

前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金
2023 年中期报告

2023 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：2023 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，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 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	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
§ 4	管理人报告	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	12
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	14
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（基金净值）变动表	17
6.4	报表附注	18
§ 7	投资组合报告	39
7.1	期末基金资产组合情况	39
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	53
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	55
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	55
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56

7.12	投资组合报告附注	56
§ 8	基金份额持有人信息	57
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§ 9	开放式基金份额变动	58
§ 10	重大事件揭示	58
10.1	基金份额持有人大会决议	58
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	59
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4	基金投资策略的改变	59
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	59
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8	其他重大事件	61
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	61
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	62
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12	备查文件目录	62
12.1	备查文件目录	62
12.2	存放地点	62
12.3	查阅方式	63

§ 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	41,172,797.78 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	10,624,749.03 份	30,548,048.75 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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>本基金的投资策略主要有以下八个方面内容：</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）股票投资组合构建</p> <p>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</p>

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

	<p>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。</p> <p>8、其他</p> <p>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	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	0755-83077987
	电子邮箱	qhky@qhkyfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4001-666-998	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.qhkyfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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（2023 年 01 月 01 日至 2023 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	177,153.14	439,632.25
本期利润	-360,904.91	-807,453.27
加权平均基金份额本期利润	-0.0396	-0.0381
本期加权平均净值利润率	-2.99%	-2.92%
本期基金份额净值增长率	-1.68%	-1.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 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	2,935,169.54	8,074,278.43
期末可供分配基金份额利润	0.2763	0.2643
期末基金资产净值	13,559,918.57	38,622,327.18
期末基金份额净值	1.2763	1.2643
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023 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	39.95%	38.65%

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
过去一个月	1.52%	0.82%	0.42%	0.82%	1.10%	0.00%
过去三个月	-5.00%	0.74%	-6.02%	0.75%	1.02%	-0.01%
过去六个月	-1.68%	0.74%	-2.55%	0.75%	0.87%	-0.01%
过去一年	-14.33%	0.88%	-14.63%	0.90%	0.30%	-0.02%
过去三年	-0.70%	1.14%	-4.31%	1.13%	3.61%	0.01%
自基金合同生效起至今	39.95%	1.16%	30.84%	1.17%	9.11%	-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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

		准差②	率③	④		
过去一个月	1.49%	0.82%	0.42%	0.82%	1.07%	0.00%
过去三个月	-5.05%	0.74%	-6.02%	0.75%	0.97%	-0.01%
过去六个月	-1.78%	0.74%	-2.55%	0.75%	0.77%	-0.01%
过去一年	-14.50%	0.88%	-14.63%	0.90%	0.13%	-0.02%
过去三年	-1.30%	1.15%	-4.31%	1.13%	3.01%	0.02%
自基金合同生效起至今	38.65%	1.16%	30.84%	1.17%	7.81%	-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资产管理合伙企业(有限合伙)各持股权 25%。目前，前海开源基金分别在北京、上海、广州设立分公司。经中国证监会批准，前海开源基金全资控股子公司——前海开源资产管理有限公司已于 2013 年 9 月 5 日在深圳市注册成立，并于 2013 年 9 月 18 日取得中国证监会核发的《特定客户资产管理业务资格证书》，截至报告期末，注册资本为 1.8 亿元人民币。

截至报告期末，前海开源基金旗下管理 97 只开放式基金，资产管理规模超过 1121 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁溥森	本基金的基金经理	2020 年 12 月 18 日	-	9 年	梁溥森先生，金融学硕士。曾任职于招商基金基金核算部，2015 年 6

					月加入前海开源基金，历任交易员、研究员，现任公司基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------------------

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

②证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

疫情干扰消退后的第一年辗转过半，在前期积压需求释放、政策性力量支撑和低基数效应的共同作用下，中国宏观经济呈现出了“触底反弹”的运行特征，但总体来说仍然是“在曲折中前进”。在整体恢复的主基调下，部分经济数据出现了来回拉扯，尤其是二季度受经济动能下降、数据挤水分等原因影响，经济数据弱于市场预期。此外，两会、央行货币政策例会以及 4 月的政治局会议对

经济的表述均较为乐观，在政策方面也有较强的定力，这使得投资者对于政策强刺激的预期逐渐落空，市场进入了“弱预期、弱现实”的状态。在缺乏基本面支撑的情况下，市场炒作呈现出了“存量资金博弈+主题投资”的状态。叠加美国经济的韧性较强而通胀降温的节奏有所反复，美联储年内不降息的信心日益增强，激进的紧缩货币政策加剧了中国资本市场波动的风险。多重因素叠加下，MSCI 中国 A 股指数上半年下跌 2.71%，本基金 A 类份额下跌 1.68%，C 类份额下跌 1.78%，相对于业绩比较基准均取得了一定的超额收益。站在当前时点，我们判断，市场已较充分计价经济基本面的复苏压力并且对刺激政策的预期同样悲观。随着美联储加息步伐的减缓，人民币汇率的企稳，中国资产性价比逐渐凸显。此外，从估值来看，A 股投资性价比较高，截止 2023 年 6 月 30 日，MSCI 中国 A 股指数相对于十年期国债的风险溢价高达 5.48%，相对吸引力比历史上 83.45%的时期更高。投资的机会和风险，不仅取决于我们挑选的投资标的，与我们买入的价格也是息息相关的，当前 MSCI 中国 A 股指数的投资性价比依然较高。当然，也会有部分投资者认为当前经济形势仍不乐观，复苏节奏不及预期等等。但正如西格尔教授在《股市长线法宝》一书中所言“如果一个投资者要等到经济周期触底时才调整投资策略，他将错过大好的投资机会”。因此，与其花费大量的精力预测（难以准确预测的）经济周期何时见底，获得超额收益的最佳途径仍然是以明显低于历史估值的价格买入股票。

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“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 1.2763 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.68%，同期业绩比较基准收益率为-2.55%；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 1.2643 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.78%，同期业绩比较基准收益率为-2.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，在前期积压需求释放、政策性力量支撑和低基数效应的共同作用下，中国宏观经济呈现出“触底反弹”的运行特征。“重启效应”使得中国经济的需求面和供给面均得到明显改善。在供

给端，受疫情影响较为严重的服务业加快反弹，1-5 月份服务业生产指数较 2022 年增速大幅回升；工业保持平稳增长，制造业增加值逆转了去年四季度开始的加速下滑态势。在需求端，受抑制的消费和投资需求得到了较为充分地释放。1-5 月份社零总额同比增长 9.3%，尤其是受疫情防控直接影响的领域反弹幅度较大。在基建投资保持高位和房地产投资跌幅缩小的共同支撑下，固定资产投资增速出现了企稳。出口方面，一方面全球经济增速放缓导致外需收缩，另一方面全球产业链供应链修复下供给能力提升，两方面因素叠加导致中国出口增速出现明显下滑，以美元计价，5 月份出口同比下降 7.5%，出口压力明显增加。总体而言，上半年中国宏观经济恢复性增长势头强劲，需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力得到了不同程度的缓解，但疤痕效应之下，需求不旺和预期低迷问题存在，同时社融-M2 增速差、M1-M2 增速差持续保持较大的负向缺口等种种现象显示出市场主体对未来的悲观预期，经济增长的内生动力仍然有待提振。

