

前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：中国银河证券股份有限公司

送出日期：2026 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

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

1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
3.3	过去三年基金的利润分配情况	9
§4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6	审计报告	15
6.1	审计报告基本信息	15
6.2	审计报告的基本内容	15
§7	年度财务报表	17
7.1	资产负债表	17
7.2	利润表	18
7.3	净资产变动表	19
7.4	报表附注	20
§8	投资组合报告	49
8.1	期末基金资产组合情况	49
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	49
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	50
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	62
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	64
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	64
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	64

8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	65
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	65
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	65
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
8.12	投资组合报告附注	65
§9	基金份额持有人信息	66
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
9.2	期末上市基金前十名持有人	67
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
9.4	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	67
§10	开放式基金份额变动	68
§11	重大事件揭示	68
11.1	基金份额持有人大会决议	68
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	68
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4	基金投资策略的改变	68
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	68
11.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	68
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
11.8	其他重大事件	70
§12	影响投资者决策的其他重要信息	72
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	72
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	73
§13	备查文件目录	73
13.1	备查文件目录	73
13.2	存放地点	73
13.3	查阅方式	73

§ 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	500ETF50 (扩位证券简称: 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	38,113,665.00 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</p>

	<p>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>2、金融衍生品投资策略 本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性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 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 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
	联系电话	0755-88601888
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com
		罗新民
		010-80927820
		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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.qhkyfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	13,522,789.72	-2,879,617.25	-1,655,145.85
本期利润	21,035,698.44	959,611.02	-1,321,304.00
加权平均基金份额本期利润	0.4908	0.0386	-0.0519
本期加权平均净值利润率	30.93%	2.95%	-3.59%
本期基金份额净值增长率	29.47%	5.95%	-3.73%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	31,999,099.45	16,882,431.18	7,542,223.74
期末可供分配基金份额利润	0.8396	0.4209	0.3411
期末基金资产净值	70,112,764.45	56,996,096.18	29,655,888.74
期末基金份额净值	1.8396	1.4209	1.3411
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	83.96%	42.09%	34.11%

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

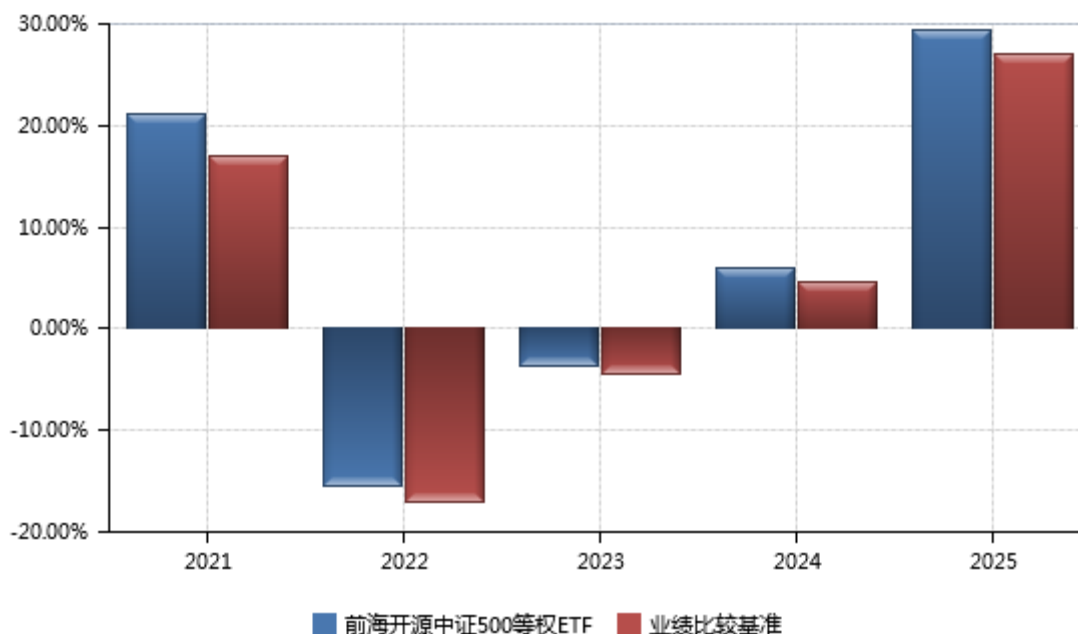
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	1.15%	1.14%	0.84%	1.13%	0.31%	0.01%
过去六个月	24.00%	1.08%	22.85%	1.07%	1.15%	0.01%
过去一年	29.47%	1.19%	27.14%	1.19%	2.33%	0.00%
过去三年	32.05%	1.34%	27.24%	1.35%	4.81%	-0.01%
过去五年	35.08%	1.26%	23.56%	1.27%	11.52%	-0.01%
自基金合同生效起至今	83.96%	1.30%	56.71%	1.31%	27.25%	-0.01%

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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至报告期末，前海开源基金旗下管理 110 只开放式基金，资产管理规模超过 979 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

梁溥森	本基金的基金经理	2020 年 05 月 07 日	-	11 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。
孔芳	本基金的基金经理	2025 年 11 月 18 日	-	15 年	孔芳女士，北京语言大学学士。2010 年 7 月至 2020 年 11 月任职于中衍期货有限公司，历任研究员、产品经理、投资经理、投资咨询部主管等职务；2020 年 11 月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司基金经理。

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

②证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，针对股票市场、债券市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个

环节，制定了《前海开源基金管理有限公司公平交易管理办法》、《前海开源基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合投资策略需要，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 1 次。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年，A 股呈现先抑后扬的稳健走势。上半年，指数通过两轮 V 型行情逐步凝聚市场信心，持续已久的悲观情绪逐步消散。在宏观政策一揽子稳市“组合拳”的精准发力下，市场快速摆脱中美贸易摩擦的不利影响，中证 500 等权重指数三季度单季暴涨超过 21%，创下 2020 年以来最佳单季度表现。急涨之后，市场回归理性，四季度以盘整态势等待基本面进一步修复。全年维度看，中证 500 等权重指数累计上涨 27.14%，本基金同期上涨 29.47%，表现优于业绩比较基准，且创下了本基金自成立以来的最大年涨幅。

展望后市，从全球金融大背景来看，尽管美联储降息的具体路径随美国经济数据波动仍存不确定性，但当前美国联邦基金利率仍维持在 3.50%-3.75% 的高位，距离美联储 3% 的长期利率目标尚有较大下行空间；加之美联储换届在即，特朗普多次释放倾向于任命更积极推动降息的新主席的信号，因此 2026 年美联储延续降息周期仍是全球金融市场的较为确定的方向之一。在美联储降息大周期下，作为全球风险资产定价锚的美国无风险利率将同步下行，以中国为代表的新兴市场及权益资产有望持续受益。从国内宏观政策来看，2026 年是“十五五”规划的开局之年，肩负“开好

局、起好步”的重要使命。2025 年 12 月中央经济工作会议明确提出，2026 年将“实施更加积极有为的宏观政策”，推动扩内需与优供给协同发力，形成更加积极的财政政策与适度宽松的货币政策的合力。从估值模型来看，分子端企业盈利改善与分母端贴现率下行的双重利好，有望持续提升股市投资价值；从资本市场生态来看，国内股票市场基础制度建设持续完善，上市公司治理水平稳步提升，股东回报机制愈发健全。参考美国资本市场 40-60 年代的发展历程，公司治理的完善将推动市场估值中枢抬升，中国股票市场的可投资性显著增强。叠加“长钱长投”等机制的落地完善，以及打破刚兑、低利率环境下“存款搬家”大趋势的延续，资金对权益市场的新增需求有望进一步推动 A 股估值中枢上行。从性价比维度考量，中国股市仍具备较高投资价值。截至 2025 年 12 月 31 日，中证 500 等权重指数 PE (TTM) 约为 33.8 倍，处于上市以来历史分位值约为 78.49%，其相对于十年期国债收益率的风险溢价约为 1.11%，相对吸引力比历史上 63.44% 的时期更高。总体来看，经过一年多的持续慢牛行情，本指数的估值修复到了合理区间，但尚未进入显著高估区间。基于我们对政策托举下我国经济基本面恢复的信心，以及对 A 股和本指数投资标的中长期的信心，我们认为本指数仍有较高的投资性价比。

