

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金
2024 年中期报告

2024 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 08 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	15
6.3	净资产变动表	16
6.4	报表附注	17
§ 7	投资组合报告	40
7.1	期末基金资产组合情况	40
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	52
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	52
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	52
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	52
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	52
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12	投资组合报告附注	53

§ 8	基金份额持有人信息	54
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9	开放式基金份额变动	55
§ 10	重大事件揭示	56
10.1	基金份额持有人大会决议	56
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	56
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4	基金投资策略的改变	56
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8	其他重大事件	59
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12	备查文件目录	60
12.1	备查文件目录	60
12.2	存放地点	60
12.3	查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金	
基金简称	前海开源沪深 300 指数	
基金主代码	000656	
基金运作方式	契约型普通开放式	
基金合同生效日	2014 年 06 月 17 日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	272,229,263.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海开源沪深 300 指数 A	前海开源沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	000656	015671
报告期末下属分级基金的份额总额	250,755,697.14 份	21,473,565.87 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪沪深 300 指数，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。
投资策略	<p>本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。</p> <p>由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，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，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>本基金管理人主要按照沪深 300 指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 85%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）股票投资组合构建</p>

	<p>本基金采用完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。由于跟踪组合构建与标的指数组合构建存在差异，若出现较为特殊的情况（例如成份股停牌、股票流动性不足以及其他影响指数复制效果的因素），本基金将采用替代性的方法构建组合，使得跟踪组合尽可能近似于全复制组合，以减少对标的指数的跟踪误差。本基金所采用替代法调整的股票组合应符合投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 85% 的投资比例限制。</p> <p>（2）股票投资组合的调整</p> <p>本基金所构建的股票投资组合将根据沪深 300 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、申购赎回变动情况等，对其进行适时调整，以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。</p> <p>3、存托凭证投资策略</p> <p>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。</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、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>6、股指期货投资策略</p> <p>本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙辰健	任航
	联系电话	0755-88601888	010-66060069
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4001-666-998	95599

传真	0755-83181169	010-68121816
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）	北京市东城区建国门内大街 69 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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	李强	谷澍

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）	
	前海开源沪深 300 指数 A	前海开源沪深 300 指数 C
本期已实现收益	-5,290,396.30	-776,918.25
本期利润	6,570,615.52	1,304,804.73
加权平均基金份额本期利润	0.0260	0.0514
本期加权平均净值利润率	1.70%	3.39%
本期基金份额净值增长率	2.07%	1.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
	前海开源沪深 300 指数 A	前海开源沪深 300 指数 C
期末可供分配利润	134,591,989.03	11,252,568.76
期末可供分配基金份额利润	0.5367	0.5240
期末基金资产净值	385,347,686.17	32,726,134.63
期末基金份额净值	1.5367	1.5240
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
	前海开源沪深 300 指数 A	前海开源沪深 300 指数 C
基金份额累计净值增长率	111.49%	-6.59%

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

前海开源沪深 300 指数 A

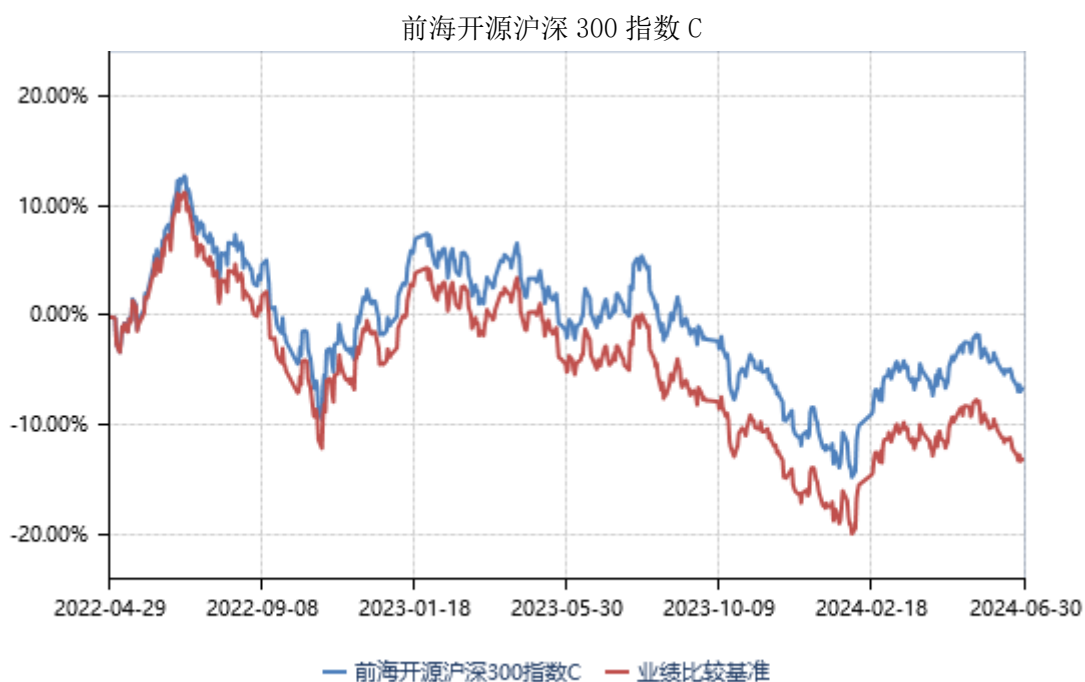
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.46%	0.45%	-3.14%	0.46%	0.68%	-0.01%
过去三个月	-0.80%	0.71%	-2.03%	0.72%	1.23%	-0.01%
过去六个月	2.07%	0.85%	0.88%	0.85%	1.19%	0.00%
过去一年	-6.36%	0.83%	-9.38%	0.83%	3.02%	0.00%
过去三年	-22.51%	0.99%	-32.19%	0.99%	9.68%	0.00%
自基金合同生效起至今	111.49%	1.28%	57.90%	1.31%	53.59%	-0.03%

前海开源沪深 300 指数 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
过去一个月	-2.49%	0.46%	-3.14%	0.46%	0.65%	0.00%
过去三个月	-0.90%	0.71%	-2.03%	0.72%	1.13%	-0.01%
过去六个月	1.86%	0.85%	0.88%	0.85%	0.98%	0.00%
过去一年	-6.73%	0.83%	-9.38%	0.83%	2.65%	0.00%
自基金合同生效起至今	-6.59%	0.90%	-13.03%	0.90%	6.44%	0.00%

