

# 景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金

## 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：中信建投证券股份有限公司

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。

基金托管人中信建投证券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 1 月 1 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>7</b>
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	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24

<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
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	74
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	74
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	74
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	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
8.12 投资组合报告附注	75
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b>	<b>76</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	76
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
9.3 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	76
9.4 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	77
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b>	<b>77</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b>	<b>77</b>
11.1 基金份额持有人大会决议	77
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	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	78
11.4 基金投资策略的改变	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	78
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	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	78
11.8 其他重大事件	79
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>81</b>
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	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	82
<b>§ 13 备查文件目录</b>	<b>82</b>
13.1 备查文件目录	82
13.2 存放地点	82
13.3 查阅方式	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	景顺长城中证 1000 指数增强	
基金主代码	015495	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 4 月 27 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	89,407,178.00 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	景顺长城中证 1000 指数增强 A	景顺长城中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	015495	015496
报告期末下属分级 基金的份额总额	49,740,449.76 份	39,666,728.24 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金为指数基金，股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。</p> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>本基金可投资国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。</p>

	<p><b>6、股票期权投资策略</b></p> <p>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。</p> <p><b>7、资产支持证券投资策略</b></p> <p>本基金将通过宏观经济、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。</p> <p><b>8、参与融资及转融通证券出借业务的投资策略</b></p> <p>本基金参与融资业务将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束，合理利用融资发掘可能的增值机会。</p> <p><b>9、信用衍生品投资策略</b></p> <p>本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，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		景顺长城基金管理有限公司	中信建投证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	朱志明
	联系电话	0755-82370388	4008-888-108
	电子邮箱	investor@igwfm.com	service@csc.com.cn
客户服务电话		4008888606	95587
传真		0755-22381339	010-85130975
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	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
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	北京市朝阳区景辉街 16 号院 1 号楼泰康集团大厦 8 层/18 层，北京市朝阳区光华路 10 号院中信大厦 82 层
邮政编码		518048	100010
法定代表人		李进	王常青

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼

	普通合伙)	17 层 01-12 室
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

§ 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		2023 年		2022 年 4 月 27 日(基金合同生 效日)-2022 年 12 月 31 日	
	景顺长城中证 1000 指数增强	景顺长城中证 1000 指数增强	景顺长城中证 1000 指数增强	景顺长城中证 1000 指数增强	景顺长城中证 1000 指数增强	景顺长城中证 1000 指数增强
	A	C	A	C	A	C
本期 已实 现收 益	2,993,425.46	63,728.48	-1,968,356.57	-3,043,889.55	27,677,585.18	16,990,599.44
本期 利润	4,232,102.14	1,255,640.98	1,168,393.74	1,183,211.53	23,335,410.98	12,082,065.69
加权 平均 基金 份额 本期 利润	0.0724	0.0149	0.0202	0.0154	0.1610	0.0710
本期 加权 平均 净值 利润 率	7.85%	1.63%	1.95%	1.50%	15.39%	6.79%
本期 基金 份额 净值 增长 率	7.67%	7.24%	-0.11%	-0.51%	-1.66%	-1.93%
3.1.2 期末 数据 和指 标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末	2,865,126.56	1,838,584.01	-1,029,640.11	-2,301,318.12	-1,126,229.52	-1,686,149.00

可供分配利润						
期末可供分配基金份额利润	0.0576	0.0464	-0.0176	-0.0242	-0.0165	-0.0192
期末基金资产净值	52,605,576.32	41,505,312.25	57,352,836.30	92,641,440.64	67,015,056.36	86,056,135.22
期末基金份额净值	1.0576	1.0463	0.9823	0.9757	0.9834	0.9807
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	5.76%	4.63%	-1.77%	-2.43%	-1.66%	-1.93%

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，小数点后第五位舍去，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。

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

景顺长城中证 1000 指数增强 A

阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较	业绩比较基	①－③	②－④
----	------	-------	------	-------	-----	-----



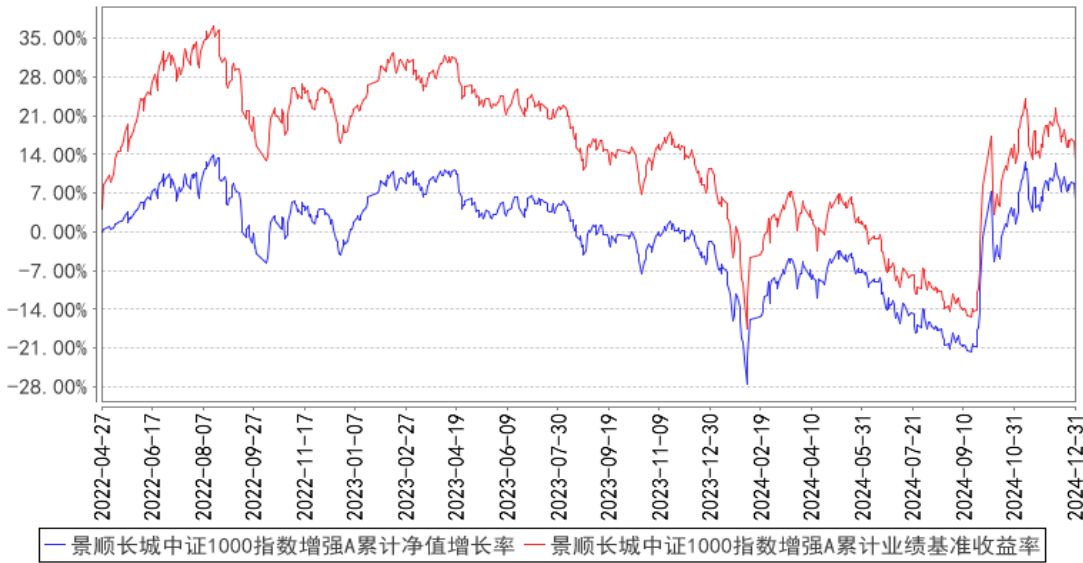
	增长率①	长率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	6.70%	2.22%	4.23%	2.28%	2.47%	-0.06%
过去六个月	21.80%	2.08%	20.68%	2.13%	1.12%	-0.05%
过去一年	7.67%	1.98%	1.41%	2.01%	6.26%	-0.03%
自基金合同生效 起至今	5.76%	1.44%	12.91%	1.50%	-7.15%	-0.06%

景顺长城中证 1000 指数增强 C

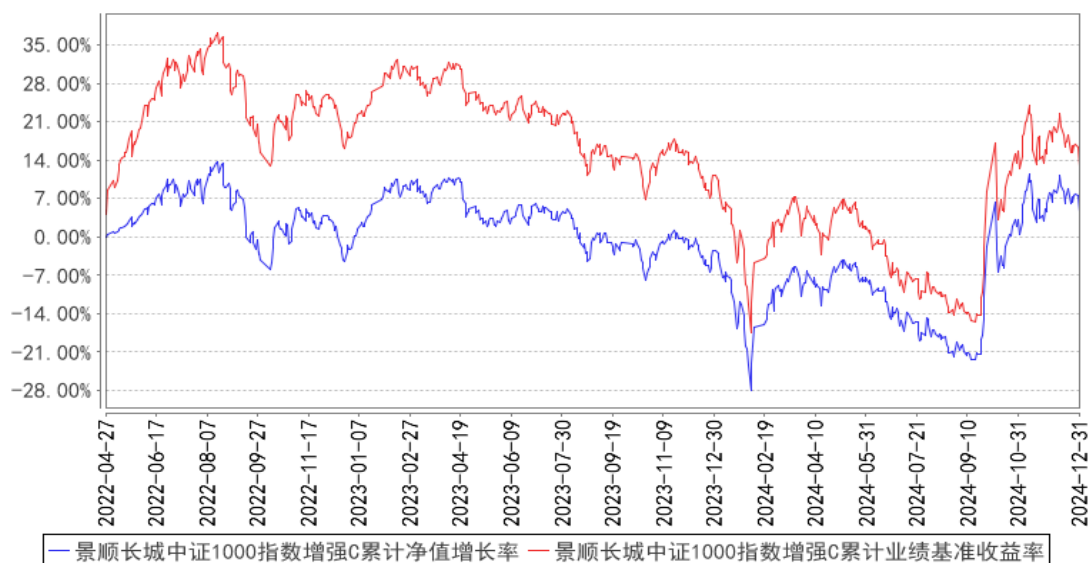
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	6.59%	2.22%	4.23%	2.28%	2.36%	-0.06%
过去六个月	21.55%	2.08%	20.68%	2.13%	0.87%	-0.05%
过去一年	7.24%	1.98%	1.41%	2.01%	5.83%	-0.03%
自基金合同生效 起至今	4.63%	1.44%	12.91%	1.50%	-8.28%	-0.06%

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1000指数增强A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



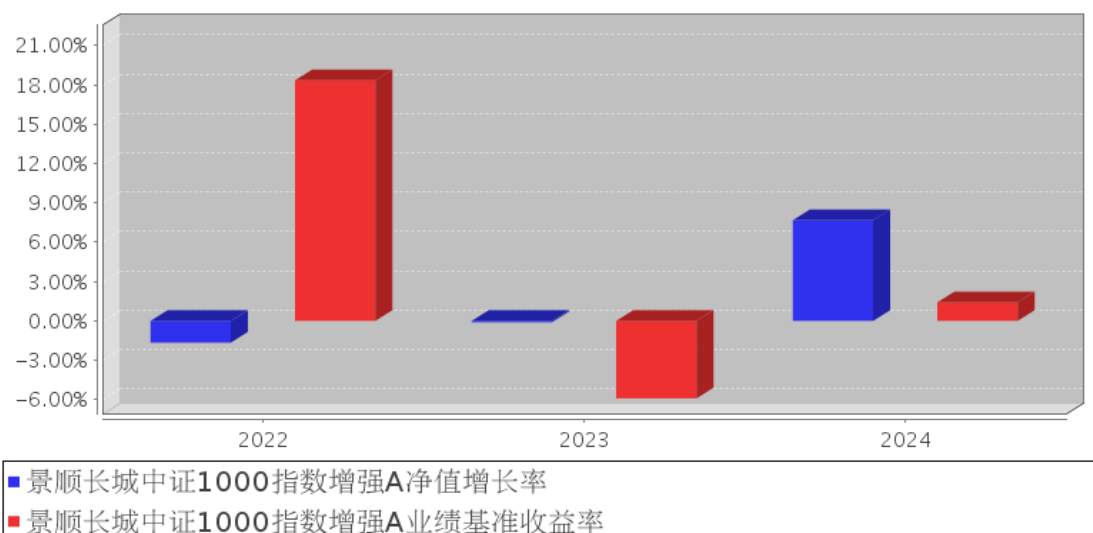
景顺长城中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



