

前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金  
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

送出日期：2026 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 03 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。

本报告中的财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录 .....	2
1.1	重要提示 .....	2
1.2	目录 .....	3
§2	基金简介 .....	5
2.1	基金基本情况 .....	5
2.2	基金产品说明 .....	5
2.3	基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4	信息披露方式 .....	6
2.5	其他相关资料 .....	6
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	7
3.1	主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2	基金净值表现 .....	8
3.3	过去三年基金的利润分配情况 .....	10
§4	管理人报告 .....	10
4.1	基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	14
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
4.9	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	15
§5	托管人报告 .....	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	15
§6	审计报告 .....	15
6.1	审计报告基本信息 .....	16
6.2	审计报告的基本内容 .....	16
§7	年度财务报表 .....	18
7.1	资产负债表 .....	18
7.2	利润表 .....	19
7.3	净资产变动表 .....	20
7.4	报表附注 .....	21
§8	投资组合报告 .....	48
8.1	期末基金资产组合情况 .....	48
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	49
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	50
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	50
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	58
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	58
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	58

8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	58
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	58
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	58
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
8.12	投资组合报告附注	59
§9	基金份额持有人信息	59
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	60
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	61
§10	开放式基金份额变动	61
§11	重大事件揭示	61
11.1	基金份额持有人大会决议	61
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	61
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
11.4	基金投资策略的改变	62
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	62
11.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	62
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
11.8	其他重大事件	63
§12	影响投资者决策的其他重要信息	64
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	64
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	65
§13	备查文件目录	65
13.1	备查文件目录	65
13.2	存放地点	65
13.3	查阅方式	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	前海开源事件驱动混合	
基金主代码	000423	
基金运作方式	契约型普通开放式	
基金合同生效日	2013 年 12 月 19 日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	34,509,713.17 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海开源事件驱动混合 A	前海开源事件驱动混合 C
下属分级基金的交易代码	000423	001865
报告期末下属分级基金的份额总额	27,589,533.56 份	6,920,179.61 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金基于对宏观经济、资本市场的深入分析和理解，在积极把握市场发展趋势和市场参与者行为逻辑的基础上，精选具有估值优势和成长潜力的公司进行投资，力争获取超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下五方面内容：</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>在大类资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金在积极把握宏观经济变迁、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上，将影响行业和公司投资价值的事件性因素作为投资的主线，以事件驱动为核心的投资策略。本基金通过选取一年内发布过基金合同约定事件的相关公告的上市公司，在其事件发生或相关公告出具后，从中挑选部分公司进入股票池；或者在事前通过公开信息的定量研究，批量选择有可能发生基金合同约定事件的公司进入股票池，管理人通过优选股票池中的股票或者批量买入构建组合。本基金的股票投资策略分为以下两个层次：（1）不同类型事件驱动下的投资组合配置；（2）个股配置。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金投资债券等固定收益类资产的主要目的是为了有效控制</p>

	<p>股票等权益类资产的投资风险，优化组合流动性管理，并显著提高债券投资组合债息收益。当股票市场风险显著增大时，本基金将降低股票等权益类资产投资的仓位，增加对债券等固定收益类资产的投资。</p> <p>因此，在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属固定收益类投资品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以目标久期管理和品种选择策略为主，以收益率利差策略、债券置换策略为辅，构造能获得稳定收益的固定收益类投资品种组合。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金将权证的作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		前海开源基金管理有限公司	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙辰健	周直毅
	联系电话	0755-88601888	021-68475608
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	custody@bosscn.com
客户服务电话		4001-666-998	95594
传真		0755-83181169	021-68476901
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）	上海市黄浦区中山南路688号
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号37层
邮政编码		518040	200120
法定代表人		李强	顾建忠

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.qhkyfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区长安街1号东方广场安永大楼17层
注册登记机构	前海开源基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦2206

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年		2024 年		2023 年	
	前海开源事件驱动混合 A	前海开源事件驱动混合 C	前海开源事件驱动混合 A	前海开源事件驱动混合 C	前海开源事件驱动混合 A	前海开源事件驱动混合 C
本期已实现收益	5,239,476.92	1,133,906.92	3,297,221.62	499,358.78	4,059,071.65	351,093.91
本期利润	8,028,503.22	1,700,928.53	781,318.24	203,056.84	171,212.59	47,859.77
加权平均基金份额本期利润	0.3144	0.3139	0.0320	-0.0441	0.0066	0.0199
本期加权平均净值利润率	15.70%	17.37%	1.76%	-2.68%	0.36%	1.19%
本期基金份额净值增长率	18.93%	18.83%	1.57%	1.55%	0.28%	0.19%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	前海开源事件驱动混合 A	前海开源事件驱动混合 C	前海开源事件驱动混合 A	前海开源事件驱动混合 C	前海开源事件驱动混合 A	前海开源事件驱动混合 C
期末可供分配利润	31,712,194.56	6,572,350.28	18,696,944.66	3,557,508.46	19,843,732.90	1,366,309.91
期末可供分配基金份额利润	1.1494	0.9497	0.8072	0.6409	0.7795	0.6164
期末基金资产净值	59,301,728.12	13,492,529.89	41,860,089.54	9,108,196.21	45,301,172.29	3,582,810.46
期末基金份额净值	2.149	1.950	1.807	1.641	1.779	1.616
	2025 年末		2024 年末		2023 年末	

3.1.3 累计 期末指标	前海开源事 件驱动混合 A	前海开源事 件驱动混合 C	前海开源事 件驱动混合 A	前海开源 事件驱动 混合 C	前海开源事 件驱动混合 A	前海开源 事件驱动 混合 C
基金份额累 计净值增长 率	114.90%	95.00%	80.70%	64.10%	77.90%	61.60%

注：①上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海开源事件驱动混合 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.66%	0.93%	0.07%	0.66%	1.59%	0.27%
过去六个月	3.92%	0.82%	11.98%	0.63%	-8.06%	0.19%
过去一年	18.93%	1.07%	12.55%	0.66%	6.38%	0.41%
过去三年	21.14%	1.03%	19.35%	0.74%	1.79%	0.29%
过去五年	3.82%	1.18%	0.34%	0.79%	3.48%	0.39%
自基金合同生 效起至今	114.90%	1.14%	104.81%	0.94%	10.09%	0.20%

前海开源事件驱动混合 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.67%	0.93%	0.07%	0.66%	1.60%	0.27%
过去六个月	3.89%	0.82%	11.98%	0.63%	-8.09%	0.19%
过去一年	18.83%	1.07%	12.55%	0.66%	6.28%	0.41%
过去三年	20.89%	1.03%	19.35%	0.74%	1.54%	0.29%
过去五年	3.39%	1.18%	0.34%	0.79%	3.05%	0.39%
自基金合同生 效起至今	95.00%	1.18%	41.14%	0.84%	53.86%	0.34%

