

景顺长城中证 500 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2024 年 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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
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	15
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	17
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
§ 5 托管人报告	17
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	18
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	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25

§ 8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
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	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	74
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	76
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	76
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	76
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	76
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	76
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	76
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	77
8.12 投资组合报告附注	77
§ 9 基金份额持有人信息	78
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	78
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
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	78
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	79
§ 10 开放式基金份额变动	79
§ 11 重大事件揭示	79
11.1 基金份额持有人大会决议	79
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	79
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	80
11.4 基金投资策略的改变	80
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	80
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	80
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	80
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	87
§ 13 备查文件目录	87
13.1 备查文件目录	87
13.2 存放地点	87
13.3 查阅方式	87

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	景顺长城中证 500 指数增强	
场内简称	无	
基金主代码	006682	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 3 月 25 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	802,386,921.21 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 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	006682	016935
报告期末下属分级 基金的份额总额	681,619,872.95 份	120,767,048.26 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 本基金可投资权证、股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融

	产品。 本基金对权证的分析判断主要从市场环境、时机、权证定价、市场供求、发行人资质、交易冲击等方面综合考量，运用权证定价模型计算权证当前的合理价格。本基金适时选择具有相对优势的权证并制定相应的投资计划。 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，本基金将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	中证 500 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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	许俊
	联系电话	0755-82370388	010-66596688
	电子邮箱	investor@igwfm.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4008888606	95566
传真		0755-22381339	010-66594942
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 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 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		李进	葛海蛟

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	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	2022 年 10 月 28 日 (C 类份 额首个估值 日)-2022 年 12 月 31 日
	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中 证 500 指数 增强 C
本期 已实 现收 益	47,885,955.70	3,590,509.16	-153,746,953.32	-389,026.05	-174,242,516.12	-149.24
本期 利润	79,492,906.16	1,802,508.00	-100,542,078.85	-223,427.37	-259,402,980.62	-2,317.25
加权 平均 基金 份额 本期 利润	0.0909	0.0576	-0.0982	-0.1099	-0.2321	-0.0566
本期 加权 平均 净值 利润 率	7.42%	4.52%	-7.24%	-8.24%	-15.82%	-4.02%
本期 基金 份额 净值 增长 率	7.14%	6.70%	-8.71%	-9.08%	-15.91%	-4.08%
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	233,281,634.17	39,980,338.08	240,447,164.26	659,433.65	461,768,101.10	45,999.82
期末可供分配基金份额利润	0.3422	0.3311	0.2528	0.2474	0.3725	0.3720
期末基金资产净值	914,901,507.12	160,747,386.34	1,191,581,131.13	3,324,599.98	1,701,516,308.00	169,665.10
期末基金份额净值	1.3422	1.3310	1.2528	1.2474	1.3724	1.3719
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	34.22%	-6.94%	25.28%	-12.79%	37.24%	-4.08%

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 500 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	-0.72%	1.89%	-0.23%	1.93%	-0.49%	-0.04%
过去六个月	13.14%	1.86%	15.13%	1.91%	-1.99%	-0.05%
过去一年	7.14%	1.68%	5.40%	1.73%	1.74%	-0.05%
过去三年	-17.76%	1.31%	-20.91%	1.33%	3.15%	-0.02%
过去五年	35.18%	1.31%	8.93%	1.31%	26.25%	0.00%
自基金合同生效 起至今	34.22%	1.30%	2.50%	1.31%	31.72%	-0.01%

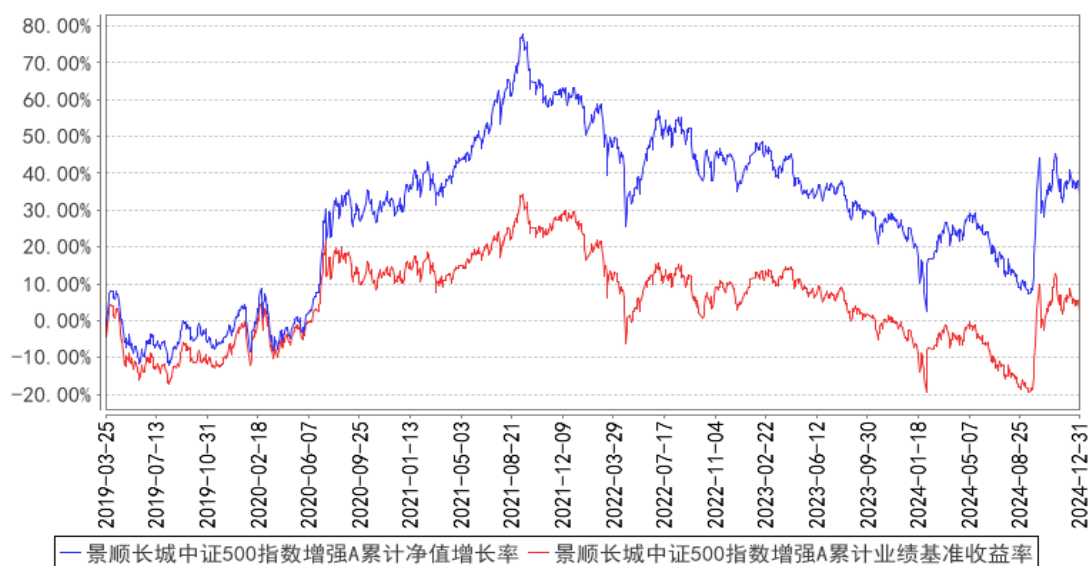
景顺长城中证 500 指数增强 C

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	-0.82%	1.89%	-0.23%	1.93%	-0.59%	-0.04%
过去六个月	12.90%	1.86%	15.13%	1.91%	-2.23%	-0.05%
过去一年	6.70%	1.68%	5.40%	1.73%	1.30%	-0.05%
自基金合同生效 起至今	-6.94%	1.28%	-3.52%	1.31%	-3.42%	-0.03%

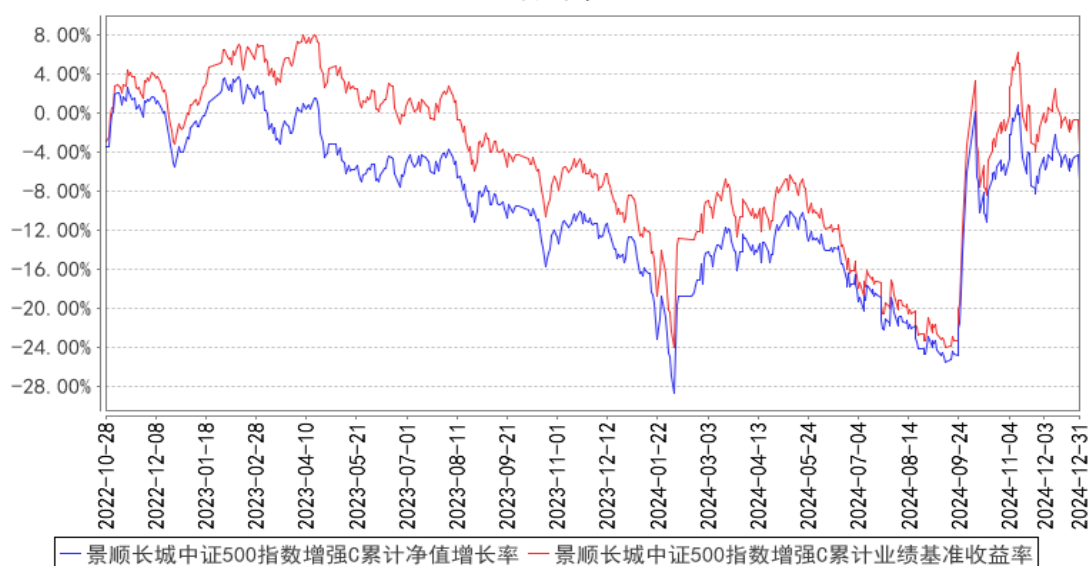
注：本基金于 2022 年 10 月 27 日增设 C 类份额，并于 2022 年 10 月 28 日开始对 C 类份额进行估值。

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

景顺长城中证500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



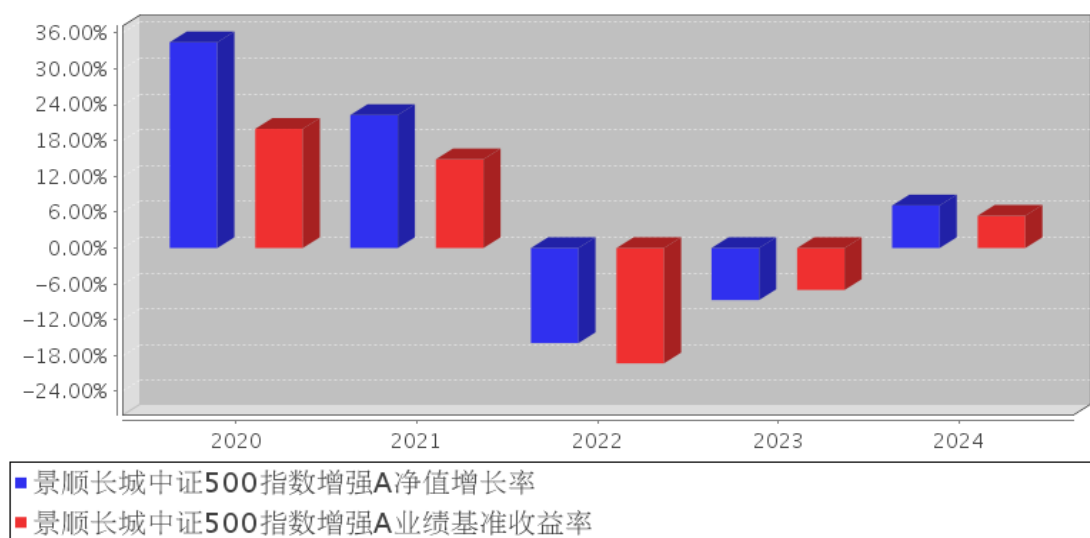
景顺长城中证500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



