前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金
2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
§2 基金简介.....5
2.1 基金基本情况.....5
2.2 基金产品说明.....5
2.3 基金管理人和基金托管人.....7
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.....8
3.1 主要会计数据和财务指标.....8
3.2 基金净值表现.....8
§4 管理人报告.....10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....11
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.....13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....14
§5 托管人报告.....14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....14
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..14
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.....14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....14
6.1 资产负债表.....14
6.2 利润表.....16
6.3 净资产变动表.....17
6.4 报表附注.....18
§7 投资组合报告.....38
7.1 期末基金资产组合情况.....38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....39
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.....40
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.....51
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.....51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....51
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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....54
§9 开放式基金份额变动.....54
§10 重大事件揭示.....54
10.1 基金份额持有人大会决议.....54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....54
10.4 基金投资策略的改变.....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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....55
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....55
10.8 其他重大事件.....57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....58
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.....58
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.....59
12.2 存放地点.....59
12.3 查阅方式.....59

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金	
基金简称	前海开源 MSCI 中国 A 股指数	
基金主代码	006524	
基金运作方式	契约型普通开放式	
基金合同生效日	2018 年 11 月 27 日	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	7,390,100.95 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C
下属分级基金的交易代码	006524	006525
报告期末下属分级基金的份额总额	4,819,295.01 份	2,570,805.94 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。 本基金的投资策略主要有以下八个方面内容： 1、大类资产配置 本基金管理人主要按照 MSCI 中国 A 股指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。 2、股票投资策略 （1）股票投资组合构建 本基金采用完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股组

	成及其权重构建股票投资组合。由于跟踪组合构建与标的指数组合构建存在差异，若出现较为特殊的情况（例如成份股停牌、股票流动性不足以及其他影响指数复制效果的因素），本基金将采用包括替代、抽样等技术手段在内的优化复制法来构建组合，使得跟踪组合尽可能近似于全复制组合，以减少对标的指数的跟踪误差。本基金所采用替代法调整的股票组合应符合投资于股票的资产比例不低于基金资产的80%的比例限制，并符合投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%的投资比例限制。 （2）股票投资组合的调整 本基金所构建的股票投资组合将根据MSCI中国A股指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况等，对其进行适时调整，以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。 3、债券投资策略 本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资，通过主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。 4、权证投资策略 本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。 5、资产支持证券投资策略 本基金通过对资产支持证券发行条款的分析、违约概率和提前偿付比率的预估，借用必要的数量模型来谋求对资产支持证券的合理定价，在严格控制风险、充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下，谨慎选择风险调整后收益较高的品种进行投资。 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。 6、股指期货投资策略 本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。 本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。 7、现金管理策略

	为保持基金的资产流动性，本基金可适当投资于货币市场工具。具体而言，本基金将根据基金资产组合中的现金存量水平、申购赎回情况及基金跟踪误差控制情况，在确定总体流动性要求的基础上，综合考虑宏观经济形势、市场资金面走向、交易对手的信用资质以及各类资产收益率水平等，确定各类货币市场工具的配置比例，并定期对组合的平均剩余期限及投资品种比例进行适当调整，在保证基金资产安全性和流动性的基础上力争创造稳定的收益。 8、其他 未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金紧密跟踪标的指数表现，具有与标的指数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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙辰健	张姗
	联系电话	0755-88601888	400-61-95555
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4001-666-998	400-61-95555
传真		0755-83181169	0755-83195201
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 2206	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518040	518040
法定代表人		李强	缪建民

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.qhkyfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	前海开源基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 2206

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）	
	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C
本期已实现收益	719,929.78	403,592.83
本期利润	693,796.75	453,841.09
加权平均基金份额本期利润	0.1338	0.1517
本期加权平均净值利润率	8.33%	9.60%
本期基金份额净值增长率	8.60%	8.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C
期末可供分配利润	3,337,058.07	1,713,542.49
期末可供分配基金份额利润	0.6924	0.6665
期末基金资产净值	8,156,353.08	4,284,348.43
期末基金份额净值	1.6924	1.6665
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C
基金份额累计净值增长率	85.58%	82.76%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	11.76%	1.21%	11.15%	1.23%	0.61%	-0.02%
过去六个月	8.60%	1.09%	7.45%	1.12%	1.15%	-0.03%

过去一年	28.20%	0.97%	25.55%	0.99%	2.65%	-0.02%
过去三年	32.60%	1.07%	25.97%	1.07%	6.63%	0.00%
过去五年	0.13%	1.06%	-5.06%	1.06%	5.19%	0.00%
过去七年	55.34%	1.11%	36.91%	1.11%	18.43%	0.00%
自基金合同生效起至今	85.58%	1.12%	64.82%	1.13%	20.76%	-0.01%

前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	11.70%	1.21%	11.15%	1.23%	0.55%	-0.02%
过去六个月	8.49%	1.09%	7.45%	1.12%	1.04%	-0.03%
过去一年	27.95%	0.97%	25.55%	0.99%	2.40%	-0.02%
过去三年	31.81%	1.07%	25.97%	1.07%	5.84%	0.00%
过去五年	-0.87%	1.06%	-5.06%	1.06%	4.19%	0.00%
过去七年	53.13%	1.11%	36.91%	1.11%	16.22%	0.00%
自基金合同生效起至今	82.76%	1.12%	64.82%	1.13%	17.94%	-0.01%

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

前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A

前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至报告期末，前海开源基金旗下管理 117 只开放式基金，资产管理规模超过 1045 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林巧亮	本基金的基金经理	2025 年 09 月 24 日	-	8 年	林巧亮先生，吉林大学硕士。2018 年 6 月至 2020 年 6 月任长城证券股份有限公司