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。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 500 等权 ETF 基金份额净值为 1.8396 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 29.47%，同期业绩比较基准收益率为 27.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前美国联邦基金利率相较于长期中性利率仍存在显著下行空间；同时，美联储即将迎来换帅窗口，美国总统特朗普多次释放信号，倾向于任命更积极推动降息的新主席。这一系列信号持续强化了市场对 2026 年美联储宽松周期延续的共识，以中国为代表的新兴市场及权益资产有望持续受益。在此背景下，中美利差倒挂幅度有望进一步收窄，人民币汇率或迎来小幅升值，我国货币政策面临的外部约束有望持续缓解。

2025 年 12 月中央经济工作会议明确提出，明年将“实施更加积极有为的宏观政策”，推动扩

内需与优供给协同发力，形成更加积极的财政政策与适度宽松的货币政策的合力。2026 年作为“十五五”规划的开局之年，肩负着“开好局、起好步”的重要使命。回顾历史，自“十五”规划以来，每一个五年规划的开局之年，均伴随重大项目集中开工、宏观政策密集出台，财政发力力度多呈边际扩张态势，有望为实体经济提供坚实支撑。货币政策方面，中央经济工作会议明确要求将“促进经济稳定增长、物价合理回升”作为重要考量，且当前我国实际利率仍处于相对高位，宽松仍是货币政策主基调，总量适度、结构宽松的特征有望在 2026 年延续。

在政策持续发力的背景下，2026 年 A 股业绩有望进一步改善。一方面，反内卷进入实质性落地阶段，价格-利润传导机制有望修复；另一方面，中美关系趋缓，有望带动我国出口链企业盈利增速边际改善。与此同时，国内外资本有望进一步向 A 股市场集聚。具体来看：其一，跨境资本有望回流。美联储降息周期开启叠加中美关系趋缓，而 A 股在全球风险资产中的性价比优势显著，有望吸引跨境资本流入；其二，居民资产配置转向利好权益类资产。当前债券收益率降至近二十年低位，房地产价格连续五年回落，而 A 股分红率与股息率相对较高，两融余额屡创新高，财富效应逐步凸显；从 A 股市值与居民储蓄的比率来看，A 股仍处于相对低配状态，资产荒背景下增量资金有望持续流入；其三，中长期资金入市将提供稳定增量。在《关于推动中长期资金入市工作的实施方案》《关于推动中长期资金入市的指导意见》等相关政策及制度体系推动下，机构资金持续加码 A 股投资，为市场提供稳定且可量化的长期筹码。基于此，我们依然长期看好 A 股市场的整体表现。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

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

(2) 本年度，公司按照证监会的要求对公司治理、投资、研究、交易、基金会计、注册登记、人力资源、基金销售等主要业务进行定期稽核工作。同时，对信息技术、用户权限、通信管理

与视频监控、基金直销、后台运营、内幕交易防控等相关业务开展了专项稽核工作，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性等。

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本基金从 2025 年 05 月 22 日至 2025 年 06 月 24 日连续 23 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，基金托管人根据《证券投资基金法》等有关法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，对本基金的基金资产净值计算以及利润分配等方面进行了复核审查，对本基金的投资范围、投资比例、投资限制等方面进行了监督，未发现存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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 2025 年年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2026）审字第 70048283_H10 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以

	及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能

	<p>涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	高鹤 邓雯
会计师事务所的地址	北京市东城区长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
审计报告日期	2026 年 03 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	700,365.29	346,287.98
结算备付金		392,982.85	129,176.32
存出保证金		278,037.20	226,485.82
交易性金融资产	7.4.7.2	68,869,118.67	56,273,418.72
其中：股票投资		68,459,656.56	55,767,101.73
基金投资		-	-
债券投资		409,462.11	506,316.99

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	96,107.98
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		70,240,504.01	57,071,476.82
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末
		2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.06	46,280.02
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,004.28	7,488.51
应付托管费		3,001.44	2,496.18
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,328.41	1,056.93
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	106,405.37	18,059.00
负债合计		127,739.56	75,380.64
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	38,113,665.00	40,113,665.00
未分配利润	7.4.7.8	31,999,099.45	16,882,431.18
净资产合计		70,112,764.45	56,996,096.18
负债和净资产总计		70,240,504.01	57,071,476.82

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，前海开源中证 500 等权 ETF 基金份额净值 1.8396 元，基金份额总额 38,113,665.00 份。

7.2 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：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		21,302,926.76	1,092,780.42
1. 利息收入		7,432.53	8,190.31
其中：存款利息收入	7.4.7.9	7,432.53	8,190.31
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）		13,687,700.41	-3,017,826.73
其中：股票投资收益	7.4.7.10	12,389,731.82	-3,667,533.56
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	27,574.23	12,676.48
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	328,430.55	142,240.75
股利收益	7.4.7.16	941,963.81	494,789.60
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	7,512,908.72	3,839,228.27
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	94,885.10	263,188.57
减：二、营业总支出		267,228.32	133,169.40
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	101,492.27	48,688.58
2. 托管费	7.4.10.2.2	33,830.74	16,229.44
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		1,183.04	513.64
8. 其他费用	7.4.7.20	130,722.27	67,737.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,035,698.44	959,611.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,035,698.44	959,611.02
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		21,035,698.44	959,611.02

7.3 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：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	40,113,665.00	16,882,431.18	56,996,096.18
二、本期期初净资产	40,113,665.00	16,882,431.18	56,996,096.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,000,000.00	15,116,668.27	13,116,668.27
（一）、综合收益总额	-	21,035,698.44	21,035,698.44
（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	-5,919,030.17	-7,919,030.17
其中：1. 基金申购款	52,000,000.00	27,569,658.96	79,569,658.96
2. 基金赎回款	-54,000,000.00	-33,488,689.13	-87,488,689.13
（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	38,113,665.00	31,999,099.45	70,112,764.45
项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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）	18,000,000.00	9,340,207.44	27,340,207.44
（一）、综合收益总额	-	959,611.02	959,611.02
（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）	18,000,000.00	8,380,596.42	26,380,596.42
其中：1. 基金申购款	130,000,000.00	35,486,775.26	165,486,775.26
2. 基金赎回款	-112,000,000.00	-27,106,178.84	-139,106,178.84
（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	40,113,665.00	16,882,431.18	56,996,096.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

秦亚峰

王厚琼

傅智

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

前海开源中证 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。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

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

报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

允价值变动计入当期损益。

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

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

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：（1）赋予基金份额持有人在基金清算时按比

例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

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

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

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分

利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

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

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的非标的指数成份股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

(1) 增值税及附加

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

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

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

（2）企业所得税

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

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

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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

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

（4）印花税（如适用）

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

（5）境外投资

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
活期存款	700,365.29	346,287.98
等于：本金	700,195.64	346,203.11
加：应计利息	169.65	84.87
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	700,365.29	346,287.98

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2025 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	58,731,834.62	-	68,459,656.56	9,727,821.94	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	404,300.00	4,462.11	409,462.11	700.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	404,300.00	4,462.11	409,462.11	700.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	59,136,134.62	4,462.11	68,869,118.67	9,728,521.94	
项目	上年度末				
	2024 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	53,237,943.51	-	55,767,101.73	2,529,158.22	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	500,675.00	5,466.99	506,316.99	175.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	500,675.00	5,466.99	506,316.99	175.00
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	53,738,618.51	5,466.99	56,273,418.72	2,529,333.22

