

前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2026 年中期报告

2026 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：2026 年 08 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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	9
2.4	信息披露方式	9
2.5	其他相关资料	9
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	9
3.1	主要会计数据和财务指标	9
3.2	基金净值表现	10
§ 4	管理人报告	11
4.1	基金管理人及基金经理情况	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	18
6.3	净资产变动表	19
6.4	报表附注	19
§ 7	投资组合报告	41
7.1	期末基金资产组合情况	41
7.2	期末投资目标基金明细	41
7.3	报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.4	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	42
7.5	报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.6	期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.7	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	50
7.8	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	50
7.9	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	50
7.10	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	50
7.11	本基金投资股指期货的投资政策	50
7.12	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51

7.13	投资组合报告附注	51
§ 8	基金份额持有人信息	52
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	53
§ 9	开放式基金份额变动	53
§ 10	重大事件揭示	53
10.1	基金份额持有人大会决议	53
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	54
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4	基金投资策略的改变	54
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
10.7	基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	54
10.8	其他重大事件	55
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12	备查文件目录	57
12.1	备查文件目录	57
12.2	存放地点	58
12.3	查阅方式	58

§ 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联接基金	
基金简称	前海开源中证 500 等权 ETF 联接	
基金主代码	023444	
基金运作方式	契约型普通开放式	
基金合同生效日	2025 年 07 月 07 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	16,742,881.57 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海开源中证 500 等权 ETF 联接 A	前海开源中证 500 等权 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	023444	023445
报告期末下属分级基金的份额总额	12,590,893.94 份	4,151,987.63 份

2.1.1 目标基金基本情况

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
基金管理人名称	前海开源基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银河证券股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，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	本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。如因标的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和跟踪误差进一步扩大。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 1、目标 ETF 投资策略 本基金投资目标 ETF 的方式如下：

	(1) 申购、赎回：按照目标 ETF 法律文件约定的方式申赎目标 ETF。 (2) 二级市场方式：在二级市场进行目标 ETF 基金份额的交易。 当目标 ETF 申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申购、赎回的方式或二级市场方式进行目标 ETF 的投资。 2、股票投资策略 本基金可投资于标的指数成份股、备选成份股，以更好的跟踪标的指数。同时，在条件允许的情况下还可通过买入标的指数成份股、备选成份股来构建组合以申购目标 ETF。因此对可投资于标的指数成份股、备选成份股的资金头寸，主要采取复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的个股时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，包括通过投资其他股票进行替代，以降低跟踪误差，优化投资组合的配置结构。 3、存托凭证投资策略 对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证进行投资。 4、债券投资策略 本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资，通过主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。 5、资产支持证券投资策略 本基金通过对资产支持证券发行条款的分析、违约概率和提前偿付比率的预估，借用必要的数量模型来谋求对资产支持证券的合理定价，在严格控制风险、充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下，谨慎选择风险调整后收益较高的品种进行投资。 6、股指期货投资策略 本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。 7、国债期货投资策略 本基金对国债期货的投资根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金将结合国债交易市场和期货交易市场的收益性、流动性的情况，通过多头或空头套期保值等投资策略进行套期保值。 8、股票期权投资策略
--	---

	本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。 9、信用衍生品投资策略 本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，根据风险管理的原则，以风险对冲为目的，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。 10、融资及转融通证券出借业务的投资策略 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。 11、现金管理策略 为保持基金的资产流动性，本基金可适当投资于货币市场工具。 12、港股通标的股票投资策略 在特殊情况下，本基金将少量投资于港股通标的股票以进行替代复制。对于同时有 A 股、H 股的指数成份公司，如果该公司 A 股长期停牌，组合无法买入该股票时，可以买入该公司 H 股进行替代。 13、其他 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，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	中证 500 等权重指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，理论上预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与标的指数的表现密切相关。 本基金可投资港股通标的股票，将面临汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.2.1 目标基金产品说明

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	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。 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。 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。 1、股票投资策略 （1）股票投资组合的构建 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。 （2）股票投资组合的调整 本基金所构建的股票投资组合将根据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。 2、金融衍生品投资策略 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。 3、资产支持证券投资策略 本基金通过对资产支持证券发行条款的分析、违约概率和提前偿付比率的预估，借用必要的数量模型来谋求对资产支持证券的合理定价，在严格控制风险、充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下，谨慎选择风险调整后收益较高的品种进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。 4、融资及转融通证券出借业务的投资策略 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。 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。
业绩比较基准	中证 500 等权重指数收益率。
风险收益特征	本基金属股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基

	金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		前海开源基金管理有限公司	中国银河证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙辰健	罗新民
	联系电话	0755-88601888	010-80927820
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	yhqz_tggz@chinastock.com.cn
客户服务电话		4001-666-998	95551；400-888-8888
传真		0755-83181169	010-80928078
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101
办公地址		深圳市福田区深南大道 7006 号 万科富春东方大厦 2206	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦
邮政编码		518040	100073
法定代表人		李强	王晟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.qhkyfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）	
	前海开源中证 500 等权 ETF 联接 A	前海开源中证 500 等权 ETF 联接 C
本期已实现收益	374,130.52	911,471.93
本期利润	726,495.33	733,304.94
加权平均基金份额本期利润	0.2774	0.1097
本期加权平均净值利润率	22.14%	8.77%
本期基金份额净值增长率	10.53%	10.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	

	前海开源中证 500 等权 ETF 联接 A	前海开源中证 500 等权 ETF 联接 C
期末可供分配利润	3,549,115.67	1,159,887.53
期末可供分配基金份额利润	0.2819	0.2794
期末基金资产净值	16,140,009.61	5,311,875.16
期末基金份额净值	1.2819	1.2794
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
	前海开源中证 500 等权 ETF 联接 A	前海开源中证 500 等权 ETF 联接 C
基金份额累计净值增长率	28.19%	27.94%