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

前海开源事件驱动混合 A



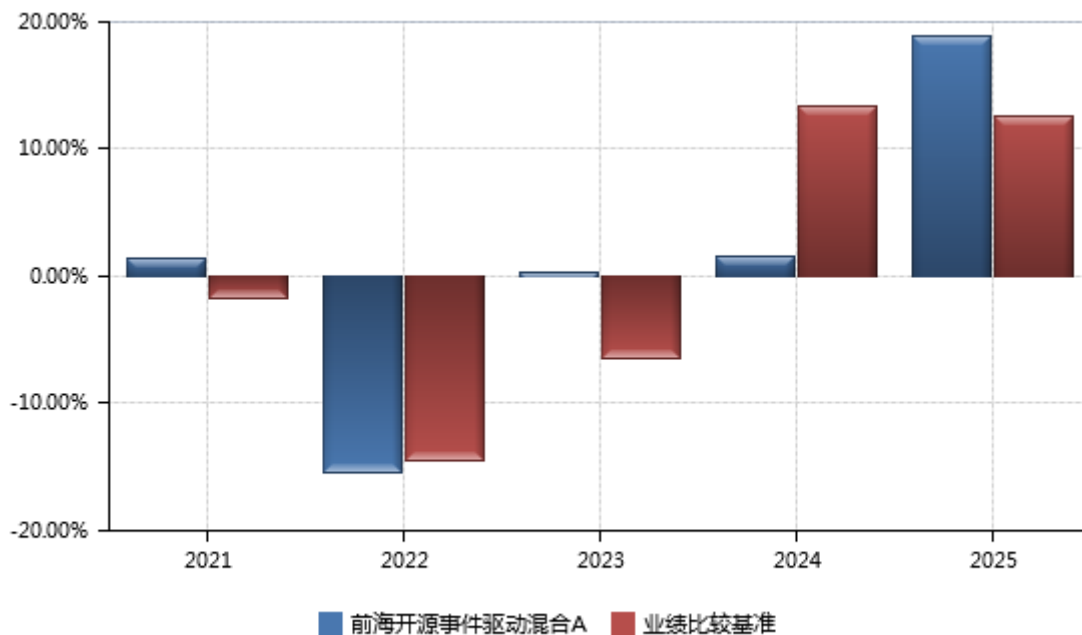
前海开源事件驱动混合 C



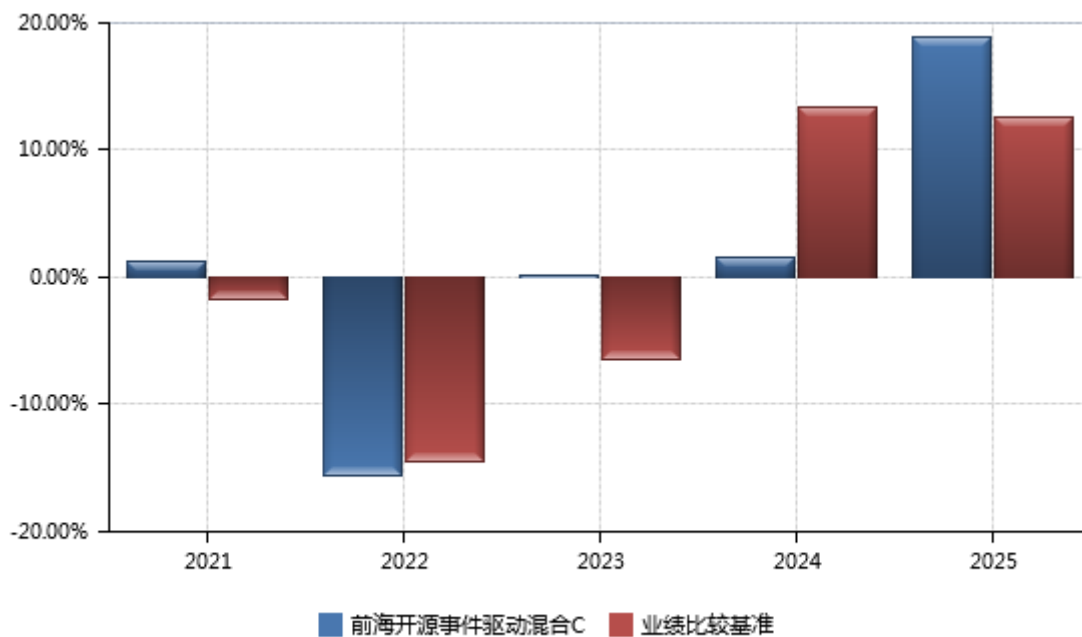
注：本基金自 2015 年 10 月 26 日起，增加 C 类基金份额并设置对应基金代码；2015 年 10 月 26 日基金份额为零。前海开源事件驱动混合 C 类基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较起始日为 2015 年 10 月 27 日。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海开源事件驱动混合 A



前海开源事件驱动混合 C



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

前海开源基金管理有限公司（以下简称“前海开源基金”）于 2012 年 12 月 27 日经中国证监会批准，2013 年 1 月 23 日注册成立，截至报告期末，注册资本为 2 亿元人民币。其中，开源证券股份有限公司、北京市中盛金期投资管理有限公司、北京长和世纪资产管理有限公司和深圳市和合投信投资合伙企业(有限合伙)各持股权 25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海、广州设立分公司。经中国证监会批准，前海开源基金全资控股子公司——前海开源资产管理有限公司已于 2013 年 9 月 5 日在深圳市注册成立，截至报告期末，注册资本为 1.8 亿元人民币。

截至报告期末，前海开源基金旗下管理 110 只开放式基金，资产管理规模超过 979 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		
王达	本基金的基金经理	2023 年 03 月 10 日	-	15 年	王达先生，金融学学士。2010 年 9 月至 2011 年 5 月任银河证券北京阜成路营业部研究助理；2011 年 6 月至 2014 年 4 月任中信产业投资基金管理有限公司研究员；2014 年 4 月至 2019 年 5 月任华商基金管理有限公司高级研究员；2019 年 6 月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司基金经理。

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

②证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋

求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订）的规定，针对股票市场、债券市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节，制定了《前海开源基金管理有限公司公平交易管理办法》、《前海开源基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合投资策略需要，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

截至2025年底，A股主要指数年内均上涨，本产品A类份额2025全年收益率为18.93%，同期业绩比较基准收益率为12.55%。

回顾全年A股市场，以沪深300为代表的主要宽基指数走出波动性较低的上涨行情，但各类风格投资人的投资体感差异较大。在持续性的指数走势里，各类突发事件扰动、行业投资偏好趋同带来的风格强化以及主题性板块轮动等交织其中，加之指数波动率频繁的快慢换挡使得本年盈利难度

