

景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券 投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）起至 2024 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	13
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22

§ 8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	61
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	61
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	61
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	62
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
8.12 投资组合报告附注	62
§ 9 基金份额持有人信息	63
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
9.2 期末上市基金前十名持有人	63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	64
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	64
§ 10 开放式基金份额变动	64
§ 11 重大事件揭示	65
11.1 基金份额持有人大会决议	65
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
11.4 基金投资策略的改变	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
11.8 其他重大事件	66
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	68
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§ 13 备查文件目录	69
13.1 备查文件目录	69
13.2 存放地点	69
13.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城中证 A500ETF
场内简称	中证 A500ETF 景顺
基金主代码	159353
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 9 月 24 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	15,038,161,812.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 10 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，以期获得与标的指数收益相似的回报。
投资策略	1、股票投资策略 本基金以中证 A500 指数为标的指数，采用完全复制法，即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。 2、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。 3、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。基金投资股票期权符合基金合同约定的比例限制（如股票仓位、个股占比等）、投资目标和风险收益特征。 4、存托凭证投资策略 本基金的存托凭证投资将根据本基金的投资目标和上述股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，通过定性和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 5、债券投资策略 出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。 6、可转换债券投资策略和可交换债券投资策略

	A) 相对价值分析：基金管理人根据定期公布的宏观和金融数据以及对宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，判断下一阶段的市场走势，分析可转换债券和可交换债券的股性和债性的相对价值。 B) 基本面研究：基金管理人依据内、外部研究成果，运用景顺长城股票研究数据库（SRD）对可转换债券和可交换债券标的公司进行多方位、多角度的分析，重点选择行业景气度较高、公司基本面素质优良的标的公司。 C) 估值分析：在基本面分析的基础上，运用 PE、PB、PCF、EV/EBITDA、PEG 等相对估值指标以及 DCF、DDM 等绝对估值方法对标的公司的股票价值进行评估，并根据标的股票的当前价格和目标价格，运用期权定价模型分别计算可转换债券和可交换债券当前的理论价格和未来目标价格，进行投资决策。 7、融资及转融通证券出借业务投资策略 本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。 参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。 8、资产支持证券投资策略 本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	郭明
	联系电话	0755-82370388	(010) 66105799
	电子邮箱	investor@igwfm.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008888606	95588
传真		0755-22381339	(010) 66105798
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		李进	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）-2024 年 12 月 31 日
本期已实现收益	10,034,763.74
本期利润	-422,066,747.33
加权平均基金份额本期利润	-0.0403
本期加权平均净值利润率	-4.09%
本期基金份额净值增长率	-2.82%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末
期末可供分配利润	-423,940,285.59
期末可供分配基金份额利润	-0.0282
期末基金资产净值	14,614,221,526.41
期末基金份额净值	0.9718
3.1.3 累计期末指标	2024 年末
基金份额累计净值增长率	-2.82%

注：1、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。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

4、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。

5、本基金基金合同生效日为 2024 年 09 月 24 日。

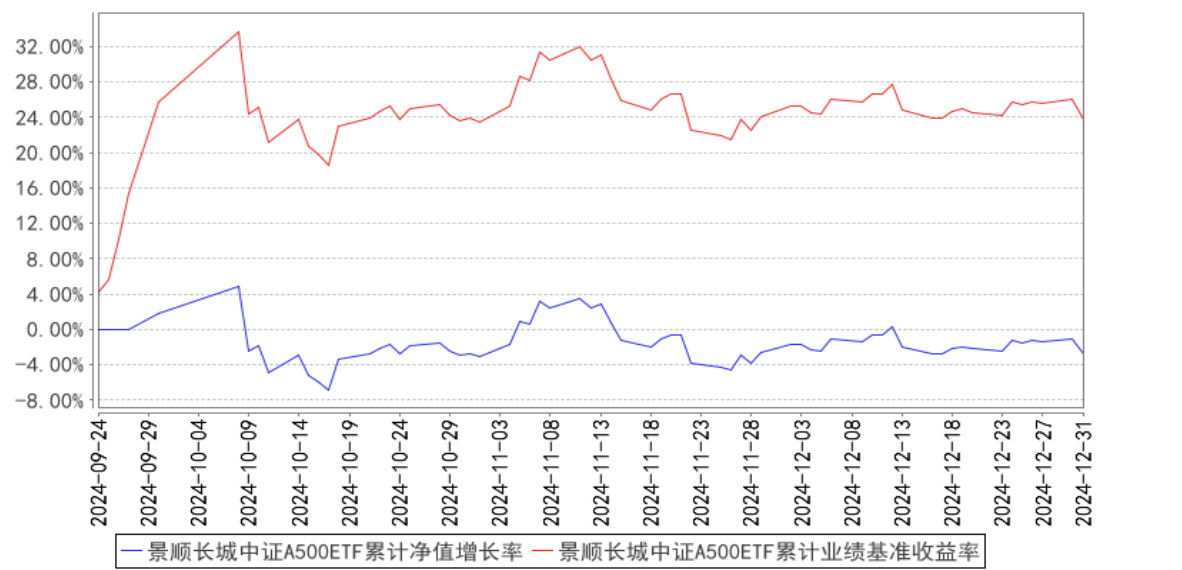
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-4.54%	1.62%	-1.62%	1.78%	-2.92%	-0.16%
自基金合同生效起至今	-2.82%	1.57%	23.70%	2.23%	-26.52%	-0.66%

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

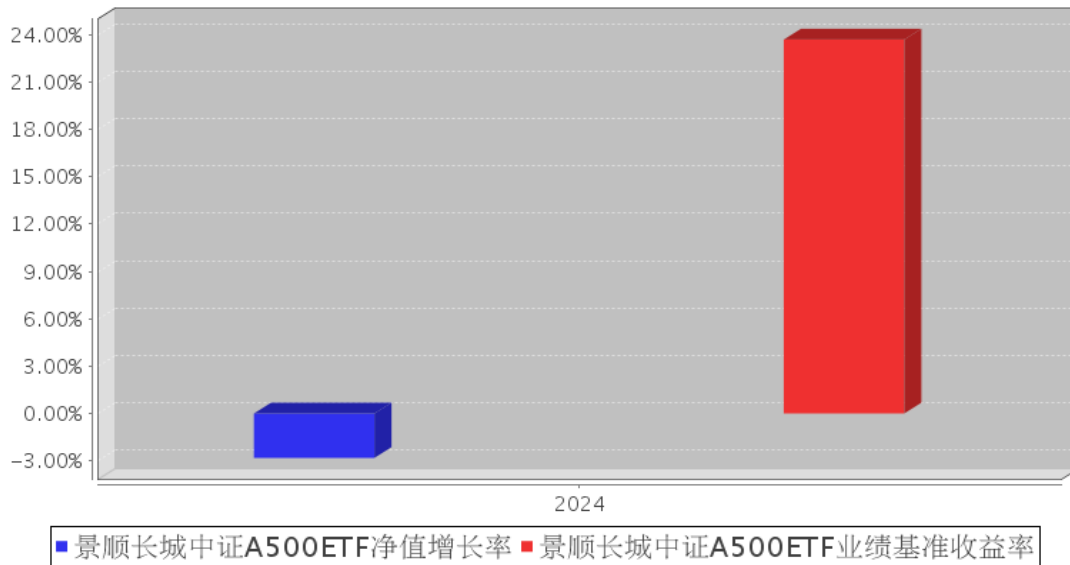
景顺长城中证A500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的建仓期为自 2024 年 9 月 24 日基金合同生效日起 6 个月。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2024 年 9 月 24 日）起至本报告期末不满一年。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城中证A500ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2024 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间为 2024 年 09 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2024年09月24日（基金合同生效日）至本报告期末未进行利润分配。

§ 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

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII等业务资格，截至2024年12月31日，本公司旗下共管理191只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产