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

前海开源中证 500 等权 ETF 联接 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	8.88%	1.33%	6.45%	1.32%	2.43%	0.01%
过去六个月	10.53%	1.39%	8.53%	1.38%	2.00%	0.01%
自基金合同生效起至今	28.19%	1.22%	31.96%	1.21%	-3.77%	0.01%

前海开源中证 500 等权 ETF 联接 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	8.84%	1.33%	6.45%	1.32%	2.39%	0.01%
过去六个月	10.42%	1.39%	8.53%	1.38%	1.89%	0.01%
自基金合同生效起至今	27.94%	1.22%	31.96%	1.21%	-4.02%	0.01%

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

前海开源中证 500 等权 ETF 联接 A



注：1、本基金的基金合同于 2025 年 07 月 07 日生效，截至 2026 年 06 月 30 日止，本基金成立未
满 1 年。

2、本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。截至 2026 年
06 月 30 日，本基金建仓期结束未满 1 年。

§ 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 117 只开放式基金，资产管理规模超过 1045 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	2025 年 07 月 07 日	-	12 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《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年市场整体似乎走出了波澜不惊的慢牛行情，但平静的水面下暗流涌动，无论是节奏上还是结构上，都是一轮“非典型慢牛”。甫一开年，市场延续了 2025 年的强劲上涨动能，上证指数走出了十七连阳的强横走势，一时间 FOMO（错失恐惧症）大行其道。美伊战争爆发后，全球资本市场风险偏好快速下降，叠加战争推高油价，市场对高通胀和货币政策收紧的预期逐渐升温，市场快速回落。其后，伴随着美伊战局缓和以及资本市场对中东形势的脱敏，市场再度震荡上行。慢牛的背后，市场内部结构极度撕裂，强弱分化特征显著。科技行业相关个股走出了波澜壮阔的牛市行情，中信电子一级行业超过 200 个个股在二季度创出了历史新高；市场交投活跃度持续升温，两市成交量维持在 2 万亿至 3 万亿的高位区间，两融余额突破 3 万亿，再创历史新高。与指数、热门行业的强势表现形成鲜明反差的是，多数传统行业个股、中小个股持续走弱，全市场超 18% 的个股价格已跌破 2024 年 9 月 23 日的收盘点位。多只巨型宽基 ETF 规模明显回落，整体规模回归到了 2024 年一季度的水平，而在这一过程中，大量非热门行业个股估值持续下修，不少基本面稳健的标的也出现了明显错杀。截至 6 月 30 日，中证 500 等权重指数上涨 8.92%，同期本基金 A 类份额上涨 10.53%，C 类份额上涨 10.42%，表现均优于业绩比较基准。

展望后市，我们认为 A 股中长期向好的趋势仍未发生变化。随着美伊相关协议落地，全球地缘风险大幅缓释，市场整体风险偏好有望持续修复。经历了本轮地缘冲突，兼具安全性与高成长性的中国资产稀缺价值得到凸显，且在全球权益资产估值比价体系中，A 股具备显著的估值折价。从国内来看，今年作为“十五五”开局之年，稳增长政策持续发力，经济企稳回暖的趋势不断巩固，为资本市场筑牢了基本面根基。叠加全球科技板块行情共振，A 股热门科技标的持续吸引增量资金聚

焦，市场交投热度居高不下。2026 年上半年万得全 A 累计成交金额突破 310 万亿，较去年同期增幅超过 90%；两融余额持续创出历史新高、新股上市初期的财富效应持续聚集人气，多项数据均印证了当下市场的亢奋情绪。在此背景下，惯性上行或是 A 股阻力较小的运行方向。在当前市场极致分化、结构撕裂的行情下，多数普通投资者无需纠结科技板块与传统板块的博弈，可以通过中证 500 指数等核心宽基指数进行均衡配置，规避单一板块、个股的波动风险，把握 A 股整体的中长期配置红利。本基金的标的指数在定期调整时通过赋予中证 500 指数成分股以相同的权重，可以帮助投资者获得一定的小市值暴露，在行业配置上更为均衡，并在每半年的定期调整中强制再平衡，自带高抛低吸的反转策略属性。

作为一个被动指数基金，本基金主要通过投资于前海开源中证 500 等权 ETF 实现对中证 500 等权重指数的跟踪，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 联接 A 基金份额净值为 1.2819 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 10.53%，同期业绩比较基准收益率为 8.53%；截至报告期末前海开源中证 500 等权 ETF 联接 C 基金份额净值为 1.2794 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 10.42%，同期业绩比较基准收益率为 8.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年一季度美伊军事冲突爆发后，霍尔木兹海峡航运通行显著受限，油轮过境规模大幅萎缩，市场原油供给担忧快速升温，国际油价短期大幅冲高，对全球通胀预期与各大资本市场形成了明显冲击。依托国际多方斡旋，地缘局势明显缓和，美伊达成了阶段性谅解备忘录，国际油价较前期明显回落。在此背景下，美欧等经济体即使货币政策立场转向，预计调整幅度也会相对温和。当然，中东地区地缘矛盾盘根错节，多方博弈格局短期难以彻底化解，全球通胀形势和主要经济体货币政策走向仍有一定的不确定性。

面对复杂多变的国际形势，国内经济延续了总体平稳、向新向优的发展态势，发展韧性与内生活力持续凸显，但支撑经济持续稳步向好的底层基础仍需进一步夯实。物价维度，海外能源价格上涨带来输入性通胀压力，带动国内 PPI 成本驱动型回升特征突出；反观 CPI 涨幅维持温和区间，居民消费修复节奏尚未达到市场预期。政策方面，中国人民银行继续实施适度宽松的货币政策，推动社会综合融资成本低位运行，为宏观经济平稳增长、产业高质量发展和金融市场稳定筑牢货币根

