

前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金
2024 年中期报告

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：中国银河证券股份有限公司

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。

基金托管人中国银河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	7
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1	资产负债表	12
6.2	利润表	14
6.3	净资产变动表	15
6.4	报表附注	16
§ 7	投资组合报告	36
7.1	期末基金资产组合情况	36
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51
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	52
7.12	投资组合报告附注	52

§ 8	基金份额持有人信息	53
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2	期末上市基金前十名持有人	54
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
§ 9	开放式基金份额变动	54
§ 10	重大事件揭示	55
10.1	基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4	基金投资策略的改变	55
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
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	57
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	57
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	57
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12	备查文件目录	58
12.1	备查文件目录	58
12.2	存放地点	58
12.3	查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	前海开源中证 500 等权 ETF
场内简称	500 等权 ETF
基金主代码	515590
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 11 月 14 日
基金管理人	前海开源基金管理有限公司
基金托管人	中国银河证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	20,113,665.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 01 月 20 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以采取包括抽样复制在内的其他指数投资技术适当对投资组合管理进行变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> <p>在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>(1) 股票投资组合的构建</p> <p>本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p>(2) 股票投资组合的调整</p> <p>本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况，对其进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差</p>

	<p>最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。</p> <p>2、金融衍生品投资策略</p> <p>本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>3、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金通过对资产支持证券发行条款的分析、违约概率和提前偿付比率的预估，借用必要的数量模型来谋求对资产支持证券的合理定价，在严格控制风险、充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下，谨慎选择风险调整后收益较高的品种进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>4、融资及转融通证券出借业务的投资策略</p> <p>本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。</p> <p>5、未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>
业绩比较基准	中证 500 等权重指数收益率。
风险收益特征	本基金属股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		前海开源基金管理有限公司	中国银河证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙辰健	罗新民
	联系电话	0755-88601888	010-80927820
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	yhzq_tggz@chinastock.com.cn
客户服务电话		4001-666-998	95551; 400-888-8888

传真	0755-83181169	010-80928078
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101
办公地址	深圳市福田区深南大道 7006 号 万科富春东方大厦 2206	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦
邮政编码	518040	100073
法定代表人	李强	王晟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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	-1,177,891.48
本期利润	-2,480,487.68
加权平均基金份额本期利润	-0.1137
本期加权平均净值利润率	-8.82%
本期基金份额净值增长率	-9.40%
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	4,324,947.59
期末可供分配基金份额利润	0.2150
期末基金资产净值	24,438,612.59
期末基金份额净值	1.2150
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	21.50%

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	-6.97%	0.97%	-7.92%	0.99%	0.95%	-0.02%
过去三个月	-6.14%	1.11%	-7.41%	1.13%	1.27%	-0.02%
过去六个月	-9.40%	1.59%	-10.51%	1.60%	1.11%	-0.01%
过去一年	-16.97%	1.25%	-18.07%	1.26%	1.10%	-0.01%
过去三年	-18.58%	1.16%	-22.04%	1.17%	3.46%	-0.01%
自基金合同生效起至今	21.50%	1.21%	5.38%	1.23%	16.12%	-0.02%

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

前海开源基金管理有限公司（以下简称“前海开源基金”）于 2012 年 12 月 27 日经中国证监会批准，2013 年 1 月 23 日注册成立，截至报告期末，注册资本为 2 亿元人民币。其中，开源证券股份有限公司、北京市中盛金期投资管理有限公司、北京长和世纪资产管理有限公司和深圳市和合投信投资合伙企业(有限合伙)各持股权 25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海、广州设立分公司。经中国证监会批准，前海开源基金全资控股子公司——前海开源资产管理有限公司已于 2013 年 9 月 5 日在深圳市注册成立，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 05 月 07 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。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。中证 500 等权重指数上半年下跌 10.51%。本基金下跌 9.40%，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 500 等权重指数 PE (TTM) 约为 21.20 倍，处于上市以来历史分位值约为 12.63%，其相对于十年期国债收益率的风险溢价约为 2.51%，相对吸引力比历史上 98.27% 的时期更高。投资的机会和风险，不仅取决于我们挑选的投资标的，与我们买入的价格也是息息相关的，当前中证 500 等权重指数的投资性价比依然较高。

作为一个被动指数基金，本基金将依然遵循一贯的投资逻辑，力争实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益，并通过参与新股申购、转债套利、期现套利等方式获得超额收益。上半年中证 500 等权重指数进行了定期调整，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中证 500 等权 ETF 基金份额净值为 1.2150 元，本报告期内，基金份额净值增长率为-9.40%，同期业绩比较基准收益率为-10.51%。

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的情形。

本基金从 2023 年 11 月 15 日至 2024 年 01 月 09 日连续 39 个工作日、从 2024 年 01 月 11 日至 2024 年 03 月 12 日连续 38 个工作日、从 2024 年 03 月 14 日至 2024 年 05 月 10 日连续 37 个工作日、从 2024 年 05 月 14 日至 2024 年 06 月 28 日连续 33 个工作日基金资产净值低于五千万元。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人根据《证券投资基金法》等有关法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，对本基金的基金资产净值计算以及利润分配等方面进行了复核审查，对本基金投资范围、投资比例限制、关联方交易、投资风格进行了监督。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，本基金托管人依法复核前海开源基金管理有限公司编制和披露的前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告、投资组合报告等内容，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金
报告截止日：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	474,957.43	1,071,063.67
结算备付金		176,105.10	218,406.12
存出保证金		194,934.49	185,197.11
交易性金融资产	6.4.7.2	23,663,017.77	29,049,471.34
其中：股票投资		23,353,464.16	28,441,580.26
基金投资		-	-
债券投资		309,553.61	607,891.08
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		-	62,168.06
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		24,509,014.79	30,586,306.30
负债和净资产			
	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 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		0.04	68,237.37
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,141.45	3,784.45
应付托管费		1,047.10	1,261.47
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.02	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	66,213.59	857,134.27
负债合计		70,402.20	930,417.56
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	20,113,665.00	22,113,665.00
未分配利润	6.4.7.8	4,324,947.59	7,542,223.74

净资产合计		24,438,612.59	29,655,888.74
负债和净资产总计		24,509,014.79	30,586,306.30

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，前海开源中证 500 等权 ETF 基金份额净值 1.2150 元，基金份额总额 20,113,665.00 份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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		-2,408,670.15	1,789,196.55
1. 利息收入		4,148.38	2,487.73
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,148.38	2,487.73
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,143,585.30	836,294.65
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,405,262.01	401,800.16
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	8,844.49	9,829.69
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	-62,124.41	18,673.44
股利收益	6.4.7.16	314,956.63	405,991.36
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	-1,302,596.20	803,336.29
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	33,362.97	147,077.88
减：二、营业总支出		71,817.53	82,841.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	20,893.11	28,110.25
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,964.22	9,370.03
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		-	67.90
8. 其他费用	6.4.7.20	43,960.20	45,293.63