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	1,186,000.00	-	-	-
其中：股指期货投资	1,186,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,186,000.00	-	-	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 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	1,161,480.00	-	-	-
其中：股指期货投资	1,161,480.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,161,480.00	-	-	-

7.4.7.3.2 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
IC2603	中证500股指期货2603合约	1.00	1,473,320.00	287,320.00
合计				287,320.00
减：可抵销期货暂收款				287,320.00
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	6,405.37	6,654.81
其中：交易所市场	6,405.37	6,654.81
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付指数使用费	-	3,404.19
预提费用	100,000.00	8,000.00
合计	106,405.37	18,059.00

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	40,113,665.00	40,113,665.00
本期申购	52,000,000.00	52,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-54,000,000.00	-54,000,000.00
本期末	38,113,665.00	38,113,665.00

7.4.7.8 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	26,857,766.98	-9,975,335.80	16,882,431.18
本期期初	26,857,766.98	-9,975,335.80	16,882,431.18

本期利润	13,522,789.72	7,512,908.72	21,035,698.44
本期基金份额交易产生的变动数	-3,579,498.75	-2,339,531.42	-5,919,030.17
其中：基金申购款	38,373,600.64	-10,803,941.68	27,569,658.96
基金赎回款	-41,953,099.39	8,464,410.26	-33,488,689.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,801,057.95	-4,801,958.50	31,999,099.45

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
活期存款利息收入	7,025.45	5,637.67
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	203.64	1,208.86
其他	203.44	1,343.78
合计	7,432.53	8,190.31

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025 年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至 2024年12月31日
股票投资收益--买卖股票差价收入	8,140,311.89	-1,130,050.07
股票投资收益--赎回差价收入	4,249,419.93	-2,537,483.49
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	12,389,731.82	-3,667,533.56

7.4.7.10.2 股票投资收益--买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	63,370,479.74	78,376,545.51
减：卖出股票成本总额	55,164,401.24	79,377,411.71
减：交易费用	65,766.61	129,183.87
买卖股票差价收入	8,140,311.89	-1,130,050.07

7.4.7.10.3 股票投资收益--赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	87,488,689.13	139,106,178.84
减：现金支付赎回款总额	34,133,488.13	56,666,105.84
减：赎回股票成本总额	49,105,781.07	84,977,556.49
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	4,249,419.93	-2,537,483.49

7.4.7.11 基金投资收益

无。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
债券投资收益--利息收入	6,009.75	6,525.34
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	21,564.48	6,151.14
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	27,574.23	12,676.48

7.4.7.12.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	907,864.92	2,213,567.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	876,445.64	2,189,000.77
减：应计利息总额	9,842.93	18,411.97
减：交易费用	11.87	3.64
买卖债券差价收入	21,564.48	6,151.14

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益—买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益—其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	328,430.55	142,240.75

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	941,963.81	494,789.60
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	941,963.81	494,789.60

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

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

1. 交易性金融资产	7,199,188.72	3,855,748.27
--股票投资	7,198,663.72	3,857,245.27
--债券投资	525.00	-1,497.00
--资产支持证券投资	-	-
--基金投资	-	-
--贵金属投资	-	-
--其他	-	-
2. 衍生工具	313,720.00	-16,520.00
--权证投资	-	-
--期货投资	313,720.00	-16,520.00
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	7,512,908.72	3,839,228.27

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年01月01日至2025年12月31日	2024年01月01日至2024年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益收入	94,885.10	263,188.57
合计	94,885.10	263,188.57

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。

7.4.7.19 信用减值损失

无。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年01月01日至2025年12月31日	2024年01月01日至2024年12月31日
审计费用	20,000.00	8,000.00
信息披露费	80,000.00	50,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	30,722.27	9,737.74
合计	130,722.27	67,737.74

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金”）	基金管理人、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
开源证券股份有限公司（“开源证券”）	基金管理人的股东
北京长和世纪资产管理有限公司	基金管理人的股东
北京市中盛金期投资管理有限公司	基金管理人的股东
深圳市和合投信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
前海开源资产管理有限公司	基金管理人的子公司
前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“前海开源中证 500 等权 ETF 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	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	126,125,514.42	100.00%	168,530,407.15	98.05%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	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	895,596.98	100.00%	2,094,788.98	49.92%

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日			
	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	25,973.20	100.00%	6,405.37	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期 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	76,454.69	96.84%	6,654.81	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。权证交易不计佣金。

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。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，针对被动股票型基金佣金协议的服务范围不包括研究服务、流动性服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	101,492.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	10,500.17	1,829.60
应支付基金管理人的净管理费	90,992.10	46,858.98

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	33,830.74	16,229.44

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2019 年 11 月 14 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	21,194,900.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	21,194,900.00

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	21,194,900.00	21,194,900.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	55.61%	52.84%

注：基金管理人前海开源基金投资本基金的交易委托广发证券股份有限公司办理，适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例
中国银河证 券	114,540.00	0.30%	114,540.00	0.29%
前海开源中 证 500 等权 ETF 联接	5,467,100.00	14.34%	-	-

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

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

无。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
118063	金 05 转债	2025 年 12 月 25 日	1 个月内 (含)	新债未上市	100.00	100.00	50	5,000.00	5,000.08	

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	404,462.03	506,316.99
合计	404,462.03	506,316.99

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。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	5,000.08	-
合计	5,000.08	-

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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

本报告期末，除卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通

暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	700,365.29	-	-	-	700,365.29
结算备付金	42,158.63	-	-	350,824.22	392,982.85
存出保证金	101,238.80	-	-	176,798.40	278,037.20

交易性金融资产	404,462.03	-	5,000.08	68,459,656.56	68,869,118.67
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	1,248,224.75	-	5,000.08	68,987,279.18	70,240,504.01
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	-	-	-	0.06	0.06
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	9,004.28	9,004.28
应付托管费	-	-	-	3,001.44	3,001.44
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	9,328.41	9,328.41
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	106,405.37	106,405.37
负债总计	-	-	-	127,739.56	127,739.56
利率敏感度缺口	1,248,224.75	-	5,000.08	68,859,539.62	70,112,764.45
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	346,287.98	-	-	-	346,287.98
结算备付金	89,772.49	-	-	39,403.83	129,176.32
存出保证金	90,276.22	-	-	136,209.60	226,485.82
交易性金融资产	506,316.99	-	-	55,767,101.73	56,273,418.72
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	96,107.98	96,107.98
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,032,653.68	-	-	56,038,823.14	57,071,476.82
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	-	-	-	46,280.02	46,280.02
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	7,488.51	7,488.51
应付托管费	-	-	-	2,496.18	2,496.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,056.93	1,056.93
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	18,059.00	18,059.00
负债总计	-	-	-	75,380.64	75,380.64
利率敏感度缺口	1,032,653.68	-	-	55,963,442.50	56,996,096.18

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	41.56	398.15
	市场利率上升 25 个基点	-41.55	-397.53

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	68,459,656.56	97.64	55,767,101.73	97.84
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	68,459,656.56	97.64	55,767,101.73	97.84

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注 7.4.7.3）。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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	3,730,264.40	2,845,109.09
业绩比较基准下降 5%	-3,730,264.40	-2,845,109.09	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	68,459,656.56	55,767,101.73
第二层次	409,462.11	506,316.99
第三层次	-	-
合计	68,869,118.67	56,273,418.72

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

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

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	68,459,656.56	97.46
	其中：股票	68,459,656.56	97.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	409,462.11	0.58
	其中：债券	409,462.11	0.58
	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	1,093,348.14	1.56
8	其他各项资产	278,037.20	0.40
9	合计	70,240,504.01	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	388,869.00	0.55
B	采矿业	2,619,329.06	3.74
C	制造业	44,655,929.37	63.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,803,916.90	4.00
E	建筑业	763,588.00	1.09
F	批发和零售业	1,423,289.60	2.03
G	交通运输、仓储和邮政业	1,898,964.00	2.71
H	住宿和餐饮业	131,404.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,882,078.34	6.96
J	金融业	4,665,104.46	6.65