配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

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		
张 晓 南	本基金的基金经理	2024 年 9 月 24 日	-	14 年	经济学硕士，CFA，FRM。曾任鹏华基金管理有限公司产品规划部高级产品设计师，兴银基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资部基金经理。2020 年 2 月加入本公司，自 2020 年 4 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理。具有 14 年证券、基金行业从业经验。
龚 丽 丽	本基金的基金经理	2024 年 9 月 24 日	-	13 年	理学硕士。曾任华泰柏瑞基金管理有限公司指数投资部研究员、基金经理助理、基金经理，申万菱信基金管理有限公司指数投资部负责人、基金经理。2022 年 3 月加入本公司，担任 ETF 与创新投资部副总经理，自 2023 年 11 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理，现任 ETF 与创新投资部副总经理、基金经理，兼任投资经理。具有 13 年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
龚丽丽	公募基金	11	31,966,324,058.61	2023 年 11 月 15 日
	私募资产管理计划	1	271,407,831.21	2023 年 12 月 27 日
	其他组合	-	-	-
	合计	12	32,237,731,889.82	-

注：龚丽丽女士所管理的景顺长城国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金于 2024 年 11 月 21 日完成清算及剩余财产分配程序。

4.1.4 基金经理薪酬机制

兼任基金经理薪酬激励与其所管理的私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂

钩；公司对兼任基金经理进行考核，结合其中长期产品业绩、投研专业能力、风险控制及合规表现等综合确定最终考核结果，并根据最终考核结果对其薪酬激励进行评定。

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、《景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的交易指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，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投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本基金的基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，建立了相关制度及流程，并对同一基金经理兼任私募资产管理计划投资经理管理的多个投资组合加强交易管理、监控和分析，防范不公平交易行为。本报告期内，本基金管理人对不同的时间窗下同向交易和反向交易的交易价差进行监控和分析，并结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析，未发现不公平交易的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 26 次，均为指数量化投资组合因投资策略

需要而发生的同日反向交易。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

在 2024 年上半年表现不佳后，随着 9 月末一系列重磅会议的召开及政策的面试，市场出现了明显的回暖。主要宽基指数有一定程度分化，宽基指数涨跌幅及排序为：科创 50(16.07%)>沪深 300(14.68%)>上证指数(12.67%)>创业板综(9.63%)>中小 100(6.01%)。市值维度，全年维度大盘占据较大优势，规模指数涨跌幅及排序为：沪深 300(14.68%)>中证 500(5.46%)>中证 1000(1.20%)。风格维度，中信风格指数涨跌幅及排序为：金融(33.36%)>稳定(17.32%)>成长(7.38%)>周期(7.31%)>消费(-2.23%)。行业维度，涨跌幅排前五行业为：银行(34.39%)>非银金融(30.17%)>通信(28.82%)>家用电器(25.44%)>电子(18.52%)，排后五行业为：医药生物(-14.33%)>农林牧渔(-11.58%)>美容护理(-10.34%)>食品饮料(-8.03%)>轻工制造(-6.01%)。

宏观数据层面，主要经济活动指标：12 月工业增加值同比增长 6.2%，前值 5.4%；12 月社会消费品零售总额同比增长 3.7%，前值 3%。通胀指标：12 月 PPI 同比-2.3%，前值-2.5%；12 月 CPI 同比 0.5%，前值 0.2%。货币金融指标：12 月 M2 同比增长 7.3%，前值 7.1%；12 月社会融资规模同比增长 8.0%，前值 7.8%。总体来看，增长斜率保持稳定，继续保持良好的复苏态势，同时通胀仍处在低位区间运行。

本基金采用复制标的指数的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。在报告期内，本基金结合申购赎回情况、标的指数成分调整情况定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为-2.82%，业绩比较基准收益率为 23.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

权益市场的长期趋势反映上市公司总体盈利能力的逐步提升，背后的驱动力是经济长期增长动能以及科技升级、产业升级带来的生产力提升。虽然 2024 年四季度市场出现反弹，但当前主要宽基指数估值水平仍处在中位数以下水平，市场仍在等待政策落地及企业盈利的改善，在经济复苏大背景下，权益市场配置价值凸显。在科技领先但市场仍未确定明显主线时，宽基指数仍是较优选择。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规

章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI (Key Performance Indicator 主要绩效指标) 为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后继教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

截至本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，经本基金管理人研究决定暂不实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他

法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2025）审字第 70015711_H87 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表,包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表,2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
其他信息	景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金管理层

	对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计

	报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	黄拥璇
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2025 年 3 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	7.4.7.1	173,362,591.28
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	14,497,164,092.22
其中：股票投资		14,497,164,092.22
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	7.4.7.6	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-
应收清算款		51,428.07
应收股利		-
应收申购款		-

递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		14,670,578,111.57
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,946,087.95
应付托管费		648,695.96
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	53,761,801.25
负债合计		56,356,585.16
净资产:		
实收基金	7.4.7.10	15,038,161,812.00
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	-423,940,285.59
净资产合计		14,614,221,526.41
负债和净资产总计		14,670,578,111.57

注：（1）报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 0.9718 元，基金份额总额 15,038,161,812.00 份。

（2）本财务报表的实际编制期间为 2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日） 至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-416,615,530.43
1. 利息收入		193,033.22

其中：存款利息收入	7.4.7.13	193,033.22
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）		17,479,534.58
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-7,606,692.70
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-
股利收益	7.4.7.19	25,086,227.28
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-432,101,511.07
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-2,186,587.16
减：二、营业总支出		5,451,216.90
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,979,855.22
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,326,618.38
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.23	144,743.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-422,066,747.33
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-422,066,747.33
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-422,066,747.33

7.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,000,161,812.00	-	-	2,000,161,812.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	13,038,000,000.00	-	-423,940,285.59	12,614,059,714.41
（一）、综合收益总额	-	-	-422,066,747.33	-422,066,747.33
（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）	13,038,000,000.00	-	-1,873,538.26	13,036,126,461.74
其中：1. 基金申购款	15,315,000,000.00	-	-31,067,766.16	15,283,932,233.84
2. 基金赎回款	-2,277,000,000.00	-	29,194,227.90	-2,247,805,772.10
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	15,038,161,812.00	-	-423,940,285.59	14,614,221,526.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

基金管理人负责人

吴建军

主管会计工作负责人

邵媛媛

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2024]1267 号文《关于准予景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由景顺长城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《景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2024 年 9 月 24 日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,999,999,944.00 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 169,636.78 元，其中人民币 161,868.00 元折合基金份额 161,868.00 份，剩余人民币 7,768.78 元归入基金财产，以上实收基金（本息）合计为人民币 2,000,161,812.00 元，折合 2,000,161,812.00 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同），此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、衍生工具（股指期货、股票期权等）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、公开发行的次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及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的相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。

基金的投资组合比例为：基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。

本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2025 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

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

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

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

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

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

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

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

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

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且

符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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

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

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资

产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。在基金收益评价日，本基金的基金管理人以基金净值增长率和标的指数同期增长率进行计算。基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率时，基金管理人可以进行收益分配。本基金收益分配后基金份额净值有可能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- （1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- （2）能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- （3）能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

(1) 增值税及附加

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基

金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

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 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

（3）个人所得税

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

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

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

（4）印花税（如适用）

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

实施减半征收。

(5) 境外投资

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	18,113,926.44
等于：本金	18,112,163.79
加：应计利息	1,762.65
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1 个月（含）-3 个月	-
存款期限 3 个月（含）至 1 年	-
存款期限 1 年（含）以上	-
其他存款	155,248,664.84
等于：本金	155,245,068.51
加：应计利息	3,596.33
减：坏账准备	-
合计	173,362,591.28

注：其他存款为存放在证券经纪商经纪专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		14,929,265,603.29	-	14,497,164,092.22	-432,101,511.07
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		14,929,265,603.29	-	14,497,164,092.22	-432,101,511.07

注：股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	144,262.30
应退替代款	53,605,087.55
可退替代款	12,451.40
合计	53,761,801.25

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,000,161,812.00	2,000,161,812.00
本期申购	15,315,000,000.00	15,315,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,277,000,000.00	-2,277,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	15,038,161,812.00	15,038,161,812.00