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,480,487.68	1,706,354.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,480,487.68	1,706,354.74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,480,487.68	1,706,354.74

6.3 净资产变动表

会计主体：前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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	22,113,665.00	7,542,223.74	29,655,888.74
二、本期期初净资产	22,113,665.00	7,542,223.74	29,655,888.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,000,000.00	-3,217,276.15	-5,217,276.15
（一）、综合收益总额	-	-2,480,487.68	-2,480,487.68
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-2,000,000.00	-736,788.47	-2,736,788.47
其中：1. 基金申购款	56,000,000.00	18,016,944.19	74,016,944.19
2. 基金赎回款	-58,000,000.00	-18,753,732.66	-76,753,732.66
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	20,113,665.00	4,324,947.59	24,438,612.59
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	24,113,665.00	9,478,667.07	33,592,332.07
二、本期期初净资产	24,113,665.00	9,478,667.07	33,592,332.07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,000,000.00	2,622,365.36	4,622,365.36
（一）、综合收益总额	-	1,706,354.74	1,706,354.74
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	2,000,000.00	916,010.62	2,916,010.62
其中：1. 基金申购款	32,000,000.00	15,502,491.12	47,502,491.12
2. 基金赎回款	-30,000,000.00	-14,586,480.50	-44,586,480.50
（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	26,113,665.00	12,101,032.43	38,214,697.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

秦亚峰 王厚琼 傅智
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1538 号《关于准予前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由前海开源基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 760,113,665.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0649 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 11 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 760,113,665.00 份,无认购资金利息折份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司,基金托管人为中国银河证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]10 号审核同意,本基金 760,113,665.00 份基金份额于 2020 年 1 月 20 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股。为更好的实现投资目标,可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、政府支持机构债券、政府支持债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:在完成建仓后,投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为:中证 500 等权重指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本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 500 等权重交易型开放式指数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	474,957.43
等于：本金	474,864.38

加：应计利息	93.05
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	474,957.43

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	25,937,805.41	-	23,353,464.16	-2,584,341.25
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	263.61	309,553.61	210.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	263.61	309,553.61	210.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	26,246,885.41	263.61	23,663,017.77	-2,584,131.25

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	1,029,800.00	-	-	-
其中：股指期货投资	1,029,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,029,800.00	-	-	-

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
IC2409	中证 500 股指期货 2409 合约	1.00	975,040.00	-54,760.00
合计				-54,760.00
减：可抵销期货暂收款				-54,760.00
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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	24,442.69
其中：交易所市场	24,442.69
银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	1,989.34
预提费用	39,781.56
合计	66,213.59

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	22,113,665.00	22,113,665.00
本期申购	56,000,000.00	56,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-58,000,000.00	-58,000,000.00
本期末	20,113,665.00	20,113,665.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,241,354.93	-9,699,131.19	7,542,223.74
本期期初	17,241,354.93	-9,699,131.19	7,542,223.74
本期利润	-1,177,891.48	-1,302,596.20	-2,480,487.68
本期基金份额交易产生的变动数	-1,186,286.34	449,497.87	-736,788.47
其中：基金申购款	41,979,622.83	-23,962,678.64	18,016,944.19
基金赎回款	-43,165,909.17	24,412,176.51	-18,753,732.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,877,177.11	-10,552,229.52	4,324,947.59

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	2,992.01
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	618.17
其他	538.20
合计	4,148.38

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资收益--买卖股票差价收入	-1,007,181.49
股票投资收益--赎回差价收入	-398,080.52
股票投资收益--申购差价收入	-
股票投资收益--证券出借差价收入	-
合计	-1,405,262.01

6.4.7.10.2 股票投资收益--买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期

	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	39,900,411.55
减：卖出股票成本总额	40,822,293.34
减：交易费用	85,299.70
买卖股票差价收入	-1,007,181.49

6.4.7.10.3 股票投资收益—赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	76,753,732.66
减：现金支付赎回款总额	31,709,061.66
减：赎回股票成本总额	45,442,751.52
减：交易费用	-
赎回差价收入	-398,080.52

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	3,465.66
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	5,378.83
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	8,844.49

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	1,560,649.88
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,544,015.36
减：应计利息总额	11,253.80
减：交易费用	1.89
买卖债券差价收入	5,378.83

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	-62,124.41

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	314,956.63
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	314,956.63

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	-1,257,716.20
--股票投资	-1,256,254.20
--债券投资	-1,462.00

—资产支持证券投资	-
—基金投资	-
—贵金属投资	-
—其他	-
2. 衍生工具	-44,880.00
—权证投资	-
—期货投资	-44,880.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,302,596.20

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	-
替代损益收入	33,362.97
合计	33,362.97

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.19 信用减值损失

无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	14,918.54
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
指数使用费	4,178.64
合计	43,960.20

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中国银河证券	77,317,986.12	95.85%	59,547,298.01	100.00%

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
中国银河证券	648,134.31	23.57%	1,120,459.73	100.00%

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
中国银河证券	57,671.93	95.85%	21,945.80	89.78%
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
中国银河证券	43,547.38	100.00%	20,630.23	100.00%

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	20,893.11	28,110.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	20,893.11	28,110.25

注：支付基金管理人前海开源基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	6,964.22	9,370.03

注：支付基金托管人中国银河证券的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例
中国银河证 券	3,739,140.00	18.59%	2,937,040.00	13.28%

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113685	升 24 转债	2024 年 06 月 14 日	1 个月内 (含)	新债未上市	100.00	100.01	80	8,000.00	8,000.60	-

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次风险管理架构体系。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，将风险控制可在可承受的范围内。

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	-	603,890.96

合计	-	603,890.96
----	---	------------

注：未评级债券为国债、央票及政策性金融债等。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	8,000.60	4,000.12
未评级	301,553.01	-
合计	309,553.61	4,000.12

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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