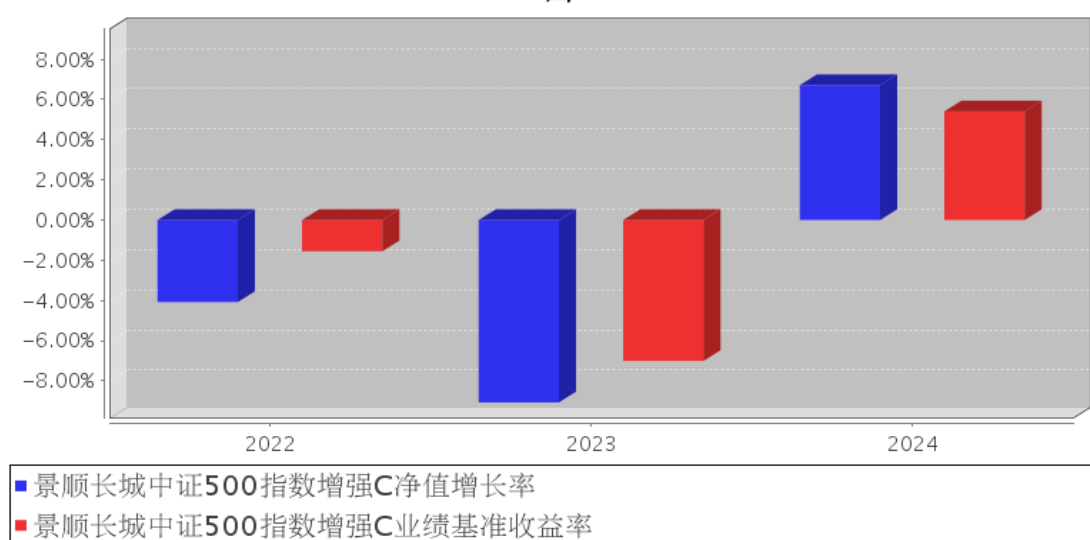
注：基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5% 其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2019 年 3 月 25 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。本基金自 2022 年 10 月 27 日起增设 C 类基金份额。

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

景顺长城中证500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500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 年景顺长城中证 500 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 10 月 28 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	2019年3月25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	2019年3月25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 500 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，景顺长城中证 500 指数增强 A 份额净值增长率为 7.14%，业绩比较基准收益率为 5.40%。

本报告期内，景顺长城中证 500 指数增强 C 份额净值增长率为 6.70%，业绩比较基准收益率为 5.40%。

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 500 指数为基准的指数增强基金，中证 500 指数汇集了 A 股市场的中大市值的个股，行业分布更加均匀。在组合构建层面，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成长稳健的公司，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及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在景顺长城中证 500 指数增强

型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2025）审字第 70015711_H32 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 500 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中证 500 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，后附的景顺长城中证 500 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 500 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中证 500 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	景顺长城中证 500 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中证 500 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中证 500 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中证 500 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 500 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：景顺长城中证 500 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	60,197,255.03	85,998,122.11
结算备付金		12,297,721.76	6,109,366.10
存出保证金		2,777,362.79	1,407,917.41
交易性金融资产	7.4.7.2	1,003,905,445.03	1,120,766,411.00
其中：股票投资		999,874,398.45	1,120,579,398.63
基金投资		-	-
债券投资		4,031,046.58	187,012.37
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		211,001.81	319,983.56

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		1,079,388,786.42	1,214,601,800.18
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		0.19	14,218,471.35
应付赎回款		1,397,149.01	704,956.77
应付管理人报酬		1,125,871.53	1,196,275.90
应付托管费		187,645.27	199,379.32
应付销售服务费		55,808.63	1,088.75
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.36
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	973,418.33	3,375,896.62
负债合计		3,739,892.96	19,696,069.07
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	802,386,921.21	953,799,133.20
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	273,261,972.25	241,106,597.91
净资产合计		1,075,648,893.46	1,194,905,731.11
负债和净资产总计		1,079,388,786.42	1,214,601,800.18

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 802,386,921.21 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 1.3422 元，基金份额 681,619,872.95 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.3310 元，基金份额 120,767,048.26 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 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		97,498,037.66	-80,750,403.49
1. 利息收入		448,709.01	449,893.32
其中：存款利息收入	7.4.7.13	448,709.01	449,893.32
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）		66,974,767.74	-135,219,741.56
其中：股票投资收益	7.4.7.14	38,740,425.95	-156,995,291.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	44,729.33	1,048,576.85
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	5,182,105.27	-1,114,815.09
股利收益	7.4.7.19	23,007,507.19	21,841,787.87
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	29,818,949.30	53,370,473.15
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	255,611.61	648,971.60
减：二、营业总支出		16,202,623.50	20,015,102.73
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	13,392,639.31	16,749,331.09
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,232,106.59	2,791,555.22
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	155,941.36	10,880.49
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		18,788.41	909.72
8. 其他费用	7.4.7.23	403,147.83	462,426.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		81,295,414.16	-100,765,506.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		81,295,414.16	-100,765,506.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		81,295,414.16	-100,765,506.22
----------	--	---------------	-----------------

7.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城中证 500 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	953,799,133.20	-	241,106,597.91	1,194,905,731.11
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	953,799,133.20	-	241,106,597.91	1,194,905,731.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-151,412,211.99	-	32,155,374.34	-119,256,837.65
（一）、综合收益总额	-	-	81,295,414.16	81,295,414.16
（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）	-151,412,211.99	-	-49,140,039.82	-200,552,251.81
其中：1. 基金申购款	417,194,622.64	-	120,893,150.32	538,087,772.96
2. 基金赎回款	-568,606,834.63	-	-170,033,190.14	-738,640,024.77
（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	802,386,921.21	-	273,261,972.25	1,075,648,893.46

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	1,239,871,872.18	-	461,814,100.92	1,701,685,973.10
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,239,871,872.18	-	461,814,100.92	1,701,685,973.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-286,072,738.98	-	-220,707,503.01	-506,780,241.99
（一）、综合收益总额	-	-	-100,765,506.22	-100,765,506.22
（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）	-286,072,738.98	-	-119,941,996.79	-406,014,735.77
其中：1. 基金申购款	130,517,423.12	-	43,468,848.23	173,986,271.35
2. 基金赎回款	-416,590,162.10	-	-163,410,845.02	-580,001,007.12
（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	953,799,133.20	-	241,106,597.91	1,194,905,731.11

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 500 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[2018]1897 号文《关于准予景顺长城中证 500 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 500 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 2019 年 3 月 25 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 1,507,912,000.78 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 967,567.93 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,508,879,568.71 元，折合 1,508,879,568.71 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据法律法规的规定及《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和《景顺长城中证 500 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 10 月 27 日起对景顺长城中证 500 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。

本基金的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）、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、同业存单、银行存款，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。

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合约需缴纳的交易保证金以后，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、存出保证金及应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 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份基金份额具有同等分配权。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	60,197,255.03	85,998,122.11
等于：本金	60,191,245.12	85,991,115.93
加：应计利息	6,009.91	7,006.18
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	60,197,255.03	85,998,122.11

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		995,085,992.50	-	999,874,398.45	4,788,405.95
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,999,840.00	23,846.58	4,031,046.58	7,360.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,999,840.00	23,846.58	4,031,046.58	7,360.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		999,085,832.50	23,846.58	1,003,905,445.03	4,795,765.95
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		1,145,830,116.98	-	1,120,579,398.63	-25,250,718.35
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	187,000.00	12.37	187,012.37	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	187,000.00	12.37	187,012.37	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,146,017,116.98	12.37	1,120,766,411.00	-25,250,718.35

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	21,000,975.00	-	-	
其中：股指期货投资	21,000,975.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	21,000,975.00	-	-	
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	11,012,080.00	-	-	
其中：股指期货投资	11,012,080.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	11,012,080.00	-	-	

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
IC2501	IC2501	18.00	20,590,560.00	-410,415.00
合计				-410,415.00
减：可抵销期货暂收款				-410,415.00
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	326.60	881.72
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	738,091.73	3,110,014.90

其中：交易所市场	738,091.73	3,110,014.90
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	185,000.00	215,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	973,418.33	3,375,896.62

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城中证 500 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	951,133,966.87	951,133,966.87
本期申购	255,432,862.44	255,432,862.44
本期赎回（以“-”号填列）	-524,946,956.36	-524,946,956.36
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	681,619,872.95	681,619,872.95

