

景顺长城沪深 300 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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

§ 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	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
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	12
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	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
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	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24

§ 8 投资组合报告	53
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	53
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	54
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	75
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	75
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
§ 9 基金份额持有人信息	76
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	77
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
§ 10 开放式基金份额变动	77
§ 11 重大事件揭示	77
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	84
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	86
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	86
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	86
§ 13 备查文件目录	86
13.1 备查文件目录	86
13.2 存放地点	86
13.3 查阅方式	86

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	景顺长城沪深 300 指数增强	
场内简称	无	
基金主代码	000311	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 10 月 29 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	2, 232, 217, 655. 43 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	景顺长城沪深 300 指数增强 A	景顺长城沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	000311	015679
报告期末下属分级 基金的份额总额	1, 989, 478, 733. 70 份	242, 738, 921. 73 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	1、资产配置策略: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。 2、股票投资策略: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。 3、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。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。 4、权证、股指期货投资策略:本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成分股、备选成分股相关的衍生工具。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的杠杆作用，

	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。 5、中小企业私募债券的投资策略:对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金会加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	任航
	联系电话	0755-82370388	010-66060069
	电子邮箱	investor@igwfm.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008888606	95599
传真		0755-22381339	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		李进	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	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	2024 年	2023 年	2022 年	2022 年 5 月 5
----------	--------	--------	--------	--------------

数据和指标							日(C 类份额 首个估值 日)-2022 年 12 月 31 日
	景顺长城沪深 300 指数增强 A	景顺长城沪深 300 指数增强 C	景顺长城沪深 300 指数增强 A	景顺长城沪 深 300 指数增 强 C	景顺长城沪深 300 指数增强 A	景顺长城沪 深 300 指数增 强 C	
本期已实现 收益	213,911,483.83	29,484,251.16	-322,579,845.01	-1,916,243.59	-968,049,826.15	-700,798.14	
本期利润	567,839,707.98	41,910,799.08	-438,199,078.82	-2,225,082.24	-1,112,482,152.84	-359,622.22	
加权平均基 金份额本期 利润	0.2664	0.6198	-0.2081	-0.2138	-0.5524	-0.1374	
本期加权平 均净值利润 率	13.26%	29.22%	-9.83%	-10.20%	-23.83%	-6.25%	
本期基金份 额净值增长 率	13.00%	12.78%	-9.94%	-10.09%	-20.96%	-4.27%	
3.1.2 期末 数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末		
期末可供分 配利润	2,049,106,191.35	247,299,842.39	1,972,023,757.71	13,789,405.48	2,355,013,173.70	6,236,937.27	
期末可供分 配基金份额 利润	1.0300	1.0188	0.9280	0.9216	1.0827	1.0801	
期末基金资 产净值	4,359,231,917.15	529,070,142.69	4,121,148,733.68	28,922,878.04	4,682,413,728.77	12,415,193.94	
期末基金份 额净值	2.191	2.180	1.939	1.933	2.153	2.150	
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	157.65%	-2.94%	128.02%	-13.94%	153.18%	-4.27%	

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三位，小数点后第四位四舍五入，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。

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

景顺长城沪深 300 指数增强 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	-2.32%	1.60%	-1.55%	1.65%	-0.77%	-0.05%
过去六个月	11.73%	1.51%	13.88%	1.58%	-2.15%	-0.07%
过去一年	13.00%	1.23%	15.72%	1.28%	-2.72%	-0.05%
过去三年	-19.57%	1.08%	-15.56%	1.12%	-4.01%	-0.04%
过去五年	0.32%	1.16%	4.14%	1.17%	-3.82%	-0.01%
自基金合同生效 起至今	157.65%	1.35%	93.88%	1.31%	63.77%	0.04%

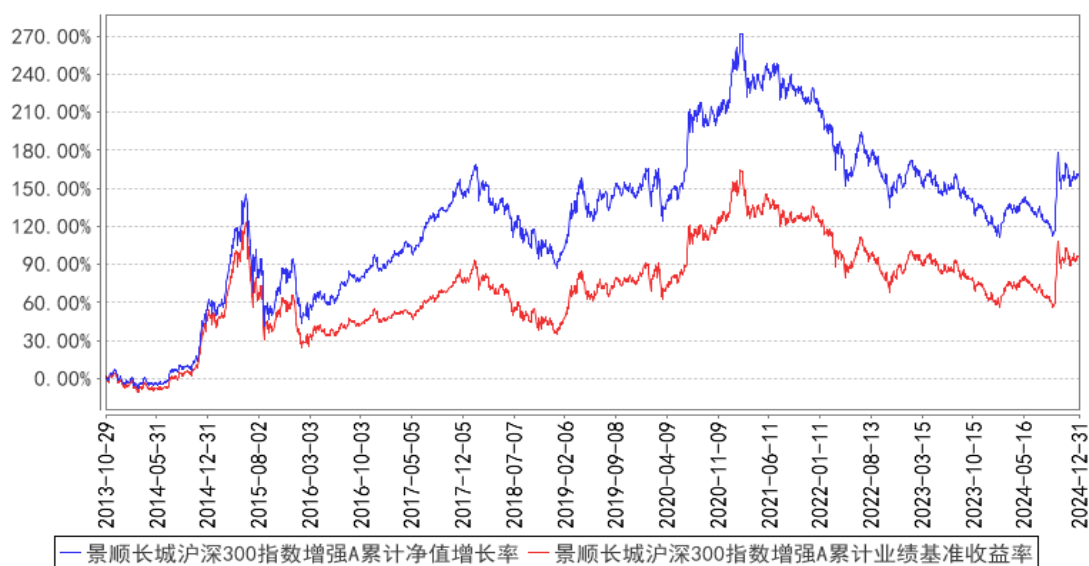
景顺长城沪深 300 指数增强 C

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	-2.37%	1.60%	-1.55%	1.65%	-0.82%	-0.05%
过去六个月	11.62%	1.52%	13.88%	1.58%	-2.26%	-0.06%
过去一年	12.78%	1.23%	15.72%	1.28%	-2.94%	-0.05%
自基金合同生效 起至今	-2.94%	1.02%	2.23%	1.07%	-5.17%	-0.05%

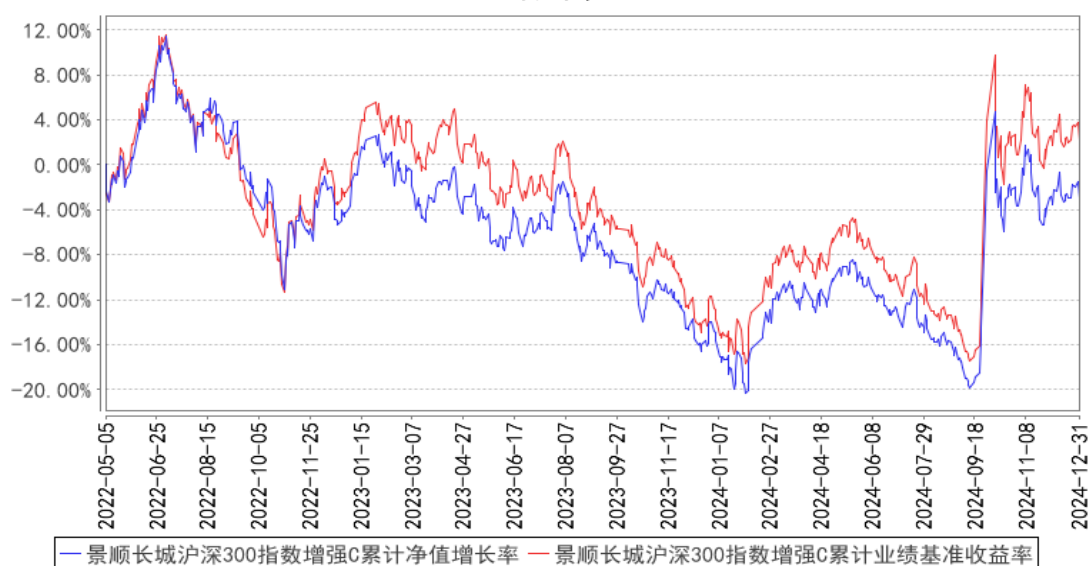
注：本基金于 2022 年 04 月 29 日增设 C 类基金份额，并于 2022 年 05 月 05 日开始对 C 类份额进行估值。

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

景顺长城沪深300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



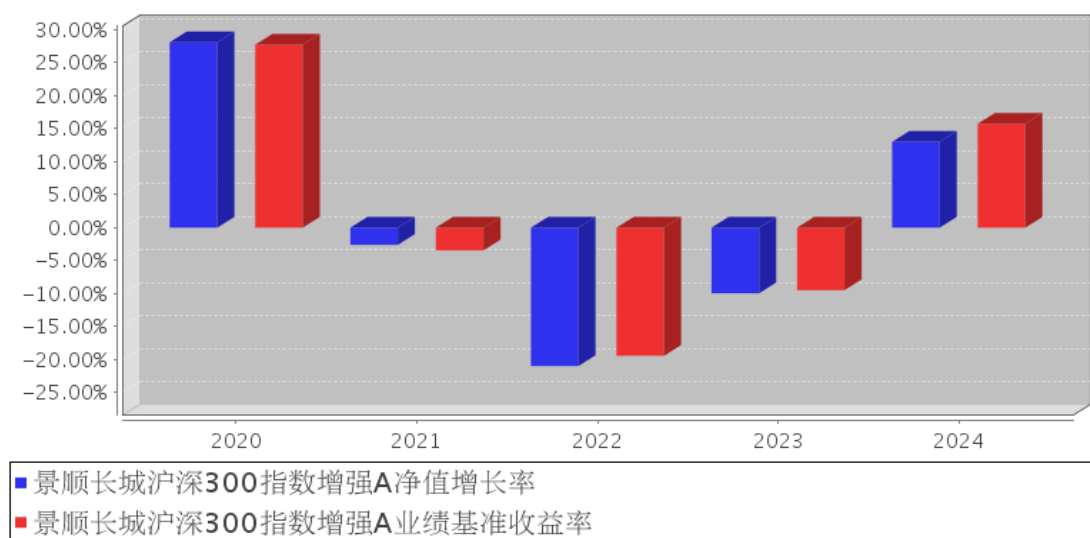
景顺长城沪深300指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