					投资经理助理；2020 年 6 月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司基金经理。
周双志	本基金的基金经理	2026 年 04 月 01 日	-	3 年	周双志先生，新加坡国立大学硕士。2022 年 7 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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，A 股市场整体呈现震荡上行态势，主要宽基指数均录得正收益。其中，上证指数累计上涨 3.16%，沪深 300 指数上涨 7.55%，深证成指与创业板指表现更为突出，分别上涨 19.82%和 35.58%。从行业层面观察，市场结构性特征较为明显，以电子、通信为代表的人工智能产业链上游环节获得了市场的较高关注，相关板块涨幅靠前；而消费、医药、商贸零售、农林牧渔等传统领域则表现相对平淡，部分板块出现一定调整，行业间的收益差距有所扩大。上半年申万一级行业中仅约 1/3 的行业上涨，行业首尾差超过 100 个百分点，全市场个股上涨比例约为三成，反映出市场内部结构的分化。

MSCI 中国 A 股指数作为一个宽基指数，其行业分布较为广泛，涵盖了金融、消费、工业、信息技术、医疗保健等多个领域。上半年，这种均衡的持仓结构使得指数的表现呈现出多面性。一方面，指数中的信息技术成分受益于 AI 产业链的景气度提升，对整体收益形成了较为明显的正向贡献；另一方面，金融板块在利率环境和资产质量预期下表现相对平稳，而消费板块中的部分标的则受到需求复苏节奏的影响，表现略显平淡。

展望后市，MSCI 中国 A 股指数所覆盖的多个板块均存在不同的发展逻辑。金融板块方面，随着宏观经济逐步企稳，银行资产的稳健性预期有望改善，保险板块在利率环境变化下也可能迎来估值修复的契机。消费板块中，部分龙头企业的估值已回落至历史较低水平，若后续内需政策持续发力，消费复苏的动能有望逐步显现。科技和工业板块则继续受益于产业升级和 AI 应用的持续推进，但需关注部分细分领域估值偏高后的波动风险。医疗保健板块在医保政策边际改善、创新药出海加速的背景下，长期配置价值依然存在。整体而言，MSCI 中国 A 股指数因其行业分布相对均衡、成分股覆盖较广的特点，能够在市场风格切换时提供一定的风险分散效果。

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。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 MSCI 中国 A 股指数 A 基金份额净值为 1.6924 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 8.60%，同期业绩比较基准收益率为 7.45%；截至报告期末前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C 基金份额净值为 1.6665 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 8.49%，同期业绩比较基准收益率为 7.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济正处于新旧动能转换的关键阶段，高质量发展仍是宏观政策的主基调。随着设备更新、消费品以旧换新等扩内需政策持续显效，制造业投资与居民消费有望稳步修复，为经济增长注入内生动力。同时，外部环境的不确定性依然存在，全球贸易格局与供应链重构进程可能带来阶段性扰动，但国内完整的产业体系与超大规模市场优势，将为经济平稳运行提供坚实支撑。

证券市场方面，随着资本市场改革举措的逐步落地，市场生态与投资者结构持续优化，长期资金入市的制度环境不断改善。下半年，市场在经历上半年的风格分化后，不同板块间的估值裂口有望趋于收敛，投资逻辑或将从单一主题驱动向业绩与估值匹配度兼顾的方向转变。在此背景下，具备清晰产业趋势、稳健现金流与合理估值水平的资产，更易获得市场资金的持续认可。整体流动性预计维持合理充裕，为权益市场提供温和支撑。

行业层面，科技自主可控与新质生产力仍是中长期主线，半导体、高端装备等领域的国产替代进程值得持续关注；同时，具备全球竞争力的制造业出海逻辑，在部分细分行业中仍具演绎空间。消费与医药板块在经历前期调整后，估值性价比逐步显现，其中创新药的政策环境边际向好、消费场景的渐进恢复，均可能为板块带来阶段性修复契机。此外，伴随经济企稳预期升温，部分资源与周期类板块的供需格局亦可能出现积极变化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本基金从 2024 年 10 月 23 日至 2026 年 06 月 30 日连续 409 个工作日基金资产净值低于五千万元，本基金管理人已根据法律法规及基金合同要求拟定相关应对方案上报中国证券监督管理委员会。

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

§5托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	819,644.36	608,836.85
结算备付金		1,187.73	1,871.14
存出保证金		1,002.89	3,203.48
交易性金融资产	6.4.7.2	11,941,715.04	15,012,883.29
其中：股票投资		11,739,616.57	14,709,854.36
基金投资		-	-
债券投资		202,098.47	303,028.93
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		197,174.42	-
应收股利		-	-
应收申购款		4,121.81	3,192.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		12,964,846.25	15,629,987.23
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 06 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		516,543.24	14,750.98
应付管理人报酬		5,190.57	6,612.12
应付托管费		1,038.11	1,322.43
应付销售服务费		686.65	1,231.15
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7.39	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	678.78	1,172.04
负债合计		524,144.74	25,088.72

净资产：			
实收基金	6.4.7.7	7,390,100.95	10,080,480.45
未分配利润	6.4.7.8	5,050,600.56	5,524,418.06
净资产合计		12,440,701.51	15,604,898.51
负债和净资产总计		12,964,846.25	15,629,987.23

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，前海开源 MSCI 中国 A 股指数基金份额总额 7,390,100.95 份，其中，前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A 类基金份额净值 1.6924 元，基金份额总额 4,819,295.01 份；前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C 类基金份额净值 1.6665 元，基金份额总额 2,570,805.94 份。

6.2 利润表

会计主体：前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金
本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		1,192,030.47	356,680.47
1.利息收入		1,018.78	2,603.10
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,018.78	2,603.10
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）		1,166,218.24	853,701.84
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,053,684.38	574,310.30
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	1,922.70	8,718.12
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	-	-56,821.97
股利收益	6.4.7.16	110,611.16	327,495.39
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	24,115.23	-502,716.23
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	678.22	3,091.76
减：二、营业总支出		44,392.63	123,454.12
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	32,470.75	77,598.37
2．托管费	6.4.10.2.2	6,494.21	15,519.69
3．销售服务费	6.4.10.2.3	4,731.13	20,950.13
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		1.98	-
8．其他费用	6.4.7.20	694.56	9,385.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,147,637.84	233,226.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,147,637.84	233,226.35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,147,637.84	233,226.35