基。同时持续落地扩容各类结构性货币政策工具，拓宽政策支持领域、优化配套实施细则，精准助力产业结构转型升级。展望下一阶段，央行将统筹强化逆周期与跨周期调节，围绕扩大内需、优化供给两大核心主线持续发力，充分激活经济内生增长动能，巩固拓展稳中向好发展态势，为“十五五”规划实现良好开局提供坚实金融支撑。资本市场制度改革持续纵深推进，自新国九条发布落地以来，市场基础制度和监管底层逻辑不断完善。类“平准基金”持续加强战略性力量储备和稳市机制建设，中长期机构资金入市规模稳步扩容；配套政策引导有条件的公司加大分红回购力度，严格减持约束，建立上市公司减持与股价、分红挂钩机制，上市公司质量和投资价值稳步提升。

我们认为，在积极财政政策与适度宽松货币政策协同发力的双重托举下，我国宏观经济与权益市场长期向好的核心逻辑并未发生改变。政策持续加码之下，企业盈利修复（分子端）与市场贴现率下行（分母端）形成双重利好，A 股整体配置价值有望持续提升；资本市场生态的持续完善，也将从制度层面夯实权益市场长牛基础。复盘上世纪 40 至 60 年代美国资本市场发展历程，持续完善上市公司治理体系能够有效推升市场中长期估值中枢。横向对比全球各大主流资本市场，综合考量资产安全边际、产业成长空间与当前估值性价比，A 股中长期配置优势突出。

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 08 月 08 日至 2026 年 06 月 30 日连续 214 个工作日基金资产净值低于五千万

元，本基金管理人已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

同时，为减轻迷你基金固定费用支出给投资者造成的负担，切实保障基金份额持有人利益，本报告期内 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日期间，由本基金管理人承担本基金的相关固定费用（包括信息披露费、审计费等）。

§ 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，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，对本基金的投资范围、投资比例、投资限制等方面进行了监督，未发现存在损害基金份额持有人利益的行为。

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 2026 年度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联接基金
报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,520,068.40	529,190.52
结算备付金		118,329.74	481.82
存出保证金		214,276.80	-

交易性金融资产	6.4.7.2	17,843,992.87	10,662,115.13
其中：股票投资		2,491,434.00	-
基金投资		15,251,296.32	10,057,277.16
债券投资		101,262.55	604,837.97
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		763,118.55	-
应收股利		-	-
应收申购款		14,083.89	29,446.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		21,473,870.25	11,221,233.85
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 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		-	-
应付赎回款		18,274.80	399,410.09
应付管理人报酬		114.72	104.00
应付托管费		38.24	34.65
应付销售服务费		907.81	1,487.19
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,537.91	12,737.63
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	112.00	48,764.18
负债合计		21,985.48	462,537.74
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	16,742,881.57	9,282,051.30
未分配利润	6.4.7.8	4,709,003.20	1,476,644.81
净资产合计		21,451,884.77	10,758,696.11
负债和净资产总计		21,473,870.25	11,221,233.85

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，前海开源中证 500 等权 ETF 联接基金份额总额

16,742,881.57 份，其中，前海开源中证 500 等权 ETF 联接 A 类基金份额净值 1.2819 元，基金份额总额 12,590,893.94 份；前海开源中证 500 等权 ETF 联接 C 类基金份额净值 1.2794 元，基金份

额总额 4,151,987.63 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联接基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		1,473,458.60
1. 利息收入		593.36
其中：存款利息收入	6.4.7.9	593.36
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）		1,276,863.41
其中：股票投资收益	6.4.7.10	21,362.66
基金投资收益	6.4.7.11	1,252,830.98
债券投资收益	6.4.7.12	2,709.31
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	-39.54
股利收益	6.4.7.16	-
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	174,197.82
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	21,804.01
减：二、营业总支出		13,658.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	573.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	191.12
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	8,367.79
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		4,526.10
8. 其他费用	6.4.7.20	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,459,800.27
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,459,800.27
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		1,459,800.27

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联接基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	9,282,051.30	1,476,644.81	10,758,696.11
二、本期期初净资产	9,282,051.30	1,476,644.81	10,758,696.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,460,830.27	3,232,358.39	10,693,188.66
（一）、综合收益总额	-	1,459,800.27	1,459,800.27
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	7,460,830.27	1,772,558.12	9,233,388.39
其中：1. 基金申购款	19,232,222.82	4,718,826.89	23,951,049.71
2. 基金赎回款	-11,771,392.55	-2,946,268.77	-14,717,661.32
（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	16,742,881.57	4,709,003.20	21,451,884.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

秦亚峰
基金管理人负责人

王厚琼
主管会计工作负责人

傅智
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金（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”）2025 年 2 月 5 日下发的证监许可[2025]204 号文“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联接基金注册的批复”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联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金募集期间为 2025 年 6 月 23 日至 2025 年 7 月 3 日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2025）验字第 70048283_H03 号验资报告。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联接基金基金合同》于 2025 年 7 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额 343,631,311.21 份，其中

认购资金利息折合 68,695.30 份基金份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司，注册登记机构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。

根据《前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》及《前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。A 类、C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

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联接基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包括主、创业板及其他依法发行上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券等）、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、现金、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 等权重指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定：资管产品运营过程中发生的应税交易，

资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、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》的规定，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，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局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《财政部 国家税务总局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《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《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《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《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《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 2026 年 06 月 30 日
活期存款	57,701.80
等于：本金	57,693.19
加：应计利息	8.61
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	2,462,366.60
等于：本金	2,462,361.92
加：应计利息	4.68
合计	2,520,068.40

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用资金账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,468,644.70	-	2,491,434.00	22,789.30
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	99,956.00	1,242.55	101,262.55	64.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	99,956.00	1,242.55	101,262.55	64.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		13,772,018.20	-	15,251,296.32	1,479,278.12
其他		-	-	-	-
合计		16,340,618.90	1,242.55	17,843,992.87	1,502,131.42