考虑到大宗商品价格转入下行通道的成本效应，中国通胀水平保持低位使得货币政策仍具有较大空间。后续，宏观经济政策如能继续发力，成功扭转企业生产性投资、居民消费支出的保守化倾向，并提高货币政策的传导效率，中国经济的产出缺口有望在下半年进一步缩小，就业压力也将得到一定程度的缓解，居民收入和企业绩效有望逐步改善，家庭和企业资产负债表逐步修复，带动信心和预期的改善，共同推进形成经济复苏发展的内生动力。

此外，随着美联储加息步伐的减缓，人民币汇率的企稳，中国资产性价比逐渐凸显。当前 A 股各主流指数仍然处于较低的估值水平，伴随着经济复苏的明朗以及风险偏好的修复，A 股有望迎来估值修复，后续无需悲观。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会主席由总经理办公会指定，估值委员会成员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 2020 年 07 月 06 日至 2023 年 03 月 24 日连续 662 个工作日基金资产净值低于五千万
元，我公司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。

§ 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。

本年度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

本年度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：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
----	-----	-------------------------	--------------------------

资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,739,281.84	728,618.68
结算备付金		161,237.61	98,989.20
存出保证金		153,688.04	3,045.51
交易性金融资产	6.4.7.2	49,461,484.83	25,175,885.55
其中：股票投资		47,944,695.93	24,465,896.96
基金投资		-	-
债券投资		1,516,788.90	709,988.59
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		103,988.11	38,549.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		52,619,680.43	26,045,088.23
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022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		332,127.13	1,000.00
应付赎回款		33.74	20,181.46
应付管理人报酬		20,978.68	11,561.65
应付托管费		4,195.75	2,312.33
应付销售服务费		6,177.82	3,048.66
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	73,921.56	48,642.21
负债合计		437,434.68	86,746.31
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	41,172,797.78	20,106,316.32
未分配利润	6.4.7.8	11,009,447.97	5,852,025.60
净资产合计		52,182,245.75	25,958,341.92
负债和净资产总计		52,619,680.43	26,045,088.23

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，前海开源 MSCI 中国 A 股指数基金份额总额 41,172,797.78 份，

其中，前海开源 MSCI 中国 A 股指数 A 类基金份额净值 1.2763 元，基金份额总额 10,624,749.03 份；前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C 类基金份额净值 1.2643 元，基金份额总额 30,548,048.75 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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-938,998.69	-1,079,237.09
1. 利息收入		4,321.15	597.98
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,321.15	597.98
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		811,854.42	-74,636.64
其中：股票投资收益	6.4.7.10	246,359.43	-177,760.80
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	12,015.47	9,237.47
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	-32.78	-
股利收益	6.4.7.16	553,512.30	93,886.69
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,785,143.57	-1,010,134.59
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	29,969.31	4,936.16
减：二、营业总支出		229,359.49	118,687.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	98,098.53	28,244.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,619.68	5,649.01
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	27,311.60	5,415.68
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.20	84,329.68	79,377.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,168,358.18	-1,197,924.20

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,168,358.18	-1,197,924.20
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,168,358.18	-1,197,924.20

6.3 净资产（基金净值）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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	20,106,316.32	-	5,852,025.60	25,958,341.92
二、本期期初净资产（基金净值）	20,106,316.32	-	5,852,025.60	25,958,341.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	21,066,481.46	-	5,157,422.37	26,223,903.83
（一）、综合收益总额	-	-	-1,168,358.18	-1,168,358.18
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	21,066,481.46	-	6,325,780.55	27,392,262.01
其中：1. 基金申购款	46,730,842.06	-	14,969,037.93	61,699,879.99
2. 基金赎回款	-25,664,360.60	-	-8,643,257.38	-34,307,617.98
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	41,172,797.78	-	11,009,447.97	52,182,245.75
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	8,148,276.80	-	5,081,739.77	13,230,016.57
二、本期期初净资产（基金净值）	8,148,276.80	-	5,081,739.77	13,230,016.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-401,413.59	-	-1,329,150.84	-1,730,564.43
（一）、综合收益总额	-	-	-1,197,924.20	-1,197,924.20
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-401,413.59	-	-131,226.64	-532,640.23

(净值减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	6,058,202.02	-	2,822,366.16	8,880,568.18
2. 基金赎回款	-6,459,615.61	-	-2,953,592.80	-9,413,208.41
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	7,746,863.21	-	3,752,588.93	11,499,452.14

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

何璁

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 \times 95%+银行人民币活期存款利率(税后) \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的其他有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
活期存款	2,739,281.84
等于：本金	2,739,085.88
加：应计利息	195.96
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	2,739,281.84

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	50,483,096.50	-	47,944,695.93	-2,538,400.57	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,496,962.00	17,088.90	1,516,788.90	2,738.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,496,962.00	17,088.90	1,516,788.90	2,738.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	51,980,058.50	17,088.90	49,461,484.83	-2,535,662.57	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,176,900.00	-	-	-
其中：股指期货投资	1,176,900.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,176,900.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2309	沪深 300 股指期货 2309 合约	1.00	1,151,700.00	-25,200.00
合计				-25,200.00
减：可抵销期货暂收款				-25,200.00
净额				0.00

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	29,045.17
其中：交易所市场	29,045.17
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用	44,876.39
合计	73,921.56

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,077,284.18	7,077,284.18
本期申购	4,259,185.04	4,259,185.04
本期赎回（以“-”号填列）	-711,720.19	-711,720.19
本期末	10,624,749.03	10,624,749.03

前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,029,032.14	13,029,032.14
本期申购	42,471,657.02	42,471,657.02
本期赎回（以“-”号填列）	-24,952,640.41	-24,952,640.41
本期末	30,548,048.75	30,548,048.75

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
本期期初	5,987,810.93	-3,877,989.13	2,109,821.80
本期利润	177,153.14	-538,058.05	-360,904.91
本期基金份额交易产生的变动数	3,011,254.42	-1,825,001.77	1,186,252.65
其中：基金申购款	3,617,073.85	-2,191,855.91	1,425,217.94
基金赎回款	-605,819.43	366,854.14	-238,965.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,176,218.49	-6,241,048.95	2,935,169.54

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
本期期初	10,836,851.52	-7,094,647.72	3,742,203.80
本期利润	439,632.25	-1,247,085.52	-807,453.27
本期基金份额交易产生的变动数	14,625,084.70	-9,485,556.80	5,139,527.90

其中：基金申购款	35,457,337.87	-21,913,517.88	13,543,819.99
基金赎回款	-20,832,253.17	12,427,961.08	-8,404,292.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,901,568.47	-17,827,290.04	8,074,278.43

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
活期存款利息收入		3,447.23
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		795.56
其他		78.36
合计		4,321.15

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	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
卖出股票成交总额		26,700,725.48
减：卖出股票成本总额		26,364,332.74
减：交易费用		90,033.31
买卖股票差价收入		246,359.43

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	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
债券投资收益—利息收入		9,107.88
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入		2,907.59
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		12,015.47

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
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	727,571.25
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	711,341.00
减：应计利息总额	13,322.09
减：交易费用	0.57
买卖债券差价收入	2,907.59

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益—买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益—其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023年01月01日至2023年06月30日
股指期货投资收益	-32.78

