

前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金  
2025 年中期报告

2025 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：中国银河证券股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 29 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。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 27 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 2025 年 01 月 01 日起至 2025 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 .....                         | 6  |
| 2.4  | 信息披露方式 .....                              | 7  |
| 2.5  | 其他相关资料 .....                              | 7  |
| § 3  | 主要财务指标和基金净值表现 .....                       | 7  |
| 3.1  | 主要会计数据和财务指标 .....                         | 7  |
| 3.2  | 基金净值表现 .....                              | 8  |
| § 4  | 管理人报告 .....                               | 8  |
| 4.1  | 基金管理人及基金经理情况 .....                        | 8  |
| 4.2  | 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....              | 9  |
| 4.3  | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                 | 9  |
| 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 .....             | 10 |
| 4.5  | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....             | 11 |
| 4.6  | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                | 11 |
| 4.7  | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                 | 12 |
| 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 .....       | 12 |
| § 5  | 托管人报告 .....                               | 12 |
| 5.1  | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 12 |
| 5.2  | 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..... | 12 |
| 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 .....       | 12 |
| § 6  | 半年度财务会计报告（未经审计） .....                     | 12 |
| 6.1  | 资产负债表 .....                               | 12 |
| 6.2  | 利润表 .....                                 | 14 |
| 6.3  | 净资产变动表 .....                              | 15 |
| 6.4  | 报表附注 .....                                | 16 |
| § 7  | 投资组合报告 .....                              | 37 |
| 7.1  | 期末基金资产组合情况 .....                          | 37 |
| 7.2  | 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 38 |
| 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 .....       | 38 |
| 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 .....                    | 52 |
| 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 .....   | 53 |
| 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 .....   | 53 |
| 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 .....      | 53 |
| 7.10 | 本基金投资股指期货的投资政策 .....                      | 53 |
| 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  | 期末上市基金前十名持有人 .....                  | 55 |
| 8.3  | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 55 |
| 8.4  | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....  | 56 |
| § 9  | 开放式基金份额变动 .....                     | 56 |
| § 10 | 重大事件揭示 .....                        | 56 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 .....                   | 56 |
| 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 .....   | 56 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 56 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 .....                     | 56 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 56 |
| 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 .....      | 56 |
| 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 .....                        | 58 |
| § 11 | 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 59 |
| 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 ..... | 59 |
| 11.2 | 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 59 |
| § 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         | 前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称         | 前海开源中证 500 等权 ETF            |
| 场内简称         | 500 等权 ETF                   |
| 基金主代码        | 515590                       |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                       |
| 基金合同生效日      | 2019 年 11 月 14 日             |
| 基金管理人        | 前海开源基金管理有限公司                 |
| 基金托管人        | 中国银河证券股份有限公司                 |
| 报告期末基金份额总额   | 34,113,665.00 份              |
| 基金合同存续期      | 不定期                          |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所                      |
| 上市日期         | 2020 年 01 月 20 日             |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。  |
| 投资策略 | <p>本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以采取包括抽样复制在内的其他指数投资技术适当对投资组合管理进行变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> <p>在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p><b>1、股票投资策略</b></p> <p><b>（1）股票投资组合的构建</b></p> <p>本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p><b>（2）股票投资组合的调整</b></p> <p>本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况，对其进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。</p> <p>2、金融衍生品投资策略</p> <p>本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>3、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。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>4、融资及转融通证券出借业务的投资策略</p> <p>本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。</p> <p>5、未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证 500 等权重指数收益率。   |
| 风险收益特征 | 本基金属股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。   |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人             | 基金托管人                       |
|---------|------|-------------------|-----------------------------|
| 名称      |      | 前海开源基金管理有限公司      | 中国银河证券股份有限公司                |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 孙辰健               | 罗新民                         |
|         | 联系电话 | 0755-88601888     | 010-80927820                |
|         | 电子邮箱 | qhky@qhkyfund.com | yhqz_tggz@chinastock.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 4001-666-998      | 95551; 400-888-8888         |

|       |   |                                  |
|-------|---|----------------------------------|
| 传真    | 0755-83181169                                 | 010-80928078                     |
| 注册地址  | 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） | 北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101 |
| 办公地址  | 深圳市福田区深南大道 7006 号 万科富春东方大厦 2206               | 北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦        |
| 邮政编码  | 518040  | 100073                           |
| 法定代表人 | 李强  | 王晟                               |

## 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 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 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（2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日） |
|---------------|---|
| 本期已实现收益       | 2,083,512.74                            |
| 本期利润          | 2,333,601.40                            |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0632                                  |
| 本期加权平均净值利润率   | 4.41%                                   |
| 本期基金份额净值增长率   | 4.41%                                   |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2025 年 06 月 30 日）                  |
| 期末可供分配利润      | 16,498,584.59                           |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.4836                                  |
| 期末基金资产净值      | 50,612,249.59                           |
| 期末基金份额净值      | 1.4836                                  |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末（2025 年 06 月 30 日）                  |
| 基金份额累计净值增长率   | 48.36%                                  |

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

| 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      | 4.27%    | 0.75%       | 3.60%      | 0.76%         | 0.67%  | -0.01% |
| 过去三个月      | 1.72%    | 1.46%       | 0.73%      | 1.46%         | 0.99%  | 0.00%  |
| 过去六个月      | 4.41%    | 1.30%       | 3.49%      | 1.30%         | 0.92%  | 0.00%  |
| 过去一年       | 22.11%   | 1.72%       | 21.05%     | 1.72%         | 1.06%  | 0.00%  |
| 过去三年       | -0.36%   | 1.34%       | -3.97%     | 1.35%         | 3.61%  | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 48.36%   | 1.31%       | 27.56%     | 1.33%         | 20.80% | -0.02% |

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



## § 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 102 只开放式基金，资产管理规模超过 1047 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 05 月 07 日 | —    | 11 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合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合投资策略需要，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

上半年 A 股在面临突发冲击时坚韧的表现逐渐凝聚了投资者信心，萦绕多时的悲观情绪逐渐拨开云雾。虽然四月初美国对等关税的横空出世造成了全球金融市场的巨震，恐慌性抛盘使得中证 500 等权重指数在 4 月 7 日重挫 9.42%，创下了指数发布以来最大单日跌幅。但 A 股在其后表现出了极强的韧性，在高层一揽子稳市“组合拳”的助力下，市场迅速收复失地，六月下旬开始上涨的速度更是明显加快，极大地提振了市场做多情绪。上半年，中证 500 等权重指数上涨 3.49%，本基金上涨 4.41%，表现优于业绩比较基准。展望后市，从全球金融大背景来看，尽管美联储降息的具体实现路径随着美国经济数据起伏仍不明朗，但当前美国联邦基金利率仍然高达 4.25%-4.5%，距离美联储 3% 的长期利率目标仍有较大的下行空间，美联储继续降息仍是 2025 年全球金融市场较为确定的方向。在美联储降息大周期下，作为全球风险资产定价之锚的美国无风险利率下行，有助于权益资产估值的提升。从国内宏观层面来看，美国关税政策仍存在高度不确定性，下半年贸易摩擦存在反复的风险，随着抢出口效应逐步消退，外需对经济增长的支撑或将减弱，内需对经济增长的贡献或继续增强。但当前内需消费增长主要受到政策驱动，消费能力和消费意愿仍然有待修复，下半年消费复苏节奏有赖政策支持。我们判断，在国内结构性矛盾持续存在、国际贸易环境更加复杂的背景下，政策的逆周期调节不会缺位。4 月中央政治局会议要求“加紧实施更加积极有为的宏观政策，用好用足更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策”，政策托举下，整体经济有望持续修复。而在“稳股市”的政策基调下，A 股下行风险有限。从估值来看，截至 2025 年 6 月 30 日，中证 500 等权重指数 PE（TTM）约为 28.67 倍，处于上市以来历史分位值约为 56.21%，其相对于十年期国债收益率的吸引力比历史上 81.94% 的时期更高。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，当前中证 500 等权重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，并通过参与新股申购、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中证 500 等权 ETF 基金份额净值为 1.4836 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 4.41%，同期业绩比较基准收益率为 3.49%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年在国际形势急剧变化、外部压力明显加大的情况下，我国经济运行总体平稳。财政发债和支出靠前发力、以旧换新等一系列政策起到了扩大内需的作用，有力支持了上半年经济增长，主要指标好于预期，上半年 GDP 同比增长 5.3%。但考虑到美国加征关税对我国出口和宏观经济的影响仍在发酵中，下半年经济增长动能，尤其是内需动能还需要来自政策的持续支持。此外，GDP 平减指数连续 9 个季度为负，表明当前我国供给强于需求的格局尚未得到实质性改善，当前经济还没有走出低通胀环境。在国内结构性矛盾持续存在、国际贸易环境更加复杂的背景下，政策的逆周期调节不会缺位。且“适度宽松”基调下的 2025 年有望比“稳健的”2024 年拥有更宽松的货币环境，从而为实体经济和资本市场提供更强的助力。在政策组合拳的发力之下，我国经济有望企稳回升，A 股业绩也有望实现温和复苏，在充裕的宏观流动性支持下，市场风险偏好和估值中枢也有望得到支撑。从历史数据来看，A 股历史上多次牛市都是在政策积极而经济基本面较弱的背景下诞生的。因此我们判断，在政策积极托举下，我国宏观经济有望实现增长稳、就业稳和物价合理回升的优化组合，A 股盈利有望回到长期增长通道，且在充裕的流动性支持之下，有望获得不错的投资回报率。

#### 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。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 2025 年 05 月 22 日至 2025 年 06 月 24 日连续 23 个工作日基金资产净值低于五千万  
元。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金托管人根据《证券投资基金法》等有关法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，对本基金的基金资产净值计算以及利润分配等方面进行了复核审查，对本基金投资范围、投资比例限制、关联方交易、投资风格进行了监督。

#### 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

本报告期内，本基金托管人依法复核前海开源基金管理有限公司编制和披露的 2025 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告、投资组合报告等内容，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产           | 附注号        | 本期末<br>2025 年 06 月 30 日         | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>   |            |                                 |                                  |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 436,791.57                      | 346,287.98                       |
| 结算备付金         |            | 229,100.87                      | 129,176.32                       |
| 存出保证金         |            | 144,443.70                      | 226,485.82                       |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 49,884,143.85                   | 56,273,418.72                    |
| 其中：股票投资       |            | 49,379,640.00                   | 55,767,101.73                    |
| 基金投资          |            | -                               | -                                |
| 债券投资          |            | 504,503.85                      | 506,316.99                       |
| 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         |            | -                               | 96,107.98                        |
| 应收股利          |            | -                               | -                                |
| 应收申购款         |            | -                               | -                                |
| 递延所得税资产       |            | -                               | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                               | -                                |
| 资产总计          |            | 50,694,479.99                   | 57,071,476.82                    |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2025 年 06 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2024 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         |            | 20,773.49                       | 46,280.02                        |
| 应付赎回款         |            | -                               | -                                |
| 应付管理人报酬       |            | 6,070.29                        | 7,488.51                         |
| 应付托管费         |            | 2,023.45                        | 2,496.18                         |
| 应付销售服务费       |            | -                               | -                                |
| 应付投资顾问费       |            | -                               | -                                |
| 应交税费          |            | -                               | 1,056.93                         |
| 应付利润          |            | -                               | -                                |
| 递延所得税负债       |            | -                               | -                                |
| 其他负债          | 6.4.7.6    | 53,363.17                       | 18,059.00                        |
| 负债合计          |            | 82,230.40                       | 75,380.64                        |
| <b>净资产：</b>   |            |                                 |                                  |

|          |         |               |               |
|----------|---------|---------------|---------------|
| 实收基金     | 6.4.7.7 | 34,113,665.00 | 40,113,665.00 |
| 未分配利润    | 6.4.7.8 | 16,498,584.59 | 16,882,431.18 |
| 净资产合计    |         | 50,612,249.59 | 56,996,096.18 |
| 负债和净资产总计 |         | 50,694,479.99 | 57,071,476.82 |