K	房地产业	787,067.00	1.12
L	租赁和商务服务业	703,209.00	1.00
M	科学研究和技术服务业	776,182.80	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	514,668.22	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	143,576.00	0.20
Q	卫生和社会工作	225,270.81	0.32
R	文化、体育和娱乐业	935,901.00	1.33
S	综合	141,309.00	0.20
	合计	68,459,656.56	97.64

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 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	300136	信维通信	4,600	285,200.00	0.41
2	600118	中国卫星	2,800	265,860.00	0.38
3	600879	航天电子	12,000	255,840.00	0.36
4	603444	吉比特	600	254,310.00	0.36
5	000559	万向钱潮	13,640	234,608.00	0.33
6	688387	信科移动	18,100	233,490.00	0.33
7	002202	金风科技	10,600	216,240.00	0.31
8	301611	珂玛科技	2,500	214,325.00	0.31
9	688027	国盾量子	400	201,516.00	0.29
10	600699	均胜电子	6,200	194,432.00	0.28
11	300604	长川科技	1,900	192,489.00	0.27
12	002837	英维克	1,800	192,402.00	0.27
13	300058	蓝色光标	16,700	192,384.00	0.27
14	688172	燕东微	6,557	189,759.58	0.27
15	000703	恒逸石化	17,600	189,552.00	0.27
16	002429	兆驰股份	25,300	187,726.00	0.27
17	000893	亚钾国际	3,900	187,083.00	0.27
18	000878	云南铜业	9,100	186,641.00	0.27

19	003031	中瓷电子	2,540	185,826.40	0.27
20	300857	协创数据	1,100	185,548.00	0.26
21	300751	迈为股份	900	185,391.00	0.26
22	002756	永兴材料	3,400	184,450.00	0.26
23	688361	中科飞测	1,200	183,588.00	0.26
24	002414	高德红外	12,500	183,375.00	0.26
25	600392	盛和资源	8,504	183,091.12	0.26
26	600498	烽火通信	5,700	182,856.00	0.26
27	002683	广东宏大	3,800	181,640.00	0.26
28	002472	双环传动	3,800	180,158.00	0.26
29	601168	西部矿业	6,500	179,660.00	0.26
30	603225	新凤鸣	9,189	178,817.94	0.26
31	603179	新泉股份	2,400	177,312.00	0.25
32	688568	中科星图	3,000	177,000.00	0.25
33	600141	兴发集团	5,100	176,358.00	0.25
34	000830	鲁西化工	10,600	175,642.00	0.25
35	603659	璞泰来	6,400	174,976.00	0.25
36	002064	华峰化学	15,900	174,900.00	0.25
37	002430	杭氧股份	5,800	173,246.00	0.25
38	600487	亨通光电	7,000	173,110.00	0.25
39	688017	绿的谐波	900	172,890.00	0.25
40	300285	国瓷材料	6,300	172,683.00	0.25
41	300037	新宙邦	3,294	172,605.60	0.25
42	688318	财富趋势	1,300	172,016.00	0.25
43	601231	环旭电子	5,700	171,000.00	0.24
44	300395	菲利华	1,700	170,510.00	0.24
45	000933	神火股份	6,200	170,314.00	0.24
46	300223	北京君正	1,600	169,664.00	0.24
47	300073	当升科技	2,900	167,620.00	0.24
48	688375	国博电子	1,800	167,598.00	0.24
49	601233	桐昆股份	9,718	167,246.78	0.24
50	603129	春风动力	600	167,208.00	0.24
51	688166	博瑞医药	3,400	166,804.00	0.24
52	601212	白银有色	28,500	166,725.00	0.24
53	601399	国机重装	34,800	166,344.00	0.24
54	002738	中矿资源	2,100	164,955.00	0.24
55	600884	杉杉股份	12,200	164,822.00	0.24
56	600096	云天化	4,900	163,709.00	0.23
57	688615	合合信息	713	162,264.54	0.23
58	002851	麦格米特	1,800	162,126.00	0.23
59	002156	通富微电	4,300	162,110.00	0.23

60	603298	杭叉集团	6,100	162,077.00	0.23
61	688235	百济神州	600	161,160.00	0.23
62	000683	博源化工	21,600	160,704.00	0.23
63	002595	豪迈科技	1,900	160,569.00	0.23
64	688608	恒玄科技	700	158,858.00	0.23
65	002056	横店东磁	8,100	157,950.00	0.23
66	600208	衢州发展	40,800	157,896.00	0.23
67	601611	中国核建	11,700	157,716.00	0.22
68	002465	海格通信	10,000	157,500.00	0.22
69	601696	中银证券	10,500	157,395.00	0.22
70	688772	珠海冠宇	7,286	156,867.58	0.22
71	688295	中复神鹰	4,774	156,634.94	0.22
72	601179	中国西电	17,200	156,520.00	0.22
73	300373	扬杰科技	2,300	156,400.00	0.22
74	600977	中国电影	9,900	155,628.00	0.22
75	600765	中航重机	8,120	155,579.20	0.22
76	688469	芯联集成	23,200	155,208.00	0.22
77	600329	达仁堂	3,400	155,108.00	0.22
78	300567	精测电子	1,700	155,040.00	0.22
79	601198	东兴证券	11,100	154,068.00	0.22
80	002532	天山铝业	9,500	153,710.00	0.22
81	603486	科沃斯	1,900	153,292.00	0.22
82	601608	中信重工	23,250	153,217.50	0.22
83	605358	立昂微	4,400	153,208.00	0.22
84	002444	巨星科技	4,500	153,090.00	0.22
85	603379	三美股份	2,520	153,014.40	0.22
86	688248	南网科技	3,420	153,010.80	0.22
87	300919	中伟股份	3,300	152,889.00	0.22
88	601958	金钼股份	9,800	152,684.00	0.22
89	603979	金诚信	2,000	152,300.00	0.22
90	000021	深科技	6,000	151,680.00	0.22
91	600363	联创光电	2,400	151,344.00	0.22
92	688002	睿创微纳	1,500	151,200.00	0.22
93	688347	华虹公司	1,400	151,018.00	0.22
94	002340	格林美	18,000	150,480.00	0.21
95	603737	三棵树	3,252	150,470.04	0.21
96	600095	湘财股份	13,599	150,404.94	0.21
97	002203	海亮股份	11,869	150,261.54	0.21
98	688120	华海清科	1,000	150,080.00	0.21
99	601106	中国一重	37,600	150,024.00	0.21
100	688122	西部超导	2,000	149,160.00	0.21