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	553,512.30
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	553,512.30

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,759,943.57
--股票投资	-1,762,572.57
--债券投资	2,629.00
--资产支持证券投资	-
--基金投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2. 衍生工具	-25,200.00
--权证投资	-
--期货投资	-25,200.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,785,143.57

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	29,689.27
转换费收入	280.04
合计	29,969.31

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
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
指数使用费	68,441.90
汇划手续费	1,011.39
合计	84,329.68

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
前海开源基金管理有限公司（“前海开源基金”）	基金管理人、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	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	98,098.53	28,244.98
其中：支付销售机构的客户维护费	38,313.68	11,239.57

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	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	19,619.68	5,649.01

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		
	2023 年 01 月 01 日至 2023 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	-	831.98	831.98
招商银行	-	16,766.64	16,766.64
合计	-	17,598.62	17,598.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 01 月 01 日至 2022 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
招商银行	-	454.99	454.99
前海开源基金	-	15.87	15.87
合计	-	470.86	470.86

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	-
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	-
报告期末持有的基金份额占基金总份 额比例	13.56%	-

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	2,739,281.84	3,447.23	530,040.98	568.51

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 2023 年 06 月 30 日，本基金持有 25,889 股托管人招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 907,195.99 元，估值总额为人民币 848,123.64 元，占基金资产净值的比例为 1.63% (于 2022 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 482,318.81 元，估值总额为人民币 495,148.14 元，占基金资产净值的比例为 1.91%)。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末 2023 年 06 月 30 日本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601916	浙商银行	2023 年 06 月 27 日	8 个交易日	配股未上市	2.02	2.64	6,060	12,241.20	15,998.40	-

注：①根据《上海证券交易所首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》和《深圳证券交易所首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分股票设置不低于 6 个月的限售期。

②基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

③基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可

靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,516,788.90	708,988.58
合计	1,516,788.90	708,988.58

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

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-

AAA 以下	-	1,000.01
未评级	-	-
合计	-	1,000.01

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在开放期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在开放期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。

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期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%。于2023年6月30日，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。于2023年6月30日，本基金组合资产中经确认的当日净赎回金额未超过7个工作日可变现资产的账面价值。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年06月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,739,281.84	-	-	-	2,739,281.84

结算备付金	161,237.61	-	-	-	161,237.61
存出保证金	15,484.04	-	-	138,204.00	153,688.04
交易性金融资产	1,516,788.90	-	-	47,944,695.93	49,461,484.83
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	0.04	-	-	103,988.07	103,988.11
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,432,792.43	-	-	48,186,888.00	52,619,680.43
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	-	-	-	332,127.13	332,127.13
应付赎回款	-	-	-	33.74	33.74
应付管理人报酬	-	-	-	20,978.68	20,978.68
应付托管费	-	-	-	4,195.75	4,195.75
应付销售服务费	-	-	-	6,177.82	6,177.82
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	-	-	-	73,921.56	73,921.56
负债总计	-	-	-	437,434.68	437,434.68
利率敏感度缺口	4,432,792.43	-	-	47,749,453.32	52,182,245.75
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	728,618.68	-	-	-	728,618.68
结算备付金	98,989.20	-	-	-	98,989.20
存出保证金	3,045.51	-	-	-	3,045.51
交易性金融资产	708,988.58	-	1,000.01	24,465,896.96	25,175,885.55
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	1.00	-	-	38,548.29	38,549.29
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,539,642.97	-	1,000.01	24,504,445.25	26,045,088.23
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	-	-	-	1,000.00	1,000.00
应付赎回款	-	-	-	20,181.46	20,181.46
应付管理人报酬	-	-	-	11,561.65	11,561.65
应付托管费	-	-	-	2,312.33	2,312.33
应付销售服务费	-	-	-	3,048.66	3,048.66
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	-	-	-	48,642.21	48,642.21
负债总计	-	-	-	86,746.31	86,746.31
利率敏感度缺口	1,539,642.97	-	1,000.01	24,417,698.94	25,958,341.92

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(2023年06月30日)	上年度末(2022年12月31日)
	市场利率增加 0.25%	-1,208.30	-554.53
市场利率减少 0.25%	1,210.22	555.40	

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 2023年06月30日		上年度末 2022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	47,944,695.93	91.88	24,465,896.96	94.25
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	47,944,695.93	91.88	24,465,896.96	94.25

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注6.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末(2023年06月30日)	上年度末(2022年12月31日)
	业绩比较基准上升5%	2,763,947.05	1,401,238.20
业绩比较基准下降5%	-2,763,947.05	-1,401,238.20	

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 2023 年 06 月 30 日	上年末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	47,944,695.93	24,438,275.36
第二层次	1,516,788.90	737,610.19
第三层次	-	-
合计	49,461,484.83	25,175,885.55

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 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(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	47,944,695.93	91.12
	其中：股票	47,944,695.93	91.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,516,788.90	2.88
	其中：债券	1,516,788.90	2.88
	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	2,900,519.45	5.51
8	其他各项资产	257,676.15	0.49
9	合计	52,619,680.43	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	518,807.50	0.99
B	采矿业	2,108,759.50	4.04
C	制造业	27,146,148.13	52.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,836,637.80	3.52
E	建筑业	1,076,987.20	2.06
F	批发和零售业	511,744.80	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	1,586,753.60	3.04
H	住宿和餐饮业	71,209.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,407,576.42	4.61
J	金融业	8,519,968.88	16.33
K	房地产业	725,007.40	1.39
L	租赁和商务服务业	453,519.00	0.87
M	科学研究和技术服务业	329,125.60	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	56,397.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	31,960.00	0.06
Q	卫生和社会工作	327,539.70	0.63
R	文化、体育和娱乐业	178,965.40	0.34

S	综合	57,589.00	0.11
	合计	47,944,695.93	91.88

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	600519	贵州茅台	1,600	2,705,600.00	5.18
2	300750	宁德时代	5,440	1,244,617.60	2.39
3	600036	招商银行	25,889	848,123.64	1.63
4	000858	五粮液	4,900	801,493.00	1.54
5	600900	长江电力	29,800	657,388.00	1.26
6	601318	中国平安	13,300	617,120.00	1.18
7	002594	比亚迪	2,300	594,021.00	1.14
8	300760	迈瑞医疗	1,500	449,700.00	0.86
9	601166	兴业银行	25,674	401,798.10	0.77
10	000568	泸州老窖	1,800	377,226.00	0.72
11	600276	恒瑞医药	7,739	370,698.10	0.71
12	601398	工商银行	76,300	367,766.00	0.70
13	601288	农业银行	101,500	358,295.00	0.69
14	600309	万华化学	3,800	333,792.00	0.64
15	600030	中信证券	14,850	293,733.00	0.56
16	601138	工业富联	11,600	292,320.00	0.56
17	601668	中国建筑	50,800	291,592.00	0.56
18	002475	立讯精密	8,985	291,563.25	0.56
19	002714	牧原股份	6,810	287,041.50	0.55
20	601899	紫金矿业	25,000	284,250.00	0.54
21	688111	金山办公	600	283,332.00	0.54
22	600809	山西汾酒	1,520	281,306.40	0.54
23	601328	交通银行	47,600	276,080.00	0.53
24	300059	东方财富	19,236	273,151.20	0.52
25	603288	海天味业	5,763	269,996.55	0.52
26	601012	隆基绿能	9,293	266,430.31	0.51
27	601888	中国中免	2,400	265,272.00	0.51