6.3 净资产变动表

会计主体：前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金
本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	10,080,480.45	5,524,418.06	15,604,898.51
二、本期期初净资产	10,080,480.45	5,524,418.06	15,604,898.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,690,379.50	-473,817.50	-3,164,197.00
（一）、综合收益总额	-	1,147,637.84	1,147,637.84
（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）	-2,690,379.50	-1,621,455.34	-4,311,834.84
其中：1.基金申购款	1,028,547.57	597,654.65	1,626,202.22
2.基金赎回款	-3,718,927.07	-2,219,109.99	-5,938,037.06
（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	7,390,100.95	5,050,600.56	12,440,701.51
项目	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	28,684,237.96	8,535,019.45	37,219,257.41
二、本期期初净资产	28,684,237.96	8,535,019.45	37,219,257.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,623,358.59	-2,042,239.69	-9,665,598.28
（一）、综合收益总额	-	233,226.35	233,226.35
（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	-7,623,358.59	-2,275,466.04	-9,898,824.63

列）			
其中：1.基金申购款	2,443,272.03	634,994.15	3,078,266.18
2.基金赎回款	-10,066,630.62	-2,910,460.19	-12,977,090.81
（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	21,060,879.37	6,492,779.76	27,553,659.13

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 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2018]708 号《关于准予前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金注册的批复》核准，由前海开源基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 228,326,970.88 元，业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2018]01210012 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金基金合同》于 2018 年 11 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 228,418,283.18 份基金份额，其中认购资金利息折合 91,312.30 份基金份额。本基金的基金管理人为前海开源基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用、而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用、但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要包括标的指数成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成份股(包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会允许基

金投资的股票)、债券(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括定期存款、协议存款及其他银行存款)、货币市场工具、金融衍生品(包括权证、股指期货)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：投资于股票的资产比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，将持有不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国 A 股指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定：资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

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

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的

通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

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

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

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

（4）印花税（如适用）

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

（5）境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日

活期存款	819,644.36
等于：本金	819,589.13
加：应计利息	55.23
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	819,644.36

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		8,914,387.82	-	11,739,616.57	2,825,228.75
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	200,260.00	1,958.47	202,098.47	-120.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	200,260.00	1,958.47	202,098.47	-120.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		9,114,647.82	1,958.47	11,941,715.04	2,825,108.75

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	215.33
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	463.45
其中：交易所市场	463.45
银行间市场	-
应付利息	-
合计	678.78

6.4.7.7 实收基金

前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,379,340.42	5,379,340.42
本期申购	243,798.57	243,798.57
本期赎回（以“-”号填列）	-803,843.98	-803,843.98
本期末	4,819,295.01	4,819,295.01

前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,701,140.03	4,701,140.03
本期申购	784,749.00	784,749.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,915,083.09	-2,915,083.09
本期末	2,570,805.94	2,570,805.94

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,930,240.56	-2,926,211.55	3,004,029.01
本期期初	5,930,240.56	-2,926,211.55	3,004,029.01
本期利润	719,929.78	-26,133.03	693,796.75
本期基金份额交易产生的变动数	-669,667.92	308,900.23	-360,767.69
其中：基金申购款	292,425.05	-146,089.48	146,335.57
基金赎回款	-962,092.97	454,989.71	-507,103.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,980,502.42	-2,643,444.35	3,337,058.07

前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,062,559.58	-2,542,170.53	2,520,389.05
本期期初	5,062,559.58	-2,542,170.53	2,520,389.05
本期利润	403,592.83	50,248.26	453,841.09
本期基金份额交易产生的变动数	-2,350,817.26	1,090,129.61	-1,260,687.65
其中：基金申购款	912,976.68	-461,657.60	451,319.08
基金赎回款	-3,263,793.94	1,551,787.21	-1,712,006.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,115,335.15	-1,401,792.66	1,713,542.49

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	1,006.87
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	8.60
其他	3.31
合计	1,018.78

6.4.7.10 股票投资收益--买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	5,300,010.33
减：卖出股票成本总额	4,241,907.99
减：交易费用	4,417.96
买卖股票差价收入	1,053,684.38

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 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益--利息收入	1,721.70
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	201.00
债券投资收益--赎回差价收入	-
债券投资收益--申购差价收入	-
合计	1,922.70

6.4.7.12.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	304,110.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	299,799.00
减：应计利息总额	4,110.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	201.00

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益--买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益--其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	110,611.16
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	110,611.16

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1.交易性金融资产	24,115.23
--股票投资	24,526.23
--债券投资	-411.00
--资产支持证券投资	-
--基金投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2.衍生工具	-
--权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	24,115.23

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	613.33
转换费收入	64.89
合计	678.22

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	694.56
合计	694.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	32,470.75	77,598.37
其中：应支付销售机构的客户维护费	12,232.48	32,270.96
应支付基金管理人的净管理费	20,238.27	45,327.41

注：支付基金管理人前海开源基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,494.21	15,519.69

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C	合计
前海开源基金	-	71.27	71.27
招商银行	-	941.13	941.13
合计	-	1,012.40	1,012.40
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C	合计
前海开源基金	-	58.05	58.05
招商银行	-	11,201.07	11,201.07
合计	-	11,259.12	11,259.12

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

日销售服务费＝前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A

份额单位：份

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

基金合同生效日（2018 年 11 月 27 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	1,440,299.58	1,440,299.58
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	1,440,299.58	1,440,299.58
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	29.89%	20.74%

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	819,644.36	1,006.87	1,335,129.53	1,605.77

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有 13,289 股托管人招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 441,890.40 元，估值总额为人民币 471,759.50 元，占基金资产净值的比例为 3.79%。(于 2025 年 12 月 31 日,本基金持有 13,289 股托管人招商银行的 A 股普通股,成本总额为人民币 441,890.40 元,估值总额为人民币 559,466.90 元,占基金资产净值的比例为 3.59%)。

6.4.11 利润分配情况

无。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 06 月 29 日	重大事项	832.00	2026 年 07 月 13 日	890.99	96	14,004.40	79,872.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	202,098.47	303,028.93
合计	202,098.47	303,028.93

