前海开源中证金融科技主题指数型证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 09 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：万联证券股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人万联证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	前海开源中证金融科技主题指数
基金主代码	027389
基金运作方式	契约型普通开放式
基金合同生效日	2026 年 06 月 09 日
报告期末基金份额总额	75,207,684.03 份
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	本基金主要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。 1、大类资产配置

	本基金管理人主要按照标的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。本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 10%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权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、存出保证金和应收申购款等。 2、股票投资策略 （1）股票投资组合构建 本基金主要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股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 10%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、申购赎回变动情况等，对其进行适时调整，力求基金净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。 在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。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。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 3、港股通标的股票投资策略 在特殊情况下，本基金将少量投资于港股通标的股票以进行

	替代复制。对于同时有 A 股、H 股的指数成份公司，如果该公司 A 股长期停牌，组合无法买入该股票时，可以买入该公司 H 股进行替代。 4、存托凭证投资策略 对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证进行投资。 5、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，主要通过组合久期配置策略，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。 6、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。 7、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。 8、国债期货投资策略 本基金对国债期货的投资根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金将结合国债交易市场和期货交易市场的收益性、流动性的情况，通过多头或空头套期保值等投资策略进行套期保值。 9、股票期权投资策略 本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。 10、信用衍生品投资策略 本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，根据风险管理的原则，以风险对冲为目的，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。 11、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。 12、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。 13、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，在履行适当程序后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	中证金融科技主题指数收益率×95%+活期存款基准利率×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。 本基金可投资港股通标的股票，将面临汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	
基金托管人	万联证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	前海开源中证金融科技主题指数 A	前海开源中证金融科技主题指数 C
下属分级基金的交易代码	027389	027390
报告期末下属分级基金的份额总额	28,644,678.10 份	46,563,005.93 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日）	
	前海开源中证金融科技主题指数 A	前海开源中证金融科技主题指数 C
1.本期已实现收益	-62,795.77	-116,688.55
2.本期利润	-1,777,342.40	-2,999,991.68
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0547	-0.0585
4.期末基金资产净值	25,790,834.59	41,897,013.10
5.期末基金份额净值	0.9004	0.8998

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。

3.2 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

前海开源中证金融科技主题指数 A

阶段	净值增长率①	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	-6.87%	1.93%	-6.89%	1.92%	0.02%	0.01%
自基金合同生效起至今	-9.96%	2.00%	-7.24%	2.17%	-2.72%	-0.17%

前海开源中证金融科技主题指数 C

阶段	净值增长率①	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	-6.92%	1.93%	-6.89%	1.92%	-0.03%	0.01%
自基金合同生效起至今	-10.02%	2.00%	-7.24%	2.17%	-2.78%	-0.17%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

前海开源中证金融科技主题指数 A



前海开源中证金融科技主题指数 C



注：1、本基金的基金合同于 2026 年 06 月 09 日生效，截至 2026 年 09 月 30 日止，本基金成立未满 1 年。

2、本基金的建仓期为 6 个月，截至 2026 年 09 月 30 日止，本基金建仓期尚未结束。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2026 年 06 月 09 日	-	12 年	梁溥森先生，中山大学硕士。曾任职于招商基金基金核算部；2015 年 6 月加盟前海开源基金管理有限公司，历任交易员、研究员，现任公司基金经理。

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

②证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金《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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

经过二季度硬科技股和非硬科技股“冰火两重天”的极致考验，三季度市场风格转向均衡但整体偏弱。市场各大核心宽基指数普遍下跌，上半年“红极一时”的科技板块杀跌明显，但中证 A 股超过 51%的股票不跌反涨，市场表现与上半年形成了明显的镜像走势。三季度以来，中证金融科技指数大跌-7.3%，同期本基金 A 类份额下跌-6.87%，C 类份额下跌-6.92%，表现与业绩比较基准基本一致。

伴随着多个以硬科技为主的指数跌破年线，叠加两市成交持续缩量，市场多头信心受到了较大冲击。不过我们认为，投资者无需过度悲观。近期监管在介绍资本市场“十五五”时期目标任务时，提出了加快健全资本市场法律制度体系、完善投资者保护机制，更加突出推动上市公司提升回报能力，并进一步增强资本市场内在稳定性。这一系列完善 A 股基础制度的举措，有助于提升市场中长期投资回报、平抑市场波动。受市场回调影响，九月以来成交量有所回落，但仍维持在 1.5 万亿元以上的高位；今年以来中证 A 股指数累计成交额已突破 440 万亿元，超过了 2025 年全年水平，市场并未陷入流动性冰点。回顾 A 股历史，1.5 万亿元以上的成交仍属于巨量区间，充裕资金环境下，市场仍会持续挖掘结构性机会、修复交易情绪。此外，当前 A 股韧性较强，关键点位资金承接特征显著，我们判断 A 股依旧处于长牛慢牛的良性趋势当中。财富管理需求复苏与市场活跃度提升，有望推动中证金融科技指数向兼具周期弹性与成长确定性的核心资产跨越。中证金融科技指数成分股上半年业绩修复明显，归母净利润同比增速接近 2022 年以来的最高水平，政策组合拳对实体经济和上市公司业绩的提振效果逐渐凸显，且其当前 PE 仅处于上市以来历史分位值的 12%左右，具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。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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源中证金融科技主题指数 A 基金份额净值为 0.9004 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.87%，同期业绩比较基准收益率为-6.89%；截至报告期末前海开源中证金融科技主题指数 C 基金份额净值为 0.8998 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.92%，同期业绩比较基

准收益率为-6.89%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	63,103,634.84	92.40
	其中：股票	63,103,634.84	92.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	3,788,385.01	5.55
8	其他资产	1,401,671.86	2.05
9	合计	68,293,691.71	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,097,681.00	7.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	483,990.00	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,803,634.20	57.33
J	金融业	18,718,329.64	27.65
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	63,103,634.84	93.23

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	300059	东方财富	390,116	6,940,163.64	10.25
2	300033	同花顺	33,800	6,660,628.00	9.84
3	600570	恒生电子	197,100	3,823,740.00	5.65
4	300803	指南针	70,600	3,743,918.00	5.53
5	300339	润和软件	105,800	3,576,040.00	5.28
6	002065	东华软件	288,300	1,873,950.00	2.77
7	000997	新大陆	94,400	1,824,752.00	2.70
8	300085	银之杰	56,400	1,634,472.00	2.41
9	300773	拉卡拉	101,140	1,454,393.20	2.15
10	300468	四方精创	70,600	1,448,006.00	2.14

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5.5 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债券投资明细

无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,401,671.86
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,401,671.86

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	前海开源中证金融科技主题指数 A	前海开源中证金融科技主题指数 C
报告期期初基金份额总额	37,802,080.45	66,215,583.89
报告期期间基金总申购份额	4,030,808.41	21,526,068.18
减：报告期期间基金总赎回份额	13,188,210.76	41,178,646.14
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	28,644,678.10	46,563,005.93

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 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金融科技主题指数型证券投资基金设立的文件

（2）《前海开源中证金融科技主题指数型证券投资基金基金合同》

（3）《前海开源中证金融科技主题指数型证券投资基金托管协议》

（4）基金管理人业务资格批件、营业执照

（5）前海开源中证金融科技主题指数型证券投资基金在规定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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 10 月 27 日