景顺长城中证 500 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	2,665,166.33	2,665,166.33
本期申购	161,761,760.20	161,761,760.20
本期赎回（以“-”号填列）	-43,659,878.27	-43,659,878.27
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	120,767,048.26	120,767,048.26

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 500 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	343,921,689.93	-103,474,525.67	240,447,164.26
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	343,921,689.93	-103,474,525.67	240,447,164.26
本期利润	47,885,955.70	31,606,950.46	79,492,906.16
本期基金份额交易产生的变动数	-82,629,031.37	-4,029,404.88	-86,658,436.25
其中：基金申购款	75,815,577.26	-4,635,364.82	71,180,212.44
基金赎回款	-158,444,608.63	605,959.94	-157,838,648.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	309,178,614.26	-75,896,980.09	233,281,634.17

景顺长城中证 500 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	949,471.42	-290,037.77	659,433.65
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	949,471.42	-290,037.77	659,433.65
本期利润	3,590,509.16	-1,788,001.16	1,802,508.00
本期基金份额交易产生的变动数	48,873,019.27	-11,354,622.84	37,518,396.43
其中：基金申购款	62,018,977.98	-12,306,040.10	49,712,937.88
基金赎回款	-13,145,958.71	951,417.26	-12,194,541.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,412,999.85	-13,432,661.77	39,980,338.08

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	261,334.44	293,578.87
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	178,554.15	152,285.50
其他	8,820.42	4,028.95
合计	448,709.01	449,893.32

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	38,740,425.95	-156,995,291.19

股票差价收入		
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	38,740,425.95	-156,995,291.19

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	7,537,012,740.39	9,325,238,763.39
减：卖出股票成本总额	7,484,893,617.07	9,455,683,519.90
减：交易费用	13,378,697.37	26,550,534.68
买卖股票差价收入	38,740,425.95	-156,995,291.19

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	9,262.97	647.86
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	35,466.36	1,047,928.99
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	44,729.33	1,048,576.85

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	222,510.62	4,379,959.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	187,000.00	3,331,200.00
减：应计利息总额	35.36	654.76
减：交易费用	8.90	175.36
买卖债券差价收入	35,466.36	1,047,928.99

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	5,182,105.27	-1,114,815.09

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	23,007,507.19	21,841,787.87
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	23,007,507.19	21,841,787.87

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	30,046,484.30	53,305,931.73
股票投资	30,039,124.30	53,305,931.73
债券投资	7,360.00	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-227,535.00	64,541.42
权证投资	-	-
期货投资	-227,535.00	64,541.42
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	29,818,949.30	53,370,473.15

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	162,548.05	511,426.37
基金转换费收入	93,063.56	137,545.23
合计	255,611.61	648,971.60

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	65,000.00	95,000.00

信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	17,611.16	21,451.87
指数使用费	200,000.00	225,281.19
存托服务费	536.67	693.15
合计	403,147.83	462,426.21

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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	1,808,604,097.07	12.16	988,085,257.09	5.42

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	498,657.93	5.76	-	-
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	925,840.26	5.43	363,135.81	11.68

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	13,392,639.31	16,749,331.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,845,158.80	4,683,332.95
应支付基金管理人的净管理费	9,547,480.51	12,065,998.14

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

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	2,232,106.59	2,791,555.22

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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/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 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	62,521.91	62,521.91
中国银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	62,521.91	62,521.91
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		
	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	61.08	61.08
中国银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	61.08	61.08

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
中国银行-活期	60,197,255.03	261,334.44	85,998,122.11	293,578.87

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
001391	国货航	2024 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	2.30	6.80	4,686	10,777.80	31,864.80	-
301552	科力	2024 年 7 月	6 个月	新股流通	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-

	装 备	15 日		受限						
301571	国 科 天 成	2024 年 8 月 14 日	6 个月	新股 流通 受限	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301585	蓝 宇 股 份	2024 年 12 月 10 日	6 个月	新股 流通 受限	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
301586	佳 力 奇	2024 年 8 月 21 日	6 个月	新股 流通 受限	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔 锋 智 能	2024 年 7 月 3 日	6 个月	新股 流通 受限	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
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	-
301607	富 特 科 技	2024 年 8 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301608	博 实 结	2024 年 7 月 25 日	6 个月	新股 流通 受限	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301611	珂 玛 科 技	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股 流通 受限	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
301617	博 苑 股 份	2024 年 12 月 3 日	6 个月	新股 流通 受限	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301622	英 思 特	2024 年 11 月 26 日	6 个月	新股 流通 受限	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301631	壹 连 科 技	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股 流通 受限	72.99	101.96	153	11,167.47	15,599.88	-

603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
603207	小方制药	2024 年 8 月 19 日	6 个月	新股流通受限	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
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	-
603310	巍华新材	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股流通受限	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
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	-
603391	力聚热能	2024 年 7 月 24 日	6 个月	新股流通受限	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
688449	联芸科技	2024 年 11 月 20 日	6 个月	新股流通受限	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-
688605	先锋精科	2024 年 12 月 4 日	6 个月	新股流通受限	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688708	佳驰科技	2024 年 11 月 27 日	6 个月	新股流通受限	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-
688710	益诺思	2024 年 8 月 27 日	6 个月	新股流通受限	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
688721	龙图	2024 年 7 月	6 个月	新股流通	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-

	光 罩	30 日		受限						
--	--------	------	--	----	--	--	--	--	--	--

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约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易

所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券，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：0.02%）。

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发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动

投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。
本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	60,197,255.03	-	-	-	-	-	60,197,255.03

结算 备付 金	12,297,721.76	-	-	-	-	-	12,297,721.76
存出 保证 金	306,495.59	-	-	-	-	2,470,867.20	2,777,362.79
交易 性金 融资 产	-	-4,031,046.58	-	-	-	999,874,398.45	1,003,905,445.03
应收 申购 款	-	-	-	-	-	211,001.81	211,001.81
资产 总计	72,801,472.38	-4,031,046.58	-	-	-	1,002,556,267.46	1,079,388,786.42
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	1,397,149.01	1,397,149.01
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	1,125,871.53	1,125,871.53
应付 托管 费	-	-	-	-	-	187,645.27	187,645.27
应付 清算 款	-	-	-	-	-	0.19	0.19
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	55,808.63	55,808.63
其他 负债	-	-	-	-	-	973,418.33	973,418.33
负债 总计	-	-	-	-	-	3,739,892.96	3,739,892.96
利率 敏感 度缺 口	72,801,472.38	-4,031,046.58	-	-	-	-	-
上年 度末 2023	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

年 12 月 31 日							
资产							
货币资金	85,998,122.11	-	-	-	-	-	85,998,122.11
结算备付金	6,109,366.10	-	-	-	-	-	6,109,366.10
存出保证金	108,413.41	-	-	-	-	1,299,504.00	1,407,917.41
交易性金融资产	-	-	-	178,011.70	9,000.67	1,120,579,398.63	1,120,766,411.00
应收申购款	-	-	-	-	-	319,983.56	319,983.56
资产总计	92,215,901.62	-	-	178,011.70	9,000.67	1,122,198,886.19	1,214,601,800.18
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	704,956.77	704,956.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,196,275.90	1,196,275.90
应付托管费	-	-	-	-	-	199,379.32	199,379.32
应付清算款	-	-	-	-	-	14,218,471.35	14,218,471.35
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,088.75	1,088.75
应交税费	-	-	-	-	-	0.36	0.36
其他负债	-	-	-	-	-	3,375,896.62	3,375,896.62
负债	-	-	-	-	-	19,696,069.07	19,696,069.07

总计							
利率敏感 度缺口	92,215,901.62	-	-178,011.70	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	-5,623.91	-
	市场利率下降 25 个基点	5,634.80	-

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	999,874,398.45	92.96	1,120,579,398.63	93.78
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	999,874,398.45	92.96	1,120,579,398.63	93.78

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%	56,034,118.17	50,225,737.60
	沪深 300 指数下降 5%	-56,034,118.17	-50,225,737.60

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	999,476,458.16	1,119,459,532.19
第二层次	4,058,783.08	212,070.53
第三层次	370,203.79	1,094,808.28

合计	1, 003, 905, 445. 03	1, 120, 766, 411. 00
----	----------------------	----------------------

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, 094, 808. 28	1, 094, 808. 28
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	157, 848. 52	157, 848. 52
转出第三层次	-	1, 094, 808. 28	1, 094, 808. 28
当期利得或损失总额	-	212, 355. 27	212, 355. 27
其中：计入损益的利得或损失	-	212, 355. 27	212, 355. 27
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	370, 203. 79	370, 203. 79
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	-	212, 355. 27	212, 355. 27
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, 295, 959. 67	2, 295, 959. 67
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	935, 498. 02	935, 498. 02

转出第三层次	-	2, 295, 959. 67	2, 295, 959. 67
当期利得或损失总额	-	159, 310. 26	159, 310. 26
其中：计入损益的利得或损失	-	159, 310. 26	159, 310. 26
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1, 094, 808. 28	1, 094, 808. 28
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, 310. 26	159, 310. 26