28	000001	平安银行	23,500	263,905.00	0.51
29	002352	顺丰控股	5,800	261,522.00	0.50
30	600000	浦发银行	35,600	257,744.00	0.49
31	601088	中国神华	8,000	246,000.00	0.47
32	600028	中国石化	38,400	244,224.00	0.47
33	002304	洋河股份	1,802	236,692.70	0.45
34	600436	片仔癀	800	229,088.00	0.44
35	601601	中国太保	8,800	228,624.00	0.44
36	601225	陕西煤业	12,400	225,556.00	0.43
37	000063	中兴通讯	4,900	223,146.00	0.43
38	002371	北方华创	700	222,355.00	0.43
39	600406	国电南瑞	9,600	221,760.00	0.42
40	300274	阳光电源	1,900	221,597.00	0.42
41	600887	伊利股份	7,801	220,924.32	0.42
42	601816	京沪高铁	41,100	216,186.00	0.41
43	002142	宁波银行	8,513	215,378.90	0.41
44	300015	爱尔眼科	11,302	209,652.10	0.40
45	601766	中国中车	31,200	202,800.00	0.39
46	603259	药明康德	3,220	200,638.20	0.38
47	600048	保利发展	15,300	199,359.00	0.38
48	600905	三峡能源	36,700	197,079.00	0.38
49	000725	京东方 A	48,100	196,729.00	0.38
50	601857	中国石油	26,200	195,714.00	0.38
51	600050	中国联通	40,700	195,360.00	0.37
52	601390	中国中铁	25,100	190,258.00	0.36
53	600438	通威股份	5,500	188,705.00	0.36
54	600150	中国船舶	5,600	184,296.00	0.35
55	600690	海尔智家	7,600	178,448.00	0.34
56	002230	科大讯飞	2,600	176,696.00	0.34
57	000002	万 科 A	12,500	175,250.00	0.34
58	002459	晶澳科技	4,144	172,804.80	0.33
59	601658	邮储银行	35,100	171,639.00	0.33
60	002129	TCL 中环	5,125	170,150.00	0.33
61	600031	三一重工	10,200	169,626.00	0.33
62	600016	民生银行	45,194	169,477.50	0.32
63	601988	中国银行	42,200	165,002.00	0.32
64	601985	中国核电	23,400	164,970.00	0.32
65	300014	亿纬锂能	2,631	159,175.50	0.31
66	601818	光大银行	51,400	157,798.00	0.30
67	600019	宝钢股份	27,600	155,112.00	0.30
68	300498	温氏股份	8,400	154,140.00	0.30

69	601919	中远海控	16,270	152,938.00	0.29
70	002493	荣盛石化	12,650	147,246.00	0.28
71	603501	韦尔股份	1,470	144,118.80	0.28
72	600893	航发动力	3,400	143,684.00	0.28
73	600104	上汽集团	10,000	141,700.00	0.27
74	601006	大秦铁路	19,000	141,170.00	0.27
75	600919	江苏银行	18,930	139,135.50	0.27
76	000625	长安汽车	10,558	136,514.94	0.26
77	601211	国泰君安	9,700	135,703.00	0.26
78	000166	申万宏源	29,100	134,442.00	0.26
79	000792	盐湖股份	7,000	134,190.00	0.26
80	300896	爱美客	300	133,485.00	0.26
81	002466	天齐锂业	1,900	132,829.00	0.25
82	300308	中际旭创	900	132,705.00	0.25
83	300122	智飞生物	3,000	132,600.00	0.25
84	688036	传音控股	900	132,300.00	0.25
85	000651	格力电器	3,600	131,436.00	0.25
86	601688	华泰证券	9,500	130,815.00	0.25
87	601066	中信建投	5,400	130,680.00	0.25
88	001979	招商蛇口	9,980	130,039.40	0.25
89	600999	招商证券	9,560	129,729.20	0.25
90	002027	分众传媒	19,000	129,390.00	0.25
91	601669	中国电建	22,100	126,854.00	0.24
92	601628	中国人寿	3,600	125,856.00	0.24
93	688012	中微公司	800	125,160.00	0.24
94	000596	古井贡酒	500	123,690.00	0.24
95	002460	赣锋锂业	2,020	123,139.20	0.24
96	600585	海螺水泥	5,100	121,074.00	0.23
97	603993	洛阳钼业	22,600	120,458.00	0.23
98	688599	天合光能	2,800	119,308.00	0.23
99	601169	北京银行	25,700	118,991.00	0.23
100	000538	云南白药	2,220	116,505.60	0.22
101	002812	恩捷股份	1,200	115,620.00	0.22
102	000938	紫光股份	3,564	113,513.40	0.22
103	300316	晶盛机电	1,600	113,440.00	0.22
104	601689	拓普集团	1,400	112,980.00	0.22
105	688256	寒武纪	600	112,800.00	0.22
106	300124	汇川技术	1,750	112,367.50	0.22
107	600989	宝丰能源	8,900	112,229.00	0.22
108	601360	三六零	8,900	111,606.00	0.21
109	600547	山东黄金	4,700	110,356.00	0.21

110	000895	双汇发展	4,500	110,205.00	0.21
111	002920	德赛西威	700	109,067.00	0.21
112	600845	宝信软件	2,132	108,326.92	0.21
113	600837	海通证券	11,700	107,874.00	0.21
114	600346	恒力石化	7,500	107,475.00	0.21
115	000776	广发证券	7,200	105,912.00	0.20
116	600111	北方稀土	4,400	105,512.00	0.20
117	300033	同花顺	600	105,168.00	0.20
118	600089	特变电工	4,700	104,763.00	0.20
119	002709	天赐材料	2,540	104,622.60	0.20
120	600011	华能国际	11,100	102,786.00	0.20
121	600886	国投电力	8,100	102,465.00	0.20
122	000338	潍柴动力	8,200	102,172.00	0.20
123	601100	恒立液压	1,588	102,156.04	0.20
124	688223	晶科能源	7,200	101,232.00	0.19
125	601009	南京银行	12,600	100,800.00	0.19
126	002049	紫光国微	1,080	100,710.00	0.19
127	601229	上海银行	17,340	99,705.00	0.19
128	601336	新华保险	2,700	99,279.00	0.19
129	002311	海大集团	2,100	98,364.00	0.19
130	600010	包钢股份	54,900	98,271.00	0.19
131	600085	同仁堂	1,700	97,852.00	0.19
132	002555	三七互娱	2,800	97,664.00	0.19
133	000425	徐工机械	14,300	96,811.00	0.19
134	600703	三安光电	5,600	96,544.00	0.19
135	000963	华东医药	2,180	94,546.60	0.18
136	600600	青岛啤酒	900	93,267.00	0.18
137	600660	福耀玻璃	2,600	93,210.00	0.18
138	600570	恒生电子	2,095	92,787.55	0.18
139	600188	兖矿能源	3,100	92,752.00	0.18
140	000301	东方盛虹	7,800	92,196.00	0.18
141	603659	璞泰来	2,407	91,995.54	0.18
142	601868	中国能建	39,300	91,962.00	0.18
143	603799	华友钴业	1,990	91,360.90	0.18
144	000100	TCL 科技	22,770	89,713.80	0.17
145	601600	中国铝业	16,100	88,389.00	0.17
146	603986	兆易创新	824	87,550.00	0.17
147	600015	华夏银行	16,100	87,101.00	0.17
148	600926	杭州银行	7,400	86,950.00	0.17
149	600958	东方证券	8,932	86,640.40	0.17
150	600039	四川路桥	8,820	86,524.20	0.17