注：本基金合同于 2024 年 9 月 24 日生效。首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 1,999,999,944.00 元，折合 1,999,999,944.00 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 161,868.00 元，折合 161,868.00 份基金份额。以上收到的实

收基金共计人民币 2,000,161,812.00 元，折合 2,000,161,812.00 份基金份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	10,034,763.74	-432,101,511.07	-422,066,747.33
本期基金份额交易产生的变动数	-4,185,030.11	2,311,491.85	-1,873,538.26
其中：基金申购款	-3,051,655.60	-28,016,110.56	-31,067,766.16
基金赎回款	-1,133,374.51	30,327,602.41	29,194,227.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,849,733.63	-429,790,019.22	-423,940,285.59

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	44,886.83
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	140,377.65
结算备付金利息收入	-
其他	7,768.74
合计	193,033.22

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年9月24日（基金合同生效日）至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,085,960.68
股票投资收益——赎回差价收入	-9,692,653.38
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-

合计	-7,606,692.70
----	---------------

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年9月24日（基金合同生效日）至2024年12月31日
卖出股票成交总额	3,092,427,457.61
减：卖出股票成本总额	3,084,881,744.06
减：交易费用	5,459,752.87
买卖股票差价收入	2,085,960.68

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年9月24日（基金合同生效日）至2024年12月31日
赎回基金份额对价总额	2,247,805,772.10
减：现金支付赎回款总额	1,304,006,935.10
减：赎回股票成本总额	953,491,490.38
减：交易费用	-
赎回差价收入	-9,692,653.38

7.4.7.14.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	25,086,227.28
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	25,086,227.28

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-432,101,511.07
股票投资	-432,101,511.07
债券投资	-
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	-432,101,511.07

注：公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益。

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-

替代损益	-2,186,587.16
合计	-2,186,587.16

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

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00
信息披露费	40,000.00
证券出借违约金	-
银行划款手续费	81.00
其他	400.00
IOPV 数据费	4,262.30
注册登记费	50,000.00
合计	144,743.30

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司
景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“景顺长城中证 A500ETF 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期末未有应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,979,855.22
其中：应支付销售机构的客户维护费	308,992.98
应支付基金管理人的净管理费	3,670,862.24

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

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,326,618.38

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期无支付给各关联方的销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期末与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期末与关联方发生转融通证券出借业务交易。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2024 年 9 月 24 日）持有的基金份额	16,376,951.00
报告期初持有的基金份额	—
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	16,376,951.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.11%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额；

2、投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
长城证券	91,699,017.00	0.61
景顺长城中证A500ETF联接	5,616,960,808.00	37.35

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期	18, 113, 926. 44	44, 886. 83

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：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
001391	国货航	2024 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	2. 30	6. 80	4, 686	10, 777. 80	31, 864. 80	-
301585	蓝宇股份	2024 年 12 月 10 日	6 个月	新股流通受限	23. 95	35. 85	210	5, 029. 50	7, 528. 50	-
301617	博苑股份	2024 年 12 月 3 日	6 个月	新股流通受限	27. 76	39. 79	253	7, 023. 28	10, 066. 87	-
301622	英思特	2024 年 11 月 26 日	6 个月	新股流通受限	22. 36	44. 92	306	6, 842. 16	13, 745. 52	-
301631	壹连科技	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股流通受限	72. 99	101. 96	153	11, 167. 47	15, 599. 88	-

603072	天和磁材	2024年12月24日	1个月内(含)	新股流通受限	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月	新股流通受限	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
688449	联芸科技	2024年11月20日	6个月	新股流通受限	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-
688605	先锋精科	2024年12月4日	6个月	新股流通受限	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688708	佳驰科技	2024年11月27日	6个月	新股流通受限	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-

7.4.12.2 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
002252	上海莱士	2024年12月23日	重大事项停牌	7.22	2025年1月7日	6.93	2,959,100	22,398,825.80	21,364,702.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。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，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险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，另一

方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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综合持仓集中度指标、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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内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%，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该比例限制）。

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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	173,362,591.28	-	-	-	-	-	173,362,591.28
交易性金融资产	-	-	-	-	-	14,497,164,092.22	14,497,164,092.22
应收清算款	-	-	-	-	-	51,428.07	51,428.07
资产总计	173,362,591.28	-	-	-	-	14,497,215,520.29	14,670,578,111.57
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,946,087.95	1,946,087.95
应付托管费	-	-	-	-	-	648,695.96	648,695.96
其他负债	-	-	-	-	-	53,761,801.25	53,761,801.25
负债总计	-	-	-	-	-	56,356,585.16	56,356,585.16
利率敏感度缺口	173,362,591.28	-	-	-	-	-	-

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格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。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	14,497,164,092.22	99.20
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	14,497,164,092.22	99.20

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2024 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	590,495,503.69
	沪深 300 指数下降 5%	-590,495,503.69

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	14,475,573,336.59
第二层次	21,392,438.50
第三层次	198,317.13
合计	14,497,164,092.22

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	86,179.87	86,179.87
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	112,137.26	112,137.26
其中：计入损益的利得或损失	-	112,137.26	112,137.26
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	198,317.13	198,317.13
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期	-	112,137.26	112,137.26

损益的未实现利得或 损失的变动——公允 价值变动损益			
----------------------------------	--	--	--

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

单位：人民币元

项目	本期末公允 价值	采用的估值 技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均 值	与公允价值之 间的关系
限售股票	198,317.13	平均价格亚 式期权模型	预期波动率	1.4783-2.8129	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	14,497,164,092.22	98.82
	其中：股票	14,497,164,092.22	98.82
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	173,362,591.28	1.18
8	其他各项资产	51,428.07	-
9	合计	14,670,578,111.57	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	74,871,023.00	0.51
B	采矿业	672,619,073.00	4.60
C	制造业	8,617,313,278.26	58.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	492,316,880.00	3.37
E	建筑业	298,438,460.55	2.04
F	批发和零售业	95,556,144.00	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	514,552,261.00	3.52
H	住宿和餐饮业	14,140,951.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	918,430,493.66	6.28
J	金融业	2,192,711,159.87	15.00
K	房地产业	155,589,781.00	1.06
L	租赁和商务服务业	157,989,702.00	1.08
M	科学研究和技术服务业	143,781,260.00	0.98
N	水利、环境和公共设施管理业	38,676,406.00	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	10,761,340.00	0.07
Q	卫生和社会工作	62,748,541.25	0.43
R	文化、体育和娱乐业	36,441,284.00	0.25
S	综合	-	-
	合计	14,496,938,038.59	99.20

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	152,796.19	0.00
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	31,864.80	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,392.64	0.00
J	金融业	-	-
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	226,053.63	0.00

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	402,250	613,029,000.00	4.19
2	300750	宁德时代	1,695,360	450,965,760.00	3.09
3	601318	中国平安	6,901,500	363,363,975.00	2.49
4	600036	招商银行	7,937,300	311,935,890.00	2.13
5	000333	美的集团	3,136,500	235,927,530.00	1.61
6	600900	长江电力	7,844,900	231,816,795.00	1.59
7	300059	东方财富	8,099,168	209,120,517.76	1.43
8	600030	中信证券	6,258,032	182,546,793.44	1.25
9	601166	兴业银行	9,324,800	178,663,168.00	1.22
10	000858	五粮液	1,243,186	174,095,767.44	1.19
11	002594	比亚迪	581,200	164,281,992.00	1.12
12	601899	紫金矿业	10,563,400	159,718,608.00	1.09
13	601398	工商银行	22,477,200	155,542,224.00	1.06
14	002475	立讯精密	3,242,498	132,164,218.48	0.90
15	600276	恒瑞医药	2,862,879	131,406,146.10	0.90
16	000651	格力电器	2,873,100	130,582,395.00	0.89
17	600887	伊利股份	4,083,000	123,224,940.00	0.84
18	688981	中芯国际	1,273,874	120,533,957.88	0.82
19	601328	交通银行	15,103,500	117,354,195.00	0.80
20	601816	京沪高铁	18,894,600	116,390,736.00	0.80
21	601288	农业银行	20,473,000	109,325,820.00	0.75
22	000725	京东方A	23,695,700	104,024,123.00	0.71
23	300760	迈瑞医疗	388,100	98,965,500.00	0.68
24	600919	江苏银行	9,414,500	92,450,390.00	0.63
25	601088	中国神华	2,115,800	91,994,984.00	0.63
26	688041	海光信息	599,578	89,810,788.62	0.61
27	688256	寒武纪	134,607	88,571,406.00	0.61
28	603259	药明康德	1,604,400	88,306,176.00	0.60