101	002624	完美世界	9,100	149,149.00	0.21
102	601615	明阳智能	10,300	149,144.00	0.21
103	300207	欣旺达	5,700	149,055.00	0.21
104	000959	首钢股份	30,400	148,960.00	0.21
105	000825	太钢不锈	30,400	148,656.00	0.21
106	603786	科博达	1,900	148,390.00	0.21
107	600580	卧龙电驱	3,020	148,282.00	0.21
108	002409	雅克科技	2,000	148,200.00	0.21
109	600549	厦门钨业	3,600	147,816.00	0.21
110	688385	复旦微电	2,000	147,400.00	0.21
111	688709	成都华微	3,200	147,168.00	0.21
112	600378	昊华科技	4,600	147,016.00	0.21
113	001389	广合科技	1,800	146,934.00	0.21
114	600497	驰宏锌锗	20,100	146,931.00	0.21
115	301308	江波龙	600	146,904.00	0.21
116	002281	光迅科技	2,100	146,895.00	0.21
117	300054	鼎龙股份	3,900	146,640.00	0.21
118	600862	中航高科	6,200	146,506.00	0.21
119	000887	中鼎股份	6,300	146,223.00	0.21
120	603650	彤程新材	3,300	145,662.00	0.21
121	002025	航天电器	2,900	145,377.00	0.21
122	300390	天华新能	2,660	145,262.60	0.21
123	603228	景旺电子	1,982	144,864.38	0.21
124	002670	国盛证券	8,600	144,824.00	0.21
125	000987	越秀资本	17,790	144,810.60	0.21
126	600801	华新建材	5,900	144,786.00	0.21
127	600499	科达制造	10,400	144,248.00	0.21
128	000831	中国稀土	3,100	143,964.00	0.21
129	601156	东航物流	7,800	143,598.00	0.20
130	002607	中公教育	52,400	143,576.00	0.20
131	002195	岩山科技	20,200	143,218.00	0.20
132	300627	华测导航	4,100	143,131.00	0.20
132	600316	洪都航空	4,100	143,131.00	0.20
134	002558	巨人网络	3,300	142,857.00	0.20
135	300763	锦浪科技	2,000	142,820.00	0.20
136	000738	航发控制	6,700	142,777.00	0.20
137	000039	中集集团	14,140	142,672.60	0.20
138	603596	伯特利	2,780	142,530.60	0.20
139	601717	中创智领	5,800	142,390.00	0.20
140	688100	威胜信息	3,623	142,383.90	0.20
141	002261	拓维信息	4,300	142,330.00	0.20

142	688234	天岳先进	1,600	142,208.00	0.20
143	002850	科达利	900	142,074.00	0.20
144	688702	盛科通信	1,000	141,690.00	0.20
145	600885	宏发股份	4,656	141,542.40	0.20
146	002223	鱼跃医疗	3,700	141,377.00	0.20
147	603568	伟明环保	5,569	141,341.22	0.20
148	000657	中钨高新	5,100	141,321.00	0.20
149	600673	东阳光	6,300	141,309.00	0.20
150	300699	光威复材	3,580	141,266.80	0.20
151	603156	养元饮品	4,900	140,875.00	0.20
152	000623	吉林敖东	7,210	140,811.30	0.20
153	300972	万辰集团	700	140,749.00	0.20
154	600143	金发科技	7,200	140,688.00	0.20
155	603920	世运电路	2,900	140,389.00	0.20
156	603699	纽威股份	2,700	140,319.00	0.20
157	688629	华丰科技	1,400	140,084.00	0.20
158	002008	大族激光	3,400	140,046.00	0.20
159	300757	罗博特科	600	139,980.00	0.20
160	002131	利欧股份	24,800	139,872.00	0.20
161	300115	长盈精密	3,000	139,500.00	0.20
162	688065	凯赛生物	2,800	139,440.00	0.20
163	000960	锡业股份	5,000	139,400.00	0.20
164	300487	蓝晓科技	2,250	138,937.50	0.20
165	000426	兴业银锡	3,900	138,840.00	0.20
166	000997	新大陆	4,900	138,768.00	0.20
167	000967	盈峰环境	18,900	138,726.00	0.20
168	003022	联泓新科	7,000	138,670.00	0.20
169	300432	富临精工	8,300	138,610.00	0.20
170	600295	鄂尔多斯	11,200	138,432.00	0.20
171	002080	中材科技	3,800	138,092.00	0.20
172	000060	中金岭南	23,600	138,060.00	0.20
173	600637	东方明珠	14,000	137,900.00	0.20
174	600435	北方导航	8,940	137,854.80	0.20
175	688525	佰维存储	1,200	137,748.00	0.20
176	603606	东方电缆	2,300	137,425.00	0.20
177	300346	南大光电	3,200	137,280.00	0.20
178	002185	华天科技	12,500	137,125.00	0.20
179	603885	吉祥航空	9,200	136,896.00	0.20
180	600848	上海临港	11,700	136,890.00	0.20
181	003021	兆威机电	1,100	136,598.00	0.19
182	688018	乐鑫科技	800	136,000.00	0.19

183	600737	中粮糖业	7,900	135,959.00	0.19
184	603338	浙江鼎力	2,400	135,936.00	0.19
185	605589	圣泉集团	4,800	135,840.00	0.19
186	601577	长沙银行	14,000	135,800.00	0.19
187	002939	长城证券	13,300	135,660.00	0.19
188	600562	国睿科技	4,800	135,648.00	0.19
189	002517	恺英网络	6,200	135,594.00	0.19
190	688676	金盘科技	1,500	135,510.00	0.19
191	002273	水晶光电	5,389	135,371.68	0.19
192	600704	物产中大	24,300	135,351.00	0.19
193	603816	顾家家居	4,400	135,256.00	0.19
194	000582	北部湾港	14,400	135,072.00	0.19
195	600563	法拉电子	1,287	135,070.65	0.19
196	002138	顺络电子	3,800	135,014.00	0.19
197	300450	先导智能	2,700	134,946.00	0.19
198	601665	齐鲁银行	23,500	134,890.00	0.19
199	002157	正邦科技	41,600	134,784.00	0.19
200	300100	双林股份	3,400	134,708.00	0.19
201	688778	厦钨新能	1,740	134,623.80	0.19
202	002353	杰瑞股份	1,900	134,577.00	0.19
203	688297	中无人机	2,800	134,456.00	0.19
204	688563	航材股份	2,300	134,435.00	0.19
205	600536	中国软件	2,903	134,408.90	0.19
206	603077	和邦生物	59,400	134,244.00	0.19
207	601061	中信金属	9,300	133,920.00	0.19
208	300724	捷佳伟创	1,400	133,840.00	0.19
209	600038	中直股份	3,700	133,681.00	0.19
210	000783	长江证券	16,400	133,660.00	0.19
211	300002	神州泰岳	11,600	133,632.00	0.19
212	002945	华林证券	8,700	133,371.00	0.19
213	002318	久立特材	4,600	133,170.00	0.19
214	688819	天能股份	4,006	133,079.32	0.19
215	600282	南钢股份	25,300	133,078.00	0.19
216	601019	山东出版	15,400	133,056.00	0.19
217	600707	彩虹股份	20,500	133,045.00	0.19
217	600820	隧道股份	20,500	133,045.00	0.19
219	300024	机器人	7,300	132,787.00	0.19
220	600873	梅花生物	13,100	132,703.00	0.19
221	000629	钒钛股份	42,800	132,680.00	0.19
222	601139	深圳燃气	20,100	132,660.00	0.19
223	600032	浙江新能	17,900	132,639.00	0.19

224	688425	铁建重工	26,149	132,575.43	0.19
225	000423	东阿阿胶	2,700	132,516.00	0.19
226	688475	萤石网络	4,400	132,484.00	0.19
227	601666	平煤股份	16,818	132,357.66	0.19
228	600511	国药股份	4,600	132,250.00	0.19
229	600177	雅戈尔	17,400	132,240.00	0.19
230	603589	口子窖	4,400	132,220.00	0.19
230	688582	芯动联科	2,000	132,220.00	0.19
232	600352	浙江龙盛	12,400	132,184.00	0.19
233	600021	上海电力	6,600	132,132.00	0.19
234	603766	隆鑫通用	8,200	132,102.00	0.19
235	601000	唐山港	34,400	132,096.00	0.19
236	600998	九州通	25,799	132,090.88	0.19
237	600808	马钢股份	31,300	132,086.00	0.19
238	301536	星宸科技	2,200	131,802.00	0.19
239	600927	永安期货	8,200	131,774.00	0.19
240	300679	电连技术	2,700	131,436.00	0.19
241	600754	锦江酒店	5,200	131,404.00	0.19
242	002739	万达电影	11,600	131,312.00	0.19
243	002436	兴森科技	6,200	131,254.00	0.19
244	002966	苏州银行	15,820	131,147.80	0.19
245	000400	许继电气	5,100	131,121.00	0.19
246	600060	海信视像	5,400	131,112.00	0.19
247	600967	内蒙一机	7,800	131,040.00	0.19
248	000009	中国宝安	13,300	131,005.00	0.19
249	600008	首创环保	43,664	130,992.00	0.19
250	600390	五矿资本	23,600	130,980.00	0.19
251	600299	安迪苏	14,600	130,962.00	0.19
252	000932	华菱钢铁	23,300	130,946.00	0.19
253	300146	汤臣倍健	10,900	130,909.00	0.19
254	002841	视源股份	3,300	130,779.00	0.19
255	688019	安集科技	600	130,752.00	0.19
256	603529	爱玛科技	4,400	130,680.00	0.19
257	603233	大参林	7,416	130,669.92	0.19
258	600688	上海石化	47,000	130,660.00	0.19
259	301200	大族数控	1,100	130,647.00	0.19
260	688692	达梦数据	500	130,635.00	0.19
261	002266	浙富控股	31,400	130,624.00	0.19
262	600132	重庆啤酒	2,500	130,600.00	0.19
263	600968	海油发展	34,000	130,560.00	0.19
264	000027	深圳能源	20,020	130,530.40	0.19