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，前海开源中证 500 等权 ETF 基金份额净值 1.4836 元，基金份额总额 34,113,665.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期<br>2025 年 01 月 01<br>日至 2025 年 06<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 01 月 01<br>日至 2024 年 06 月<br>30 日 |
|------------------------|------------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>         |            | 2,466,624.03                                   | -2,408,670.15                                       |
| 1. 利息收入                |            | 2,135.99                                       | 4,148.38  |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.9    | 2,135.99                                       | 4,148.38  |
| 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）      |            | 2,202,457.22                                   | -1,143,585.30                                       |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.10   | 1,686,312.26                                   | -1,405,262.01                                       |
| 基金投资收益                 | 6.4.7.11   | -  | -   |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.12   | 6,172.73                                       | 8,844.49  |
| 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   | -252.59  | -62,124.41  |
| 股利收益                   | 6.4.7.16   | 510,224.82                                     | 314,956.63  |
| 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   | 250,088.66                                     | -1,302,596.20                                       |
| 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   | 11,942.16                                      | 33,362.97   |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |            | 133,022.63                                     | 71,817.53   |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 39,396.18                                      | 20,893.11   |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 13,132.05                                      | 6,964.22  |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | -  | -   |
| 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            |          | 183.56       | -             |
| 8. 其他费用             | 6.4.7.20 | 80,310.84    | 43,960.20     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 2,333,601.40 | -2,480,487.68 |
| 减：所得税费用             |          | -            | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 2,333,601.40 | -2,480,487.68 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |          | -            | -             |
| 六、综合收益总额            |          | 2,333,601.40 | -2,480,487.68 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日      |               |                |
|--|---|---------------|----------------|
|  | 实收基金  | 未分配<br>利润     | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产                                | 40,113,665.00                                 | 16,882,431.18 | 56,996,096.18  |
| 二、本期期初净资产                                | 40,113,665.00                                 | 16,882,431.18 | 56,996,096.18  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -6,000,000.00                                 | -383,846.59   | -6,383,846.59  |
| （一）、综合收益总额                               | -   | 2,333,601.40  | 2,333,601.40   |
| （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）      | -6,000,000.00                                 | -2,717,447.99 | -8,717,447.99  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 2,000,000.00                                  | 806,460.17    | 2,806,460.17   |
| 2. 基金赎回款                                 | -8,000,000.00                                 | -3,523,908.16 | -11,523,908.16 |
| （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                                | 34,113,665.00                                 | 16,498,584.59 | 50,612,249.59  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |               |                |
|  | 实收基金  | 未分配<br>利润     | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产                                | 22,113,665.00                                 | 7,542,223.74  | 29,655,888.74  |
| 二、本期期初净资产                                | 22,113,665.00                                 | 7,542,223.74  | 29,655,888.74  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -2,000,000.00                                 | -3,217,276.15 | -5,217,276.15  |
| （一）、综合收益总额                               | -   | -2,480,487.68 | -2,480,487.68  |
| （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）      | -2,000,000.00                                 | -736,788.47   | -2,736,788.47  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 56,000,000.00                                 | 18,016,944.19 | 74,016,944.19  |

|  |                |                |                |
|--|----------------|----------------|----------------|
| 2. 基金赎回款                                 | -58,000,000.00 | -18,753,732.66 | -76,753,732.66 |
| (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                                | 20,113,665.00  | 4,324,947.59   | 24,438,612.59  |

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

基金管理人负责人

王厚琼

主管会计工作负责人

傅智

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1538 号《关于准予前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由前海开源基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 760,113,665.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0649 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 11 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 760,113,665.00 份,无认购资金利息折份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司,基金托管人为中国银河证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]10 号审核同意,本基金 760,113,665.00 份基金份额于 2020 年 1 月 20 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股。为更好的实现投资目标,可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、政府支持机构债券、政府支持债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:在完成建仓后,投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为:中证 500 等权重指数收益率。



## 6.4.2 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 3 号《半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。

## 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

### （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。

### 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<br>2025 年 06 月 30 日 |
|--------|-------------------------|
| 活期存款   | 436,791.57              |
| 等于：本金  | 436,683.61              |
| 加：应计利息 | 107.96                  |
| 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             | 436,791.57 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2025 年 06 月 30 日 |          |               |              |
|---------------|-------|-------------------------|----------|---------------|--------------|
|               |       | 成本                      | 应计利息     | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票            |       | 46,681,523.12           | -        | 49,379,640.00 | 2,698,116.88 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                       | -        | -             | -            |
| 债券            | 交易所市场 | 501,425.00              | 2,653.85 | 504,503.85    | 425.00       |
|               | 银行间市场 | -                       | -        | -             | -            |
|               | 合计    | 501,425.00              | 2,653.85 | 504,503.85    | 425.00       |
| 资产支持证券        |       | -                       | -        | -             | -            |
| 基金            |       | -                       | -        | -             | -            |
| 其他            |       | -                       | -        | -             | -            |
| 合计            |       | 47,182,948.12           | 2,653.85 | 49,884,143.85 | 2,698,541.88 |

#### 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<br>2025 年 06 月 30 日 |      |    |    |
|-----------|--|-------------------------|------|----|----|
|           |  | 合同/名义<br>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    |  | 1,076,640.00            | -    | -  | -  |
| 其中：股指期货投资 |  | 1,076,640.00            | -    | -  | -  |
| 其他衍生工具    |  | -                       | -    | -  | -  |
| 合计        |  | 1,076,640.00            | -    | -  | -  |

##### 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    |
|--------|----------|----------|--------------|-----------|
| IC2512 | 中证 500 股 | 1.00     | 1,131,120.00 | 54,480.00 |

|            |             |  |  |           |
|------------|-------------|--|--|-----------|
|            | 指期货 2512 合约 |  |  |           |
| 合计         |             |  |  | 54,480.00 |
| 减：可抵销期货暂收款 |             |  |  | 54,480.00 |
| 净额         |             |  |  | 0.00      |

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 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<br>2025 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      | 3,774.60                |
| 其中：交易所市场    | 3,774.60                |
| 银行间市场       | —                       |
| 应付利息        | —                       |
| 预提费用        | 49,588.57               |
| 合计          | 53,363.17               |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |               |
|------|--|---------------|
|      | 基金份额（份）                                  | 账面金额          |
| 上年度末 | 40,113,665.00                            | 40,113,665.00 |

|               |               |               |
|---------------|---------------|---------------|
| 本期申购          | 2,000,000.00  | 2,000,000.00  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -8,000,000.00 | -8,000,000.00 |
| 本期末           | 34,113,665.00 | 34,113,665.00 |

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | 26,857,766.98 | -9,975,335.80 | 16,882,431.18 |
| 本期期初           | 26,857,766.98 | -9,975,335.80 | 16,882,431.18 |
| 本期利润           | 2,083,512.74  | 250,088.66    | 2,333,601.40  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -4,074,861.40 | 1,357,413.41  | -2,717,447.99 |
| 其中：基金申购款       | 1,364,169.56  | -557,709.39   | 806,460.17    |
| 基金赎回款          | -5,439,030.96 | 1,915,122.80  | -3,523,908.16 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 24,866,418.32 | -8,367,833.73 | 16,498,584.59 |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |
|-----------|--|
| 活期存款利息收入  | 2,029.89                                 |
| 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 | 38.07                                    |
| 其他        | 68.03                                    |
| 合计        | 2,135.99                                 |

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |
|------------------|--|
| 股票投资收益--买卖股票差价收入 | 1,326,163.27                             |
| 股票投资收益--赎回差价收入   | 360,148.99                               |
| 股票投资收益--申购差价收入   | -  |
| 股票投资收益--证券出借差价收入 | -  |
| 合计               | 1,686,312.26                             |

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益--买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |
|----|--|
|----|--|

|            |               |
|------------|---------------|
| 卖出股票成交总额   | 12,045,143.57 |
| 减：卖出股票成本总额 | 10,707,284.84 |
| 减：交易费用     | 11,695.46     |
| 买卖股票差价收入   | 1,326,163.27  |

#### 6.4.7.10.3 股票投资收益--赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |
|-------------|--|
| 赎回基金份额对价总额  | 11,523,908.16                            |
| 减：现金支付赎回款总额 | 4,471,798.16                             |
| 减：赎回股票成本总额  | 6,691,961.01                             |
| 减：交易费用      | -  |
| 赎回差价收入      | 360,148.99                               |

#### 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<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |
|----------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益--利息收入                     | 3,533.75                      |
| 债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付）<br>差价收入 | 2,638.98                      |
| 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                               | 6,172.73                      |

##### 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<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 523,866.50                    |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 513,275.00                    |
| 减：应计利息总额               | 7,951.88                      |
| 减：交易费用                 | 0.64                          |
| 买卖债券差价收入               | 2,638.98                      |

#### 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<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |
|----------|--|
| 股指期货投资收益 | -252.59                                  |

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |
|---------------|--|
| 股票投资产生的股利收益   | 510,224.82                               |
| 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            | 510,224.82                               |

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |
|------------|--|
| 1. 交易性金融资产 | 169,208.66                               |
| --股票投资     | 168,958.66                               |
| --债券投资     | 250.00                                   |



|                        |            |
|------------------------|------------|
| —资产支持证券投资              | —          |
| —基金投资                  | —          |
| —贵金属投资                 | —          |
| —其他                    | —          |
| 2. 衍生工具                | 80,880.00  |
| —权证投资                  | —          |
| —期货投资                  | 80,880.00  |
| 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                     | 250,088.66 |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |
|---------|--|
| 基金赎回费收入 | —  |
| 替代损益收入  | 11,942.16                                |
| 合计      | 11,942.16                                |

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

#### 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<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |
|---------|--|
| 审计费用    | 9,916.99                                 |
| 信息披露费   | 39,671.58                                |
| 证券出借违约金 | —  |
| 指数使用费   | 30,722.27                                |
| 合计      | 80,310.84                                |

### 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、基金销售机构 |
| 中国银河证券股份有限公司（“中国银河证券”） | 基金托管人、基金销售机构 |

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

金额单位：人民币元

| 关联方名称  | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |                  | 上年度可比期间<br>2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |                  |
|--------|--|------------------|---|------------------|
|        | 成交金额                                     | 占当期股票<br>成交总额的比例 | 成交金额  | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 中国银河证券 | 21,139,705.65                            | 100.00%          | 77,317,986.12                                 | 95.85%           |

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称  | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |                  | 上年度可比期间<br>2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |                  |
|--------|--|------------------|---|------------------|
|        | 成交金额                                     | 占当期债券<br>成交总额的比例 | 成交金额  | 占当期债券<br>成交总额的比例 |
| 中国银河证券 | 515,041.50                               | 100.00%          | 648,134.31                                    | 23.57%           |