29	600309	万华化学	1,209,200	86,276,420.00	0.59
30	000063	中兴通讯	2,066,800	83,498,720.00	0.57
31	300124	汇川技术	1,380,500	80,869,690.00	0.55
32	002371	北方华创	205,404	80,312,964.00	0.55
33	601668	中国建筑	13,341,500	80,049,000.00	0.55
34	600000	浦发银行	7,529,583	77,479,409.07	0.53
35	601601	中国太保	2,196,000	74,839,680.00	0.51
36	601988	中国银行	13,516,500	74,475,915.00	0.51
37	000001	平安银行	6,221,020	72,785,934.00	0.50
38	002415	海康威视	2,367,800	72,691,460.00	0.50
39	601728	中国电信	9,956,600	71,886,652.00	0.49
40	300308	中际旭创	575,540	71,084,945.40	0.49
41	300274	阳光电源	930,200	68,676,666.00	0.47
42	600690	海尔智家	2,406,103	68,501,752.41	0.47
43	600941	中国移动	579,300	68,450,088.00	0.47
44	603019	中科曙光	938,000	67,836,160.00	0.46
45	002714	牧原股份	1,751,100	67,312,284.00	0.46
46	601766	中国中车	7,799,600	65,360,648.00	0.45
47	601857	中国石油	7,267,600	64,972,344.00	0.44
48	600406	国电南瑞	2,576,200	64,971,764.00	0.44
49	601127	赛力斯	484,000	64,560,760.00	0.44
50	600660	福耀玻璃	1,027,700	64,128,480.00	0.44
51	601919	中远海控	4,092,300	63,430,650.00	0.43
52	601985	中国核电	6,055,300	63,156,779.00	0.43
53	600031	三一重工	3,803,500	62,681,680.00	0.43
54	600028	中国石化	9,352,500	62,474,700.00	0.43
55	002352	顺丰控股	1,544,600	62,247,380.00	0.43
56	600104	上汽集团	2,969,200	61,640,592.00	0.42
57	601012	隆基绿能	3,887,280	61,069,168.80	0.42
58	000100	TCL 科技	12,043,251	60,577,552.53	0.41
59	000568	泸州老窖	471,800	59,069,360.00	0.40
60	601225	陕西煤业	2,486,900	57,845,294.00	0.40
61	002230	科大讯飞	1,187,000	57,355,840.00	0.39
62	603501	韦尔股份	546,090	57,017,256.90	0.39
63	600050	中国联通	10,195,198	54,136,501.38	0.37
64	688012	中微公司	280,950	53,144,502.00	0.36
65	300502	新易盛	454,300	52,507,994.00	0.36
66	600150	中国船舶	1,433,800	51,559,448.00	0.35
67	688008	澜起科技	731,212	49,649,294.80	0.34
68	603288	海天味业	1,070,212	49,122,730.80	0.34
69	000338	潍柴动力	3,480,100	47,677,370.00	0.33
70	002625	光启技术	967,100	46,227,380.00	0.32
71	002027	分众传媒	6,483,200	45,576,896.00	0.31

72	603986	兆易创新	425,400	45,432,720.00	0.31
73	601628	中国人寿	1,068,800	44,804,096.00	0.31
74	688111	金山办公	149,140	42,712,204.60	0.29
75	000625	长安汽车	3,185,355	42,556,342.80	0.29
76	601390	中国中铁	6,587,700	42,095,403.00	0.29
77	000425	徐工机械	5,303,300	42,055,169.00	0.29
78	600418	江淮汽车	1,121,200	42,045,000.00	0.29
79	601888	中国中免	626,700	41,995,167.00	0.29
80	600436	片仔癀	194,507	41,721,751.50	0.29
81	600089	特变电工	3,238,910	41,263,713.40	0.28
82	000938	紫光股份	1,467,200	40,832,176.00	0.28
83	600048	保利发展	4,606,600	40,814,476.00	0.28
84	601658	邮储银行	7,120,820	40,446,257.60	0.28
85	002241	歌尔股份	1,560,800	40,284,248.00	0.28
86	000792	盐湖股份	2,438,600	40,139,356.00	0.27
87	600905	三峡能源	9,175,500	40,096,935.00	0.27
88	300033	同花顺	138,600	39,847,500.00	0.27
89	601006	大秦铁路	5,853,700	39,688,086.00	0.27
90	300015	爱尔眼科	2,990,746	39,627,384.50	0.27
91	600938	中国海油	1,341,400	39,584,714.00	0.27
92	600019	宝钢股份	5,640,500	39,483,500.00	0.27
93	600438	通威股份	1,730,800	38,267,988.00	0.26
94	600584	长电科技	917,650	37,495,179.00	0.26
95	601600	中国铝业	5,084,400	37,370,340.00	0.26
96	300014	亿纬锂能	786,000	36,737,640.00	0.25
97	600585	海螺水泥	1,539,300	36,604,554.00	0.25
98	600760	中航沈飞	708,036	35,911,585.92	0.25
99	600893	航发动力	854,000	35,398,300.00	0.24
100	601989	中国重工	7,310,500	35,163,505.00	0.24
101	600111	北方稀土	1,623,600	34,452,792.00	0.24
102	000977	浪潮信息	661,700	34,328,996.00	0.23
103	000538	云南白药	572,500	34,321,375.00	0.23
104	002463	沪电股份	858,300	34,031,595.00	0.23
105	002050	三花智控	1,435,800	33,755,658.00	0.23
106	688271	联影医疗	265,746	33,590,294.40	0.23
107	605499	东鹏饮料	134,100	33,326,532.00	0.23
108	300408	三环集团	859,600	33,103,196.00	0.23
109	002179	中航光电	814,667	32,016,413.10	0.22
110	600886	国投电力	1,911,700	31,772,454.00	0.22
111	000002	万科 A	4,364,600	31,686,996.00	0.22
112	601669	中国电建	5,523,700	30,159,402.00	0.21
113	603993	洛阳钼业	4,531,800	30,136,470.00	0.21
114	002028	思源电气	396,600	28,832,820.00	0.20