本报告期末，除卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资

产)无固定到期日且不计息,因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。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	474,957.43	-	-	-	474,957.43
结算备付金	144,502.02	-	-	31,603.08	176,105.10
存出保证金	77,929.69	-	-	117,004.80	194,934.49
交易性金融资产	301,553.01	-	8,000.60	23,353,464.16	23,663,017.77
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	998,942.15	-	8,000.60	23,502,072.04	24,509,014.79
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	-	-	-	0.04	0.04
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	3,141.45	3,141.45
应付托管费	-	-	-	1,047.10	1,047.10
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.02	0.02
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	66,213.59	66,213.59
负债总计	-	-	-	70,402.20	70,402.20
利率敏感度缺口	998,942.15	-	8,000.60	23,431,669.84	24,438,612.59
上年度末 2023 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	1,071,063.67	-	-	-	1,071,063.67

结算备付金	92,744.23	-	-	125,661.89	218,406.12
存出保证金	55,246.71	-	-	129,950.40	185,197.11
交易性金融资产	603,890.96	-	4,000.12	28,441,580.26	29,049,471.34
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	62,168.06	62,168.06
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,822,945.57	-	4,000.12	28,759,360.61	30,586,306.30
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	-	-	-	68,237.37	68,237.37
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	3,784.45	3,784.45
应付托管费	-	-	-	1,261.47	1,261.47
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	-	-	-	857,134.27	857,134.27
负债总计	-	-	-	930,417.56	930,417.56
利率敏感度缺口	1,822,945.57	-	4,000.12	27,828,943.05	29,655,888.74

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	720.09	1,214.90
市场利率上升 25 个基点	-716.66	-1,210.03	

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币汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 等权重指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，中证 500 等权重指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 90%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	23,353,464.16	95.56	28,441,580.26	95.91
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	23,353,464.16	95.56	28,441,580.26	95.91

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%	1,216,425.21	1,476,225.01
	业绩比较基准下降 5%	-1,216,425.21	-1,476,225.01

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	23,353,464.16	28,441,580.26
第二层次	309,553.61	607,891.08
第三层次	-	-
合计	23,663,017.77	29,049,471.34

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	23,353,464.16	95.29
	其中：股票	23,353,464.16	95.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	309,553.61	1.26
	其中：债券	309,553.61	1.26
	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	651,062.53	2.66
8	其他各项资产	194,934.49	0.80
9	合计	24,509,014.79	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	174,923.00	0.72
B	采矿业	961,823.60	3.94
C	制造业	14,037,672.87	57.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,218,024.02	4.98
E	建筑业	311,850.00	1.28
F	批发和零售业	513,498.52	2.10
G	交通运输、仓储和邮政业	749,873.00	3.07
H	住宿和餐饮业	73,646.00	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,715,696.52	7.02

J	金融业	1,981,346.45	8.11
K	房地产业	329,972.00	1.35
L	租赁和商务服务业	223,201.00	0.91
M	科学研究和技术服务业	250,418.16	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	128,494.02	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	42,534.00	0.17
Q	卫生和社会工作	164,704.00	0.67
R	文化、体育和娱乐业	427,211.00	1.75
S	综合	48,576.00	0.20
	合计	23,353,464.16	95.56

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688617	惠泰医疗	200	91,220.00	0.37
2	688052	纳芯微	800	82,224.00	0.34
3	688169	石头科技	200	78,520.00	0.32
4	688536	思瑞浦	800	78,248.00	0.32
5	688120	华海清科	400	75,832.00	0.31
6	300502	新易盛	700	73,885.00	0.30
7	603225	新凤鸣	4,689	73,101.51	0.30
8	601233	桐昆股份	4,518	72,107.28	0.30
9	600968	海油发展	17,200	70,864.00	0.29
10	601298	青岛港	7,300	69,788.00	0.29
11	002273	水晶光电	4,089	69,431.22	0.28
12	600536	中国软件	2,303	68,905.76	0.28
13	603160	汇顶科技	1,000	68,750.00	0.28
14	300677	英科医疗	2,560	68,633.60	0.28
15	002384	东山精密	3,300	68,310.00	0.28
16	001872	招商港口	3,500	67,375.00	0.28
17	688281	华秦科技	800	66,656.00	0.27

18	601000	唐山港	14,100	66,270.00	0.27
19	603228	景旺电子	2,075	65,985.00	0.27
20	600038	中直股份	1,600	65,776.00	0.27
21	601665	齐鲁银行	13,300	65,303.00	0.27
22	002595	豪迈科技	1,700	64,889.00	0.27
23	300866	安克创新	910	64,801.10	0.27
24	300017	网宿科技	8,200	64,780.00	0.27
25	600066	宇通客车	2,500	64,500.00	0.26
26	600970	中材国际	5,300	63,918.00	0.26
27	002966	苏州银行	8,520	63,900.00	0.26
28	601991	大唐发电	21,200	63,812.00	0.26
29	601717	郑煤机	4,300	63,640.00	0.26
30	688375	国博电子	900	63,576.00	0.26
31	000878	云南铜业	5,100	63,546.00	0.26
32	002155	湖南黄金	3,500	63,350.00	0.26
33	601156	东航物流	3,100	63,085.00	0.26
34	600546	山煤国际	4,300	62,866.00	0.26
35	002156	通富微电	2,800	62,692.00	0.26
36	601231	环旭电子	3,900	62,595.00	0.26
37	002625	光启技术	3,600	62,460.00	0.26
38	600863	内蒙华电	13,400	62,176.00	0.25
39	002738	中矿资源	2,300	61,640.00	0.25
40	688029	南微医学	1,000	61,560.00	0.25
41	002532	天山铝业	7,500	60,825.00	0.25
42	600350	山东高速	6,800	60,180.00	0.25
43	300394	天孚通信	680	60,125.60	0.25
44	601598	中国外运	10,600	59,678.00	0.24
45	688099	晶晨股份	1,000	59,320.00	0.24
46	000830	鲁西化工	5,100	59,109.00	0.24
47	601611	中国核建	7,300	59,057.00	0.24
48	300136	信维通信	3,000	58,740.00	0.24
49	601098	中南传媒	4,700	58,374.00	0.24
50	600529	山东药玻	2,300	58,282.00	0.24
51	000703	恒逸石化	8,200	58,138.00	0.24
52	002608	江苏国信	7,500	58,125.00	0.24
53	002465	海格通信	5,600	58,016.00	0.24
54	600521	华海药业	3,400	57,970.00	0.24
55	601179	中国西电	7,200	57,888.00	0.24
56	600582	天地科技	8,400	57,876.00	0.24
57	603786	科博达	900	57,735.00	0.24
58	002429	兆驰股份	12,000	57,720.00	0.24

