

前海开源中证健康产业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：国信证券股份有限公司

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。

基金托管人国信证券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	6
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	7
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1	资产负债表	12
6.2	利润表	13
6.3	净资产变动表	14
6.4	报表附注	15
§ 7	投资组合报告	34
7.1	期末基金资产组合情况	34
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	35
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	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	40
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	40
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	40
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	40
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	40
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12	投资组合报告附注	41

§ 8	基金份额持有人信息 .....	42
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	42
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42
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 .....	42
§ 9	开放式基金份额变动 .....	42
§ 10	重大事件揭示 .....	42
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	43
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 .....	43
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	43
10.4	基金投资策略的改变 .....	43
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	43
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 .....	43
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	43
10.8	其他重大事件 .....	44
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	45
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 .....	45
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	45
§ 12	备查文件目录 .....	45
12.1	备查文件目录 .....	45
12.2	存放地点 .....	45
12.3	查阅方式 .....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源中证健康产业指数型证券投资基金
基金简称	前海开源中证健康指数
场内简称	中证健康
基金主代码	164401
基金运作方式	契约型普通开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 18 日
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	国信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	74,945,757.58 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金紧密跟踪标的指数——中证健康产业指数，通过严谨数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过【0.35%】，年跟踪误差不超过【4%】。
投资策略	<p>本基金采用动态复制标的指数的投资方法，参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，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>当预期成份股发生调整或成份股发生配股、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>本基金力争份额净值增长率与同期业绩比较基准的增长率之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>为实现跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值的 90% 的比例投资于标的指数成份股及其备选成份股，并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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 股票投资组合的构建</p> <p>本基金在建仓期内，将参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</p>

	<p>当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p>(2) 股票投资组合的调整</p> <p>本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化，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。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金可以根据流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。</p>
业绩比较基准	中证健康产业指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险和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。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司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	国信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙辰健	薛璐
	联系电话	0755-88601888	0755-22940163
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	03339@guosen.com.cn
客户服务电话		4001-666-998	0755-61897778
传真		0755-83181169	0755-22940165
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）	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
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	深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦19楼
邮政编码		518040	518000
法定代表人		李强	张纳沙

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
----------------	------

登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.qhkyfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	-5,404,854.45
本期利润	-10,362,275.59
加权平均基金份额本期利润	-0.1355
本期加权平均净值利润率	-19.48%
本期基金份额净值增长率	-17.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	5,779,074.70
期末可供分配基金份额利润	0.0771
期末基金资产净值	46,996,987.22
期末基金份额净值	0.6271
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	-41.01%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-8.86%	0.92%	-9.64%	0.95%	0.78%	-0.03%

过去三个月	-9.95%	0.99%	-10.77%	1.01%	0.82%	-0.02%
过去六个月	-17.69%	1.29%	-18.22%	1.30%	0.53%	-0.01%
过去一年	-23.66%	1.05%	-23.80%	1.06%	0.14%	-0.01%
过去三年	-43.47%	1.09%	-46.76%	1.11%	3.29%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-41.01%	1.09%	-45.86%	1.11%	4.85%	-0.02%

### 3.2.2 自基金转型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变动的比较



注：本基金自 2020 年 12 月 18 日起转型为前海开源中证健康产业指数型证券投资基金。

## § 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 12 月 18 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遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内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。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，叠加处于历史极低位置的估值，我们对于后续行情仍然保持乐观。中证健康产业指数上半年下跌 19.13%，本基金下跌 17.69%，表现优于业绩比较基准。从估值来看，截止 2024 年 6 月 28 日，中证健康产业指数 PE (TTM) 约为 28.11 倍，处于上市以来历史分位值约为 11.87%，其相对于十年期国债收益率的风险溢价约为 1.35%，相对吸引力比历史上 99.71% 的时期更高。投资的机会和风险，不仅取决于我们挑选的投资标的，与我们买入的价格也是息息相关的，当前中证健康产业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、转债套利等方式获得超额收益。本基金将持续关注成份股的基本面变化情况，通过监控成份股负面信息及其影响，在不影响本基金投资运作的情况下及时对潜在“地雷股”进行出清，并力争通过多种方式对基金业绩进行一定的增厚，积跬步以致千里，力争在紧密跟踪业绩比较基准并追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的同时，能够为持有人贡献一定的业绩正偏离。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源中证健康指数基金份额净值为 0.6271 元，本报告期内，基金份额净值增长率为-17.69%，同期业绩比较基准收益率为-18.22%。