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 2026 年 06 月 30 日			
		合同/名义 金额	公允价值		备注
			资产	负债	
利率衍生工具		-	-	-	-
货币衍生工具		-	-	-	-
权益衍生工具		1,713,000.00	-	-	-
其中：股指期货投资		1,713,000.00	-	-	-
其他衍生工具		-	-	-	-
合计		1,713,000.00	-	-	-

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
IC2607	中证 500 股指期货 2607 合约	1.00	1,785,640.00	72,640.00
合计				72,640.00
减：可抵销期货暂收款				72,640.00
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 2026 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	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
其他	112.00
合计	112.00

6.4.7.7 实收基金

前海开源中证 500 等权 ETF 联接 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,941,839.82	2,941,839.82
本期申购	11,377,128.95	11,377,128.95
本期赎回（以“-”号填列）	-1,728,074.83	-1,728,074.83
本期末	12,590,893.94	12,590,893.94

前海开源中证 500 等权 ETF 联接 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,340,211.48	6,340,211.48

本期申购	7,855,093.87	7,855,093.87
本期赎回（以“-”号填列）	-10,043,317.72	-10,043,317.72
本期末	4,151,987.63	4,151,987.63

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

前海开源中证 500 等权 ETF 联接 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	662,501.91	-192,255.96	470,245.95
本期期初	662,501.91	-192,255.96	470,245.95
本期利润	374,130.52	352,364.81	726,495.33
本期基金份额交易产生的变动数	3,717,972.72	-1,365,598.33	2,352,374.39
其中：基金申购款	4,179,269.85	-1,417,783.23	2,761,486.62
基金赎回款	-461,297.13	52,184.90	-409,112.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,754,605.15	-1,205,489.48	3,549,115.67

前海开源中证 500 等权 ETF 联接 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	1,420,495.33	-414,096.47	1,006,398.86
本期期初	1,420,495.33	-414,096.47	1,006,398.86
本期利润	911,471.93	-178,166.99	733,304.94
本期基金份额交易产生的变动数	-775,052.05	195,235.78	-579,816.27
其中：基金申购款	2,102,076.84	-144,736.57	1,957,340.27
基金赎回款	-2,877,128.89	339,972.35	-2,537,156.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,556,915.21	-397,027.68	1,159,887.53

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	391.87
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	90.53
结算备付金利息收入	6.08
其他	104.88
合计	593.36

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资收益--买卖股票差价收入	-1,280.07
股票投资收益--赎回差价收入	-
股票投资收益--申购差价收入	22,642.73
股票投资收益--证券出借差价收入	-
合计	21,362.66

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	-
减：卖出股票成本总额	-
减：交易费用	1,280.07
买卖股票差价收入	-1,280.07

6.4.7.10.3 股票投资收益--申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
申购基金份额总额	4,165,200.00
减：现金支付申购款总额	1,688,992.55
减：申购股票成本总额	2,453,564.72
减：交易费用	-
申购差价收入	22,642.73

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	8,918,407.60
减：卖出/赎回基金成本总额	7,623,436.26
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	37,717.61
减：交易费用	4,422.75
基金投资收益	1,252,830.98

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 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益--利息收入	2,570.31
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	139.00
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	2,709.31

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 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	506,099.73
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	499,945.00
减：应计利息总额	6,015.73
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	139.00

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	-39.54

6.4.7.16 股利收益

无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	101,557.82
--股票投资	22,789.30
--债券投资	-185.00
--资产支持证券投资	-
--基金投资	78,953.52
--贵金属投资	-
--其他	-
2. 衍生工具	72,640.00
--权证投资	-
--期货投资	72,640.00
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	174,197.82

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	1,460.85
转换费收入	20,343.16
合计	21,804.01

6.4.7.19 信用减值损失

无。

6.4.7.20 其他费用

无。

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、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
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
前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金（“前海开源中证 500 等权 ETF”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	573.32
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,147.08
应支付基金管理人的净管理费	-2,573.76

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。支付销售机构的客户维护费不因投资于基金管理人所管理的目标 ETF 而调减，因此应支付基金管理人的净管理费为负。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扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 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 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	191.12

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扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 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 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 0.05% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源中证 500 等权 ETF 联接 A	前海开源中证 500 等权 ETF 联接 C	合计
前海开源基金	-	2,378.21	2,378.21

中国银河证券	-	2,104.32	2,104.32
合计	-	4,482.53	4,482.53

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给前海开源基金，再由前海开源基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

前海开源中证 500 等权 ETF 联接 A

份额单位：份

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2025 年 07 月 07 日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	10,466,755.91
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	10,466,755.91
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	83.13%

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入和强制调增份额。基金管理人前海开源基金投资本基金的交易委托前海开源基金直销中心办理，适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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

于 2026 年 06 月 30 日, 本基金持有 7,323,200.00 份目标 ETF 基金份额, 占其总份额的比例为 21.47%。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	101,262.55	604,837.97
合计	101,262.55	604,837.97

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

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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	2,520,068.40	-	-	-	2,520,068.40
结算备付金	118,329.74	-	-	-	118,329.74
存出保证金	-	-	-	214,276.80	214,276.80
交易性金融资产	101,262.55	-	-	17,742,730.32	17,843,992.87
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	763,118.55	763,118.55
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	14,083.89	14,083.89
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,739,660.69	-	-	18,734,209.56	21,473,870.25
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	18,274.80	18,274.80
应付管理人报酬	-	-	-	114.72	114.72
应付托管费	-	-	-	38.24	38.24
应付销售服务费	-	-	-	907.81	907.81
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2,537.91	2,537.91
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	112.00	112.00
负债总计	-	-	-	21,985.48	21,985.48
利率敏感度缺口	2,739,660.69	-	-	18,712,224.08	21,451,884.77
上年度末 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	529,190.52	-	-	-	529,190.52
结算备付金	481.82	-	-	-	481.82
存出保证金	-	-	-	-	-