115	002049	紫光国微	435,500	28,033,135.00	0.19
116	300433	蓝思科技	1,277,000	27,966,300.00	0.19
117	000988	华工科技	645,700	27,958,810.00	0.19
118	688036	传音控股	294,161	27,945,295.00	0.19
119	600009	上海机场	796,800	27,210,720.00	0.19
120	600570	恒生电子	971,682	27,197,379.18	0.19
121	600010	包钢股份	14,559,500	27,080,670.00	0.19
122	601186	中国铁建	2,950,600	27,057,002.00	0.19
123	601727	上海电气	3,245,000	26,316,950.00	0.18
124	600547	山东黄金	1,159,900	26,248,537.00	0.18
125	600795	国电电力	5,717,500	26,186,150.00	0.18
126	300339	润和软件	510,700	25,550,321.00	0.17
127	002384	东山精密	874,600	25,538,320.00	0.17
128	603799	华友钴业	870,100	25,459,126.00	0.17
129	002456	欧菲光	2,121,600	25,416,768.00	0.17
130	002460	赣锋锂业	722,900	25,308,729.00	0.17
131	000768	中航西飞	891,400	25,173,136.00	0.17
132	002422	科伦药业	820,700	24,563,551.00	0.17
133	601058	赛轮轮胎	1,688,000	24,189,040.00	0.17
134	601800	中国交建	2,280,579	23,832,050.55	0.16
135	001979	招商蛇口	2,323,300	23,790,592.00	0.16
136	600989	宝丰能源	1,410,400	23,751,136.00	0.16
137	600415	小商品城	1,757,000	23,561,370.00	0.16
138	601360	三六零	2,243,000	23,215,050.00	0.16
139	000157	中联重科	3,183,800	23,018,874.00	0.16
140	600839	四川长虹	2,367,600	22,847,340.00	0.16
141	600066	宇通客车	851,100	22,452,018.00	0.15
142	600029	南方航空	3,456,900	22,435,281.00	0.15
143	600489	中金黄金	1,864,400	22,428,732.00	0.15
144	600115	中国东航	5,487,700	21,950,800.00	0.15
145	002466	天齐锂业	664,000	21,912,000.00	0.15
146	002001	新 和 成	991,100	21,774,467.00	0.15
147	600487	亨通光电	1,264,300	21,771,246.00	0.15
148	600745	闻泰科技	558,300	21,650,874.00	0.15
149	600674	川投能源	1,249,100	21,546,975.00	0.15
150	301236	软通动力	365,900	21,481,989.00	0.15
151	002340	格林美	3,286,300	21,459,539.00	0.15
152	300782	卓胜微	238,400	21,384,480.00	0.15
153	002252	上海莱士	2,959,100	21,364,702.00	0.15
154	300418	昆仑万维	553,200	21,287,136.00	0.15
155	601689	拓普集团	432,080	21,171,920.00	0.14
156	300207	欣旺达	946,700	21,120,877.00	0.14
157	601633	长城汽车	797,800	21,006,074.00	0.14

158	688169	石头科技	95,301	20,898,556.29	0.14
159	600160	巨化股份	865,000	20,863,800.00	0.14
160	003816	中国广核	5,045,400	20,837,502.00	0.14
161	600346	恒力石化	1,353,500	20,776,225.00	0.14
162	000661	长春高新	207,528	20,636,584.32	0.14
163	600426	华鲁恒升	952,900	20,592,169.00	0.14
164	002648	卫星化学	1,080,688	20,306,127.52	0.14
165	688777	中控技术	407,876	20,259,200.92	0.14
166	002236	大华股份	1,265,600	20,249,600.00	0.14
167	600196	复星医药	814,500	20,240,325.00	0.14
168	002156	通富微电	682,300	20,161,965.00	0.14
169	300122	智飞生物	766,300	20,153,690.00	0.14
170	688126	沪硅产业	1,057,377	19,899,835.14	0.14
171	600256	广汇能源	2,947,200	19,834,656.00	0.14
172	002273	水晶光电	891,300	19,804,686.00	0.14
173	000786	北新建材	651,000	19,731,810.00	0.14
174	002920	德赛西威	178,900	19,698,679.00	0.13
175	300394	天孚通信	214,260	19,574,793.60	0.13
176	601117	中国化学	2,349,900	19,480,671.00	0.13
177	000963	华东医药	562,900	19,476,340.00	0.13
178	600460	士兰微	745,700	19,403,114.00	0.13
179	600372	中航机载	1,551,900	19,134,927.00	0.13
180	002185	华天科技	1,644,900	19,097,289.00	0.13
181	600011	华能国际	2,820,200	19,092,754.00	0.13
182	601868	中国能建	8,317,600	19,047,304.00	0.13
183	601111	中国国航	2,403,000	19,007,730.00	0.13
184	002601	龙佰集团	1,071,700	18,936,939.00	0.13
185	600183	生益科技	777,800	18,706,090.00	0.13
186	002129	TCL 中环	2,074,725	18,402,810.75	0.13
187	600096	云天化	822,500	18,341,750.00	0.13
188	001965	招商公路	1,311,200	18,291,240.00	0.13
189	002202	金风科技	1,769,500	18,278,935.00	0.13
190	688223	晶科能源	2,566,902	18,250,673.22	0.12
191	300347	泰格医药	332,000	18,133,840.00	0.12
192	601100	恒立液压	343,000	18,100,110.00	0.12
193	000066	中国长城	1,239,800	18,063,886.00	0.12
194	000423	东阿阿胶	287,900	18,057,088.00	0.12
195	000807	云铝股份	1,333,500	18,042,255.00	0.12
196	601021	春秋航空	312,700	18,033,409.00	0.12
197	002180	纳思达	638,600	17,989,362.00	0.12
198	600085	同仁堂	439,500	17,839,305.00	0.12
199	600741	华域汽车	1,011,000	17,803,710.00	0.12
200	300896	爱美客	97,540	17,801,050.00	0.12

201	300832	新产业	250,500	17,747,925.00	0.12
202	600482	中国动力	720,500	17,630,635.00	0.12
203	002493	荣盛石化	1,947,800	17,627,590.00	0.12
204	600176	中国巨石	1,540,600	17,547,434.00	0.12
205	002459	晶澳科技	1,272,300	17,494,125.00	0.12
206	600219	南山铝业	4,468,600	17,472,226.00	0.12
207	300661	圣邦股份	213,030	17,421,593.40	0.12
208	601168	西部矿业	1,070,200	17,198,114.00	0.12
209	600352	浙江龙盛	1,670,111	17,185,442.19	0.12
210	300759	康龙化成	668,000	17,167,600.00	0.12
211	000933	神火股份	1,009,900	17,067,310.00	0.12
212	603392	万泰生物	241,883	17,043,076.18	0.12
213	600885	宏发股份	535,200	17,030,064.00	0.12
214	002709	天赐材料	860,700	16,973,004.00	0.12
215	600988	赤峰黄金	1,067,500	16,663,675.00	0.11
216	600515	海南机场	4,395,700	16,615,746.00	0.11
217	300017	网宿科技	1,565,800	16,550,506.00	0.11
218	002916	深南电路	132,209	16,526,125.00	0.11
219	000975	山金国际	1,068,900	16,428,993.00	0.11
220	002738	中矿资源	462,500	16,418,750.00	0.11
221	002138	顺络电子	517,200	16,281,456.00	0.11
222	300476	胜宏科技	386,700	16,276,203.00	0.11
223	600188	兖矿能源	1,148,400	16,272,828.00	0.11
224	002938	鹏鼎控股	445,800	16,262,784.00	0.11
225	600845	宝信软件	554,620	16,228,181.20	0.11
226	002271	东方雨虹	1,248,600	16,206,828.00	0.11
227	601877	正泰电器	690,200	16,157,582.00	0.11
228	688396	华润微	341,410	16,111,137.90	0.11
229	002078	太阳纸业	1,075,800	15,997,146.00	0.11
230	000630	铜陵有色	4,922,100	15,898,383.00	0.11
231	002281	光迅科技	304,200	15,870,114.00	0.11
232	300136	信维通信	621,200	15,803,328.00	0.11
233	300474	景嘉微	168,455	15,748,857.95	0.11
234	600233	圆通速递	1,105,400	15,685,626.00	0.11
235	601319	中国人保	2,049,100	15,614,142.00	0.11
236	600161	天坛生物	759,580	15,571,390.00	0.11
237	002555	三七互娱	995,600	15,571,184.00	0.11
238	002085	万丰奥威	816,000	15,463,200.00	0.11
239	600879	航天电子	1,693,800	15,176,448.00	0.10
240	601618	中国中冶	4,580,000	15,114,000.00	0.10
241	300058	蓝色光标	1,621,200	15,044,736.00	0.10
242	002517	恺英网络	1,105,000	15,039,050.00	0.10
243	601607	上海医药	713,000	14,973,000.00	0.10