151	600588	用友网络	4,213	86,366.50	0.17
152	600795	国电电力	22,400	85,792.00	0.16
153	601995	中金公司	2,400	85,248.00	0.16
154	002236	大华股份	4,300	84,925.00	0.16
155	601618	中国中冶	21,300	84,561.00	0.16
156	603369	今世缘	1,600	84,480.00	0.16
157	603806	福斯特	2,251	83,714.69	0.16
158	600029	南方航空	13,800	83,214.00	0.16
159	000977	浪潮信息	1,708	82,838.00	0.16
160	601865	福莱特	2,100	80,871.00	0.15
161	605117	德业股份	540	80,757.00	0.15
162	688008	澜起科技	1,400	80,388.00	0.15
163	600196	复星医药	2,600	80,340.00	0.15
164	300413	芒果超媒	2,340	80,051.40	0.15
165	600426	华鲁恒升	2,610	79,944.30	0.15
166	002241	歌尔股份	4,400	78,100.00	0.15
167	601111	中国国航	9,400	77,456.00	0.15
168	601607	上海医药	3,400	76,194.00	0.15
169	601633	长城汽车	3,000	75,510.00	0.14
170	601788	光大证券	4,700	74,683.00	0.14
171	300408	三环集团	2,500	73,375.00	0.14
172	600745	闻泰科技	1,500	73,350.00	0.14
173	000999	华润三九	1,200	72,792.00	0.14
174	601939	建设银行	11,600	72,616.00	0.14
175	600741	华域汽车	3,900	71,994.00	0.14
176	300999	金龙鱼	1,800	71,982.00	0.14
177	601877	正泰电器	2,600	71,890.00	0.14
178	601319	中国人保	12,100	70,664.00	0.14
179	300433	蓝思科技	6,000	70,560.00	0.14
180	601727	上海电气	15,400	70,378.00	0.13
181	603260	合盛硅业	1,000	70,020.00	0.13
182	002602	世纪华通	9,220	69,979.80	0.13
183	600023	浙能电力	13,800	69,966.00	0.13
184	600176	中国巨石	4,914	69,582.24	0.13
185	601916	浙商银行	26,260	69,326.40	0.13
186	603833	欧派家居	720	68,976.00	0.13
187	601021	春秋航空	1,200	68,964.00	0.13
188	688303	大全能源	1,700	68,765.00	0.13
189	600584	长电科技	2,200	68,574.00	0.13
190	000661	长春高新	500	68,150.00	0.13
191	688396	华润微	1,300	68,133.00	0.13

192	600009	上海机场	1,500	68,130.00	0.13
193	600674	川投能源	4,500	67,725.00	0.13
194	002736	国信证券	7,700	67,221.00	0.13
195	000733	振华科技	700	67,095.00	0.13
196	002050	三花智控	2,200	66,572.00	0.13
197	600027	华电国际	9,900	66,231.00	0.13
198	601127	赛力斯	1,800	66,186.00	0.13
199	000983	山西焦煤	7,250	65,975.00	0.13
200	600115	中国东航	13,800	65,688.00	0.13
201	603392	万泰生物	983	65,634.91	0.13
202	600522	中天科技	4,100	65,231.00	0.13
203	600732	爱旭股份	2,100	64,575.00	0.12
204	000876	新希望	5,500	64,240.00	0.12
205	688169	石头科技	200	64,136.00	0.12
206	600233	圆通速递	4,400	64,064.00	0.12
207	601377	兴业证券	10,400	63,648.00	0.12
208	600875	东方电气	3,400	63,410.00	0.12
209	600221	海航控股	40,100	63,358.00	0.12
210	601825	沪农商行	11,600	63,220.00	0.12
211	601238	广汽集团	5,900	61,478.00	0.12
212	601117	中国化学	7,400	61,272.00	0.12
213	002074	国轩高科	2,200	60,764.00	0.12
214	002938	鹏鼎控股	2,500	60,725.00	0.12
215	300782	卓胜微	628	60,683.64	0.12
216	002841	视源股份	900	60,156.00	0.12
217	002600	领益智造	8,700	60,117.00	0.12
218	002252	上海莱士	8,000	60,080.00	0.12
219	601881	中国银河	5,100	59,211.00	0.11
220	300832	新产业	1,000	59,000.00	0.11
221	600415	小商品城	6,900	58,857.00	0.11
222	600803	新奥股份	3,100	58,838.00	0.11
223	601699	潞安环能	3,600	58,752.00	0.11
224	603345	安井食品	400	58,720.00	0.11
225	002001	新和成	3,800	58,520.00	0.11
226	002180	纳思达	1,700	58,225.00	0.11
227	000157	中联重科	8,600	58,050.00	0.11
228	300496	中科创达	600	57,810.00	0.11
229	002648	卫星化学	3,841	57,461.36	0.11
230	601872	招商轮船	9,900	57,321.00	0.11
231	300763	锦浪科技	550	57,255.00	0.11
232	603688	石英股份	500	56,920.00	0.11

233	300454	深信服	500	56,625.00	0.11
234	600079	人福医药	2,100	56,574.00	0.11
235	688126	沪硅产业	2,700	56,430.00	0.11
236	300724	捷佳伟创	500	56,175.00	0.11
237	300661	圣邦股份	682	56,012.66	0.11
238	300142	沃森生物	2,100	55,545.00	0.11
239	600132	重庆啤酒	600	55,296.00	0.11
240	601838	成都银行	4,500	54,945.00	0.11
241	600256	广汇能源	8,000	54,880.00	0.11
242	600061	国投资本	7,700	54,824.00	0.11
243	688777	中控技术	870	54,618.60	0.10
244	600460	士兰微	1,800	54,486.00	0.10
245	603486	科沃斯	700	54,439.00	0.10
246	002384	东山精密	2,100	54,390.00	0.10
247	600161	天坛生物	2,000	54,300.00	0.10
248	300628	亿联网络	1,540	54,007.80	0.10
249	000786	北新建材	2,200	53,922.00	0.10
250	300751	迈为股份	316	53,524.08	0.10
251	688363	华熙生物	600	53,496.00	0.10
252	000807	云铝股份	4,200	53,466.00	0.10
253	002422	科伦药业	1,800	53,424.00	0.10
254	600026	中远海能	4,200	53,088.00	0.10
255	300223	北京君正	600	52,986.00	0.10
256	601901	方正证券	8,100	52,974.00	0.10
257	688188	柏楚电子	280	52,796.80	0.10
258	600489	中金黄金	5,100	52,683.00	0.10
259	002821	凯莱英	440	51,858.40	0.10
260	603198	迎驾贡酒	800	51,040.00	0.10
261	600332	白云山	1,601	51,039.88	0.10
262	688099	晶晨股份	600	50,592.00	0.10
263	688009	中国通号	8,700	50,460.00	0.10
264	002738	中矿资源	980	49,921.20	0.10
265	002603	以岭药业	1,940	49,838.60	0.10
266	000066	中国长城	3,600	49,788.00	0.10
267	300003	乐普医疗	2,200	49,742.00	0.10
268	600702	舍得酒业	400	49,580.00	0.10
269	002601	龙佰集团	3,000	49,500.00	0.09
270	603737	三棵树	756	49,457.52	0.09
271	603444	吉比特	100	49,111.00	0.09
272	603899	晨光股份	1,100	49,104.00	0.09
273	600536	中国软件	1,040	48,755.20	0.09