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	370, 203. 79	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0. 2665-2. 8129	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, 094, 808. 28	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	999,874,398.45	92.63
	其中：股票	999,874,398.45	92.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,031,046.58	0.37
	其中：债券	4,031,046.58	0.37
	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	72,494,976.79	6.72
8	其他各项资产	2,988,364.60	0.28
9	合计	1,079,388,786.42	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	3,500,073.00	0.33
B	采矿业	20,362,831.30	1.89
C	制造业	526,585,827.46	48.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,672,092.00	1.74
E	建筑业	7,949,576.00	0.74
F	批发和零售业	30,730,219.71	2.86
G	交通运输、仓储和邮政业	6,816,500.00	0.63
H	住宿和餐饮业	4,867,428.00	0.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	77,798,975.89	7.23
J	金融业	70,660,644.13	6.57
K	房地产业	11,979,126.00	1.11
L	租赁和商务服务业	5,380,980.00	0.50
M	科学研究和技术服务业	6,131,742.00	0.57
N	水利、环境和公共设施管理业	2,912,679.12	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,545,527.00	0.24

R	文化、体育和娱乐业	19,277,268.00	1.79
S	综合	2,335,901.00	0.22
	合计	818,507,390.61	76.09

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	5,108,030.00	0.47
C	制造业	119,211,236.13	11.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	968,277.00	0.09
E	建筑业	383,628.00	0.04
F	批发和零售业	7,510,635.00	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	697,520.80	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,964,510.80	1.95
J	金融业	13,827,896.55	1.29
K	房地产业	4,738,051.00	0.44
L	租赁和商务服务业	3,033,527.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	4,060,747.56	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	530,343.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	332,605.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	181,367,007.84	16.86

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	300866	安克创新	104,173	10,171,451.72	0.95
2	000783	长江证券	1,310,100	8,934,882.00	0.83
3	600418	江淮汽车	219,300	8,223,750.00	0.76
4	600096	云天化	357,800	7,978,940.00	0.74
5	600885	宏发股份	249,400	7,935,908.00	0.74
6	600352	浙江龙盛	701,700	7,220,493.00	0.67
7	000423	东阿阿胶	114,100	7,156,352.00	0.67
8	300207	欣旺达	318,700	7,110,197.00	0.66
9	002517	恺英网络	521,400	7,096,254.00	0.66
10	000039	中集集团	903,600	7,020,972.00	0.65
11	000728	国元证券	825,650	6,902,434.00	0.64
12	002414	高德红外	913,070	6,784,110.10	0.63
13	601717	郑煤机	509,500	6,613,310.00	0.61
14	600487	亨通光电	378,800	6,522,936.00	0.61
15	600498	烽火通信	334,400	6,507,424.00	0.60
16	300054	鼎龙股份	240,588	6,260,099.76	0.58
17	002625	光启技术	130,100	6,218,780.00	0.58
18	601231	环旭电子	368,300	6,076,950.00	0.56
19	000729	燕京啤酒	502,500	6,050,100.00	0.56
20	002532	天山铝业	761,400	5,992,218.00	0.56
21	002500	山西证券	944,200	5,929,576.00	0.55
22	002558	巨人网络	460,200	5,839,938.00	0.54
23	600282	南钢股份	1,238,500	5,808,565.00	0.54
24	000987	越秀资本	809,825	5,684,971.50	0.53
25	002185	华天科技	489,100	5,678,451.00	0.53
26	000988	华工科技	130,900	5,667,970.00	0.53
27	603939	益丰药房	231,800	5,593,334.00	0.52
28	002202	金风科技	539,300	5,570,969.00	0.52
29	600704	物产中大	1,083,760	5,483,825.60	0.51
30	605358	立昂微	221,100	5,476,647.00	0.51
31	600153	建发股份	511,500	5,380,980.00	0.50
32	600380	健康元	475,600	5,360,012.00	0.50
33	600141	兴发集团	245,300	5,323,010.00	0.49
34	000997	新大陆	262,900	5,244,855.00	0.49
35	600521	华海药业	292,100	5,219,827.00	0.49
36	000738	航发控制	232,317	5,166,730.08	0.48
37	300724	捷佳伟创	81,100	5,126,331.00	0.48
38	600637	东方明珠	660,140	5,122,686.40	0.48
39	002739	万达电影	413,500	5,019,890.00	0.47
40	002203	海亮股份	457,300	4,915,975.00	0.46
41	300012	华测检测	392,100	4,873,803.00	0.45
42	600765	中航重机	237,600	4,863,672.00	0.45
43	002128	电投能源	246,104	4,818,716.32	0.45

44	601567	三星医疗	150,000	4,614,000.00	0.43
45	600998	九州通	895,000	4,582,400.00	0.43
46	600642	申能股份	481,000	4,564,690.00	0.42
47	601108	财通证券	558,010	4,558,941.70	0.42
48	002064	华峰化学	556,700	4,553,806.00	0.42
49	000034	神州数码	129,000	4,521,450.00	0.42
50	600580	卧龙电驱	261,500	4,495,185.00	0.42
51	002156	通富微电	151,300	4,470,915.00	0.42
52	002624	完美世界	432,800	4,470,824.00	0.42
53	002384	东山精密	152,900	4,464,680.00	0.42
54	600873	梅花生物	445,100	4,464,353.00	0.42
55	300699	光威复材	126,960	4,399,164.00	0.41
56	600208	衢州发展	1,486,000	4,398,560.00	0.41
57	002472	双环传动	140,300	4,295,986.00	0.40
58	600862	中航高科	168,700	4,261,362.00	0.40
59	688002	睿创微纳	90,100	4,235,601.00	0.39
60	000066	中国长城	289,900	4,223,843.00	0.39
61	002432	九安医疗	102,700	4,188,106.00	0.39
62	688122	西部超导	96,862	4,147,630.84	0.39
63	000967	盈峰环境	826,600	4,108,202.00	0.38
64	300529	健帆生物	139,400	4,089,996.00	0.38
65	300001	特锐德	186,000	4,082,700.00	0.38
66	002273	水晶光电	183,600	4,079,592.00	0.38
67	002078	太阳纸业	271,000	4,029,770.00	0.37
68	000050	深天马 A	445,500	4,022,865.00	0.37
69	002508	老板电器	187,000	4,007,410.00	0.37
70	300604	长川科技	89,800	3,962,874.00	0.37
71	002436	兴森科技	353,200	3,924,052.00	0.36
72	601179	中国西电	515,900	3,915,681.00	0.36
73	002223	鱼跃医疗	107,300	3,915,377.00	0.36
74	300476	胜宏科技	92,300	3,884,907.00	0.36
75	000878	云南铜业	318,000	3,876,420.00	0.36
76	300251	光线传媒	406,500	3,837,360.00	0.36
77	000513	丽珠集团	100,200	3,807,600.00	0.35
78	600563	法拉电子	31,200	3,710,304.00	0.34
79	002138	顺络电子	115,350	3,631,218.00	0.34
80	002831	裕同科技	133,500	3,617,850.00	0.34
81	688777	中控技术	71,896	3,571,074.32	0.33
82	600517	国网英大	636,900	3,509,319.00	0.33
83	300144	宋城演艺	365,600	3,396,424.00	0.32
84	002294	信立泰	108,800	3,365,184.00	0.31
85	603338	浙江鼎力	51,800	3,342,136.00	0.31
86	600062	华润双鹤	167,300	3,312,540.00	0.31

87	600155	华创云信	444,700	3,290,780.00	0.31
88	600867	通化东宝	404,529	3,260,503.74	0.30
89	600021	上海电力	354,900	3,254,433.00	0.30
90	600350	山东高速	316,000	3,248,480.00	0.30
91	603160	汇顶科技	40,300	3,245,762.00	0.30
92	301236	软通动力	54,900	3,223,179.00	0.30
93	300002	神州泰岳	277,000	3,210,430.00	0.30
94	600060	海信视像	160,900	3,208,346.00	0.30
95	000921	海信家电	110,200	3,184,780.00	0.30
96	600909	华安证券	525,300	3,183,318.00	0.30
97	600820	隧道股份	435,100	3,128,369.00	0.29
98	600258	首旅酒店	212,600	3,118,842.00	0.29
99	002368	太极股份	131,300	3,109,184.00	0.29
100	002153	石基信息	434,900	3,105,186.00	0.29
101	002008	大族激光	122,700	3,067,500.00	0.29
102	002738	中矿资源	85,600	3,038,800.00	0.28
103	300390	天华新能	131,760	3,037,068.00	0.28
104	688617	惠泰医疗	8,100	3,015,873.00	0.28
105	600398	海澜之家	401,900	3,014,250.00	0.28
106	601958	金钼股份	298,600	3,003,916.00	0.28
107	600582	天地科技	483,600	2,988,648.00	0.28
108	002444	巨星科技	91,600	2,963,260.00	0.28
109	600655	豫园股份	458,957	2,951,093.51	0.27
110	603927	中科软	135,600	2,942,520.00	0.27
111	603129	春风动力	18,500	2,905,795.00	0.27
112	000703	恒逸石化	449,400	2,822,232.00	0.26
113	600098	广州发展	436,500	2,802,330.00	0.26
114	002340	格林美	426,900	2,787,657.00	0.26
115	300558	贝达药业	51,600	2,782,788.00	0.26
116	601168	西部矿业	172,714	2,775,513.98	0.26
117	000027	深圳能源	426,800	2,765,664.00	0.26
118	600499	科达制造	354,512	2,765,193.60	0.26
119	300223	北京君正	40,500	2,762,100.00	0.26
120	002056	横店东磁	210,700	2,730,672.00	0.25
121	688005	容百科技	85,814	2,707,431.70	0.25
122	603899	晨光股份	89,300	2,701,325.00	0.25
123	603486	科沃斯	57,200	2,688,400.00	0.25
124	300567	精测电子	41,700	2,681,310.00	0.25
125	600536	中国软件	57,400	2,680,006.00	0.25
126	002568	百润股份	93,100	2,607,731.00	0.24
127	300037	新宙邦	69,300	2,594,592.00	0.24
128	300373	扬杰科技	59,400	2,585,088.00	0.24
129	000623	吉林敖东	148,400	2,562,868.00	0.24