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

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入

短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	819,644.36	-	-	-	819,644.36
结算备付金	1,187.73	-	-	-	1,187.73
存出保证金	1,002.89	-	-	-	1,002.89
交易性金融资产	202,098.47	-	-	11,739,616.57	11,941,715.04
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	197,174.42	197,174.42
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,121.81	4,121.81
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,023,933.45	-	-	11,940,912.80	12,964,846.25
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	516,543.24	516,543.24
应付管理人报酬	-	-	-	5,190.57	5,190.57
应付托管费	-	-	-	1,038.11	1,038.11
应付销售服务费	-	-	-	686.65	686.65
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	7.39	7.39
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	678.78	678.78
负债总计	-	-	-	524,144.74	524,144.74
利率敏感度缺口	1,023,933.45	-	-	11,416,768.06	12,440,701.51
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	608,836.85	-	-	-	608,836.85
结算备付金	1,871.14	-	-	-	1,871.14
存出保证金	3,203.48	-	-	-	3,203.48
交易性金融资产	303,028.93	-	-	14,709,854.36	15,012,883.29
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	-	-	-	3,192.47	3,192.47
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	916,940.40	-	-	14,713,046.83	15,629,987.23
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	14,750.98	14,750.98
应付管理人报酬	-	-	-	6,612.12	6,612.12
应付托管费	-	-	-	1,322.43	1,322.43
应付销售服务费	-	-	-	1,231.15	1,231.15
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	-	-	-	1,172.04	1,172.04
负债总计	-	-	-	25,088.72	25,088.72
利率敏感度缺口	916,940.40	-	-	14,687,958.11	15,604,898.51

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	147.74	217.28
	市场利率上升 25 个基点	-147.53	-216.96

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人

定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	11,739,616.57	94.36	14,709,854.36	94.26
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	11,739,616.57	94.36	14,709,854.36	94.26

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	689,285.33	745,233.40
	业绩比较基准下降 5%	-689,285.33	-745,233.40

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	11,659,744.57	14,574,287.56
第二层次	281,970.47	438,595.73
第三层次	-	-
合计	11,941,715.04	15,012,883.29

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）本报告期内本基金管理人主动承担了本基金部分基金费用，如信息披露费、审计费等。

（2）除上述事项外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	11,739,616.57	90.55
	其中：股票	11,739,616.57	90.55
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	202,098.47	1.56
	其中：债券	202,098.47	1.56
	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	820,832.09	6.33
8	其他各项资产	202,299.12	1.56
9	合计	12,964,846.25	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	60,817.90	0.49
B	采矿业	540,921.20	4.35
C	制造业	7,681,209.70	61.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	354,296.00	2.85
E	建筑业	134,007.40	1.08
F	批发和零售业	60,925.60	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	289,978.20	2.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	375,656.85	3.02
J	金融业	1,987,119.20	15.97
K	房地产业	52,671.40	0.42
L	租赁和商务服务业	62,758.00	0.50
M	科学研究和技术服务业	90,675.20	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	7,382.40	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,928.52	0.08
R	文化、体育和娱乐业	7,763.00	0.06
S	综合	23,506.00	0.19
	合计	11,739,616.57	94.36

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	600036	招商银行	13,289	471,759.50	3.79
2	300750	宁德时代	1,040	408,730.40	3.29
3	600519	贵州茅台	300	355,647.00	2.86
4	300308	中际旭创	280	355,600.00	2.86
5	601138	工业富联	2,700	194,805.00	1.57
6	688041	海光信息	500	185,150.00	1.49
7	603986	兆易创新	224	182,560.00	1.47
8	002371	北方华创	205	181,334.80	1.46
9	300502	新易盛	280	169,960.00	1.37
10	600900	长江电力	5,500	145,585.00	1.17
11	688012	中微公司	298	139,613.00	1.12
12	601288	农业银行	22,100	134,147.00	1.08
13	601899	紫金矿业	4,900	123,186.00	0.99
14	002475	立讯精密	1,685	118,624.00	0.95
15	601318	中国平安	2,400	114,576.00	0.92
16	002384	东山精密	400	104,940.00	0.84
17	600183	生益科技	600	104,040.00	0.84
18	601398	工商银行	14,500	102,515.00	0.82
19	002916	深南电路	216	98,906.40	0.80
20	002594	比亚迪	1,200	95,640.00	0.77
21	001309	德明利	100	94,290.00	0.76
22	688008	澜起科技	300	92,970.00	0.75
23	688361	中科飞测	200	86,000.00	0.69
24	300274	阳光电源	520	82,690.40	0.66
25	688072	拓荆科技	96	79,872.00	0.64
26	601166	兴业银行	4,674	77,401.44	0.62
27	603259	药明康德	620	77,196.20	0.62
28	601328	交通银行	11,900	76,517.00	0.62
29	600030	中信证券	2,650	76,134.50	0.61
30	600276	恒瑞医药	1,439	74,885.56	0.60
31	300059	东方财富	3,536	72,063.68	0.58
32	603993	洛阳钼业	4,100	71,955.00	0.58
33	301308	江波龙	100	70,380.00	0.57
34	000725	京东方 A	8,100	70,308.00	0.57
35	300476	胜宏科技	200	69,286.00	0.56