244	002444	巨星科技	462,500	14,961,875.00	0.10
245	688120	华海清科	91,597	14,929,395.03	0.10
246	688099	晶晨股份	216,031	14,837,009.08	0.10
247	300223	北京君正	217,300	14,819,860.00	0.10
248	002074	国轩高科	694,500	14,737,290.00	0.10
249	601615	明阳智能	1,166,400	14,708,304.00	0.10
250	002405	四维图新	1,522,600	14,677,864.00	0.10
251	300002	神州泰岳	1,257,300	14,572,107.00	0.10
252	000999	华润三九	328,500	14,565,690.00	0.10
253	002353	杰瑞股份	393,400	14,551,866.00	0.10
254	002195	岩山科技	3,641,600	14,457,152.00	0.10
255	300024	机器人	802,200	14,399,490.00	0.10
256	300346	南大光电	368,700	14,228,133.00	0.10
257	605117	德业股份	166,400	14,110,720.00	0.10
258	600588	用友网络	1,313,800	14,097,074.00	0.10
259	002532	天山铝业	1,788,800	14,077,856.00	0.10
260	000408	藏格矿业	506,900	14,056,337.00	0.10
261	002223	鱼跃医疗	385,100	14,052,299.00	0.10
262	300450	先导智能	701,500	14,044,030.00	0.10
263	002128	电投能源	717,200	14,042,776.00	0.10
264	688617	惠泰医疗	37,685	14,031,256.05	0.10
265	002465	海格通信	1,272,100	13,967,658.00	0.10
266	300496	中科创达	234,500	13,966,820.00	0.10
267	000301	东方盛虹	1,697,100	13,933,191.00	0.10
268	601567	三星医疗	452,200	13,909,672.00	0.10
269	603606	东方电缆	263,300	13,836,415.00	0.09
270	688072	拓荆科技	89,744	13,790,960.48	0.09
271	600362	江西铜业	666,400	13,754,496.00	0.09
272	688047	龙芯中科	103,441	13,683,175.48	0.09
273	300114	中航电测	190,400	13,666,912.00	0.09
274	600765	中航重机	665,980	13,632,610.60	0.09
275	688599	天合光能	702,726	13,562,611.80	0.09
276	600862	中航高科	536,300	13,546,938.00	0.09
277	002008	大族激光	540,100	13,502,500.00	0.09
278	300383	光环新网	921,800	13,449,062.00	0.09
279	300012	华测检测	1,079,700	13,420,671.00	0.09
280	002131	利欧股份	4,340,900	13,413,381.00	0.09
281	601872	招商轮船	2,089,600	13,394,336.00	0.09
282	300866	安克创新	137,080	13,384,491.20	0.09
283	300316	晶盛机电	419,502	13,382,113.80	0.09
284	000831	中国稀土	476,300	13,360,215.00	0.09
285	600895	张江高科	496,600	13,308,880.00	0.09
286	002472	双环传动	433,500	13,273,770.00	0.09

287	601238	广汽集团	1,421,100	13,273,074.00	0.09
288	600177	雅戈尔	1,482,500	13,194,250.00	0.09
289	603605	珀莱雅	153,296	12,984,171.20	0.09
290	600803	新奥股份	596,400	12,929,952.00	0.09
291	300699	光威复材	372,500	12,907,125.00	0.09
292	300413	芒果超媒	479,800	12,901,822.00	0.09
293	600332	白云山	450,600	12,806,052.00	0.09
294	601233	桐昆股份	1,082,900	12,778,220.00	0.09
295	300037	新宙邦	337,540	12,637,497.60	0.09
296	000400	许继电气	457,200	12,586,716.00	0.09
297	300395	菲利华	334,100	12,565,501.00	0.09
298	688122	西部超导	293,274	12,557,992.68	0.09
299	603260	合盛硅业	225,900	12,551,004.00	0.09
300	300054	鼎龙股份	481,300	12,523,426.00	0.09
301	300628	亿联网络	323,300	12,479,380.00	0.09
302	300999	金龙鱼	381,800	12,450,498.00	0.09
303	300142	沃森生物	1,025,900	12,392,872.00	0.08
304	300604	长川科技	280,200	12,365,226.00	0.08
305	601799	星宇股份	92,100	12,293,508.00	0.08
306	600027	华电国际	2,184,100	12,252,801.00	0.08
307	600039	四川路桥	1,677,200	12,210,016.00	0.08
308	000009	中国宝安	1,322,300	12,099,045.00	0.08
309	603596	伯特利	271,100	12,088,349.00	0.08
310	002436	兴森科技	1,084,052	12,043,817.72	0.08
311	688235	百济神州	74,199	11,947,522.98	0.08
312	600153	建发股份	1,134,800	11,938,096.00	0.08
313	002812	恩捷股份	373,100	11,935,469.00	0.08
314	002007	华兰生物	704,900	11,877,565.00	0.08
315	600549	厦门钨业	611,600	11,785,532.00	0.08
316	600143	金发科技	1,351,900	11,680,416.00	0.08
317	002821	凯莱英	153,480	11,678,293.20	0.08
318	600398	海澜之家	1,540,300	11,552,250.00	0.08
319	601216	君正集团	2,165,500	11,390,530.00	0.08
320	300724	捷佳伟创	179,300	11,333,553.00	0.08
321	000738	航发控制	506,100	11,255,664.00	0.08
322	000617	中油资本	1,622,200	11,176,958.00	0.08
323	000932	华菱钢铁	2,659,200	11,115,456.00	0.08
324	002294	信立泰	356,700	11,032,731.00	0.08
325	002558	巨人网络	867,800	11,012,382.00	0.08
326	600018	上港集团	1,790,500	10,957,860.00	0.07
327	000878	云南铜业	898,900	10,957,591.00	0.07
328	600529	山东药玻	425,200	10,957,404.00	0.07
329	603659	璞泰来	686,400	10,920,624.00	0.07

330	600497	驰宏锌锗	1,958,800	10,910,516.00	0.07
331	688002	睿创微纳	231,375	10,876,938.75	0.07
332	300919	中伟股份	299,423	10,815,158.76	0.07
333	002607	中公教育	3,165,100	10,761,340.00	0.07
334	600141	兴发集团	495,300	10,748,010.00	0.07
335	002409	雅克科技	184,100	10,668,595.00	0.07
336	000623	吉林敖东	614,200	10,607,234.00	0.07
337	002312	川发龙蟒	725,500	10,497,985.00	0.07
338	000034	神州数码	299,500	10,497,475.00	0.07
339	002065	东华软件	1,438,700	10,444,962.00	0.07
340	000733	振华科技	247,400	10,432,858.00	0.07
341	300073	当升科技	258,600	10,416,408.00	0.07
342	002064	华峰化学	1,271,800	10,403,324.00	0.07
343	300001	特锐德	473,800	10,399,910.00	0.07
344	688009	中国通号	1,659,483	10,388,363.58	0.07
345	300459	汤姆猫	1,802,700	10,347,498.00	0.07
346	600563	法拉电子	87,000	10,346,040.00	0.07
347	600026	中远海能	890,800	10,333,280.00	0.07
348	600118	中国卫星	378,500	10,333,050.00	0.07
349	300088	长信科技	1,574,800	10,299,192.00	0.07
350	688188	柏楚电子	52,998	10,294,861.50	0.07
351	002318	久立特材	438,400	10,262,944.00	0.07
352	002432	九安医疗	250,100	10,199,078.00	0.07
353	002739	万达电影	837,700	10,169,678.00	0.07
354	600820	隧道股份	1,411,000	10,145,090.00	0.07
355	603087	甘李药业	229,800	10,134,180.00	0.07
356	600704	物产中大	1,998,000	10,109,880.00	0.07
357	600521	华海药业	564,800	10,092,976.00	0.07
358	600637	东方明珠	1,292,500	10,029,800.00	0.07
359	688303	大全能源	415,027	10,018,751.78	0.07
360	601179	中国西电	1,313,900	9,972,501.00	0.07
361	002410	广联达	846,700	9,957,192.00	0.07
362	600699	均胜电子	633,200	9,922,244.00	0.07
363	603806	福斯特	670,177	9,918,619.60	0.07
364	002841	视源股份	266,600	9,840,206.00	0.07
365	300315	掌趣科技	1,749,900	9,624,450.00	0.07
366	601018	宁波港	2,495,200	9,606,520.00	0.07
367	601677	明泰铝业	796,500	9,581,895.00	0.07
368	300003	乐普医疗	843,400	9,564,156.00	0.07
369	300751	迈为股份	90,000	9,463,500.00	0.06
370	688180	君实生物	345,969	9,455,332.77	0.06
371	603568	伟明环保	437,000	9,452,310.00	0.06
372	300763	锦浪科技	154,500	9,435,315.00	0.06