被大幅推高。从年初市场的快速调整，到春节后以 Deepseek 与机器人为主的泛科技行情，再到 4 月初中美贸易摩擦导致的波动，8 月中下旬开始以半导体和 CPO 为主的板块开启资金集聚的强势行情，以及年底附近贵金属与商业航天的爆发等等现象，均表明行业与风格在 2025 年内不断切换，赚钱效应也在各类风格之间轮转。

2025 年全球都在变局中演进，政治与经贸等各类领域发生了足以改变格局的重大事件，巨大的不确定性直接导致了全球金融市场产生较大震荡。我们认为，进入 2026 年全球或将持续维持不确定的状态，各类冲突与摩擦、以及突发与超预期状况或将不断扰动全球市场。站在投资角度我们认为需要重点思考整体投资组合的风险敞口，将回撤控制放在优先顺位考虑。

展望 2026 年，我们判断 A 股市场或将维持震荡上升的格局，其中震荡的幅度和频率或将强于 2025 年，这将使得投资人在 2026 年面对的情况更加复杂。本报告期末，我们将资产依旧主要配置在我们持续看好的四大板块（硬核科技、医药医疗、TMT 与中特估），其中我们将根据实际情况向一些中短期滞涨的方向稍作倾斜，包括软件开发与医疗保健等；除此之外，在保持较高仓位的同时持仓风格也将向中盘方向稍作加强。随后我们将持续跟踪市场表现，在维持当前集中风格的前提下校准组合。

放眼新年，我们对市场持乐观态度。我们依旧维持 2024 年三季度观点，看好后市大级别行情。随着行情的推进与展开，市场也逐步进入到纵深阶段，加之内外都处在变化中，所以有些短期行情的演化是所有投资人都不曾经历过的，追求形似就是刻舟求剑的“着相”之举。但在变化中亦存在很多不变的东西，我们寻求的是市场运行的规律与神韵，不被眼前的 K 线困住才能看到更大的世界。

最后，感谢支持与关注我们的朋友，祝丙午年顺遂。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源事件驱动混合 A 基金份额净值为 2.149 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 18.93%，同期业绩比较基准收益率为 12.55%；截至报告期末前海开源事件驱动混合 C 基金份额净值为 1.950 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 18.83%，同期业绩比较基准收益率为 12.55%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，我们认为国内宏观经济将呈现稳步回升态势，具体到证券投资市场，我们的目光也将聚焦具有向好变化的宏观方向，在上述投资策略和运作分析中已详述，此处不再展开。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益的角度出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 本年度，公司采取外聘律师、内外部专业人士相结合的方式，对各业务部门进行了多维度、多层次的法律法规培训和职业道德培训，进一步提高了公司从业人员的合规素质和职业道德修养，持续夯实公司合规文化体系基础。

(2) 本年度，公司按照证监会的要求对公司治理、投资、研究、交易、基金会计、注册登记、人力资源、基金销售等主要业务进行定期稽核工作。同时，对信息技术、用户权限、通信管理与视频监控、基金直销、后台运营、内幕交易防控等相关业务开展了专项稽核工作，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性等。

(3) 通过事前合规防范、事中系统控制、事后完善纠偏的方式，全面加强了对公司产品日常投资运作的管理与监控，保证投资符合既定的投资决策程序与业务流程，基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

(4) 全面参与新产品设计、新业务拓展工作，负责日常合同审查，监督客户投诉处理。积极参与证监会新规定出台前的讨论并提出修改建议。

(5) 完成各基金及公司的各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；重视媒体监督和投资者关系管理工作。

(6) 按照规定向人民银行报送反洗钱相关报表和报告，开展数据治理，优化可疑交易监测指标，加强反洗钱系统建设，确保反洗钱工作运行正常。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会主席由总经理办公会指定，估值委员会成员包含投资、研究、会计和风控等岗位资深人员，均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的基金行业实践经验。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供固定收益品种和流通受限股票的估值相关数据。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2026）审字第 70048283_H43 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时，管理层负责评估前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>高鹤   邓雯</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>北京市东城区长安街1号东方广场安永大楼17层</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2026年03月26日</p>

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	4,810,433.69	2,833,001.06
结算备付金		1,446,500.28	2,011,218.79
存出保证金		380,310.80	520,414.77
交易性金融资产	7.4.7.2	66,397,013.03	46,138,814.80
其中：股票投资		66,397,013.03	46,138,814.80
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	734,772.21	-
应收清算款		-	214,717.18
应收股利		-	-
应收申购款		6,293.67	529.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		73,775,323.68	51,718,696.02
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b> <b>2025 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末</b> <b>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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		606,549.71	288,050.60
应付赎回款		35,815.11	22,523.47
应付管理人报酬		54,779.63	41,119.84
应付托管费		3,043.32	2,284.45
应付销售服务费		1,105.86	817.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	279,772.04	395,614.11
负债合计		981,065.67	750,410.27
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	34,509,713.17	28,713,832.63
未分配利润	7.4.7.8	38,284,544.84	22,254,453.12
净资产合计		72,794,258.01	50,968,285.75
负债和净资产总计		73,775,323.68	51,718,696.02

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，前海开源事件驱动混合基金份额总额 34,509,713.17 份，其中，前海开源事件驱动混合 A 类基金份额净值 2.149 元，基金份额总额 27,589,533.56 份；前海开源事件驱动混合 C 类基金份额净值 1.950 元，基金份额总额 6,920,179.61 份。

## 7.2 利润表

会计主体：前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		10,433,606.16	1,198,696.04
1. 利息收入		141,597.25	183,476.90
其中：存款利息收入	7.4.7.9	45,708.48	92,238.29
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		95,888.77	91,238.61
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,891,451.35	4,185,790.39
其中：股票投资收益	7.4.7.10	6,331,159.78	3,618,706.94
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	32.50	51,692.46
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	560,259.07	515,390.99
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	3,356,047.91	-3,218,319.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	44,509.65	47,747.75
<b>减：二、营业总支出</b>		704,174.41	620,434.64
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	545,878.74	468,602.31

2. 托管费	7.4.10.2.2	30,326.64	26,033.44
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	9,737.03	7,560.89
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.20	118,232.00	118,238.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>9,729,431.75</b>	<b>578,261.40</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>9,729,431.75</b>	<b>578,261.40</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>9,729,431.75</b>	<b>578,261.40</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	28,713,832.63	22,254,453.12	50,968,285.75
二、本期期初净资产	28,713,832.63	22,254,453.12	50,968,285.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,795,880.54	16,030,091.72	21,825,972.26
（一）、综合收益总额	-	9,729,431.75	9,729,431.75
（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）	5,795,880.54	6,300,659.97	12,096,540.51
其中：1. 基金申购款	14,314,097.66	15,432,818.20	29,746,915.86
2. 基金赎回款	-8,518,217.12	-9,132,158.23	-17,650,375.35
（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	34,509,713.17	38,284,544.84	72,794,258.01
项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	27,673,939.94	21,210,042.81	48,883,982.75
二、本期期初净资产	27,673,939.94	21,210,042.81	48,883,982.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,039,892.69	1,044,410.31	2,084,303.00