36	688347	华虹宏力	200	67,260.00	0.54
37	300408	三环集团	400	66,760.00	0.54
38	600176	中国巨石	914	66,612.32	0.54
39	000858	五粮液	900	66,600.00	0.54
40	600487	亨通光电	600	65,604.00	0.53
41	600150	中国船舶	1,800	60,822.00	0.49
42	000333	美的集团	800	60,424.00	0.49
43	601211	国泰海通	3,300	60,060.00	0.48
44	002463	沪电股份	370	56,536.00	0.45
45	601869	长飞光纤	100	54,590.00	0.44
46	300394	天孚通信	180	54,482.40	0.44
47	002281	光迅科技	200	51,388.00	0.41
48	601088	中国神华	1,300	50,752.00	0.41
49	601816	京沪高铁	10,900	49,377.00	0.40
50	688521	芯原股份	133	49,361.62	0.40
51	600000	浦发银行	5,700	49,077.00	0.39
52	601225	陕西煤业	2,400	48,840.00	0.39
53	600522	中天科技	800	48,544.00	0.39
54	300433	蓝思科技	900	48,294.00	0.39
55	600309	万华化学	700	47,887.00	0.38
56	000657	中钨高新	500	47,860.00	0.38
57	300857	协创数据	140	47,586.00	0.38
58	601857	中国石油	5,400	46,872.00	0.38
59	002353	杰瑞股份	300	45,750.00	0.37
60	601939	建设银行	4,700	45,261.00	0.36
61	002142	宁波银行	1,513	44,920.97	0.36
62	600406	国电南瑞	1,900	43,415.00	0.35
63	601985	中国核电	4,800	43,344.00	0.35
64	000001	平安银行	4,300	43,215.00	0.35
65	688082	盛美上海	100	43,200.00	0.35
66	601601	中国太保	1,500	42,780.00	0.34
67	002714	牧原股份	1,210	42,337.90	0.34
68	002938	鹏鼎控股	400	42,152.00	0.34
69	601919	中远海控	3,170	42,034.20	0.34
70	600584	长电科技	400	41,420.00	0.33
71	000338	潍柴动力	1,500	40,875.00	0.33
72	300760	迈瑞医疗	300	40,749.00	0.33
73	601668	中国建筑	9,200	39,928.00	0.32
74	600999	招商证券	1,860	39,246.00	0.32
75	600111	北方稀土	800	38,440.00	0.31
76	300620	光库科技	100	37,820.00	0.30

77	688629	华丰科技	200	37,502.00	0.30
78	688313	仕佳光子	200	36,930.00	0.30
79	000988	华工科技	200	36,922.00	0.30
80	000792	盐湖股份	1,200	36,228.00	0.29
81	002080	中材科技	400	36,000.00	0.29
82	601872	招商轮船	2,000	35,140.00	0.28
83	600809	山西汾酒	320	34,998.40	0.28
84	600989	宝丰能源	1,700	34,561.00	0.28
85	300014	亿纬锂能	531	34,530.93	0.28
86	002352	顺丰控股	1,100	34,386.00	0.28
87	300604	长川科技	100	34,142.00	0.27
88	600549	厦门钨业	400	34,080.00	0.27
89	600028	中国石化	7,600	33,896.00	0.27
90	300033	同花顺	140	33,740.00	0.27
91	600887	伊利股份	1,401	33,567.96	0.27
92	605117	德业股份	316	33,552.88	0.27
93	300442	润泽科技	400	33,228.00	0.27
94	601688	华泰证券	1,600	32,992.00	0.27
95	600031	三一重工	1,900	32,832.00	0.26
96	601766	中国中车	6,300	32,760.00	0.26
97	000063	中兴通讯	900	32,571.00	0.26
98	603288	海天味业	963	31,933.08	0.26
99	688126	沪硅产业	800	31,912.00	0.26
100	600160	巨化股份	600	31,806.00	0.26
101	601100	恒立液压	288	30,977.28	0.25
102	000776	广发证券	1,300	30,420.00	0.24
103	300475	香农芯创	100	30,000.00	0.24
104	601336	新华保险	500	29,830.00	0.24
105	601066	中信建投	1,000	29,070.00	0.23
106	600690	海尔智家	1,400	28,574.00	0.23
107	300751	迈为股份	100	28,246.00	0.23
108	600050	中国联通	7,000	28,000.00	0.23
109	300548	长芯博创	100	27,800.00	0.22
110	002709	天赐材料	540	27,772.20	0.22
111	000408	藏格矿业	400	27,728.00	0.22
112	600019	宝钢股份	5,100	27,693.00	0.22
113	002460	赣锋锂业	420	27,468.00	0.22
114	600089	特变电工	1,190	26,775.00	0.22
115	000100	TCL 科技	4,570	26,597.40	0.21
116	688183	生益电子	200	26,480.00	0.21
117	688331	荣昌生物	200	26,052.00	0.21

118	688120	华海清科	80	25,774.40	0.21
119	603501	豪威集团	270	25,609.50	0.21
120	601600	中国铝业	3,100	25,482.00	0.20
121	601995	中金公司	700	25,305.00	0.20
122	300223	君正股份	100	24,890.00	0.20
123	002230	科大讯飞	600	24,504.00	0.20
124	601127	赛力斯	400	24,500.00	0.20
125	300136	信维通信	200	23,850.00	0.19
126	600905	三峡能源	6,400	23,744.00	0.19
127	001389	广合科技	100	23,725.00	0.19
128	688249	晶合集成	400	23,612.00	0.19
129	600673	东阳光	700	23,506.00	0.19
130	000425	徐工机械	2,900	23,461.00	0.19
131	600703	三安光电	1,100	23,342.00	0.19
132	000166	申万宏源	5,300	23,320.00	0.19
133	000568	泸州老窖	300	23,256.00	0.19
134	600346	恒力石化	1,300	23,023.00	0.19
135	600893	航发动力	600	23,004.00	0.18
136	002156	通富微电	300	22,761.00	0.18
137	002602	世纪华通	1,600	22,560.00	0.18
138	600010	包钢股份	10,100	22,523.00	0.18
139	600498	烽火通信	300	22,080.00	0.18
140	600460	士兰微	400	21,864.00	0.18
141	688578	艾力斯	200	21,840.00	0.18
142	601727	上海电气	3,100	21,700.00	0.17
143	600489	中金黄金	1,200	21,660.00	0.17
144	600362	江西铜业	500	21,650.00	0.17
145	000977	浪潮信息	308	21,560.00	0.17
146	601888	中国中免	400	21,484.00	0.17
147	601009	南京银行	2,169	21,451.41	0.17
148	600886	国投电力	1,600	21,296.00	0.17
149	002493	荣盛石化	1,950	20,962.50	0.17
150	601868	中国能建	7,800	20,826.00	0.17
151	002600	领益智造	1,200	20,808.00	0.17
152	603296	华勤技术	280	20,795.60	0.17
153	600547	山东黄金	900	20,781.00	0.17
154	601006	大秦铁路	4,500	20,745.00	0.17
155	002837	英维克	260	20,685.60	0.17
156	600188	兖矿能源	1,160	20,613.20	0.17
157	601390	中国中铁	4,900	20,433.00	0.16
158	600105	永鼎股份	300	20,244.00	0.16