59	600177	雅戈尔	8,100	57,672.00	0.24
60	001286	陕西能源	5,000	57,650.00	0.24
61	600901	江苏金租	11,400	57,570.00	0.24
62	601168	西部矿业	3,200	57,440.00	0.24
63	600873	梅花生物	5,700	57,114.00	0.23
64	600820	隧道股份	8,700	56,811.00	0.23
65	002432	九安医疗	1,400	56,756.00	0.23
66	601128	常熟银行	7,480	56,623.60	0.23
67	600839	四川长虹	12,600	56,574.00	0.23
68	601577	长沙银行	6,900	56,442.00	0.23
69	688772	珠海冠宇	3,786	56,411.40	0.23
70	002223	鱼跃医疗	1,500	56,400.00	0.23
71	600801	华新水泥	4,100	56,375.00	0.23
72	600021	上海电力	5,700	56,373.00	0.23
73	600096	云天化	2,900	56,318.00	0.23
74	688390	固德威	1,000	56,120.00	0.23
75	002281	光迅科技	1,500	56,055.00	0.23
76	688107	安路科技	2,200	55,924.00	0.23
77	600282	南钢股份	11,200	55,776.00	0.23
77	600348	华阳股份	5,600	55,776.00	0.23
79	000027	深圳能源	7,620	55,626.00	0.23
80	600377	宁沪高速	4,400	55,440.00	0.23
81	688188	柏楚电子	300	55,365.00	0.23
82	000683	远兴能源	8,000	55,280.00	0.23
83	000400	许继电气	1,600	55,056.00	0.23
84	688200	华峰测控	600	55,050.00	0.23
85	002138	顺络电子	2,000	54,920.00	0.22
86	600699	均胜电子	3,700	54,834.00	0.22
87	600062	华润双鹤	2,800	54,824.00	0.22
88	601928	凤凰传媒	5,000	54,800.00	0.22
89	300251	光线传媒	6,500	54,665.00	0.22
90	002563	森马服饰	9,400	54,614.00	0.22
91	300373	扬杰科技	1,400	54,460.00	0.22
92	600060	海信视像	2,200	54,428.00	0.22
93	603338	浙江鼎力	900	54,378.00	0.22
94	300001	特锐德	2,700	54,324.00	0.22
95	000937	冀中能源	8,100	54,270.00	0.22
96	000960	锡业股份	3,500	54,215.00	0.22
97	002673	西部证券	8,700	53,853.00	0.22
98	002831	裕同科技	2,100	53,739.00	0.22
99	601077	渝农商行	10,700	53,714.00	0.22

100	603606	东方电缆	1,100	53,691.00	0.22
101	002756	永兴材料	1,500	53,670.00	0.22
102	603444	吉比特	300	53,403.00	0.22
103	002670	国盛金控	6,300	53,361.00	0.22
104	002739	万达电影	4,400	53,196.00	0.22
105	603156	养元饮品	2,500	53,175.00	0.22
106	002508	老板电器	2,400	53,040.00	0.22
107	002353	杰瑞股份	1,500	52,620.00	0.22
108	002423	中粮资本	7,000	52,430.00	0.21
109	600563	法拉电子	687	52,335.66	0.21
110	600131	国网信通	3,100	52,297.00	0.21
111	600418	江淮汽车	3,300	52,272.00	0.21
112	002572	索菲亚	3,400	52,122.00	0.21
113	000513	丽珠集团	1,400	52,094.00	0.21
114	002958	青农商行	19,400	51,992.00	0.21
115	603529	爱玛科技	1,900	51,927.00	0.21
116	601118	海南橡胶	11,400	51,870.00	0.21
117	000563	陕国投 A	18,800	51,700.00	0.21
118	300529	健帆生物	1,900	51,699.00	0.21
119	603379	三美股份	1,320	51,664.80	0.21
120	689009	九号公司	1,400	51,534.00	0.21
121	000887	中鼎股份	4,200	51,408.00	0.21
122	688525	佰维存储	800	51,320.00	0.21
123	600879	航天电子	6,600	51,282.00	0.21
124	603056	德邦股份	3,900	51,090.00	0.21
125	601866	中远海发	19,800	51,084.00	0.21
126	600885	宏发股份	1,840	50,931.20	0.21
127	605358	立昂微	2,200	50,908.00	0.21
128	000728	国元证券	8,400	50,904.00	0.21
129	600498	烽火通信	3,200	50,880.00	0.21
130	600398	海澜之家	5,500	50,820.00	0.21
131	002185	华天科技	6,200	50,530.00	0.21
132	002409	雅克科技	800	50,328.00	0.21
133	002152	广电运通	4,800	50,208.00	0.21
134	688516	奥特维	1,200	50,172.00	0.21
135	000423	东阿阿胶	800	50,080.00	0.20
136	600549	厦门钨业	2,900	50,025.00	0.20
137	300009	安科生物	5,855	50,001.70	0.20
138	000709	河钢股份	25,700	49,858.00	0.20
139	600956	新天绿能	6,100	49,837.00	0.20
140	000630	铜陵有色	13,800	49,818.00	0.20

141	600580	卧龙电驱	4,100	49,815.00	0.20
142	603596	伯特利	1,280	49,792.00	0.20
143	600155	华创云信	8,400	49,644.00	0.20
144	600299	安迪苏	5,100	49,470.00	0.20
145	002019	亿帆医药	4,000	49,440.00	0.20
146	688180	君实生物	1,700	49,385.00	0.20
147	600765	中航重机	2,420	49,368.00	0.20
148	600995	南网储能	5,100	49,266.00	0.20
149	688017	绿的谐波	600	49,260.00	0.20
150	000060	中金岭南	11,600	49,184.00	0.20
151	600380	健康元	4,400	49,148.00	0.20
152	600378	昊华科技	1,700	49,130.00	0.20
153	002653	海思科	1,600	49,120.00	0.20
154	002340	格林美	7,700	49,049.00	0.20
155	600707	彩虹股份	7,200	49,032.00	0.20
156	600988	赤峰黄金	3,000	49,020.00	0.20
157	601058	赛轮轮胎	3,500	49,000.00	0.20
158	600483	福能股份	4,200	48,972.00	0.20
159	600352	浙江龙盛	5,700	48,963.00	0.20
160	002078	太阳纸业	3,500	48,825.00	0.20
161	600361	创新新材	12,100	48,763.00	0.20
162	600598	北大荒	3,900	48,711.00	0.20
163	600497	驰宏锌锗	9,100	48,594.00	0.20
164	600673	东阳光	6,900	48,576.00	0.20
165	600642	申能股份	5,500	48,565.00	0.20
166	002128	电投能源	2,300	48,530.00	0.20
167	000155	川能动力	4,500	48,465.00	0.20
168	603816	顾家家居	1,500	48,435.00	0.20
169	300253	卫宁健康	8,200	48,380.00	0.20
170	601666	平煤股份	4,318	48,361.60	0.20
171	002797	第一创业	9,500	48,355.00	0.20
172	002439	启明星辰	2,800	48,328.00	0.20
173	000783	长江证券	10,000	48,300.00	0.20
174	600153	建发股份	5,400	48,222.00	0.20
175	000831	中国稀土	1,900	48,165.00	0.20
176	000883	湖北能源	8,000	48,080.00	0.20
177	600895	张江高科	2,600	48,048.00	0.20
178	688248	南网科技	1,620	48,000.60	0.20
179	000988	华工科技	1,600	47,888.00	0.20
180	688387	信科移动	9,500	47,880.00	0.20
181	600583	海油工程	8,100	47,871.00	0.20