号填列)			
(一)、综合收益总额	-	578,261.40	578,261.40
(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)	1,039,892.69	466,148.91	1,506,041.60
其中: 1. 基金申购款	15,176,673.56	10,195,453.92	25,372,127.48
2. 基金赎回款	-14,136,780.87	-9,729,305.01	-23,866,085.88
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	28,713,832.63	22,254,453.12	50,968,285.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

秦亚峰

王厚琼

傅智

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金(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[2013]1399号《关于核准前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的批复》核准,由前海开源基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币128,484,379.36元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2013]第332A0009号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2013年12月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为128,523,462.75份基金份额,其中认购资金利息折合39,083.39份基金份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司,基金托管人为上海银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,001,250.00基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据本基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司于2015年10月23日发布的《关于前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同的公告》以及更新的《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,自2015年10月26日起,本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提

销售服务费称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：将基金资产的 0%-95% 投资于股票，将不低于 5% 的基金资产投资于债券等固定收益类品种，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率  $\times 70\%$  + 中证全债指数收益率  $\times 30\%$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司于审计报告日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### （1）金融资产分类

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

##### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

- （1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调

整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金

融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

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

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

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额

能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

##### (1) 增值税及附加

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

根据财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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

## （2）企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

## （3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所

得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

#### （4）印花税（如适用）

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

#### （5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	4,810,433.69	2,833,001.06
等于：本金	4,809,490.77	2,832,404.76
加：应计利息	942.92	596.30
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	4,810,433.69	2,833,001.06

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	66,442,613.17	-	66,397,013.03	-45,600.14
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	66,442,613.17	-	66,397,013.03	-45,600.14
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	49,540,462.85	-	46,138,814.80	-3,401,648.05
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	49,540,462.85	-	46,138,814.80	-3,401,648.05

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	734,772.21	-
银行间市场	-	-
合计	734,772.21	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 其他资产

无。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.50	0.05
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	175,271.54	371,114.06
其中：交易所市场	175,271.54	371,114.06
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	104,500.00	24,500.00
合计	279,772.04	395,614.11

#### 7.4.7.7 实收基金

前海开源事件驱动混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,163,144.88	23,163,144.88
本期申购	10,865,696.46	10,865,696.46
本期赎回（以“-”号填列）	-6,439,307.78	-6,439,307.78
本期末	27,589,533.56	27,589,533.56

前海开源事件驱动混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,550,687.75	5,550,687.75
本期申购	3,448,401.20	3,448,401.20
本期赎回（以“-”号填列）	-2,078,909.34	-2,078,909.34
本期末	6,920,179.61	6,920,179.61

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

前海开源事件驱动混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	27,710,715.00	-9,013,770.34	18,696,944.66
本期期初	27,710,715.00	-9,013,770.34	18,696,944.66
本期利润	5,239,476.92	2,789,026.30	8,028,503.22
本期基金份额交易产生的变动数	6,319,832.75	-1,333,086.07	4,986,746.68
其中：基金申购款	15,389,388.43	-3,140,045.95	12,249,342.48
基金赎回款	-9,069,555.68	1,806,959.88	-7,262,595.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	39,270,024.67	-7,557,830.11	31,712,194.56

前海开源事件驱动混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,454,055.16	-1,896,546.70	3,557,508.46
本期期初	5,454,055.16	-1,896,546.70	3,557,508.46
本期利润	1,133,906.92	567,021.61	1,700,928.53
本期基金份额交易产生的变动数	1,625,017.47	-311,104.18	1,313,913.29
其中：基金申购款	3,979,644.26	-796,168.54	3,183,475.72
基金赎回款	-2,354,626.79	485,064.36	-1,869,562.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,212,979.55	-1,640,629.27	6,572,350.28

## 7.4.7.9 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12 月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
活期存款利息收入	40,438.64	75,617.11
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	3,689.18	13,384.70
其他	1,580.66	3,236.48
合计	45,708.48	92,238.29

## 7.4.7.10 股票投资收益--买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	684,323,514.49	704,058,743.07
减：卖出股票成本总额	676,919,748.12	699,211,711.11
减：交易费用	1,072,606.59	1,228,325.02
买卖股票差价收入	6,331,159.78	3,618,706.94

## 7.4.7.11 基金投资收益

无。

## 7.4.7.12 债券投资收益

## 7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月 31日
债券投资收益--利息收入	25.50	3,075.45
债券投资收益--买卖债券（债 转股及债券到期兑付）差价收 入	7.00	48,617.01
债券投资收益--赎回差价收入	-	-
债券投资收益--申购差价收入	-	-
合计	32.50	51,692.46

## 7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12 月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	700,862.82	15,882,162.93
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	699,657.00	15,724,802.99
减：应计利息总额	1,198.82	108,742.93
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	7.00	48,617.01

#### 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益—买卖资产支持证券差价收入

无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入

无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

无。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益—其他投资收益

无。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
----	-----------------------------------	--

股票投资产生的股利收益	560,259.07	515,390.99
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	560,259.07	515,390.99

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2025年01月01日至2025年12月31日	2024年01月01日至2024年12月31日
1. 交易性金融资产	3,356,047.91	-3,218,319.00
--股票投资	3,356,047.91	-3,218,319.00
--债券投资	-	-
--资产支持证券投资	-	-
--基金投资	-	-
--贵金属投资	-	-
--其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
--权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	3,356,047.91	-3,218,319.00

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年01月01日至2025年12月31日	2024年01月01日至2024年12月31日
基金赎回费收入	34,534.26	45,735.31
转换费收入	9,975.39	2,012.44
合计	44,509.65	47,747.75

#### 7.4.7.19 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年01月01日至2025年12月31日	2024年01月01日至2024年12月31日
审计费用	20,000.00	20,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00

证券出借违约金	-	-
汇划手续费	232.00	238.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	118,232.00	118,238.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
上海银行股份有限公司（“上海银行”）	基金托管人、基金销售机构
开源证券股份有限公司（“开源证券”）	基金销售机构、基金管理人的股东
北京长和世纪资产管理有限公司	基金管理人的股东
北京市中盛金期投资管理有限公司	基金管理人的股东
深圳市和合投信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
前海开源资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年01月01日至 2025年12月31日	2024年01月01日至 2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	545,878.74	468,602.31
其中：应支付销售机构的客户维护费	89,865.35	88,657.22
应支付基金管理人的净管理费	456,013.39	379,945.09

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 0.90% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.90\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年01月01日至2025年 12月31日	2024年01月01日至2024 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	30,326.64	26,033.44