130	600970	中材国际	266,400	2,525,472.00	0.23
131	601568	北元集团	599,500	2,517,900.00	0.23
132	300677	英科医疗	98,800	2,497,664.00	0.23
133	603298	杭叉集团	138,800	2,483,132.00	0.23
134	603087	甘李药业	56,300	2,482,830.00	0.23
135	002318	久立特材	105,900	2,479,119.00	0.23
136	688213	思特威	31,898	2,479,112.56	0.23
137	002465	海格通信	224,500	2,465,010.00	0.23
138	000998	隆平高科	220,400	2,461,868.00	0.23
139	600511	国药股份	71,600	2,450,152.00	0.23
140	688469	芯联集成	472,400	2,423,412.00	0.23
141	688180	君实生物	88,570	2,420,618.10	0.23
142	002372	伟星新材	190,900	2,411,067.00	0.22
143	601666	平煤股份	238,200	2,386,764.00	0.22
144	002563	森马服饰	338,800	2,378,376.00	0.22
145	600859	王府井	153,100	2,359,271.00	0.22
146	002821	凯莱英	31,000	2,358,790.00	0.22
147	688120	华海清科	14,448	2,354,879.52	0.22
148	000636	风华高科	164,100	2,354,835.00	0.22
149	600673	东阳光	206,900	2,335,901.00	0.22
150	600906	财达证券	327,600	2,325,960.00	0.22
151	600737	中粮糖业	227,800	2,325,838.00	0.22
152	600848	上海临港	229,100	2,313,910.00	0.22
153	002044	美年健康	502,400	2,306,016.00	0.21
154	601990	南京证券	266,200	2,305,292.00	0.21
155	601099	太平洋	538,600	2,294,436.00	0.21
156	603606	东方电缆	43,300	2,275,415.00	0.21
157	002439	启明星辰	143,100	2,263,842.00	0.21
158	603185	弘元绿能	138,900	2,257,125.00	0.21
159	300339	润和软件	44,000	2,201,320.00	0.20
160	600872	中炬高新	99,200	2,184,384.00	0.20
161	300496	中科创达	36,500	2,173,940.00	0.20
162	300957	贝泰妮	50,800	2,168,652.00	0.20
163	600839	四川长虹	223,300	2,154,845.00	0.20
164	688772	珠海冠宇	133,880	2,152,790.40	0.20
165	600271	航天信息	235,500	2,145,405.00	0.20
166	000559	万向钱潮	344,700	2,119,905.00	0.20
167	601611	中国核建	234,500	2,119,880.00	0.20
168	688099	晶晨股份	30,597	2,101,401.96	0.20
169	002683	广东宏大	77,900	2,062,792.00	0.19
170	601098	中南传媒	137,400	2,062,374.00	0.19
171	002409	雅克科技	35,100	2,034,045.00	0.19
172	002240	盛新锂能	147,100	2,027,038.00	0.19

173	002266	浙富控股	648,756	2,024,118.72	0.19
174	603444	吉比特	9,200	2,013,328.00	0.19
175	002373	千方科技	193,500	1,962,090.00	0.18
176	688188	柏楚电子	10,030	1,948,327.50	0.18
177	600109	国金证券	222,600	1,943,298.00	0.18
178	000887	中鼎股份	144,200	1,891,904.00	0.18
179	002673	西部证券	231,500	1,886,725.00	0.18
180	000960	锡业股份	133,800	1,877,214.00	0.17
181	600007	中国国贸	76,600	1,873,636.00	0.17
182	002281	光迅科技	35,600	1,857,252.00	0.17
183	000893	亚钾国际	91,000	1,834,560.00	0.17
184	600392	盛和资源	178,100	1,830,868.00	0.17
185	300285	国瓷材料	106,600	1,816,464.00	0.17
186	300136	信维通信	70,900	1,803,696.00	0.17
187	688425	铁建重工	409,617	1,802,314.80	0.17
188	300803	指南针	18,700	1,794,265.00	0.17
189	002429	兆驰股份	309,900	1,791,222.00	0.17
190	002867	周大生	122,500	1,779,925.00	0.17
191	002268	电科网安	107,800	1,751,750.00	0.16
192	600754	锦江酒店	65,100	1,748,586.00	0.16
193	688047	龙芯中科	13,200	1,746,096.00	0.16
194	300073	当升科技	43,100	1,736,068.00	0.16
195	601162	天风证券	386,600	1,731,968.00	0.16
196	002595	豪迈科技	34,400	1,726,536.00	0.16
197	002353	杰瑞股份	46,300	1,712,637.00	0.16
198	600329	达仁堂	54,600	1,681,680.00	0.16
199	601456	国联证券	124,100	1,677,832.00	0.16
200	600373	中文传媒	130,400	1,636,520.00	0.15
201	000009	中国宝安	177,900	1,627,785.00	0.15
202	600977	中国电影	139,200	1,616,112.00	0.15
203	600177	雅戈尔	179,913	1,601,225.70	0.15
204	600549	厦门钨业	80,800	1,557,016.00	0.14
205	002507	涪陵榨菜	108,207	1,528,964.91	0.14
206	603596	伯特利	33,600	1,498,224.00	0.14
207	603885	吉祥航空	108,800	1,490,560.00	0.14
208	600390	五矿资本	228,200	1,471,890.00	0.14
209	600801	华新水泥	121,200	1,466,520.00	0.14
210	301358	湖南裕能	32,300	1,463,836.00	0.14
211	600707	彩虹股份	176,400	1,450,008.00	0.13
212	002019	亿帆医药	134,144	1,438,023.68	0.13
213	002557	洽洽食品	49,399	1,435,040.95	0.13
214	600895	张江高科	53,000	1,420,400.00	0.13
215	600901	江苏金租	271,984	1,419,756.48	0.13

216	603728	鸣志电器	26,000	1,404,000.00	0.13
217	601128	常熟银行	183,085	1,385,953.45	0.13
218	601665	齐鲁银行	244,600	1,367,314.00	0.13
219	600299	安迪苏	106,100	1,331,555.00	0.12
220	688521	芯原股份	25,375	1,330,411.25	0.12
221	688297	中无人机	32,785	1,320,579.80	0.12
222	601928	凤凰传媒	109,700	1,265,938.00	0.12
223	300888	稳健医疗	30,000	1,262,400.00	0.12
224	688052	纳芯微	9,500	1,237,850.00	0.12
225	000958	电投产融	197,400	1,229,802.00	0.11
226	002155	湖南黄金	77,100	1,212,783.00	0.11
227	300017	网宿科技	112,800	1,192,296.00	0.11
228	600764	中国海防	41,800	1,183,776.00	0.11
229	600516	方大炭素	238,500	1,151,955.00	0.11
230	600497	驰宏锌锗	201,600	1,122,912.00	0.10
231	688567	孚能科技	96,604	1,120,606.40	0.10
232	688072	拓荆科技	7,232	1,111,341.44	0.10
233	600312	平高电气	57,800	1,109,760.00	0.10
234	002262	恩华药业	45,400	1,105,490.00	0.10
235	002797	第一创业	132,000	1,102,200.00	0.10
236	002572	索菲亚	63,600	1,092,648.00	0.10
237	601156	东航物流	64,200	1,083,054.00	0.10
238	001203	大中矿业	124,300	1,076,438.00	0.10
239	600988	赤峰黄金	68,700	1,072,407.00	0.10
240	603290	斯达半导	11,900	1,068,858.00	0.10
241	600316	洪都航空	33,100	1,063,172.00	0.10
242	603345	安井食品	13,000	1,059,240.00	0.10
243	002756	永兴材料	28,040	1,057,668.80	0.10
244	002385	大北农	243,600	1,054,788.00	0.10
245	002966	苏州银行	128,400	1,041,324.00	0.10
246	002984	森麒麟	42,000	1,035,720.00	0.10
247	603893	瑞芯微	9,200	1,012,552.00	0.09
248	600535	天士力	69,200	1,000,632.00	0.09
249	002085	万丰奥威	52,700	998,665.00	0.09
250	601991	大唐发电	350,200	998,070.00	0.09
251	600325	华发股份	171,500	987,840.00	0.09
252	601577	长沙银行	111,100	987,679.00	0.09
253	601598	中国外运	180,800	967,280.00	0.09
254	600739	辽宁成大	90,500	936,675.00	0.09
255	688536	思瑞浦	9,963	921,577.50	0.09
256	600131	国网信通	48,600	919,026.00	0.09
257	300763	锦浪科技	15,000	916,050.00	0.09
258	601001	晋控煤业	66,200	904,954.00	0.08