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

前海开源沪深 300 指数 A



注：本基金自 2022 年 04 月 29 日起，增加 C 类基金份额并设置对应基金代码。

§ 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，并于 2013 年 9 月 18 日取得中国证监会核发的《特定客户资产管理业务资格证书》，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 96 只开放式基金，资产管理规模超过 949 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁溥森	本基金的基金经理	2020 年 08 月 12 日	-	10 年	梁溥森先生，中山大学硕士。曾任职于招商基金基金核算部；2015 年 6 月加盟前海开源基金管理有限公司，历任交易员、研究员，现任公司基金经理。

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

②证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内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

经历了三年的持续回调后，上半年市场行情继续胶着，尤其是去年表现相当坚挺的小市值个股走势更是承压，沪深 300 指数小幅上涨 0.89%。自从一季度大量资金涌入以沪深 300 为代表的宽基 ETF 以后，市场流动性风险得到了较大程度的释放，大中市值个股已经站稳了阵脚，但信心的重整还需要得到基本面的支撑。展望后市，美国经济的不确定性增加，将驱动美联储逐渐开启降息周期，这将有利于新兴市场的整体表现。同时，伴随着国内政策端的持续发力，经济有望逐步恢复，投资者信心也将持续修复，叠加处于历史较低位置的估值，我们对于后续行情仍然保持乐观。沪深 300 指数上半年小幅收涨 0.89%，本基金 A 类份额上涨 2.07%，C 类份额上涨 1.86%，表现均优于业绩比较基准。从估值来看，截止 2024 年 6 月 28 日，沪深 300 指数 PE (TTM) 仅为 11.84 倍，处于上市以来历史分位值约为 30.27%，其相对于十年期国债收益率的风险溢价高达 6.24%，相对吸引力比历史上 85.79% 的时期更高。投资的机会和风险，不仅取决于我们挑选的投资标的，与我们买入的价格也是息息相关的，当前沪深 300 指数的投资性价比依然较高。

作为一个被动指数基金，本基金将依然遵循一贯的投资逻辑，力争实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益，并通过参与新股申购、转债套利、期现套利等方式获得超额收益。上半年沪深 300 指数进行了定期调整，但调整成分股的权重占比较低，本基金跟随指数的定期调整对持仓进行了相应的调整。本基金将持续关注成份股的基本面变化情况，通过监控成份股负面信息及其影响，在不影响本基金投资运作的情况下及时对潜在“地雷股”进行出清，以期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沪深 300 指数 A 基金份额净值为 1.5367 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.07%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%；截至报告期末前海开源沪深 300 指数 C 基金份额净值为 1.5240 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.86%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从上半年来看，经济在一季度先小幅回升，二季度再度走弱，上半年 GDP 同比增长 5%，地产低位运行和金融防空转要求下，第三产业增速回落较多，财富效应回落叠加地产后周期消费拖累，居民消费恢复仍然偏慢，经济整体压力仍存，出口则表现出了较强的韧性。4 月底举行的政治局会议对经济形势进行了积极评价，认为经济运行中的积极因素增多，社会预期改善，但也指出了有效需求不足、企业经营压力大、风险隐患等挑战，指出要靠前发力有效落实已经确定的宏观政策，实施好积极的财政政策和稳健的货币政策；要积极扩大国内需求；要创造更多消费场景；要深入推进以人为本的新型城镇化，持续释放消费和投资潜力。上半年政策温和发力，517 新一轮地产政策放松力度较大，但 3000 亿的收储力度偏克制。尽管疤痕效应之下，基本面的修复还是比较缓慢的，但政策端的持续发力，尤其是二季度基本面走弱后，政策支持力度有望得到加强，经济基本面有望得到进一步修复。6 月 11 日世界银行发布最新一期《全球经济展望》报告，预计中国 2024 年的增长率为 4.8%，比 1 月份的预测高出 0.3 个百分点，主要是 2024 年年初的经济活动，尤其是出口，强于预期。资本市场政策方面，四月份发布的新“国九条”体现了高层对资本市场的高度重视，强调了进一步完善发行上市制度，严把发行上市准入关，进一步严格强制退市标准，畅通“出口关”；加大对分红优质公司的激励力度，多措并举推动提高股息率。多管齐下有望推动资本市场实现高质量发展。此外，尽管美联储开启降息的准确时点仍不确定，但降息周期开启是大势所趋，我国权益资产估值在全球横向对比中具有明显的估值优势，在全球资金再分配的过程中，中国资产性价比逐渐凸显。

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。本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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—前海开源基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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

本托管人认为，前海开源基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，前海开源基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	11,002,460.37	10,614,880.90
结算备付金		341,821.81	406,937.35
存出保证金		520,235.83	525,627.84
交易性金融资产	6.4.7.2	406,742,082.35	424,349,086.67
其中：股票投资		392,523,471.39	408,247,431.88
基金投资		-	-
债券投资		14,218,610.96	16,101,654.79
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		-	25,111.04
应收股利		-	-
应收申购款		570,476.74	3,965,688.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		419,177,077.10	439,887,331.80
负债和净资产			
		本期末	上年度末
		2024 年 06 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		251,837.50	799,806.64
应付赎回款		459,316.58	4,340,321.97
应付管理人报酬		173,492.66	178,432.21
应付托管费		34,698.53	35,686.47
应付销售服务费		10,429.80	13,086.33
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,125.13	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	170,356.10	278,945.71
负债合计		1,103,256.30	5,646,279.33
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	272,229,263.01	288,589,626.54
未分配利润	6.4.7.8	145,844,557.79	145,651,425.93
净资产合计		418,073,820.80	434,241,052.47
负债和净资产总计		419,177,077.10	439,887,331.80

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，前海开源沪深 300 指数基金份额总额 272,229,263.01 份，其中，前海开源沪深 300 指数 A 类基金份额净值 1.5367 元，基金份额总额 250,755,697.14 份；前海开源沪深 300 指数 C 类基金份额净值 1.5240 元，基金份额总额 21,473,565.87 份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
一、营业总收入		9,393,240.04	5,201,684.58
1. 利息收入		43,008.52	32,180.53
其中：存款利息收入	6.4.7.9	43,008.52	32,180.53
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）		-4,703,335.55	1,915,136.84
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-9,646,197.79	-2,429,733.42
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	163,810.48	152,975.86
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	262,435.20	803.98
股利收益	6.4.7.16	4,516,616.56	4,191,090.42
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	13,942,734.80	3,192,911.07
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	110,832.27	61,456.14
减：二、营业总支出		1,517,819.79	1,316,122.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,057,568.26	926,275.84