###### 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称  | 本期<br>2025年01月01日至2025年06月30日      |                |           |                  |
|--------|------------------------------------|----------------|-----------|------------------|
|        | 当期<br>佣金                           | 占当期佣金总量的<br>比例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣金总<br>额的比例 |
| 中国银河证券 | 4,352.81                           | 100.00%        | 3,774.60  | 100.00%          |
| 关联方名称  | 上年度可比期间<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |                |           |                  |
|        | 当期<br>佣金                           | 占当期佣金总量的<br>比例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣金总<br>额的比例 |
| 中国银河证券 | 57,671.93                          | 95.85%         | 21,945.80 | 89.78%           |

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

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，针对被动股票型基金佣金协议的服务范围不包括研究服务、流动性服务等。

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<br>2025年01月01日至<br>2025年06月30日 | 上年度可比期间<br>2024年01月01日至<br>2024年06月30日 |
|------------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 39,396.18                         | 20,893.11                              |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 5,174.53                          | -                                      |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 34,221.65                         | 20,893.11                              |

注：支付基金管理人前海开源基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2025年01月01日至2025年<br>06月30日 | 上年度可比期间<br>2024年01月01日至2024<br>年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 13,132.05                         | 6,964.22                               |

注：支付基金托管人中国银河证券的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计

至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                               | 本期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025<br>年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 01 月 01 日至 2024<br>年 06 月 30 日 |
|----------------------------------|---|--|
| 基金合同生效日（2019 年 11 月 14 日）持有的基金份额 | —   | —  |
| 报告期初持有的基金份额                      | 21,194,900.00                               | —  |
| 报告期间申购/买入总份额                     | —   | —  |
| 报告期间因拆分变动份额                      | —   | —  |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                   | —   | —  |
| 报告期末持有的基金份额                      | 21,194,900.00                               | —  |
| 报告期末持有的基金份额占基金总<br>份额比例          | 62.13%                                      | —  |

##### 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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 | 上年度末 |
|-------|-----|------|
|-------|-----|------|

|            | 2025 年 06 月 30 日 |                              | 2024 年 12 月 31 日 |                          |
|------------|------------------|------------------------------|------------------|--------------------------|
|            | 持有的<br>基金份额      | 持有的基金份<br>额<br>占基金总份额<br>的比例 | 持有的<br>基金份额      | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 |
| 中国银河证<br>券 | 114,540.00       | 0.34%                        | 114,540.00       | 0.29%                    |

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。

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末 2025 年 06 月 30 日本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：债券 |          |                        |                  |            |          |            |                  |            |            |    |
|----------------------|----------|------------------------|------------------|------------|----------|------------|------------------|------------|------------|----|
| 证券<br>代码             | 证券<br>名称 | 成功<br>认购日              | 受限期              | 流通受<br>限类型 | 认购<br>价格 | 期末估<br>值单价 | 数量<br>(单位：<br>张) | 期末<br>成本总额 | 期末估值<br>总额 | 备注 |
| 123257               | 安克转债     | 2025 年<br>06 月 16<br>日 | 1 个月<br>内<br>(含) | 新债未<br>上市  | 100.00   | 100.01     | 23               | 2,300.00   | 2,300.15   | -  |

##### 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。

#### 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<br>2025 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | —                       | —                        |
| A-1 以下 | —                       | —                        |
| 未评级    | 502,203.70              | 506,316.99               |
| 合计     | 502,203.70              | 506,316.99               |

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<br>2025 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | —                       | —                        |
| AAA 以下 | 2,300.15                | —                        |
| 未评级    | —                       | —                        |
| 合计     | 2,300.15                | —                        |

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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。

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<br>2025 年 06 月 30<br>日 | 1 年以内      | 1-5 年 | 5 年以上    | 不计息           | 合计            |
|----------------------------|------------|-------|----------|---------------|---------------|
| 资产                         |            |       |          |               |               |
| 货币资金                       | 436,791.57 | -     | -        | -             | 436,791.57    |
| 结算备付金                      | 7,064.72   | -     | -        | 222,036.15    | 229,100.87    |
| 存出保证金                      | 8,709.30   | -     | -        | 135,734.40    | 144,443.70    |
| 交易性金融资产                    | 502,203.70 | -     | 2,300.15 | 49,379,640.00 | 49,884,143.85 |
| 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                      | -          | -     | -        | -             | -             |
| 递延所得税资产                    | -          | -     | -        | -             | -             |
| 其他资产                       | -          | -     | -        | -             | -             |
| 资产总计                       | 954,769.29 | -     | 2,300.15 | 49,737,410.55 | 50,694,479.99 |
| 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                      | -          | -     | -        | 20,773.49     | 20,773.49     |

|                             |              |       |          |               |               |
|-----------------------------|--------------|-------|----------|---------------|---------------|
| 应付赎回款                       | -            | -     | -        | -             | -             |
| 应付管理人报酬                     | -            | -     | -        | 6,070.29      | 6,070.29      |
| 应付托管费                       | -            | -     | -        | 2,023.45      | 2,023.45      |
| 应付销售服务费                     | -            | -     | -        | -             | -             |
| 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                        | -            | -     | -        | 53,363.17     | 53,363.17     |
| 负债总计                        | -            | -     | -        | 82,230.40     | 82,230.40     |
| 利率敏感度缺口                     | 954,769.29   | -     | 2,300.15 | 49,655,180.15 | 50,612,249.59 |
| 上年度末<br>2024 年 12 月 31<br>日 | 1 年以内        | 1-5 年 | 5 年以上    | 不计息           | 合计            |
| 资产                          |              |       |          |               |               |
| 货币资金                        | 346,287.98   | -     | -        | -             | 346,287.98    |
| 结算备付金                       | 89,772.49    | -     | -        | 39,403.83     | 129,176.32    |
| 存出保证金                       | 90,276.22    | -     | -        | 136,209.60    | 226,485.82    |
| 交易性金融资产                     | 506,316.99   | -     | -        | 55,767,101.73 | 56,273,418.72 |
| 衍生金融资产                      | -            | -     | -        | -             | -             |
| 买入返售金融资产                    | -            | -     | -        | -             | -             |
| 应收清算款                       | -            | -     | -        | 96,107.98     | 96,107.98     |
| 应收股利                        | -            | -     | -        | -             | -             |
| 应收申购款                       | -            | -     | -        | -             | -             |
| 递延所得税资产                     | -            | -     | -        | -             | -             |
| 其他资产                        | -            | -     | -        | -             | -             |
| 资产总计                        | 1,032,653.68 | -     | -        | 56,038,823.14 | 57,071,476.82 |
| 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                       | -            | -     | -        | 46,280.02     | 46,280.02     |
| 应付赎回款                       | -            | -     | -        | -             | -             |
| 应付管理人报酬                     | -            | -     | -        | 7,488.51      | 7,488.51      |
| 应付托管费                       | -            | -     | -        | 2,496.18      | 2,496.18      |
| 应付销售服务费                     | -            | -     | -        | -             | -             |
| 应付投资顾问费                     | -            | -     | -        | -             | -             |
| 应交税费                        | -            | -     | -        | 1,056.93      | 1,056.93      |
| 应付利润                        | -            | -     | -        | -             | -             |
| 递延所得税负债                     | -            | -     | -        | -             | -             |

|         |              |   |   |               |               |
|---------|--------------|---|---|---------------|---------------|
| 其他负债    | -            | - | - | 18,059.00     | 18,059.00     |
| 负债总计    | -            | - | - | 75,380.64     | 75,380.64     |
| 利率敏感度缺口 | 1,032,653.68 | - | - | 55,963,442.50 | 56,996,096.18 |

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<br>影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                    | 本期末（2025 年 06 月 30 日）           | 上年度末（2024 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 680.53                          | 398.15                 |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | -678.69                         | -397.53                |

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。

本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 等权重指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，中证 500 等权重指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 90%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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

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 |
|----|-----|------|

|               | 2025 年 06 月 30 日 |               | 2024 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  | 49,379,640.00    | 97.56         | 55,767,101.73    | 97.84         |
| 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            | 49,379,640.00    | 97.56         | 55,767,101.73    | 97.84         |

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（2025 年 06 月 30 日）       | 上年度末（2024 年 12 月 31 日） |
|    | 业绩比较基准上升 5%          | 2,681,833.88                | 2,845,109.09           |
|    | 业绩比较基准下降 5%          | -2,681,833.88               | -2,845,109.09          |

#### 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<br>2025 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 49,379,640.00           | 55,767,101.73            |
| 第二层次          | 504,503.85              | 506,316.99               |

|      |               |               |
|------|---------------|---------------|
| 第三层次 | —             | —             |
| 合计   | 49,884,143.85 | 56,273,418.72 |

#### 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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 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(2024 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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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              | 49,379,640.00 | 97.41        |
|    | 其中：股票             | 49,379,640.00 | 97.41        |
| 2  | 基金投资              | —             | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 504,503.85    | 1.00         |
|    | 其中：债券             | 504,503.85    | 1.00         |
|    | 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      | 665,892.44    | 1.31         |

|   |        |               |        |
|---|--------|---------------|--------|
| 8 | 其他各项资产 | 144,443.70    | 0.28   |
| 9 | 合计     | 50,694,479.99 | 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         | 183,830.00    | 0.36         |
| B  | 采矿业              | 1,839,736.38  | 3.63         |
| C  | 制造业              | 30,678,181.90 | 60.61        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,320,071.38  | 4.58         |
| E  | 建筑业              | 572,988.00    | 1.13         |
| F  | 批发和零售业           | 1,231,017.66  | 2.43         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,284,730.00  | 2.54         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 172,878.00    | 0.34         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,484,145.25  | 6.88         |
| J  | 金融业              | 4,206,570.63  | 8.31         |
| K  | 房地产业             | 793,924.00    | 1.57         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 385,421.00    | 0.76         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 478,480.20    | 0.95         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 270,592.52    | 0.53         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —             | —            |
| P  | 教育               | 95,166.00     | 0.19         |
| Q  | 卫生和社会工作          | 292,343.08    | 0.58         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 959,308.00    | 1.90         |
| S  | 综合               | 130,256.00    | 0.26         |
|    | 合计               | 49,379,640.00 | 97.56        |