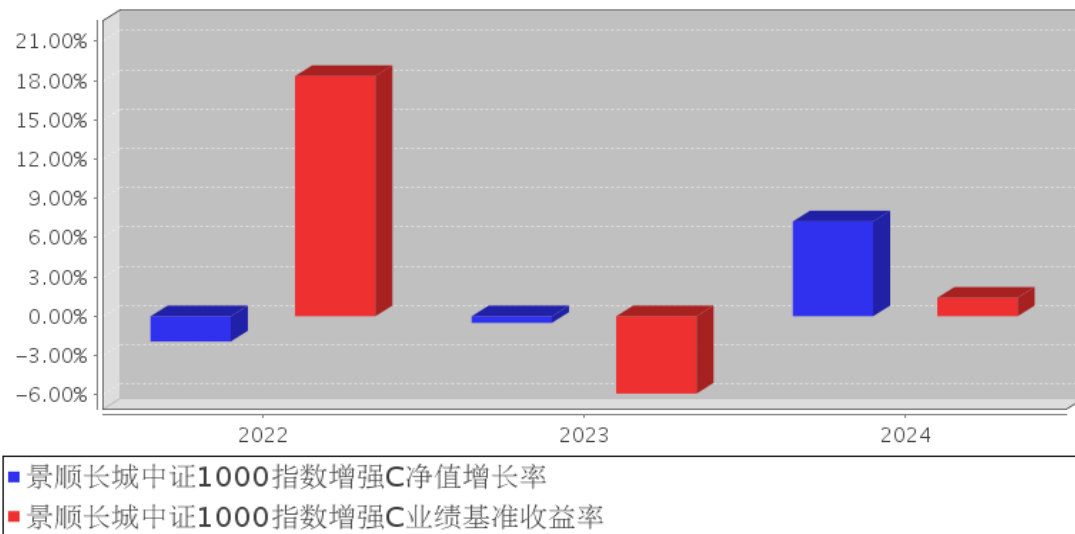
注：本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证，下同）的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自 2022 年 4 月 27 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

### 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1000指数增强A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



景顺长城中证1000指数增强C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：2022 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间为 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 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2022年04月27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		
黎海威	本基金的基金经理	2022 年 4 月 27 日	-	21 年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012 年 8 月加入本公司，自 2013 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有 21 年证券、基金行业从业经验。
徐喻军	本基金的基金经理	2022 年 4 月 27 日	-	14 年	理学硕士，CFA。曾任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员，自 2014 年 4 月起担任量化及指数投资部基金经理。具有 14 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

无。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 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 1000 指数增强型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投资指令时，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投资指令。

#### 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，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 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

回顾 2024 年，全年经济运行呈现“前高、中低、后扬”的走势，9 月份以来，存量和增量政策精准发力，四季度经济明显回升。从数据来看，2024 年全年 GDP 增长 5.0%，其中四季度 GDP 当季同比增长 5.4%，显示出我国第四季度的刺激政策取得了显著成效。2024 年 10 月至 12 月国内制造业 PMI 依次为 50.1、50.3、50.1，连续三个月处于扩张区间，2025 年 1 月 PMI 有所回落，显示出新的增量政策依然有一定必要性。2025 年 1 月 CPI 同比上涨 0.50%，环比上涨 0.70%，价格水平持续改善。2024 年 12 月 M2 同比增长 7.3%，M1 同比下降 1.4%，M1 环比持续回升。从资产价格的表现来看，2024 年 A 股市场波动加剧，大盘风格显著优于小盘风格，价值风格优于成长风格，沪深 300、中证 500 和中证 1000 指数全年分别上涨 14.68%、5.46%和 1.2%。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，景顺长城中证 1000 指数增强 A 份额净值增长率为 7.67%，业绩比较基准收益率为 1.41%。

本报告期内，景顺长城中证 1000 指数增强 C 份额净值增长率为 7.24%，业绩比较基准收益率为 1.41%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，宏观经济层面，海外市场的冲击依然存在，关税仍然是较大的不确定因素，但国内稳增长的政策方向已经逐步明朗，国内科技企业的快速崛起将系统性提升我国科技公司的估值水平，市场的机遇要大于风险。随着经济数据的不断验证以及市场风险偏好水平的逐步改善，权益类资产在低利率环境下的风险收益比将进一步凸显。在经济新旧动能转换的过程中，A 股市场仍然将以结构性机会为主，这将给我们的量化模型带来较大的发挥空间。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。

本基金是以中证 1000 指数为基准的指数增强基金，中证 1000 指数作为中小市值企业的代表，在市场预期改善以及经济修复的过程中将有更大的弹性。选股层面，我们的投资组合主要以基本面量化选股为主，风格上维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生持续稳定的超额收益。

#### 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（如需）。

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续教育课程，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

在本报告期内，本基金托管人在托管本基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

§ 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_H74 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 1000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了景顺长城中证 1000 指数增强型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 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的景顺长城中证 1000 指数增强型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 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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 1000 指数增强型证券投资基金，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。</p>
其他信息	<p>景顺长城中证 1000 指数增强型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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估景顺长城中证 1000 指数增强型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。</p> <p>治理层负责监督景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基</p>

	金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>（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。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对景顺长城中证 1000 指数增强型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 1000 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	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 1000 指数增强型证券投资基金

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	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	27,153,914.37	12,291,515.77
结算备付金		679,015.09	449,156.23
存出保证金		142,939.20	561,273.60
交易性金融资产	7.4.7.2	87,822,055.68	136,776,147.08
其中：股票投资		86,814,294.04	136,657,139.11
基金投资		-	-
债券投资		1,007,761.64	119,007.97
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		290,202.30	333,904.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		116,088,126.64	150,411,997.46
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>			
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		21,815,678.28	92,728.26
应付管理人报酬		102,177.45	118,811.48
应付托管费		15,326.64	17,821.71
应付销售服务费		22,027.64	28,309.03
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.21
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	22,028.06	160,049.83
负债合计		21,977,238.07	417,720.52
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	89,407,178.00	153,325,235.17
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	4,703,710.57	-3,330,958.23
净资产合计		94,110,888.57	149,994,276.94
负债和净资产总计		116,088,126.64	150,411,997.46

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 89,407,178.00 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 1.0576 元，基金份额 49,740,449.76 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.0463 元，基金份额 39,666,728.24 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		7,449,268.67	4,428,309.30
1. 利息收入		67,265.38	81,247.66
其中：存款利息收入	7.4.7.13	67,265.38	81,247.66
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）		4,828,131.90	-3,106,917.27
其中：股票投资收益	7.4.7.14	2,583,337.06	-4,850,504.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	22,509.92	242,580.99
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	49,099.92	-133,076.64
股利收益	7.4.7.19	2,173,185.00	1,634,083.26
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	2, 430, 589. 18	7, 363, 851. 39
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	123, 282. 21	90, 127. 52
减：二、营业总支出		1, 961, 525. 55	2, 076, 704. 03
1. 管理人报酬	7. 4. 10. 2. 1	1, 311, 532. 39	1, 391, 136. 17
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7. 4. 10. 2. 2	196, 729. 94	208, 670. 40
3. 销售服务费	7. 4. 10. 2. 3	309, 085. 56	316, 532. 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	7. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		2, 177. 66	364. 78
8. 其他费用	7. 4. 7. 23	142, 000. 00	160, 000. 00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5, 487, 743. 12	2, 351, 605. 27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5, 487, 743. 12	2, 351, 605. 27
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5, 487, 743. 12	2, 351, 605. 27

7.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 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	153, 325, 235. 17	-	-3, 330, 958. 23	149, 994, 276. 94
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	153,325,235.17	-	-3,330,958.23	149,994,276.94
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-63,918,057.17	-	8,034,668.80	-55,883,388.37
(一)、综合收益总额	-	-	5,487,743.12	5,487,743.12
(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)	-63,918,057.17	-	2,546,925.68	-61,371,131.49
其中：1. 基金申购款	132,050,776.24	-	-8,910,895.39	123,139,880.85
2. 基金赎回款	-195,968,833.41	-	11,457,821.07	-184,511,012.34
(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	89,407,178.00	-	4,703,710.57	94,110,888.57
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	155,883,570.10	-	-2,812,378.52	153,071,191.58
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	155,883,570.10	-	-2,812,378.52	153,071,191.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,558,334.93	-	-518,579.71	-3,076,914.64
(一)、综合收益总额	-	-	2,351,605.27	2,351,605.27

(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-2,558,334.93	-	-2,870,184.98	-5,428,519.91
其中: 1. 基金申购款	73,498,745.54	-	1,476,327.56	74,975,073.10
2. 基金赎回款	-76,057,080.47	-	-4,346,512.54	-80,403,593.01
(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	153,325,235.17	-	-3,330,958.23	149,994,276.94

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

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金(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[2022]478 号文《关于准予景顺长城中证 1000 指数增强型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 1000 指数增强型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 2022 年 4 月 27 日生效。本基金为契约型开放式,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 581,796,523.71 元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币 107,725.39 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 581,904,249.10 元,折合 581,904,249.10 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,登记机构为本基金管理人,基金托管人为中信建投证券股份有限公司。



根据《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》和《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、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/申购时收取前端认购/申购费用，且不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的，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，而是从本类别基金资产净值中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

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、科创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）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、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、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换公司债）、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、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金将根据法律法规的规定参与转融通证券出借及融资业务。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证，下同）的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权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：中证 1000 指数收益率 $\times$ 95%+商业银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

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 年度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。

##### 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

本基金同一类别的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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于该类基金份额的面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