2. 托管费	6.4.10.2.2	211,513.68	185,255.24
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	77,061.31	32,777.98
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		947.26	606.15
8. 其他费用	6.4.7.20	170,729.28	171,207.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,875,420.25	3,885,562.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,875,420.25	3,885,562.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,875,420.25	3,885,562.00

6.3 净资产变动表

会计主体：前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	288,589,626.54	145,651,425.93	434,241,052.47
二、本期期初净资产	288,589,626.54	145,651,425.93	434,241,052.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-16,360,363.53	193,131.86	-16,167,231.67
（一）、综合收益总额	-	7,875,420.25	7,875,420.25
（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）	-16,360,363.53	-7,682,288.39	-24,042,651.92
其中：1. 基金申购款	149,614,461.43	75,576,268.30	225,190,729.73
2. 基金赎回款	-165,974,824.96	-83,258,556.69	-249,233,381.65
（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	272,229,263.01	145,844,557.79	418,073,820.80
项目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 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	224,385,213.28	140,662,782.17	365,047,995.45
二、本期期初净资产	224,385,213.28	140,662,782.17	365,047,995.45

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	249,807.62	3,249,695.87	3,499,503.49
（一）、综合收益总额	-	3,885,562.00	3,885,562.00
（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）	249,807.62	-635,866.13	-386,058.51
其中：1. 基金申购款	63,231,216.72	43,572,445.87	106,803,662.59
2. 基金赎回款	-62,981,409.10	-44,208,312.00	-
			107,189,721.10
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	224,635,020.90	143,912,478.04	368,547,498.94

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

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]494 号《关于核准前海开源沪深 300 指数型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《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 234,687,022.67 元，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2014]02030017 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》于 2014 年 6 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 234,720,620.35 份基金份额，其中认购资金利息折合 33,597.68 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司于 2022 年 4 月 29 日发布的《关于前海开源沪深 300 指数型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同等事项的公告》以及更新的《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，自 2022 年 4 月 29 日起，本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金

A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以沪深 300 指数的成份股及其备选成份股(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票)为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本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：投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 85%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的其他有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁

后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2024 年 06 月 30 日
活期存款	11,002,460.37
等于：本金	11,000,482.90
加：应计利息	1,977.47
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	11,002,460.37

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	464,332,423.31	-	392,523,471.39	-71,808,951.92	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	13,934,014.01	215,810.96	14,218,610.96	68,785.99
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	13,934,014.01	215,810.96	14,218,610.96	68,785.99

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	478,266,437.32	215,810.96	406,742,082.35	-71,740,165.93

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 2024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	4,145,460.00	-	-	-
其中：股指期货投资	4,145,460.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,145,460.00	-	-	-

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
IF2409	沪深300股指期货2409合约	4.00	4,108,320.00	-37,140.00
合计				-37,140.00
减：可抵销期货暂收款				-37,140.00
净额				0.00

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 2024 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	990.78
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	39,857.72
其中：交易所市场	39,857.72
银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	40,000.00
预提费用	89,507.60
合计	170,356.10

6.4.7.7 实收基金

前海开源沪深 300 指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	260,918,832.92	260,918,832.92
本期申购	61,621,563.59	61,621,563.59
本期赎回（以“-”号填列）	-71,784,699.37	-71,784,699.37
本期末	250,755,697.14	250,755,697.14

前海开源沪深 300 指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	27,670,793.62	27,670,793.62
本期申购	87,992,897.84	87,992,897.84
本期赎回（以“-”号填列）	-94,190,125.59	-94,190,125.59
本期末	21,473,565.87	21,473,565.87

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

前海开源沪深 300 指数 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	710,172,865.35	-	131,923,462.84
本期期初	710,172,865.35	-	131,923,462.84

		578,249,402.51	
本期利润	-5,290,396.30	11,861,011.82	6,570,615.52
本期基金份额交易产生的变动数	-27,601,688.16	23,699,598.83	-3,902,089.33
其中：基金申购款	166,529,158.97	134,857,283.37	31,671,875.60
基金赎回款	-194,130,847.13	158,556,882.20	-35,573,964.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	677,280,780.89	542,688,791.86	134,591,989.03

前海开源沪深 300 指数 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	75,032,221.55	-61,304,258.46	13,727,963.09
本期期初	75,032,221.55	-61,304,258.46	13,727,963.09
本期利润	-776,918.25	2,081,722.98	1,304,804.73
本期基金份额交易产生的变动数	-16,537,407.52	12,757,208.46	-3,780,199.06
其中：基金申购款	236,890,868.96	192,986,476.26	43,904,392.70
基金赎回款	-253,428,276.48	205,743,684.72	-47,684,591.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	57,717,895.78	-46,465,327.02	11,252,568.76

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	40,218.56
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	2,548.49
其他	241.47
合计	43,008.52

6.4.7.10 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	72,664,378.66
减：卖出股票成本总额	82,174,961.79
减：交易费用	135,614.66
买卖股票差价收入	-9,646,197.79

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益--利息收入	127,356.17
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	36,454.31
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	163,810.48

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 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,087,003.93
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,006,721.28
减：应计利息总额	43,787.94
减：交易费用	40.40
买卖债券差价收入	36,454.31

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
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	262,435.20

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,516,616.56
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	4,516,616.56

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	14,120,754.80
--股票投资	14,088,714.80
--债券投资	32,040.00
--资产支持证券投资	-
--基金投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2. 衍生工具	-178,020.00
--权证投资	-
--期货投资	-178,020.00
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	13,942,734.80

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

基金赎回费收入	103,870.42
转换费收入	6,961.85
合计	110,832.27

6.4.7.19 信用减值损失

无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,221.68
指数使用费	80,000.00
合计	170,729.28

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
开源证券	27,174,578.89	22.17%	-	-

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总 额的比例
开源证券	20,268.24	22.17%	8,817.18	22.12%
关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总 额的比例
-	-	-	-	-

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

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,057,568.26	926,275.84
其中：应支付销售机构的客户维护费	369,930.53	253,830.20
应支付基金管理人的净管理费	687,637.73	672,445.64

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 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	211,513.68	185,255.24

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源沪深 300 指数 A	前海开源沪深 300 指数 C	合计
前海开源基金	-	13,293.62	13,293.62
开源证券	-	109.62	109.62
合计	-	13,403.24	13,403.24
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源沪深 300 指数 A	前海开源沪深 300 指数 C	合计
前海开源基金	-	8,302.81	8,302.81
合计	-	8,302.81	8,302.81

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 0.40% 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 × 0.40% / 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自有资金投资本基金的情况

无。

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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	11,002,460.37	40,218.56	7,980,143.72	27,469.18

