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；</p> <p>4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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量化优选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 《前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源量化优选灵活配置混合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) 前海开源量化优选灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人前海开源基金管理有限公司，客户服务电话：4001-666-998
- (3) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.qhkyfund.com

前海开源基金管理有限公司

2025 年 03 月 31 日