

**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遵规守信情况的说明	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遵规守信情况声明	12
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、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>1、股票投资策略</p> <p>（1）股票投资组合的构建</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>（2）股票投资组合的调整</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
	联系电话	0755-88601888
	电子邮箱	qhky@qhkyfund. com
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信投资合伙企业(有限合伙)各持股权 25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海、广州设立分公司。经中国证监会批准，前海开源基金全资控股子公司—前海开源资产管理有限公司已于 2013 年 9 月 5 日在深圳市注册成立，截至报告期末，注册资本为 1.8 亿元人民币。

截至报告期末，前海开源基金旗下管理 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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，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的真实、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 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
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
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6. 4. 7. 3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付清算款		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
净资产：			

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 等权重 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
一、营业总收入		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
减：二、营业总支出		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		
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	未分配利润	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		
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
项目	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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 王厚琼 傅智
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

前海开源中证 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

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 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			
	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
	银行间市场	-	-	-
	合计	501,425.00	2,653.85	504,503.85
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			
	2025 年 06 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		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	
	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	
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
上年度末	基金份额（份） 40,113,665.00	账面金额 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
	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
	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
	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
	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
	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）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
	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 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 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 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 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 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 2025年01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中国银河证券	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 2025年01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
中国银河证券	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 2025年01月01日至2025年06月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总 额的比例
中国银河证券	4,352.81	100.00%	3,774.60	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中国银河证券	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 2025年01月01日至 2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至 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 2025年01月01日至2025年 06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	21,194,900.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总 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	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国银河证券	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										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位： 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123257	安克转债	2025 年 06 月 16 日	1 个月内 (含)	新债未上市	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主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系建设，建立了以监察及风险控制委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理团队和相关业务部门构成的多层级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理团队负责，协调并与各部门合作完成运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 2025 年 06 月 30 日	上年度末 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 2025 年 06 月 30 日	上年度末 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 2025 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	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					
2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	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 2025 年 06 月 30 日	上年度末 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

金额单位：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，以尽量避免赎空风险。

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 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 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》等有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 额	占当期	成交金 额	占当期	成交金 额	占当期	成交金 额	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	515,04 1.50	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 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份额赎回的现金需要，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 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 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

前海开源基金管理有限公司

2025 年 08 月 29 日