159	600660	福耀玻璃	400	20,176.00	0.16
160	600875	东方电气	700	20,139.00	0.16
161	000538	云南白药	420	19,895.40	0.16
162	002001	新和成	700	19,894.00	0.16
163	002648	卫星化学	841	19,755.09	0.16
164	601689	拓普集团	350	19,747.00	0.16
165	601958	金钼股份	700	19,677.00	0.16
166	601012	隆基绿能	1,493	19,588.16	0.16
167	688396	华润微	200	19,510.00	0.16
168	601669	中国电建	4,100	19,270.00	0.15
169	688469	芯联集成	1,800	19,098.00	0.15
170	000630	铜陵有色	3,000	19,080.00	0.15
171	002850	科达利	100	18,930.00	0.15
172	601881	中国银河	1,500	18,855.00	0.15
173	603893	瑞芯微	100	18,836.00	0.15
174	601998	中信银行	2,700	18,711.00	0.15
175	300390	天华新能	200	18,702.00	0.15
176	600104	上汽集团	1,900	18,544.00	0.15
177	002202	金风科技	775	18,522.50	0.15
178	300498	温氏股份	1,500	18,480.00	0.15
179	002466	天齐锂业	300	18,396.00	0.15
180	300803	指南针	200	18,334.00	0.15
181	300316	晶盛机电	300	18,120.00	0.15
182	000807	云铝股份	800	17,712.00	0.14
183	601229	上海银行	2,040	17,707.20	0.14
184	688036	传音控股	300	17,685.00	0.14
185	601628	中国人寿	500	17,675.00	0.14
186	002050	三花智控	400	17,532.00	0.14
187	600958	东方证券	1,832	17,294.08	0.14
188	000301	东方盛虹	1,500	17,175.00	0.14
189	000960	锡业股份	400	17,076.00	0.14
190	600795	国电电力	3,600	16,812.00	0.14
191	002851	麦格米特	100	16,718.00	0.13
192	300124	汇川技术	250	16,582.50	0.13
193	601825	沪农商行	2,200	16,478.00	0.13
194	688617	惠泰医疗	90	16,340.40	0.13
195	601168	西部矿业	600	16,284.00	0.13
195	601991	大唐发电	2,300	16,284.00	0.13
197	000938	紫光股份	564	16,277.04	0.13
198	601231	环旭电子	500	16,200.00	0.13
199	600026	中远海能	900	16,146.00	0.13

200	002049	紫光国微	180	15,975.00	0.13
201	688387	信科移动	800	15,872.00	0.13
202	000895	双汇发展	700	15,680.00	0.13
203	601360	三六零	1,800	15,642.00	0.13
204	002185	华天科技	700	15,617.00	0.13
205	600674	川投能源	1,100	15,587.00	0.13
206	601319	中国人保	2,300	15,548.00	0.12
207	002027	分众传媒	3,200	15,488.00	0.12
208	002422	科伦药业	400	15,408.00	0.12
209	002304	洋河股份	402	15,336.30	0.12
210	600585	海螺水泥	900	15,255.00	0.12
211	600023	浙能电力	2,900	15,254.00	0.12
212	600115	中国东航	4,000	15,240.00	0.12
213	600011	华能国际	2,000	15,180.00	0.12
214	002625	光启技术	500	15,160.00	0.12
215	000651	格力电器	400	15,000.00	0.12
216	603659	璞泰来	507	14,667.51	0.12
217	001979	招商蛇口	2,280	14,660.40	0.12
218	603228	景旺电子	200	14,482.00	0.12
219	600926	杭州银行	1,000	14,450.00	0.12
220	600039	四川路桥	1,820	14,232.40	0.11
221	300782	卓胜微	128	14,026.24	0.11
222	603799	华友钴业	290	13,995.40	0.11
223	600601	方正科技	1,000	13,840.00	0.11
224	688187	时代电气	200	13,732.00	0.11
225	002414	高德红外	1,025	13,591.50	0.11
226	002595	豪迈科技	290	13,514.00	0.11
227	600066	宇通客车	500	13,405.00	0.11
228	002311	海大集团	300	13,383.00	0.11
229	002812	恩捷股份	200	13,382.00	0.11
230	300395	菲利华	100	13,373.00	0.11
231	000066	中国长城	700	13,335.00	0.11
232	601111	中国国航	2,200	13,310.00	0.11
233	000426	兴业银锡	400	13,184.00	0.11
234	002736	国信证券	1,300	12,987.00	0.10
234	601788	光大证券	900	12,987.00	0.10
236	601901	方正证券	1,800	12,960.00	0.10
237	600029	南方航空	2,500	12,950.00	0.10
238	600418	江淮汽车	500	12,915.00	0.10
239	001965	招商公路	1,400	12,824.00	0.10
240	000625	长安汽车	1,758	12,604.86	0.10