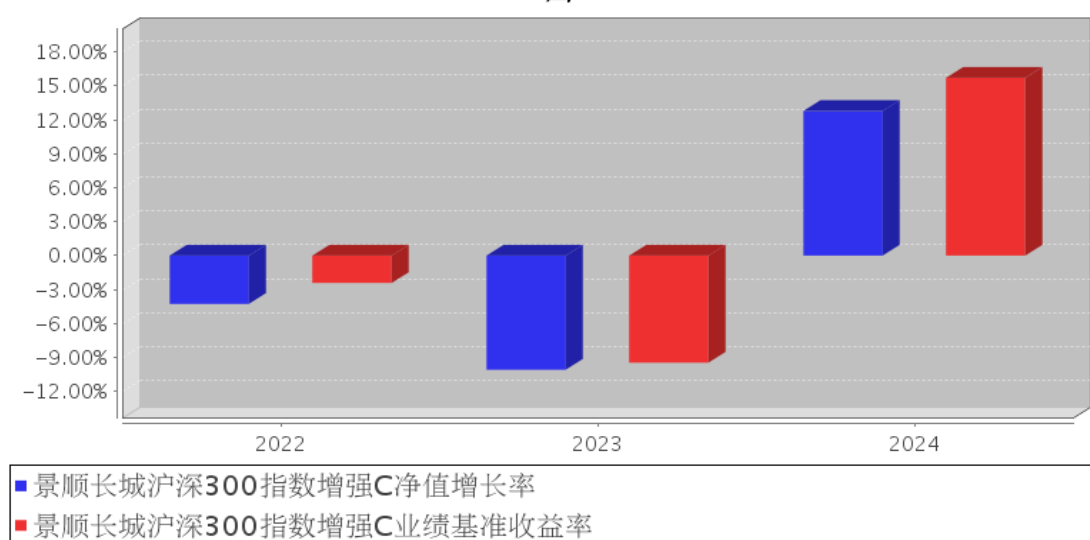
注：本基金的资产配置比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%-95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2013 年 10 月 29 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。本基金自 2022 年 4 月 29 日起增设 C 类基金份额。

3.2.3 过去五年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

景顺长城沪深300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



景顺长城沪深300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 年景顺长城沪深 300 指数增强 C 净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是 2022 年 05 月 05 日（C 类份额首个估值日）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

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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	2013年10月29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。

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、《景顺长城沪深 300 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，景顺长城沪深 300 指数增强 A 份额净值增长率为 13.00%，业绩比较基准收益率为 15.72%。

本报告期内，景顺长城沪深 300 指数增强 C 份额净值增长率为 12.78%，业绩比较基准收益率为 15.72%。

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。

本基金是以沪深 300 指数为基准的指数增强基金，从基准的角度来看，沪深 300 指数汇聚了国内各行业的头部企业，这些企业在经济逐步企稳复苏的过程中将会率先迎来基本面的改善。从选股模型的角度来看，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、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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一

景顺长城基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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_H11 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	景顺长城沪深 300 指数增强型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沪深 300 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。 我们认为，后附的景顺长城沪深 300 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沪深 300 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。
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沪深 300 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。

其他信息	景顺长城沪深 300 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。 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沪深 300 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。 治理层负责监督景顺长城沪深 300 指数增强型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沪深 300 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沪深 300 指数增强型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：景顺长城沪深 300 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
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	159,386,473.16	100,991,076.87
结算备付金		57,524,521.84	67,182,230.59
存出保证金		3,959,089.98	8,608,349.27
交易性金融资产	7.4.7.2	4,700,563,290.18	3,984,937,877.36
其中：股票投资		4,568,898,791.55	3,853,578,368.49
基金投资		-	-
债券投资		131,664,498.63	131,359,508.87
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		-	168,623.95
应收股利		-	-
应收申购款		1,353,654.62	3,740,610.03

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		4,922,787,029.78	4,165,628,768.07
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
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		20,376.19	-
应付赎回款		26,780,219.45	4,214,728.53
应付管理人报酬		4,220,048.91	3,460,992.18
应付托管费		844,009.77	692,198.45
应付销售服务费		85,092.03	4,714.36
应付投资顾问费		-	-
应交税费		18,294.41	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	2,516,929.18	7,184,522.83
负债合计		34,484,969.94	15,557,156.35
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	2,232,217,655.43	2,140,092,526.03
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	2,656,084,404.41	2,009,979,085.69
净资产合计		4,888,302,059.84	4,150,071,611.72
负债和净资产总计		4,922,787,029.78	4,165,628,768.07

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,232,217,655.43 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 2.191 元，基金份额 1,989,478,733.70 份；本基金 C 类份额净值人民币 2.180 元，基金份额 242,738,921.73 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城沪深 300 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		664,237,462.99	-385,528,371.16
1. 利息收入		2,177,882.89	1,731,462.48
其中：存款利息收入	7.4.7.13	2,177,882.89	1,731,462.48
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）		294,848,750.44	-272,032,808.76
其中：股票投资收益	7.4.7.14	152,602,924.80	-380,469,066.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	2,348,961.11	2,450,743.75
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	21,411,683.46	-6,176,097.54
股利收益	7.4.7.19	118,485,181.07	112,161,611.89
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	366,354,828.95	-115,928,072.46
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	856,000.71	701,047.58
减：二、营业总支出		54,486,955.93	54,895,789.90
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	44,320,198.41	44,891,597.66
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	8,864,039.69	8,978,319.64
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	286,555.23	43,649.10
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		77,310.06	0.58
8. 其他费用	7.4.7.23	938,852.54	982,222.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		609,750,507.06	-440,424,161.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		609,750,507.06	-440,424,161.06
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		609,750,507.06	-440,424,161.06
----------	--	----------------	-----------------

7.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城沪深 300 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	2,140,092,526.03	-	2,009,979,085.69	4,150,071,611.72
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,140,092,526.03	-	2,009,979,085.69	4,150,071,611.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	92,125,129.40	-	646,105,318.72	738,230,448.12
（一）、综合收益总额	-	-	609,750,507.06	609,750,507.06
（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）	92,125,129.40	-	36,354,811.66	128,479,941.06
其中：1. 基金申购款	863,150,152.65	-	892,674,070.35	1,755,824,223.00
2. 基金赎回款	-771,025,023.25	-	-856,319,258.69	-1,627,344,281.94
（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	2,232,217,655.43	-	2,656,084,404.41	4,888,302,059.84

资产				
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	2,180,988,407.47	-	2,513,840,515.24	4,694,828,922.71
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,180,988,407.47	-	2,513,840,515.24	4,694,828,922.71
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-40,895,881.44	-	-503,861,429.55	-544,757,310.99
（一）、综合收益总额	-	-	-440,424,161.06	-440,424,161.06
（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）	-40,895,881.44	-	-63,437,268.49	-104,333,149.93
其中：1. 基金申购款	494,363,586.17	-	551,325,549.77	1,045,689,135.94
2. 基金赎回款	-535,259,467.61	-	-614,762,818.26	-1,150,022,285.87
（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	2,140,092,526.03	-	2,009,979,085.69	4,150,071,611.72

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

景顺长城沪深 300 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[2013]1028 号文《关于核准景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金募集的批复》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《景顺长城沪深 300 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 2013 年 10 月 29 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 381,986,684.48 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 155,294.37 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 382,141,978.85 元，折合 382,141,978.85 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据法律法规的规定及《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》的约定，经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定自 2022 年 4 月 29 日起对景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金在现有份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费；C 类基金份额在投资者申购基金份额时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费。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分股及备选成分股。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分股（包含创业板及其他经中国证监会核准发行的股票及存托凭证）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，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。

本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%–95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股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保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其

中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。

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某一类别的基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于该类基金份额的面值。

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	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	159,386,473.16	100,991,076.87
等于：本金	159,353,866.19	100,964,569.38
加：应计利息	32,606.97	26,507.49
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	-	-
等于：本金	-	-

加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	159,386,473.16	100,991,076.87

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		4,377,189,201.02	-	4,568,898,791.55	191,709,590.53
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	129,935,910.00	1,456,498.63	131,664,498.63	272,090.00
	合计	129,935,910.00	1,456,498.63	131,664,498.63	272,090.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,507,125,111.02	1,456,498.63	4,700,563,290.18	191,981,680.53
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		4,028,382,200.79	-	3,853,578,368.49	-174,803,832.30
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	9,000.00	0.67	9,000.67	-
	银行间市场	129,937,220.00	1,454,508.20	131,350,508.20	-41,220.00
	合计	129,946,220.00	1,454,508.87	131,359,508.87	-41,220.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,158,328,420.79	1,454,508.87	3,984,937,877.36	-174,845,052.30

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	23,616,525.88	-	-	-
其中：股指期货投资	23,616,525.88	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	23,616,525.88	-	-	-
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	67,677,936.00	-	-	-
其中：股指期货投资	67,677,936.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	67,677,936.00	-	-	-

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
IF2501	IF2501	20.00	23,632,800.00	16,274.12
合计				16,274.12
减：可抵销期货暂收款				16,274.12
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	31,364.33	6,595.08

应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,083,823.62	6,774,060.42
其中：交易所市场	2,083,823.62	6,774,060.42
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	199,500.00	234,500.00
应付指数使用费	202,241.23	169,367.33
合计	2,516,929.18	7,184,522.83

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城沪深 300 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	2,125,130,372.31	2,125,130,372.31
本期申购	449,100,150.51	449,100,150.51
本期赎回（以“-”号填列）	-584,751,789.12	-584,751,789.12
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	1,989,478,733.70	1,989,478,733.70

景顺长城沪深 300 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	14,962,153.72	14,962,153.72
本期申购	414,050,002.14	414,050,002.14
本期赎回（以“-”号填列）	-186,273,234.13	-186,273,234.13
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	242,738,921.73	242,738,921.73

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

景顺长城沪深 300 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	1, 972, 023, 757. 71	23, 994, 603. 66	1, 996, 018, 361. 37
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1, 972, 023, 757. 71	23, 994, 603. 66	1, 996, 018, 361. 37
本期利润	213, 911, 483. 83	353, 928, 224. 15	567, 839, 707. 98
本期基金份额交易产生的变动数	-136, 829, 050. 19	-57, 275, 835. 71	-194, 104, 885. 90
其中：基金申购款	389, 113, 513. 11	56, 735, 717. 57	445, 849, 230. 68
基金赎回款	-525, 942, 563. 30	-114, 011, 553. 28	-639, 954, 116. 58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2, 049, 106, 191. 35	320, 646, 992. 10	2, 369, 753, 183. 45

景顺长城沪深 300 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	13, 789, 405. 48	171, 318. 84	13, 960, 724. 32
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	13, 789, 405. 48	171, 318. 84	13, 960, 724. 32
本期利润	29, 484, 251. 16	12, 426, 547. 92	41, 910, 799. 08
本期基金份额交易产生的变动数	204, 026, 185. 75	26, 433, 511. 81	230, 459, 697. 56
其中：基金申购款	369, 379, 036. 92	77, 445, 802. 75	446, 824, 839. 67
基金赎回款	-165, 352, 851. 17	-51, 012, 290. 94	-216, 365, 142. 11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	247, 299, 842. 39	39, 031, 378. 57	286, 331, 220. 96

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	978, 002. 68	1, 047, 761. 33
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1, 188, 630. 88	673, 261. 68
其他	11, 249. 33	10, 439. 47
合计	2, 177, 882. 89	1, 731, 462. 48