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作为增值税纳税人；

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	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	24,355,843.69	9,854,145.72
等于：本金	24,355,285.98	9,852,540.58
加：应计利息	557.71	1,605.14
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	2,798,070.68	2,437,370.05
等于：本金	2,797,490.93	2,437,063.94
加：应计利息	579.75	306.11
减：坏账准备	-	-
合计	27,153,914.37	12,291,515.77

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		86,237,431.42	-	86,814,294.04	576,862.62
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	999,970.00	5,961.64	1,007,761.64	1,830.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	999,970.00	5,961.64	1,007,761.64	1,830.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		87,237,401.42	5,961.64	87,822,055.68	578,692.62

项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		138,437,715.67	-	136,657,139.11	-1,780,576.56
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	119,000.00	7.97	119,007.97	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	119,000.00	7.97	119,007.97	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		138,556,715.67	7.97	136,776,147.08	-1,780,576.56

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	1,226,120.00	-	-	
其中：股指期货投资	1,226,120.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	1,226,120.00	-	-	
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	4,783,560.00	-	-	
其中	4,783,560.00	-	-	

中：股指期货投资				
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,783,560.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的股指期货投资期末合同/名义金额为初始合约价值。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2501	IM2501	1.00	1,191,160.00	-34,960.00
合计				-34,960.00
减：可抵销期货暂收款				-34,960.00
净额				0.00

注：（1）衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

（2）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度末的其他权益工具投资余额为零。

7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末及上年度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	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	28.06	49.83
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	22,000.00	160,000.00
合计	22,028.06	160,049.83

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	58,382,476.41	58,382,476.41
本期申购	24,194,316.83	24,194,316.83
本期赎回（以“-”号填列）	-32,836,343.48	-32,836,343.48
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	49,740,449.76	49,740,449.76
-----	---------------	---------------

景顺长城中证 1000 指数增强 C

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	94,942,758.76	94,942,758.76
本期申购	107,856,459.41	107,856,459.41
本期赎回（以“-”号填列）	-163,132,489.93	-163,132,489.93
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	39,666,728.24	39,666,728.24

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

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

景顺长城中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,587,425.64	-3,617,065.75	-1,029,640.11
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,587,425.64	-3,617,065.75	-1,029,640.11
本期利润	2,993,425.46	1,238,676.68	4,232,102.14
本期基金份额交易产生的变动数	-12,904.24	-324,431.23	-337,335.47
其中：基金申购款	-326,986.89	-638,615.72	-965,602.61
基金赎回款	314,082.65	314,184.49	628,267.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,567,946.86	-2,702,820.30	2,865,126.56

景顺长城中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,580,161.72	-5,881,479.84	-2,301,318.12
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,580,161.72	-5,881,479.84	-2,301,318.12
本期利润	63,728.48	1,191,912.50	1,255,640.98
本期基金份额交易产	351,236.02	2,533,025.13	2,884,261.15

生的变动数			
其中：基金申购款	-3,039,664.18	-4,905,628.60	-7,945,292.78
基金赎回款	3,390,900.20	7,438,653.73	10,829,553.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,995,126.22	-2,156,542.21	1,838,584.01

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	44,615.83	43,539.84
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	9,691.80	9,796.24
结算备付金利息收入	12,957.75	27,911.58
其他	-	-
合计	67,265.38	81,247.66

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1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,583,337.06	-4,850,504.88
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
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	2,583,337.06	-4,850,504.88

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 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	998,495,409.30	1,167,619,510.81
减：卖出股票成本总额	994,503,617.10	1,170,113,807.70

减：交易费用	1,408,455.14	2,356,207.99
买卖股票差价收入	2,583,337.06	-4,850,504.88

#### 7.4.7.14.3 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

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	2,326.29	172.05
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	20,183.63	242,408.94
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	22,509.92	242,580.99

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	139,213.67	1,307,532.62
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	119,000.00	1,064,900.00
减：应计利息总额	24.51	171.32
减：交易费用	5.53	52.36
买卖债券差价收入	20,183.63	242,408.94

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	49,099.92	-133,076.64

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,173,185.00	1,634,083.26
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	2,173,185.00	1,634,083.26

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 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	2,359,269.18	7,312,091.39
股票投资	2,357,439.18	7,312,091.39
债券投资	1,830.00	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	71,320.00	51,760.00



权证投资	-	-
期货投资	71,320.00	51,760.00
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	2,430,589.18	7,363,851.39

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	112,005.17	86,323.95
基金转换费收入	11,277.04	3,803.57
合计	123,282.21	90,127.52

#### 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 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	22,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
合计	142,000.00	160,000.00

#### 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、登记机构、基金销售机构
中信建投证券股份有限公司（“中信建投证券”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、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
------------------	-----------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
中信建投证券	1,843,109,563.40	95.01	2,321,891,775.62	100.00

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
中信建投证券	747,140.66	95.22	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
中信建投证券	1,199,706.80	100.00	-	-

注：（1）上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

（2）本报告期内 1-6 月该类佣金协议的服务范围包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等（上年度可比期间：同）。

（3）根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

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 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,311,532.39	1,391,136.17
其中：应支付销售机构的客户维护费	386,249.86	355,528.56
应支付基金管理人的净管理费	925,282.53	1,035,607.61

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	196,729.94	208,670.40

注：支付基金托管人的托管费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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城中证 1000 指数增强 A	景顺长城中证 1000 指数增强 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	136,711.03	136,711.03
中信建投证券	-	113,114.28	113,114.28
长城证券	-	23.06	23.06
合计	-	249,848.37	249,848.37
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城中证 1000 指数增强 A	景顺长城中证 1000 指数增强 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	—	193,231.95	193,231.95
中信建投证券	—	73,906.82	73,906.82
长城证券	—	11.88	11.88
合计	—	267,150.65	267,150.65

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 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。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×0.40%/当年天数。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未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

本基金于本报告期及上年度可比期间未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

本基金于本报告期及上年度可比期间未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

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 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

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 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 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信建投证券－ 证券资金账户	1,505,274.82	6,763.30	2,437,370.05	9,796.24

注：基金托管人中信建投证券受托作为本基金的证券经纪商。上述款项为本基金存放于中信建投证券基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未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
301552	科力装备	2024 年 7 月 15 日	6 个月	新股流通受限	30.00	56.87	102	3,060.00	5,800.74	-
301585	蓝宇股份	2024 年 12 月 10 日	6 个月	新股流通受限	23.95	35.85	141	3,376.95	5,054.85	-
301603	乔锋智能	2024 年 7 月 3 日	6 个月	新股流通受限	26.50	41.98	151	4,001.50	6,338.98	-
301606	绿联科技	2024 年 7 月 17 日	6 个月	新股流通受限	21.21	36.49	147	3,117.87	5,364.03	-
301608	博实结	2024 年 7 月 25 日	6 个月	新股流通受限	44.50	65.38	71	3,159.50	4,641.98	-
301617	博苑股份	2024 年 12 月 3 日	6 个月	新股流通受限	27.76	39.79	122	3,386.72	4,854.38	-
301622	英思特	2024 年 11 月 26 日	6 个月	新股流通受限	22.36	44.92	171	3,823.56	7,681.32	-

603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	18.65	22.61	85	1,585.25	1,921.85	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通受限	20.56	36.17	86	1,768.16	3,110.62	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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行合同责任, 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的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 0.00%（上年度末：0.08%）。

#### 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组合持仓集中度指标、流通受限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公司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	27,153,914.37	-	-	-	-	-	27,153,914.37
结算备付金	679,015.09	-	-	-	-	-	679,015.09
存出保证金	-	-	-	-	-	142,939.20	142,939.20
交易性金融资产	-	-1,007,761.64	-	-	-	86,814,294.04	87,822,055.68
应收申购款	-	-	-	-	-	290,202.30	290,202.30
资产总计	27,832,929.46	-1,007,761.64	-	-	-	87,247,435.54	116,088,126.64
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	21,815,678.28	21,815,678.28
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	102,177.45	102,177.45
应付托管费	-	-	-	-	-	15,326.64	15,326.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-	22,027.64	22,027.64
其他负债	-	-	-	-	-	22,028.06	22,028.06
负债总计	-	-	-	-	-	21,977,238.07	21,977,238.07
利率敏感度缺口	27,832,929.46	-1,007,761.64	-	-	-	-	-
上年度末 2023 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	12,291,515.77	-	-	-	-	-	12,291,515.77
结算备付金	449,156.23	-	-	-	-	-	449,156.23
存出保证金	-	-	-	-	-	561,273.60	561,273.60
交易性金融资产	-	-	-96,006.31	23,001.66	136,657,139.11	136,776,147.08	
应收申购款	-	-	-	-	-	333,904.78	333,904.78
资产总计	12,740,672.00	-	-96,006.31	23,001.66	137,552,317.49	150,411,997.46	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	92,728.26	92,728.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	118,811.48	118,811.48
应付托管	-	-	-	-	-	17,821.71	17,821.71

费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	28,309.03	28,309.03
应交税费	-	-	-	-	-	0.21	0.21
其他负债	-	-	-	-	-	160,049.83	160,049.83
负债总计	-	-	-	-	-	417,720.52	417,720.52
利率敏感度缺口	12,740,672.00	-	-	-96,006.31	23,001.66	-	-

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-1,405.98	-
	市场利率下降 25 个基点	1,408.70	-

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		上年度末 2023 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	86,814,294.04	92.25	136,657,139.11	91.11

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	86,814,294.04	92.25	136,657,139.11	91.11

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）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	5,051,428.60	6,906,327.25
	沪深 300 指数下降 5%	-5,051,428.60	-6,906,327.25

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	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	86,769,525.29	136,401,903.73
第二层次	1,007,761.64	119,007.97

第三层次	44,768.75	255,235.38
合计	87,822,055.68	136,776,147.08

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 1 月 1 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	-	255,235.38	255,235.38
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	27,279.51	27,279.51
转出第三层次	-	255,235.38	255,235.38
当期利得或损失总额	-	17,489.24	17,489.24
其中：计入损益的利得或损失	-	17,489.24	17,489.24
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	44,768.75	44,768.75
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	17,489.24	17,489.24
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	762,658.21	762,658.21
当期购买	-	-	-