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末 2024 年 06 月 30 日本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024年03月19日	6个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024年01月11日	6个月	新股流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001389	广合科技	2024年03月26日	6个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024年05月28日	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年01月26日	6个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年03月20日	6个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024年03月13日	6个月	新股流通受限	39.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301539	宏鑫科技	2024年04月03日	6个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024年06月13日	6个月	新股流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
30156	达利	2023年	6个月	新股流	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-

6	凯普	12月22日		通受限							
301580	爱迪特	2024年06月19日	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-	
301587	中瑞股份	2024年03月27日	6个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-	
301588	美新科技	2024年03月06日	6个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-	
301591	肯特股份	2024年02月20日	6个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-	
601033	永兴股份	2024年01月11日	6个月	新股流通受限	16.20	15.96	525	8,505.00	8,379.00	-	
603082	北自科技	2024年01月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-	
603285	键邦股份	2024年06月28日	6个交易日	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-	
603285	键邦股份	2024年06月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-	
603341	龙旗科技	2024年02月23日	6个月	新股流通受限	26.00	37.49	209	5,434.00	7,835.41	-	
603344	星德胜	2024年03月13日	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-	
603350	安乃达	2024年06月26日	6个交易日	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-	
603350	安乃达	2024年06月26日	6个月	新股流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-	
603375	盛景微	2024年01月17日	6个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-	
603381	永臻股份	2024年06月19日	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	157	3,665.95	3,945.41	-	

		日								
688530	欧莱新材	2024年04月29日	6个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024年02月01日	6个月	新股流通受限	22.66	15.89	559	12,666.94	8,882.51	-
688691	灿芯股份	2024年04月02日	6个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年06月04日	6个月	新股流通受限	86.96	174.93	137	11,913.52	23,965.41	-
688709	成都华微	2024年01月31日	6个月	新股流通受限	15.69	18.79	721	11,312.49	13,547.59	-

注：①基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

②基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

③基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

④基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

本报告期，“骏鼎达”（股票代码：301538）新股申购持有数量为107股，根据《深圳市骏鼎达新材料股份有限公司2023年年度权益分派实施公告》，以资本公积转增股本43股，报告期末本基金持有“骏鼎达”限售股票数量合计为150股，认购价格为除权后的价格。

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，参见附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6。

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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	14,218,610.96	16,101,654.79
合计	14,218,610.96	16,101,654.79

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 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。本报告期末，本基金组合资产中经确认的当日净赎回金额未超过 7 个工作日可变现资产的账面价值。

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 2024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	11,002,460.37	-	-	-	11,002,460.37
结算备付金	341,821.81	-	-	-	341,821.81
存出保证金	27,237.43	-	-	492,998.40	520,235.83
交易性金融资产	14,218,610.96	-	-	392,523,471.39	406,742,082.35
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	-	-	-	570,476.74	570,476.74
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	25,590,130.57	-	-	393,586,946.53	419,177,077.10
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	-	-	-	251,837.50	251,837.50
应付赎回款	-	-	-	459,316.58	459,316.58
应付管理人报酬	-	-	-	173,492.66	173,492.66
应付托管费	-	-	-	34,698.53	34,698.53
应付销售服务费	-	-	-	10,429.80	10,429.80
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3,125.13	3,125.13
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	170,356.10	170,356.10
负债总计	-	-	-	1,103,256.30	1,103,256.30
利率敏感度缺口	25,590,130.57	-	-	-392,483,690.23	418,073,820.80
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	10,614,880.90	-	-	-	10,614,880.90
结算备付金	406,937.35	-	-	-	406,937.35
存出保证金	28,367.04	-	-	497,260.80	525,627.84
交易性金融资产	16,101,654.79	-	-	408,247,431.88	424,349,086.67
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	25,111.04	25,111.04
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,965,688.00	3,965,688.00
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	27,151,840.08	-	-	412,735,491.72	439,887,331.80
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	799,806.64	799,806.64
应付赎回款	-	-	-	4,340,321.97	4,340,321.97
应付管理人报酬	-	-	-	178,432.21	178,432.21
应付托管费	-	-	-	35,686.47	35,686.47
应付销售服务费	-	-	-	13,086.33	13,086.33
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	-	-	-	278,945.71
负债总计	-	-	-	5,646,279.33
利率敏感度缺口	27,151,840.08	-	-	407,089,212.39

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（2024年06月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	2,627.37	21,252.08
	市场利率上升 25 个基点	-2,626.40	-21,194.80

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金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。

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 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	392,523,471.39	93.89	408,247,431.88	94.01
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	392,523,471.39	93.89	408,247,431.88	94.01

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（2024 年 06 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	17,019,599.49	21,628,536.77
	业绩比较基准下降 5%	-17,019,599.49	-21,628,536.77

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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	392,262,268.51	407,163,131.58

第二层次	14,264,222.07	16,101,654.79
第三层次	215,591.77	1,084,300.30
合计	406,742,082.35	424,349,086.67

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股票和债券，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股票和债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，确定相关股票和债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 2024 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(2023 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

无。

§ 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	392,523,471.39	93.64
	其中：股票	392,523,471.39	93.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,218,610.96	3.39
	其中：债券	14,218,610.96	3.39
	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	11,344,282.18	2.71
8	其他各项资产	1,090,712.57	0.26
9	合计	419,177,077.10	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,910,312.40	1.17
B	采矿业	27,385,722.56	6.55
C	制造业	203,087,489.89	48.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,266,227.89	4.37
E	建筑业	9,342,354.89	2.23
F	批发和零售业	991,507.80	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	15,166,432.07	3.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,409,175.25	4.16
J	金融业	85,012,064.76	20.33
K	房地产业	3,519,564.39	0.84
L	租赁和商务服务业	3,069,300.80	0.73
M	科学研究和技术服务业	3,064,924.85	0.73
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	1,037,190.96	0.25
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	392,262,268.51	93.83

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	218,358.50	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	34,465.38	0.01

J	金融业		-
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		-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,379.00	0.00
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	261,202.88	0.06