373	000683	远兴能源	1,679,600	9,388,964.00	0.06
374	300144	宋城演艺	1,009,300	9,376,397.00	0.06
375	603939	益丰药房	388,200	9,367,266.00	0.06
376	300454	深信服	162,500	9,327,500.00	0.06
377	002152	广电运通	795,200	9,272,032.00	0.06
378	600008	首创环保	2,823,600	9,261,408.00	0.06
379	600392	盛和资源	898,800	9,239,664.00	0.06
380	002044	美年健康	2,008,300	9,218,097.00	0.06
381	603129	春风动力	58,500	9,188,595.00	0.06
382	000039	中集集团	1,182,450	9,187,636.50	0.06
383	002407	多氟多	762,100	9,145,200.00	0.06
384	600486	扬农化工	157,330	9,104,687.10	0.06
385	600170	上海建工	3,418,700	9,059,555.00	0.06
386	300068	南都电源	560,100	9,040,014.00	0.06
387	002624	完美世界	870,200	8,989,166.00	0.06
388	300529	健帆生物	306,300	8,986,842.00	0.06
389	600763	通策医疗	201,961	8,967,068.40	0.06
390	601000	唐山港	1,899,600	8,947,116.00	0.06
391	000960	锡业股份	634,100	8,896,423.00	0.06
392	300251	光线传媒	940,400	8,877,376.00	0.06
393	600498	烽火通信	455,600	8,865,976.00	0.06
394	300627	华测导航	212,100	8,865,780.00	0.06
395	600816	建元信托	2,525,500	8,839,250.00	0.06
396	600316	洪都航空	274,700	8,823,364.00	0.06
397	300558	贝达药业	161,900	8,731,267.00	0.06
398	600516	方大炭素	1,806,300	8,724,429.00	0.06
399	300285	国瓷材料	511,600	8,717,664.00	0.06
400	603816	顾家家居	315,300	8,695,974.00	0.06
401	603979	金诚信	238,600	8,661,180.00	0.06
402	002497	雅化集团	737,700	8,631,090.00	0.06
403	000629	钒钛股份	2,980,400	8,583,552.00	0.06
404	300390	天华新能	372,300	8,581,515.00	0.06
405	002603	以岭药业	536,000	8,581,360.00	0.06
406	002025	航天电器	176,700	8,580,552.00	0.06
407	000830	鲁西化工	733,600	8,575,784.00	0.06
408	603613	国联股份	322,560	8,573,644.80	0.06
409	605358	立昂微	343,648	8,512,160.96	0.06
410	601966	玲珑轮胎	469,100	8,462,564.00	0.06
411	300568	星源材质	860,500	8,364,060.00	0.06
412	300296	利亚德	1,296,600	8,350,104.00	0.06
413	600535	天士力	575,300	8,318,838.00	0.06
414	601880	辽港股份	4,807,900	8,317,667.00	0.06
415	600998	九州通	1,617,600	8,282,112.00	0.06

416	000069	华侨城 A	3,093,300	8,259,111.00	0.06
417	600038	中直股份	211,500	8,155,440.00	0.06
418	002414	高德红外	1,096,100	8,144,023.00	0.06
419	600325	华发股份	1,411,500	8,130,240.00	0.06
420	603833	欧派家居	117,800	8,121,132.00	0.06
421	002176	江特电机	1,094,800	8,112,468.00	0.06
422	603077	和邦生物	3,964,300	8,087,172.00	0.06
423	002389	航天彩虹	445,800	8,046,690.00	0.06
424	300253	卫宁健康	1,122,400	8,036,384.00	0.05
425	600655	豫园股份	1,247,400	8,020,782.00	0.05
426	300182	捷成股份	1,365,900	8,017,833.00	0.05
427	300567	精测电子	123,400	7,934,620.00	0.05
428	002245	蔚蓝锂芯	737,400	7,882,806.00	0.05
429	002756	永兴材料	208,600	7,868,392.00	0.05
430	600859	王府井	509,600	7,852,936.00	0.05
431	600754	锦江酒店	292,000	7,843,120.00	0.05
432	603000	人民网	353,800	7,797,752.00	0.05
433	000519	中兵红箭	536,100	7,746,645.00	0.05
434	603885	吉祥航空	564,500	7,733,650.00	0.05
435	600166	福田汽车	3,046,800	7,647,468.00	0.05
436	000998	隆平高科	676,700	7,558,739.00	0.05
437	300212	易华录	322,200	7,539,480.00	0.05
438	002439	启明星辰	468,700	7,414,834.00	0.05
439	000708	中信特钢	648,200	7,395,962.00	0.05
440	600323	瀚蓝环境	312,700	7,385,974.00	0.05
441	002151	北斗星通	277,700	7,370,158.00	0.05
442	300601	康泰生物	429,400	7,364,210.00	0.05
443	002145	中核钛白	1,736,300	7,361,912.00	0.05
444	600131	国网信通	384,800	7,276,568.00	0.05
445	600004	白云机场	757,600	7,272,960.00	0.05
446	600867	通化东宝	889,040	7,165,662.40	0.05
447	603899	晨光股份	235,600	7,126,900.00	0.05
448	300070	碧水源	1,394,000	7,053,640.00	0.05
449	300118	东方日升	585,400	7,013,092.00	0.05
450	002120	韵达股份	929,300	6,988,336.00	0.05
451	603486	科沃斯	148,400	6,974,800.00	0.05
452	601155	新城控股	580,400	6,941,584.00	0.05
453	603290	斯达半导	77,120	6,926,918.40	0.05
454	688005	容百科技	218,051	6,879,509.05	0.05
455	300676	华大基因	160,900	6,752,973.00	0.05
456	000887	中鼎股份	506,600	6,646,592.00	0.05
457	000818	航锦科技	347,600	6,639,160.00	0.05
458	601866	中远海发	2,539,800	6,628,878.00	0.05

459	002368	太极股份	278,600	6,597,248.00	0.05
460	600667	太极实业	945,200	6,540,784.00	0.04
461	300595	欧普康视	344,200	6,522,590.00	0.04
462	002240	盛新锂能	469,500	6,469,710.00	0.04
463	002508	老板电器	301,700	6,465,431.00	0.04
464	600755	厦门国贸	972,900	6,460,056.00	0.04
465	002831	裕同科技	237,310	6,431,101.00	0.04
466	002572	索菲亚	369,900	6,354,882.00	0.04
467	300438	鹏辉能源	224,500	6,310,695.00	0.04
468	300573	兴齐眼药	90,400	6,308,112.00	0.04
469	600258	首旅酒店	429,300	6,297,831.00	0.04
470	002268	电科网安	379,000	6,158,750.00	0.04
471	600129	太极集团	248,600	6,145,392.00	0.04
472	000547	航天发展	819,100	5,987,621.00	0.04
473	600771	广誉远	312,900	5,901,294.00	0.04
474	600399	抚顺特钢	1,011,900	5,869,020.00	0.04
475	601636	旗滨集团	1,032,800	5,794,008.00	0.04
476	600499	科达制造	736,500	5,744,700.00	0.04
477	002544	普天科技	260,600	5,584,658.00	0.04
478	000035	中国天楹	1,123,400	5,470,958.00	0.04
479	603650	彤程新材	154,600	5,406,362.00	0.04
480	600884	杉杉股份	721,000	5,371,450.00	0.04
481	300769	德方纳米	144,600	5,332,848.00	0.04
482	002266	浙富控股	1,674,600	5,224,752.00	0.04
483	002372	伟星新材	407,900	5,151,777.00	0.04
484	603688	石英股份	174,700	5,019,131.00	0.03
485	603882	金域医学	179,295	4,935,991.35	0.03
486	002292	奥飞娱乐	569,400	4,925,310.00	0.03
487	300457	赢合科技	248,400	4,754,376.00	0.03
488	002541	鸿路钢构	264,200	4,737,106.00	0.03
489	603456	九洲药业	343,600	4,700,448.00	0.03
490	002091	江苏国泰	627,000	4,589,640.00	0.03
491	688390	固德威	109,510	4,478,959.00	0.03
492	688063	派能科技	110,761	4,435,978.05	0.03
493	603588	高能环境	780,300	4,088,772.00	0.03
494	000967	盈峰环境	811,400	4,032,658.00	0.03
495	002081	金螳螂	1,021,900	3,648,183.00	0.02
496	600315	上海家化	214,000	3,618,740.00	0.02
497	600167	联美控股	587,500	3,366,375.00	0.02
498	600007	中国国贸	130,000	3,179,800.00	0.02
499	001914	招商积余	270,800	2,862,356.00	0.02
500	600335	国机汽车	383,100	2,386,713.00	0.02