274	600918	中泰证券	6,900	47,679.00	0.09
275	002463	沪电股份	2,270	47,533.80	0.09
276	002007	华兰生物	2,120	47,509.20	0.09
277	600362	江西铜业	2,500	47,450.00	0.09
278	603939	益丰药房	1,282	47,434.00	0.09
279	002916	深南电路	620	46,729.40	0.09
280	688390	固德威	280	46,720.80	0.09
281	688561	奇安信	900	46,629.00	0.09
282	600754	锦江酒店	1,100	46,574.00	0.09
283	601878	浙商证券	4,700	46,436.00	0.09
284	688122	西部超导	830	46,255.90	0.09
285	300759	康龙化成	1,200	45,936.00	0.09
286	300037	新宙邦	880	45,663.20	0.09
287	000988	华工科技	1,200	45,612.00	0.09
288	300146	汤臣倍健	1,900	45,562.00	0.09
289	600160	巨化股份	3,300	45,474.00	0.09
290	603882	金城医学	600	45,300.00	0.09
291	002756	永兴材料	720	45,079.20	0.09
292	002568	百润股份	1,236	44,928.60	0.09
293	002558	巨人网络	2,500	44,825.00	0.09
294	600018	上港集团	8,500	44,625.00	0.09
295	601958	金铂股份	4,000	44,600.00	0.09
296	002202	金风科技	4,175	44,338.50	0.08
297	300418	昆仑万维	1,100	44,308.00	0.08
298	603606	东方电缆	900	44,127.00	0.08
299	601615	明阳智能	2,600	43,888.00	0.08
300	002409	雅克科技	600	43,728.00	0.08
301	000729	燕京啤酒	3,500	43,645.00	0.08
302	688536	思瑞浦	200	43,600.00	0.08
303	688521	芯原股份	600	43,152.00	0.08
304	603290	斯达半导	200	43,040.00	0.08
305	600004	白云机场	3,000	43,020.00	0.08
306	000423	东阿阿胶	800	42,760.00	0.08
307	300604	长川科技	900	42,741.00	0.08
308	600219	南山铝业	14,100	42,582.00	0.08
309	002064	华峰化学	6,200	42,532.00	0.08
310	300919	中伟股份	700	42,175.00	0.08
311	600705	中航产融	11,000	42,130.00	0.08
312	600970	中材国际	3,300	42,075.00	0.08
313	002028	思源电气	900	42,048.00	0.08
314	600642	申能股份	6,000	41,940.00	0.08

315	601216	君正集团	10,200	41,820.00	0.08
316	601555	东吴证券	5,961	41,369.34	0.08
317	002430	杭氧股份	1,200	41,232.00	0.08
318	002625	光启技术	2,700	41,202.00	0.08
319	600563	法拉电子	300	41,190.00	0.08
320	600515	海南机场	10,100	41,006.00	0.08
321	601108	财通证券	5,640	40,833.60	0.08
322	000629	钒钛股份	10,400	40,664.00	0.08
323	000408	藏格矿业	1,800	40,626.00	0.08
324	002414	高德红外	5,225	40,598.25	0.08
325	002294	信立泰	1,300	40,547.00	0.08
326	002624	完美世界	2,400	40,536.00	0.08
327	000069	华侨城 A	9,200	40,480.00	0.08
328	603185	弘元绿能	540	40,257.00	0.08
329	000932	华菱钢铁	8,400	40,068.00	0.08
330	600109	国金证券	4,600	39,882.00	0.08
331	600606	绿地控股	14,500	39,875.00	0.08
332	601058	赛轮轮胎	3,500	39,865.00	0.08
333	600298	安琪酵母	1,100	39,831.00	0.08
334	002850	科达利	300	39,675.00	0.08
335	688063	派能科技	200	39,650.00	0.08
336	603596	伯特利	500	39,630.00	0.08
337	002223	鱼跃医疗	1,100	39,589.00	0.08
338	600487	亨通光电	2,700	39,582.00	0.08
339	603156	养元饮品	1,600	39,520.00	0.08
340	601077	渝农商行	11,000	39,490.00	0.08
341	002340	格林美	5,700	39,387.00	0.08
342	600884	杉杉股份	2,600	39,364.00	0.08
343	600157	永泰能源	27,600	39,192.00	0.08
344	002080	中材科技	1,900	38,988.00	0.07
345	600763	通策医疗	400	38,744.00	0.07
346	300144	宋城演艺	3,100	38,440.00	0.07
347	601233	桐昆股份	2,900	38,425.00	0.07
348	002156	通富微电	1,700	38,420.00	0.07
349	601966	玲珑轮胎	1,729	38,418.38	0.07
350	601577	长沙银行	4,900	38,024.00	0.07
351	000021	深科技	1,900	37,981.00	0.07
352	688220	翱捷科技	500	37,695.00	0.07
353	688516	奥特维	200	37,680.00	0.07
354	688187	时代电气	900	37,674.00	0.07
355	601990	南京证券	4,600	37,628.00	0.07

356	600096	云天化	2,200	37,554.00	0.07
357	603233	大参林	1,334	37,365.34	0.07
358	300390	天华新能	1,040	37,232.00	0.07
359	600153	建发股份	3,400	37,094.00	0.07
360	601799	星宇股份	300	37,080.00	0.07
361	002372	伟星新材	1,800	36,972.00	0.07
362	000723	美锦能源	4,900	36,946.00	0.07
363	600183	生益科技	2,600	36,920.00	0.07
364	002185	华天科技	4,000	36,800.00	0.07
365	600383	金地集团	5,100	36,771.00	0.07
366	603816	顾家家居	960	36,624.00	0.07
367	000738	航发控制	1,500	36,600.00	0.07
368	600177	雅戈尔	5,800	36,598.00	0.07
369	000975	银泰黄金	3,120	36,504.00	0.07
370	600352	浙江龙盛	3,900	36,465.00	0.07
371	002056	横店东磁	2,000	36,420.00	0.07
372	603658	安图生物	700	36,211.00	0.07
373	000032	深桑达 A	1,100	36,190.00	0.07
374	600546	山煤国际	2,500	36,175.00	0.07
375	600848	上海临港	3,020	36,089.00	0.07
376	000799	酒鬼酒	400	36,060.00	0.07
377	601155	新城控股	2,500	36,025.00	0.07
378	002128	电投能源	2,700	35,694.00	0.07
379	002153	石基信息	2,548	35,672.00	0.07
380	600998	九州通	3,427	35,572.26	0.07
381	300957	贝泰妮	400	35,552.00	0.07
382	603885	吉祥航空	2,300	35,489.00	0.07
383	600779	水井坊	600	35,394.00	0.07
384	000783	长江证券	6,100	35,380.00	0.07
385	300769	德方纳米	320	35,273.60	0.07
386	002032	苏泊尔	700	35,000.00	0.07
387	600486	扬农化工	400	34,968.00	0.07
388	600511	国药股份	900	34,965.00	0.07
389	688032	禾迈股份	98	34,804.70	0.07
390	603338	浙江鼎力	620	34,726.20	0.07
391	688180	君实生物	900	34,686.00	0.07
392	600985	淮北矿业	3,000	34,560.00	0.07
393	603589	口子窖	700	34,545.00	0.07
394	000027	深圳能源	5,240	34,531.60	0.07
395	603613	国联股份	935	34,529.55	0.07
396	600021	上海电力	3,200	34,464.00	0.07