当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	174,966.16	174,966.16
转出第三层次	-	762,658.21	762,658.21
当期利得或损失总额	-	80,269.22	80,269.22
其中：计入损益的利得或损失	-	80,269.22	80,269.22
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	255,235.38	255,235.38
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	80,269.22	80,269.22

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	44,768.75	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.3521-2.3782	负相关
项目	上年度末公允价值	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	255,235.38	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1962-2.1775	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

本基金本报告期末及上年度末均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	86,814,294.04	74.78
	其中：股票	86,814,294.04	74.78
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,007,761.64	0.87
	其中：债券	1,007,761.64	0.87
	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	27,832,929.46	23.98
8	其他各项资产	433,141.50	0.37
9	合计	116,088,126.64	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	285,324.00	0.30
B	采矿业	796,188.40	0.85
C	制造业	56,261,474.87	59.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,481,164.00	1.57
E	建筑业	933,693.00	0.99
F	批发和零售业	2,992,201.00	3.18
G	交通运输、仓储和邮政业	2,168,218.00	2.30
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,707,729.20	11.38
J	金融业	1,382,325.00	1.47
K	房地产业	1,881,478.00	2.00
L	租赁和商务服务业	1,317,145.00	1.40
M	科学研究和技术服务业	1,233,342.84	1.31
N	水利、环境和公共设施管理业	808,352.00	0.86
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	495,075.00	0.53

R	文化、体育和娱乐业	1,002,816.00	1.07
S	综合	-	-
	合计	83,746,526.31	88.99

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	118,089.00	0.13
C	制造业	1,933,574.27	2.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	917.00	0.00
E	建筑业	13,720.00	0.01
F	批发和零售业	25,520.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	705,828.46	0.75
J	金融业	69,262.00	0.07
K	房地产业	102,666.00	0.11
L	租赁和商务服务业	19,350.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	9,542.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	69,299.00	0.07
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	3,067,767.73	3.26

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	600718	东软集团	61,700	664,509.00	0.71
2	000686	东北证券	79,500	631,230.00	0.67

3	000528	柳工	51,400	619,884.00	0.66
4	002212	天融信	93,600	603,720.00	0.64
5	002249	大洋电机	102,600	602,262.00	0.64
6	600602	云赛智联	37,500	593,250.00	0.63
7	600037	歌华有线	78,100	582,626.00	0.62
8	601137	博威合金	28,300	574,490.00	0.61
9	002023	海特高新	56,000	568,400.00	0.60
10	300346	南大光电	14,700	567,273.00	0.60
11	600420	国药现代	45,000	537,300.00	0.57
12	300627	华测导航	12,700	530,860.00	0.56
13	600428	中远海特	72,400	528,520.00	0.56
14	000951	中国重汽	30,700	521,286.00	0.55
15	603612	索通发展	38,200	516,082.00	0.55
16	300409	道氏技术	37,200	506,292.00	0.54
17	600320	振华重工	121,600	476,672.00	0.51
18	002550	千红制药	75,700	469,340.00	0.50
19	002139	拓邦股份	34,400	468,184.00	0.50
20	300772	运达股份	34,730	459,825.20	0.49
21	300244	迪安诊断	39,900	452,865.00	0.48
22	300181	佐力药业	28,500	437,760.00	0.47
23	300113	顺网科技	26,000	437,060.00	0.46
24	603766	隆鑫通用	47,900	435,890.00	0.46
25	601126	四方股份	25,500	432,480.00	0.46
26	002668	TCL 智家	32,800	430,336.00	0.46
27	600216	浙江医药	26,600	421,876.00	0.45
28	301175	中科环保	77,400	417,960.00	0.44
29	002967	广电计量	25,000	410,000.00	0.44
30	605589	圣泉集团	16,900	398,502.00	0.42
31	600210	紫江企业	58,900	389,329.00	0.41
32	002456	欧菲光	32,400	388,152.00	0.41
33	000848	承德露露	43,200	387,504.00	0.41
34	301050	雷电微力	7,500	386,850.00	0.41
35	603025	大豪科技	25,200	384,300.00	0.41
36	605111	新洁能	11,260	381,826.60	0.41
37	002705	新宝股份	25,100	376,500.00	0.40
38	002745	木林森	42,600	371,472.00	0.39
39	601369	陕鼓动力	42,300	368,010.00	0.39
40	600559	老白干酒	17,400	365,226.00	0.39
41	300850	新强联	19,100	365,001.00	0.39
42	002091	江苏国泰	49,600	363,072.00	0.39
43	002906	华阳集团	11,700	359,775.00	0.38
44	600269	赣粤高速	63,300	355,113.00	0.38
45	688127	蓝特光学	13,100	355,010.00	0.38



46	002928	华夏航空	45,700	354,632.00	0.38
47	301327	华宝新能	4,600	352,866.00	0.37
48	002237	恒邦股份	34,500	348,450.00	0.37
49	300777	中简科技	12,300	347,967.00	0.37
50	300079	数码视讯	63,000	340,830.00	0.36
51	300811	铂科新材	6,300	339,633.00	0.36
52	600993	马应龙	13,000	339,430.00	0.36
53	300415	伊之密	16,900	339,014.00	0.36
54	000415	渤海租赁	89,400	337,038.00	0.36
55	002497	雅化集团	28,600	334,620.00	0.36
56	300482	万孚生物	14,900	333,909.00	0.35
57	002043	兔宝宝	28,000	332,640.00	0.35
58	300083	创世纪	49,300	320,943.00	0.34
59	300620	光库科技	6,600	320,760.00	0.34
60	002567	唐人神	62,600	319,260.00	0.34
61	300432	富临精工	20,500	315,290.00	0.34
62	600649	城投控股	69,900	311,055.00	0.33
63	688019	安集科技	2,228	310,494.08	0.33
64	688372	伟测科技	5,292	309,687.84	0.33
65	300674	宇信科技	15,800	308,416.00	0.33
66	603197	保隆科技	8,100	305,775.00	0.32
67	688185	康希诺	5,000	305,250.00	0.32
68	603005	晶方科技	10,800	305,100.00	0.32
69	603920	世运电路	10,300	302,820.00	0.32
70	000682	东方电子	28,000	299,880.00	0.32
71	300236	上海新阳	8,000	298,960.00	0.32
72	600623	华谊集团	42,500	297,500.00	0.32
73	300770	新媒股份	7,300	294,993.00	0.31
74	300525	博思软件	18,900	294,462.00	0.31
75	300672	国科微	4,400	293,700.00	0.31
76	000966	长源电力	61,800	293,550.00	0.31
77	000550	江铃汽车	12,400	290,780.00	0.31
78	600729	重庆百货	9,800	286,650.00	0.30
79	688208	道通科技	7,254	284,066.64	0.30
80	300456	赛微电子	16,500	283,470.00	0.30
81	000970	中科三环	27,100	281,027.00	0.30
82	301031	中熔电气	2,700	280,854.00	0.30
83	002036	联创电子	29,400	276,360.00	0.29
84	300679	电连技术	4,600	274,620.00	0.29
85	688270	臻镭科技	7,800	273,000.00	0.29
86	002222	福晶科技	8,380	271,512.00	0.29
87	603477	巨星农牧	15,200	269,800.00	0.29
88	600728	佳都科技	56,900	266,292.00	0.28

89	688123	聚辰股份	4,432	259,360.64	0.28
90	000680	山推股份	26,700	258,990.00	0.28
91	600366	宁波韵升	34,700	255,392.00	0.27
92	000881	中广核技	34,600	253,618.00	0.27
93	600266	城建发展	49,700	253,470.00	0.27
94	000902	新洋丰	19,200	250,368.00	0.27
95	600648	外高桥	21,000	250,110.00	0.27
96	688388	嘉元科技	16,947	249,629.31	0.27
97	603267	鸿远电子	6,800	246,364.00	0.26
98	300232	洲明科技	35,700	245,259.00	0.26
99	300034	钢研高纳	15,700	244,920.00	0.26
100	300327	中颖电子	10,000	244,700.00	0.26
101	603100	川仪股份	11,200	241,360.00	0.26
102	300685	艾德生物	10,500	239,400.00	0.25
103	600710	苏美达	25,700	239,010.00	0.25
104	301078	孩子王	21,000	238,980.00	0.25
105	300170	汉得信息	19,100	236,840.00	0.25
106	300475	香农芯创	8,300	236,467.00	0.25
107	688063	派能科技	5,900	236,295.00	0.25
108	603013	亚普股份	15,500	232,190.00	0.25
109	600531	豫光金铅	35,900	230,478.00	0.24
110	688200	华峰测控	2,200	229,900.00	0.24
111	600641	万业企业	15,700	229,534.00	0.24
112	002948	青岛银行	59,100	229,308.00	0.24
113	300666	江丰电子	3,300	229,185.00	0.24
114	002706	良信股份	29,400	225,792.00	0.24
115	688183	生益电子	5,700	223,782.00	0.24
116	603118	共进股份	25,100	223,390.00	0.24
117	603083	剑桥科技	5,500	223,300.00	0.24
118	601975	招商南油	71,000	222,230.00	0.24
119	000923	河钢资源	15,900	221,010.00	0.23
120	002332	仙琚制药	21,800	216,692.00	0.23
121	688048	长光华芯	5,500	214,445.00	0.23
122	600633	浙数文化	20,400	213,384.00	0.23
123	300598	诚迈科技	4,400	212,960.00	0.23
124	601222	林洋能源	30,100	212,807.00	0.23
125	300570	太辰光	2,900	210,830.00	0.22
126	002701	奥瑞金	37,100	210,357.00	0.22
127	600446	金证股份	12,200	210,328.00	0.22
128	300261	雅本化学	30,000	205,500.00	0.22
129	600550	保变电气	26,100	204,885.00	0.22
130	002174	游族网络	21,900	204,765.00	0.22
131	002226	江南化工	37,200	201,624.00	0.21