注：支付基金托管人上海银行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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025年01月01日至2025年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源事件 驱动混合 A	前海开源事件 驱动混合 C	合计
前海开源基金	-	7,528.84	7,528.84
合计	-	7,528.84	7,528.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2024年01月01日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源事件 驱动混合 A	前海开源事件 驱动混合 C	合计

前海开源基金	-	3,330.35	3,330.35
开源证券	-	217.84	217.84
合计	-	3,548.19	3,548.19

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给前海开源基金，再由前海开源基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

前海开源事件驱动混合 A

份额单位：份

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2013 年 12 月 19 日）持有的基金份额	10,001,250.00	10,001,250.00
报告期初持有的基金份额	14,639,770.15	14,639,770.15
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	14,639,770.15	14,639,770.15
报告期末持有的基金份额占基金总 份额比例	53.06%	63.20%

## 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

前海开源事件驱动混合 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 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
前海开源资 产管理有限 公司	1,158,077.59	4.20%	-	-

前海开源事件驱动混合 C

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 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
前海开源资 产管理有限 公司	3,870,080.27	55.92%	3,870,080.27	69.72%

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

## 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海银行	4,810,433.69	40,438.64	2,833,001.06	75,617.11

注：本基金的银行存款由基金托管人上海银行保管，按适用利率或约定利率计息。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末 2025 年 12 月 31 日本基金持有的流通受限证券

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

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，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。

#### **7.4.13.2 信用风险**

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

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

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

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

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

##### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

##### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本报告期末，除卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,810,433.69	-	-	-	4,810,433.69
结算备付金	1,446,500.28	-	-	-	1,446,500.28
存出保证金	380,310.80	-	-	-	380,310.80
交易性金融资产	-	-	-	66,397,013.03	66,397,013.03
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	734,772.21	-	-	-	734,772.21
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	6,293.67	6,293.67
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,372,016.98	-	-	66,403,306.70	73,775,323.68
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	-	-	-	606,549.71	606,549.71
应付赎回款	-	-	-	35,815.11	35,815.11
应付管理人报酬	-	-	-	54,779.63	54,779.63
应付托管费	-	-	-	3,043.32	3,043.32
应付销售服务费	-	-	-	1,105.86	1,105.86
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	-	-	-	279,772.04	279,772.04
负债总计	-	-	-	981,065.67	981,065.67
利率敏感度缺口	7,372,016.98	-	-	65,422,241.03	72,794,258.01
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	2,833,001.06	-	-	-	2,833,001.06
结算备付金	2,011,218.79	-	-	-	2,011,218.79
存出保证金	520,414.77	-	-	-	520,414.77
交易性金融资产	-	-	-	46,138,814.80	46,138,814.80
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	214,717.18	214,717.18
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	529.42	529.42
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,364,634.62	-	-	46,354,061.40	51,718,696.02
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	-	-	288,050.60	288,050.60
应付赎回款	-	-	22,523.47	22,523.47
应付管理人报酬	-	-	41,119.84	41,119.84
应付托管费	-	-	2,284.45	2,284.45
应付销售服务费	-	-	817.80	817.80
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	-	-	395,614.11	395,614.11
负债总计	-	-	750,410.27	750,410.27
利率敏感度缺口	5,364,634.62	-	-	45,603,651.13
				50,968,285.75

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所

持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 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	66,397,013.03	91.21	46,138,814.80	90.52
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	66,397,013.03	91.21	46,138,814.80	90.52

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	3,212,312.43	2,642,328.50
	业绩比较基准下降 5%	-3,212,312.43	-2,642,328.50

### 7.4.14 公允价值

#### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末	上年度末
---------------	-----	------

	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
第一层次	66,397,013.03	46,138,814.80
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	66,397,013.03	46,138,814.80

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

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

无。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2024 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	66,397,013.03	90.00
	其中：股票	66,397,013.03	90.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	734,772.21	1.00
	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	6,256,933.97	8.48
8	其他各项资产	386,604.47	0.52
9	合计	73,775,323.68	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,439,997.13	14.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,287,565.00	4.52
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,980,764.27	54.92
J	金融业	6,643,332.00	9.13
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	6,045,354.63	8.30
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	66,397,013.03	91.21

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603387	基蛋生物	418,865	3,505,900.05	4.82
2	688315	诺禾致源	261,651	3,474,725.28	4.77
3	688338	赛科希德	134,124	3,471,129.12	4.77
4	688468	科美诊断	471,794	3,462,967.96	4.76
5	600446	金证股份	215,100	3,424,392.00	4.70
6	600570	恒生电子	113,200	3,412,980.00	4.69
7	688225	亚信安全	173,231	3,360,681.40	4.62
8	603927	中科软	175,271	3,345,923.39	4.60
9	688083	中望软件	49,050	3,340,795.50	4.59
10	600927	永安期货	207,600	3,336,132.00	4.58
11	688588	凌志软件	233,060	3,335,088.60	4.58
12	688232	新点软件	133,863	3,322,479.66	4.56
13	688508	芯朋微	54,393	3,312,533.70	4.55
14	001236	弘业期货	312,000	3,307,200.00	4.54
15	300383	光环新网	264,300	3,306,393.00	4.54
16	000032	深桑达 A	169,900	3,287,565.00	4.52
17	688023	安恒信息	63,822	3,281,089.02	4.51
18	300002	神州泰岳	283,800	3,269,376.00	4.49
19	300738	奥飞数据	176,800	3,269,032.00	4.49
20	688179	阿拉丁	205,815	2,570,629.35	3.53

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688232	新点软件	14,689,104.45	28.82
2	300383	光环新网	13,262,989.00	26.02
3	000032	深桑达 A	12,708,875.00	24.93
4	300738	奥飞数据	12,136,618.00	23.81
5	605009	豪悦护理	11,653,821.60	22.86