397	600348	华阳股份	4,350	34,408.50	0.07
398	601231	环旭电子	2,300	34,408.00	0.07
399	000728	国元证券	5,270	34,360.40	0.07
400	300487	蓝晓科技	550	34,331.00	0.07
401	002405	四维图新	2,950	34,161.00	0.07
402	601991	大唐发电	10,300	34,093.00	0.07
403	301236	软通动力	1,250	34,012.50	0.07
404	600378	昊华科技	900	33,876.00	0.06
405	002044	美年健康	4,760	33,843.60	0.06
406	000009	中国宝安	2,800	33,796.00	0.06
407	600481	双良节能	2,400	33,552.00	0.06
408	000630	铜陵有色	11,600	33,524.00	0.06
409	300601	康泰生物	1,320	33,514.80	0.06
410	002531	天顺风能	2,200	33,506.00	0.06
411	300118	东方日升	1,300	33,319.00	0.06
412	603568	伟明环保	1,900	33,269.00	0.06
413	688728	格科微	2,100	33,222.00	0.06
414	600872	中炬高新	900	33,111.00	0.06
415	601696	中银证券	3,100	33,046.00	0.06
416	600873	梅花生物	3,700	33,041.00	0.06
417	300595	欧普康视	1,080	32,605.20	0.06
418	000831	中国稀土	1,100	32,560.00	0.06
419	000933	神火股份	2,500	32,500.00	0.06
420	601880	辽港股份	20,800	32,448.00	0.06
421	300347	泰格医药	500	32,270.00	0.06
422	002078	太阳纸业	3,000	32,070.00	0.06
423	002607	中公教育	6,800	31,960.00	0.06
424	600566	济川药业	1,100	31,944.00	0.06
425	002240	盛新锂能	1,000	31,870.00	0.06
426	600521	华海药业	1,720	31,665.20	0.06
427	002152	广电运通	2,700	31,644.00	0.06
428	002120	韵达股份	3,310	31,643.60	0.06
429	601933	永辉超市	10,100	31,613.00	0.06
430	002739	万达电影	2,500	31,350.00	0.06
431	002673	西部证券	4,900	31,115.00	0.06
432	300207	欣旺达	1,900	31,008.00	0.06
433	601168	西部矿业	2,900	30,479.00	0.06
434	600549	厦门钨业	1,600	30,448.00	0.06
435	300073	当升科技	600	30,198.00	0.06
436	002353	杰瑞股份	1,200	30,156.00	0.06
437	002939	长城证券	3,700	30,081.00	0.06

438	688385	复旦微电	600	30,060.00	0.06
439	300676	华大基因	500	29,995.00	0.06
440	002244	滨江集团	3,400	29,988.00	0.06
441	002385	大北农	4,500	29,700.00	0.06
442	300699	光威复材	960	29,616.00	0.06
443	000960	锡业股份	1,900	29,545.00	0.06
444	300395	菲利华	600	29,520.00	0.06
445	600655	豫园股份	4,300	29,498.00	0.06
446	600559	老白干酒	1,200	29,412.00	0.06
447	605358	立昂微	800	29,384.00	0.06
448	600598	北大荒	2,200	29,326.00	0.06
449	000591	太阳能	4,300	29,154.00	0.06
450	300251	光线传媒	3,600	29,124.00	0.06
451	000987	越秀资本	4,582	29,095.70	0.06
452	603529	爱玛科技	900	28,998.00	0.06
453	600141	兴发集团	1,300	28,886.00	0.06
454	300438	鹏辉能源	600	28,824.00	0.06
455	000513	丽珠集团	740	28,793.40	0.06
456	000683	远兴能源	4,000	28,760.00	0.06
457	600583	海油工程	4,900	28,665.00	0.05
458	000800	一汽解放	3,400	28,458.00	0.05
459	600988	赤峰黄金	2,100	28,266.00	0.05
460	601198	东兴证券	3,500	28,070.00	0.05
461	000703	恒逸石化	4,140	28,069.20	0.05
462	002518	科士达	700	28,007.00	0.05
463	600038	中直股份	700	27,874.00	0.05
464	002268	电科网安	1,000	27,870.00	0.05
465	002508	老板电器	1,100	27,819.00	0.05
466	600704	物产中大	5,600	27,664.00	0.05
467	603858	步长制药	1,340	27,590.60	0.05
468	603456	九洲药业	1,000	27,380.00	0.05
469	603712	七一二	900	27,189.00	0.05
470	600699	均胜电子	1,540	27,165.60	0.05
471	000519	中兵红箭	1,500	27,135.00	0.05
472	688005	容百科技	500	27,010.00	0.05
473	002465	海格通信	2,600	26,884.00	0.05
474	002831	裕同科技	1,100	26,829.00	0.05
475	002299	圣农发展	1,400	26,810.00	0.05
476	600380	健康元	2,100	26,691.00	0.05
477	300212	易华录	800	26,584.00	0.05
478	601866	中远海发	10,700	26,429.00	0.05

479	600516	方大炭素	4,252	26,362.40	0.05
480	600369	西南证券	7,200	26,280.00	0.05
481	002407	多氟多	1,320	26,215.20	0.05
482	002966	苏州银行	4,000	26,200.00	0.05
483	603517	绝味食品	700	26,005.00	0.05
484	002791	坚朗五金	400	25,884.00	0.05
485	601636	旗滨集团	3,000	25,860.00	0.05
486	600170	上海建工	9,600	25,824.00	0.05
487	002797	第一创业	4,500	25,740.00	0.05
487	600392	盛和资源	2,000	25,740.00	0.05
489	601016	节能风电	6,960	25,543.20	0.05
490	000709	河钢股份	11,200	25,312.00	0.05
491	000893	亚钾国际	1,100	25,234.00	0.05
492	002532	天山铝业	4,200	25,158.00	0.05
493	002176	江特电机	2,100	25,032.00	0.05
494	002145	中核钛白	4,245	25,003.05	0.05
495	300568	星源材质	1,450	24,925.50	0.05
496	688779	长远锂科	2,200	24,794.00	0.05
497	000050	深天马 A	2,700	24,786.00	0.05
498	002065	东华软件	3,500	24,710.00	0.05
499	603707	健友股份	1,829	24,691.50	0.05
500	600258	首旅酒店	1,300	24,635.00	0.05
501	600688	上海石化	7,900	24,569.00	0.05
502	000155	川能动力	1,700	24,480.00	0.05
503	300373	扬杰科技	600	24,342.00	0.05
504	000937	冀中能源	3,800	24,244.00	0.05
505	300558	贝达药业	500	24,015.00	0.05
506	000825	太钢不锈	6,200	23,994.00	0.05
507	002541	鸿路钢构	830	23,912.30	0.05
508	600499	科达制造	2,100	23,856.00	0.05
509	002507	涪陵榨菜	1,300	23,803.00	0.05
510	600673	东阳光	3,300	23,793.00	0.05
511	601456	国联证券	2,600	23,660.00	0.05
512	600056	中国医药	1,820	23,623.60	0.05
513	603077	和邦生物	9,700	23,571.00	0.05
514	002926	华西证券	2,800	23,268.00	0.04
515	000830	鲁西化工	2,200	23,232.00	0.04
516	002266	浙富控股	5,600	23,128.00	0.04
517	002497	雅化集团	1,300	23,114.00	0.04
518	000739	普洛药业	1,300	23,062.00	0.04
519	603218	日月股份	1,200	22,788.00	0.04