#### 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

报告期内，国信证券股份有限公司（以下称“托管人”）严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益分配的情况等方面进行了必要的监督、复核和审查。

### 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

托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现等财务信息相关内容，认为其不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：前海开源中证健康产业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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,052,872.01	1,690,569.58
结算备付金		-	-
存出保证金		8,687.88	42,654.26
交易性金融资产	6.4.7.2	46,142,097.52	58,372,200.59
其中：股票投资		44,415,551.90	56,663,304.70
基金投资		-	-
债券投资		1,726,545.62	1,708,895.89
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		455,985.85	39,065.22
应收股利		-	-
应收申购款		18,449.11	25,974.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		47,678,092.37	60,170,464.12
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		502,026.78	80,305.12
应付赎回款		11,914.52	17,661.01
应付管理人报酬		40,854.96	50,974.84
应付托管费		8,171.00	10,194.98
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	118,137.89	181,104.82
负债合计		681,105.15	340,240.77
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	41,217,912.52	43,188,329.63
未分配利润	6.4.7.8	5,779,074.70	16,641,893.72
净资产合计		46,996,987.22	59,830,223.35
负债和净资产总计		47,678,092.37	60,170,464.12

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，前海开源中证健康产业指数基金份额净值 0.6271 元，基金份额总额 74,945,757.58 份。

## 6.2 利润表

会计主体：前海开源中证健康产业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		-9,900,226.06	-5,065,124.50

1. 利息收入		8,098.80	17,569.97
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,098.80	17,569.97
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）		-4,954,739.80	-24,287,356.50
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-5,576,607.82	-25,190,634.68
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	40,817.86	92,407.34
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	-	-
股利收益	6.4.7.16	581,050.16	810,870.84
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	-4,957,421.14	19,134,761.55
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	3,836.08	69,900.48
<b>减：二、营业总支出</b>		462,049.53	1,053,112.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	264,504.09	740,674.76
2. 托管费	6.4.10.2.2	52,900.83	148,134.97
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		0.03	0.01
8. 其他费用	6.4.7.20	144,644.58	164,302.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-10,362,275.59	-6,118,236.80
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-10,362,275.59	-6,118,236.80
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-10,362,275.59	-6,118,236.80

### 6.3 净资产变动表

会计主体：前海开源中证健康产业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	43,188,329.63	16,641,893.72	59,830,223.35
二、本期期初净资产	43,188,329.63	16,641,893.72	59,830,223.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,970,417.11	-10,862,819.02	-12,833,236.13
（一）、综合收益总额	-	-10,362,275.59	-10,362,275.59
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,970,417.11	-500,543.43	-2,470,960.54
其中：1. 基金申购款	1,932,181.73	507,512.95	2,439,694.68
2. 基金赎回款	-3,902,598.84	-1,008,056.38	-4,910,655.22
（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	41,217,912.52	5,779,074.70	46,996,987.22
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	117,957,117.02	70,844,790.23	188,801,907.25
二、本期期初净资产	117,957,117.02	70,844,790.23	188,801,907.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-74,057,509.56	-49,168,783.91	-
（一）、综合收益总额	-	-6,118,236.80	-6,118,236.80
（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）	-74,057,509.56	-43,050,547.11	-
其中：1. 基金申购款	3,457,735.77	2,063,118.10	5,520,853.87
2. 基金赎回款	-77,515,245.33	-45,113,665.21	-
（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	43,899,607.46	21,676,006.32	65,575,613.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

秦亚峰

王厚琼

傅智

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

前海开源中证健康产业指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金(以下简称“前海开源健康分级基金”)转型而来。根据中国证券监督管理委员会