132	002534	西子洁能	18,100	201,091.00	0.21
133	002405	四维图新	20,800	200,512.00	0.21
134	300130	新国都	9,200	199,272.00	0.21
135	603565	中谷物流	20,300	198,940.00	0.21
136	600850	电科数字	8,300	198,370.00	0.21
137	000603	盛达资源	16,400	196,636.00	0.21
138	002446	盛路通信	29,900	195,845.00	0.21
139	300151	昌红科技	11,500	195,500.00	0.21
140	600562	国睿科技	9,800	195,314.00	0.21
141	601311	骆驼股份	23,500	194,815.00	0.21
142	688209	英集芯	11,000	194,370.00	0.21
143	002270	华明装备	11,500	194,235.00	0.21
144	300323	华灿光电	23,400	193,752.00	0.21
145	600055	万东医疗	12,800	193,280.00	0.21
146	600163	中闽能源	31,700	193,053.00	0.21
147	600246	万通发展	25,900	192,955.00	0.21
148	603383	顶点软件	5,100	191,250.00	0.20
149	601702	华峰铝业	10,400	190,528.00	0.20
150	600064	南京高科	24,500	190,365.00	0.20
151	688131	皓元医药	5,300	189,210.00	0.20
152	600478	科力远	45,500	187,915.00	0.20
153	688596	正帆科技	5,238	186,210.90	0.20
154	603678	火炬电子	6,100	186,050.00	0.20
155	003012	东鹏控股	28,100	185,741.00	0.20
156	603530	神马电力	7,500	185,325.00	0.20
157	688007	光峰科技	12,500	184,875.00	0.20
158	000885	城发环境	14,000	183,540.00	0.20
159	600874	创业环保	30,700	183,279.00	0.19
160	601677	明泰铝业	15,200	182,856.00	0.19
161	300035	中科电气	12,100	180,895.00	0.19
162	603690	至纯科技	7,200	180,792.00	0.19
163	002020	京新药业	14,100	180,480.00	0.19
164	002837	英维克	4,460	180,184.00	0.19
165	603283	赛腾股份	2,600	179,816.00	0.19
166	600557	康缘药业	13,000	177,060.00	0.19
167	002127	南极电商	40,100	176,440.00	0.19
168	000766	通化金马	11,200	175,840.00	0.19
169	001309	德明利	2,000	174,400.00	0.19
170	000025	特力 A	10,500	173,460.00	0.18
171	300088	长信科技	26,300	172,002.00	0.18
172	000049	德赛电池	7,300	171,623.00	0.18
173	688150	莱特光电	7,500	168,900.00	0.18
174	601886	江河集团	31,200	168,480.00	0.18

175	001270	铖昌科技	4,380	166,878.00	0.18
176	688700	东威科技	5,600	164,976.00	0.18
177	002100	天康生物	25,100	164,405.00	0.17
178	688568	中科星图	3,200	163,296.00	0.17
179	301511	德福科技	13,000	163,280.00	0.17
180	603301	振德医疗	7,400	162,726.00	0.17
181	600335	国机汽车	26,000	161,980.00	0.17
182	601811	新华文轩	10,200	161,670.00	0.17
183	002130	沃尔核材	6,400	161,600.00	0.17
184	600100	同方股份	22,700	161,397.00	0.17
185	600639	浦东金桥	14,500	160,950.00	0.17
186	002773	康弘药业	8,200	160,720.00	0.17
187	605333	沪光股份	4,900	159,887.00	0.17
188	000029	深深房 A	10,600	159,636.00	0.17
189	300363	博腾股份	10,100	159,277.00	0.17
190	002151	北斗星通	6,000	159,240.00	0.17
191	002123	梦网科技	14,700	158,907.00	0.17
192	600363	联创光电	3,300	158,004.00	0.17
193	300757	罗博特科	700	157,724.00	0.17
194	600640	国脉文化	13,200	157,608.00	0.17
195	600664	哈药股份	37,800	156,114.00	0.17
196	002396	星网锐捷	8,200	155,718.00	0.17
197	300438	鹏辉能源	5,500	154,605.00	0.16
198	300303	聚飞光电	22,300	152,086.00	0.16
199	300443	金雷股份	7,600	151,392.00	0.16
200	000090	天健集团	36,800	151,248.00	0.16
201	000969	安泰科技	13,500	150,525.00	0.16
202	300031	宝通科技	8,100	148,392.00	0.16
203	301171	易点天下	5,200	146,588.00	0.16
204	600572	康恩贝	31,300	145,858.00	0.15
205	000061	农产品	20,800	145,808.00	0.15
206	300406	九强生物	10,900	145,624.00	0.15
207	300253	卫宁健康	20,300	145,348.00	0.15
208	688235	百济神州	900	144,918.00	0.15
209	600285	羚锐制药	6,500	144,040.00	0.15
210	688037	芯源微	1,718	143,676.34	0.15
211	300682	朗新集团	11,700	142,740.00	0.15
212	000035	中国天楹	29,200	142,204.00	0.15
213	601515	东峰集团	35,600	141,688.00	0.15
214	600810	神马股份	17,500	141,575.00	0.15
215	688598	金博股份	6,700	141,102.00	0.15
216	000503	国新健康	12,800	140,544.00	0.15
217	301558	三态股份	15,900	139,284.00	0.15

218	301029	怡合达	5,600	138,432.00	0.15
219	002011	盾安环境	12,800	138,368.00	0.15
220	002911	佛燃能源	10,900	137,776.00	0.15
221	002960	青鸟消防	11,800	137,706.00	0.15
222	688559	海目星	4,000	137,600.00	0.15
223	300257	开山股份	15,000	136,800.00	0.15
224	688066	航天宏图	6,700	136,680.00	0.15
225	300841	康华生物	2,500	136,300.00	0.14
226	600389	江山股份	9,400	135,830.00	0.14
227	600757	长江传媒	14,100	134,937.00	0.14
228	002498	汉缆股份	39,600	134,244.00	0.14
228	301339	通行宝	6,600	134,244.00	0.14
229	601528	瑞丰银行	23,800	133,994.00	0.14
230	300663	科蓝软件	7,700	133,672.00	0.14
231	300634	彩讯股份	6,100	132,980.00	0.14
232	300036	超图软件	7,800	132,444.00	0.14
233	002649	博彦科技	10,900	132,108.00	0.14
234	600331	宏达股份	17,300	131,826.00	0.14
235	002075	沙钢股份	20,900	130,834.00	0.14
236	300602	飞荣达	6,800	130,696.00	0.14
237	002097	山河智能	17,400	130,500.00	0.14
238	600596	新安股份	14,800	129,944.00	0.14
239	300416	苏试试验	11,000	129,360.00	0.14
240	688352	顾中科技	10,600	128,578.00	0.14
241	002215	诺普信	11,300	126,899.00	0.13
242	002194	武汉凡谷	11,200	125,664.00	0.13
243	300101	振芯科技	5,800	125,628.00	0.13
244	300747	锐科激光	6,500	124,540.00	0.13
245	000917	电广传媒	17,600	124,432.00	0.13
246	002635	安洁科技	7,800	124,176.00	0.13
247	603393	新天然气	4,100	124,107.00	0.13
248	600449	宁夏建材	8,200	123,164.00	0.13
249	300735	光弘科技	4,400	123,156.00	0.13
250	601921	浙版传媒	15,600	122,928.00	0.13
251	002461	珠江啤酒	12,400	122,636.00	0.13
252	600058	五矿发展	17,000	121,040.00	0.13
253	002698	博实股份	7,100	120,700.00	0.13
254	603169	兰石重装	22,000	119,900.00	0.13
255	300762	上海瀚讯	5,700	119,871.00	0.13
256	600783	鲁信创投	9,400	119,098.00	0.13
257	300115	长盈精密	7,300	118,552.00	0.13
258	000928	中钢国际	18,600	118,482.00	0.13
259	603229	奥翔药业	11,800	117,882.00	0.13

260	002847	盐津铺子	1,880	117,688.00	0.13
261	688348	昱能科技	2,400	117,120.00	0.12
262	000875	吉电股份	22,200	116,772.00	0.12
263	002400	省广集团	14,400	115,056.00	0.12
264	002891	中宠股份	3,200	114,240.00	0.12
265	601869	长飞光纤	3,800	113,582.00	0.12
266	600618	氯碱化工	11,500	113,390.00	0.12
267	300315	掌趣科技	20,600	113,300.00	0.12
268	688380	中微半导	3,763	112,513.70	0.12
269	603730	岱美股份	12,500	112,375.00	0.12
270	300618	寒锐钴业	3,300	111,441.00	0.12
271	603308	应流股份	7,900	111,390.00	0.12
272	600171	上海贝岭	2,800	111,104.00	0.12
273	300298	三诺生物	4,300	110,983.00	0.12
274	600422	昆药集团	7,000	110,950.00	0.12
275	603171	税友股份	3,600	109,800.00	0.12
276	300827	上能电气	2,500	109,750.00	0.12
277	300458	全志科技	2,830	109,690.80	0.12
278	600548	深高速	8,000	107,840.00	0.11
279	002726	龙大美食	13,600	107,712.00	0.11
280	688498	源杰科技	800	107,360.00	0.11
281	300624	万兴科技	1,700	107,355.00	0.11
282	000758	中色股份	21,660	107,000.40	0.11
283	301153	中科江南	3,800	106,172.00	0.11
284	600094	大名城	29,100	105,924.00	0.11
285	300451	创业慧康	23,400	104,832.00	0.11
286	600866	星湖科技	16,200	104,814.00	0.11
287	601801	皖新传媒	14,200	104,228.00	0.11
288	002315	焦点科技	2,500	104,200.00	0.11
289	002010	传化智联	23,000	104,190.00	0.11
289	002626	金达威	6,900	104,190.00	0.11
290	688707	振华新材	9,500	104,025.00	0.11
291	002697	红旗连锁	17,600	104,016.00	0.11
292	002859	洁美科技	5,000	103,750.00	0.11
293	002747	埃斯顿	5,600	103,600.00	0.11
294	600330	天通股份	14,500	102,950.00	0.11
295	300633	开立医疗	3,500	102,865.00	0.11
296	688322	奥比中光	2,200	102,300.00	0.11
297	600120	浙江东方	21,900	102,054.00	0.11
298	603439	贵州三力	7,800	101,400.00	0.11
299	300428	立中集团	6,200	101,060.00	0.11
300	000913	钱江摩托	5,600	100,856.00	0.11
301	603466	风语筑	10,800	100,656.00	0.11