259	603568	伟明环保	41,080	888,560.40	0.08
260	688281	华秦科技	9,036	841,251.60	0.08
261	002958	青农商行	270,600	822,624.00	0.08
262	600143	金发科技	93,800	810,432.00	0.08
263	603688	石英股份	26,700	767,091.00	0.07
264	000883	湖北能源	148,800	741,024.00	0.07
265	300024	机器人	41,200	739,540.00	0.07
266	601997	贵阳银行	120,800	724,800.00	0.07
267	600546	山煤国际	60,300	713,349.00	0.07
268	600959	江苏有线	211,000	706,850.00	0.07
269	603225	新凤鸣	62,500	695,625.00	0.06
270	002152	广电运通	59,600	694,936.00	0.06
271	688387	信科移动	114,157	680,375.72	0.06
272	601965	中国汽研	37,700	664,274.00	0.06
273	003031	中瓷电子	12,120	634,966.80	0.06
274	000830	鲁西化工	51,900	606,711.00	0.06
275	601155	新城控股	49,800	595,608.00	0.06
276	600995	南网储能	58,800	595,056.00	0.06
277	688248	南网科技	18,500	593,665.00	0.06
278	601966	玲珑轮胎	32,900	593,516.00	0.06
279	002410	广联达	49,740	584,942.40	0.05
280	688234	天岳先进	11,000	563,200.00	0.05
281	600685	中船防务	23,700	561,690.00	0.05
282	600598	北大荒	37,500	553,125.00	0.05
283	603179	新泉股份	12,800	546,560.00	0.05
284	000537	中绿电	55,400	505,248.00	0.05
285	600483	福能股份	50,600	504,482.00	0.05
286	000400	许继电气	18,300	503,799.00	0.05
287	688475	萤石网络	16,602	501,214.38	0.05
288	600378	昊华科技	17,300	500,143.00	0.05
289	002299	圣农发展	33,500	485,080.00	0.05
290	688114	华大智造	10,050	470,239.50	0.04
291	000733	振华科技	11,000	463,870.00	0.04
292	601019	山东出版	39,000	442,650.00	0.04
293	000021	深科技	22,800	434,568.00	0.04
294	000932	华菱钢铁	103,300	431,794.00	0.04
295	601216	君正集团	80,000	420,800.00	0.04
296	000598	兴蓉环境	53,700	407,583.00	0.04
297	603605	珀莱雅	4,800	406,560.00	0.04
298	600369	西南证券	86,300	403,021.00	0.04
299	300474	景嘉微	4,200	392,658.00	0.04
300	002244	滨江集团	45,200	389,172.00	0.04
301	603786	科博达	5,900	364,620.00	0.03

302	689009	九号公司	7,108	337,630.00	0.03
303	000060	中金岭南	71,000	332,990.00	0.03
304	300919	中伟股份	8,800	317,856.00	0.03
305	600968	海油发展	73,400	313,418.00	0.03
306	601212	白银有色	107,000	297,460.00	0.03
307	600863	内蒙华电	62,800	271,924.00	0.03
308	300751	迈为股份	2,400	252,360.00	0.02
309	688578	艾力斯	4,200	251,580.00	0.02
310	300573	兴齐眼药	3,600	251,208.00	0.02
311	688363	华熙生物	4,700	239,888.00	0.02
312	603882	金域医学	8,700	239,511.00	0.02
313	688525	佰维存储	3,700	229,289.00	0.02
314	002423	中粮资本	13,000	174,070.00	0.02
315	002430	杭氧股份	7,800	170,040.00	0.02
316	603707	健友股份	12,800	169,856.00	0.02
317	600095	湘财股份	23,300	167,760.00	0.02
318	600606	绿地控股	74,400	156,240.00	0.01
319	688819	天能股份	5,572	151,669.84	0.01
320	688349	三一重能	4,900	151,312.00	0.01
321	603826	坤彩科技	7,500	144,375.00	0.01
322	002487	大金重工	6,700	137,283.00	0.01
323	300395	菲利华	3,500	131,635.00	0.01
324	002195	岩山科技	30,100	119,497.00	0.01
325	603000	人民网	4,300	94,772.00	0.01
326	688331	荣昌生物	3,100	93,341.00	0.01
327	688278	特宝生物	1,200	88,044.00	0.01
328	688276	百克生物	3,300	82,863.00	0.01
329	600166	福田汽车	26,100	65,511.00	0.01
330	601233	桐昆股份	5,400	63,720.00	0.01
331	688017	绿的谐波	493	53,273.58	0.00
332	688778	厦钨新能	1,100	50,204.00	0.00
333	603228	景旺电子	1,800	50,112.00	0.00
334	688065	凯赛生物	1,200	46,560.00	0.00
335	600056	中国医药	3,700	41,070.00	0.00
336	300212	易华录	1,500	35,100.00	0.00
337	603233	大参林	2,060	31,023.60	0.00
338	603979	金诚信	600	21,780.00	0.00
339	301165	锐捷网络	300	21,660.00	0.00
340	600529	山东药玻	700	18,039.00	0.00
341	601000	唐山港	3,600	16,956.00	0.00
342	600008	首创环保	3,900	12,792.00	0.00
343	600132	重庆啤酒	200	12,604.00	0.00
344	600170	上海建工	4,700	12,455.00	0.00

345	002080	中材科技	900	11,772.00	0.00
346	000739	普洛药业	700	11,382.00	0.00
347	600528	中铁工业	1,400	11,284.00	0.00
348	603858	步长制药	700	11,060.00	0.00
349	600928	西安银行	2,900	10,469.00	0.00
350	601228	广州港	3,000	10,170.00	0.00
351	601139	深圳燃气	1,400	9,884.00	0.00
352	600129	太极集团	300	7,416.00	0.00
353	600339	中油工程	2,000	7,160.00	0.00
354	600032	浙江新能	900	6,660.00	0.00
355	601158	重庆水务	500	2,450.00	0.00
356	600361	创新新材	400	1,544.00	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	300750	宁德时代	11,500	3,059,000.00	0.28
2	688095	福昕软件	39,951	2,683,109.16	0.25
3	301029	怡合达	103,406	2,556,196.32	0.24
4	300682	朗新集团	202,950	2,475,990.00	0.23
5	601899	紫金矿业	163,700	2,475,144.00	0.23
6	000933	神火股份	139,900	2,364,310.00	0.22
7	300627	华测导航	55,400	2,315,720.00	0.22
8	600887	伊利股份	71,800	2,166,924.00	0.20
9	603508	思维列控	90,000	2,140,200.00	0.20
10	600066	宇通客车	80,882	2,133,667.16	0.20
11	002791	坚朗五金	91,688	2,084,985.12	0.19
12	688550	瑞联新材	62,406	1,952,683.74	0.18
13	002212	天融信	302,200	1,949,190.00	0.18
14	688372	伟测科技	33,200	1,942,864.00	0.18
15	300433	蓝思科技	87,100	1,907,490.00	0.18
16	002151	北斗星通	70,700	1,876,378.00	0.17
17	601058	赛轮轮胎	127,100	1,821,343.00	0.17
18	300643	万通智控	147,500	1,764,100.00	0.16
19	300790	宇瞳光学	90,000	1,718,100.00	0.16
20	603966	法兰泰克	219,900	1,697,628.00	0.16
21	002091	江苏国泰	231,700	1,696,044.00	0.16
22	601318	中国平安	31,500	1,658,475.00	0.15
23	688779	五矿新能	311,024	1,654,647.68	0.15
24	300079	数码视讯	303,800	1,643,558.00	0.15
25	300253	卫宁健康	229,200	1,641,072.00	0.15
26	600315	上海家化	95,900	1,621,669.00	0.15
27	688388	嘉元科技	109,200	1,608,516.00	0.15
28	002466	天齐锂业	47,800	1,577,400.00	0.15