(以下简称“中国证监会”)[2020]1995号《关于准予前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金变更注册的批复》以及本基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司于2020年11月19日发布的《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，前海开源基金管理有限公司于2020年10月20日起至2020年11月16日以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议通过了《关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》。根据本基金的基金管理人前海开源基金管理有限公司于2020年12月17日发布的《前海开源基金管理有限公司关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金转型后基金名称、基金简称变更的公告》及2020年12月21日发布的《前海开源基金管理有限公司关于前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金份额转换结果的公告》，前海开源健康分级基金以2020年12月17日为基金份额转换基准日，前海开源健康A份额、前海开源健康B份额以前海开源健康分级基础份额在基金份额转换基准日日终的基金份额净值为基准，按照各自的基金份额参考净值转换成本基金基金份额的场内份额，前海开源健康分级份额之场内份额和场外份额自动转换成本基金之场内份额和场外份额。前海开源健康分级基金自2020年12月18日起转型为本基金，经与基金托管人协商一致，基金管理人将《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金合同》修订为《前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金合同》。自2020年12月18日起《前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金基金合同》失效，《前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金合同》自同日起生效。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司，基金托管人为国信证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源中证健康产业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，包括中证健康产业指数的成份股、备选成份股、固定收益资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、质押及买断式回购、银行存款等)、资产支持证券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的相关规定)。本基金的投资组合比例为：投资于中证健康产业指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证健康产业指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率(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》、《前海开源中证健康产业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	1,052,872.01
等于：本金	1,052,528.70
加：应计利息	343.31
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	1,052,872.01

#### 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	64,459,735.65	-	44,415,551.90	-20,044,183.75	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,691,925.00	26,205.62	1,726,545.62	8,415.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,691,925.00	26,205.62	1,726,545.62	8,415.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	66,151,660.65	26,205.62	46,142,097.52	-20,035,768.75	

#### 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

无。

#### 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	15.27
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	13,478.04
其中：交易所市场	13,478.04
银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	40,000.00
预提费用	64,644.58
合计	118,137.89

## 6.4.7.7 实收基金

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	78,528,611.11	43,188,329.63
本期申购	3,513,258.76	1,932,181.73
本期赎回（以“-”号填列）	-7,096,112.29	-3,902,598.84
本期末	74,945,757.58	41,217,912.52

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

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	28,913,366.40	-12,271,472.68	16,641,893.72
本期期初	28,913,366.40	-12,271,472.68	16,641,893.72
本期利润	-5,404,854.45	-4,957,421.14	-10,362,275.59
本期基金份额交易产生的变动数	-1,273,206.50	772,663.07	-500,543.43
其中：基金申购款	1,239,537.61	-732,024.66	507,512.95
基金赎回款	-2,512,744.11	1,504,687.73	-1,008,056.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,235,305.45	-16,456,230.75	5,779,074.70

## 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	7,930.15
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	87.21
其他	81.44
合计	8,098.80

#### 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	12,369,325.05
减：卖出股票成本总额	17,922,243.65
减：交易费用	23,689.22
买卖股票差价收入	-5,576,607.82

#### 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	13,914.49
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	26,903.37
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	40,817.86

##### 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	1,441,145.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,408,597.83
减：应计利息总额	5,587.58
减：交易费用	57.12
买卖债券差价收入	26,903.37

#### 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

无。

## 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	581,050.16
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	581,050.16

## 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	-4,957,421.14
--股票投资	-4,961,161.14
--债券投资	3,740.00
--资产支持证券投资	-
--基金投资	-

—贵金属投资	-
—其他	-
2. 衍生工具	-
—权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-4,957,421.14

#### 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	3,807.19
转换费收入	28.89
合计	3,836.08

#### 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	24,863.02
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
指数使用费	80,000.00
合计	144,644.58

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金”）	基金管理人、基金销售机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
国信证券	17,647,474.48	81.66%	-	-

## 6.4.10.1.2 权证交易

无。

## 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
国信证券	13,536.66	0.95%	-	-

## 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
国信证券	13,162.75	81.66%	13,162.75	97.66%

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	264,504.09	740,674.76
其中：应支付销售机构的客户维护费	72,050.86	94,267.87
应支付基金管理人的净管理费	192,453.23	646,406.89

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 1.00% 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×1.00%/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	52,900.83	148,134.97

注：支付基金托管人国信证券的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

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

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

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

无。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末 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

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，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	1,726,545.62	1,708,895.89
合计	1,726,545.62	1,708,895.89