182	600271	航天信息	6,500	47,840.00	0.20
183	600535	天士力	3,800	47,804.00	0.20
184	301165	锐捷网络	1,600	47,744.00	0.20
185	300054	鼎龙股份	2,100	47,628.00	0.19
186	688002	睿创微纳	1,700	47,549.00	0.19
187	300212	易华录	2,820	47,460.60	0.19
188	688114	华大智造	1,000	47,410.00	0.19
189	000598	兴蓉环境	6,300	47,376.00	0.19
190	603893	瑞芯微	800	47,336.00	0.19
191	603650	彤程新材	1,600	47,280.00	0.19
192	688561	奇安信	2,000	47,240.00	0.19
193	002373	千方科技	5,204	47,200.28	0.19
194	688348	昱能科技	800	47,200.00	0.19
195	603486	科沃斯	1,000	47,180.00	0.19
196	001203	大中矿业	4,900	47,089.00	0.19
197	601608	中信重工	12,350	47,053.50	0.19
198	000932	华菱钢铁	10,600	46,958.00	0.19
199	002444	巨星科技	1,900	46,930.00	0.19
200	688172	燕东微	2,900	46,922.00	0.19
201	688234	天岳先进	1,000	46,920.00	0.19
202	002939	长城证券	7,000	46,900.00	0.19
203	600435	北方导航	5,440	46,892.80	0.19
204	600985	淮北矿业	2,800	46,872.00	0.19
205	601958	金钼股份	4,500	46,845.00	0.19
206	002028	思源电气	700	46,830.00	0.19
207	000537	中绿电	4,900	46,697.00	0.19
208	603568	伟明环保	2,269	46,696.02	0.19
209	000039	中集集团	5,040	46,670.40	0.19
210	000933	神火股份	2,300	46,529.00	0.19
211	002261	拓维信息	4,200	46,494.00	0.19
212	000032	深桑达 A	3,100	46,438.00	0.19
212	600704	物产中大	10,700	46,438.00	0.19
214	603087	甘李药业	1,000	46,320.00	0.19
215	002372	伟星新材	3,000	46,260.00	0.19
216	002558	巨人网络	4,900	46,256.00	0.19
217	300058	蓝色光标	8,500	46,240.00	0.19
218	600511	国药股份	1,500	46,185.00	0.19
219	000738	航发控制	2,300	46,161.00	0.19
220	603658	安图生物	1,000	46,070.00	0.19
221	002518	科士达	2,600	46,020.00	0.19
222	600373	中文传媒	3,100	46,004.00	0.19

223	002936	郑州银行	26,567	45,960.91	0.19
224	601966	玲珑轮胎	2,500	45,925.00	0.19
225	300296	利亚德	10,200	45,900.00	0.19
226	002064	华峰化学	6,400	45,888.00	0.19
227	002984	森麒麟	1,900	45,771.00	0.19
228	002008	大族激光	2,200	45,760.00	0.19
229	000636	风华高科	3,500	45,710.00	0.19
230	601567	三星医疗	1,300	45,500.00	0.19
231	603979	金诚信	900	45,477.00	0.19
232	601139	深圳燃气	6,800	45,424.00	0.19
233	600528	中铁工业	6,200	45,384.00	0.19
234	601198	东兴证券	5,700	45,372.00	0.19
235	002414	高德红外	7,700	45,353.00	0.19
236	002294	信立泰	1,700	45,271.00	0.19
237	600906	财达证券	7,900	45,267.00	0.19
238	600516	方大炭素	10,500	45,255.00	0.19
239	300114	中航电测	1,000	45,250.00	0.19
240	600871	石化油服	26,000	45,240.00	0.19
241	300567	精测电子	800	45,208.00	0.18
242	600867	通化东宝	5,400	45,198.00	0.18
243	603298	杭叉集团	2,300	45,172.00	0.18
244	600755	厦门国贸	6,300	45,171.00	0.18
245	688301	奕瑞科技	392	45,170.16	0.18
246	688538	和辉光电	22,800	45,144.00	0.18
247	002368	太极股份	2,000	45,100.00	0.18
248	601555	东吴证券	7,640	45,076.00	0.18
249	600737	中粮糖业	4,700	45,073.00	0.18
250	002867	周大生	3,450	45,057.00	0.18
251	300776	帝尔激光	980	45,040.80	0.18
252	688220	翱捷科技	1,200	44,952.00	0.18
253	601108	财通证券	6,800	44,948.00	0.18
254	688425	铁建重工	12,200	44,896.00	0.18
255	300002	神州泰岳	5,500	44,660.00	0.18
256	000825	太钢不锈	13,200	44,616.00	0.18
257	000750	国海证券	15,330	44,610.30	0.18
258	603345	安井食品	600	44,586.00	0.18
259	000997	新大陆	3,200	44,512.00	0.18
260	688063	派能科技	1,120	44,475.20	0.18
261	601016	节能风电	14,850	44,401.50	0.18
262	000623	吉林敖东	3,310	44,354.00	0.18
263	300748	金力永磁	3,420	44,323.20	0.18