265	600516	方大炭素	22,900	130,301.00	0.19
266	300458	全志科技	3,100	130,293.00	0.19
267	603728	鸣志电器	1,800	130,230.00	0.19
268	603833	欧派家居	2,500	130,225.00	0.19
269	300144	宋城演艺	15,900	130,221.00	0.19
270	001696	宗申动力	6,000	130,140.00	0.19
270	601216	君正集团	27,000	130,140.00	0.19
272	603605	珀莱雅	1,900	130,112.00	0.19
273	002821	凯莱英	1,400	130,102.00	0.19
274	600598	北大荒	8,700	130,065.00	0.19
275	600959	江苏有线	37,800	130,032.00	0.19
276	002152	广电运通	9,400	129,814.00	0.19
277	601921	浙版传媒	16,600	129,812.00	0.19
278	688266	泽璟制药	1,400	129,780.00	0.19
279	600582	天地科技	22,200	129,426.00	0.18
280	000883	湖北能源	28,500	129,390.00	0.18
281	601016	节能风电	43,850	129,357.50	0.18
282	603087	甘李药业	1,900	129,333.00	0.18
283	301358	湖南裕能	2,000	129,320.00	0.18
284	601128	常熟银行	18,348	129,169.92	0.18
285	600131	国网信通	8,000	129,120.00	0.18
286	002271	东方雨虹	9,500	129,105.00	0.18
287	688349	三一重能	5,100	128,928.00	0.18
288	600007	中国国贸	6,500	128,830.00	0.18
289	601880	辽港股份	80,500	128,800.00	0.18
290	688728	格科微	8,619	128,767.86	0.18
291	300339	润和软件	2,600	128,700.00	0.18
292	600004	白云机场	13,600	128,656.00	0.18
293	601333	广深铁路	42,300	128,592.00	0.18
294	002126	银轮股份	3,400	128,520.00	0.18
294	600578	京能电力	25,200	128,520.00	0.18
296	600764	中国海防	4,700	128,498.00	0.18
297	601098	中南传媒	11,400	128,364.00	0.18
298	002831	裕同科技	4,500	128,295.00	0.18
299	002372	伟星新材	12,300	128,289.00	0.18
300	600655	豫园股份	25,000	128,250.00	0.18
301	003035	南网能源	28,000	128,240.00	0.18
302	601918	新集能源	19,400	128,234.00	0.18
303	600171	上海贝岭	4,100	128,125.00	0.18
304	600535	天士力	8,500	128,095.00	0.18
305	300003	乐普医疗	8,100	128,061.00	0.18

306	300718	长盛轴承	1,500	128,040.00	0.18
307	600062	华润双鹤	7,000	128,030.00	0.18
308	002603	以岭药业	7,500	128,025.00	0.18
309	601997	贵阳银行	21,800	127,966.00	0.18
310	002153	石基信息	11,804	127,837.32	0.18
311	002155	湖南黄金	6,060	127,805.40	0.18
312	600985	淮北矿业	11,500	127,765.00	0.18
313	002335	科华数据	2,300	127,719.00	0.18
314	300623	捷捷微电	4,700	127,699.00	0.18
315	600486	扬农化工	1,840	127,677.60	0.18
316	600606	绿地控股	76,900	127,654.00	0.18
317	603000	人民网	6,700	127,635.00	0.18
318	002385	大北农	31,900	127,600.00	0.18
319	000415	渤海租赁	31,500	127,575.00	0.18
320	603658	安图生物	3,600	127,512.00	0.18
321	601928	凤凰传媒	12,700	127,508.00	0.18
322	001221	悍高集团	2,200	127,402.00	0.18
323	600663	陆家嘴	16,100	127,351.00	0.18
324	601228	广州港	39,300	127,332.00	0.18
325	001213	中铁特货	31,400	127,170.00	0.18
326	002926	华西证券	13,700	127,136.00	0.18
327	600602	云赛智联	6,800	127,092.00	0.18
328	002410	广联达	10,100	127,058.00	0.18
329	600398	海澜之家	21,000	127,050.00	0.18
330	300676	华大基因	2,800	127,008.00	0.18
331	600995	南网储能	10,100	126,957.00	0.18
332	300748	金力永磁	3,720	126,889.20	0.18
333	603345	安井食品	1,600	126,848.00	0.18
334	300735	光弘科技	5,100	126,786.00	0.18
335	002583	海能达	11,200	126,784.00	0.18
336	600970	中材国际	12,200	126,758.00	0.18
337	000951	中国重汽	7,500	126,750.00	0.18
338	600906	财达证券	19,000	126,730.00	0.18
339	688052	纳芯微	800	126,544.00	0.18
340	600816	建元信托	44,700	126,501.00	0.18
341	601966	玲珑轮胎	8,700	126,411.00	0.18
342	002797	第一创业	18,400	126,408.00	0.18
343	300383	光环新网	10,100	126,351.00	0.18
344	002130	沃尔核材	4,800	126,336.00	0.18
345	601866	中远海发	50,100	126,252.00	0.18
346	600566	济川药业	4,800	126,240.00	0.18

347	300558	贝达药业	2,700	126,063.00	0.18
348	601990	南京证券	15,900	125,928.00	0.18
349	688561	奇安信	3,539	125,917.62	0.18
350	000733	振华科技	2,400	125,784.00	0.18
351	301301	川宁生物	12,400	125,736.00	0.18
352	603806	福斯特	9,000	125,640.00	0.18
353	000537	绿发电力	15,300	125,613.00	0.18
354	002007	华兰生物	8,300	125,579.00	0.18
355	000062	深圳华强	5,100	125,562.00	0.18
356	601155	新城控股	9,000	125,550.00	0.18
357	688322	奥比中光	1,400	125,538.00	0.18
358	688278	特宝生物	1,500	125,520.00	0.18
359	000088	盐田港	28,200	125,490.00	0.18
360	688281	华秦科技	1,700	125,460.00	0.18
361	002673	西部证券	15,900	125,451.00	0.18
362	600739	辽宁成大	11,200	125,216.00	0.18
363	600483	福能股份	13,200	125,004.00	0.18
364	688578	艾力斯	1,200	124,980.00	0.18
365	600098	广州发展	19,100	124,914.00	0.18
366	000958	电投产融	19,300	124,871.00	0.18
367	601965	中国汽研	7,500	124,500.00	0.18
368	601555	东吴证券	13,740	124,484.40	0.18
369	603899	晨光股份	4,600	124,476.00	0.18
370	688183	生益电子	1,300	124,397.00	0.18
371	002568	百润股份	5,700	124,317.00	0.18
372	002958	青农商行	40,100	124,310.00	0.18
373	002439	启明星辰	8,800	124,256.00	0.18
374	000539	粤电力 A	28,100	124,202.00	0.18
375	600720	中交设计	17,200	124,184.00	0.18
376	300888	稳健医疗	3,280	124,115.20	0.18
377	300601	康泰生物	8,400	124,068.00	0.18
378	000513	丽珠集团	3,600	124,056.00	0.18
379	601118	海南橡胶	21,200	124,020.00	0.18
380	600153	建发股份	13,400	123,950.00	0.18
381	300529	健帆生物	6,300	123,921.00	0.18
382	600348	华阳股份	15,000	123,900.00	0.18
383	601865	福莱特	7,900	123,793.00	0.18
384	301498	乖宝宠物	1,900	123,785.00	0.18
385	688213	思特威	1,300	123,617.00	0.18
386	002461	珠江啤酒	13,300	123,557.00	0.18
387	603858	步长制药	7,900	123,556.00	0.18