241	600233	圆通速递	800	12,600.00	0.10
242	688122	西部超导	200	12,562.00	0.10
243	601877	正泰电器	500	12,535.00	0.10
244	600426	华鲁恒升	510	12,199.20	0.10
245	600096	云天化	400	12,160.00	0.10
246	600438	通威股份	1,000	12,110.00	0.10
247	300418	昆仑万维	300	12,108.00	0.10
248	600048	保利发展	2,600	12,038.00	0.10
249	688188	柏楚电子	112	11,950.40	0.10
250	301269	华大九天	100	11,942.00	0.10
251	002738	中矿资源	200	11,798.00	0.09
252	688777	中控技术	100	11,750.00	0.09
253	000783	长江证券	1,200	11,700.00	0.09
254	600219	南山铝业	2,900	11,571.00	0.09
255	002128	电投能源	500	11,560.00	0.09
256	002236	大华股份	700	11,543.00	0.09
257	300628	亿联网络	340	11,498.80	0.09
258	601377	兴业证券	1,900	11,476.00	0.09
259	002064	华峰化学	1,200	11,388.00	0.09
260	002241	歌尔股份	500	11,265.00	0.09
261	600196	复星医药	500	11,235.00	0.09
262	600895	张江高科	300	11,175.00	0.09
263	000157	中联重科	1,600	11,152.00	0.09
264	000831	中国稀土	200	11,098.00	0.09
265	002558	巨人网络	400	11,024.00	0.09
266	300058	蓝色光标	800	11,008.00	0.09
267	002074	国轩高科	400	11,004.00	0.09
268	600436	片仔癀	100	10,928.00	0.09
269	688223	晶科能源	2,300	10,925.00	0.09
270	600741	华域汽车	700	10,864.00	0.09
271	002532	天山铝业	1,000	10,730.00	0.09
272	000963	华东医药	380	10,685.60	0.09
273	601456	国联民生	1,200	10,608.00	0.09
274	300919	中伟新材	240	10,500.00	0.08
275	300866	安克创新	100	10,450.00	0.08
276	600600	青岛啤酒	200	10,446.00	0.08
277	002379	宏桥控股	700	10,339.00	0.08
278	601117	中国化学	1,400	10,290.00	0.08
278	688099	晶晨股份	100	10,290.00	0.08
280	688271	联影医疗	100	10,123.00	0.08
281	000708	中信特钢	800	10,096.00	0.08

282	601699	潞安环能	700	9,996.00	0.08
283	603606	东方电缆	240	9,962.40	0.08
284	600580	卧龙电驱	300	9,930.00	0.08
285	300015	爱尔眼科	1,202	9,928.52	0.08
286	002129	TCL 中环	825	9,916.50	0.08
287	600061	国投资本	1,500	9,825.00	0.08
288	600027	华电国际	2,200	9,790.00	0.08
289	603260	合盛硅业	200	9,652.00	0.08
290	300454	深信服	100	9,620.00	0.08
291	300661	圣邦股份	67	9,613.16	0.08
292	600642	申能股份	1,100	9,603.00	0.08
293	603806	福斯特	571	9,587.09	0.08
294	601198	东兴证券	700	9,513.00	0.08
295	000999	华润三九	422	9,490.78	0.08
296	002555	三七互娱	500	9,435.00	0.08
297	601216	君正集团	2,100	9,366.00	0.08
298	601878	浙商证券	976	9,272.00	0.07
299	600143	金发科技	600	9,270.00	0.07
300	300748	金力永磁	300	9,255.00	0.07
301	601607	上海医药	600	9,240.00	0.07
302	600221	海航控股	6,800	9,180.00	0.07
303	002195	岩山科技	1,400	9,156.00	0.07
304	601021	春秋航空	200	9,116.00	0.07
305	601799	星宇股份	100	9,062.00	0.07
306	601618	中国中冶	3,700	9,028.00	0.07
307	601108	财通证券	1,040	8,996.00	0.07
308	600845	宝信软件	538	8,946.94	0.07
309	000975	山金国际	520	8,840.00	0.07
310	300759	康龙化成	300	8,679.00	0.07
311	688472	阿特斯	800	8,656.00	0.07
312	600918	中泰证券	1,600	8,512.00	0.07
313	000933	神火股份	400	8,480.00	0.07
314	600352	浙江龙盛	700	8,477.00	0.07
315	601555	东吴证券	1,061	8,403.12	0.07
316	300115	长盈精密	300	8,382.00	0.07
317	600588	用友网络	913	8,381.34	0.07
318	600570	恒生电子	395	8,370.05	0.07
319	688568	中科星图	200	8,294.00	0.07
320	002601	龙佰集团	500	8,240.00	0.07
321	002920	德赛西威	100	8,150.00	0.07
322	600415	小商品城	800	8,128.00	0.07

323	002517	恺英网络	500	8,125.00	0.07
324	601058	赛轮轮胎	700	8,071.00	0.06
325	605499	东鹏饮料	65	8,022.95	0.06
326	000596	古井贡酒	100	7,980.00	0.06
327	600803	新奥股份	500	7,900.00	0.06
328	600988	赤峰黄金	300	7,896.00	0.06
329	600157	永泰能源	4,900	7,889.00	0.06
330	601577	长沙银行	900	7,839.00	0.06
331	300251	光线传媒	700	7,763.00	0.06
332	000559	万向钱潮	600	7,758.00	0.06
333	600711	盛屯矿业	700	7,679.00	0.06
334	600839	四川长虹	1,100	7,678.00	0.06
335	002465	海格通信	600	7,662.00	0.06
336	300207	欣旺达	400	7,596.00	0.06
337	002078	太阳纸业	600	7,494.00	0.06
338	000002	万科 A	2,500	7,400.00	0.06
339	600515	海南机场	2,700	7,398.00	0.06
340	603568	伟明环保	480	7,382.40	0.06
341	002340	格林美	1,100	7,271.00	0.06
342	000728	国元证券	970	7,265.30	0.06
343	000983	山西焦煤	1,250	7,250.00	0.06
344	000617	中油资本	1,100	7,249.00	0.06
345	600298	安琪酵母	200	7,240.00	0.06
346	000786	北新建材	400	7,236.00	0.06
347	300122	智飞生物	600	7,014.00	0.06
348	300896	爱美客	80	6,976.00	0.06
349	600085	同仁堂	300	6,933.00	0.06
350	600009	上海机场	300	6,930.00	0.06
351	600733	北汽蓝谷	1,400	6,818.00	0.05
352	600536	中国软件	240	6,748.80	0.05
353	002939	长城证券	800	6,672.00	0.05
354	000661	长春高新	100	6,660.00	0.05
355	002131	利欧股份	1,400	6,650.00	0.05
356	601777	千里科技	800	6,528.00	0.05
357	002252	上海莱士	1,500	6,510.00	0.05
358	300413	芒果超媒	440	6,437.20	0.05
359	002294	信立泰	200	6,378.00	0.05
360	301236	软通动力	150	6,367.50	0.05
361	000876	新希望	1,000	6,270.00	0.05
362	601238	广汽集团	1,200	6,096.00	0.05
363	600021	上海电力	400	6,028.00	0.05