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	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月
----	----------------------------	-------------------------------

	日	31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	152,602,924.80	-380,469,066.86
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	152,602,924.80	-380,469,066.86

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	18,312,495,613.15	16,899,636,255.85
减：卖出股票成本 总额	18,128,498,677.28	17,232,043,029.63
减：交易费用	31,394,011.07	48,062,293.08
买卖股票差价收 入	152,602,924.80	-380,469,066.86

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	2,284,684.33	2,455,608.37
债券投资收益——买 卖债券（债转股及债 券到期兑付）差价收 入	64,276.78	-4,864.62
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	2,348,961.11	2,450,743.75

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	132,546,123.64	133,472,641.25
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	129,946,220.00	131,032,680.00
减：应计利息总额	2,535,001.42	2,444,159.72
减：交易费用	625.44	666.15
买卖债券差价收入	64,276.78	-4,864.62

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	21,411,683.46	-6,176,097.54

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	118,485,181.07	112,161,611.89
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	118,485,181.07	112,161,611.89

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	366,826,732.83	-116,415,776.46
股票投资	366,513,422.83	-116,762,736.46
债券投资	313,310.00	346,960.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-471,429.88	487,704.00
权证投资	-	-
期货投资	-471,429.88	487,704.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	474.00	-
合计	366,354,828.95	-115,928,072.46

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	844,899.83	691,788.49
基金转换费收入	11,100.88	9,259.09
合计	856,000.71	701,047.58

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	75,000.00	110,000.00

信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行划款手续费	16,529.43	15,957.35
指数使用费	709,123.11	718,265.57
其他	200.00	-
合计	938,852.54	982,222.92

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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 (%)
长城证券	1,020,428,905.93	2.77	992,132,956.47	2.95

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（%）
长城证券	375,934.92	1.89	-	-
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（%）
长城证券	928,226.87	2.96	180,091.79	2.66

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	44,320,198.41	44,891,597.66
其中：应支付销售机构的客户维护费	16,005,894.97	15,883,882.65
应支付基金管理人的净管理费	28,314,303.44	29,007,715.01

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	8,864,039.69	8,978,319.64

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，

按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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		
	景顺长城沪深 300 指数增强 A	景顺长城沪深 300 指数增强 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	47,010.10	47,010.10
中国农业银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	47,010.10	47,010.10
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城沪深 300 指数增强 A	景顺长城沪深 300 指数增强 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	6,179.78	6,179.78
中国农业银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	6,179.78	6,179.78

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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
中国农业银行－活期	159,386,473.16	978,002.68	100,991,076.87	1,047,761.33

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	143	4,290.00	8,132.41	—
301603	乔锋智能	2024 年 7 月	6 个月	新股流通	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	—

		3 日		受限						
301606	绿联科技	2024 年 7 月 17 日	6 个月	新股流通受限	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通受限	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-

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	440,000	3,225,984.67	3,176,800.00	-

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（上年度末：0.00%）。

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组合持仓集中

度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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	159,386,473.16	-	-	-	-	-	159,386,473.16
结算备付金	57,524,521.84	-	-	-	-	-	57,524,521.84
存出保证金	768,661.98	-	-	-	-	3,190,428.00	3,959,089.98
交易性金融资产	-	-	131,664,498.63	-	-	4,568,898,791.55	4,700,563,290.18
应收申购款	-	-	-	-	-	1,353,654.62	1,353,654.62
资产总计	217,679,656.98	-	131,664,498.63	-	-	4,573,442,874.17	4,922,787,029.78
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	26,780,219.45	26,780,219.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,220,048.91	4,220,048.91
应付托管费	-	-	-	-	-	844,009.77	844,009.77
应付清算款	-	-	-	-	-	20,376.19	20,376.19
应付销售服务费	-	-	-	-	-	85,092.03	85,092.03
应交税费	-	-	-	-	-	18,294.41	18,294.41
其他负债	-	-	-	-	-	2,516,929.18	2,516,929.18
负债总计	-	-	-	-	-	34,484,969.94	34,484,969.94
利率敏感度缺口	217,679,656.98	-	131,664,498.63	-	-	-	-
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	100,991,076.87	-	-	-	-	-	100,991,076.87
结算备付金	67,182,230.59	-	-	-	-	-	67,182,230.59
存出保证金	428,472.47	-	-	-	-	8,179,876.80	8,608,349.27
交易性金融资产	-	-	131,350,508.20	-	9,000.67	3,853,578,368.49	3,984,937,877.36
应收申购款	-	-	-	-	-	3,740,610.03	3,740,610.03
应收清算款	-	-	-	-	-	168,623.95	168,623.95
资产总计	168,601,779.93	-	131,350,508.20	-	9,000.67	3,865,667,479.27	4,165,628,768.07
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	4,214,728.53	4,214,728.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,460,992.18	3,460,992.18
应付托管费	-	-	-	-	692,198.45	692,198.45
应付销售服务费	-	-	-	-	4,714.36	4,714.36
其他负债	-	-	-	-	7,184,522.83	7,184,522.83
负债总计	-	-	-	-	15,557,156.35	15,557,156.35
利率敏感度缺口	168,601,779.93	-131,350,508.20	-9,000.67	-	-	-

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	-100,580.53	-140,689.53
	市场利率下降 25 个基点	100,734.49	140,991.64

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	4,568,898,791.55	93.47	3,853,578,368.49	92.86
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	4,568,898,791.55	93.47	3,853,578,368.49	92.86

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%	222,209,069.17	176,590,963.42
	沪深 300 指数下降 5%	-222,209,069.17	-176,590,963.42

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	4,565,682,877.05	3,852,413,015.36
第二层次	134,841,298.63	131,384,567.03

第三层次	39,114.50	1,140,294.97
合计	4,700,563,290.18	3,984,937,877.36

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	-	1,140,294.97	1,140,294.97
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	23,448.87	23,448.87
转出第三层次	-	1,140,294.97	1,140,294.97
当期利得或损失总额	-	15,665.63	15,665.63
其中：计入损益的利得或损失	-	15,665.63	15,665.63
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	39,114.50	39,114.50
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	-	15,665.63	15,665.63
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	-	2,449,370.69	2,449,370.69
当期购买	-	-	-

当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	980,784.73	980,784.73
转出第三层次	-	2,449,370.69	2,449,370.69
当期利得或损失总额	-	159,510.24	159,510.24
其中：计入损益的利得或损失	-	159,510.24	159,510.24
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,140,294.97	1,140,294.97
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	-	159,510.24	159,510.24

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	39,114.50	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.3521-0.5758	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	1,140,294.97	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1962-2.1988	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	4,568,898,791.55	92.81
	其中：股票	4,568,898,791.55	92.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	131,664,498.63	2.67
	其中：债券	131,664,498.63	2.67
	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	216,910,995.00	4.41
8	其他各项资产	5,312,744.60	0.11
9	合计	4,922,787,029.78	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	20,986,138.00	0.43
B	采矿业	149,529,729.44	3.06
C	制造业	2,111,221,610.13	43.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	104,122,323.64	2.13
E	建筑业	75,630,622.04	1.55
F	批发和零售业	14,004,265.00	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	129,083,970.61	2.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	171,173,166.68	3.50
J	金融业	1,083,418,445.23	22.16
K	房地产业	14,164,906.94	0.29
L	租赁和商务服务业	41,762,629.94	0.85
M	科学研究和技术服务业	20,489,446.48	0.42
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	2,297,550.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,937,884,804.13	80.56

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	1,490,509.00	0.03
B	采矿业	23,066,494.00	0.47
C	制造业	425,505,580.13	8.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,147,134.78	0.25
E	建筑业	6,528,662.00	0.13
F	批发和零售业	10,778,057.00	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	12,095,763.00	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	67,442,571.52	1.38
J	金融业	29,037,283.02	0.59
K	房地产业	17,869,006.50	0.37
L	租赁和商务服务业	6,599,217.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	3,843,555.67	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	7,208,610.80	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	193,385.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	7,208,158.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	631,013,987.42	12.91

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	135,629	206,698,596.00	4.23
2	300750	宁德时代	639,993	170,238,138.00	3.48
3	601318	中国平安	2,849,349	150,018,224.85	3.07
4	000333	美的集团	1,328,000	99,892,160.00	2.04

5	600036	招商银行	2,376,683	93,403,641.90	1.91
6	600900	长江电力	2,327,900	68,789,445.00	1.41
7	002594	比亚迪	237,569	67,151,253.54	1.37
8	601166	兴业银行	3,031,039	58,074,707.24	1.19
9	000651	格力电器	1,258,282	57,188,916.90	1.17
10	601899	紫金矿业	3,749,100	56,686,392.00	1.16
11	600887	伊利股份	1,767,600	53,346,168.00	1.09
12	600030	中信证券	1,708,640	49,841,028.80	1.02
13	000725	京东方 A	10,728,860	47,099,695.40	0.96
14	601688	华泰证券	2,487,005	43,746,417.95	0.89
15	300059	东方财富	1,652,500	42,667,550.00	0.87
16	601988	中国银行	7,549,794	41,599,364.94	0.85
17	600660	福耀玻璃	645,300	40,266,720.00	0.82
18	601398	工商银行	5,816,900	40,252,948.00	0.82
19	600276	恒瑞医药	866,360	39,765,924.00	0.81
20	601211	国泰君安	2,009,554	37,478,182.10	0.77
21	002475	立讯精密	904,118	36,851,849.68	0.75
22	688981	中芯国际	374,041	35,391,759.42	0.72
23	000776	广发证券	2,163,580	35,071,631.80	0.72
24	601939	建设银行	3,824,100	33,613,839.00	0.69
25	601766	中国中车	3,944,429	33,054,315.02	0.68
26	601989	中国重工	6,632,032	31,900,073.92	0.65
27	002371	北方华创	78,761	30,795,551.00	0.63
28	601601	中国太保	901,500	30,723,120.00	0.63
29	601328	交通银行	3,924,645	30,494,491.65	0.62
30	601919	中远海控	1,953,933	30,285,961.50	0.62
31	601728	中国电信	4,185,200	30,217,144.00	0.62
32	600919	江苏银行	3,054,100	29,991,262.00	0.61
33	000858	五 粮 液	208,399	29,184,195.96	0.60
34	300408	三环集团	756,800	29,144,368.00	0.60
35	000338	潍柴动力	2,099,978	28,769,698.60	0.59
36	002352	顺丰控股	710,007	28,613,282.10	0.59
37	300433	蓝思科技	1,300,800	28,487,520.00	0.58
38	002001	新 和 成	1,265,000	27,792,050.00	0.57
39	601319	中国人保	3,614,634	27,543,511.08	0.56
40	002027	分众传媒	3,839,498	26,991,670.94	0.55
41	601877	正泰电器	1,148,727	26,891,699.07	0.55
42	600941	中国移动	226,432	26,755,205.12	0.55
43	600690	海尔智家	924,700	26,326,209.00	0.54
44	600019	宝钢股份	3,715,188	26,006,316.00	0.53
45	000895	双汇发展	975,000	25,311,000.00	0.52
46	600406	国电南瑞	998,905	25,192,384.10	0.52
47	600000	浦发银行	2,421,000	24,912,090.00	0.51