388	002312	川发龙蟒	11,300	123,509.00	0.18
389	002265	建设工业	4,600	123,372.00	0.18
390	300001	特锐德	4,800	123,264.00	0.18
391	002773	康弘药业	4,100	122,877.00	0.18
392	002128	电投能源	4,400	122,804.00	0.18
393	300957	贝泰妮	3,100	122,791.00	0.18
394	603707	健友股份	13,580	122,627.40	0.17
395	603688	石英股份	3,350	122,543.00	0.17
396	603939	益丰药房	5,640	122,500.80	0.17
397	600298	安琪酵母	2,800	122,472.00	0.17
398	601598	中国外运	20,200	122,412.00	0.17
399	688363	华熙生物	2,800	122,304.00	0.17
400	688188	柏楚电子	900	122,301.00	0.17
401	600126	杭钢股份	14,960	122,073.60	0.17
402	000739	普洛药业	7,500	122,025.00	0.17
403	600988	赤峰黄金	3,900	121,836.00	0.17
404	688617	惠泰医疗	500	121,635.00	0.17
405	000921	海信家电	4,900	121,569.00	0.17
406	300070	碧水源	31,000	121,520.00	0.17
406	688114	华大智造	2,000	121,520.00	0.17
408	300496	中科创达	1,800	121,500.00	0.17
409	688301	奕瑞科技	1,200	121,332.00	0.17
410	300140	节能环境	17,900	121,183.00	0.17
411	000155	川能动力	10,400	121,160.00	0.17
412	603927	中科软	6,344	121,106.96	0.17
413	000528	柳工	10,200	121,074.00	0.17
414	600517	国网英大	20,100	120,801.00	0.17
415	000723	美锦能源	25,600	120,320.00	0.17
416	002432	九安医疗	3,000	120,120.00	0.17
417	688180	君实生物	3,500	119,560.00	0.17
418	600601	方正科技	10,200	119,544.00	0.17
419	600685	中船防务	4,200	119,490.00	0.17
420	000785	居然智家	40,900	119,428.00	0.17
421	000750	国海证券	28,130	119,271.20	0.17
422	300012	华测检测	8,800	119,240.00	0.17
423	688336	三生国健	2,000	119,140.00	0.17
424	300677	英科医疗	3,060	119,034.00	0.17
424	600642	申能股份	15,300	119,034.00	0.17
426	002032	苏泊尔	2,700	119,016.00	0.17
427	000429	粤高速 A	10,100	118,978.00	0.17
428	000937	冀中能源	22,100	118,898.00	0.17

429	002984	森麒麟	5,600	118,552.00	0.17
430	603160	汇顶科技	1,500	118,500.00	0.17
431	600332	白云山	4,600	118,404.00	0.17
432	603341	龙旗科技	2,800	118,328.00	0.17
433	002044	美年健康	22,400	118,272.00	0.17
434	002078	太阳纸业	7,500	118,125.00	0.17
435	600909	华安证券	17,420	118,107.60	0.17
436	600546	山煤国际	11,700	118,053.00	0.17
437	601699	潞安环能	10,000	118,000.00	0.17
438	600312	平高电气	6,800	117,980.00	0.17
439	603049	中策橡胶	2,100	117,495.00	0.17
440	002299	圣农发展	7,100	117,434.00	0.17
441	601567	三星医疗	5,100	117,402.00	0.17
442	689009	九号公司	2,100	116,739.00	0.17
443	000034	神州数码	3,000	116,730.00	0.17
444	000519	中兵红箭	6,400	116,544.00	0.17
445	688520	神州细胞	2,687	116,373.97	0.17
446	688599	天合光能	7,000	115,850.00	0.17
447	000729	燕京啤酒	10,300	115,669.00	0.16
448	688538	和辉光电	43,451	115,579.66	0.16
449	600157	永泰能源	73,600	115,552.00	0.16
450	300570	太辰光	1,000	115,550.00	0.16
451	600521	华海药业	6,800	115,396.00	0.16
452	603290	斯达半导	1,200	115,308.00	0.16
453	002065	东华软件	12,600	115,290.00	0.16
454	688192	迪哲医药	2,000	115,200.00	0.16
455	300454	深信服	1,000	115,160.00	0.16
456	600901	江苏金租	18,800	115,056.00	0.16
457	600528	中铁工业	14,000	114,520.00	0.16
458	600166	福田汽车	39,100	114,172.00	0.16
459	002294	信立泰	2,300	113,965.00	0.16
460	300017	网宿科技	11,100	113,775.00	0.16
461	688099	晶晨股份	1,300	113,399.00	0.16
462	601001	晋控煤业	8,600	113,090.00	0.16
463	002500	山西证券	18,800	112,612.00	0.16
464	601108	财通证券	12,900	112,488.00	0.16
465	600871	石化油服	52,000	112,320.00	0.16
466	000709	河钢股份	48,400	111,804.00	0.16
467	300474	景嘉微	1,550	111,398.50	0.16
468	601099	太平洋	27,100	111,381.00	0.16
469	600369	西南证券	24,800	111,104.00	0.16

470	601799	星宇股份	900	111,033.00	0.16
471	601991	大唐发电	31,700	110,633.00	0.16
472	002244	滨江集团	11,000	110,550.00	0.16
473	002085	万丰奥威	6,900	110,469.00	0.16
474	000032	深桑达 A	5,700	110,295.00	0.16
475	600339	中油工程	32,800	109,880.00	0.16
476	600109	国金证券	11,800	109,740.00	0.16
477	000728	国元证券	13,100	109,385.00	0.16
478	000050	深天马 A	12,100	109,263.00	0.16
479	000591	太阳能	24,600	109,224.00	0.16
480	002120	韵达股份	16,200	109,188.00	0.16
481	000598	兴蓉环境	15,200	108,984.00	0.16
482	600583	海油工程	19,800	108,702.00	0.16
483	002262	恩华药业	4,500	108,585.00	0.15
484	603565	中谷物流	10,800	108,432.00	0.15
485	002508	老板电器	5,600	108,360.00	0.15
486	000898	鞍钢股份	42,800	108,284.00	0.15
487	600170	上海建工	40,800	108,120.00	0.15
488	002608	江苏国信	14,600	107,894.00	0.15
489	002423	中粮资本	9,200	107,640.00	0.15
490	600863	内蒙华电	24,000	107,520.00	0.15
491	600763	通策医疗	2,661	106,998.81	0.15
492	001286	陕西能源	11,400	106,134.00	0.15
493	601162	天风证券	25,400	105,664.00	0.15
494	002402	和而泰	2,700	105,624.00	0.15
495	600380	健康元	9,000	103,950.00	0.15
496	300142	沃森生物	9,500	103,645.00	0.15
497	688777	中控技术	2,100	103,614.00	0.15
498	688220	翱捷科技	1,200	99,132.00	0.14
499	000563	陕国投 A	28,400	97,980.00	0.14