302	000756	新华制药	6,400	100,544.00	0.11
303	002651	利君股份	13,700	100,421.00	0.11
304	605009	豪悦护理	2,500	99,900.00	0.11
305	000718	苏宁环球	42,300	99,828.00	0.11
306	002612	朗姿股份	6,100	99,796.00	0.11
307	002402	和而泰	5,500	99,605.00	0.11
308	000860	顺鑫农业	5,100	99,297.00	0.11
309	300741	华宝股份	5,700	99,123.00	0.11
310	300463	迈克生物	7,500	99,000.00	0.11
311	601619	嘉泽新能	29,800	98,936.00	0.11
312	002946	新乳业	6,800	98,668.00	0.10
313	300226	上海钢联	4,300	98,341.00	0.10
314	300470	中密控股	2,600	98,020.00	0.10
315	002216	三全食品	8,150	97,800.00	0.10
316	300366	创意信息	10,500	97,650.00	0.10
317	688608	恒玄科技	300	97,611.00	0.10
318	605365	立达信	6,200	97,340.00	0.10
319	301268	铭利达	5,800	96,164.00	0.10
320	300045	华力创通	4,600	96,094.00	0.10
321	600206	有研新材	6,100	95,587.00	0.10
322	300660	江苏雷利	2,500	95,550.00	0.10
323	002777	久远银海	5,500	94,710.00	0.10
324	688279	峰岬科技	600	94,620.00	0.10
325	000762	西藏矿业	4,400	94,600.00	0.10
326	603300	海南华铁	16,300	94,214.00	0.10
327	000429	粤高速 A	6,400	94,080.00	0.10
328	688408	中信博	1,300	93,600.00	0.10
329	600133	东湖高新	10,000	93,500.00	0.10
330	600894	广日股份	6,400	93,440.00	0.10
331	000543	皖能电力	11,800	93,338.00	0.10
332	688484	南芯科技	2,587	93,235.48	0.10
333	601609	金田股份	15,700	92,630.00	0.10
334	002901	大博医疗	3,000	92,520.00	0.10
335	300623	捷捷微电	2,700	92,232.00	0.10
336	002061	浙江交科	22,500	91,800.00	0.10
337	603915	国茂股份	7,800	91,416.00	0.10
338	603533	掌阅科技	4,500	91,395.00	0.10
339	601595	上海电影	3,700	91,390.00	0.10
340	688515	裕太微	921	91,179.00	0.10
341	300568	星源材质	9,200	89,424.00	0.10
342	300185	通裕重工	34,700	89,179.00	0.09
343	601107	四川成渝	17,000	88,910.00	0.09
344	300027	华谊兄弟	33,800	88,556.00	0.09

345	300779	惠城环保	900	87,840.00	0.09
346	000062	深圳华强	3,900	87,360.00	0.09
346	300687	赛意信息	4,800	87,360.00	0.09
347	603888	新华网	3,900	87,126.00	0.09
348	301510	固高科技	3,300	86,130.00	0.09
349	003006	百亚股份	3,500	83,965.00	0.09
350	600248	陕建股份	18,700	83,776.00	0.09
351	002003	伟星股份	5,900	83,603.00	0.09
352	301205	联特科技	1,100	83,259.00	0.09
353	300773	拉卡拉	4,700	83,190.00	0.09
354	300133	华策影视	11,500	83,030.00	0.09
355	300068	南都电源	5,100	82,314.00	0.09
356	300613	富瀚微	1,400	81,900.00	0.09
357	688110	东芯股份	3,287	81,846.30	0.09
358	000829	天音控股	6,200	81,716.00	0.09
359	002643	万润股份	6,800	81,600.00	0.09
360	002488	金固股份	7,800	81,432.00	0.09
361	600211	西藏药业	2,200	81,268.00	0.09
362	300077	国民技术	3,400	81,056.00	0.09
363	300459	汤姆猫	14,100	80,934.00	0.09
364	002851	麦格米特	1,300	79,898.00	0.08
365	600151	航天机电	10,000	79,800.00	0.08
366	301381	赛维时代	3,500	79,660.00	0.08
367	300319	麦捷科技	6,300	78,624.00	0.08
368	603368	柳药集团	4,400	78,584.00	0.08
369	603075	热威股份	4,200	78,246.00	0.08
370	600458	时代新材	6,100	78,141.00	0.08
371	000676	智度股份	9,100	76,986.00	0.08
372	601500	通用股份	14,300	76,219.00	0.08
373	001301	尚太科技	1,100	75,405.00	0.08
374	688403	汇成股份	8,400	75,264.00	0.08
375	688315	诺禾致源	6,000	75,000.00	0.08
376	300134	大富科技	6,300	73,899.00	0.08
377	002925	盈趣科技	4,700	73,602.00	0.08
378	600827	百联股份	6,600	72,138.00	0.08
379	600195	中牧股份	10,700	71,797.00	0.08
380	300180	华峰超纤	11,200	70,560.00	0.07
380	603919	金徽酒	3,600	70,560.00	0.07
381	600750	江中药业	3,100	70,370.00	0.07
382	600861	北京人力	3,600	69,660.00	0.07
383	002351	漫步者	4,200	69,300.00	0.07
384	601208	东材科技	9,100	68,614.00	0.07
385	002389	航天彩虹	3,800	68,590.00	0.07



386	603123	翠微股份	8,500	68,425.00	0.07
387	002004	华邦健康	15,100	68,252.00	0.07
388	000901	航天科技	6,200	68,014.00	0.07
389	300183	东软载波	3,500	67,725.00	0.07
390	002716	湖南白银	19,700	66,783.00	0.07
391	002176	江特电机	9,000	66,690.00	0.07
392	000498	山东路桥	11,200	66,640.00	0.07
393	601890	亚星锚链	8,500	66,215.00	0.07
394	600459	贵研铂业	4,800	65,904.00	0.07
395	601777	力帆科技	8,600	65,790.00	0.07
396	002987	京北方	4,600	65,458.00	0.07
397	002242	九阳股份	6,300	65,268.00	0.07
398	600186	莲花控股	11,400	64,980.00	0.07
399	300188	国投智能	4,700	64,813.00	0.07
400	300768	迪普科技	3,700	64,750.00	0.07
401	301238	瑞泰新材	4,100	64,206.00	0.07
402	603317	天味食品	4,800	64,032.00	0.07
403	300655	晶瑞电材	6,800	63,648.00	0.07
404	300379	东方通	4,200	63,378.00	0.07
405	300579	数字认证	2,000	62,840.00	0.07
406	003009	中天火箭	1,600	62,400.00	0.07
407	688739	成大生物	2,400	61,872.00	0.07
408	688321	微芯生物	3,300	61,314.00	0.07
409	688289	圣湘生物	2,671	60,631.70	0.06
410	300182	捷成股份	10,300	60,461.00	0.06
411	603299	苏盐井神	5,400	60,156.00	0.06
412	688268	华特气体	1,300	59,696.00	0.06
413	688027	国盾量子	200	59,672.00	0.06
414	002068	黑猫股份	5,600	59,584.00	0.06
415	688083	中望软件	696	59,556.72	0.06
416	002895	川恒股份	2,400	59,040.00	0.06
417	688326	经纬恒润	700	58,870.00	0.06
418	600675	中华企业	20,900	58,729.00	0.06
419	600012	皖通高速	3,300	58,245.00	0.06
420	688300	联瑞新材	900	57,960.00	0.06
421	603398	沐邦高科	2,500	57,525.00	0.06
422	002292	奥飞娱乐	6,500	56,225.00	0.06
423	603093	南华期货	4,700	55,930.00	0.06
424	300455	航天智装	4,300	55,728.00	0.06
425	600933	爱柯迪	3,400	55,420.00	0.06
426	600587	新华医疗	3,300	54,945.00	0.06
427	688128	中国电研	2,600	54,626.00	0.06
428	002125	湘潭电化	5,400	54,432.00	0.06

429	002583	海能达	3,800	53,998.00	0.06
430	603306	华懋科技	1,700	53,737.00	0.06
431	000099	中信海直	2,000	52,720.00	0.06
432	301291	明阳电气	1,200	52,704.00	0.06
433	002034	旺能环境	3,400	52,700.00	0.06
434	600552	凯盛科技	4,600	52,486.00	0.06
435	603328	依顿电子	5,300	52,258.00	0.06
436	688091	上海谊众	1,300	51,896.00	0.06
437	688630	芯碁微装	883	50,966.76	0.05
438	688116	天奈科技	1,300	50,453.00	0.05
439	600575	淮河能源	12,700	50,419.00	0.05
440	002079	苏州固锔	4,900	50,323.00	0.05
441	688107	安路科技	1,700	50,286.00	0.05
442	300726	宏达电子	1,600	49,760.00	0.05
443	000028	国药一致	1,700	49,725.00	0.05
444	600185	格力地产	6,900	49,611.00	0.05
445	600577	精达股份	6,800	49,572.00	0.05
446	001236	弘业期货	5,100	49,164.00	0.05
447	603039	泛微网络	1,000	49,000.00	0.05
448	600475	华光环能	5,400	48,654.00	0.05
449	688166	博瑞医药	1,600	48,320.00	0.05
450	600502	安徽建工	10,100	48,278.00	0.05
451	002245	蔚蓝锂芯	4,500	48,105.00	0.05
452	300352	北信源	9,100	48,048.00	0.05
453	301039	中集车辆	5,300	47,965.00	0.05
454	600667	太极实业	6,900	47,748.00	0.05
455	000600	建投能源	8,400	47,544.00	0.05
456	688206	概伦电子	2,500	47,275.00	0.05
457	300075	数字政通	2,700	46,710.00	0.05
458	002063	远光软件	8,100	46,656.00	0.05
459	002545	东方铁塔	6,600	46,398.00	0.05
460	603108	润达医疗	2,900	46,197.00	0.05
461	601969	海南矿业	6,500	46,085.00	0.05
462	002088	鲁阳节能	3,600	46,044.00	0.05
463	002597	金禾实业	2,000	45,660.00	0.05
464	002317	众生药业	3,700	44,955.00	0.05
465	002761	浙江建投	5,100	44,778.00	0.05
466	600662	外服控股	8,800	44,616.00	0.05
467	603358	华达科技	1,300	43,420.00	0.05
468	600223	福瑞达	5,700	43,092.00	0.05
469	300705	九典制药	2,400	43,080.00	0.05
470	600882	妙可蓝多	2,400	42,960.00	0.05
471	002233	塔牌集团	5,600	42,952.00	0.05