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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 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上市公司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	1,052,872.01	-	-	-	1,052,872.01
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	8,687.88	-	-	-	8,687.88
交易性金融资产	1,726,545.62	-	-	44,415,551.90	46,142,097.52
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	455,985.85	455,985.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	18,449.11	18,449.11

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,788,105.51	-	-	44,889,986.86	47,678,092.37
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	-	-	-	502,026.78	502,026.78
应付赎回款	-	-	-	11,914.52	11,914.52
应付管理人报酬	-	-	-	40,854.96	40,854.96
应付托管费	-	-	-	8,171.00	8,171.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	118,137.89	118,137.89
负债总计	-	-	-	681,105.15	681,105.15
利率敏感度缺口	2,788,105.51	-	-	44,208,881.71	46,996,987.22
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	1,690,569.58	-	-	-	1,690,569.58
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	42,654.26	-	-	-	42,654.26
交易性金融资产	1,708,895.89	-	-	56,663,304.70	58,372,200.59
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	39,065.22	39,065.22
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	25,974.47	25,974.47
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,442,119.73	-	-	56,728,344.39	60,170,464.12
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	-	-	-	-	-

产款					
应付清算款	-	-	-	80,305.12	80,305.12
应付赎回款	-	-	-	17,661.01	17,661.01
应付管理人报酬	-	-	-	50,974.84	50,974.84
应付托管费	-	-	-	10,194.98	10,194.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	181,104.82	181,104.82
负债总计	-	-	-	340,240.77	340,240.77
利率敏感度缺口	3,442,119.73	-	-	56,388,103.62	59,830,223.35

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	319.04	2,387.66
市场利率上升25个基点	-318.92	-2,381.01	

#### 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	44,415,551.90	94.51	56,663,304.70	94.71
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	44,415,551.90	94.51	56,663,304.70	94.71

#### 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%	2,296,753.94	1,938,454.15
	业绩比较基准下降 5%	-2,296,753.94	-1,938,454.15

### 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	44,415,551.90	56,167,573.70
第二层次	1,726,545.62	2,204,626.89
第三层次	-	-
合计	46,142,097.52	58,372,200.59

#### 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	44,415,551.90	93.16
	其中：股票	44,415,551.90	93.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,726,545.62	3.62
	其中：债券	1,726,545.62	3.62
	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	1,052,872.01	2.21
8	其他各项资产	483,122.84	1.01
9	合计	47,678,092.37	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	4,660,346.90	9.92
B	采矿业	-	-
C	制造业	27,263,006.09	58.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,831,719.52	6.03
E	建筑业	399,007.00	0.85
F	批发和零售业	1,647,665.40	3.51
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	-	-
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	1,782,645.07	3.79
N	水利、环境和公共设施管理业	4,611,646.51	9.81
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,219,515.41	2.59
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	44,415,551.90	94.51

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000538	云南白药	11,113	568,429.95	1.21
2	002252	上海莱士	71,000	555,220.00	1.18
3	300760	迈瑞医疗	1,885	548,365.35	1.17
4	603392	万泰生物	8,105	533,957.40	1.14
5	000598	兴蓉环境	69,600	523,392.00	1.11
6	601200	上海环境	59,800	508,300.00	1.08
7	688208	道通科技	21,000	506,940.00	1.08
8	000895	双汇发展	21,320	506,776.40	1.08
9	688400	凌云光	29,929	499,215.72	1.06
10	603658	安图生物	10,700	492,949.00	1.05
11	601607	上海医药	25,700	491,127.00	1.05
12	002001	新和成	25,473	489,081.60	1.04
13	601033	永兴股份	30,200	488,938.00	1.04
14	600323	瀚蓝环境	23,354	488,098.60	1.04
15	600461	洪城环境	42,113	487,668.54	1.04
16	000035	中国天楹	107,600	487,428.00	1.04
17	603588	高能环境	77,512	486,775.36	1.04
18	300003	乐普医疗	32,800	486,752.00	1.04
19	600475	华光环能	55,000	479,050.00	1.02
20	300138	晨光生物	56,600	477,138.00	1.02
21	300347	泰格医药	9,766	474,627.60	1.01
22	000967	盈峰环境	112,100	474,183.00	1.01
23	601952	苏垦农发	52,496	473,513.92	1.01
24	000685	中山公用	65,500	472,255.00	1.00
25	600887	伊利股份	18,196	470,184.64	1.00
26	600276	恒瑞医药	12,112	465,827.52	0.99
27	300070	碧水源	110,893	464,641.67	0.99
28	600597	光明乳业	59,690	463,791.30	0.99
29	600196	复星医药	20,754	459,493.56	0.98
30	300832	新产业	6,800	458,592.00	0.98
31	300896	爱美客	2,660	457,786.00	0.97
32	600161	天坛生物	18,732	457,060.80	0.97
33	002311	海大集团	9,700	456,385.00	0.97
34	600598	北大荒	36,500	455,885.00	0.97
35	603568	伟明环保	22,133	455,497.14	0.97
36	688114	华大智造	9,556	453,049.96	0.96
37	600873	梅花生物	45,200	452,904.00	0.96