29	688141	杰华特	50,700	1,551,927.00	0.14
30	600741	华域汽车	87,400	1,539,114.00	0.14
31	002648	卫星化学	80,900	1,520,111.00	0.14
32	300298	三诺生物	58,200	1,502,142.00	0.14
33	688233	神工股份	63,063	1,478,827.35	0.14
34	300806	斯迪克	113,200	1,465,940.00	0.14
35	000963	华东医药	40,800	1,411,680.00	0.13
36	300696	爱乐达	90,700	1,408,571.00	0.13
37	600420	国药现代	116,900	1,395,786.00	0.13
38	002073	软控股份	167,800	1,386,028.00	0.13
39	002068	黑猫股份	128,900	1,371,496.00	0.13
40	300286	安科瑞	65,100	1,337,805.00	0.12
41	601901	方正证券	158,600	1,321,138.00	0.12
42	000951	中国重汽	74,000	1,256,520.00	0.12
43	301327	华宝新能	16,300	1,250,373.00	0.12
44	300624	万兴科技	19,800	1,250,370.00	0.12
45	600710	苏美达	132,800	1,235,040.00	0.11
46	300661	圣邦股份	15,100	1,234,878.00	0.11
47	000999	华润三九	27,700	1,228,218.00	0.11
48	601699	潞安环能	85,100	1,222,036.00	0.11
49	600861	北京人力	63,100	1,220,985.00	0.11
50	002967	广电计量	73,200	1,200,480.00	0.11
51	601881	中国银河	78,100	1,189,463.00	0.11
52	603612	索通发展	86,900	1,174,019.00	0.11
53	300124	汇川技术	20,000	1,171,600.00	0.11
54	600120	浙江东方	250,800	1,168,728.00	0.11
55	600037	歌华有线	153,300	1,143,618.00	0.11
56	601012	隆基绿能	70,300	1,104,413.00	0.10
57	688270	臻镭科技	31,500	1,102,500.00	0.10
58	002371	北方华创	2,800	1,094,800.00	0.10
59	601688	华泰证券	62,000	1,090,580.00	0.10
60	601702	华峰铝业	59,100	1,082,712.00	0.10
61	300132	青松股份	211,200	1,041,216.00	0.10
62	600019	宝钢股份	147,800	1,034,600.00	0.10
63	601136	首创证券	47,000	1,034,000.00	0.10
64	600648	外高桥	86,800	1,033,788.00	0.10
65	000975	山金国际	65,600	1,008,272.00	0.09
66	600113	浙江东日	71,200	991,104.00	0.09
67	688209	英集芯	55,100	973,617.00	0.09
68	603799	华友钴业	32,800	959,728.00	0.09
69	300777	中简科技	33,700	953,373.00	0.09
70	300741	华宝股份	52,900	919,931.00	0.09
71	600064	南京高科	116,900	908,313.00	0.08

72	300485	赛升药业	128,600	901,486.00	0.08
73	300059	东方财富	34,600	893,372.00	0.08
74	002001	新 和 成	40,500	889,785.00	0.08
75	601989	中国重工	183,100	880,711.00	0.08
76	600460	士兰微	33,600	874,272.00	0.08
77	002030	达安基因	153,000	869,040.00	0.08
78	688020	方邦股份	24,500	866,075.00	0.08
79	300409	道氏技术	62,800	854,708.00	0.08
80	603259	药明康德	15,000	825,600.00	0.08
81	688200	华峰测控	7,726	807,367.00	0.08
82	000517	荣安地产	361,100	805,253.00	0.07
83	300394	天孚通信	8,720	796,659.20	0.07
84	600522	中天科技	55,500	794,760.00	0.07
85	688063	派能科技	19,765	791,588.25	0.07
86	000651	格力电器	17,400	790,830.00	0.07
87	000682	东方电子	73,700	789,327.00	0.07
88	001309	德明利	9,000	784,800.00	0.07
89	300855	图南股份	35,400	775,968.00	0.07
90	601319	中国人保	101,400	772,668.00	0.07
91	601336	新华保险	15,500	770,350.00	0.07
92	605365	立达信	48,900	767,730.00	0.07
93	002028	思源电气	10,500	763,350.00	0.07
94	601377	兴业证券	121,800	762,468.00	0.07
95	603158	腾龙股份	94,200	761,136.00	0.07
96	600649	城投控股	170,800	760,060.00	0.07
97	600163	中闽能源	122,700	747,243.00	0.07
98	300428	立中集团	45,100	735,130.00	0.07
99	601877	正泰电器	31,300	732,733.00	0.07
100	600085	同仁堂	17,800	722,502.00	0.07
101	300620	光库科技	14,800	719,280.00	0.07
102	603317	天味食品	53,876	718,705.84	0.07
103	600718	东软集团	66,300	714,051.00	0.07
104	600827	百联股份	63,900	698,427.00	0.06
105	000776	广发证券	42,900	695,409.00	0.06
106	600216	浙江医药	42,400	672,464.00	0.06
107	601211	国泰君安	35,800	667,670.00	0.06
108	300366	创意信息	71,500	664,950.00	0.06
109	688176	亚虹医药	97,482	661,902.78	0.06
110	600320	振华重工	165,100	647,192.00	0.06
111	601601	中国太保	18,700	637,296.00	0.06
112	688700	东威科技	21,600	636,336.00	0.06
113	603533	掌阅科技	31,200	633,672.00	0.06
114	600639	浦东金桥	56,700	629,370.00	0.06

115	300598	诚迈科技	13,000	629,200.00	0.06
116	000528	柳 工	52,100	628,326.00	0.06
117	002594	比亚迪	2,200	621,852.00	0.06
118	002651	利君股份	84,100	616,453.00	0.06
119	002180	纳思达	21,600	608,472.00	0.06
120	603214	爱婴室	26,100	588,816.00	0.05
121	600183	生益科技	24,000	577,200.00	0.05
122	000417	合百集团	89,300	569,734.00	0.05
123	002237	恒邦股份	56,200	567,620.00	0.05
124	002250	联化科技	102,700	565,877.00	0.05
125	300170	汉得信息	44,600	553,040.00	0.05
126	603055	台华新材	49,900	552,892.00	0.05
127	002928	华夏航空	69,600	540,096.00	0.05
128	603676	卫信康	54,100	538,295.00	0.05
129	002550	千红制药	86,700	537,540.00	0.05
130	600641	万业企业	36,500	533,630.00	0.05
131	000035	中国天楹	108,900	530,343.00	0.05
132	002446	盛路通信	79,200	518,760.00	0.05
133	300458	全志科技	13,300	515,508.00	0.05
134	601059	信达证券	34,200	512,316.00	0.05
135	300986	志特新材	41,826	507,767.64	0.05
136	002612	朗姿股份	30,800	503,888.00	0.05
137	002891	中宠股份	14,100	503,370.00	0.05
138	002938	鹏鼎控股	13,600	496,128.00	0.05
139	000049	德赛电池	20,400	479,604.00	0.04
140	000415	渤海租赁	122,500	461,825.00	0.04
141	300257	开山股份	48,400	441,408.00	0.04
142	601127	赛力斯	3,200	426,848.00	0.04
143	000547	航天发展	58,300	426,173.00	0.04
144	600557	康缘药业	31,200	424,944.00	0.04
145	000029	深深房 A	27,700	417,162.00	0.04
146	002023	海特高新	40,400	410,060.00	0.04
147	002459	晶澳科技	29,400	404,250.00	0.04
148	000725	京东方 A	90,000	395,100.00	0.04
149	300672	国科微	5,900	393,825.00	0.04
150	002992	宝明科技	6,200	388,120.00	0.04
151	600055	万东医疗	24,900	375,990.00	0.03
152	300659	中孚信息	23,200	375,608.00	0.03
153	688300	联瑞新材	5,700	367,080.00	0.03
154	300660	江苏雷利	9,600	366,912.00	0.03
155	688369	致远互联	17,800	357,246.00	0.03
156	600559	老白干酒	16,700	350,533.00	0.03
157	300779	惠城环保	3,500	341,600.00	0.03

158	601628	中国人寿	8,100	339,552.00	0.03
159	688023	安恒信息	8,300	338,640.00	0.03
160	002912	中新赛克	13,200	337,788.00	0.03
161	600219	南山铝业	85,300	333,523.00	0.03
162	300740	水羊股份	24,700	326,534.00	0.03
163	603678	火炬电子	10,600	323,300.00	0.03
164	688008	澜起科技	4,693	318,654.70	0.03
165	002284	亚太股份	39,900	308,826.00	0.03
166	600237	铜峰电子	46,700	305,885.00	0.03
167	002050	三花智控	13,000	305,630.00	0.03
168	300772	运达股份	22,724	300,865.76	0.03
169	605333	沪光股份	9,200	300,196.00	0.03
170	300274	阳光电源	4,000	295,320.00	0.03
171	301050	雷电微力	5,600	288,848.00	0.03
172	688598	金博股份	13,700	288,522.00	0.03
173	603067	振华股份	22,700	286,701.00	0.03
174	001914	招商积余	26,300	277,991.00	0.03
175	688152	麒麟信安	5,200	270,608.00	0.03
176	603171	税友股份	8,600	262,300.00	0.02
177	300633	开立医疗	8,900	261,571.00	0.02
178	601137	博威合金	12,600	255,780.00	0.02
179	300048	合康新能	50,600	255,024.00	0.02
180	300244	迪安诊断	22,300	253,105.00	0.02
181	300415	伊之密	12,600	252,756.00	0.02
182	688107	安路科技	8,500	251,430.00	0.02
183	688275	万润新能	5,200	251,316.00	0.02
184	688048	长光华芯	6,200	241,738.00	0.02
185	000156	华数传媒	33,200	239,040.00	0.02
186	000758	中色股份	47,100	232,674.00	0.02
187	600491	龙元建设	60,900	227,766.00	0.02
188	688208	道通科技	5,755	225,365.80	0.02
189	688636	智明达	7,900	221,990.00	0.02
190	688259	创耀科技	6,300	221,193.00	0.02
191	600027	华电国际	39,400	221,034.00	0.02
192	688508	芯朋微	5,100	219,147.00	0.02
193	600562	国睿科技	10,800	215,244.00	0.02
194	000766	通化金马	13,200	207,240.00	0.02
195	301153	中科江南	7,300	203,962.00	0.02
196	300045	华力创通	9,700	202,633.00	0.02
197	301511	德福科技	16,100	202,216.00	0.02
198	600640	国脉文化	16,800	200,592.00	0.02
199	600266	城建发展	38,900	198,390.00	0.02
200	601939	建设银行	22,445	197,291.55	0.02