交易性金融资产	604,837.97	-	-	10,057,277.16	10,662,115.13
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	-	-	-	29,446.38	29,446.38
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,134,510.31	-	-	10,086,723.54	11,221,233.85
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	399,410.09	399,410.09
应付管理人报酬	-	-	-	104.00	104.00
应付托管费	-	-	-	34.65	34.65
应付销售服务费	-	-	-	1,487.19	1,487.19
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	12,737.63	12,737.63
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	48,764.18	48,764.18
负债总计	-	-	-	462,537.74	462,537.74
利率敏感度缺口	1,134,510.31	-	-	9,624,185.80	10,758,696.11

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（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	18.71	644.71
	市场利率上升 25 个基点	-18.70	-643.19

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。本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股(含存托凭证)、备选成份股(含存托凭证)，所面临的其他价格风险来源于所持有的金融工具的价格波动的影响。

本基金主要通过对目标 ETF 基金份额的投资，本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪中证 500 等权重指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。当在因特殊情况导致跟踪偏离度和跟踪误差超过风险控制目标，基金管理人将搭配使用其他合理方法采取合理措施，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 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	2,491,434.00	11.61	—	—
交易性金融资产—基金投资	15,251,296.32	71.10	10,057,277.16	93.48
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	17,742,730.32	82.71	10,057,277.16	93.48

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（2026 年 06 月 30	上年度末（2025 年 12 月 31

		日)	日)
	业绩比较基准上升 5%	979,777.83	502,863.86
	业绩比较基准下降 5%	-979,777.83	-502,863.86

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	17,742,730.32	10,057,277.16
第二层次	101,262.55	604,837.97
第三层次	-	-
合计	17,843,992.87	10,662,115.13

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 2026 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(2025 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

- (1) 本报告期内本基金管理人主动承担了本基金部分基金费用，如信息披露费、审计费等。
- (2) 除上述事项外，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	2,491,434.00	11.60
	其中：股票	2,491,434.00	11.60
2	基金投资	15,251,296.32	71.02
3	固定收益投资	101,262.55	0.47
	其中：债券	101,262.55	0.47
	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	2,638,398.14	12.29
8	其他各项资产	991,479.24	4.62
9	合计	21,473,870.25	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
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	股票型	交易型开放式	前海开源基金管理有限公司	15,251,296.32	71.10

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 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	12,900.00	0.06
B	采矿业	110,892.00	0.52
C	制造业	1,612,269.00	7.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	88,416.00	0.41
E	建筑业	35,517.00	0.17
F	批发和零售业	45,445.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	89,996.00	0.42
H	住宿和餐饮业	7,196.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	208,840.00	0.97
J	金融业	178,998.00	0.83
K	房地产业	29,504.00	0.14
L	租赁和商务服务业	6,344.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	13,836.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	14,914.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	6,776.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	29,591.00	0.14
S	综合	—	—
	合计	2,491,434.00	11.61

7.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.4 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	601869	长飞光纤	100	54,590.00	0.25
2	688629	华丰科技	200	37,502.00	0.17
3	688313	仕佳光子	200	36,930.00	0.17
4	603444	吉比特	100	35,842.00	0.17
5	688234	天岳先进	200	34,702.00	0.16
6	688002	睿创微纳	200	30,938.00	0.14
7	603256	宏和科技	100	26,533.00	0.12

8	688322	奥比中光	200	26,110.00	0.12
9	688331	荣昌生物	200	26,052.00	0.12
10	688018	乐鑫科技	200	25,584.00	0.12
11	603129	春风动力	100	25,580.00	0.12
12	688220	翱捷科技	200	24,864.00	0.12
13	688301	奕瑞科技	200	24,800.00	0.12
14	688777	中控技术	200	23,500.00	0.11
15	688266	泽璟制药	200	23,332.00	0.11
16	688578	艾力斯	200	21,840.00	0.10
17	688213	思特威	200	21,414.00	0.10
18	688375	国博电子	200	20,860.00	0.10
19	688099	晶晨股份	200	20,580.00	0.10
20	603650	彤程新材	200	19,596.00	0.09
21	600563	法拉电子	100	19,080.00	0.09
22	688169	石头科技	200	18,994.00	0.09
23	688676	金盘科技	200	16,928.00	0.08
24	688172	燕东微	200	16,732.00	0.08
25	688343	云天励飞	200	16,332.00	0.08
26	603290	斯达半导	100	15,294.00	0.07
27	689009	九号公司	400	15,260.00	0.07
28	688318	财富趋势	200	14,262.00	0.07
29	688385	复旦微电	200	14,258.00	0.07
30	600141	兴发集团	300	14,091.00	0.07
31	688248	南网科技	200	13,836.00	0.06
32	688187	时代电气	200	13,732.00	0.06
33	688582	芯动联科	200	13,000.00	0.06
34	605589	圣泉集团	200	12,714.00	0.06
35	688122	西部超导	200	12,562.00	0.06
36	603160	汇顶科技	200	12,342.00	0.06
37	600909	华安证券	1,100	12,221.00	0.06
38	600497	驰宏锌锗	1,000	12,110.00	0.06
39	688295	中复神鹰	200	12,108.00	0.06
40	600392	盛和资源	400	11,908.00	0.06
41	688469	芯联集成	1,100	11,671.00	0.05
42	688709	成都华微	300	11,427.00	0.05
43	601958	金钼股份	400	11,244.00	0.05
44	688278	特宝生物	200	10,880.00	0.05
44	688778	厦钨新能	200	10,880.00	0.05
46	688336	三生国健	200	10,620.00	0.05
47	688563	航材股份	200	10,246.00	0.05
48	688114	华大智造	200	10,216.00	0.05