48	603501	韦尔股份	231,884	24,211,008.44	0.50
49	600050	中国联通	4,522,366	24,013,763.46	0.49
50	002142	宁波银行	978,900	23,797,059.00	0.49
51	002648	卫星化学	1,225,415	23,025,547.85	0.47
52	600219	南山铝业	5,812,078	22,725,224.98	0.46
53	600015	华夏银行	2,789,319	22,342,445.19	0.46
54	000166	申万宏源	4,117,433	22,028,266.55	0.45
55	002938	鹏鼎控股	579,500	21,140,160.00	0.43
56	300308	中际旭创	168,823	20,851,328.73	0.43
57	603259	药明康德	370,537	20,394,356.48	0.42
58	002236	大华股份	1,260,400	20,166,400.00	0.41
59	002415	海康威视	638,727	19,608,918.90	0.40
60	688012	中微公司	102,443	19,378,117.88	0.40
61	601009	南京银行	1,813,871	19,317,726.15	0.40
62	600031	三一重工	1,146,743	18,898,324.64	0.39
63	600875	东方电气	1,179,800	18,747,022.00	0.38
64	601012	隆基绿能	1,188,300	18,668,193.00	0.38
65	601006	大秦铁路	2,746,717	18,622,741.26	0.38
66	601088	中国神华	420,571	18,286,427.08	0.37
67	300760	迈瑞医疗	71,439	18,216,945.00	0.37
68	601881	中国银河	1,185,165	18,050,062.95	0.37
69	688041	海光信息	118,902	17,810,330.58	0.36
70	601998	中信银行	2,485,786	17,350,786.28	0.35
71	601229	上海银行	1,886,074	17,257,577.10	0.35
72	601818	光大银行	4,446,825	17,209,212.75	0.35
73	601916	浙商银行	5,806,200	16,896,042.00	0.35
74	603288	海天味业	360,453	16,544,792.70	0.34
75	601658	邮储银行	2,896,397	16,451,534.96	0.34
76	601225	陕西煤业	705,374	16,406,999.24	0.34
77	600196	复星医药	655,700	16,294,145.00	0.33
78	600362	江西铜业	785,817	16,219,262.88	0.33
79	000001	平安银行	1,365,900	15,981,030.00	0.33
80	601668	中国建筑	2,626,380	15,758,280.00	0.32
81	601117	中国化学	1,886,100	15,635,769.00	0.32
82	600066	宇通客车	588,200	15,516,716.00	0.32
83	601336	新华保险	304,908	15,153,927.60	0.31
84	605499	东鹏饮料	60,625	15,066,525.00	0.31
85	600926	杭州银行	1,000,800	14,621,688.00	0.30
86	002714	牧原股份	366,500	14,088,260.00	0.29
87	601669	中国电建	2,575,600	14,062,776.00	0.29
88	600741	华域汽车	788,308	13,882,103.88	0.28
89	600584	长电科技	336,200	13,737,132.00	0.28
90	000425	徐工机械	1,725,500	13,683,215.00	0.28

91	688256	寒武纪	20,600	13,554,800.00	0.28
92	600438	通威股份	606,600	13,411,926.00	0.27
93	300661	圣邦股份	161,900	13,240,182.00	0.27
94	601169	北京银行	2,148,000	13,210,200.00	0.27
95	688009	中国通号	2,085,478	13,055,092.28	0.27
96	600600	青岛啤酒	158,000	12,785,360.00	0.26
97	688111	金山办公	44,500	12,744,355.00	0.26
98	601377	兴业证券	1,949,100	12,201,366.00	0.25
99	601111	中国国航	1,493,500	11,813,585.00	0.24
100	601628	中国人寿	280,404	11,754,535.68	0.24
101	300979	华利集团	149,200	11,734,580.00	0.24
102	600489	中金黄金	928,977	11,175,593.31	0.23
103	002179	中航光电	284,200	11,169,060.00	0.23
104	000157	中联重科	1,535,167	11,099,257.41	0.23
105	300418	昆仑万维	285,100	10,970,648.00	0.22
106	000807	云铝股份	797,900	10,795,587.00	0.22
107	002459	晶澳科技	770,340	10,592,175.00	0.22
108	600958	东方证券	994,600	10,502,976.00	0.21
109	000063	中兴通讯	252,717	10,209,766.80	0.21
110	000100	TCL 科技	2,026,151	10,191,539.53	0.21
111	000999	华润三九	229,257	10,165,255.38	0.21
112	000538	云南白药	168,814	10,120,399.30	0.21
113	600016	民生银行	2,428,226	10,028,573.38	0.21
114	600183	生益科技	411,681	9,900,928.05	0.20
115	600176	中国巨石	867,800	9,884,242.00	0.20
116	601390	中国中铁	1,539,251	9,835,813.89	0.20
117	600009	上海机场	282,005	9,630,470.75	0.20
118	601138	工业富联	446,430	9,598,245.00	0.20
119	688223	晶科能源	1,344,053	9,556,216.83	0.20
120	000596	古井贡酒	54,633	9,467,898.90	0.19
121	300014	亿纬锂能	199,800	9,338,652.00	0.19
122	000975	山金国际	605,900	9,312,683.00	0.19
123	601888	中国中免	138,000	9,247,380.00	0.19
124	600048	保利发展	1,039,407	9,209,146.02	0.19
125	000768	中航西飞	315,425	8,907,602.00	0.18
126	300274	阳光电源	116,680	8,614,484.40	0.18
127	300394	天孚通信	94,180	8,604,284.80	0.18
128	688008	澜起科技	124,138	8,428,970.20	0.17
129	000792	盐湖股份	510,300	8,399,538.00	0.17
130	300124	汇川技术	139,000	8,142,620.00	0.17
131	601127	赛力斯	60,500	8,070,095.00	0.17
132	002028	思源电气	109,600	7,967,920.00	0.16
133	600938	中国海油	264,610	7,808,641.10	0.16

134	601186	中国铁建	850,685	7,800,781.45	0.16
135	000977	浪潮信息	149,430	7,752,428.40	0.16
136	000408	藏格矿业	278,126	7,712,433.98	0.16
137	603986	兆易创新	71,250	7,609,500.00	0.16
138	002466	天齐锂业	229,300	7,566,900.00	0.15
139	601838	成都银行	442,103	7,564,382.33	0.15
140	600115	中国东航	1,881,800	7,527,200.00	0.15
141	600346	恒力石化	486,500	7,467,775.00	0.15
142	600027	华电国际	1,326,100	7,439,421.00	0.15
143	002463	沪电股份	182,000	7,216,300.00	0.15
144	600029	南方航空	1,111,500	7,213,635.00	0.15
145	600309	万华化学	101,000	7,206,350.00	0.15
146	000963	华东医药	208,000	7,196,800.00	0.15
147	002812	恩捷股份	224,100	7,168,959.00	0.15
148	601100	恒立液压	135,100	7,129,227.00	0.15
149	300498	温氏股份	417,800	6,897,878.00	0.14
150	002916	深南电路	55,000	6,875,000.00	0.14
151	002920	德赛西威	61,900	6,815,809.00	0.14
152	601607	上海医药	324,165	6,807,465.00	0.14
153	601618	中国中冶	2,044,401	6,746,523.30	0.14
154	002180	纳思达	238,800	6,726,996.00	0.14
155	002304	洋河股份	80,200	6,699,106.00	0.14
156	600795	国电电力	1,399,992	6,411,963.36	0.13
157	300999	金龙鱼	196,400	6,404,604.00	0.13
158	600085	同仁堂	154,900	6,287,391.00	0.13
159	603296	华勤技术	88,400	6,271,980.00	0.13
160	002230	科大讯飞	128,400	6,204,288.00	0.13
161	601816	京沪高铁	995,700	6,133,512.00	0.13
162	601699	潞安环能	423,900	6,087,204.00	0.12
163	600989	宝丰能源	356,489	6,003,274.76	0.12
164	601857	中国石油	668,000	5,971,920.00	0.12
165	600089	特变电工	463,800	5,908,812.00	0.12
166	600160	巨化股份	244,200	5,890,104.00	0.12
167	603993	洛阳钼业	839,691	5,583,945.15	0.11
168	300502	新易盛	47,900	5,536,282.00	0.11
169	600415	小商品城	411,900	5,523,579.00	0.11
170	600460	士兰微	206,700	5,378,334.00	0.11
171	601808	中海油服	350,431	5,344,072.75	0.11
172	301269	华大九天	43,900	5,316,290.00	0.11
173	600023	浙能电力	878,700	4,973,442.00	0.10
174	600809	山西汾酒	26,675	4,913,801.75	0.10
175	603799	华友钴业	166,400	4,868,864.00	0.10
176	000568	泸州老窖	37,607	4,708,396.40	0.10

177	603392	万泰生物	66,121	4,658,885.66	0.10
178	601901	方正证券	556,200	4,633,146.00	0.09
179	001965	招商公路	330,200	4,606,290.00	0.09
180	002050	三花智控	192,700	4,530,377.00	0.09
181	600482	中国动力	177,500	4,343,425.00	0.09
182	601689	拓普集团	86,700	4,248,300.00	0.09
183	600188	兖矿能源	292,831	4,149,415.27	0.08
184	300832	新产业	57,380	4,065,373.00	0.08
185	600570	恒生电子	144,500	4,044,555.00	0.08
186	002311	海大集团	81,663	4,005,570.15	0.08
187	600905	三峡能源	899,100	3,929,067.00	0.08
188	600585	海螺水泥	160,424	3,814,882.72	0.08
189	000661	长春高新	38,100	3,788,664.00	0.08
190	600018	上港集团	585,700	3,584,484.00	0.07
191	688187	时代电气	71,712	3,436,439.04	0.07
192	601360	三六零	327,700	3,391,695.00	0.07
193	688599	天合光能	174,748	3,372,636.40	0.07
194	601800	中国交建	319,200	3,335,640.00	0.07
195	300413	芒果超媒	124,000	3,334,360.00	0.07
196	002252	上海莱士	440,000	3,176,800.00	0.06
197	601633	长城汽车	115,231	3,034,032.23	0.06
198	003816	中国广核	707,000	2,919,910.00	0.06
199	600011	华能国际	422,011	2,857,014.47	0.06
200	002601	龙佰集团	160,966	2,844,269.22	0.06
201	000625	长安汽车	212,200	2,834,992.00	0.06
202	601799	星宇股份	19,900	2,656,252.00	0.05
203	603195	公牛集团	37,508	2,634,561.92	0.05
204	600803	新奥股份	119,900	2,599,432.00	0.05
205	000002	万科 A	355,242	2,579,056.92	0.05
206	600104	上汽集团	123,264	2,558,960.64	0.05
207	001979	招商蛇口	232,100	2,376,704.00	0.05
208	600886	国投电力	139,500	2,318,490.00	0.05
209	300015	爱尔眼科	173,400	2,297,550.00	0.05
210	000800	一汽解放	274,967	2,254,729.40	0.05
211	300782	卓胜微	24,100	2,161,770.00	0.04
212	600918	中泰证券	321,000	2,108,970.00	0.04
213	600150	中国船舶	58,254	2,094,813.84	0.04
214	002709	天赐材料	104,900	2,068,628.00	0.04
215	600893	航发动力	49,483	2,051,070.35	0.04
216	300450	先导智能	102,200	2,046,044.00	0.04
217	600845	宝信软件	64,900	1,898,974.00	0.04
218	601600	中国铝业	249,400	1,833,090.00	0.04
219	600436	片仔癀	8,500	1,823,250.00	0.04