364	002487	大金重工	100	5,797.00	0.05
365	601933	永辉超市	2,000	5,680.00	0.05
366	688599	天合光能	400	5,648.00	0.05
367	000564	供销大集	4,000	5,320.00	0.04
368	688303	大全能源	300	5,229.00	0.04
369	002459	晶澳科技	644	5,216.40	0.04
370	000932	华菱钢铁	1,500	5,205.00	0.04
371	601212	白银有色	1,000	5,080.00	0.04
372	603486	科沃斯	100	5,075.00	0.04
373	603392	万泰生物	183	4,935.51	0.04
374	300347	泰格医药	100	4,800.00	0.04
375	601567	三星电气	300	4,482.00	0.04
376	601179	中国西电	300	4,476.00	0.04
377	300832	新产业	100	4,200.00	0.03

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	601869	长飞光纤	46,501.00	0.30
2	688041	海光信息	43,270.00	0.28
3	000657	中钨高新	39,258.00	0.25
4	300394	天孚通信	37,064.00	0.24
5	688047	龙芯中科	33,916.00	0.22
6	002602	世纪华通	33,307.00	0.21
7	688313	仕佳光子	30,979.00	0.20
8	688361	中科飞测	30,900.00	0.20
9	300620	光库科技	30,060.00	0.19
10	688629	华丰科技	27,750.00	0.18
11	601995	中金公司	27,696.00	0.18
12	300751	迈为股份	26,365.00	0.17
13	000426	兴业银锡	26,070.00	0.17
14	002379	宏桥控股	24,272.00	0.16
15	001309	德明利	23,022.00	0.15
16	300548	长芯博创	22,715.00	0.15
17	600673	东阳光	22,656.00	0.15
18	688110	东芯股份	22,484.00	0.14

19	688331	荣昌生物	21,992.00	0.14
20	601231	环旭电子	21,825.00	0.14

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	300750	宁德时代	153,700.00	0.98
2	600519	贵州茅台	142,512.00	0.91
3	601138	工业富联	116,986.00	0.75
4	688041	海光信息	105,470.08	0.68
5	300502	新易盛	95,420.00	0.61
6	300394	天孚通信	87,325.04	0.56
7	601318	中国平安	73,905.00	0.47
8	601988	中国银行	69,776.00	0.45
9	688012	中微公司	69,584.00	0.45
10	600900	长江电力	67,780.00	0.43
11	601899	紫金矿业	62,322.00	0.40
12	600919	江苏银行	62,058.00	0.40
13	300308	中际旭创	61,748.00	0.40
14	688120	华海清科	54,080.00	0.35
15	601658	邮储银行	52,395.00	0.34
16	002594	比亚迪	47,919.00	0.31
17	600276	恒瑞医药	42,602.00	0.27
18	600000	浦发银行	41,538.00	0.27
19	601288	农业银行	40,608.00	0.26
20	600030	中信证券	37,996.00	0.24

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	1,247,143.97
卖出股票收入（成交）总额	5,300,010.33

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	202,098.47	1.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	202,098.47	1.62

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	019792	25 国债 19	2,000	202,098.47	1.62

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 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	1,002.89
2	应收清算款	197,174.42
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,121.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	202,299.12

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

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A	420	11,474.51	1,440,299.58	29.89%	3,378,995.43	70.11%
前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C	713	3,605.62	-	-	2,570,805.94	100.00%
合计	1,133	6,522.60	1,440,299.58	19.49%	5,949,801.37	80.51%

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

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A	199,227.37	4.1340%
	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C	0.78	0.0000%
	合计	199,228.15	2.6959%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C
基金合同生效日（2018 年 11 月 27 日）基金份额总额	14,095,545.22	214,322,737.96
本报告期期初基金份额总额	5,379,340.42	4,701,140.03
本报告期基金总申购份额	243,798.57	784,749.00
减：本报告期基金总赎回份额	803,843.98	2,915,083.09
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,819,295.01	2,570,805.94

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及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，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

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

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
德邦证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	本报告期退租 1 个
国泰海通证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	本报告期

						退租 2 个
五矿证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	6,547,154.30	100.00%	1,348.02	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。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏	-	-	-	-	-	-	-	-

源证券								
万和证券	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	200,260.00	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	前海开源基金管理有限公司关于终止与上海凯石财富基金销售有限公司销售业务合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2026年01月12日
2	前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026年01月22日
3	关于旗下部分基金增加易方达财富管理基金销售（广州）有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026年02月10日
4	关于防范不法分子冒用前海开源基金名义进行非法活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2026年02月10日
5	前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026年03月31日
6	前海开源基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会规定媒介	2026年03月31日
7	前海开源 MSCI 中国 A 股指数型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	2026年04月02日
8	前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2026年04月02日
9	前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金招募说明书（20260402 更新）	中国证监会规定媒介	2026年04月02日
10	前海开源基金管理有限公司关于终止与海通证券股份有限公司合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2026年04月03日
11	前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026年04月22日
12	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定媒介	2026年04月30日
13	前海开源基金管理有限公司关于终止与深圳富济基金销售有限公司销售业务合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2026年05月18日

14	前海开源基金管理有限公司关于终止与上海有鱼基金销售有限公司销售业务合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2026年05月29日
15	前海开源基金管理有限公司关于终止与中证金牛（北京）基金销售有限公司销售业务合作关系的公告	中国证监会规定媒介	2026年06月01日
16	前海开源基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示公告	中国证监会规定媒介	2026年06月18日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	20260630	1,496,165.12	-	-	1,496,165.12	20.25%
产品特有风险							

1. 巨额赎回风险

（1）本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；

（2）单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定延缓支付赎回款项、部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务的办理；

2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

个别投资者大额赎回后，若本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决，其他投资者可能面临相应风险；

3.流动性风险

单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

4.巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（1）中国证券监督管理委员会批准前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金设立的文件

（2）《前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金基金合同》

（3）《前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金托管协议》

（4）基金管理人业务资格批件、营业执照

（5）前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金在规定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

（1）投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

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

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

前海开源基金管理有限公司

2026 年 08 月 31 日