### 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  | 688617 | 惠泰医疗 | 580    | 172,260.00 | 0.34 |
| 2  | 603228 | 景旺电子 | 3,582  | 149,870.88 | 0.30 |
| 3  | 002558 | 巨人网络 | 6,200  | 146,010.00 | 0.29 |
| 4  | 688520 | 神州细胞 | 2,388  | 142,921.80 | 0.28 |
| 5  | 688608 | 恒玄科技 | 400    | 139,192.00 | 0.28 |
| 6  | 300476 | 胜宏科技 | 1,000  | 134,380.00 | 0.27 |
| 7  | 600095 | 湘财股份 | 13,299 | 133,388.97 | 0.26 |
| 8  | 688002 | 睿创微纳 | 1,900  | 132,468.00 | 0.26 |
| 9  | 301165 | 锐捷网络 | 2,140  | 131,524.40 | 0.26 |
| 10 | 600673 | 东阳光  | 11,200 | 130,256.00 | 0.26 |
| 11 | 603129 | 春风动力 | 600    | 129,900.00 | 0.26 |
| 12 | 300803 | 指南针  | 1,595  | 128,652.70 | 0.25 |
| 13 | 600435 | 北方导航 | 8,240  | 128,461.60 | 0.25 |
| 14 | 002281 | 光迅科技 | 2,600  | 128,232.00 | 0.25 |
| 15 | 000519 | 中兵红箭 | 5,800  | 126,962.00 | 0.25 |
| 16 | 600862 | 中航高科 | 4,800  | 125,184.00 | 0.25 |
| 17 | 688065 | 凯赛生物 | 2,600  | 122,460.00 | 0.24 |
| 18 | 300251 | 光线传媒 | 6,000  | 121,620.00 | 0.24 |
| 19 | 688122 | 西部超导 | 2,341  | 121,451.08 | 0.24 |
| 20 | 002065 | 东华软件 | 12,600 | 120,960.00 | 0.24 |
| 21 | 603298 | 杭叉集团 | 5,700  | 119,415.00 | 0.24 |
| 22 | 600879 | 航天电子 | 11,400 | 119,358.00 | 0.24 |
| 23 | 600764 | 中国海防 | 3,500  | 119,000.00 | 0.24 |
| 24 | 689009 | 九号公司 | 2,004  | 118,576.68 | 0.23 |
| 25 | 000887 | 中鼎股份 | 6,700  | 117,853.00 | 0.23 |
| 26 | 002261 | 拓维信息 | 3,800  | 117,610.00 | 0.23 |
| 27 | 688220 | 翱捷科技 | 1,500  | 117,450.00 | 0.23 |
| 28 | 000997 | 新大陆  | 3,600  | 116,568.00 | 0.23 |
| 29 | 603486 | 科沃斯  | 2,000  | 116,460.00 | 0.23 |
| 30 | 603379 | 三美股份 | 2,420  | 116,450.40 | 0.23 |
| 31 | 601717 | 中创智领 | 7,000  | 116,340.00 | 0.23 |
| 32 | 603979 | 金诚信  | 2,500  | 116,100.00 | 0.23 |
| 33 | 002966 | 苏州银行 | 13,220 | 116,071.60 | 0.23 |
| 34 | 601198 | 东兴证券 | 10,400 | 115,960.00 | 0.23 |
| 35 | 601162 | 天风证券 | 23,500 | 115,855.00 | 0.23 |
| 36 | 688521 | 芯原股份 | 1,200  | 115,800.00 | 0.23 |
| 37 | 002683 | 广东宏大 | 3,400  | 115,396.00 | 0.23 |
| 38 | 000426 | 兴业银锡 | 7,300  | 115,340.00 | 0.23 |
| 39 | 600060 | 海信视像 | 5,000  | 115,100.00 | 0.23 |
| 40 | 688318 | 财富趋势 | 1,000  | 114,920.00 | 0.23 |
| 41 | 600499 | 科达制造 | 11,700 | 114,660.00 | 0.23 |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 42 | 603688 | 石英股份 | 3,250  | 114,465.00 | 0.23 |
| 43 | 002152 | 广电运通 | 8,500  | 114,240.00 | 0.23 |
| 44 | 002472 | 双环传动 | 3,400  | 113,866.00 | 0.22 |
| 45 | 601665 | 齐鲁银行 | 18,000 | 113,760.00 | 0.22 |
| 46 | 301308 | 江波龙  | 1,300  | 113,737.00 | 0.22 |
| 47 | 601155 | 新城控股 | 8,300  | 113,544.00 | 0.22 |
| 48 | 688561 | 奇安信  | 3,339  | 113,459.22 | 0.22 |
| 49 | 601555 | 东吴证券 | 12,940 | 113,225.00 | 0.22 |
| 50 | 002670 | 国盛金控 | 7,500  | 112,875.00 | 0.22 |
| 51 | 002414 | 高德红外 | 11,000 | 112,750.00 | 0.22 |
| 52 | 688183 | 生益电子 | 2,200  | 112,640.00 | 0.22 |
| 53 | 300748 | 金力永磁 | 4,720  | 112,524.80 | 0.22 |
| 54 | 603737 | 三棵树  | 3,052  | 112,466.20 | 0.22 |
| 55 | 300395 | 菲利华  | 2,200  | 112,420.00 | 0.22 |
| 56 | 688017 | 绿的谐波 | 900    | 112,401.00 | 0.22 |
| 57 | 688297 | 中无人机 | 2,100  | 112,140.00 | 0.22 |
| 58 | 600498 | 烽火通信 | 5,300  | 111,459.00 | 0.22 |
| 59 | 002080 | 中材科技 | 5,700  | 111,150.00 | 0.22 |
| 60 | 002185 | 华天科技 | 11,000 | 111,100.00 | 0.22 |
| 61 | 600208 | 衢州发展 | 37,400 | 110,704.00 | 0.22 |
| 62 | 300017 | 网宿科技 | 10,300 | 110,416.00 | 0.22 |
| 63 | 688301 | 奕瑞科技 | 1,260  | 110,388.60 | 0.22 |
| 64 | 000733 | 振华科技 | 2,200  | 110,110.00 | 0.22 |
| 65 | 688027 | 国盾量子 | 400    | 110,004.00 | 0.22 |
| 66 | 600398 | 海澜之家 | 15,800 | 109,968.00 | 0.22 |
| 67 | 002926 | 华西证券 | 12,300 | 109,962.00 | 0.22 |
| 68 | 000987 | 越秀资本 | 15,990 | 109,691.40 | 0.22 |
| 69 | 300073 | 当升科技 | 2,500  | 109,675.00 | 0.22 |
| 70 | 688385 | 复旦微电 | 2,225  | 109,625.75 | 0.22 |
| 71 | 301498 | 乖宝宠物 | 1,000  | 109,370.00 | 0.22 |
| 72 | 600580 | 卧龙电驱 | 5,520  | 109,130.40 | 0.22 |
| 73 | 300373 | 扬杰科技 | 2,100  | 108,990.00 | 0.22 |
| 74 | 603659 | 璞泰来  | 5,800  | 108,924.00 | 0.22 |
| 75 | 000623 | 吉林敖东 | 6,410  | 108,649.50 | 0.21 |
| 76 | 002517 | 恺英网络 | 5,600  | 108,136.00 | 0.21 |
| 77 | 600271 | 航天信息 | 11,700 | 108,108.00 | 0.21 |
| 78 | 688072 | 拓荆科技 | 700    | 107,597.00 | 0.21 |
| 79 | 600578 | 京能电力 | 23,800 | 106,862.00 | 0.21 |
| 80 | 300450 | 先导智能 | 4,300  | 106,855.00 | 0.21 |
| 81 | 601933 | 永辉超市 | 21,800 | 106,820.00 | 0.21 |
| 82 | 600699 | 均胜电子 | 6,100  | 106,384.00 | 0.21 |