220	600332	白云山	63,800	1,813,196.00	0.04
221	688271	联影医疗	14,253	1,801,579.20	0.04
222	600588	用友网络	155,700	1,670,661.00	0.03
223	601059	信达证券	105,500	1,580,390.00	0.03
224	600061	国投资本	207,600	1,561,152.00	0.03
225	605117	德业股份	18,100	1,534,880.00	0.03
226	600039	四川路桥	207,380	1,509,726.40	0.03
227	601698	中国卫通	73,800	1,505,520.00	0.03
228	300033	同花顺	5,100	1,466,250.00	0.03
229	000786	北新建材	48,300	1,463,973.00	0.03
230	000938	紫光股份	52,200	1,452,726.00	0.03
231	300122	智飞生物	51,500	1,354,450.00	0.03
232	688082	盛美上海	13,433	1,343,300.00	0.03
233	601238	广汽集团	139,300	1,301,062.00	0.03
234	000876	新希望	140,700	1,263,486.00	0.03
235	688303	大全能源	50,268	1,213,469.52	0.02
236	603369	今世缘	25,559	1,156,033.57	0.02
237	002493	荣盛石化	113,100	1,023,555.00	0.02
238	601021	春秋航空	17,700	1,020,759.00	0.02
239	600547	山东黄金	43,858	992,506.54	0.02
240	600028	中国石化	144,600	965,928.00	0.02
241	601868	中国能建	412,800	945,312.00	0.02
242	600025	华能水电	83,431	793,428.81	0.02
243	000617	中油资本	102,200	704,158.00	0.01
244	688472	阿特斯	53,426	671,030.56	0.01
245	002129	TCL 中环	68,900	611,143.00	0.01
246	601898	中煤能源	48,500	590,730.00	0.01
247	688396	华润微	12,503	590,016.57	0.01
248	600161	天坛生物	28,440	583,020.00	0.01
249	600674	川投能源	33,300	574,425.00	0.01
250	600111	北方稀土	25,400	538,988.00	0.01
251	601985	中国核电	49,500	516,285.00	0.01
252	002007	华兰生物	30,300	510,555.00	0.01
253	300896	爱美客	2,500	456,250.00	0.01
254	002271	东方雨虹	30,300	393,294.00	0.01
255	603019	中科曙光	5,100	368,832.00	0.01
256	300442	润泽科技	6,900	358,524.00	0.01
257	002422	科伦药业	11,900	356,167.00	0.01
258	600426	华鲁恒升	14,700	317,667.00	0.01
259	688126	沪硅产业	15,400	289,828.00	0.01
260	688036	传音控股	2,382	226,290.00	0.00
261	601878	浙商证券	17,400	212,976.00	0.00
262	603833	欧派家居	2,500	172,350.00	0.00

263	000983	山西焦煤	20,300	167,272.00	0.00
264	300628	亿联网络	4,100	158,260.00	0.00
265	002049	紫光国微	1,900	122,303.00	0.00
266	002241	歌尔股份	4,700	121,307.00	0.00
267	300759	康龙化成	3,700	95,090.00	0.00
268	603806	福斯特	5,395	79,846.00	0.00
269	000708	中信特钢	6,400	73,024.00	0.00
270	601872	招商轮船	5,000	32,050.00	0.00
271	000630	铜陵有色	1,800	5,814.00	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	300866	安克创新	191,350	18,683,414.00	0.38
2	600096	云天化	551,200	12,291,760.00	0.25
3	300627	华测导航	249,900	10,445,820.00	0.21
4	000039	中集集团	1,338,800	10,402,476.00	0.21
5	000423	东阿阿胶	144,400	9,056,768.00	0.19
6	300373	扬杰科技	199,200	8,669,184.00	0.18
7	601717	郑煤机	660,800	8,577,184.00	0.18
8	600487	亨通光电	485,200	8,355,144.00	0.17
9	600582	天地科技	1,278,200	7,899,276.00	0.16
10	000513	丽珠集团	200,100	7,603,800.00	0.16
11	601869	长飞光纤	245,900	7,349,951.00	0.15
12	601168	西部矿业	456,900	7,342,383.00	0.15
13	603568	伟明环保	330,860	7,156,501.80	0.15
14	600380	健康元	629,100	7,089,957.00	0.15
15	000729	燕京啤酒	545,100	6,563,004.00	0.13
16	688235	百济神州	40,318	6,492,004.36	0.13
17	000738	航发控制	282,301	6,278,374.24	0.13
18	002128	电投能源	311,100	6,091,338.00	0.12
19	300054	鼎龙股份	227,500	5,919,550.00	0.12
20	300682	朗新集团	483,100	5,893,820.00	0.12
21	002532	天山铝业	738,800	5,814,356.00	0.12
22	002558	巨人网络	443,700	5,630,553.00	0.12
23	601231	环旭电子	334,100	5,512,650.00	0.11
24	603899	晨光股份	177,556	5,371,069.00	0.11
25	600216	浙江医药	325,400	5,160,844.00	0.11
26	002517	恺英网络	368,200	5,011,202.00	0.10
27	000528	柳 工	412,400	4,973,544.00	0.10
28	600299	安迪苏	394,800	4,954,740.00	0.10
29	600120	浙江东方	1,009,154	4,702,657.64	0.10
30	002294	信立泰	149,873	4,635,571.89	0.09
31	600642	申能股份	482,962	4,583,309.38	0.09

32	301327	华宝新能	59,700	4,579,587.00	0.09
33	603966	法兰泰克	592,660	4,575,335.20	0.09
34	600153	建发股份	434,800	4,574,096.00	0.09
35	300529	健帆生物	152,700	4,480,218.00	0.09
36	600064	南京高科	576,400	4,478,628.00	0.09
37	601825	沪农商行	523,400	4,454,134.00	0.09
38	600649	城投控股	998,200	4,441,990.00	0.09
39	600350	山东高速	431,800	4,438,904.00	0.09
40	300360	炬华科技	263,200	4,413,864.00	0.09
41	000429	粤高速 A	298,900	4,393,830.00	0.09
42	300001	特锐德	198,500	4,357,075.00	0.09
43	601567	三星医疗	137,400	4,226,424.00	0.09
44	002064	华峰化学	514,800	4,211,064.00	0.09
45	002202	金风科技	407,500	4,209,475.00	0.09
46	002791	坚朗五金	182,300	4,145,502.00	0.08
47	002568	百润股份	145,400	4,072,654.00	0.08
48	300741	华宝股份	226,800	3,944,052.00	0.08
49	002948	青岛银行	1,016,300	3,943,244.00	0.08
50	688388	嘉元科技	266,075	3,919,284.75	0.08
51	688469	芯联集成	762,921	3,913,784.73	0.08
52	688233	神工股份	165,700	3,885,665.00	0.08
53	688019	安集科技	27,647	3,852,885.92	0.08
54	002078	太阳纸业	247,000	3,672,890.00	0.08
55	600572	康恩贝	734,000	3,420,440.00	0.07
56	002683	广东宏大	128,900	3,413,272.00	0.07
57	688002	睿创微纳	72,146	3,391,583.46	0.07
58	300207	欣旺达	151,400	3,377,734.00	0.07
59	600737	中粮糖业	328,100	3,349,901.00	0.07
60	002153	石基信息	466,200	3,328,668.00	0.07
61	300002	神州泰岳	283,200	3,282,288.00	0.07
62	002461	珠江啤酒	331,300	3,276,557.00	0.07
63	688095	福昕软件	48,136	3,232,813.76	0.07
64	600248	陕建股份	715,900	3,207,232.00	0.07
65	002237	恒邦股份	305,600	3,086,560.00	0.06
66	600517	国网英大	557,300	3,070,723.00	0.06
67	002281	光迅科技	57,900	3,020,643.00	0.06
68	600850	电科数字	125,600	3,001,840.00	0.06
69	002624	完美世界	285,700	2,951,281.00	0.06
70	000988	华工科技	68,100	2,948,730.00	0.06
71	600062	华润双鹤	148,661	2,943,487.80	0.06
72	000921	海信家电	101,100	2,921,790.00	0.06
73	600352	浙江龙盛	282,000	2,901,780.00	0.06
74	300620	光库科技	59,300	2,881,980.00	0.06

75	688739	成大生物	111,256	2,868,179.68	0.06
76	600995	南网储能	279,200	2,825,504.00	0.06
77	002444	巨星科技	86,900	2,811,215.00	0.06
78	688188	柏楚电子	14,301	2,777,969.25	0.06
79	601811	新华文轩	173,200	2,745,220.00	0.06
80	002612	朗姿股份	167,100	2,733,756.00	0.06
81	002739	万达电影	221,600	2,690,224.00	0.06
82	600420	国药现代	221,500	2,644,710.00	0.05
83	603939	益丰药房	107,800	2,601,214.00	0.05
84	300777	中简科技	90,900	2,571,561.00	0.05
85	688176	亚虹医药	377,014	2,559,925.06	0.05
86	600037	歌华有线	340,300	2,538,638.00	0.05
87	600901	江苏金租	455,155	2,375,909.10	0.05
88	000623	吉林敖东	134,800	2,327,996.00	0.05
89	300079	数码视讯	423,300	2,290,053.00	0.05
90	600557	康缘药业	165,400	2,252,748.00	0.05
91	300779	惠城环保	22,900	2,235,040.00	0.05
92	000034	神州数码	63,300	2,218,665.00	0.05
93	600873	梅花生物	221,000	2,216,630.00	0.05
94	001914	招商积余	209,200	2,211,244.00	0.05
95	600256	广汇能源	327,600	2,204,748.00	0.05
96	300346	南大光电	56,500	2,180,335.00	0.04
97	600885	宏发股份	68,200	2,170,124.00	0.04
98	300366	创意信息	229,000	2,129,700.00	0.04
99	600549	厦门钨业	110,300	2,125,481.00	0.04
100	002250	联化科技	383,300	2,111,983.00	0.04
101	002008	大族激光	83,800	2,095,000.00	0.04
102	600985	淮北矿业	148,100	2,083,767.00	0.04
103	600633	浙数文化	198,600	2,077,356.00	0.04
104	300558	贝达药业	38,100	2,054,733.00	0.04
105	603214	爱婴室	91,000	2,052,960.00	0.04
106	002151	北斗星通	77,300	2,051,542.00	0.04
107	600143	金发科技	236,800	2,045,952.00	0.04
108	688372	伟测科技	34,420	2,014,258.40	0.04
109	601162	天风证券	447,500	2,004,800.00	0.04
110	300624	万兴科技	31,560	1,993,014.00	0.04
111	601155	新城控股	166,000	1,985,360.00	0.04
112	300323	华灿光电	238,700	1,976,436.00	0.04
113	002500	山西证券	313,300	1,967,524.00	0.04
114	300888	稳健医疗	46,600	1,960,928.00	0.04
115	688322	奥比中光	41,839	1,945,513.50	0.04
116	600602	云赛智联	122,000	1,930,040.00	0.04
117	002385	大北农	444,600	1,925,118.00	0.04