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	13,665	20,051,884.35	4.80
2	300750	宁德时代	57,380	10,330,121.40	2.47
3	601318	中国平安	236,192	9,768,901.12	2.34
4	600036	招商银行	268,203	9,169,860.57	2.19
5	600900	长江电力	265,591	7,680,891.72	1.84
6	000333	美的集团	106,202	6,850,029.00	1.64
7	601166	兴业银行	361,197	6,364,291.14	1.52
8	601899	紫金矿业	355,761	6,250,720.77	1.50
9	000858	五粮液	42,201	5,403,416.04	1.29
10	002594	比亚迪	19,833	4,963,208.25	1.19
11	601328	交通银行	596,635	4,456,863.45	1.07
12	601398	工商银行	758,345	4,322,566.50	1.03
13	002475	立讯精密	109,150	4,290,686.50	1.03
14	601088	中国神华	90,451	4,013,310.87	0.96
15	600030	中信证券	211,602	3,857,504.46	0.92
16	300760	迈瑞医疗	13,200	3,840,012.00	0.92
17	000651	格力电器	97,500	3,823,950.00	0.91
18	600276	恒瑞医药	98,812	3,800,309.52	0.91
19	600887	伊利股份	138,526	3,579,511.84	0.86
20	600309	万华化学	40,955	3,311,621.30	0.79

21	000725	京东方 A	802,203	3,281,010.27	0.78
22	601225	陕西煤业	115,590	2,978,754.30	0.71
23	601919	中远海控	189,750	2,939,227.50	0.70
24	600919	江苏银行	392,570	2,916,795.10	0.70
25	300059	东方财富	274,306	2,896,671.36	0.69
26	601816	京沪高铁	531,400	2,853,618.00	0.68
27	300308	中际旭创	19,320	2,663,841.60	0.64
28	002714	牧原股份	59,817	2,608,021.20	0.62
29	601857	中国石油	245,533	2,533,900.56	0.61
30	002415	海康威视	80,728	2,495,302.48	0.60
31	601668	中国建筑	448,646	2,382,310.26	0.57
32	300124	汇川技术	46,151	2,367,546.30	0.57
33	601138	工业富联	86,000	2,356,400.00	0.56
34	600690	海尔智家	81,966	2,326,195.08	0.56
35	000568	泸州老窖	16,205	2,325,255.45	0.56
36	300498	温氏股份	116,160	2,302,291.20	0.55
37	600809	山西汾酒	10,600	2,235,328.00	0.53
38	002371	北方华创	6,900	2,207,241.00	0.53
39	601985	中国核电	204,350	2,178,371.00	0.52
40	600406	国电南瑞	86,956	2,170,421.76	0.52
41	603259	药明康德	54,665	2,142,321.35	0.51
42	000001	平安银行	210,239	2,133,925.85	0.51
43	600031	三一重工	128,625	2,122,312.50	0.51
44	601988	中国银行	455,591	2,104,830.42	0.50
45	601601	中国太保	75,473	2,102,677.78	0.50
46	600000	浦发银行	254,250	2,092,477.50	0.50
47	600941	中国移动	19,463	2,092,272.50	0.50
48	601728	中国电信	335,100	2,060,865.00	0.49
49	000792	盐湖股份	117,700	2,053,865.00	0.49
50	600016	民生银行	531,535	2,014,517.65	0.48
51	300274	阳光电源	32,340	2,006,050.20	0.48
52	600028	中国石化	315,000	1,990,800.00	0.48
53	601766	中国中车	262,907	1,974,431.57	0.47
54	688981	中芯国际	42,800	1,973,080.00	0.47
55	600150	中国船舶	48,300	1,966,293.00	0.47
56	601012	隆基绿能	139,470	1,955,369.40	0.47
57	600050	中国联通	413,000	1,941,100.00	0.46
58	000063	中兴通讯	69,101	1,932,754.97	0.46
59	002142	宁波银行	87,138	1,922,264.28	0.46
60	000338	潍柴动力	117,204	1,903,392.96	0.46
61	002352	顺丰控股	52,900	1,888,001.00	0.45

62	600438	通威股份	98,200	1,876,602.00	0.45
63	601169	北京银行	319,854	1,867,947.36	0.45
64	603501	韦尔股份	18,300	1,818,471.00	0.43
65	600837	海通证券	209,765	1,795,588.40	0.43
66	000100	TCL 科技	405,748	1,752,831.36	0.42
67	002230	科大讯飞	39,732	1,706,489.40	0.41
68	600660	福耀玻璃	34,464	1,650,825.60	0.39
69	601229	上海银行	215,000	1,560,900.00	0.37
70	600089	特变电工	108,680	1,507,391.60	0.36
71	600938	中国海油	45,100	1,488,300.00	0.36
72	600188	兖矿能源	64,350	1,462,675.50	0.35
73	688041	海光信息	20,600	1,448,592.00	0.35
74	601390	中国中铁	221,090	1,441,506.80	0.34
75	000625	长安汽车	107,327	1,441,401.61	0.34
76	000983	山西焦煤	137,300	1,415,563.00	0.34
77	600104	上汽集团	100,560	1,393,761.60	0.33
78	603986	兆易创新	14,408	1,377,692.96	0.33
79	601688	华泰证券	110,657	1,371,040.23	0.33
80	600436	片仔癀	6,600	1,367,322.00	0.33
81	600048	保利发展	155,135	1,358,982.60	0.33
82	601006	大秦铁路	188,544	1,349,975.04	0.32
83	600905	三峡能源	308,100	1,343,316.00	0.32
84	002027	分众传媒	217,740	1,319,504.40	0.32
85	688012	中微公司	9,300	1,313,718.00	0.31
86	601211	国泰君安	96,924	1,313,320.20	0.31
87	601888	中国中免	20,960	1,309,790.40	0.31
88	603019	中科曙光	31,456	1,305,424.00	0.31
89	601600	中国铝业	170,780	1,303,051.40	0.31
90	603993	洛阳钼业	152,301	1,294,558.50	0.31
91	601818	光大银行	399,890	1,267,651.30	0.30
92	600019	宝钢股份	190,575	1,267,323.75	0.30
93	601699	潞安环能	68,600	1,243,718.00	0.30
94	603288	海天味业	35,911	1,237,852.17	0.30
95	600039	四川路桥	156,640	1,235,889.60	0.30
96	600585	海螺水泥	52,046	1,227,765.14	0.29
97	601658	邮储银行	239,700	1,215,279.00	0.29
98	601989	中国重工	246,093	1,213,238.49	0.29
99	600886	国投电力	64,456	1,175,677.44	0.28
100	601009	南京银行	111,854	1,162,163.06	0.28
101	688111	金山办公	5,100	1,160,250.00	0.28
102	600795	国电电力	192,727	1,154,434.73	0.28