472	301239	普瑞眼科	900	42,210.00	0.04
473	603583	捷昌驱动	1,700	42,007.00	0.04
474	601020	华钰矿业	3,300	41,646.00	0.04
475	688076	诺泰生物	800	41,536.00	0.04
476	688586	江航装备	4,299	41,141.43	0.04
477	301217	铜冠铜箔	3,700	40,996.00	0.04
478	603699	纽威股份	1,800	39,906.00	0.04
479	600643	爱建集团	7,700	39,809.00	0.04
480	001914	招商积余	3,700	39,109.00	0.04
481	300973	立高食品	1,000	39,030.00	0.04
482	688337	普源精电	1,000	39,000.00	0.04
483	603055	台华新材	3,500	38,780.00	0.04
484	301297	富乐德	900	38,250.00	0.04
485	002267	陕天然气	4,500	38,025.00	0.04
486	600869	远东股份	7,800	37,050.00	0.04
487	301207	华兰疫苗	2,100	36,771.00	0.04
488	300492	华图山鼎	500	36,400.00	0.04
489	600751	海航科技	13,700	36,031.00	0.04
490	603279	景津装备	2,000	35,760.00	0.04
491	000791	甘肃能源	5,900	35,577.00	0.04
492	000657	中钨高新	3,800	34,998.00	0.04
493	301262	海看股份	1,400	34,818.00	0.04
494	600328	中盐化工	4,400	34,628.00	0.04
495	603236	移远通信	500	34,220.00	0.04
496	688318	财富趋势	200	34,200.00	0.04
497	301526	国际复材	8,800	32,560.00	0.03
498	001696	宗申动力	1,300	32,370.00	0.03
499	600761	安徽合力	1,800	31,770.00	0.03
500	300576	容大感光	700	31,626.00	0.03
501	600645	中源协和	1,600	30,880.00	0.03
502	600057	厦门象屿	4,700	30,503.00	0.03
503	603337	杰克股份	1,000	30,460.00	0.03
504	000685	中山公用	3,300	30,459.00	0.03
505	688177	百奥泰	1,557	30,174.66	0.03
506	002605	姚记科技	1,100	29,326.00	0.03
507	000828	东莞控股	2,700	28,863.00	0.03
508	000719	中原传媒	2,500	28,400.00	0.03
509	300820	英杰电气	500	27,625.00	0.03
510	300775	三角防务	1,100	27,423.00	0.03
511	002274	华昌化工	3,500	27,195.00	0.03
512	300725	药石科技	800	26,880.00	0.03
513	600776	东方通信	2,400	26,856.00	0.03
514	301015	百洋医药	1,100	26,631.00	0.03

515	300039	上海凯宝	4,300	26,574.00	0.03
516	002727	一心堂	2,000	26,040.00	0.03
517	600509	天富能源	3,900	25,233.00	0.03
518	002840	华统股份	2,000	25,220.00	0.03
519	688261	东微半导	600	25,194.00	0.03
520	600657	信达地产	6,000	24,960.00	0.03
521	300080	易成新能	5,700	24,909.00	0.03
522	600682	南京新百	3,600	24,624.00	0.03
523	000801	四川九洲	1,700	24,327.00	0.03
524	002158	汉钟精机	1,300	24,076.00	0.03
525	600059	古越龙山	2,700	23,976.00	0.03
526	688798	艾为电子	338	23,599.16	0.03
527	600073	光明肉业	3,400	23,596.00	0.03
528	300085	银之杰	600	22,950.00	0.02
529	603983	丸美生物	700	22,582.00	0.02
530	688503	聚和材料	500	22,145.00	0.02
531	601101	昊华能源	2,600	21,398.00	0.02
532	600961	株冶集团	2,700	21,249.00	0.02
533	002183	怡亚通	4,600	20,654.00	0.02
534	603733	仙鹤股份	1,000	20,630.00	0.02
535	688658	悦康药业	1,400	20,174.00	0.02
536	603989	艾华集团	1,300	19,604.00	0.02
537	600987	航民股份	2,800	19,432.00	0.02
538	300737	科顺股份	3,800	19,266.00	0.02
539	688167	炬光科技	300	19,110.00	0.02
540	601068	中铝国际	4,300	18,963.00	0.02
541	603636	南威软件	1,800	18,900.00	0.02
542	301047	义翘神州	300	18,555.00	0.02
543	002588	史丹利	2,500	18,450.00	0.02
544	603881	数据港	800	18,120.00	0.02
545	600864	哈投股份	2,400	17,640.00	0.02
546	600651	飞乐音响	4,200	17,388.00	0.02
547	000727	冠捷科技	6,000	16,680.00	0.02
548	603801	志邦家居	1,300	16,653.00	0.02
549	688392	骄成超声	400	16,320.00	0.02
550	301363	美好医疗	500	16,210.00	0.02
551	300638	广和通	800	16,120.00	0.02
552	605577	龙版传媒	1,100	15,983.00	0.02
553	603027	千禾味业	1,300	15,743.00	0.02
554	688409	富创精密	300	15,471.00	0.02
555	688336	三生国健	713	15,272.46	0.02
556	003021	兆威机电	200	14,782.00	0.02
557	688362	甬矽电子	437	14,718.16	0.02

558	000681	视觉中国	700	14,574.00	0.02
559	601096	宏盛华源	3,200	13,920.00	0.01
560	688262	国芯科技	500	13,850.00	0.01
561	300894	火星号	1,000	13,700.00	0.01
562	002275	桂林三金	900	13,581.00	0.01
563	688789	宏华数科	200	13,276.00	0.01
564	000019	深粮控股	2,000	13,140.00	0.01
565	002126	银轮股份	700	13,104.00	0.01
566	002145	中核钛白	3,000	12,720.00	0.01
567	605599	菜百股份	1,100	12,485.00	0.01
568	600033	福建高速	2,900	11,252.00	0.01
569	603609	禾丰股份	1,300	11,206.00	0.01
570	301487	盟固利	500	10,635.00	0.01
571	601900	南方传媒	700	10,577.00	0.01
572	002468	申通快递	1,000	10,130.00	0.01
573	603297	永新光学	100	9,382.00	0.01
574	600835	上海机电	500	8,960.00	0.01
575	603588	高能环境	1,700	8,908.00	0.01
576	600480	凌云股份	800	8,648.00	0.01
577	603063	禾望电气	400	7,984.00	0.01
578	000735	罗牛山	1,100	7,326.00	0.01
579	600323	瀚蓝环境	300	7,086.00	0.01
580	000690	宝新能源	1,400	6,272.00	0.01
581	300761	立华股份	300	5,838.00	0.01
582	603871	嘉友国际	300	5,805.00	0.01
583	000915	华特达因	200	5,636.00	0.01
584	301606	绿联科技	147	5,364.03	0.01
585	000517	荣安地产	2,400	5,352.00	0.01
586	603305	旭升集团	400	5,260.00	0.01
587	000156	华数传媒	600	4,320.00	0.00
588	000567	海德股份	600	4,098.00	0.00
589	600461	洪城环境	400	3,980.00	0.00
590	002428	云南锗业	200	3,780.00	0.00
591	002654	万润科技	300	3,639.00	0.00
592	002312	川发龙蟒	200	2,894.00	0.00
593	603219	富佳股份	200	2,834.00	0.00
594	688097	博众精工	100	2,625.00	0.00
595	002243	力合科创	300	2,418.00	0.00
596	300087	荃银高科	200	2,360.00	0.00
597	000059	华锦股份	300	1,437.00	0.00
598	002675	东诚药业	100	1,222.00	0.00
599	603132	金徽股份	100	1,123.00	0.00
600	600780	通宝能源	100	563.00	0.00

601	000557	西部创业	100	519.00	0.00
-----	--------	------	-----	--------	------

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	688550	瑞联新材	3,900	122,031.00	0.13
2	688233	神工股份	5,200	121,940.00	0.13
3	603258	电魂网络	5,300	105,417.00	0.11
4	000423	东阿阿胶	1,600	100,352.00	0.11
5	600533	栖霞建设	39,700	92,898.00	0.10
6	002558	巨人网络	7,300	92,637.00	0.10
7	688508	芯朋微	2,078	89,291.66	0.09
8	002185	华天科技	7,500	87,075.00	0.09
9	300373	扬杰科技	2,000	87,040.00	0.09
10	300866	安克创新	700	68,348.00	0.07
11	600875	东方电气	4,200	66,738.00	0.07
12	601168	西部矿业	3,600	57,852.00	0.06
13	300369	绿盟科技	8,000	57,520.00	0.06
14	000039	中集集团	7,300	56,721.00	0.06
15	603068	博通集成	2,000	55,300.00	0.06
16	002717	岭南股份	16,900	54,587.00	0.06
17	600096	云天化	2,400	53,520.00	0.06
18	688176	亚虹医药	7,845	53,267.55	0.06
19	688369	致远互联	2,600	52,182.00	0.06
20	300643	万通智控	4,100	49,036.00	0.05
21	601179	中国西电	6,200	47,058.00	0.05
22	000547	航天发展	6,200	45,322.00	0.05
23	000975	山金国际	2,900	44,573.00	0.05
24	688381	帝奥微	2,300	44,344.00	0.05
25	300724	捷佳伟创	700	44,247.00	0.05
26	002273	水晶光电	1,900	42,218.00	0.04
27	300132	青松股份	8,100	39,933.00	0.04
28	600487	亨通光电	2,000	34,440.00	0.04
29	300659	中孚信息	2,100	33,999.00	0.04
30	688095	福昕软件	500	33,580.00	0.04
31	688025	杰普特	700	33,250.00	0.04
32	002202	金风科技	3,200	33,056.00	0.04
33	600141	兴发集团	1,500	32,550.00	0.03
34	600901	江苏金租	6,200	32,364.00	0.03
35	603158	腾龙股份	3,800	30,704.00	0.03
36	300986	志特新材	2,500	30,350.00	0.03
37	002532	天山铝业	3,800	29,906.00	0.03
38	601717	郑煤机	2,300	29,854.00	0.03
39	600380	健康元	2,500	28,175.00	0.03