264	000958	电投产融	12,100	44,286.00	0.18
265	601997	贵阳银行	8,400	44,268.00	0.18
266	601162	天风证券	20,300	44,254.00	0.18
267	300699	光威复材	1,780	44,197.40	0.18
268	600098	广州发展	6,900	44,160.00	0.18
269	002153	石基信息	7,704	44,143.92	0.18
270	002268	电科网安	3,100	44,113.00	0.18
271	600578	京能电力	13,600	44,064.00	0.18
272	002472	双环传动	2,000	44,040.00	0.18
273	300438	鹏辉能源	2,400	44,016.00	0.18
274	000519	中兵红箭	3,000	44,010.00	0.18
275	300390	天华新能	2,560	43,980.80	0.18
276	603000	人民网	2,200	43,978.00	0.18
277	601858	中国科传	2,300	43,976.00	0.18
278	601965	中国汽研	2,600	43,914.00	0.18
279	300595	欧普康视	2,800	43,904.00	0.18
280	600141	兴发集团	2,300	43,884.00	0.18
281	003022	联泓新科	3,200	43,872.00	0.18
282	300487	蓝晓科技	1,050	43,848.00	0.18
283	601019	山东出版	3,700	43,734.00	0.18
284	603707	健友股份	3,680	43,718.40	0.18
285	002497	雅化集团	4,900	43,708.00	0.18
285	300601	康泰生物	2,800	43,708.00	0.18
287	300803	指南针	1,200	43,692.00	0.18
288	600032	浙江新能	6,000	43,680.00	0.18
289	601228	广州港	14,300	43,615.00	0.18
290	600004	白云机场	4,600	43,608.00	0.18
291	600008	首创环保	16,264	43,587.52	0.18
292	002244	滨江集团	6,000	43,560.00	0.18
293	000778	新兴铸管	12,500	43,500.00	0.18
294	300568	星源材质	5,300	43,460.00	0.18
295	600859	王府井	3,700	43,438.00	0.18
296	000739	普洛药业	3,200	43,424.00	0.18
296	600157	永泰能源	36,800	43,424.00	0.18
296	601615	明阳智能	4,600	43,424.00	0.18
299	002408	齐翔腾达	7,740	43,344.00	0.18
299	002436	兴森科技	4,200	43,344.00	0.18
301	300012	华测检测	4,300	43,258.00	0.18
302	600763	通策医疗	800	43,240.00	0.18
303	603179	新泉股份	1,100	43,164.00	0.18
304	600392	盛和资源	5,004	43,134.48	0.18

305	603589	口子窖	1,100	43,109.00	0.18
306	601212	白银有色	15,500	43,090.00	0.18
307	688779	长远锂科	9,300	43,059.00	0.18
308	600339	中油工程	13,800	43,056.00	0.18
309	603290	斯达半导	500	43,055.00	0.18
310	002195	岩山科技	17,100	42,921.00	0.18
311	603127	昭衍新药	3,228	42,835.56	0.18
312	600816	建元信托	15,800	42,818.00	0.18
313	000785	居然之家	17,600	42,768.00	0.18
314	600416	湘电股份	4,300	42,742.00	0.17
315	300070	碧水源	10,200	42,738.00	0.17
316	601158	重庆水务	8,900	42,720.00	0.17
317	600022	山东钢铁	35,000	42,700.00	0.17
318	601696	中银证券	4,700	42,676.00	0.17
319	688295	中复神鹰	2,100	42,630.00	0.17
320	300861	美畅股份	2,200	42,570.00	0.17
320	600170	上海建工	19,800	42,570.00	0.17
322	002624	完美世界	5,600	42,560.00	0.17
323	688276	百克生物	1,500	42,555.00	0.17
324	300682	朗新集团	5,000	42,550.00	0.17
325	000559	万向钱潮	9,540	42,548.40	0.17
326	002607	中公教育	27,800	42,534.00	0.17
327	603456	九洲药业	3,100	42,532.00	0.17
328	300207	欣旺达	2,800	42,476.00	0.17
329	300357	我武生物	2,100	42,462.00	0.17
330	601933	永辉超市	17,100	42,408.00	0.17
331	000723	美锦能源	8,900	42,364.00	0.17
332	601399	国机重装	16,400	42,312.00	0.17
333	600143	金发科技	6,400	42,304.00	0.17
334	002557	洽洽食品	1,500	42,285.00	0.17
335	301236	软通动力	1,200	42,252.00	0.17
336	300383	光环新网	5,000	42,250.00	0.17
337	002926	华西证券	6,400	42,176.00	0.17
338	000539	粤电力 A	8,300	42,164.00	0.17
339	601216	君正集团	11,400	42,066.00	0.17
340	002044	美年健康	11,100	41,958.00	0.17
341	000818	航锦科技	1,900	41,952.00	0.17
342	688005	容百科技	1,800	41,904.00	0.17
343	300088	长信科技	8,900	41,830.00	0.17
344	601880	辽港股份	34,000	41,820.00	0.17
345	600486	扬农化工	740	41,773.00	0.17

346	002025	航天电器	900	41,742.00	0.17
347	601155	新城控股	4,700	41,689.00	0.17
348	002202	金风科技	6,200	41,664.00	0.17
349	000959	首钢股份	15,300	41,616.00	0.17
350	000987	越秀资本	8,390	41,614.40	0.17
351	600325	华发股份	6,400	41,600.00	0.17
352	601990	南京证券	5,400	41,472.00	0.17
353	688777	中控技术	1,100	41,470.00	0.17
354	600663	陆家嘴	4,700	41,454.00	0.17
355	601456	国联证券	4,300	41,452.00	0.17
356	301267	华夏眼科	2,000	41,440.00	0.17
357	600566	济川药业	1,300	41,223.00	0.17
358	600928	西安银行	12,600	41,202.00	0.17
359	000031	大悦城	17,600	41,184.00	0.17
360	300073	当升科技	1,200	41,172.00	0.17
361	002056	横店东磁	3,300	41,151.00	0.17
362	300118	东方日升	3,400	41,140.00	0.17
363	300474	景嘉微	650	41,099.50	0.17
364	000401	冀东水泥	10,100	41,006.00	0.17
365	600848	上海临港	4,500	40,995.00	0.17
366	688475	萤石网络	1,200	40,932.00	0.17
367	002299	圣农发展	3,000	40,920.00	0.17
368	300024	机器人	4,200	40,908.00	0.17
369	600390	五矿资本	10,100	40,905.00	0.17
370	002407	多氟多	3,340	40,848.20	0.17
371	600872	中炬高新	1,800	40,842.00	0.17
372	601828	美凯龙	16,000	40,800.00	0.17
373	000050	深天马 A	5,600	40,768.00	0.17
374	600517	国网英大	9,400	40,702.00	0.17
375	000729	燕京啤酒	4,600	40,618.00	0.17
376	688819	天能股份	1,700	40,562.00	0.17
377	603826	坤彩科技	1,400	40,558.00	0.17
378	600369	西南证券	11,300	40,454.00	0.17
379	603317	天味食品	3,542	40,414.22	0.17
380	300765	新诺威	1,600	40,368.00	0.17
381	002262	恩华药业	1,700	40,358.00	0.17
382	600967	内蒙一机	5,600	40,320.00	0.16
383	600056	中国医药	3,980	40,277.60	0.16
384	002240	盛新锂能	3,000	40,260.00	0.16
384	002683	广东宏大	2,000	40,260.00	0.16
386	603728	鸣志电器	1,000	40,230.00	0.16