103	688008	澜起科技	19,700	1,126,052.00	0.27
104	601628	中国人寿	36,049	1,119,321.45	0.27
105	600999	招商证券	80,057	1,113,592.87	0.27
106	000938	紫光股份	49,406	1,104,224.10	0.26
107	000425	徐工机械	153,396	1,096,781.40	0.26
108	601939	建设银行	145,332	1,075,456.80	0.26
109	600547	山东黄金	38,837	1,063,357.06	0.25
110	300014	亿纬锂能	26,500	1,057,880.00	0.25
111	600893	航发动力	28,849	1,054,430.95	0.25
112	002304	洋河股份	13,000	1,049,620.00	0.25
113	688303	大全能源	51,400	1,048,046.00	0.25
114	002179	中航光电	27,424	1,043,483.20	0.25
115	601669	中国电建	185,847	1,038,884.73	0.25
116	300015	爱尔眼科	100,503	1,037,190.96	0.25
117	000002	万科 A	146,900	1,018,017.00	0.24
118	002241	歌尔股份	51,710	1,008,862.10	0.24
119	600926	杭州银行	76,800	1,002,240.00	0.24
120	000538	云南白药	19,420	993,333.00	0.24
121	600674	川投能源	52,700	988,125.00	0.24
122	600584	长电科技	30,900	979,839.00	0.23
123	688271	联影医疗	8,900	976,330.00	0.23
124	600760	中航沈飞	23,812	954,861.20	0.23
125	600111	北方稀土	54,611	939,309.20	0.22
126	002050	三花智控	48,429	924,025.32	0.22
127	600489	中金黄金	62,400	923,520.00	0.22
128	600011	华能国际	94,900	912,938.00	0.22
129	688256	寒武纪	4,551	904,147.17	0.22
130	601916	浙商银行	326,200	900,312.00	0.22
131	002252	上海莱士	114,980	899,143.60	0.22
132	600015	华夏银行	137,711	881,350.40	0.21
133	600009	上海机场	26,779	863,622.75	0.21
134	600958	东方证券	112,955	858,458.00	0.21
135	600426	华鲁恒升	32,140	856,209.60	0.20
136	601186	中国铁建	99,442	852,217.94	0.20
137	002311	海大集团	18,000	846,900.00	0.20
138	300408	三环集团	28,900	843,591.00	0.20
139	000166	申万宏源	195,013	840,506.03	0.20
140	601901	方正证券	106,963	826,823.99	0.20
141	600989	宝丰能源	47,600	824,908.00	0.20
142	000157	中联重科	107,202	823,311.36	0.20
143	000977	浪潮信息	22,300	811,051.00	0.19

144	003816	中国广核	170,100	787,563.00	0.19
145	688036	传音控股	10,200	780,708.00	0.19
146	000776	广发证券	63,904	777,711.68	0.19
147	002049	紫光国微	14,680	772,168.00	0.18
148	300433	蓝思科技	42,100	768,325.00	0.18
149	002001	新和成	39,624	760,780.80	0.18
150	000596	古井贡酒	3,600	759,852.00	0.18
151	601377	兴业证券	148,980	753,838.80	0.18
152	600115	中国东航	185,250	742,852.50	0.18
153	601111	中国国航	100,456	741,365.28	0.18
154	300122	智飞生物	25,850	724,575.50	0.17
155	000768	中航西飞	29,400	706,482.00	0.17
156	002460	赣锋锂业	24,420	699,633.00	0.17
157	601633	长城汽车	27,202	688,210.60	0.16
158	600010	包钢股份	489,904	685,865.60	0.16
159	002601	龙佰集团	36,200	672,234.00	0.16
160	001979	招商蛇口	76,401	671,564.79	0.16
161	600029	南方航空	113,972	671,295.08	0.16
162	601800	中国交建	75,084	671,250.96	0.16
163	002466	天齐锂业	22,300	666,993.00	0.16
164	002648	卫星化学	37,060	666,338.80	0.16
165	002236	大华股份	42,800	661,688.00	0.16
166	603799	华友钴业	29,649	656,132.37	0.16
167	000786	北新建材	22,000	652,520.00	0.16
168	601838	成都银行	42,100	639,499.00	0.15
169	601117	中国化学	77,600	639,424.00	0.15
170	002493	荣盛石化	65,550	633,213.00	0.15
171	600023	浙能电力	88,900	632,079.00	0.15
172	600346	恒力石化	45,180	630,261.00	0.15
173	603369	今世缘	13,600	628,320.00	0.15
174	300782	卓胜微	8,080	628,139.20	0.15
175	600161	天坛生物	25,720	627,568.00	0.15
176	000661	长春高新	6,800	624,036.00	0.15
177	600372	中航机载	52,000	622,440.00	0.15
178	600196	复星医药	27,997	619,853.58	0.15
179	601788	光大证券	42,240	617,548.80	0.15
180	002938	鹏鼎控股	15,400	612,304.00	0.15
181	688223	晶科能源	86,100	611,310.00	0.15
182	600845	宝信软件	19,050	608,266.50	0.15
183	601872	招商轮船	71,800	606,710.00	0.15
184	601021	春秋航空	10,750	605,547.50	0.14

185	002129	TCL 中环	69,900	604,635.00	0.14
186	000807	云铝股份	44,700	603,897.00	0.14
187	300418	昆仑万维	18,600	599,664.00	0.14
188	601868	中国能建	279,500	592,540.00	0.14
189	600219	南山铝业	155,500	592,455.00	0.14
190	300661	圣邦股份	7,150	591,877.00	0.14
191	600570	恒生电子	33,452	590,762.32	0.14
192	600176	中国巨石	52,920	584,766.00	0.14
193	002180	纳思达	21,900	578,598.00	0.14
194	601360	三六零	75,300	578,304.00	0.14
195	300896	爱美客	3,320	571,372.00	0.14
196	600741	华域汽车	34,824	570,417.12	0.14
197	600233	圆通速递	36,300	568,095.00	0.14
198	600085	同仁堂	14,829	566,616.09	0.14
199	601689	拓普集团	10,500	562,905.00	0.13
200	601995	中金公司	19,000	562,590.00	0.13
201	605499	东鹏饮料	2,600	560,950.00	0.13
202	300347	泰格医药	11,500	558,900.00	0.13
203	601336	新华保险	18,427	553,362.81	0.13
204	600600	青岛啤酒	7,600	553,052.00	0.13
205	002736	国信证券	63,503	551,841.07	0.13
206	600183	生益科技	26,000	547,560.00	0.13
207	603392	万泰生物	8,249	543,444.12	0.13
208	600362	江西铜业	22,940	543,219.20	0.13
209	601100	恒立液压	11,644	542,377.52	0.13
210	601066	中信建投	28,000	538,720.00	0.13
211	002271	东方雨虹	43,400	535,556.00	0.13
212	000895	双汇发展	22,506	534,967.62	0.13
213	002920	德赛西威	6,100	531,249.00	0.13
214	600745	闻泰科技	18,700	528,275.00	0.13
215	000963	华东医药	18,680	519,490.80	0.12
216	001965	招商公路	43,800	519,468.00	0.12
217	601881	中国银河	47,000	510,420.00	0.12
218	600027	华电国际	73,500	510,090.00	0.12
219	601898	中煤能源	40,300	502,944.00	0.12
220	688126	沪硅产业	36,400	502,684.00	0.12
221	601618	中国中冶	157,526	488,330.60	0.12
222	300033	同花顺	4,700	487,390.00	0.12
223	000999	华润三九	11,310	481,579.80	0.12
224	002459	晶澳科技	42,768	479,001.60	0.11
225	002916	深南电路	4,500	475,965.00	0.11