6	601186	中国铁建	11,415,902.00	22.40
7	688041	海光信息	10,861,076.91	21.31
8	688981	中芯国际	10,644,936.76	20.89
9	601800	中国交建	10,538,469.00	20.68
10	300002	神州泰岳	10,492,706.00	20.59
11	600941	中国移动	10,243,397.00	20.10
12	300315	掌趣科技	9,922,853.00	19.47
13	688225	亚信安全	9,822,595.28	19.27
14	002970	锐明技术	9,800,078.00	19.23
15	688338	赛科希德	9,669,949.11	18.97
16	601390	中国中铁	9,479,807.00	18.60
17	688588	凌志软件	9,439,743.45	18.52
18	600050	中国联通	9,207,313.00	18.06
19	688023	安恒信息	9,164,370.92	17.98
20	601728	中国电信	8,941,940.00	17.54
21	688315	诺禾致源	8,469,421.63	16.62
22	603927	中科软	8,462,602.00	16.60
23	688031	星环科技	8,403,781.14	16.49
24	300783	三只松鼠	8,362,955.00	16.41
25	601336	新华保险	8,242,669.00	16.17
26	300939	秋田微	7,800,388.00	15.30
27	601318	中国平安	7,586,129.00	14.88
28	001236	弘业期货	7,545,179.00	14.80
29	600927	永安期货	7,361,725.36	14.44
30	601601	中国太保	7,195,705.00	14.12
31	688601	力芯微	7,132,604.77	13.99
32	002990	盛视科技	7,127,602.00	13.98
33	688179	阿拉丁	7,064,014.34	13.86
34	002605	姚记科技	6,896,907.00	13.53
35	688682	霍莱沃	6,764,023.76	13.27
36	601019	山东出版	6,518,837.00	12.79
37	601998	中信银行	6,466,146.00	12.69
38	600012	皖通高速	6,437,307.00	12.63
39	688508	芯朋微	6,407,561.25	12.57
40	001965	招商公路	6,405,033.00	12.57
41	600570	恒生电子	6,347,221.00	12.45
42	601628	中国人寿	6,226,307.00	12.22
43	688800	瑞可达	6,198,455.61	12.16
44	688083	中望软件	6,157,234.04	12.08
45	601328	交通银行	6,072,329.00	11.91
46	688365	光云科技	6,051,293.86	11.87

47	688468	科美诊断	5,960,101.37	11.69
48	600900	长江电力	5,802,912.00	11.39
49	601939	建设银行	5,791,652.00	11.36
50	603158	腾龙股份	5,778,777.00	11.34
51	688012	中微公司	5,775,044.46	11.33
52	002423	中粮资本	5,747,101.00	11.28
53	300898	熊猫乳品	5,680,601.00	11.15
54	002859	洁美科技	5,671,315.00	11.13
55	688347	华虹公司	5,554,437.86	10.90
56	601098	中南传媒	5,430,173.00	10.65
57	600015	华夏银行	5,366,761.00	10.53
58	688087	英科再生	4,689,789.94	9.20
59	688621	阳光诺和	4,444,138.37	8.72
60	688158	优刻得	4,394,214.21	8.62
61	601801	皖新传媒	4,376,444.00	8.59
62	600373	中文传媒	4,259,648.00	8.36
63	000415	渤海租赁	4,237,968.00	8.31
64	601088	中国神华	4,096,604.00	8.04
65	000166	申万宏源	4,048,410.00	7.94
66	600958	东方证券	3,988,075.00	7.82
67	601166	兴业银行	3,956,936.00	7.76
68	601319	中国人保	3,887,543.00	7.63
69	600377	宁沪高速	3,799,329.00	7.45
70	601006	大秦铁路	3,788,733.00	7.43
71	600350	山东高速	3,786,380.00	7.43
72	601169	北京银行	3,740,972.00	7.34
73	300760	迈瑞医疗	3,718,245.00	7.30
74	600036	招商银行	3,698,803.00	7.26
75	000001	平安银行	3,617,694.00	7.10
76	600446	金证股份	3,538,877.00	6.94
77	002368	太极股份	3,491,318.00	6.85
78	603387	基蛋生物	3,481,126.25	6.83
79	688131	皓元医药	3,452,652.20	6.77
80	688222	成都先导	3,383,014.77	6.64
81	300496	中科创达	3,373,610.00	6.62
82	002351	漫步者	3,318,492.00	6.51
83	300253	卫宁健康	3,306,262.00	6.49
84	002727	一心堂	3,297,142.00	6.47
85	600757	长江传媒	3,267,194.00	6.41
86	002405	四维图新	3,265,357.00	6.41
87	601077	渝农商行	3,260,206.00	6.40

88	688777	中控技术	3,258,724.72	6.39
89	300418	昆仑万维	3,222,058.00	6.32
90	300015	爱尔眼科	3,181,680.00	6.24
91	601928	凤凰传媒	3,172,439.00	6.22
92	603883	老百姓	3,138,534.00	6.16
93	600271	航天信息	2,973,820.00	5.83
94	300896	爱美客	2,846,223.00	5.58
95	000617	中油资本	2,778,363.00	5.45
96	601788	光大证券	2,762,478.00	5.42
97	601698	中国卫通	2,753,143.00	5.40
98	002939	长城证券	2,751,042.00	5.40
99	601600	中国铝业	2,729,949.00	5.36
100	600497	驰宏锌锗	2,704,920.00	5.31
101	601377	兴业证券	2,692,066.00	5.28
102	000878	云南铜业	2,671,651.00	5.24
103	688095	福昕软件	2,540,364.68	4.98
104	300976	达瑞电子	2,433,886.00	4.78
105	300937	药易购	2,398,250.00	4.71
106	002279	久其软件	2,272,521.00	4.46
107	600030	中信证券	2,235,989.00	4.39
108	601900	南方传媒	2,173,422.00	4.26
109	603439	三力制药	2,140,946.00	4.20
110	300957	贝泰妮	2,126,114.00	4.17
111	605058	澳弘电子	2,109,895.00	4.14
112	601658	邮储银行	2,100,739.00	4.12
113	600028	中国石化	2,096,522.00	4.11
114	688026	洁特生物	2,092,513.56	4.11
115	000065	北方国际	2,072,346.00	4.07
116	600938	中国海油	1,956,245.00	3.84
117	002558	巨人网络	1,936,073.00	3.80
118	600118	中国卫星	1,920,907.00	3.77
119	688111	金山办公	1,907,572.74	3.74
120	601668	中国建筑	1,904,589.00	3.74
121	601857	中国石油	1,890,746.00	3.71
122	002697	红旗连锁	1,870,812.00	3.67
123	603882	金域医学	1,783,549.00	3.50
124	600763	通策医疗	1,769,449.00	3.47
125	300676	华大基因	1,766,777.00	3.47
126	002044	美年健康	1,757,594.00	3.45
127	688689	银河微电	1,670,356.09	3.28
128	001872	招商港口	1,657,933.00	3.25

129	000977	浪潮信息	1,646,201.00	3.23
130	601000	唐山港	1,630,996.55	3.20
131	600737	中粮糖业	1,620,950.00	3.18
132	600008	首创环保	1,618,358.00	3.18
133	603889	新澳股份	1,603,215.00	3.15
134	000848	承德露露	1,590,747.00	3.12
135	301080	百普赛斯	1,540,693.00	3.02
136	002788	鹭燕医药	1,441,057.00	2.83
137	002027	分众传媒	1,367,915.00	2.68
138	601288	农业银行	1,327,629.00	2.60
139	301236	软通动力	1,247,437.00	2.45
140	600717	天津港	1,100,114.00	2.16
141	000928	中钢国际	1,079,958.00	2.12
142	605199	ST 葫芦娃	1,076,256.00	2.11
143	601398	工商银行	1,071,002.00	2.10
144	002572	索菲亚	1,062,363.00	2.08
145	600887	伊利股份	1,057,672.00	2.08