|     |        |       |        |            |      |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 83  | 603893 | 瑞芯微   | 700    | 106,302.00 | 0.21 |
| 84  | 600685 | 中船防务  | 3,900  | 106,041.00 | 0.21 |
| 85  | 000009 | 中国宝安  | 11,900 | 105,672.00 | 0.21 |
| 86  | 601991 | 大唐发电  | 33,300 | 105,561.00 | 0.21 |
| 87  | 600316 | 洪都航空  | 2,800  | 105,560.00 | 0.21 |
| 88  | 688819 | 天能股份  | 3,800  | 105,488.00 | 0.21 |
| 89  | 688234 | 天岳先进  | 1,800  | 105,390.00 | 0.21 |
| 90  | 002044 | 美年健康  | 20,500 | 105,370.00 | 0.21 |
| 91  | 688180 | 君实生物  | 3,100  | 105,338.00 | 0.21 |
| 92  | 688188 | 柏楚电子  | 800    | 105,328.00 | 0.21 |
| 93  | 000032 | 深桑达 A | 5,200  | 105,196.00 | 0.21 |
| 94  | 600884 | 杉杉股份  | 11,100 | 105,006.00 | 0.21 |
| 95  | 300757 | 罗博特科  | 700    | 104,979.00 | 0.21 |
| 96  | 688052 | 纳芯微   | 600    | 104,694.00 | 0.21 |
| 97  | 600549 | 厦门钨业  | 5,000  | 104,600.00 | 0.21 |
| 98  | 002444 | 巨星科技  | 4,100  | 104,591.00 | 0.21 |
| 99  | 002465 | 海格通信  | 7,500  | 104,550.00 | 0.21 |
| 100 | 300676 | 华大基因  | 2,100  | 104,517.00 | 0.21 |
| 101 | 600816 | 建元信托  | 35,400 | 104,430.00 | 0.21 |
| 102 | 000750 | 国海证券  | 25,330 | 104,359.60 | 0.21 |
| 103 | 603596 | 伯特利   | 1,980  | 104,326.20 | 0.21 |
| 104 | 300558 | 贝达药业  | 1,800  | 104,310.00 | 0.21 |
| 105 | 002203 | 海亮股份  | 10,100 | 104,232.00 | 0.21 |
| 106 | 300037 | 新宙邦   | 2,960  | 104,192.00 | 0.21 |
| 107 | 600562 | 国睿科技  | 3,300  | 103,917.00 | 0.21 |
| 108 | 600927 | 永安期货  | 7,000  | 103,670.00 | 0.20 |
| 109 | 601456 | 国联民生  | 10,000 | 103,500.00 | 0.20 |
| 110 | 600329 | 达仁堂   | 3,100  | 103,416.00 | 0.20 |
| 111 | 300765 | 新诺威   | 2,000  | 103,380.00 | 0.20 |
| 112 | 300763 | 锦浪科技  | 1,800  | 103,302.00 | 0.20 |
| 113 | 002056 | 横店东磁  | 7,300  | 103,295.00 | 0.20 |
| 114 | 300604 | 长川科技  | 2,300  | 103,293.00 | 0.20 |
| 115 | 600535 | 天士力   | 6,600  | 103,290.00 | 0.20 |
| 116 | 300487 | 蓝晓科技  | 2,050  | 103,115.00 | 0.20 |
| 117 | 300383 | 光环新网  | 7,200  | 102,960.00 | 0.20 |
| 118 | 688281 | 华秦科技  | 1,700  | 102,867.00 | 0.20 |
| 119 | 002025 | 航天电器  | 2,000  | 102,820.00 | 0.20 |
| 120 | 600895 | 张江高科  | 4,000  | 102,800.00 | 0.20 |
| 121 | 601128 | 常熟银行  | 13,948 | 102,796.76 | 0.20 |
| 122 | 601696 | 中银证券  | 9,600  | 102,624.00 | 0.20 |
| 123 | 000960 | 锡业股份  | 6,700  | 102,510.00 | 0.20 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 124 | 000893 | 亚钾国际 | 3,400  | 102,476.00 | 0.20 |
| 125 | 600521 | 华海药业 | 5,500  | 102,465.00 | 0.20 |
| 126 | 688578 | 艾力斯  | 1,100  | 102,344.00 | 0.20 |
| 127 | 688213 | 思特威  | 1,000  | 102,220.00 | 0.20 |
| 128 | 688375 | 国博电子 | 1,700  | 102,017.00 | 0.20 |
| 129 | 002436 | 兴森科技 | 7,700  | 101,948.00 | 0.20 |
| 130 | 688563 | 航材股份 | 1,800  | 101,934.00 | 0.20 |
| 131 | 002850 | 科达利  | 900    | 101,853.00 | 0.20 |
| 132 | 000878 | 云南铜业 | 8,000  | 101,760.00 | 0.20 |
| 133 | 603341 | 龙旗科技 | 2,500  | 101,575.00 | 0.20 |
| 134 | 600583 | 海油工程 | 18,600 | 101,556.00 | 0.20 |
| 135 | 002423 | 中粮资本 | 8,300  | 101,509.00 | 0.20 |
| 136 | 002353 | 杰瑞股份 | 2,900  | 101,500.00 | 0.20 |
| 137 | 300002 | 神州泰岳 | 8,600  | 101,480.00 | 0.20 |
| 138 | 688120 | 华海清科 | 600    | 101,220.00 | 0.20 |
| 139 | 000021 | 深科技  | 5,400  | 101,196.00 | 0.20 |
| 140 | 000783 | 长江证券 | 14,600 | 101,178.00 | 0.20 |
| 141 | 688525 | 佰维存储 | 1,500  | 101,100.00 | 0.20 |
| 142 | 688361 | 中科飞测 | 1,200  | 101,028.00 | 0.20 |
| 143 | 002340 | 格林美  | 15,900 | 100,965.00 | 0.20 |
| 144 | 688278 | 特宝生物 | 1,400  | 100,954.00 | 0.20 |
| 145 | 601231 | 环旭电子 | 6,900  | 100,947.00 | 0.20 |
| 146 | 600369 | 西南证券 | 23,200 | 100,920.00 | 0.20 |
| 146 | 600486 | 扬农化工 | 1,740  | 100,920.00 | 0.20 |
| 148 | 600038 | 中直股份 | 2,600  | 100,906.00 | 0.20 |
| 149 | 002195 | 岩山科技 | 17,900 | 100,777.00 | 0.20 |
| 150 | 600808 | 马钢股份 | 29,200 | 100,740.00 | 0.20 |
| 151 | 300699 | 光威复材 | 3,180  | 100,710.60 | 0.20 |
| 152 | 002595 | 豪迈科技 | 1,700  | 100,674.00 | 0.20 |
| 152 | 300001 | 特锐德  | 4,200  | 100,674.00 | 0.20 |
| 154 | 600153 | 建发股份 | 9,700  | 100,589.00 | 0.20 |
| 155 | 300054 | 鼎龙股份 | 3,500  | 100,380.00 | 0.20 |
| 156 | 002841 | 视源股份 | 2,900  | 100,340.00 | 0.20 |
| 157 | 300207 | 欣旺达  | 5,000  | 100,300.00 | 0.20 |
| 158 | 600378 | 昊华科技 | 3,700  | 100,159.00 | 0.20 |
| 159 | 600707 | 彩虹股份 | 15,500 | 100,130.00 | 0.20 |
| 160 | 600339 | 中油工程 | 30,600 | 100,062.00 | 0.20 |
| 161 | 002130 | 沃尔核材 | 4,200  | 100,044.00 | 0.20 |
| 162 | 600143 | 金发科技 | 9,700  | 100,007.00 | 0.20 |
| 163 | 002156 | 通富微电 | 3,900  | 99,918.00  | 0.20 |
| 164 | 603786 | 科博达  | 1,800  | 99,738.00  | 0.20 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 165 | 002939 | 长城证券 | 11,900 | 99,722.00 | 0.20 |
| 166 | 600390 | 五矿资本 | 17,100 | 99,693.00 | 0.20 |
| 167 | 601958 | 金钼股份 | 9,100  | 99,554.00 | 0.20 |
| 168 | 000598 | 兴蓉环境 | 13,800 | 99,498.00 | 0.20 |
| 169 | 603160 | 汇顶科技 | 1,400  | 99,442.00 | 0.20 |
| 170 | 002294 | 信立泰  | 2,100  | 99,393.00 | 0.20 |
| 171 | 601216 | 君正集团 | 18,000 | 99,360.00 | 0.20 |
| 172 | 002500 | 山西证券 | 17,000 | 99,280.00 | 0.20 |
| 173 | 600166 | 福田汽车 | 36,600 | 99,186.00 | 0.20 |
| 174 | 002430 | 杭氧股份 | 5,100  | 99,042.00 | 0.20 |
| 175 | 000403 | 派林生物 | 5,460  | 98,989.80 | 0.20 |
| 176 | 000636 | 风华高科 | 7,200  | 98,928.00 | 0.20 |
| 177 | 600497 | 驰宏锌锗 | 18,700 | 98,923.00 | 0.20 |
| 178 | 600688 | 上海石化 | 34,700 | 98,895.00 | 0.20 |
| 179 | 688099 | 晶晨股份 | 1,392  | 98,845.92 | 0.20 |
| 180 | 688777 | 中控技术 | 2,200  | 98,802.00 | 0.20 |
| 181 | 000988 | 华工科技 | 2,100  | 98,721.00 | 0.20 |
| 182 | 300140 | 节能环保 | 16,000 | 98,720.00 | 0.20 |
| 183 | 601000 | 唐山港  | 24,300 | 98,658.00 | 0.19 |
| 184 | 601099 | 太平洋  | 25,100 | 98,643.00 | 0.19 |
| 185 | 600126 | 杭钢股份 | 10,960 | 98,640.00 | 0.19 |
| 186 | 603179 | 新泉股份 | 2,100  | 98,637.00 | 0.19 |
| 187 | 603087 | 甘李药业 | 1,800  | 98,604.00 | 0.19 |
| 188 | 601990 | 南京证券 | 12,200 | 98,576.00 | 0.19 |
| 189 | 000039 | 中集集团 | 12,540 | 98,564.40 | 0.19 |
| 190 | 300474 | 景嘉微  | 1,350  | 98,550.00 | 0.19 |
| 191 | 000723 | 美锦能源 | 22,800 | 98,496.00 | 0.19 |
| 192 | 002409 | 雅克科技 | 1,800  | 98,442.00 | 0.19 |
| 193 | 600299 | 安迪苏  | 10,200 | 98,430.00 | 0.19 |
| 194 | 300390 | 天华新能 | 5,160  | 98,401.20 | 0.19 |
| 195 | 600536 | 中国软件 | 2,103  | 98,357.31 | 0.19 |
| 196 | 688172 | 燕东微  | 5,000  | 98,300.00 | 0.19 |
| 197 | 603606 | 东方电缆 | 1,900  | 98,249.00 | 0.19 |
| 198 | 600528 | 中铁工业 | 13,300 | 98,154.00 | 0.19 |
| 199 | 003022 | 联泓新科 | 6,200  | 98,146.00 | 0.19 |
| 200 | 601168 | 西部矿业 | 5,900  | 98,117.00 | 0.19 |
| 201 | 002429 | 兆驰股份 | 22,400 | 98,112.00 | 0.19 |
| 202 | 300070 | 碧水源  | 21,800 | 98,100.00 | 0.19 |
| 203 | 002837 | 英维克  | 3,300  | 98,043.00 | 0.19 |
| 204 | 300627 | 华测导航 | 2,800  | 98,000.00 | 0.19 |
| 205 | 601997 | 贵阳银行 | 15,700 | 97,968.00 | 0.19 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 206 | 000400 | 许继电气 | 4,500  | 97,965.00 | 0.19 |
| 207 | 600848 | 上海临港 | 10,800 | 97,956.00 | 0.19 |
| 208 | 600487 | 亨通光电 | 6,400  | 97,920.00 | 0.19 |
| 209 | 003031 | 中瓷电子 | 1,840  | 97,906.40 | 0.19 |
| 210 | 600516 | 方大炭素 | 21,100 | 97,904.00 | 0.19 |
| 211 | 000591 | 太阳能  | 22,300 | 97,897.00 | 0.19 |
| 212 | 002410 | 广联达  | 7,300  | 97,893.00 | 0.19 |
| 213 | 000034 | 神州数码 | 2,600  | 97,864.00 | 0.19 |
| 214 | 000629 | 钒钛股份 | 38,200 | 97,792.00 | 0.19 |
| 215 | 301267 | 华夏眼科 | 5,100  | 97,767.00 | 0.19 |
| 216 | 601001 | 晋控煤业 | 8,000  | 97,760.00 | 0.19 |
| 217 | 600170 | 上海建工 | 40,900 | 97,751.00 | 0.19 |
| 218 | 300724 | 捷佳伟创 | 1,800  | 97,740.00 | 0.19 |
| 219 | 601615 | 明阳智能 | 8,500  | 97,665.00 | 0.19 |
| 220 | 000825 | 太钢不锈 | 27,200 | 97,648.00 | 0.19 |
| 221 | 600977 | 中国电影 | 9,100  | 97,552.00 | 0.19 |
| 222 | 000831 | 中国稀土 | 2,700  | 97,524.00 | 0.19 |
| 223 | 002155 | 湖南黄金 | 5,460  | 97,461.00 | 0.19 |
| 224 | 601866 | 中远海发 | 39,400 | 97,318.00 | 0.19 |
| 225 | 688349 | 三一重能 | 3,900  | 97,266.00 | 0.19 |
| 226 | 002120 | 韵达股份 | 14,500 | 97,150.00 | 0.19 |
| 227 | 600118 | 中国卫星 | 3,400  | 97,138.00 | 0.19 |
| 228 | 000958 | 电投产融 | 14,200 | 97,128.00 | 0.19 |
| 229 | 002821 | 凯莱英  | 1,100  | 97,075.00 | 0.19 |
| 230 | 002797 | 第一创业 | 13,700 | 96,996.00 | 0.19 |
| 231 | 000729 | 燕京啤酒 | 7,500  | 96,975.00 | 0.19 |
| 232 | 600312 | 平高电气 | 6,300  | 96,957.00 | 0.19 |
| 233 | 600970 | 中材国际 | 11,300 | 96,954.00 | 0.19 |
| 234 | 002508 | 老板电器 | 5,100  | 96,951.00 | 0.19 |
| 235 | 002085 | 万丰奥威 | 6,100  | 96,929.00 | 0.19 |
| 236 | 300223 | 北京君正 | 1,400  | 96,880.00 | 0.19 |
| 237 | 600563 | 法拉电子 | 887    | 96,762.83 | 0.19 |
| 238 | 301358 | 湖南裕能 | 3,100  | 96,689.00 | 0.19 |
| 239 | 600096 | 云天化  | 4,400  | 96,668.00 | 0.19 |
| 240 | 601233 | 桐昆股份 | 9,118  | 96,650.80 | 0.19 |
| 241 | 601106 | 中国一重 | 34,500 | 96,600.00 | 0.19 |
| 242 | 300339 | 润和软件 | 1,900  | 96,577.00 | 0.19 |
| 243 | 600765 | 中航重机 | 5,720  | 96,553.60 | 0.19 |
| 244 | 002244 | 滨江集团 | 9,900  | 96,525.00 | 0.19 |
| 245 | 002738 | 中矿资源 | 3,000  | 96,480.00 | 0.19 |
| 246 | 600109 | 国金证券 | 11,000 | 96,470.00 | 0.19 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 247 | 300003 | 乐普医疗 | 7,000  | 96,460.00 | 0.19 |
| 248 | 603650 | 彤程新材 | 3,000  | 96,450.00 | 0.19 |
| 249 | 300058 | 蓝色光标 | 14,700 | 96,432.00 | 0.19 |
| 250 | 603233 | 大参林  | 5,916  | 96,430.80 | 0.19 |
| 251 | 002958 | 青农商行 | 26,700 | 96,387.00 | 0.19 |
| 252 | 600637 | 东方明珠 | 12,900 | 96,363.00 | 0.19 |
| 253 | 688100 | 威胜信息 | 2,600  | 96,330.00 | 0.19 |
| 254 | 300115 | 长盈精密 | 4,500  | 96,300.00 | 0.19 |
| 255 | 002563 | 森马服饰 | 18,300 | 96,258.00 | 0.19 |
| 256 | 000060 | 中金岭南 | 21,000 | 96,180.00 | 0.19 |
| 257 | 688153 | 唯捷创芯 | 3,100  | 96,131.00 | 0.19 |
| 258 | 002608 | 江苏国信 | 13,100 | 96,023.00 | 0.19 |
| 259 | 002831 | 裕同科技 | 4,100  | 96,022.00 | 0.19 |
| 260 | 600655 | 豫园股份 | 17,300 | 96,015.00 | 0.19 |
| 261 | 002739 | 万达电影 | 8,400  | 96,012.00 | 0.19 |
| 262 | 600959 | 江苏有线 | 27,900 | 95,976.00 | 0.19 |
| 263 | 600056 | 中国医药 | 9,280  | 95,955.20 | 0.19 |
| 264 | 603077 | 和邦生物 | 54,800 | 95,900.00 | 0.19 |
| 265 | 603858 | 步长制药 | 5,900  | 95,816.00 | 0.19 |
| 266 | 000830 | 鲁西化工 | 9,300  | 95,790.00 | 0.19 |
| 267 | 600956 | 新天绿能 | 12,400 | 95,728.00 | 0.19 |
| 268 | 600739 | 辽宁成大 | 8,700  | 95,700.00 | 0.19 |
| 269 | 002273 | 水晶光电 | 4,789  | 95,636.33 | 0.19 |
| 270 | 002138 | 顺络电子 | 3,400  | 95,608.00 | 0.19 |
| 271 | 002624 | 完美世界 | 6,300  | 95,571.00 | 0.19 |
| 272 | 601156 | 东航物流 | 7,300  | 95,557.00 | 0.19 |
| 273 | 605358 | 立昂微  | 4,100  | 95,530.00 | 0.19 |
| 274 | 003035 | 南网能源 | 20,800 | 95,472.00 | 0.19 |
| 275 | 601577 | 长沙银行 | 9,600  | 95,424.00 | 0.19 |
| 276 | 600704 | 物产中大 | 18,100 | 95,387.00 | 0.19 |
| 277 | 300623 | 捷捷微电 | 3,200  | 95,360.00 | 0.19 |
| 278 | 300919 | 中伟股份 | 2,900  | 95,352.00 | 0.19 |
| 279 | 300679 | 电连技术 | 2,100  | 95,298.00 | 0.19 |
| 280 | 002851 | 麦格米特 | 1,900  | 95,266.00 | 0.19 |
| 281 | 300458 | 全志科技 | 2,400  | 95,256.00 | 0.19 |
| 282 | 002756 | 永兴材料 | 3,000  | 95,250.00 | 0.19 |
| 283 | 603156 | 养元饮品 | 4,500  | 95,220.00 | 0.19 |
| 284 | 002607 | 中公教育 | 31,100 | 95,166.00 | 0.19 |
| 285 | 000883 | 湖北能源 | 21,100 | 95,161.00 | 0.19 |
| 286 | 000785 | 居然智家 | 31,200 | 95,160.00 | 0.19 |
| 287 | 600901 | 江苏金租 | 15,700 | 95,142.00 | 0.19 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 288 | 600873 | 梅花生物 | 8,900  | 95,141.00 | 0.19 |
| 289 | 600867 | 通化东宝 | 11,600 | 95,120.00 | 0.19 |
| 290 | 600720 | 中交设计 | 12,300 | 95,079.00 | 0.19 |
| 291 | 688778 | 厦钨新能 | 1,700  | 95,064.00 | 0.19 |
| 292 | 002507 | 涪陵榨菜 | 7,430  | 95,029.70 | 0.19 |
| 293 | 688248 | 南网科技 | 3,020  | 95,009.20 | 0.19 |
| 294 | 600872 | 中炬高新 | 5,000  | 95,000.00 | 0.19 |
| 295 | 688538 | 和辉光电 | 40,588 | 94,975.92 | 0.19 |
| 296 | 600885 | 宏发股份 | 4,256  | 94,951.36 | 0.19 |
| 297 | 601061 | 中信金属 | 12,000 | 94,920.00 | 0.19 |
| 297 | 688387 | 信科移动 | 16,800 | 94,920.00 | 0.19 |
| 299 | 600928 | 西安银行 | 24,200 | 94,864.00 | 0.19 |
| 300 | 603338 | 浙江鼎力 | 2,000  | 94,800.00 | 0.19 |
| 301 | 002568 | 百润股份 | 3,700  | 94,757.00 | 0.19 |
| 302 | 002532 | 天山铝业 | 11,400 | 94,734.00 | 0.19 |
| 303 | 000066 | 中国长城 | 6,400  | 94,720.00 | 0.19 |
| 304 | 002432 | 九安医疗 | 2,600  | 94,718.00 | 0.19 |
| 305 | 300857 | 协创数据 | 1,100  | 94,666.00 | 0.19 |
| 306 | 601228 | 广州港  | 29,300 | 94,639.00 | 0.19 |
| 307 | 300142 | 沃森生物 | 8,600  | 94,600.00 | 0.19 |
| 308 | 600909 | 华安证券 | 16,220 | 94,562.60 | 0.19 |
| 309 | 002603 | 以岭药业 | 6,700  | 94,470.00 | 0.19 |
| 310 | 600141 | 兴发集团 | 4,600  | 94,438.00 | 0.19 |
| 311 | 600079 | 人福医药 | 4,500  | 94,410.00 | 0.19 |
| 312 | 600517 | 国网英大 | 18,500 | 94,350.00 | 0.19 |
| 313 | 002439 | 启明星辰 | 5,900  | 94,341.00 | 0.19 |
| 314 | 601918 | 新集能源 | 14,600 | 94,316.00 | 0.19 |
| 315 | 002202 | 金风科技 | 9,200  | 94,300.00 | 0.19 |
| 316 | 601636 | 旗滨集团 | 18,800 | 94,188.00 | 0.19 |
| 317 | 300601 | 康泰生物 | 6,200  | 94,178.00 | 0.19 |
| 318 | 000423 | 东阿阿胶 | 1,800  | 94,140.00 | 0.19 |
| 319 | 601108 | 财通证券 | 11,900 | 94,129.00 | 0.19 |
| 320 | 688772 | 珠海冠宇 | 6,586  | 94,113.94 | 0.19 |
| 321 | 001389 | 广合科技 | 1,600  | 94,032.00 | 0.19 |
| 322 | 688469 | 芯联集成 | 19,700 | 93,969.00 | 0.19 |
| 323 | 600155 | 华创云信 | 13,500 | 93,960.00 | 0.19 |
| 324 | 603826 | 坤彩科技 | 4,800  | 93,936.00 | 0.19 |
| 325 | 600663 | 陆家嘴  | 10,600 | 93,916.00 | 0.19 |
| 326 | 002572 | 索菲亚  | 6,700  | 93,867.00 | 0.19 |
| 327 | 000967 | 盈峰环境 | 13,500 | 93,825.00 | 0.19 |
| 328 | 000739 | 普洛药业 | 6,700  | 93,800.00 | 0.19 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 329 | 300677 | 英科医疗 | 3,960  | 93,772.80 | 0.19 |
| 330 | 002673 | 西部证券 | 11,900 | 93,772.00 | 0.19 |
| 331 | 600380 | 健康元  | 8,500  | 93,755.00 | 0.19 |
| 332 | 002984 | 森麒麟  | 5,000  | 93,750.00 | 0.19 |
| 333 | 000709 | 河钢股份 | 43,400 | 93,744.00 | 0.19 |
| 334 | 300285 | 国瓷材料 | 5,400  | 93,690.00 | 0.19 |
| 335 | 600132 | 重庆啤酒 | 1,700  | 93,670.00 | 0.19 |
| 336 | 688568 | 中科星图 | 2,600  | 93,626.00 | 0.18 |
| 337 | 600871 | 石化油服 | 48,000 | 93,600.00 | 0.18 |
| 338 | 601212 | 白银有色 | 29,900 | 93,587.00 | 0.18 |
| 339 | 600392 | 盛和资源 | 7,104  | 93,559.68 | 0.18 |
| 340 | 600737 | 中粮糖业 | 9,900  | 93,555.00 | 0.18 |
| 341 | 688235 | 百济神州 | 400    | 93,456.00 | 0.18 |
| 342 | 600582 | 天地科技 | 15,600 | 93,444.00 | 0.18 |
| 343 | 002945 | 华林证券 | 6,500  | 93,405.00 | 0.18 |
| 344 | 600820 | 隧道股份 | 15,300 | 93,330.00 | 0.18 |
| 345 | 000027 | 深圳能源 | 14,620 | 93,275.60 | 0.18 |
| 346 | 000415 | 渤海租赁 | 28,000 | 93,240.00 | 0.18 |
| 347 | 601098 | 中南传媒 | 7,100  | 93,152.00 | 0.18 |
| 348 | 688295 | 中复神鹰 | 4,474  | 93,059.20 | 0.18 |
| 349 | 601118 | 海南橡胶 | 19,700 | 92,984.00 | 0.18 |
| 350 | 603000 | 人民网  | 4,600  | 92,966.00 | 0.18 |
| 351 | 002385 | 大北农  | 23,000 | 92,920.00 | 0.18 |
| 352 | 002653 | 海思科  | 2,200  | 92,884.00 | 0.18 |
| 353 | 601019 | 山东出版 | 9,800  | 92,806.00 | 0.18 |
| 354 | 601928 | 凤凰传媒 | 8,300  | 92,711.00 | 0.18 |
| 355 | 601880 | 辽港股份 | 61,800 | 92,700.00 | 0.18 |
| 356 | 601921 | 浙版传媒 | 11,500 | 92,690.00 | 0.18 |
| 357 | 002008 | 大族激光 | 3,800  | 92,606.00 | 0.18 |
| 358 | 002223 | 鱼跃医疗 | 2,600  | 92,560.00 | 0.18 |
| 359 | 002064 | 华峰化学 | 14,000 | 92,540.00 | 0.18 |
| 360 | 000921 | 海信家电 | 3,600  | 92,520.00 | 0.18 |
| 361 | 600171 | 上海贝岭 | 2,700  | 92,475.00 | 0.18 |
| 362 | 600373 | 中文传媒 | 9,000  | 92,430.00 | 0.18 |
| 363 | 601966 | 玲珑轮胎 | 6,300  | 92,421.00 | 0.18 |
| 364 | 601965 | 中国汽研 | 5,200  | 92,300.00 | 0.18 |
| 365 | 600566 | 济川药业 | 3,500  | 92,155.00 | 0.18 |
| 366 | 600906 | 财达证券 | 13,500 | 92,070.00 | 0.18 |
| 367 | 001696 | 宗申动力 | 4,100  | 92,045.00 | 0.18 |
| 368 | 600325 | 华发股份 | 18,900 | 92,043.00 | 0.18 |
| 369 | 600131 | 国网信通 | 5,200  | 92,040.00 | 0.18 |