226	601607	上海医药	24,700	472,017.00	0.11
227	600515	海南机场	150,000	471,000.00	0.11
228	600026	中远海能	29,900	466,739.00	0.11
229	000301	东方盛虹	58,200	463,854.00	0.11
230	300832	新产业	6,800	458,592.00	0.11
231	000876	新希望	50,140	458,279.60	0.11
232	600332	白云山	15,525	455,348.25	0.11
233	600588	用友网络	45,449	454,490.00	0.11
234	600875	东方电气	24,600	453,870.00	0.11
235	601877	正泰电器	23,800	453,628.00	0.11
236	002074	国轩高科	23,500	450,025.00	0.11
237	601998	中信银行	66,700	446,890.00	0.11
238	002709	天赐材料	25,400	446,024.00	0.11
239	601878	浙商证券	41,054	440,098.88	0.11
240	600415	小商品城	59,300	440,006.00	0.11
241	002555	三七互娱	33,500	437,175.00	0.10
242	600025	华能水电	39,900	430,122.00	0.10
243	688396	华润微	11,443	428,425.92	0.10
244	600803	新奥股份	20,400	424,320.00	0.10
245	000408	藏格矿业	17,400	418,818.00	0.10
246	300316	晶盛机电	14,500	416,585.00	0.10
247	300628	亿联网络	11,240	413,294.80	0.10
248	002812	恩捷股份	13,000	411,450.00	0.10
249	688599	天合光能	24,000	406,080.00	0.10
250	300142	沃森生物	35,500	403,990.00	0.10
251	300450	先导智能	24,220	402,778.60	0.10
252	300223	北京君正	7,200	399,168.00	0.10
253	605117	德业股份	5,264	391,325.76	0.09
254	002007	华兰生物	24,196	382,054.84	0.09
255	601238	广汽集团	49,000	379,260.00	0.09
256	600460	士兰微	21,500	376,465.00	0.09
257	301269	华大九天	4,800	369,840.00	0.09
258	300496	中科创达	8,100	369,279.00	0.09
259	300751	迈为股份	3,060	365,608.80	0.09
260	603260	合盛硅业	7,800	364,338.00	0.09
261	300759	康龙化成	19,575	363,703.50	0.09
262	601319	中国人保	70,300	362,045.00	0.09
263	300999	金龙鱼	13,200	361,020.00	0.09
264	000733	振华科技	8,500	353,005.00	0.08
265	600018	上港集团	60,539	349,915.42	0.08
266	600918	中泰证券	61,500	348,705.00	0.08

267	002821	凯莱英	5,280	347,424.00	0.08
268	601799	星宇股份	3,100	347,324.00	0.08
269	300413	芒果超媒	16,520	345,268.00	0.08
270	603806	福斯特	22,904	336,688.80	0.08
271	688009	中国通号	55,613	333,678.00	0.08
272	601865	福莱特	16,400	329,640.00	0.08
273	600132	重庆啤酒	5,400	327,780.00	0.08
274	603195	公牛集团	4,164	321,127.68	0.08
275	600061	国投资本	56,529	319,388.85	0.08
276	300919	中伟股份	10,220	316,717.80	0.08
277	603659	璞泰来	22,180	313,403.40	0.07
278	000617	中油资本	56,000	309,120.00	0.07
279	000708	中信特钢	22,300	302,611.00	0.07
280	601059	信达证券	21,100	299,831.00	0.07
281	002603	以岭药业	18,500	283,605.00	0.07
282	002410	广联达	29,520	282,801.60	0.07
283	300454	深信服	5,500	277,915.00	0.07
284	688187	时代电气	5,600	276,528.00	0.07
285	002841	视源股份	9,200	271,676.00	0.06
286	300442	润泽科技	11,200	268,240.00	0.06
287	603899	晨光股份	8,200	256,496.00	0.06
288	688363	华熙生物	4,200	237,594.00	0.06
289	601808	中海油服	13,000	223,600.00	0.05
290	600732	爱旭股份	24,180	218,829.00	0.05
291	603833	欧派家居	3,960	212,097.60	0.05
292	300979	华利集团	3,400	206,890.00	0.05
293	601236	红塔证券	30,680	196,965.60	0.05
294	601698	中国卫通	13,600	191,624.00	0.05
295	688082	盛美上海	2,133	180,259.83	0.04
296	300957	贝泰妮	3,700	178,784.00	0.04
297	000800	一汽解放	19,900	155,817.00	0.04
298	603296	华勤技术	2,100	115,983.00	0.03
299	001289	龙源电力	2,800	48,300.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
2	688692	达梦数据	137	23,965.41	0.01
3	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01

4	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
5	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
6	688709	成都华微	721	13,547.59	0.00
7	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
8	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
9	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
10	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
11	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
12	688584	上海合晶	559	8,882.51	0.00
13	601033	永兴股份	525	8,379.00	0.00
14	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
15	603341	龙旗科技	209	7,835.41	0.00
16	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
17	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
18	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
19	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
20	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
21	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
22	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
23	603381	永臻股份	157	3,945.41	0.00
24	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
25	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
26	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
27	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601699	潞安环能	2,743,979.00	0.63
2	601088	中国神华	2,727,852.00	0.63
3	688303	大全能源	2,708,531.81	0.62
4	600438	通威股份	2,656,690.00	0.61
5	000983	山西焦煤	2,628,282.00	0.61
6	601225	陕西煤业	2,595,086.00	0.60
7	600039	四川路桥	2,440,029.00	0.56
8	600188	兖矿能源	2,287,089.16	0.53
9	601919	中远海控	2,239,561.00	0.52
10	600900	长江电力	1,835,377.00	0.42
11	600519	贵州茅台	1,817,111.00	0.42