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688232	新点软件	12,452,368.20	24.43
2	605009	豪悦护理	11,520,250.72	22.60
3	002970	锐明技术	11,432,661.00	22.43
4	000032	深桑达 A	11,345,810.00	22.26
5	601186	中国铁建	11,292,808.00	22.16
6	300315	掌趣科技	11,223,521.00	22.02
7	688981	中芯国际	10,741,068.16	21.07
8	688041	海光信息	10,725,913.79	21.04
9	601800	中国交建	10,431,544.00	20.47
10	600941	中国移动	10,227,121.18	20.07
11	688031	星环科技	10,064,742.24	19.75
12	300383	光环新网	9,787,348.00	19.20
13	600050	中国联通	9,709,931.00	19.05
14	002990	盛视科技	9,505,727.00	18.65
15	601390	中国中铁	9,233,692.00	18.12
16	300002	神州泰岳	9,188,734.00	18.03
17	688601	力芯微	8,911,563.43	17.48

18	601728	中国电信	8,527,276.00	16.73
19	300738	奥飞数据	8,501,890.00	16.68
20	002605	姚记科技	8,433,764.00	16.55
21	601336	新华保险	8,285,113.00	16.26
22	300939	秋田微	8,227,754.00	16.14
23	300783	三只松鼠	8,136,366.00	15.96
24	688338	赛科希德	7,930,367.45	15.56
25	601318	中国平安	7,611,282.00	14.93
26	688682	霍莱沃	7,411,508.40	14.54
27	688800	瑞可达	7,361,660.28	14.44
28	601601	中国太保	7,149,194.00	14.03
29	002423	中粮资本	7,098,932.00	13.93
30	688012	中微公司	6,990,567.48	13.72
31	688225	亚信安全	6,629,577.50	13.01
32	688365	光云科技	6,399,747.53	12.56
33	601998	中信银行	6,390,591.00	12.54
34	600012	皖通高速	6,252,866.00	12.27
35	601019	山东出版	6,206,195.00	12.18
36	688621	阳光诺和	6,165,023.85	12.10
37	001965	招商公路	6,155,189.00	12.08
38	688588	凌志软件	6,121,793.14	12.01
39	688023	安恒信息	6,119,869.34	12.01
40	601628	中国人寿	6,069,154.13	11.91
41	002859	洁美科技	6,025,473.00	11.82
42	688158	优刻得	5,968,243.48	11.71
43	688347	华虹公司	5,948,428.70	11.67
44	688179	阿拉丁	5,841,151.56	11.46
45	603158	腾龙股份	5,760,847.00	11.30
46	600900	长江电力	5,753,110.00	11.29
47	601328	交通银行	5,745,794.00	11.27
48	300898	熊猫乳品	5,719,383.00	11.22
49	601939	建设银行	5,701,669.00	11.19
50	601098	中南传媒	5,598,748.00	10.98
51	600927	永安期货	5,536,442.88	10.86
52	688222	成都先导	5,348,550.78	10.49
53	600015	华夏银行	5,170,399.00	10.14
54	688315	诺禾致源	5,112,161.37	10.03
55	603927	中科软	5,078,167.35	9.96
56	300253	卫宁健康	4,965,735.00	9.74
57	001236	弘业期货	4,883,778.00	9.58
58	688087	英科再生	4,872,434.49	9.56

59	002368	太极股份	4,864,277.00	9.54
60	300418	昆仑万维	4,757,343.00	9.33
61	300496	中科创达	4,565,742.00	8.96
62	601698	中国卫通	4,275,693.00	8.39
63	000415	渤海租赁	4,188,741.00	8.22
64	600958	东方证券	4,159,683.00	8.16
65	000166	申万宏源	4,158,434.00	8.16
66	601801	皖新传媒	4,142,760.00	8.13
67	600373	中文传媒	4,127,250.00	8.10
68	688131	皓元医药	4,103,397.23	8.05
69	601088	中国神华	4,004,707.00	7.86
70	601319	中国人保	3,935,817.00	7.72
71	600570	恒生电子	3,874,498.00	7.60
72	688026	洁特生物	3,796,324.66	7.45
73	600030	中信证券	3,789,162.00	7.43
74	300760	迈瑞医疗	3,752,563.00	7.36
75	300976	达瑞电子	3,728,064.00	7.31
76	688508	芯朋微	3,666,748.39	7.19
77	002405	四维图新	3,641,454.00	7.14
78	601166	兴业银行	3,635,462.00	7.13
79	601006	大秦铁路	3,598,461.00	7.06
80	603439	三力制药	3,532,348.00	6.93
81	600350	山东高速	3,529,919.00	6.93
82	600377	宁沪高速	3,524,069.00	6.91
83	301080	百普赛斯	3,519,638.00	6.91
84	600036	招商银行	3,496,772.00	6.86
85	600118	中国卫星	3,473,600.00	6.82
86	688777	中控技术	3,445,706.54	6.76
87	000001	平安银行	3,431,513.00	6.73
88	601928	凤凰传媒	3,395,390.00	6.66
89	600757	长江传媒	3,386,844.00	6.65
90	601169	北京银行	3,375,630.00	6.62
91	002351	漫步者	3,334,058.00	6.54
92	601077	渝农商行	3,233,346.00	6.34
93	300015	爱尔眼科	3,133,812.00	6.15
94	002727	一心堂	3,126,126.00	6.13
95	603883	老百姓	3,105,105.10	6.09
96	600271	航天信息	3,099,851.00	6.08
97	688095	福昕软件	3,018,840.74	5.92
98	688689	银河微电	2,908,455.35	5.71
99	002939	长城证券	2,907,167.00	5.70