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00
2	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.00
3	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
4	001391	国货航	4,686	31,864.80	0.00
5	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
6	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
7	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
8	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
9	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	910,258,649.76	6.23
2	601318	中国平安	471,265,482.64	3.22
3	600036	招商银行	360,569,220.65	2.47
4	600900	长江电力	259,869,771.85	1.78
5	600030	中信证券	246,647,373.96	1.69
6	601899	紫金矿业	215,430,497.00	1.47
7	601166	兴业银行	207,642,058.30	1.42
8	600276	恒瑞医药	171,539,550.92	1.17
9	601398	工商银行	163,319,564.00	1.12
10	688981	中芯国际	158,365,565.75	1.08
11	601328	交通银行	151,277,303.07	1.04
12	600887	伊利股份	137,165,828.00	0.94
13	600309	万华化学	136,116,137.24	0.93
14	601816	京沪高铁	124,532,501.00	0.85
15	601288	农业银行	116,530,776.00	0.80
16	601601	中国太保	106,970,930.69	0.73
17	603259	药明康德	102,573,038.52	0.70
18	601088	中国神华	100,764,294.37	0.69
19	600919	江苏银行	99,363,103.10	0.68
20	601668	中国建筑	98,176,312.45	0.67

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
----	-----	------	----------	----------------

	码			
1	600519	贵州茅台	266,070,512.74	1.82
2	300750	宁德时代	72,423,418.40	0.50
3	601318	中国平安	70,126,756.99	0.48
4	600036	招商银行	54,863,481.33	0.38
5	600030	中信证券	51,926,245.30	0.36
6	002304	洋河股份	42,528,628.00	0.29
7	688981	中芯国际	42,490,322.95	0.29
8	601328	交通银行	42,371,513.12	0.29
9	600900	长江电力	41,385,921.25	0.28
10	600309	万华化学	38,209,343.12	0.26
11	000858	五粮液	36,818,427.80	0.25
12	601899	紫金矿业	34,546,000.00	0.24
13	601166	兴业银行	32,187,825.00	0.22
14	600157	永泰能源	30,587,980.00	0.21
15	300760	迈瑞医疗	29,167,579.00	0.20
16	600276	恒瑞医药	29,163,215.32	0.20
17	601398	工商银行	26,803,574.00	0.18
18	300782	卓胜微	24,993,827.00	0.17
19	601601	中国太保	23,999,414.38	0.16
20	603392	万泰生物	23,836,035.00	0.16

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	12,561,189,476.17
卖出股票收入（成交）总额	3,092,427,457.61

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证监会的处罚。

兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方分局的处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内未出现被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	51,428.07
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	51,428.07
---	----	-----------

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688449	联芸科技	41,392.64	0.00	新股流通受限
2	688605	先锋精科	39,937.92	0.00	新股流通受限
3	688708	佳驰科技	38,181.00	0.00	新股流通受限
4	001391	国货航	31,864.80	0.00	新股流通受限
5	603072	天和磁材	27,736.50	0.00	新股流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国工商银行股份有限公司-景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
23,848	630,583.77	8,088,376,845.00	53.79	1,332,824,159.00	8.86	5,616,960,808.00	37.35

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国人寿保险股份有限公司	1,369,323,808.00	9.11
2	中国平安人寿保险股份有限公司一	953,851,060.00	6.34

	自有资金		
3	中国平安人寿保险股份有限公司－ 分红一个险分红	830,950,110.00	5.53
4	景顺长城基金－中国人寿保险股份 有限公司－分红险－景顺长城基金 国寿股份均衡股票型组合单一资产 管理计划（可供出售）	724,599,580.00	4.82
5	景顺长城基金－中国人寿保险股份 有限公司－传统险－景顺长城基金 国寿股份均衡股票传统可供出售单 一资产管理计划	494,497,275.00	3.29
6	新华人寿保险股份有限公司	361,557,232.00	2.40
7	工银安盛人寿保险有限公司	231,126,630.00	1.54
8	方正证券股份有限公司	229,864,378.00	1.53
9	广发证券股份有限公司	131,929,065.00	0.88
10	中信证券股份有限公司	117,953,848.00	0.78
－	中国工商银行股份有限公司－景顺 长城中证 A500 交易型开放式指数证 券投资基金联接基金	5,616,960,808.00	37.35

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	129,776.00	0.000863

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末基金的基金经理未持有本基金。

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
龚丽丽	公募基金	50~100
	私募资产管理计划	－
	合计	50~100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024 年 9 月 24 日） 基金份额总额	2,000,161,812.00
基金合同生效日起至报告期期末基金	15,315,000,000.00

总申购份额	
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,277,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	15,038,161,812.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：
报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。
基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：
报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 1 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 50,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

11.6.2 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，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	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 (%)	
中信证券股份有限公司	5	15,652,728,563.34	100.00	2,909,810.61	100.00	本期报告新增

注：1、基金管理人选择交易单元的标准为：交易单元所属券商财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强。

2、基金管理人选择交易单元参与证券交易的程序为：基金管理人定期对符合上述标准的券商进行测评，测评结果是决定后期使用各证券公司交易单元参与证券交易的依据。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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 (%)
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 7 日
2	景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 7 日
3	景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 7 日
4	景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 7 日
5	景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 7 日
6	景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 7 日
7	景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金提前结束募集暨进行比例配售的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 19 日
8	景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金认购申请确认比例结	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 19 日

	果的公告		
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 20 日
10	景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 20 日
11	关于景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 24 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 27 日
13	关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 28 日
14	景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 10 日
15	景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 10 日
16	关于景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购和赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 10 日
17	景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 15 日
18	关于景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 15 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新或完善身份信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 21 日
20	关于景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增东吴证券和浙商证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 21 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金综合风险评级变动的通知	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 23 日
22	关于景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增华金证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 11 月 14 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 11 月 15 日
24	关于景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 11 月 18 日
25	关于景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 11 月 19 日

	商的公告		
26	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 11 月 22 日
27	关于景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 11 月 28 日
28	关于景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增万联证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 12 月 6 日
29	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 12 月 6 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
本基金的联接基金	1	20241108-20241231	0.00	5,651,721,708.00	34,760,900.00	5,616,960,808.00	37.35
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况,可能会出现如下风险: 1、大额申购风险 在出现投资者大额申购时,如本基金所投资的标的资产未及时准备,则可能降低基金净值涨幅。 2、如面临大额赎回的情况,可能导致以下风险: (1) 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; (2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一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》的约定决定部分延期赎回,如果连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响; (3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平; (4) 因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动; (5) 基金资产规模过小,可能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; (6) 大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。 本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止和化解上述风险,最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前,请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦自行承担基金							

投资中出现的各类风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金于 2024 年 10 月 15 日开始在深圳证券交易所上市交易，场内简称：中证 A500ETF 景顺，代码：159353。详情请参阅本基金管理人于 2024 年 10 月 15 日发布的《关于景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告》。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2025 年 3 月 28 日