8.3.2 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300757	罗博特科	707,678.00	1.24
2	300476	胜宏科技	490,280.00	0.86

3	603444	吉比特	473,813.00	0.83
4	300454	深信服	374,275.00	0.66
5	301498	乖宝宠物	361,808.00	0.63
6	002850	科达利	353,531.00	0.62
7	603129	春风动力	348,332.00	0.61
8	002821	凯莱英	330,800.00	0.58
9	688578	艾力斯	329,638.30	0.58
10	300857	协创数据	319,809.00	0.56
11	688213	思特威	306,190.00	0.54
12	300037	新宙邦	305,027.94	0.54
13	002203	海亮股份	294,053.10	0.52
14	001696	宗申动力	292,771.00	0.51
15	300627	华测导航	289,740.00	0.51
16	688521	芯原股份	287,018.85	0.50
17	300450	先导智能	286,447.00	0.50
18	688608	恒玄科技	284,894.00	0.50
19	002130	沃尔核材	283,509.00	0.50
20	002007	华兰生物	281,602.00	0.49

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300476	胜宏科技	1,056,752.00	1.85
2	300757	罗博特科	668,776.00	1.17
3	301308	江波龙	562,253.00	0.99
4	002558	巨人网络	515,827.00	0.91
5	300803	指南针	500,504.00	0.88
6	688521	芯原股份	483,465.10	0.85
7	000988	华工科技	433,922.00	0.76
8	301165	锐捷网络	424,319.00	0.74
9	002850	科达利	406,976.00	0.71
10	002837	英维克	404,782.00	0.71
11	688072	拓荆科技	396,787.95	0.70
12	300251	光线传媒	377,727.00	0.66
13	002653	海思科	376,878.00	0.66
14	301498	乖宝宠物	371,916.00	0.65
15	688578	艾力斯	368,919.67	0.65
16	300390	天华新能	350,025.00	0.61

17	002353	杰瑞股份	349,440.00	0.61
18	000426	兴业银锡	343,962.00	0.60
19	300677	英科医疗	340,857.00	0.60
20	002080	中材科技	339,362.00	0.60

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	63,009,387.72
卖出股票收入（成交）总额	63,370,479.74

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	404,462.03	0.58
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）	5,000.08	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	409,462.11	0.58

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019766	25 国债 01	4,000	404,462.03	0.58
2	118063	金 05 转债	50	5,000.08	0.01

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前

一年内受到公开谴责、处罚说明

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	278,037.20
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	278,037.20

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数	户均持有	持有人结构
-------	------	-------

(户)	的基金份额	机构投资者		个人投资者		中国银河证券股份有限公司—前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
377	101,097.25	30,434,193.00	79.85%	7,679,472.00	20.15%	5,467,100.00	14.34%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含了“前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金”持有本基金的数据。

9.2 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	前海开源基金管理有限公司	21,194,900.00	55.61%
2	中信建投证券股份有限公司	1,556,085.00	4.08%
3	华泰证券股份有限公司	895,900.00	2.35%
4	中信证券股份有限公司	727,764.00	1.91%
5	BARCLAYS BANK PLC	475,204.00	1.25%
6	杨建中	422,500.00	1.11%
7	蒋祖逸	400,000.00	1.05%
8	顾宁	245,433.00	0.64%
9	刘百荣	200,000.00	0.52%
10	周丹	200,000.00	0.52%
11	中国银河证券股份有限公司—前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金	5,467,100.00	14.34%

9.3 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%

9.4 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

§ 10 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	40,113,665.00
本报告期基金总申购份额	52,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	54,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	38,113,665.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内无涉及托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及影响基金管理人经营管理或基金运作业务的诉讼。

本报告期内无涉及本基金基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人没有受到监管部门调查或处罚。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

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

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人未受监管部门调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管部门的高级管理人员未受监管部门调查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券	2	-	-	-	-	本报告期新增 2 个
方正证券	2	-	-	-	-	-
中国银河证券	6	126,125,514.42	100.00%	25,973.20	100.00%	-

注：本基金管理人依据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》等相关规定制定了证券公司参与证券交易的选择标准和程序，使用所选中证券公司的交易单元进行证券投资。

1、选择标准

- (1) 财务状况良好，经营行为规范，制度流程完善，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；
- (2) 具备高效、安全的通讯条件，信息系统建设完备，交易设施满足公募基金证券交易的需求；
- (3) 交易费率符合法律法规及监管要求，具备市场竞争力；
- (4) 法律法规及规范性文件所规定的其他要求。

2、选择程序

- (1) 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司；
- (2) 本基金管理人与被选中的证券公司签订相关协议。

3、本部分的数据统计范围仅包括本基金；本公司网站披露的《前海开源基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）》的统计范围为报告期间存续过的所有公募基金，包括报告期间成立、清算、转型的公募基金。敬请投资者关注上述报告的统计口径差异。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	895,596.98	100.00%	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2025 年 01 月 22 日
2	前海开源基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2025 年 03 月 14 日
3	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（2025 年 3 月修订）	中国证监会规定媒介	2025 年 03 月 19 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托管协议（2025 年 3 月修订）	中国证监会规定媒介	2025 年 03 月 19 日
5	关于前海开源基金管理有限公司旗下部分指数基金标的指数许可使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证监会规定媒介	2025 年 03 月 19 日
6	前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（20250325 更新）	中国证监会规定媒介	2025 年 03 月 25 日
7	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	中国证监会规定媒介	2025 年 03 月 25 日
8	前海开源中证 500 等权重交易型开放式	中国证监会规定媒介	2025 年 03 月 31 日

	指数证券投资基金 2024 年年度报告		日
9	前海开源基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证监会规定媒介	2025 年 03 月 31 日
10	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	2025 年 04 月 11 日
11	前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2025 年 04 月 22 日
12	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	2025 年 06 月 09 日
13	前海开源基金管理有限公司关于终止与民商基金销售（上海）有限公司销售业务合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2025 年 06 月 10 日
14	前海开源基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示公告	中国证监会规定媒介	2025 年 06 月 11 日
15	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	2025 年 06 月 20 日
16	前海开源基金管理有限公司关于前海开源基金 APP 业务迁移的公告	中国证监会规定媒介	2025 年 06 月 21 日
17	前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2025 年 07 月 21 日
18	前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2025 年中期报告	中国证监会规定媒介	2025 年 08 月 29 日
19	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	2025 年 10 月 22 日
20	前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2025 年 10 月 28 日
21	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	中国证监会规定媒介	2025 年 11 月 20 日
22	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经理变更公告	中国证监会规定媒介	2025 年 11 月 20 日

23	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分基金风险等级的公告	中国证监会规定媒介	2025 年 11 月 20 日
24	前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书 (20251120 更新)	中国证监会规定媒介	2025 年 11 月 20 日
25	前海开源基金管理有限公司关于旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	中国证监会规定媒介	2025 年 11 月 24 日
26	前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书 (20251124 更新)	中国证监会规定媒介	2025 年 11 月 24 日
27	前海开源中证 500 等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书 (20251210 更新)	中国证监会规定媒介	2025 年 12 月 10 日
28	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	中国证监会规定媒介	2025 年 12 月 10 日
29	前海开源基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示公告	中国证监会规定媒介	2025 年 12 月 11 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20250101- 20251231	21,194,900.00	-	-	21,194,900.00	55.61%
中国银河证券股份有限公司—前海开源中证 500 等权重交易型	1	20250710- 20250921, 20250930-20251027	-	50,847,300.00	45,380,200.00	5,467,100.00	14.34%

开放式指数证券投资基金联接基金							
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>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源中证 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规定报刊上各项公告的原稿

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

(2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人前海开源基金管理有限公司，客户服务电话：4001-666-998

(3) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.qhkyfund.com

前海开源基金管理有限公司
2026 年 03 月 31 日