118	601528	瑞丰银行	340,470	1,916,846.10	0.04
119	600100	同方股份	266,100	1,891,971.00	0.04
120	300035	中科电气	125,000	1,868,750.00	0.04
121	000069	华侨城 A	698,400	1,864,728.00	0.04
122	603025	大豪科技	121,500	1,852,875.00	0.04
123	600208	衢州发展	602,800	1,784,288.00	0.04
124	000881	中广核技	240,400	1,762,132.00	0.04
125	300101	振芯科技	80,900	1,752,294.00	0.04
126	603005	晶方科技	61,800	1,745,850.00	0.04
127	002138	顺络电子	55,300	1,740,844.00	0.04
128	300432	富临精工	112,600	1,731,788.00	0.04
129	000825	太钢不锈	493,500	1,717,380.00	0.04
130	600707	彩虹股份	207,500	1,705,650.00	0.03
131	600739	辽宁成大	156,500	1,619,775.00	0.03
132	688180	君实生物	58,317	1,593,803.61	0.03
133	600728	佳都科技	332,900	1,557,972.00	0.03
134	688158	优刻得	111,407	1,557,469.86	0.03
135	002334	英威腾	205,000	1,541,600.00	0.03
136	603087	甘李药业	34,700	1,530,270.00	0.03
137	002396	星网锐捷	77,600	1,473,624.00	0.03
138	301029	怡合达	59,300	1,465,896.00	0.03
139	600491	龙元建设	384,400	1,437,656.00	0.03
140	002376	新北洋	218,935	1,427,456.20	0.03
141	600703	三安光电	115,700	1,408,069.00	0.03
142	600060	海信视像	69,500	1,385,830.00	0.03
143	301031	中熔电气	13,300	1,383,466.00	0.03
144	603533	掌阅科技	67,200	1,364,832.00	0.03
145	600522	中天科技	94,600	1,354,672.00	0.03
146	000735	罗 牛 山	202,000	1,345,320.00	0.03
147	600021	上海电力	146,400	1,342,488.00	0.03
148	603185	弘元绿能	82,240	1,336,400.00	0.03
149	600378	昊华科技	46,101	1,332,779.91	0.03
150	002891	中宠股份	37,000	1,320,900.00	0.03
151	601665	齐鲁银行	235,582	1,316,903.38	0.03
152	300203	聚光科技	85,600	1,303,688.00	0.03
153	688550	瑞联新材	40,389	1,263,771.81	0.03
154	000503	国新健康	113,100	1,241,838.00	0.03
155	300253	卫宁健康	171,200	1,225,792.00	0.03
156	002409	雅克科技	21,100	1,222,745.00	0.03
157	601128	常熟银行	161,240	1,220,586.80	0.02
158	300598	诚迈科技	24,600	1,190,640.00	0.02
159	001872	招商港口	57,900	1,185,213.00	0.02
160	300672	国科微	17,200	1,148,100.00	0.02

161	002625	光启技术	24,000	1,147,200.00	0.02
162	603508	思维列控	47,400	1,127,172.00	0.02
163	002372	伟星新材	87,600	1,106,388.00	0.02
164	600418	江淮汽车	29,500	1,106,250.00	0.02
165	300957	贝泰妮	25,750	1,099,267.50	0.02
166	002967	广电计量	66,800	1,095,520.00	0.02
167	688050	爱博医疗	11,900	1,083,257.00	0.02
168	688707	振华新材	98,426	1,077,764.70	0.02
169	601179	中国西电	141,700	1,075,503.00	0.02
170	688208	道通科技	27,423	1,073,884.68	0.02
171	688777	中控技术	21,000	1,043,070.00	0.02
172	600098	广州发展	161,400	1,036,188.00	0.02
173	688083	中望软件	11,700	1,001,169.00	0.02
174	300390	天华新能	43,100	993,455.00	0.02
175	601958	金钼股份	95,500	960,730.00	0.02
176	600710	苏美达	102,900	956,970.00	0.02
177	688225	亚信安全	50,200	914,142.00	0.02
178	600718	东软集团	84,700	912,219.00	0.02
179	002223	鱼跃医疗	24,500	894,005.00	0.02
180	002032	苏泊尔	16,600	883,286.00	0.02
181	601156	东航物流	51,900	875,553.00	0.02
182	600320	振华重工	207,600	813,792.00	0.02
183	000932	华菱钢铁	192,200	803,396.00	0.02
184	300358	楚天科技	117,100	803,306.00	0.02
185	688183	生益电子	20,200	793,052.00	0.02
186	688048	长光华芯	20,200	787,598.00	0.02
187	002773	康弘药业	39,100	766,360.00	0.02
188	000498	山东路桥	125,900	749,105.00	0.02
189	300251	光线传媒	78,000	736,320.00	0.02
190	300724	捷佳伟创	11,400	720,594.00	0.01
191	300476	胜宏科技	17,100	719,739.00	0.01
192	002906	华阳集团	23,100	710,325.00	0.01
193	301358	湖南裕能	15,600	706,992.00	0.01
194	603893	瑞芯微	6,400	704,384.00	0.01
195	600282	南钢股份	150,100	703,969.00	0.01
196	300428	立中集团	42,700	696,010.00	0.01
197	601077	渝农商行	114,500	692,725.00	0.01
198	300415	伊之密	34,400	690,064.00	0.01
199	300662	科锐国际	32,200	678,132.00	0.01
200	603338	浙江鼎力	10,500	677,460.00	0.01
201	688371	菲沃泰	42,751	663,495.52	0.01
202	688005	容百科技	20,913	659,805.15	0.01
203	605111	新洁能	19,200	651,072.00	0.01

204	300223	北京君正	9,408	641,625.60	0.01
205	688152	麒麟信安	12,051	627,134.04	0.01
206	688027	国盾量子	2,100	626,556.00	0.01
207	600705	中航产融	169,300	614,559.00	0.01
208	600635	大众公用	137,800	613,210.00	0.01
209	600428	中远海特	82,500	602,250.00	0.01
210	605365	立达信	37,800	593,460.00	0.01
211	603083	剑桥科技	14,400	584,640.00	0.01
212	600008	首创环保	177,930	583,610.40	0.01
213	300130	新国都	26,300	569,658.00	0.01
214	300677	英科医疗	22,300	563,744.00	0.01
215	603697	有友食品	53,600	545,648.00	0.01
216	601611	中国核建	60,100	543,304.00	0.01
217	000032	深桑达 A	30,300	534,492.00	0.01
218	600536	中国软件	11,429	533,620.01	0.01
219	002399	海普瑞	49,700	531,293.00	0.01
220	300482	万孚生物	23,500	526,635.00	0.01
221	603138	海量数据	36,100	518,757.00	0.01
222	600640	国脉文化	42,800	511,032.00	0.01
223	300144	宋城演艺	54,900	510,021.00	0.01
224	002626	金达威	33,300	502,830.00	0.01
225	301050	雷电微力	9,700	500,326.00	0.01
226	600158	中体产业	60,200	497,854.00	0.01
227	688088	虹软科技	12,636	487,244.16	0.01
228	301236	软通动力	8,200	481,422.00	0.01
229	603171	税友股份	15,700	478,850.00	0.01
230	300454	深信服	8,200	470,680.00	0.01
231	301363	美好医疗	14,100	457,122.00	0.01
232	300136	信维通信	17,200	437,568.00	0.01
233	000951	中国重汽	25,600	434,688.00	0.01
234	600780	通宝能源	77,100	434,073.00	0.01
235	002410	广联达	36,419	428,287.44	0.01
236	688248	南网科技	13,203	423,684.27	0.01
237	000997	新大陆	21,100	420,945.00	0.01
238	603379	三美股份	10,800	414,504.00	0.01
239	601702	华峰铝业	22,400	410,368.00	0.01
240	601158	重庆水务	82,800	405,720.00	0.01
241	601311	骆驼股份	47,900	397,091.00	0.01
242	601666	平煤股份	37,400	374,748.00	0.01
243	600562	国睿科技	18,700	372,691.00	0.01
244	600988	赤峰黄金	23,400	365,274.00	0.01
245	601000	唐山港	76,800	361,728.00	0.01
246	002423	中粮资本	26,800	358,852.00	0.01

247	601137	博威合金	17,600	357,280.00	0.01
248	002614	奥佳华	53,900	356,818.00	0.01
249	600511	国药股份	10,400	355,888.00	0.01
250	002065	东华软件	48,600	352,836.00	0.01
251	600702	舍得酒业	5,100	336,243.00	0.01
252	000029	深深房 A	22,200	334,332.00	0.01
253	600733	北汽蓝谷	41,700	333,600.00	0.01
254	688687	凯因科技	15,400	332,332.00	0.01
255	300673	佩蒂股份	18,500	328,005.00	0.01
256	300567	精测电子	5,100	327,930.00	0.01
257	002402	和而泰	18,000	325,980.00	0.01
258	600211	西藏药业	8,800	325,072.00	0.01
259	688331	荣昌生物	10,752	323,742.72	0.01
260	600755	厦门国贸	46,900	311,416.00	0.01
261	688072	拓荆科技	2,006	308,262.02	0.01
262	688321	微芯生物	16,300	302,854.00	0.01
263	300181	佐力药业	19,500	299,520.00	0.01
264	603707	健友股份	22,100	293,267.00	0.01
265	600655	豫园股份	45,400	291,922.00	0.01
266	600639	浦东金桥	25,800	286,380.00	0.01
267	000415	渤海租赁	75,600	285,012.00	0.01
268	000877	天山股份	49,900	282,434.00	0.01
269	300134	大富科技	23,800	279,174.00	0.01
270	601777	千里科技	36,300	277,695.00	0.01
271	002992	宝明科技	4,400	275,440.00	0.01
272	688023	安恒信息	6,600	269,280.00	0.01
273	300212	易华录	11,500	269,100.00	0.01
274	300659	中孚信息	16,500	267,135.00	0.01
275	600861	北京人力	13,800	267,030.00	0.01
276	300363	博腾股份	16,800	264,936.00	0.01
277	688326	经纬恒润	3,100	260,710.00	0.01
278	300286	安科瑞	12,600	258,930.00	0.01
279	688401	路维光电	9,800	258,622.00	0.01
280	300928	华安鑫创	7,800	256,542.00	0.01
281	688819	天能股份	9,100	247,702.00	0.01
282	600499	科达制造	31,200	243,360.00	0.00
283	600563	法拉电子	2,000	237,840.00	0.00
284	688200	华峰测控	2,244	234,498.00	0.00
285	601598	中国外运	43,200	231,120.00	0.00
286	600827	百联股份	21,100	230,623.00	0.00
287	688515	裕太微	2,300	227,700.00	0.00
288	603198	迎驾贡酒	4,200	226,548.00	0.00
289	300674	宇信科技	11,600	226,432.00	0.00