387	000156	华数传媒	6,400	40,192.00	0.16
388	600481	双良节能	8,600	40,162.00	0.16
389	688521	芯原股份	1,500	40,125.00	0.16
390	000898	鞍钢股份	18,900	40,068.00	0.16
391	603218	日月股份	3,900	40,053.00	0.16
392	603517	绝味食品	2,600	40,040.00	0.16
393	603712	七一二	2,200	40,018.00	0.16
394	600118	中国卫星	1,800	40,014.00	0.16
395	001227	兰州银行	16,800	39,984.00	0.16
396	300395	菲利华	1,300	39,975.00	0.16
397	002500	山西证券	8,500	39,950.00	0.16
398	000967	盈峰环境	9,400	39,762.00	0.16
399	600079	人福医药	2,300	39,491.00	0.16
400	002120	韵达股份	5,100	39,474.00	0.16
401	600925	苏能股份	7,800	39,390.00	0.16
402	688520	神州细胞	1,000	39,350.00	0.16
403	603185	弘元绿能	2,300	39,307.00	0.16
404	600298	安琪酵母	1,400	39,102.00	0.16
405	000591	太阳能	8,300	39,093.00	0.16
406	600754	锦江酒店	1,700	39,066.00	0.16
407	002266	浙富控股	14,000	39,060.00	0.16
407	300558	贝达药业	1,200	39,060.00	0.16
409	002487	大金重工	1,700	38,896.00	0.16
410	688331	荣昌生物	900	38,880.00	0.16
411	600329	达仁堂	1,200	38,868.00	0.16
412	003031	中瓷电子	840	38,841.60	0.16
412	300037	新宙邦	1,360	38,841.60	0.16
414	688213	思特威	800	38,800.00	0.16
415	600977	中国电影	3,600	38,736.00	0.16
416	000921	海信家电	1,200	38,688.00	0.16
417	300003	乐普医疗	2,600	38,584.00	0.16
418	600739	辽宁成大	4,600	38,502.00	0.16
419	002690	美亚光电	2,330	38,445.00	0.16
420	603868	飞科电器	1,000	38,400.00	0.16
420	688567	孚能科技	4,000	38,400.00	0.16
422	002865	钧达股份	1,000	38,380.00	0.16
423	002507	涪陵榨菜	3,130	38,342.50	0.16
424	688122	西部超导	1,000	38,320.00	0.16
425	600637	东方明珠	6,300	38,304.00	0.16
426	002850	科达利	500	38,190.00	0.16
427	603883	老百姓	2,075	38,097.00	0.16

428	603882	金域医学	1,400	38,066.00	0.16
429	603305	旭升集团	3,600	38,016.00	0.16
430	600808	马钢股份	18,800	37,976.00	0.16
431	600909	华安证券	9,020	37,974.20	0.16
432	300724	捷佳伟创	700	37,807.00	0.15
433	000021	深科技	2,500	37,800.00	0.15
434	301358	湖南裕能	1,200	37,752.00	0.15
435	301029	怡合达	1,920	37,747.20	0.15
436	688385	复旦微电	1,200	37,656.00	0.15
437	600862	中航高科	2,000	37,560.00	0.15
438	002203	海亮股份	4,700	37,506.00	0.15
439	300285	国瓷材料	2,100	37,485.00	0.15
440	300763	锦浪科技	900	37,476.00	0.15
441	003035	南网能源	8,500	37,400.00	0.15
442	603885	吉祥航空	3,400	37,366.00	0.15
443	600764	中国海防	1,900	37,297.00	0.15
444	603077	和邦生物	22,600	37,290.00	0.15
445	688349	三一重能	1,500	37,260.00	0.15
446	600126	杭钢股份	9,060	37,236.60	0.15
447	600499	科达制造	4,400	37,092.00	0.15
448	002568	百润股份	2,200	37,026.00	0.15
449	603688	石英股份	1,250	37,012.50	0.15
450	688153	唯捷创芯	1,000	37,000.00	0.15
451	600109	国金证券	4,900	36,995.00	0.15
452	000009	中国宝安	4,300	36,980.00	0.15
453	603927	中科软	2,044	36,975.96	0.15
454	600959	江苏有线	14,000	36,960.00	0.15
455	600095	湘财股份	6,199	36,946.04	0.15
456	002945	华林证券	3,700	36,926.00	0.15
457	600827	百联股份	5,000	36,900.00	0.15
458	600998	九州通	7,499	36,595.12	0.15
459	600316	洪都航空	2,200	36,586.00	0.15
460	600166	福田汽车	16,200	36,450.00	0.15
461	603858	步长制药	2,400	36,360.00	0.15
462	688065	凯赛生物	800	36,312.00	0.15
463	000066	中国长城	4,100	35,875.00	0.15
464	002065	东华软件	7,900	35,708.00	0.15
465	600927	永安期货	3,200	35,680.00	0.15
466	000893	亚钾国际	2,200	35,552.00	0.15
467	603737	三棵树	980	35,544.60	0.15
468	002506	协鑫集成	18,300	35,502.00	0.15

469	601636	旗滨集团	5,500	35,475.00	0.15
470	603939	益丰药房	1,440	35,352.00	0.14
471	300146	汤臣倍健	2,600	35,230.00	0.14
472	300676	华大基因	1,000	35,010.00	0.14
473	300888	稳健医疗	1,380	34,914.00	0.14
473	600612	老凤祥	600	34,914.00	0.14
475	600500	中化国际	10,000	34,900.00	0.14
475	688006	杭可科技	2,000	34,900.00	0.14
477	601106	中国一重	15,100	34,881.00	0.14
478	002080	中材科技	2,700	34,830.00	0.14
479	600129	太极集团	1,200	34,704.00	0.14
480	600258	首旅酒店	2,800	34,580.00	0.14
481	000629	钒钛股份	13,800	34,500.00	0.14
482	002517	恺英网络	3,600	34,380.00	0.14
483	688778	厦钨新能	1,100	34,364.00	0.14
484	600399	抚顺特钢	6,100	34,343.00	0.14
485	688032	禾迈股份	298	34,204.44	0.14
486	600655	豫园股份	6,600	33,990.00	0.14
487	600315	上海家化	1,900	33,782.00	0.14
488	300144	宋城演艺	4,200	33,726.00	0.14
489	601568	北元集团	9,030	33,501.30	0.14
490	000998	隆平高科	3,400	33,422.00	0.14
491	002430	杭氧股份	1,500	33,375.00	0.14
492	002531	天顺风能	3,700	33,078.00	0.14
493	688297	中无人机	1,000	33,030.00	0.14
494	300604	长川科技	1,200	32,604.00	0.13
495	600884	杉杉股份	4,000	32,480.00	0.13
496	601992	金隅集团	23,200	31,784.00	0.13
497	002385	大北农	8,200	31,570.00	0.13
498	600208	新潮中宝	19,900	31,442.00	0.13
499	002791	坚朗五金	1,200	31,044.00	0.13
500	603233	大参林	2,116	30,258.80	0.12