|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 370 | 000050 | 深天马 A | 10,800 | 92,016.00 | 0.18 |
| 371 | 600177 | 雅戈尔   | 12,600 | 91,980.00 | 0.18 |
| 371 | 600282 | 南钢股份  | 21,900 | 91,980.00 | 0.18 |
| 373 | 603728 | 鸣志电器  | 1,600  | 91,952.00 | 0.18 |
| 374 | 600348 | 华阳股份  | 13,800 | 91,908.00 | 0.18 |
| 375 | 601611 | 中国核建  | 10,000 | 91,900.00 | 0.18 |
| 376 | 002153 | 石基信息  | 10,604 | 91,830.64 | 0.18 |
| 377 | 300212 | 易华录   | 4,220  | 91,827.20 | 0.18 |
| 378 | 600361 | 创新新材  | 23,000 | 91,770.00 | 0.18 |
| 379 | 603927 | 中科软   | 4,744  | 91,748.96 | 0.18 |
| 380 | 600863 | 内蒙华电  | 22,300 | 91,653.00 | 0.18 |
| 381 | 300595 | 欧普康视  | 6,000  | 91,620.00 | 0.18 |
| 381 | 688702 | 盛科通信  | 1,500  | 91,620.00 | 0.18 |
| 383 | 603885 | 吉祥航空  | 6,800  | 91,596.00 | 0.18 |
| 384 | 600483 | 福能股份  | 9,500  | 91,580.00 | 0.18 |
| 385 | 300496 | 中科创达  | 1,600  | 91,552.00 | 0.18 |
| 386 | 002078 | 太阳纸业  | 6,800  | 91,528.00 | 0.18 |
| 387 | 600925 | 苏能股份  | 17,500 | 91,525.00 | 0.18 |
| 388 | 603939 | 益丰药房  | 3,740  | 91,517.80 | 0.18 |
| 389 | 601016 | 节能风电  | 31,650 | 91,468.50 | 0.18 |
| 390 | 000959 | 首钢股份  | 26,900 | 91,460.00 | 0.18 |
| 391 | 601858 | 中国科传  | 4,700  | 91,415.00 | 0.18 |
| 392 | 688475 | 萤石网络  | 2,900  | 91,408.00 | 0.18 |
| 393 | 600968 | 海油发展  | 22,400 | 91,392.00 | 0.18 |
| 394 | 600839 | 四川长虹  | 9,400  | 91,368.00 | 0.18 |
| 395 | 000062 | 深圳华强  | 3,400  | 91,324.00 | 0.18 |
| 396 | 000738 | 航发控制  | 4,400  | 91,300.00 | 0.18 |
| 397 | 600157 | 永泰能源  | 68,100 | 91,254.00 | 0.18 |
| 398 | 601598 | 中国外运  | 18,500 | 91,205.00 | 0.18 |
| 399 | 300012 | 华测检测  | 7,800  | 91,182.00 | 0.18 |
| 400 | 002372 | 伟星新材  | 8,800  | 91,168.00 | 0.18 |
| 401 | 000703 | 恒逸石化  | 15,500 | 91,140.00 | 0.18 |
| 402 | 000932 | 华菱钢铁  | 20,700 | 91,080.00 | 0.18 |
| 403 | 603605 | 珀莱雅   | 1,100  | 91,069.00 | 0.18 |
| 404 | 300024 | 机器人   | 5,300  | 91,054.00 | 0.18 |
| 405 | 000683 | 博源化工  | 19,000 | 91,010.00 | 0.18 |
| 406 | 000543 | 皖能电力  | 13,000 | 91,000.00 | 0.18 |
| 407 | 600995 | 南网储能  | 9,300  | 90,954.00 | 0.18 |
| 408 | 300567 | 精测电子  | 1,500  | 90,915.00 | 0.18 |
| 409 | 601179 | 中国西电  | 14,800 | 90,872.00 | 0.18 |
| 410 | 688728 | 格科微   | 5,900  | 90,860.00 | 0.18 |