38	002294	信立泰	17,000	452,710.00	0.96
39	600436	片仔癀	2,182	452,044.94	0.96
40	301500	飞南资源	25,900	451,955.00	0.96
41	002422	科伦药业	14,900	451,917.00	0.96
42	600008	首创环保	168,430	451,392.40	0.96
43	003035	南网能源	102,300	450,120.00	0.96
44	600332	白云山	15,335	449,775.55	0.96
45	003039	顺控发展	35,886	449,651.58	0.96
46	002223	鱼跃医疗	11,900	447,440.00	0.95
47	601158	重庆水务	93,200	447,360.00	0.95
48	002714	牧原股份	10,159	442,932.40	0.94
49	300203	聚光科技	43,800	441,942.00	0.94
50	002534	西子洁能	44,104	441,481.04	0.94
51	300119	瑞普生物	32,400	441,288.00	0.94
52	002266	浙富控股	157,906	440,557.74	0.94
53	603100	川仪股份	18,700	439,637.00	0.94
54	600866	星湖科技	79,500	438,840.00	0.93
55	603259	药明康德	11,177	438,026.63	0.93
56	300498	温氏股份	22,100	438,022.00	0.93
57	300761	立华股份	19,280	436,499.20	0.93
58	603662	柯力传感	18,700	436,458.00	0.93
59	688686	奥普特	6,800	435,404.00	0.93
60	300122	智飞生物	15,494	434,296.82	0.92
61	300142	沃森生物	38,073	433,270.74	0.92
62	300140	节能环境	72,400	432,228.00	0.92
63	300601	康泰生物	27,540	429,899.40	0.91
64	603896	寿仙谷	18,300	429,501.00	0.91
65	300087	荃银高科	69,310	428,335.80	0.91
66	000423	东阿阿胶	6,800	425,680.00	0.91
67	000998	隆平高科	43,300	425,639.00	0.91
68	002100	天康生物	61,200	424,116.00	0.90
69	688271	联影医疗	3,858	423,222.60	0.90
70	600085	同仁堂	11,000	420,310.00	0.89
71	300759	康龙化成	22,598	419,870.84	0.89
72	000999	华润三九	9,860	419,838.80	0.89
73	600195	中牧股份	56,032	419,679.68	0.89
74	002299	圣农发展	30,700	418,748.00	0.89
75	002821	凯莱英	6,352	417,961.60	0.89
76	688506	百利天恒	2,300	417,220.00	0.89
77	002041	登海种业	51,500	416,120.00	0.89
78	002946	新乳业	47,401	415,232.76	0.88