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	300394	天孚通信	335,363.00	1.13
2	300866	安克创新	242,522.50	0.82
3	002850	科达利	236,619.00	0.80
4	002463	沪电股份	232,199.00	0.78
5	000933	神火股份	223,998.00	0.76
6	002865	钧达股份	220,391.00	0.74
7	300474	景嘉微	214,180.00	0.72
8	000513	丽珠集团	214,143.00	0.72
9	000400	许继电气	212,841.00	0.72
10	002223	鱼跃医疗	205,165.00	0.69
11	002738	中矿资源	203,960.00	0.69
12	003031	中瓷电子	203,570.00	0.69
13	002128	电投能源	200,697.00	0.68
14	002078	太阳纸业	196,145.00	0.66
15	300677	英科医疗	195,321.00	0.66
16	002595	豪迈科技	194,608.00	0.66
17	300724	捷佳伟创	193,497.00	0.65
18	002155	湖南黄金	191,260.00	0.64
19	000883	湖北能源	187,304.00	0.63
20	000598	兴蓉环境	185,929.01	0.63

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	300394	天孚通信	390,642.00	1.32
2	002463	沪电股份	341,499.00	1.15
3	000933	神火股份	278,833.00	0.94
4	000975	银泰黄金	266,547.40	0.90
5	002128	电投能源	257,505.00	0.87
6	300866	安克创新	254,026.00	0.86
7	002850	科达利	248,420.00	0.84
8	000400	许继电气	246,253.00	0.83
9	002422	科伦药业	241,915.00	0.82
10	002032	苏泊尔	233,865.00	0.79
11	002078	太阳纸业	233,219.00	0.79
12	000513	丽珠集团	222,055.00	0.75
13	000598	兴蓉环境	219,628.00	0.74
14	002281	光迅科技	219,439.00	0.74

15	000630	铜陵有色	218,388.00	0.74
16	000883	湖北能源	218,039.00	0.74
17	300502	新易盛	216,318.00	0.73
18	002028	思源电气	215,017.00	0.73
19	000581	威孚高科	213,219.00	0.72
20	002223	鱼跃医疗	212,292.00	0.72

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	40,802,785.90
卖出股票收入（成交）总额	39,900,411.55

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	301,553.01	1.23
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）	8,000.60	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	309,553.61	1.27

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	019706	23 国债 13	3,000	301,553.01	1.23
2	113685	升 24 转债	80	8,000.60	0.03

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金运用股指期货交易的原则是，在流动性较好和投资期限适当的合约上安排比例适当的头寸，以降低对市场的冲击并减少交易成本，根据市场流动性状况及投资需求，分时段执行展期交易，在交易过程中，对投资组合的风险状况持续监控。具体而言，当前对股指期货交易主要用以获得股指期货的基差收敛收益，并利用股指期货的杠杆效应保留部分现金以避免跨市场 ETF 的尾盘赎回风险。考虑到本基金跟踪的中证 500 等权重指数与 IC 合约跟踪的中证 500 指数存在一定的偏离，我们会根据实际情况对成分股持仓进行调整，以达到更好的跟踪等权指数的目的。我们还会重点关注调整后的成分券数量是否满足 ETF 的赎回上限要求，以尽量避免赎回风险。

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	194,934.49
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	194,934.49

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
516	38,979.97	7,877,032.00	39.16%	12,236,633.00	60.84%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国银河证券股份有限公司	3,739,140.00	18.59%
2	中信建投证券股份有限公司	2,605,004.00	12.95%
3	中信证券股份有限公司	913,588.00	4.54%
4	海通证券股份有限公司	570,800.00	2.84%
5	杨建中	422,500.00	2.10%
6	蒋祖逸	400,000.00	1.99%
7	刘百荣	317,000.00	1.58%
8	施庆道	300,000.00	1.49%
9	顾宁	245,433.00	1.22%
10	罗兰珍	204,000.00	1.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年11月14日）基金份额 总额	760,113,665.00
本报告期期初基金份额总额	22,113,665.00
本报告期基金总申购份额	56,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	58,000,000.00

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	20,113,665.00

§ 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。

本报告期内无涉及托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	托管人
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 01 月 11 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	被出具警示函行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原	公司在开展私募基金产品相关业务过程中托管人履职尽责存在瑕

因	疵。
管理人采取整改措施的情况 (如提出整改意见)	公司对监管措施认定的相关问题进行全面梳理排查,进一步强化代销管理,优化制度建设、完善决策机制、加强合规风控;同时,公司进一步强化托管人职责的履行,持续健全并严格执行托管准入制度,完善系统流程建设,加强风险管控,勤勉尽责维护投资者利益。
其他	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	
方正证券	2	3,347,616.63	4.15%	2,496.89	4.15%	-
中国银河证券	6	77,317,986.12	95.85%	57,671.93	95.85%	-

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

方正证券	2,101,640.00	76.43%	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	648,134.31	23.57%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2024年01月22日
2	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金新增部分申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2024年03月07日
3	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
4	前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024年03月30日
5	前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2024年04月22日
6	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
7	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
8	前海开源基金管理有限公司关于前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2024年05月30日
9	前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新（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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

机构	1	20240109- 20240109, 2024031 3- 20240313, 2024051 3-20240513	1, 775, 208. 00	26, 236, 700. 00	25, 406, 904. 00	2, 605, 004. 0 0	12. 95%
	2	20240514- 20240516, 2024052 3-20240526	2, 937, 040. 00	14, 812, 400. 00	14, 010, 300. 00	3, 739, 140. 0 0	18. 59%
产品特有风险							
<p>1. 大额赎回风险 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的大额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>2. 终止基金合同的风险 个别投资者大额赎回后，若本基金连续 55 个工作日出现基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会，其他投资者可能面临相应风险；</p> <p>3. 流动性风险 单一投资者大额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；</p> <p>4. 大额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- (2) 《前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (3) 《前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (5) 前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金在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，客户服务热线：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