49	688708	佳驰科技	200	10,160.00	0.05
50	688180	君实生物	300	10,146.00	0.05
51	688281	华秦科技	200	10,046.00	0.05
52	688387	信科移动	500	9,920.00	0.05
53	688772	珠海冠宇	500	9,815.00	0.05
54	603156	养元饮品	200	9,814.00	0.05
55	600171	上海贝岭	300	9,582.00	0.04
56	688065	凯赛生物	200	9,570.00	0.04
57	601108	财通证券	1,100	9,515.00	0.04
58	601112	振石股份	500	9,115.00	0.04
59	688349	三一重能	600	9,108.00	0.04
60	601799	星宇股份	100	9,062.00	0.04
61	603049	中策橡胶	200	8,962.00	0.04
62	600906	财达证券	1,200	8,952.00	0.04
62	601179	中国西电	600	8,952.00	0.04
64	603175	超颖电子	100	8,909.00	0.04
65	601696	中银证券	700	8,855.00	0.04
66	688538	和辉光电	3,400	8,840.00	0.04
67	603565	中谷物流	900	8,829.00	0.04
68	600109	国金证券	1,000	8,780.00	0.04
69	601555	东吴证券	1,100	8,712.00	0.04
70	603658	安图生物	300	8,706.00	0.04
71	603659	璞泰来	300	8,679.00	0.04
72	601233	桐昆股份	400	8,660.00	0.04
73	600879	航天电子	400	8,516.00	0.04
74	603338	浙江鼎力	200	8,500.00	0.04
75	603341	龙旗科技	200	8,498.00	0.04
76	600562	国睿科技	400	8,488.00	0.04
77	600352	浙江龙盛	700	8,477.00	0.04
78	688599	天合光能	600	8,472.00	0.04
79	601099	太平洋	2,500	8,425.00	0.04
79	601162	天风证券	2,500	8,425.00	0.04
81	603806	福斯特	500	8,395.00	0.04
82	600316	洪都航空	300	8,382.00	0.04
83	600060	海信视像	300	8,361.00	0.04
84	688297	中无人机	200	8,310.00	0.04
85	603606	东方电缆	200	8,302.00	0.04
86	688568	中科星图	200	8,294.00	0.04
87	600177	雅戈尔	1,100	8,283.00	0.04
88	603688	石英股份	100	8,261.00	0.04
89	600132	重庆啤酒	200	8,260.00	0.04

90	603899	晨光股份	400	8,252.00	0.04
91	603885	吉祥航空	800	8,232.00	0.04
92	688475	萤石网络	300	8,205.00	0.04
93	601236	红塔证券	1,200	8,184.00	0.04
94	603786	科博达	200	8,182.00	0.04
95	601198	东兴证券	600	8,154.00	0.04
96	600884	杉杉股份	600	8,130.00	0.04
97	601156	东航物流	500	8,060.00	0.04
98	600369	西南证券	2,000	8,040.00	0.04
98	600602	云赛智联	500	8,040.00	0.04
100	600704	物产中大	1,700	8,024.00	0.04
101	600516	方大炭素	1,300	8,021.00	0.04
102	600062	华润双鹤	500	8,020.00	0.04
103	603345	安井食品	100	8,019.00	0.04
104	600332	白云山	400	8,016.00	0.04
105	688192	迪哲医药	200	7,986.00	0.04
106	600535	天士力	600	7,938.00	0.04
107	600208	衢州发展	2,800	7,924.00	0.04
108	601928	凤凰传媒	900	7,911.00	0.04
109	600988	赤峰黄金	300	7,896.00	0.04
110	603077	和邦生物	3,400	7,888.00	0.04
111	601000	唐山港	1,900	7,885.00	0.04
112	601990	南京证券	1,200	7,884.00	0.04
113	603225	新凤鸣	400	7,860.00	0.04
114	600435	北方导航	700	7,840.00	0.04
115	600511	国药股份	300	7,812.00	0.04
116	601611	中国核建	700	7,805.00	0.04
117	603529	爱玛科技	400	7,804.00	0.04
118	600350	山东高速	700	7,791.00	0.04
119	601991	大唐发电	1,100	7,788.00	0.04
120	605358	立昂微	100	7,760.00	0.04
121	600390	五矿资本	1,700	7,752.00	0.04
121	600765	中航重机	600	7,752.00	0.04
121	600977	中国电影	600	7,752.00	0.04
124	600143	金发科技	500	7,725.00	0.04
125	603568	伟明环保	500	7,690.00	0.04
126	600711	盛屯矿业	700	7,679.00	0.04
127	600685	中船防务	300	7,632.00	0.04
128	600967	内蒙一机	700	7,595.00	0.04
129	603379	三美股份	100	7,589.00	0.04
130	600038	中直股份	300	7,587.00	0.04

131	600166	福田汽车	2,600	7,566.00	0.04
132	600380	健康元	800	7,536.00	0.04
133	600100	同方股份	1,100	7,535.00	0.04
134	600095	湘财股份	1,000	7,530.00	0.04
135	603233	大参林	500	7,515.00	0.04
136	600998	九州通	1,600	7,504.00	0.03
137	601665	齐鲁银行	1,300	7,501.00	0.03
138	600848	上海临港	1,000	7,490.00	0.03
139	600517	国网英大	1,600	7,488.00	0.03
140	600637	东方明珠	900	7,479.00	0.03
141	603589	口子窖	400	7,472.00	0.03
142	600927	永安期货	600	7,470.00	0.03
142	601567	三星电气	500	7,470.00	0.03
144	603596	伯特利	300	7,452.00	0.03
145	600329	达仁堂	200	7,444.00	0.03
146	600655	豫园股份	1,800	7,398.00	0.03
147	603000	人民网	500	7,395.00	0.03
148	600995	南网储能	600	7,380.00	0.03
149	601016	节能风电	1,900	7,372.00	0.03
150	600498	烽火通信	100	7,360.00	0.03
151	601139	深圳燃气	1,300	7,358.00	0.03
152	601865	福莱特	700	7,357.00	0.03
153	601399	国机重装	2,100	7,350.00	0.03
154	600282	南钢股份	1,600	7,344.00	0.03
155	601228	广州港	2,600	7,332.00	0.03
156	600398	海澜之家	1,400	7,322.00	0.03
157	600131	国网信通	500	7,300.00	0.03
157	603858	步长制药	500	7,300.00	0.03
159	600820	隧道股份	1,400	7,294.00	0.03
160	600004	白云机场	1,000	7,260.00	0.03
160	601106	中国一重	2,200	7,260.00	0.03
162	600808	马钢股份	2,900	7,250.00	0.03
163	600157	永泰能源	4,500	7,245.00	0.03
163	601298	青岛港	900	7,245.00	0.03
165	600298	安琪酵母	200	7,240.00	0.03
166	688425	铁建重工	1,800	7,236.00	0.03
167	603737	三棵树	300	7,230.00	0.03
168	600292	电投水电	600	7,224.00	0.03
169	600862	中航高科	400	7,212.00	0.03
170	600521	华海药业	500	7,200.00	0.03
171	600754	锦江酒店	400	7,196.00	0.03