|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 411 | 600598 | 北大荒   | 6,300  | 90,846.00 | 0.18 |
| 412 | 600529 | 山东药玻  | 4,100  | 90,774.00 | 0.18 |
| 413 | 688114 | 华大智造  | 1,400  | 90,762.00 | 0.18 |
| 414 | 000728 | 国元证券  | 11,500 | 90,735.00 | 0.18 |
| 415 | 300529 | 健帆生物  | 4,200  | 90,594.00 | 0.18 |
| 416 | 600295 | 鄂尔多斯  | 10,400 | 90,584.00 | 0.18 |
| 417 | 000559 | 万向钱潮  | 11,840 | 90,576.00 | 0.18 |
| 418 | 603589 | 口子窖   | 2,600  | 90,480.00 | 0.18 |
| 419 | 300751 | 迈为股份  | 1,300  | 90,428.00 | 0.18 |
| 420 | 600511 | 国药股份  | 3,100  | 90,396.00 | 0.18 |
| 421 | 000155 | 川能动力  | 9,200  | 90,344.00 | 0.18 |
| 422 | 000563 | 陕国投 A | 25,300 | 90,321.00 | 0.18 |
| 423 | 688676 | 金盘科技  | 2,700  | 90,315.00 | 0.18 |
| 424 | 600859 | 王府井   | 6,500  | 90,285.00 | 0.18 |
| 425 | 688425 | 铁建重工  | 22,100 | 90,168.00 | 0.18 |
| 426 | 000513 | 丽珠集团  | 2,500  | 90,100.00 | 0.18 |
| 427 | 603707 | 健友股份  | 8,080  | 90,092.00 | 0.18 |
| 428 | 600004 | 白云机场  | 9,900  | 90,090.00 | 0.18 |
| 429 | 002299 | 圣农发展  | 6,300  | 90,027.00 | 0.18 |
| 430 | 600546 | 山煤国际  | 10,300 | 89,919.00 | 0.18 |
| 431 | 688032 | 禾迈股份  | 900    | 89,874.00 | 0.18 |
| 432 | 603868 | 飞科电器  | 2,500  | 89,675.00 | 0.18 |
| 433 | 600021 | 上海电力  | 10,200 | 89,658.00 | 0.18 |
| 434 | 600988 | 赤峰黄金  | 3,600  | 89,568.00 | 0.18 |
| 435 | 600612 | 老凤祥   | 1,800  | 89,550.00 | 0.18 |
| 436 | 002312 | 川发龙蟒  | 7,800  | 89,544.00 | 0.18 |
| 437 | 603529 | 爱玛科技  | 2,600  | 89,440.00 | 0.18 |
| 438 | 000539 | 粤电力 A | 19,700 | 89,438.00 | 0.18 |
| 439 | 603290 | 斯达半导  | 1,100  | 89,397.00 | 0.18 |
| 440 | 603225 | 新凤鸣   | 8,389  | 89,342.85 | 0.18 |
| 441 | 001213 | 中铁特货  | 22,000 | 89,320.00 | 0.18 |
| 441 | 603816 | 顾家家居  | 3,500  | 89,320.00 | 0.18 |
| 443 | 002007 | 华兰生物  | 5,700  | 89,319.00 | 0.18 |
| 444 | 600008 | 首创环保  | 29,564 | 89,283.28 | 0.18 |
| 445 | 600032 | 浙江新能  | 11,800 | 89,208.00 | 0.18 |
| 446 | 600763 | 通策医疗  | 2,161  | 89,206.08 | 0.18 |
| 447 | 688249 | 晶合集成  | 4,400  | 89,188.00 | 0.18 |
| 448 | 601608 | 中信重工  | 20,350 | 88,929.50 | 0.18 |
| 449 | 300144 | 宋城演艺  | 10,400 | 88,920.00 | 0.18 |
| 450 | 002318 | 久立特材  | 3,800  | 88,882.00 | 0.18 |
| 451 | 600801 | 华新水泥  | 7,500  | 88,800.00 | 0.18 |

|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 451 | 605589 | 圣泉集团  | 3,200  | 88,800.00 | 0.18 |
| 453 | 300346 | 南大光电  | 2,800  | 88,592.00 | 0.18 |
| 454 | 603345 | 安井食品  | 1,100  | 88,462.00 | 0.17 |
| 455 | 300957 | 贝泰妮   | 2,000  | 88,440.00 | 0.17 |
| 456 | 600998 | 九州通   | 17,199 | 88,402.86 | 0.17 |
| 457 | 000898 | 鞍钢股份  | 38,100 | 88,392.00 | 0.17 |
| 457 | 600352 | 浙江龙盛  | 8,700  | 88,392.00 | 0.17 |
| 459 | 601666 | 平煤股份  | 11,918 | 88,312.38 | 0.17 |
| 460 | 601399 | 国机重装  | 29,400 | 88,200.00 | 0.17 |
| 461 | 000933 | 神火股份  | 5,300  | 88,192.00 | 0.17 |
| 462 | 600098 | 广州发展  | 14,100 | 88,125.00 | 0.17 |
| 463 | 002461 | 珠江啤酒  | 7,800  | 88,062.00 | 0.17 |
| 464 | 600298 | 安琪酵母  | 2,500  | 87,925.00 | 0.17 |
| 465 | 000951 | 中国重汽  | 5,000  | 87,900.00 | 0.17 |
| 466 | 301301 | 川宁生物  | 7,300  | 87,892.00 | 0.17 |
| 467 | 603565 | 中谷物流  | 9,200  | 87,860.00 | 0.17 |
| 468 | 600606 | 绿地控股  | 53,900 | 87,857.00 | 0.17 |
| 469 | 000537 | 中绿电   | 10,500 | 87,780.00 | 0.17 |
| 470 | 600062 | 华润双鹤  | 4,700  | 87,702.00 | 0.17 |
| 471 | 601158 | 重庆水务  | 18,900 | 87,696.00 | 0.17 |
| 472 | 600258 | 首旅酒店  | 6,200  | 87,606.00 | 0.17 |
| 473 | 600363 | 联创光电  | 1,500  | 87,495.00 | 0.17 |
| 474 | 300136 | 信维通信  | 3,900  | 87,360.00 | 0.17 |
| 474 | 688582 | 芯动联科  | 1,300  | 87,360.00 | 0.17 |
| 476 | 603568 | 伟明环保  | 4,569  | 87,176.52 | 0.17 |
| 477 | 001286 | 陕西能源  | 10,000 | 87,000.00 | 0.17 |
| 478 | 601333 | 广深铁路  | 30,000 | 86,700.00 | 0.17 |
| 479 | 000582 | 北部湾港  | 10,500 | 86,625.00 | 0.17 |
| 480 | 603556 | 海兴电力  | 3,400  | 86,598.00 | 0.17 |
| 481 | 601139 | 深圳燃气  | 13,600 | 86,496.00 | 0.17 |
| 482 | 000528 | 柳工    | 9,000  | 86,490.00 | 0.17 |
| 483 | 600007 | 中国国贸  | 4,200  | 86,436.00 | 0.17 |
| 484 | 603658 | 安图生物  | 2,300  | 86,250.00 | 0.17 |
| 485 | 300146 | 汤臣倍健  | 7,600  | 85,424.00 | 0.17 |
| 486 | 300735 | 光弘科技  | 3,400  | 85,340.00 | 0.17 |
| 487 | 002266 | 浙富控股  | 27,700 | 85,316.00 | 0.17 |
| 488 | 000429 | 粤高速 A | 6,400  | 85,312.00 | 0.17 |
| 489 | 600754 | 锦江酒店  | 3,800  | 85,272.00 | 0.17 |
| 490 | 600985 | 淮北矿业  | 7,500  | 85,050.00 | 0.17 |
| 491 | 300454 | 深信服   | 900    | 84,762.00 | 0.17 |
| 492 | 301536 | 星宸科技  | 1,400  | 84,420.00 | 0.17 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 493 | 000937 | 冀中能源 | 14,400 | 82,800.00 | 0.16 |
| 494 | 688363 | 华熙生物 | 1,600  | 82,160.00 | 0.16 |
| 495 | 300573 | 兴齐眼药 | 1,580  | 81,828.20 | 0.16 |
| 496 | 300888 | 稳健医疗 | 1,980  | 81,378.00 | 0.16 |
| 497 | 603899 | 晨光股份 | 2,800  | 81,172.00 | 0.16 |
| 498 | 002773 | 康弘药业 | 2,800  | 81,116.00 | 0.16 |
| 499 | 002262 | 恩华药业 | 3,900  | 81,042.00 | 0.16 |
| 500 | 601568 | 北元集团 | 18,930 | 78,559.50 | 0.16 |