290	600559	老白干酒	10,700	224,593.00	0.00
291	605358	立昂微	9,000	222,930.00	0.00
292	002368	太极股份	9,300	220,224.00	0.00
293	300685	艾德生物	9,600	218,880.00	0.00
294	603129	春风动力	1,300	204,191.00	0.00
295	000875	吉电股份	38,800	204,088.00	0.00
296	300604	长川科技	4,600	202,998.00	0.00
297	300166	东方国信	20,600	193,640.00	0.00
298	002185	华天科技	16,400	190,404.00	0.00
299	300747	锐科激光	9,700	185,852.00	0.00
300	600132	重庆啤酒	2,900	182,758.00	0.00
301	002432	九安医疗	4,400	179,432.00	0.00
302	000933	神火股份	10,500	177,450.00	0.00
303	002131	利欧股份	55,400	171,186.00	0.00
304	600369	西南证券	36,100	168,587.00	0.00
305	600316	洪都航空	5,000	160,600.00	0.00
306	688596	正帆科技	4,500	159,975.00	0.00
307	300666	江丰电子	2,300	159,735.00	0.00
308	688772	珠海冠宇	9,645	155,091.60	0.00
309	000059	华锦股份	32,200	154,238.00	0.00
310	600550	保变电气	19,500	153,075.00	0.00
311	300244	迪安诊断	13,400	152,090.00	0.00
312	300049	福瑞股份	4,800	151,392.00	0.00
313	600113	浙江东日	10,800	150,336.00	0.00
314	600872	中炬高新	6,800	149,736.00	0.00
315	600986	浙文互联	24,300	145,314.00	0.00
316	002772	众兴菌业	19,700	145,189.00	0.00
317	002489	浙江永强	43,700	141,588.00	0.00
318	688206	概伦电子	7,400	139,934.00	0.00
319	688275	万润新能	2,861	138,272.13	0.00
320	002600	领益智造	17,200	137,600.00	0.00
321	601828	美凯龙	42,300	135,783.00	0.00
322	000718	苏宁环球	56,700	133,812.00	0.00
323	300820	英杰电气	2,400	132,600.00	0.00
324	002497	雅化集团	11,300	132,210.00	0.00
325	603737	三棵树	3,100	132,060.00	0.00
326	002595	豪迈科技	2,600	130,494.00	0.00
327	002340	格林美	19,900	129,947.00	0.00
328	600688	上海石化	41,800	126,236.00	0.00
329	301558	三态股份	14,400	126,144.00	0.00
330	603766	隆鑫通用	13,800	125,580.00	0.00
331	002158	汉钟精机	6,500	120,380.00	0.00
332	300446	航天智造	7,200	118,872.00	0.00

333	603690	至纯科技	4,680	117,514.80	0.00
334	600266	城建发展	22,700	115,770.00	0.00
335	600894	广日股份	7,800	113,880.00	0.00
336	600641	万业企业	7,780	113,743.60	0.00
337	600864	哈投股份	15,300	112,455.00	0.00
338	300458	全志科技	2,900	112,404.00	0.00
339	688066	航天宏图	5,300	108,120.00	0.00
340	603337	杰克股份	3,500	106,610.00	0.00
341	600732	爱旭股份	9,600	105,792.00	0.00
342	002262	恩华药业	4,300	104,705.00	0.00
343	688425	铁建重工	23,416	103,030.40	0.00
344	300570	太辰光	1,400	101,780.00	0.00
345	600619	海立股份	8,300	101,260.00	0.00
346	300919	中伟股份	2,800	101,136.00	0.00
347	605589	圣泉集团	4,200	99,036.00	0.00
348	002567	唐人神	19,400	98,940.00	0.00
349	002265	建设工业	4,200	97,734.00	0.00
350	300751	迈为股份	900	94,635.00	0.00
351	300369	绿盟科技	12,400	89,156.00	0.00
352	002030	达安基因	15,560	88,380.80	0.00
353	300459	汤姆猫	14,200	81,508.00	0.00
354	300821	东岳硅材	10,500	81,480.00	0.00
355	000682	东方电子	7,600	81,396.00	0.00
356	603298	杭叉集团	4,500	80,505.00	0.00
357	000783	长江证券	11,800	80,476.00	0.00
358	601011	宝泰隆	25,600	77,056.00	0.00
359	002384	东山精密	2,600	75,920.00	0.00
360	000733	振华科技	1,800	75,906.00	0.00
361	000966	长源电力	15,900	75,525.00	0.00
362	002073	软控股份	9,100	75,166.00	0.00
363	688630	芯碁微装	1,300	75,036.00	0.00
364	002176	江特电机	9,600	71,136.00	0.00
365	000560	我爱我家	23,300	71,065.00	0.00
366	688120	华海清科	431	70,248.69	0.00
367	002556	辉隆股份	12,600	70,182.00	0.00
368	603301	振德医疗	3,100	68,169.00	0.00
369	002851	麦格米特	1,100	67,606.00	0.00
370	603727	博迈科	5,700	65,436.00	0.00
371	688608	恒玄科技	200	65,074.00	0.00
372	600859	王府井	4,200	64,722.00	0.00
373	603997	继峰股份	5,600	64,120.00	0.00
374	605333	沪光股份	1,900	61,997.00	0.00
375	688700	东威科技	2,100	61,866.00	0.00

376	002284	亚太股份	7,900	61,146.00	0.00
377	002821	凯莱英	800	60,872.00	0.00
378	603383	顶点软件	1,600	60,000.00	0.00
379	300656	民德电子	2,400	59,712.00	0.00
380	002277	友阿股份	10,200	59,670.00	0.00
381	601918	新集能源	8,300	59,594.00	0.00
382	688037	芯源微	680	56,868.40	0.00
383	600996	贵广网络	6,600	56,430.00	0.00
384	300037	新宙邦	1,500	56,160.00	0.00
385	000680	山推股份	5,700	55,290.00	0.00
386	688323	瑞华泰	4,400	54,076.00	0.00
387	688319	欧林生物	5,000	53,000.00	0.00
388	000400	许继电气	1,900	52,307.00	0.00
389	000035	中国天楹	10,700	52,109.00	0.00
390	002873	新天药业	5,500	52,085.00	0.00
391	603605	珀莱雅	600	50,820.00	0.00
392	600170	上海建工	19,100	50,615.00	0.00
393	002488	金固股份	4,300	44,892.00	0.00
394	600452	涪陵电力	4,100	43,419.00	0.00
395	603882	金域医学	1,500	41,295.00	0.00
396	002212	天融信	6,400	41,280.00	0.00
397	000062	深圳华强	1,800	40,320.00	0.00
398	600869	远东股份	8,300	39,425.00	0.00
399	002130	沃尔核材	1,500	37,875.00	0.00
400	688185	康希诺	596	36,385.80	0.00
401	000417	合百集团	5,700	36,366.00	0.00
402	688033	天宜上佳	6,300	36,225.00	0.00
403	002456	欧菲光	3,000	35,940.00	0.00
404	603920	世运电路	1,200	35,280.00	0.00
405	300696	爱乐达	2,200	34,166.00	0.00
406	600871	石化油服	16,700	34,068.00	0.00
407	600131	国网信通	1,800	34,038.00	0.00
408	300772	运达股份	2,500	33,100.00	0.00
409	300142	沃森生物	2,700	32,616.00	0.00
410	600419	天润乳业	3,500	32,585.00	0.00
411	600298	安琪酵母	900	32,445.00	0.00
412	002597	金禾实业	1,400	31,962.00	0.00
413	688020	方邦股份	900	31,815.00	0.00
414	600814	杭州解百	3,800	31,502.00	0.00
415	301511	德福科技	2,500	31,400.00	0.00
416	300497	富祥药业	3,500	29,190.00	0.00
417	601098	中南传媒	1,900	28,519.00	0.00
418	000710	贝瑞基因	3,300	27,885.00	0.00

419	600990	四创电子	1,300	27,664.00	0.00
420	601727	上海电气	3,400	27,574.00	0.00
421	300305	裕兴股份	4,900	26,705.00	0.00
422	688047	龙芯中科	200	26,456.00	0.00
423	000676	智度股份	3,100	26,226.00	0.00
424	601126	四方股份	1,500	25,440.00	0.00
425	300113	顺网科技	1,500	25,215.00	0.00
426	601096	宏盛华源	5,600	24,360.00	0.00
427	688062	迈威生物	1,200	24,240.00	0.00
428	600501	航天晨光	1,200	21,768.00	0.00
429	600210	紫江企业	3,200	21,152.00	0.00
430	688362	甬矽电子	600	20,208.00	0.00
431	300475	香农芯创	700	19,943.00	0.00
432	300012	华测检测	1,600	19,888.00	0.00
433	003006	百亚股份	800	19,192.00	0.00
434	002673	西部证券	2,300	18,745.00	0.00
435	603258	电魂网络	900	17,901.00	0.00
436	000728	国元证券	2,100	17,556.00	0.00
437	002287	奇正藏药	800	17,120.00	0.00
438	688598	金博股份	800	16,848.00	0.00
439	002244	滨江集团	1,900	16,359.00	0.00
440	300996	普联软件	900	16,308.00	0.00
441	301188	力诺药包	1,000	15,020.00	0.00
442	000720	新能泰山	4,500	14,625.00	0.00
443	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
444	603439	贵州三力	1,100	14,300.00	0.00
445	000550	江铃汽车	600	14,070.00	0.00
446	300255	常山药业	700	13,993.00	0.00
447	600963	岳阳林纸	2,200	11,176.00	0.00
448	600246	万通发展	1,400	10,430.00	0.00
449	000948	南天信息	600	10,038.00	0.00
450	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
451	300048	合康新能	1,900	9,576.00	0.00
452	002273	水晶光电	400	8,888.00	0.00
453	300813	泰林生物	500	8,635.00	0.00
454	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
455	002413	雷科防务	1,800	7,848.00	0.00
456	603919	金徽酒	400	7,840.00	0.00
457	603826	坤彩科技	400	7,700.00	0.00
458	688299	长阳科技	500	7,350.00	0.00
459	603186	华正新材	300	7,227.00	0.00
460	603056	德邦股份	500	7,165.00	0.00
461	600848	上海临港	619	6,251.90	0.00