40	601567	三星医疗	900	27,684.00	0.03
41	002961	瑞达期货	1,900	27,303.00	0.03
42	600066	宇通客车	1,000	26,380.00	0.03
43	688313	仕佳光子	1,600	26,224.00	0.03
44	688152	麒麟信安	500	26,020.00	0.03
45	300378	鼎捷数智	1,000	25,870.00	0.03
46	000417	合百集团	4,000	25,520.00	0.03
47	688023	安恒信息	571	23,296.80	0.02
48	300684	中石科技	1,000	22,430.00	0.02
49	300513	恒实科技	2,400	21,912.00	0.02
50	002057	中钢天源	2,900	20,938.00	0.02
51	002517	恺英网络	1,500	20,415.00	0.02
52	688201	信安世纪	2,300	20,309.00	0.02
53	300696	爱乐达	1,300	20,189.00	0.02
54	603138	海量数据	1,400	20,118.00	0.02
55	300061	旗天科技	1,500	19,350.00	0.02
56	002734	利民股份	2,300	18,331.00	0.02
57	300394	天孚通信	200	18,272.00	0.02
58	300054	鼎龙股份	700	18,214.00	0.02
59	002912	中新赛克	700	17,913.00	0.02
60	688368	晶丰明源	200	17,800.00	0.02
61	300360	炬华科技	1,000	16,770.00	0.02
62	603508	思维列控	700	16,646.00	0.02
63	603129	春风动力	100	15,707.00	0.02
64	002128	电投能源	800	15,664.00	0.02
65	300418	昆仑万维	400	15,392.00	0.02
66	002549	凯美特气	2,400	14,712.00	0.02
67	605305	中际联合	500	14,165.00	0.02
68	000997	新大陆	700	13,965.00	0.01
69	002542	中化岩土	3,500	13,720.00	0.01
70	688680	海优新材	400	13,512.00	0.01
71	002685	华东重机	1,900	12,787.00	0.01
72	300002	神州泰岳	1,100	12,749.00	0.01
73	000536	华映科技	2,800	12,628.00	0.01
74	300308	中际旭创	100	12,351.00	0.01
75	300752	隆利科技	700	11,900.00	0.01
76	002031	巨轮智能	2,100	10,437.00	0.01
77	600208	衢州发展	3,300	9,768.00	0.01
78	300803	指南针	100	9,595.00	0.01
79	301091	深城交	200	9,542.00	0.01
80	300813	泰林生物	500	8,635.00	0.01
81	300476	胜宏科技	200	8,418.00	0.01
82	688371	菲沃泰	500	7,760.00	0.01

83	301622	英思特	171	7,681.32	0.01
84	603998	方盛制药	700	7,294.00	0.01
85	600203	福日电子	800	7,168.00	0.01
86	603185	弘元绿能	400	6,500.00	0.01
87	301603	乔锋智能	151	6,338.98	0.01
88	301552	科力装备	102	5,800.74	0.01
89	000921	海信家电	200	5,780.00	0.01
90	300100	双林股份	200	5,528.00	0.01
91	301585	蓝宇股份	141	5,054.85	0.01
92	301617	博苑股份	122	4,854.38	0.01
93	301608	博实结	71	4,641.98	0.00
94	300604	长川科技	100	4,413.00	0.00
95	603087	甘李药业	100	4,410.00	0.00
96	300578	会畅通讯	200	3,850.00	0.00
97	300802	矩子科技	200	3,654.00	0.00
98	002536	飞龙股份	300	3,474.00	0.00
99	002903	宇环数控	200	3,250.00	0.00
100	603350	安乃达	86	3,110.62	0.00
101	300481	濮阳惠成	200	2,964.00	0.00
102	300531	优博讯	200	2,790.00	0.00
103	002786	银宝山新	300	2,775.00	0.00
104	002414	高德红外	300	2,229.00	0.00
105	600237	铜峰电子	300	1,965.00	0.00
106	603285	键邦股份	85	1,921.85	0.00
107	002765	蓝黛科技	200	1,720.00	0.00
108	603887	城地香江	100	1,592.00	0.00
109	002250	联化科技	200	1,102.00	0.00
110	600021	上海电力	100	917.00	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	605589	圣泉集团	3,704,616.00	2.47
2	600667	太极实业	3,341,014.00	2.23
3	000528	柳工	2,984,851.00	1.99
4	300573	兴齐眼药	2,959,026.00	1.97
5	600710	苏美达	2,942,189.46	1.96
6	600285	羚锐制药	2,931,762.00	1.95
7	300170	汉得信息	2,903,782.00	1.94
8	000951	中国重汽	2,765,440.00	1.84
9	600420	国药现代	2,760,931.00	1.84
10	600037	歌华有线	2,727,786.00	1.82



11	300638	广和通	2,671,185.40	1.78
12	301219	腾远钴业	2,669,644.00	1.78
13	601137	博威合金	2,666,835.74	1.78
14	300770	新媒股份	2,666,198.00	1.78
15	603920	世运电路	2,627,772.00	1.75
16	002318	久立特材	2,626,205.00	1.75
17	300482	万孚生物	2,602,525.58	1.74
18	601126	四方股份	2,588,009.00	1.73
19	300113	顺网科技	2,565,262.00	1.71
20	600211	西藏药业	2,557,472.00	1.71

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	600667	太极实业	4,086,834.00	2.72
2	300170	汉得信息	3,828,626.00	2.55
3	002130	沃尔核材	3,784,009.00	2.52
4	600312	平高电气	3,496,050.46	2.33
5	605589	圣泉集团	3,489,282.20	2.33
6	688235	百济神州	3,395,698.25	2.26
7	301219	腾远钴业	3,226,384.24	2.15
8	601137	博威合金	3,171,384.00	2.11
9	600710	苏美达	3,128,755.00	2.09
10	603920	世运电路	3,124,923.00	2.08
11	300573	兴齐眼药	3,016,283.00	2.01
12	688018	乐鑫科技	2,936,086.53	1.96
13	600100	同方股份	2,928,957.00	1.95
14	002335	科华数据	2,889,881.46	1.93
15	000951	中国重汽	2,854,148.00	1.90
16	000921	海信家电	2,843,151.00	1.90
17	688158	优刻得	2,829,926.91	1.89
18	300458	全志科技	2,816,731.00	1.88
19	002215	诺普信	2,814,375.00	1.88
20	601126	四方股份	2,705,908.00	1.80

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	942,303,332.85
卖出股票收入（成交）总额	998,495,409.30

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

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	1,007,761.64	1.07
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	1,007,761.64	1.07

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019749	24 国债 15	10,000	1,007,761.64	1.07

### 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

本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

（1）时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。

（2）套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

（3）合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

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

本基金可投资国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

东软集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方市场监督管理局的处罚。

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	142,939.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	290,202.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	433,141.50

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

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

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 (%)
景顺长城 中证 1000 指数增强 A	4,015	12,388.65	859.64	—	49,739,590.12	100.00
景顺长城 中证 1000 指数增强 C	4,083	9,715.09	2,226,008.55	5.61	37,440,719.69	94.39
合计	8,098	11,040.65	2,226,868.19	2.49	87,180,309.81	97.51

注：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）。

9.2 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	景顺长城中证 1000 指数增强 A	48,983.64	0.098478
	景顺长城中证 1000 指数增强 C	7.00	0.000018
	合计	48,990.64	0.054795

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人负责	景顺长城中证 1000 指数增强 A	—

人持有本开放式基金	景顺长城中证 1000 指数增强 C	—
	合计	—
本基金基金经理持有本开放式基金	景顺长城中证 1000 指数增强 A	0~10
	景顺长城中证 1000 指数增强 C	—
	合计	0~10

9.4 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

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城中证 1000 指数增强 A	景顺长城中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 (2022 年 4 月 27 日) 基金份额总额	317,257,520.90	264,646,728.20
本报告期期初基金份 额总额	58,382,476.41	94,942,758.76
本报告期基金总申购 份额	24,194,316.83	107,856,459.41
减：本报告期基金总 赎回份额	32,836,343.48	163,132,489.93
本报告期基金拆分变 动份额	—	—
本报告期期末基金份 额总额	49,740,449.76	39,666,728.24

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 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 3 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 22,000.00 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 (%)	
中信建投证券股份有限公司	3	1,843,109,563.40	95.01	747,140.66	95.22	未变更
中国银河证券股份有限公司	3	96,830,562.86	4.99	37,518.42	4.78	未变更
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更

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 (%)
中信建投证券股份有限公司	1,139,183.67	100.00	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	景顺长城基金管理有限公司关于调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 10 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 22 日
3	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 22 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增微众银行为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 2 月 23 日
5	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 3 月 22 日
6	关于警惕假冒景顺长城基金 APP 开展诈骗活动的声明	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 27 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 29 日
8	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 29 日
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 4 月 13 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于持续	中国证监会指定报刊及	2024 年 4 月 15 日

	完善客户身份信息的提示	网站	
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 22 日
12	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 22 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国信证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 21 日
14	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 5 月 24 日
15	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 5 月 31 日
16	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 14 日
17	景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 21 日
18	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 6 月 29 日
19	关于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 7 月 16 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 7 月 19 日
21	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 7 月 19 日
22	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 8 月 23 日
23	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 8 月 30 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 8 月 30 日
25	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 6 日
26	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
27	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
28	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
29	景顺长城基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 8 日
30	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



31	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
32	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 25 日
33	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 25 日
34	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
35	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
36	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 11 月 30 日
37	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 11 月 30 日
38	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 (%)
机构	1	20240101-20240624	44,912,107.89	0.00	44,912,107.89	0.00	0.00
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>1、大额申购风险</p> <p>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。</p> <p>2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p>							

(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

无。

## § 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 1000 指数增强型证券投资基金募集注册的文件;
- 2、《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》;
- 3、《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》;
- 4、《景顺长城中证 1000 指数增强型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