### 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  | 688608 | 恒玄科技 | 151,388.00 | 0.27           |
| 2  | 688027 | 国盾量子 | 110,986.00 | 0.19           |
| 3  | 688235 | 百济神州 | 103,338.00 | 0.18           |
| 4  | 688318 | 财富趋势 | 101,697.12 | 0.18           |
| 5  | 600562 | 国睿科技 | 96,668.00  | 0.17           |
| 6  | 300757 | 罗博特科 | 96,462.00  | 0.17           |
| 7  | 000543 | 皖能电力 | 96,350.00  | 0.17           |
| 8  | 002130 | 沃尔核材 | 96,338.00  | 0.17           |
| 9  | 601921 | 浙版传媒 | 94,875.00  | 0.17           |
| 10 | 603659 | 璞泰来  | 94,813.00  | 0.17           |
| 11 | 688183 | 生益电子 | 94,106.96  | 0.17           |
| 12 | 300115 | 长盈精密 | 94,050.00  | 0.17           |
| 13 | 300458 | 全志科技 | 93,302.00  | 0.16           |
| 14 | 300450 | 先导智能 | 93,281.00  | 0.16           |
| 15 | 300679 | 电连技术 | 93,103.00  | 0.16           |
| 16 | 001389 | 广合科技 | 92,976.00  | 0.16           |
| 17 | 600363 | 联创光电 | 92,117.00  | 0.16           |
| 18 | 300857 | 协创数据 | 92,021.00  | 0.16           |
| 19 | 002007 | 华兰生物 | 91,704.00  | 0.16           |
| 20 | 600985 | 淮北矿业 | 91,660.00  | 0.16           |

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  | 300476 | 胜宏科技 | 167,974.00 | 0.29            |
| 2  | 688331 | 荣昌生物 | 166,201.88 | 0.29            |
| 3  | 002487 | 大金重工 | 161,997.00 | 0.28            |
| 4  | 300866 | 安克创新 | 159,314.30 | 0.28            |
| 5  | 688536 | 思瑞浦  | 158,620.29 | 0.28            |
| 6  | 302132 | 中航成飞 | 157,536.00 | 0.28            |
| 7  | 002384 | 东山精密 | 149,832.00 | 0.26            |
| 8  | 603444 | 吉比特  | 147,186.00 | 0.26            |
| 9  | 002019 | 亿帆医药 | 144,683.00 | 0.25            |
| 10 | 002690 | 美亚光电 | 138,235.70 | 0.24            |
| 11 | 000818 | 航锦科技 | 136,987.00 | 0.24            |
| 12 | 300251 | 光线传媒 | 131,570.00 | 0.23            |
| 13 | 002625 | 光启技术 | 131,315.00 | 0.23            |
| 14 | 001203 | 大中矿业 | 126,148.00 | 0.22            |
| 15 | 002867 | 周大生  | 122,262.00 | 0.21            |
| 16 | 600418 | 江淮汽车 | 119,167.00 | 0.21            |
| 17 | 600350 | 山东高速 | 116,411.00 | 0.20            |
| 18 | 002128 | 电投能源 | 114,736.00 | 0.20            |
| 19 | 300009 | 安科生物 | 109,905.60 | 0.19            |
| 20 | 301236 | 软通动力 | 109,082.00 | 0.19            |

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 | 9,282,100.46  |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 12,045,143.57 |

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      | 502,203.70 | 0.99          |
| 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） | 2,300.15   | 0.00 |
| 8  | 同业存单      | —          | —    |
| 9  | 其他        | —          | —    |
| 10 | 合计        | 504,503.85 | 1.00 |

## 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  | 019766 | 25 国债 01 | 5,000 | 502,203.70 | 0.99         |
| 2  | 123257 | 安克转债     | 23    | 2,300.15   | 0.00         |

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

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

无。

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

无。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金运用股指期货交易的原则是，在流动性较好和投资期限适当的合约上安排比例适当的头寸，以降低对市场的冲击并减少交易成本，根据市场流动性状况及投资需求，分时段执行展期交易，在交易过程中，对投资组合的风险状况持续监控。具体而言，当前对股指期货交易主要用以获得股指期货的基差收敛收益，并利用股指期货的杠杆效应保留部分现金以避免跨市场 ETF 的尾盘赎回风险。考虑到本基金跟踪的中证 500 等权重指数与 IC 合约跟踪的中证 500 指数存在一定的偏离，我们会根据实际情况对成分股持仓进行调整，以达到更好的跟踪等权指数的目的。我们还会重

点关注调整后的成分券数量是否满足 ETF 的赎回上限要求，以尽量避免赎回风险。

总体而言，本基金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。后续我们将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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 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 | 144,443.70 |
| 2  | 应收清算款 | —          |
| 3  | 应收股利  | —          |
| 4  | 应收利息  | —          |
| 5  | 应收申购款 | —          |
| 6  | 其他应收款 | —          |
| 7  | 待摊费用  | —          |
| 8  | 其他    | —          |
| 9  | 合计    | 144,443.70 |

### 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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构         |            |              |            |
|--------------|---------------|---------------|------------|--------------|------------|
|              |               | 机构投资者         |            | 个人投资者        |            |
|              |               | 持有份额          | 占总份额<br>比例 | 持有份额         | 占总份额<br>比例 |
| 422          | 80,838.07     | 24,273,716.00 | 71.16%     | 9,839,949.00 | 28.84%     |

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称        | 持有份额（份）       | 占上市总份额比例 |
|----|--------------|---------------|----------|
| 1  | 前海开源基金管理有限公司 | 21,194,900.00 | 62.13%   |
| 2  | 中信建投证券股份有限公司 | 1,660,684.00  | 4.87%    |
| 3  | 中信证券股份有限公司   | 753,988.00    | 2.21%    |
| 4  | 华泰证券股份有限公司   | 549,500.00    | 1.61%    |
| 5  | 杨建中          | 422,500.00    | 1.24%    |
| 6  | 蒋祖逸          | 400,000.00    | 1.17%    |
| 7  | 刘百荣          | 317,000.00    | 0.93%    |
| 8  | 施庆道          | 300,000.00    | 0.88%    |
| 9  | 顾宁           | 245,433.00    | 0.72%    |
| 10 | 罗兰珍          | 204,000.00    | 0.60%    |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 0.00      | 0.0000%  |

**8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

| 项目                                     | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式基<br>金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基<br>金                    | 0                 |

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

|                                     |                |
|-------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2019 年 11 月 14 日）基金份额<br>总额 | 760,113,665.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                        | 40,113,665.00  |
| 本报告期基金总申购份额                         | 2,000,000.00   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                       | 8,000,000.00   |
| 本报告期基金拆分变动份额                        | —              |
| 本报告期期末基金份额总额                        | 34,113,665.00  |

**§ 10 重大事件揭示****10.1 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。

**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，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内无涉及托管部门的重大人事变动。

**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。

本报告期内无涉及本基金基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

**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，基金托管部门的高级管理人员或者托管人未受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 |    |
| 方正证券   | 2      | —             | —            | —         | —          | —  |
| 中国银河证券 | 6      | 21,139,705.65 | 100.00%      | 4,352.81  | 100.00%    | —  |

注：本基金管理人依据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》等相关规定制定了证券公司的选择标准和程序，使用所选中证券公司的交易单元进行证券投资。

#### 1、选择标准

(1) 除被动股票型基金以外的其他类型基金

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) 通讯条件及信息系统建设情况；5) 近 1 年未受到与经纪业务、信息技术管理等和证券交易相关的行政处罚或行政监管措施；6) 财务状况良好；7) 其他可增强资质的情况及特色。

(2) 被动股票型基金

1) 经营能力；2) 系统建设情况；3) 合规建设情况；4) 专业服务能力；5) 费率优势；6) 法律法规及规范性文件所规定的其他要求。

#### 2、选择程序

本基金管理人在选择证券公司时严格执行上述标准，在综合比较各家证券公司的财务状况、经营行为规范状况、风控合规能力和交易、研究服务水平（针对非被动股票型基金）后选择符合标准的证券公司，并与选中的证券公司签订相关协议。

### 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  | 占当期 | 成交金    | 占当期 | 成交金  | 占当期 | 成交金  | 占当期 |

|        | 额          | 债券成交总额的比例 | 额 | 债券回购成交总额的比例 | 额 | 权证成交总额的比例 | 额 | 基金成交总额的比例 |
|--------|------------|-----------|---|-------------|---|-----------|---|-----------|
| 方正证券   | -          | -         | - | -           | - | -         | - | -         |
| 中国银河证券 | 515,041.50 | 100.00%   | - | -           | - | -         | - | -         |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式    | 法定披露日期      |
|----|---|-----------|-------------|
| 1  | 前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告               | 中国证监会规定媒介 | 2025年01月22日 |
| 2  | 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 | 2025年03月14日 |
| 3  | 前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同（2025 年 3 月修订）            | 中国证监会规定媒介 | 2025年03月19日 |
| 4  | 前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金托管协议（2025 年 3 月修订）            | 中国证监会规定媒介 | 2025年03月19日 |
| 5  | 关于前海开源基金管理有限公司旗下部分指数基金标的指数许可使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告       | 中国证监会规定媒介 | 2025年03月19日 |
| 6  | 前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（202503 25 更新）           | 中国证监会规定媒介 | 2025年03月25日 |
| 7  | 前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新                    | 中国证监会规定媒介 | 2025年03月25日 |
| 8  | 前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告                   | 中国证监会规定媒介 | 2025年03月31日 |
| 9  | 前海开源基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）              | 中国证监会规定媒介 | 2025年03月31日 |
| 10 | 前海开源基金管理有限公司关于前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金新增申购赎回代办证券公司的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025年04月11日 |
| 11 | 前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告               | 中国证监会规定媒介 | 2025年04月22日 |

|    |   |           |             |
|----|---|-----------|-------------|
| 12 | 前海开源基金管理有限公司关于前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金新增申购赎回代办证券公司的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025年06月09日 |
| 13 | 前海开源基金管理有限公司关于终止与民商基金销售（上海）有限公司销售业务合作关系的公告                | 中国证监会规定媒介 | 2025年06月10日 |
| 14 | 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 | 2025年06月11日 |
| 15 | 前海开源基金管理有限公司关于前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金新增申购赎回代办证券公司的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025年06月20日 |
| 16 | 前海开源基金管理有限公司关于前海开源基金 APP 业务迁移的公告                          | 中国证监会规定媒介 | 2025年06月21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

| 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              | 20250101-20250630       | 21,194,900.00 | -    | -    | 21,194,900.00 | 62.13% |
| 产品特有风险  |                |                         |               |      |      |               |        |
| <p>1. 大额赎回风险</p> <p>本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的大额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>2. 终止基金合同的风险</p> <p>个别投资者大额赎回后，若本基金连续 55 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，基金管理人应当终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会，其他投资者可能面临相应风险；</p> <p>3. 流动性风险</p> <p>单一投资者大额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；</p> <p>4. 大额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。</p> |                |                         |               |      |      |               |        |

### 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中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- （2）《前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- （3）《前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- （4）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （5）前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上各项公告的原稿

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 12.3 查阅方式

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

前海开源基金管理有限公司  
2025 年 08 月 29 日