100	600497	驰宏锌锗	2,873,009.00	5.64
101	601600	中国铝业	2,872,377.00	5.64
102	000878	云南铜业	2,854,991.00	5.60
103	601788	光大证券	2,840,382.00	5.57
104	601377	兴业证券	2,784,003.00	5.46
105	300896	爱美客	2,772,923.12	5.44
106	000617	中油资本	2,772,470.00	5.44
107	688468	科美诊断	2,696,352.76	5.29
108	688083	中望软件	2,678,171.72	5.25
109	300937	药易购	2,623,717.00	5.15
110	301236	软通动力	2,603,972.00	5.11
111	002279	久其软件	2,480,472.00	4.87
112	605058	澳弘电子	2,334,101.00	4.58
113	601900	南方传媒	2,185,846.00	4.29
114	002558	巨人网络	2,170,866.00	4.26
115	002697	红旗连锁	2,144,138.00	4.21
116	000065	北方国际	2,121,297.00	4.16
117	601658	邮储银行	2,117,705.00	4.15
118	300957	贝泰妮	2,067,546.00	4.06
119	600028	中国石化	1,961,736.00	3.85
120	688111	金山办公	1,955,589.37	3.84
121	601668	中国建筑	1,916,276.00	3.76
122	002044	美年健康	1,897,153.00	3.72
123	600938	中国海油	1,869,570.00	3.67
124	601857	中国石油	1,848,219.00	3.63
125	600763	通策医疗	1,765,024.00	3.46
126	603882	金域医学	1,759,428.00	3.45
127	300676	华大基因	1,748,494.00	3.43
128	300803	指南针	1,690,789.00	3.32
129	600737	中粮糖业	1,685,094.00	3.31
130	000848	承德露露	1,637,242.00	3.21
131	000977	浪潮信息	1,631,501.00	3.20
132	603889	新澳股份	1,629,708.00	3.20
133	600008	首创环保	1,617,276.00	3.17
134	001872	招商港口	1,594,682.00	3.13
135	601000	唐山港	1,574,683.90	3.09
136	002788	鹭燕医药	1,450,492.00	2.85
137	300059	东方财富	1,437,406.00	2.82
138	002027	分众传媒	1,372,475.00	2.69
139	601288	农业银行	1,325,196.00	2.60
140	688589	力合微	1,234,934.18	2.42

141	000928	中钢国际	1,206,817.00	2.37
142	605199	ST 葫芦娃	1,126,439.00	2.21
143	600717	天津港	1,088,574.00	2.14
144	002572	索菲亚	1,073,021.00	2.11
145	601398	工商银行	1,063,602.00	2.09
146	603833	欧派家居	1,039,014.00	2.04
147	600887	伊利股份	1,033,980.00	2.03

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	693,821,898.44
卖出股票收入（成交）总额	684,323,514.49

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

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

无。

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

无。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

#### 8.12 投资组合报告附注

##### 8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

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

##### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

##### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	380,310.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,293.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	386,604.47

##### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

##### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

##### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
前海开源事件驱动混合 A	1,386	19,905.87	15,797,847.74	57.26%	11,791,685.82	42.74%
前海开源事件驱动混合 C	533	12,983.45	3,870,080.27	55.92%	3,050,099.34	44.08%
合计	1,919	17,983.18	19,667,928.01	56.99%	14,841,785.16	43.01%

注：① 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	前海开源事件驱动混合 A	6,357,612.17	23.0436%
	前海开源事件驱动混合 C	547.18	0.0079%
	合计	6,358,159.35	18.4243%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	前海开源事件驱动混合 A	0
	前海开源事件驱动混合 C	0
	合计	0

本基金基金经理持有本开放式基金	前海开源事件驱动混合 A	>100
	前海开源事件驱动混合 C	0~10
	合计	>100

#### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	14,639,770.15	42.42%	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	6,281,706.87	18.20%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	76,452.48	0.22%	-	-	-
合计	20,997,929.50	60.85%	-	-	-

注：1、上述份额总数为扣除认购费用并包含利息结转份额后的总份额数。

2、本基金发起式资金提供方仅为基金管理人，基金管理人高级管理人员、基金经理、基金管理人股东、其他从业人员持有的基金份额不属于发起份额。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	前海开源事件驱动混合 A	前海开源事件驱动混合 C
基金合同生效日（2013 年 12 月 19 日）基金份额总额	128,523,462.75	-
本报告期期初基金份额总额	23,163,144.88	5,550,687.75
本报告期基金总申购份额	10,865,696.46	3,448,401.20
减：本报告期基金总赎回份额	6,439,307.78	2,078,909.34
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	27,589,533.56	6,920,179.61

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及影响基金管理人经营管理或基金运作业务的诉讼，无涉及基金财产的诉讼。

报告期内未发生涉及基金托管业务的重大诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计服务的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)，本年度应支付的审计费用为 20,000.00 元。该事务所自 2024 年 09 月 25 日起为本基金提供审计服务至今，本报告期内无改聘会计师事务所的事项。

### 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人没有受到监管部门调查或处罚。

#### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人高级管理人员、相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

#### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受调查或处罚等情况。

#### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	1,378,145,412.93	100.00%	642,075.35	100.00%	-
中国银河证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-

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

司参与证券交易的选择标准和程序，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) 财务状况良好，经营行为规范，制度流程完善，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；

(2) 具备高效、安全的通讯条件，信息系统建设完备，交易设施满足公募基金证券交易的需求；

(3) 交易费率符合法律法规及监管要求，具备市场竞争力；

(4) 法律法规及规范性文件所规定的其他要求。

### 2、选择程序

(1) 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司；

(2) 本基金管理人与被选中的证券公司签订相关协议。

3、本部分的数据统计范围仅包括本基金；本公司网站披露的《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（2025 年度）》的统计范围为报告期间存续过的所有公募基金，包括报告期间成立、清算、转型的公募基金。敬请投资者关注上述报告的统计口径差异。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方证券	1,399,321.00	100.00%	1,205,319.00	100.00%	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金 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	关于旗下部分基金增加麦高证券有限责任公司为销售机构并参加其费率优惠活动	中国证监会规定媒介	2025 年 03 月 18 日

	动的公告		
4	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
5	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会规定媒介	2025 年 03 月 31 日
6	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2025 年 04 月 22 日
7	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
8	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
9	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
10	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2025 年 07 月 21 日
11	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金 2025 年中期报告	中国证监会规定媒介	2025 年 08 月 29 日
12	关于前海开源基金管理有限公司直销柜台认/申购旗下基金实行费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2025 年 10 月 13 日
13	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2025 年 10 月 28 日
14	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分基金风险等级的公告	中国证监会规定媒介	2025 年 11 月 20 日
15	前海开源基金管理有限公司关于终止与深圳市金海九州基金销售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 12 月 08 日
16	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（20251210 更新）	中国证监会规定媒介	2025 年 12 月 10 日
17	前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式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 12 月 10 日
18	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 12 月 11 日
19	前海开源基金管理有限公司关于终止与上海钜派钰茂基金销售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 12 月 19 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20250101-20251231	14,639,770.15	-	-	14,639,770.15	42.42%
产品特有风险							
<p>1. 巨额赎回风险</p> <p>(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大,单一投资者的巨额赎回,可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响;</p> <p>(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。如个别投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据基金合同约定决定延缓支付赎回款项、部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请,可能影响投资者赎回业务的办理;</p> <p>2. 转换运作方式或终止基金合同的风险</p> <p>个别投资者大额赎回后,若本基金连续60个工作日出现基金份额持有人低于200人或基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决,其他投资者可能面临相应风险;</p> <p>3. 流动性风险</p> <p>单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险;</p> <p>4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小,导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。</p>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金设立的文件
- (2) 《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式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) 前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金在规定报刊上各项公告的原稿

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 13.3 查阅方式

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

前海开源基金管理有限公司  
2026 年 03 月 31 日