12	601166	兴业银行	1,739,365.00	0.40
13	601998	中信银行	1,576,455.89	0.36
14	601318	中国平安	771,491.00	0.18
15	300750	宁德时代	737,367.00	0.17
16	600161	天坛生物	665,039.00	0.15
17	000807	云铝股份	637,392.00	0.15
18	300418	昆仑万维	618,510.00	0.14
19	601878	浙商证券	526,003.60	0.12
20	603259	药明康德	524,562.00	0.12

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601088	中国神华	2,883,516.00	0.66
2	601919	中远海控	2,610,945.00	0.60
3	600519	贵州茅台	2,543,416.00	0.59
4	601225	陕西煤业	2,447,514.00	0.56
5	600188	兖矿能源	2,152,542.00	0.50
6	601699	潞安环能	2,147,661.00	0.49
7	600438	通威股份	2,088,842.00	0.48
8	000983	山西焦煤	2,025,656.00	0.47
9	600039	四川路桥	1,939,812.00	0.45
10	688303	大全能源	1,784,382.18	0.41
11	601166	兴业银行	1,774,812.00	0.41
12	601998	中信银行	1,524,416.30	0.35
13	601318	中国平安	1,394,016.00	0.32
14	300750	宁德时代	1,181,919.40	0.27
15	600036	招商银行	1,161,549.00	0.27
16	000333	美的集团	1,040,347.00	0.24
17	601899	紫金矿业	897,107.00	0.21
18	000858	五粮液	874,840.00	0.20
19	600028	中国石化	849,030.00	0.20
20	600900	长江电力	732,351.00	0.17

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	52,362,286.50
卖出股票收入（成交）总额	72,664,378.66

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	14,218,610.96	3.40
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	14,218,610.96	3.40

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019709	23 国债 16	140,000	14,218,610.96	3.40

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同，为了更好地实现投资目标，本基金可少量投资于股指期货。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险

等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，主要通过多头套期保值策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本基金将在流动性较好和投资期限适当的合约上安排比例适当的头寸，以降低对市场的冲击并减少交易成本，根据市场流动性状况及投资需求，分时段执行展期交易，在交易过程中，对投资组合的风险状况持续监控。

具体而言，当前对股指期货交易主要用以获得股指期货的基差收敛收益，并将剩余资金进行现金管理获得部分收益，我们还会在期货保证金账户中预留足够多的保证金以进行期货投资风险控制。考虑到股指期货结算规则等特性，使用期货进行指数跟踪可能会存在一定的偏离，我们会根据市场实际情况评估跟踪偏离及获得超额收益的性价比，选择最有利于持有人的期货投资策略。

总体而言，本基金进行股指期货投资风险可控，并且能够利用股指期货的杠杆作用降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，或者进行低风险的套利活动，符合本基金的投资政策与投资目标。后续我们将密切关注期货市场表现情况及跟踪误差情况，决定是否继续投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

报告期末，本基金投资的前十名证券除“招商银行(证券代码 600036)”外其他证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	520,235.83
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	570,476.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,090,712.57

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	603285	键邦股份	24,002.55	0.01	新股未上市、新股流通受限
2	688692	达梦数据	23,965.41	0.01	新股流通受限
3	603350	安乃达	21,608.56	0.01	新股未上市、新股流通受限
4	301536	星辰科技	15,521.87	0.00	新股流通受限
5	301538	骏鼎达	13,686.00	0.00	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 沪深 300 指数 A	37,989	6,600.74	43,854,988.3 8	17.49%	206,900,708.7 6	82.51%
前海开源 沪深 300 指数 C	17,021	1,261.59	446,946.28	2.08%	21,026,619.59	97.92%
合计	55,010	4,948.72	44,301,934.6 6	16.27%	227,927,328.3 5	83.73%

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	前海开源沪深 300 指数 A	2,446,101.03	0.9755%
	前海开源沪深 300 指数 C	8,716.65	0.0406%
	合计	2,454,817.68	0.9017%

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	前海开源沪深 300 指数 A	10~50
	前海开源沪深 300 指数 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	前海开源沪深 300 指数 A	10~50
	前海开源沪深 300 指数 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	前海开源沪深 300 指数 A	前海开源沪深 300 指数 C
基金合同生效日（2014 年 06 月 17 日）基金份额总额	234,720,620.35	-
本报告期期初基金份额总额	260,918,832.92	27,670,793.62
本报告期基金总申购份额	61,621,563.59	87,992,897.84
减：本报告期基金总赎回份额	71,784,699.37	94,190,125.59
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	250,755,697.14	21,473,565.87

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

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的重大人事变动：2024 年 4 月 23 日起，王厚琼先生任副总经理。

本报告期内无涉及基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国新证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	53,776,461.11	43.88%	40,111.56	43.88%	-
华泰证券	2	41,614,793.42	33.95%	31,040.54	33.95%	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	27,174,578.89	22.17%	20,268.24	22.17%	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
星展证券	2	-	-	-	-	-
中国国际金融	2	-	-	-	-	-
中国银河证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：依据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》和相关业务规则，本基金管理人制定了基金租用证券公司交易单元的选择标准和程序，其中，被动股票型基金租用证券公司交易单元的选择标准和程序如下：

A：选择标准

1. 经营能力；2. 合规建设情况；3. 专业服务能力；4. 费率优势；5. 法律法规及规范性文件所规定证券交易单元租赁服务商的其他要求。

B: 选择程序

证券公司的选择由本基金管理人交易单元管理小组决定。管理小组根据选择标准来挑选财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易能力较强的证券公司参与证券交易，并根据证券公司提供服务的情况对各往来证券公司进行评估，评估结果作为交易单元租用选择和调整的参考依据。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期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
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	1,008,069.22	100.00%	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
星展证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银 河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

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北京增财基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2024年01月05日
2	关于旗下部分基金增加江海证券有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2024年01月10日
3	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2024年01月22日
4	关于旗下部分基金增加贵州省贵文文化基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2024年03月05日
5	前海开源基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2024年03月18日
6	关于旗下部分基金增加江苏银行股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2024年03月29日
7	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024年03月30日
8	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2024年04月22日
9	前海开源基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2024年04月24日
10	关于防范不法分子冒用前海开源基金名义进行非法活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2024年05月15日
11	关于旗下部分基金增加上海证券有限责任公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2024年05月23日

12	前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金产品资料概要更新（20240626 更新）	中国证监会规定媒介	2024年06月26日
----	---	-----------	-------------

§ 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

无。

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沪深 300 指数型证券投资基金设立的文件
- (2) 《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金托管协议》
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (5) 前海开源沪深 300 指数型证券投资基金在指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
2024 年 08 月 30 日