462	300149	睿智医药	900	5,778.00	0.00
463	002831	裕同科技	200	5,420.00	0.00
464	002777	久远银海	300	5,166.00	0.00
465	300460	惠伦晶体	400	4,856.00	0.00
466	600114	东睦股份	300	4,851.00	0.00
467	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
468	603538	美诺华	300	3,813.00	0.00
469	600970	中材国际	400	3,792.00	0.00
470	300768	迪普科技	200	3,500.00	0.00
471	688711	宏微科技	200	3,456.00	0.00
472	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00
473	000090	天健集团	600	2,466.00	0.00
474	301030	仕净科技	100	2,414.00	0.00
475	600637	东方明珠	300	2,328.00	0.00
476	600648	外高桥	100	1,191.00	0.00
477	600331	宏达股份	100	762.00	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	600030	中信证券	173,431,479.15	4.18
2	600519	贵州茅台	146,725,242.64	3.54
3	600276	恒瑞医药	139,340,328.00	3.36
4	300750	宁德时代	136,591,454.70	3.29
5	601318	中国平安	133,638,214.04	3.22
6	000333	美的集团	129,070,656.26	3.11
7	002475	立讯精密	124,095,084.61	2.99
8	600887	伊利股份	123,523,584.32	2.98
9	603259	药明康德	119,793,035.14	2.89
10	601398	工商银行	119,028,420.00	2.87
11	600309	万华化学	117,248,067.51	2.83
12	000725	京东方 A	114,258,500.20	2.75
13	601728	中国电信	107,603,485.00	2.59
14	600900	长江电力	106,483,984.00	2.57
15	601899	紫金矿业	105,621,373.00	2.55
16	601166	兴业银行	103,497,558.85	2.49
17	601328	交通银行	97,095,220.04	2.34
18	002415	海康威视	97,030,391.77	2.34
19	002594	比亚迪	95,746,393.50	2.31
20	000858	五粮液	95,423,177.14	2.30
21	600089	特变电工	91,602,055.92	2.21
22	601601	中国太保	90,978,043.00	2.19

23	002001	新 和 成	90,395,390.80	2.18
24	601229	上海银行	89,395,126.28	2.15
25	603501	韦尔股份	89,268,173.40	2.15
26	600941	中国移动	88,155,819.00	2.12
27	601877	正泰电器	87,307,680.36	2.10
28	600426	华鲁恒升	86,415,800.25	2.08
29	600050	中国联通	85,643,232.20	2.06
30	601816	京沪高铁	84,612,562.00	2.04
31	601818	光大银行	84,353,392.65	2.03
32	000063	中兴通讯	83,220,047.87	2.01
33	601766	中国中车	83,157,794.96	2.00
34	601919	中远海控	83,011,283.85	2.00

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	600030	中信证券	179,347,512.16	4.32
2	600519	贵州茅台	144,361,250.00	3.48
3	600276	恒瑞医药	137,735,292.00	3.32
4	603259	药明康德	130,030,940.98	3.13
5	600309	万华化学	127,831,301.20	3.08
6	600900	长江电力	125,451,890.00	3.02
7	300750	宁德时代	124,295,003.91	3.00
8	600887	伊利股份	122,621,580.94	2.95
9	000063	中兴通讯	113,777,053.00	2.74
10	601328	交通银行	112,849,954.79	2.72
11	601919	中远海控	111,273,192.50	2.68
12	601318	中国平安	109,456,628.00	2.64
13	300760	迈瑞医疗	108,085,924.17	2.60
14	000858	五 粮 液	104,352,168.96	2.51
15	000568	泸州老窖	103,467,144.79	2.49
16	000725	京东方 A	102,884,570.80	2.48
17	000338	潍柴动力	98,314,170.00	2.37
18	601229	上海银行	98,060,935.95	2.36
19	600150	中国船舶	94,706,624.10	2.28
20	600845	宝信软件	94,221,841.19	2.27
21	601398	工商银行	92,933,009.00	2.24
22	002475	立讯精密	92,526,050.82	2.23
23	688036	传音控股	90,917,788.65	2.19
24	600426	华鲁恒升	88,639,499.78	2.14
25	600089	特变电工	88,415,193.94	2.13
26	600941	中国移动	88,363,127.70	2.13

27	002415	海康威视	86,617,868.00	2.09
28	603501	韦尔股份	86,484,702.24	2.08
29	000651	格力电器	86,337,383.00	2.08
30	601816	京沪高铁	85,936,085.00	2.07
31	000333	美的集团	85,379,695.00	2.06
32	600104	上汽集团	83,586,428.14	2.01
33	002001	新 和 成	83,361,440.02	2.01
34	601838	成都银行	83,215,903.00	2.01

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	18,477,305,677.51
卖出股票收入（成交）总额	18,312,495,613.15

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	131,664,498.63	2.69
	其中：政策性金融债	131,664,498.63	2.69
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	131,664,498.63	2.69

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	240304	24 进出 04	1,300,000	131,664,498.63	2.69

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的杠杆作用，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。

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	3,959,089.98
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,353,654.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,312,744.60

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 沪深 300 指数增强 A	321,933	6,179.79	368,648,915.83	18.53	1,620,829,817.87	81.47
景顺长城 沪深 300 指数增强 C	2,044	118,756.81	221,320,647.25	91.18	21,418,274.48	8.82
合计	323,977	6,890.05	589,969,563.08	26.43	1,642,248,092.35	73.57

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	景顺长城沪深 300 指数增强 A	103,985.28	0.005227
	景顺长城沪深 300 指数增强 C	28,381.59	0.011692

人员持有本基金			
	合计	132,366.87	0.005930

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

- 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。

9.4 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	景顺长城沪深 300 指数增强 A	景顺长城沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日 (2013 年 10 月 29 日) 基金份额总额	382,141,978.85	—
本报告期期初基金份额总额	2,125,130,372.31	14,962,153.72
本报告期基金总申购份额	449,100,150.51	414,050,002.14
减：本报告期基金总赎回份额	584,751,789.12	186,273,234.13
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	1,989,478,733.70	242,738,921.73

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 12 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 75,000.00 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，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
中国国际金融股份有限公司	2	5,072,291,508.20	13.79	3,717,183.00	18.70	未变更
方正证券股份有限公司	2	3,989,831,754.53	10.85	796,557.35	4.01	未变更
国信证券股份有限公司	1	3,375,075,184.33	9.17	658,169.48	3.31	未变更
长江证券股份有限公司	2	3,145,506,925.44	8.55	2,975,371.03	14.97	未变更
华泰证券股份有限公司	1	3,128,521,844.71	8.50	2,717,551.12	13.67	未变更
广发证券股份有限公司	2	2,833,301,079.71	7.70	1,267,308.10	6.38	未变更
平安证券股份	2	2,654,394,436.09	7.22	517,611.68	2.60	未变

有限公司						更
申万宏源证券 有限公司	1	1,698,640,560.52	4.62	553,249.70	2.78	未变 更
中信建投证券 股份有限公司	1	1,660,654,075.78	4.51	323,827.55	1.63	未变 更
东方财富证券 股份有限公司	2	1,524,812,337.27	4.14	297,338.26	1.50	本期 报告 新增 2 个
国泰君安证券 股份有限公司	2	1,176,349,155.11	3.20	1,112,722.04	5.60	本期 报告 新增 1 个
海通证券股份 有限公司	1	1,097,974,989.71	2.98	1,038,596.02	5.22	未变 更
中信证券股份 有限公司	6	1,026,769,116.20	2.79	940,713.10	4.73	未变 更
长城证券股份 有限公司	1	1,020,428,905.93	2.77	375,934.92	1.89	未变 更
中国银河证券 股份有限公司	2	818,663,388.53	2.23	159,651.08	0.80	未变 更
国盛证券有限 责任公司	1	673,975,593.02	1.83	637,516.84	3.21	未变 更
东方证券股份 有限公司	2	634,775,532.70	1.73	600,433.51	3.02	未变 更
天风证券股份 有限公司	1	443,255,100.10	1.20	419,279.89	2.11	未变 更
兴业证券股份 有限公司	1	438,546,822.06	1.19	414,822.09	2.09	未变 更
川财证券有限 责任公司	1	360,832,257.16	0.98	341,320.09	1.72	未变 更
国投证券股份 有限公司	1	13,591,763.63	0.04	12,857.67	0.06	未变 更
诚通证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	未变 更
东北证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	未变 更
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	未变 更
光大证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	未变 更
国金证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	未变 更
恒泰证券股份	1	-	-	-	-	未变

有限公司						更
华创证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	未变 更
华福证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	未变 更
民生证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	未变 更
瑞银证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	未变 更
申港证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	本期 报告 退租 1 个
西南证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	未变 更
招商证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	本期 报告 退租 1 个
中泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	本期 报告 退租 2 个

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(%)
中国国际金融股份有限公司	11,123.64	100.00	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
国信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
长江证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
广发证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
平安证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
海通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中信证 券股份 有限公	-	-	-	-	-	-

司						
长城证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国银 河证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国盛证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
东方证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
天风证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
兴业证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
川财证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
国投证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
诚通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东北证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东兴证 券股份 有限公	-	-	-	-	-	-

司						
光大证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华创证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
华福证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
民生证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
申港证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
西南证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
招商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 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终止北京增财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 1 月 19 日
3	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
4	景顺长城沪深 300 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
5	景顺长城基金管理有限公司关于终止华融融达期货股份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 2 月 8 日
6	关于景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金新增渤海证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 5 日
7	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
8	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
9	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
10	景顺长城沪深 300 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
11	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
12	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 15 日
13	景顺长城沪深 300 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
14	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
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 24 日
16	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
17	景顺长城沪深 300 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
18	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

19	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
20	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
21	景顺长城沪深 300 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
23	景顺长城基金管理有限公司关于终止喜鹊财富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 7 月 26 日
24	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
25	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增郑州银行为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 8 月 30 日
26	景顺长城沪深 300 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
27	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
28	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
29	景顺长城基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）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 9 月 10 日
30	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
31	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
32	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增银泰证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 26 日
33	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
34	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
35	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
36	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
37	景顺长城基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定报刊及	2024 年 10 月 25 日

	基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告	网站	
38	景顺长城沪深 300 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
39	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
40	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
41	景顺长城沪深 300 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
42	景顺长城沪深 300 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
43	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
44	关于景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金新增恒泰证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 12 月 11 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

无。

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沪深 300 指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城沪深 300 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