172	688561	奇安信	300	7,194.00	0.03
173	603939	益丰药房	400	7,192.00	0.03
174	601155	新城控股	700	7,182.00	0.03
174	601997	贵阳银行	1,400	7,182.00	0.03
176	603298	杭叉集团	300	7,158.00	0.03
176	603766	隆鑫通用	600	7,158.00	0.03
178	600363	联创光电	200	7,156.00	0.03
179	601608	中信重工	1,500	7,155.00	0.03
180	688363	华熙生物	200	7,154.00	0.03
181	601216	君正集团	1,600	7,136.00	0.03
182	600483	福能股份	700	7,133.00	0.03
182	601966	玲珑轮胎	700	7,133.00	0.03
184	601212	白银有色	1,400	7,112.00	0.03
185	600170	上海建工	3,200	7,104.00	0.03
186	600816	建元信托	2,900	7,076.00	0.03
187	600008	首创环保	2,600	7,072.00	0.03
187	601866	中远海发	3,200	7,072.00	0.03
189	600312	平高电气	400	7,064.00	0.03
190	600339	中油工程	2,300	7,061.00	0.03
191	600583	海油工程	1,400	7,042.00	0.03
192	601019	山东出版	1,100	7,040.00	0.03
193	600688	上海石化	2,400	7,032.00	0.03
194	600985	淮北矿业	500	7,025.00	0.03
195	688166	博瑞医药	200	7,002.00	0.03
196	600642	申能股份	800	6,984.00	0.03
196	601128	常熟银行	1,200	6,984.00	0.03
198	600764	中国海防	400	6,972.00	0.03
199	601577	长沙银行	800	6,968.00	0.03
200	601001	晋控煤业	400	6,956.00	0.03
201	601717	中创智领	500	6,955.00	0.03
202	600161	天坛生物	600	6,948.00	0.03
203	600377	宁沪高速	600	6,942.00	0.03
203	601615	明阳智能	600	6,942.00	0.03
205	600663	陆家嘴	1,100	6,908.00	0.03
206	600871	石化油服	3,400	6,902.00	0.03
207	600499	科达制造	500	6,900.00	0.03
207	600901	江苏金租	1,200	6,900.00	0.03
207	601880	辽港股份	5,000	6,900.00	0.03
210	600885	宏发股份	200	6,898.00	0.03
211	600606	绿地控股	5,700	6,897.00	0.03
212	601098	中南传媒	700	6,888.00	0.03

213	688520	神州细胞	200	6,842.00	0.03
214	600763	通策医疗	200	6,776.00	0.03
215	600105	永鼎股份	100	6,748.00	0.03
216	600595	中孚实业	1,200	6,744.00	0.03
217	600126	杭钢股份	1,100	6,743.00	0.03
218	603816	顾家家居	300	6,708.00	0.03
219	600582	天地科技	1,500	6,675.00	0.03
220	600968	海油发展	2,000	6,660.00	0.03
220	688819	天能股份	300	6,660.00	0.03
222	600566	济川药业	300	6,657.00	0.03
223	603119	浙江荣泰	100	6,634.00	0.03
224	600873	梅花生物	900	6,615.00	0.03
225	600546	山煤国际	600	6,558.00	0.03
226	600598	北大荒	600	6,504.00	0.03
227	600098	广州发展	1,100	6,501.00	0.03
228	601808	中海油服	600	6,486.00	0.03
229	600699	均胜电子	300	6,483.00	0.03
230	601598	中国外运	1,300	6,448.00	0.03
231	600295	鄂尔多斯	600	6,432.00	0.03
232	600970	中材国际	900	6,417.00	0.03
233	601118	海南橡胶	1,300	6,396.00	0.03
234	600153	建发股份	800	6,344.00	0.03
235	600299	安迪苏	800	6,280.00	0.03
236	600801	华新建材	400	6,240.00	0.03
237	600348	华阳股份	800	6,120.00	0.03
238	600863	华能蒙电	1,300	6,110.00	0.03
239	603728	鸣志电器	100	6,092.00	0.03
240	603308	应流股份	100	6,040.00	0.03
241	600021	上海电力	400	6,028.00	0.03
242	603833	欧派家居	200	6,022.00	0.03
243	603605	珀莱雅	100	5,992.00	0.03
244	600256	广汇能源	1,200	5,928.00	0.03
245	603979	金诚信	100	5,903.00	0.03
246	600578	京能电力	900	5,805.00	0.03
247	601666	平煤股份	800	5,720.00	0.03
248	601699	潞安环能	400	5,712.00	0.03
249	603087	甘李药业	100	5,676.00	0.03
250	600032	浙江新能	800	5,640.00	0.03
251	600536	中国软件	200	5,624.00	0.03
252	603092	德力佳	100	5,397.00	0.03
253	603486	科沃斯	100	5,075.00	0.02