79	603882	金域医学	15,267	415,109.73	0.88
80	300015	爱尔眼科	39,799	410,725.68	0.87
81	000930	中粮科技	81,000	407,430.00	0.87
82	000661	长春高新	4,429	406,449.33	0.86
83	600313	农发种业	72,300	404,157.00	0.86
84	002458	益生股份	46,620	403,729.20	0.86
85	603477	巨星农牧	13,999	401,771.30	0.85
86	600882	妙可蓝多	32,100	400,287.00	0.85
87	002663	普邦股份	335,300	399,007.00	0.85
88	002385	大北农	103,600	398,860.00	0.85
89	000963	华东医药	14,300	397,683.00	0.85
90	300094	国联水产	155,800	395,732.00	0.84
91	002603	以岭药业	25,800	395,514.00	0.84
92	301267	华夏眼科	19,000	393,680.00	0.84
93	601118	海南橡胶	86,300	392,665.00	0.84
94	002840	华统股份	23,612	391,723.08	0.83
95	301030	仕净科技	15,700	386,534.00	0.82
96	001269	欧晶科技	13,880	385,864.00	0.82
97	600201	生物股份	53,320	384,437.20	0.82
98	002007	华兰生物	24,017	379,228.43	0.81
99	603939	益丰药房	14,448	354,698.40	0.75
100	300197	节能铁汉	274,000	312,360.00	0.66

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

无。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002840	华统股份	1,109,685.00	1.85
2	688400	凌云光	508,900.29	0.85
3	300138	晨光生物	499,158.00	0.83
4	601033	永兴股份	498,422.00	0.83
5	603662	柯力传感	485,884.00	0.81
6	600866	星湖科技	484,015.00	0.81
7	301500	飞南资源	474,028.00	0.79
8	301030	仕净科技	471,269.00	0.79
9	002223	鱼跃医疗	470,061.00	0.79
10	601158	重庆水务	469,154.00	0.78

11	300119	瑞普生物	467,608.00	0.78
12	688506	百利天恒	463,757.30	0.78
13	000423	东阿阿胶	449,666.00	0.75
14	002663	普邦股份	428,137.00	0.72
15	600461	洪城环境	306,400.81	0.51
16	603882	金域医学	206,563.00	0.35
17	688114	华大智造	206,040.00	0.34
18	300122	智飞生物	196,885.00	0.33
19	300142	沃森生物	196,480.00	0.33
20	603259	药明康德	161,000.00	0.27

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	002840	华统股份	1,222,290.16	2.04
2	600461	洪城环境	596,129.00	1.00
3	000155	川能动力	569,724.00	0.95
4	301175	中科环保	467,013.44	0.78
5	688526	科前生物	455,313.96	0.76
6	688112	鼎阳科技	439,542.77	0.73
7	688180	君实生物	435,420.68	0.73
8	600763	通策医疗	398,848.05	0.67
9	603233	大参林	398,373.80	0.67
10	603566	普莱柯	393,930.00	0.66
11	300072	海新能科	354,860.00	0.59
12	002124	天邦食品	346,005.00	0.58
13	688337	普源精电	332,244.79	0.56
14	300761	立华股份	323,259.00	0.54
15	000598	兴蓉环境	316,583.00	0.53
16	603568	伟明环保	300,770.00	0.50
17	002549	凯美特气	297,906.00	0.50
18	002310	东方园林	280,469.00	0.47
19	601118	海南橡胶	257,056.00	0.43
20	603392	万泰生物	251,193.00	0.42

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	10,635,651.99
卖出股票收入（成交）总额	12,369,325.05

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	1,726,545.62	3.67
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	1,726,545.62	3.67

## 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	17,000	1,726,545.62	3.67

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

无。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,687.88
2	应收清算款	455,985.85
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	18,449.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	483,122.84

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
9,468	7,915.69	188,198.00	0.25%	74,757,559.58	99.75%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	959.59	0.0013%

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年12月18日）基金份额总额	542,709,705.13
本报告期期初基金份额总额	78,528,611.11
本报告期基金总申购份额	3,513,258.76
减：本报告期基金总赎回份额	7,096,112.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	74,945,757.58

## § 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。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期内无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期无托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 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	
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	17,647,474.48	81.66%	13,162.75	81.66%	-
中金财富	2	3,962,236.75	18.34%	2,955.38	18.34%	-

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
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	13,536.66	0.95%	-	-	-	-	-	-
中金财富	1,413,515.08	99.05%	-	-	-	-	-	-

### 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	前海开源中证健康产业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	前海开源中证健康产业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	前海开源中证健康产业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	前海开源中证健康产业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中证健康产业指数型证券投资基金设立的文件
- (2) 《前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源中证健康产业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) 前海开源中证健康产业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

基金管理人或基金托管人处

### 12.3 查阅方式

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

前海开源基金管理有限公司  
2024 年 08 月 30 日