520	688301	奕瑞科技	80	22,594.40	0.04
521	300529	健帆生物	970	22,484.60	0.04
522	688002	睿创微纳	500	22,400.00	0.04
523	002487	大金重工	700	21,588.00	0.04
524	002138	顺络电子	900	21,519.00	0.04
525	000998	隆平高科	1,400	21,490.00	0.04
526	002500	山西证券	3,800	21,204.00	0.04
527	000401	冀东水泥	2,800	20,636.00	0.04
528	603127	昭衍新药	496	20,286.40	0.04
529	300357	我武生物	600	20,178.00	0.04
530	600338	西藏珠峰	1,100	20,086.00	0.04
531	002192	融捷股份	300	20,049.00	0.04
532	601666	平煤股份	2,600	19,604.00	0.04
533	603866	桃李面包	1,906	19,288.72	0.04
534	002408	齐翔腾达	3,000	19,110.00	0.04
535	601992	金隅集团	8,700	18,966.00	0.04
536	600801	华新水泥	1,500	18,525.00	0.04
537	600885	宏发股份	580	18,473.00	0.04
538	300363	博腾股份	600	17,754.00	0.03
539	002092	中泰化学	2,700	17,415.00	0.03
540	002030	达安基因	1,680	16,749.60	0.03
541	603893	瑞芯微	100	7,285.00	0.01

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	600519	贵州茅台	3,192,345.00	12.30
2	300750	宁德时代	1,297,829.62	5.00
3	000858	五粮液	960,067.00	3.70
4	600036	招商银行	939,108.00	3.62
5	601318	中国平安	659,131.00	2.54
6	600900	长江电力	642,926.00	2.48
7	002594	比亚迪	601,840.00	2.32
8	601888	中国中免	501,540.00	1.93
9	601166	兴业银行	498,980.00	1.92
10	300760	迈瑞医疗	462,273.00	1.78

11	000568	泸州老窖	459,430.00	1.77
12	600809	山西汾酒	445,532.00	1.72
13	601012	隆基绿能	410,623.00	1.58
14	603288	海天味业	408,558.00	1.57
15	600309	万华化学	402,421.00	1.55
16	300059	东方财富	395,152.00	1.52
17	601398	工商银行	393,805.00	1.52
18	601288	农业银行	357,811.00	1.38
19	000001	平安银行	348,210.00	1.34
20	601668	中国建筑	344,116.00	1.33

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	600519	贵州茅台	1,769,497.00	6.82
2	300750	宁德时代	720,015.00	2.77
3	000858	五粮液	558,390.00	2.15
4	600036	招商银行	497,103.00	1.92
5	600900	长江电力	362,700.00	1.40
6	601318	中国平安	353,759.00	1.36
7	002594	比亚迪	329,312.00	1.27
8	601888	中国中免	302,070.00	1.16
9	601166	兴业银行	296,698.00	1.14
10	300059	东方财富	256,163.00	0.99
11	600809	山西汾酒	250,878.00	0.97
12	300760	迈瑞医疗	244,891.00	0.94
13	000568	泸州老窖	244,669.00	0.94
14	603288	海天味业	235,999.00	0.91
15	688111	金山办公	234,108.00	0.90
16	601398	工商银行	233,083.00	0.90
17	601012	隆基绿能	229,568.00	0.88
18	600309	万华化学	223,254.00	0.86
19	300124	汇川技术	217,946.00	0.84
20	601288	农业银行	213,658.00	0.82

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	51,605,704.28
卖出股票收入（成交）总额	26,700,725.48

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,516,788.90	2.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,516,788.90	2.91

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	019688	22 国债 23	15,000	1,516,788.90	2.91

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的金融衍生品。本基金投资股指期货主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过股指期货多头进行现货替代及赚取超额收益，并利用股

指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本，降低大额申购赎回对基金的影响，达到有效跟踪标的指数的目的。我们将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。考虑到本基金跟踪的 MSCI 中国 A 股指数与 IF 合约跟踪的沪深 300 指数存在一定的偏离，我们会根据实际情况对成份股持仓进行调整，以达到更好的跟踪目标指数的目的。

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。后续我们密切关注期货市场表现情况及跟踪误差情况，决定是否继续投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

报告期末，本基金投资的前十名证券除“中国平安（证券代码 601318）”、“招商银行（证券代码 600036）”、“兴业银行（证券代码 601166）”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规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	153,688.04
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	103,988.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	257,676.15

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	642	16,549.45	1,803,539.60	16.97%	8,821,209.43	83.03%
前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C	1,115	27,397.35	7,767,423.69	25.43%	22,780,625.06	74.57%
合计	1,757	23,433.58	9,570,963.29	23.25%	31,601,834.49	76.75%

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	268,197.97	2.5243%
	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C	113,390.16	0.3712%
	合计	381,588.13	0.9268%

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、基金投资和研发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	10~50
	前海开源 MSCI 中国 A 股指数 C	0
	合计	10~50

§ 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	7,077,284.18	13,029,032.14
本报告期基金总申购份额	4,259,185.04	42,471,657.02
减：本报告期基金总赎回份额	711,720.19	24,952,640.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	10,624,749.03	30,548,048.75

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

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

本报告期无涉及基金管理人、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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
德邦证券	2	78,180,434.83	100.00%	57,176.14	100.00%	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-

申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中国国际 金融	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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	2,211,213.69	100.00%	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证	-	-	-	-	-	-	-	-

券									
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023年01月20日
2	前海开源基金管理有限公司关于旗下基金定期定额投资业务起点金额的公告	中国证监会规定媒介	2023年02月08日
3	前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023年03月31日
4	前海开源基金管理有限公司关于变更公司官方电子直销交易平台 APP 名称的公告	中国证监会规定媒介	2023年03月31日
5	前海开源 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023年04月22日
6	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过蚂蚁（杭州）基金销售有限公司办理业务最低限额的公告	中国证监会规定媒介	2023年05月04日
7	前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过上海中欧财富基金销售有限公司办理业务最低限额的公告	中国证监会规定媒介	2023年05月15日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230327-20230405	-	11,342,155.01	11,342,155.01	-	-
产品特有风险							
<p>1. 巨额赎回风险</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>2. 转换运作方式或终止基金合同的风险</p> <p>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；</p> <p>3. 流动性风险</p> <p>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；</p> <p>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。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证券监督管理委员会批准前海开源 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指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人前海开源基金管理有限公司，客户服务电话：
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
2023 年 08 月 31 日