254	600486	扬农化工	100	5,070.00	0.02
255	603699	纽威股份	100	5,030.00	0.02
256	603179	新泉股份	100	4,965.00	0.02
257	603920	世运电路	100	4,804.00	0.02

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 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	601869	长飞光纤	108,450.00	1.01
2	688313	仕佳光子	74,810.00	0.70
3	688629	华丰科技	71,340.00	0.66
4	603444	吉比特	69,900.00	0.65
5	688234	天岳先进	67,436.00	0.63
6	688002	睿创微纳	61,314.00	0.57
7	603256	宏和科技	54,831.00	0.51
8	688331	荣昌生物	51,652.00	0.48
9	603129	春风动力	51,480.00	0.48
10	688322	奥比中光	51,204.00	0.48
11	688018	乐鑫科技	50,068.00	0.47
12	688301	奕瑞科技	49,224.00	0.46
13	688220	翱捷科技	49,170.00	0.46
14	688777	中控技术	46,392.00	0.43
15	688266	泽璟制药	45,164.00	0.42
16	688578	艾力斯	42,748.00	0.40
17	688213	思特威	41,702.00	0.39
18	688099	晶晨股份	40,708.61	0.38
19	688375	国博电子	40,198.00	0.37
20	600563	法拉电子	37,966.00	0.35

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

7.5.2 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

无。

7.5.3 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	4,922,209.42
卖出股票收入（成交）总额	-

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

7.6 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	101,262.55	0.47
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	101,262.55	0.47

7.7 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	019785	25 国债 13	1,000	101,262.55	0.47

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。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。在市场行情波动加剧，期货出现明显折价时，可视情况增加股指期货交易，以获得股指期货的基差收敛收益。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，我们会在日常运作中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。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

无。

7.12.2 本期国债期货投资评价

无。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.13.3 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	214,276.80
2	应收清算款	763,118.55
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	14,083.89
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	991,479.24

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
前海开源中证 500 等权 ETF 联接 A	177	71,134.99	10,466,755.91	83.13%	2,124,138.03	16.87%
前海开源中证 500 等权 ETF 联接 C	496	8,370.94	—	—	4,151,987.63	100.00%
合计	673	24,877.98	10,466,755.91	62.51%	6,276,125.66	37.49%

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

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	前海开源中证 500 等权 ETF 联接 A	320,333.29	2.5442%

	前海开源中证 500 等权 ETF 联接 C	156,035.43	3.7581%
	合计	476,368.72	2.8452%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	前海开源中证 500 等权 ETF 联接 A	0
	前海开源中证 500 等权 ETF 联接 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	前海开源中证 500 等权 ETF 联接 A	0~10
	前海开源中证 500 等权 ETF 联接 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	前海开源中证 500 等权 ETF 联接 A	前海开源中证 500 等权 ETF 联接 C
基金合同生效日（2025 年 07 月 07 日）基金份额总额	150,399,719.32	193,231,591.89
本报告期期初基金份额总额	2,941,839.82	6,340,211.48
本报告期基金总申购份额	11,377,128.95	7,855,093.87
减：本报告期基金总赎回份额	1,728,074.83	10,043,317.72
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	12,590,893.94	4,151,987.63

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，基金管理人以通讯方式组织召开了本基金基金份额持有人大会，会议投票时间自 2026 年 4 月 9 日起，至 2026 年 5 月 6 日 17:00 止，审议《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联接基金持续运作的议案》。根据计票结果，未达到法定的持有人会议召开条件，故本次基金份额持有人大会召开失败。具体情况详见基金管理人在中国证监会规定媒介发布的相关公告。

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。

本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：自 2026 年 2 月 10 日起，戴景平不再担任中国银河证券股份有限公司托管总部副总经理职务。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 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。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
国投证券	3	4,922,209.42	100.00%	4,638.48	100.00%	-

注：本基金管理人依据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》等相关规定制定了证券公司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、本基金采用证券公司交易结算模式，可以豁免单个券商交易佣金的比例限制。

10.7.2 基金租用或者通过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
国投证券	200,084.00	100.00%	-	-	-	-	17,491,709.50	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	前海开源基金管理有限公司关于终止与上海凯石财富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	2026年01月12日
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联接基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026年01月22日

3	关于旗下部分基金增加易方达财富管理基金销售（广州）有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026年02月10日
4	关于防范不法分子冒用前海开源基金名义进行非法活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2026年02月10日
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联接基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026年03月31日
6	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）	中国证监会规定媒介	2026年03月31日
7	前海开源基金管理有限公司关于终止与海通证券股份有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2026年04月03日
8	关于以通讯方式召开前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定媒介	2026年04月07日
9	关于以通讯方式召开前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定媒介	2026年04月08日
10	关于以通讯方式召开前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会规定媒介	2026年04月09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联接基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026年04月22日
12	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定媒介	2026年04月30日
13	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联接基金基金份额持有人大会会议情况的公告	中国证监会规定媒介	2026年05月08日
14	前海开源基金管理有限公司关于终止与深圳富济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	2026年05月18日
15	前海开源基金管理有限公司关于终止与上海有鱼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	2026年05月29日
16	前海开源基金管理有限公司关于终止与中证金牛（北京）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	2026年06月01日

17	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	2026年06月18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	20260609-20260630	-	10,466,755.91	-	10,466,755.91	62.51%

产品特有风险

1. 巨额赎回风险

(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；

(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；

2. 转换运作方式或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 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，基金管理人应当在 10 个工作日内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、终止基金合同、持续运作等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会，其他投资者可能面临相应风险；

3. 流动性风险

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；

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。

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联接基金设立的文件

(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联接基金基金合同》

- (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联接基金托管协议》
- (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联接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

2026 年 08 月 31 日