201	688083	中望软件	2,300	196,811.00	0.02
202	600584	长电科技	4,800	196,128.00	0.02
203	688201	信安世纪	22,100	195,143.00	0.02
204	601698	中国卫通	9,300	189,720.00	0.02
205	600662	外服控股	37,100	188,097.00	0.02
206	300813	泰林生物	10,000	172,700.00	0.02
207	603727	博迈科	14,800	169,904.00	0.02
208	300438	鹏辉能源	5,900	165,849.00	0.02
209	300662	科锐国际	7,800	164,268.00	0.02
210	603530	神马电力	6,600	163,086.00	0.02
211	000550	江铃汽车	6,900	161,805.00	0.02
212	688348	昱能科技	3,283	160,210.40	0.01
213	688019	安集科技	1,100	153,296.00	0.01
214	603258	电魂网络	7,600	151,164.00	0.01
215	002396	星网锐捷	7,800	148,122.00	0.01
216	688009	中国通号	23,602	147,748.52	0.01
217	600246	万通发展	19,800	147,510.00	0.01
218	688519	南亚新材	6,600	140,316.00	0.01
219	600446	金证股份	8,100	139,644.00	0.01
220	301217	铜冠铜箔	12,500	138,500.00	0.01
221	003012	东鹏控股	20,700	136,827.00	0.01
222	688668	鼎通科技	2,746	128,677.56	0.01
223	002475	立讯精密	3,100	126,356.00	0.01
224	600428	中远海特	17,200	125,560.00	0.01
225	000498	山东路桥	21,000	124,950.00	0.01
226	688680	海优新材	3,600	121,608.00	0.01
227	688066	航天宏图	5,900	120,360.00	0.01
228	300766	每日互动	8,100	118,341.00	0.01
229	603766	隆鑫通用	13,000	118,300.00	0.01
230	300203	聚光科技	7,700	117,271.00	0.01
231	601229	上海银行	12,800	117,120.00	0.01
232	600702	舍得酒业	1,700	112,081.00	0.01
233	688378	奥来德	4,900	111,769.00	0.01
234	605589	圣泉集团	4,700	110,826.00	0.01
235	688313	仕佳光子	6,700	109,813.00	0.01
236	300360	炬华科技	6,500	109,005.00	0.01
237	002518	科士达	4,800	108,144.00	0.01
238	002773	康弘药业	5,500	107,800.00	0.01
239	601279	英利汽车	27,500	105,325.00	0.01
240	603186	华正新材	4,300	103,587.00	0.01
241	688326	经纬恒润	1,143	96,126.30	0.01
242	603501	韦尔股份	900	93,969.00	0.01
243	300685	艾德生物	3,900	88,920.00	0.01

244	688206	概伦电子	4,700	88,877.00	0.01
245	601607	上海医药	4,200	88,200.00	0.01
246	300408	三环集团	2,200	84,722.00	0.01
247	300131	英唐智控	10,400	84,344.00	0.01
248	002536	飞龙股份	6,900	79,902.00	0.01
249	300015	爱尔眼科	6,000	79,500.00	0.01
250	688155	先惠技术	2,000	75,880.00	0.01
251	300308	中际旭创	600	74,106.00	0.01
252	000710	贝瑞基因	8,700	73,515.00	0.01
253	300656	民德电子	2,900	72,152.00	0.01
254	688371	菲沃泰	4,339	67,341.28	0.01
255	603308	应流股份	4,700	66,270.00	0.01
256	300918	南山智尚	6,300	64,953.00	0.01
257	600537	亿晶光电	20,700	63,549.00	0.01
258	300014	亿纬锂能	1,300	60,762.00	0.01
259	600533	栖霞建设	25,800	60,372.00	0.01
260	300531	优博讯	4,300	59,985.00	0.01
261	600058	五矿发展	7,900	56,248.00	0.01
262	600651	飞乐音响	12,700	52,578.00	0.00
263	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.00
264	603538	美诺华	3,400	43,214.00	0.00
265	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00
266	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.00
267	688015	交控科技	2,000	39,660.00	0.00
268	603005	晶方科技	1,400	39,550.00	0.00
269	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
270	688012	中微公司	200	37,832.00	0.00
271	001391	国货航	4,686	31,864.80	0.00
272	600248	陕建股份	6,900	30,912.00	0.00
273	688381	帝奥微	1,600	30,848.00	0.00
274	688082	盛美上海	300	30,000.00	0.00
275	688596	正帆科技	826	29,364.30	0.00
276	300475	香农芯创	1,000	28,490.00	0.00
277	688630	芯碁微装	491	28,340.52	0.00
278	300130	新国都	1,300	28,158.00	0.00
279	603690	至纯科技	1,120	28,123.20	0.00
280	688037	芯源微	334	27,932.42	0.00
281	002158	汉钟精机	1,500	27,780.00	0.00
281	300666	江丰电子	400	27,780.00	0.00
282	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
283	300820	英杰电气	500	27,625.00	0.00
284	688687	凯因科技	1,200	25,896.00	0.00
285	688319	欧林生物	2,400	25,440.00	0.00

286	000025	特力A	1,200	19,824.00	0.00
287	688380	中微半导	600	17,940.00	0.00
288	688631	莱斯信息	200	17,418.00	0.00
289	605305	中际联合	600	16,998.00	0.00
290	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
291	003009	中天火箭	400	15,600.00	0.00
292	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
293	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
294	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
295	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
296	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
297	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
298	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
299	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
300	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
301	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
302	605117	德业股份	100	8,480.00	0.00
303	600362	江西铜业	400	8,256.00	0.00
304	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
305	688557	兰剑智能	400	7,668.00	0.00
306	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
307	002010	传化智联	1,600	7,248.00	0.00
308	688131	皓元医药	200	7,140.00	0.00
309	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
310	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
311	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
312	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
313	603285	键邦股份	129	2,916.69	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	000933	神火股份	36,376,054.00	3.04
2	300866	安克创新	29,829,626.01	2.50
3	300502	新易盛	28,434,707.00	2.38
4	002384	东山精密	28,426,849.00	2.38
5	601058	赛轮轮胎	28,205,561.00	2.36
6	600566	济川药业	26,146,195.00	2.19
7	601233	桐昆股份	25,307,201.12	2.12
8	600873	梅花生物	25,245,508.00	2.11
9	603185	弘元绿能	25,227,797.04	2.11
10	300207	欣旺达	24,829,468.00	2.08

11	300529	健帆生物	24,439,316.00	2.05
12	600096	云天化	24,240,494.20	2.03
13	002465	海格通信	23,759,021.00	1.99
14	002444	巨星科技	23,603,431.00	1.98
15	600418	江淮汽车	23,564,475.00	1.97
16	002273	水晶光电	23,557,775.00	1.97
17	300394	天孚通信	23,443,075.72	1.96
18	600143	金发科技	23,401,525.00	1.96
19	000783	长江证券	23,006,248.00	1.93
20	000630	铜陵有色	22,849,811.00	1.91

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	000933	神火股份	36,027,572.00	3.02
2	601058	赛轮轮胎	33,384,583.76	2.79
3	300502	新易盛	33,035,077.00	2.76
4	600066	宇通客车	32,014,606.26	2.68
5	601168	西部矿业	30,414,673.00	2.55
6	000630	铜陵有色	29,703,341.00	2.49
7	600529	山东药玻	29,543,203.80	2.47
8	300394	天孚通信	29,412,731.08	2.46
9	603185	弘元绿能	29,216,815.01	2.45
10	002384	东山精密	27,962,992.00	2.34
11	000830	鲁西化工	27,582,645.00	2.31
12	600765	中航重机	27,435,319.00	2.30
13	002273	水晶光电	26,389,386.81	2.21
14	600909	华安证券	26,198,396.00	2.19
15	600901	江苏金租	25,948,747.00	2.17
16	601128	常熟银行	25,876,174.00	2.17
17	300383	光环新网	25,733,674.00	2.15
18	002625	光启技术	25,717,030.00	2.15
19	601233	桐昆股份	25,562,393.76	2.14
20	600873	梅花生物	25,557,378.00	2.14
21	600862	中航高科	25,351,526.53	2.12
22	002422	科伦药业	25,178,657.00	2.11
23	600566	济川药业	25,091,067.00	2.10
24	300866	安克创新	24,891,871.80	2.08
25	300285	国瓷材料	24,777,259.36	2.07
26	002683	广东宏大	24,636,941.00	2.06
27	000997	新大陆	24,429,719.00	2.04
28	600062	华润双鹤	24,428,464.74	2.04

29	600580	卧龙电驱	24,254,782.82	2.03
30	002008	大族激光	24,109,821.00	2.02
31	600985	淮北矿业	24,088,462.00	2.02

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	7,334,149,492.59
卖出股票收入（成交）总额	7,537,012,740.39

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	4,031,046.58	0.37
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	4,031,046.58	0.37

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	40,000	4,031,046.58	0.37

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

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,777,362.79
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	211,001.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,988,364.60

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 中证 500 指数增强 A	48,618	14,019.91	291,781,021.88	42.81	389,838,851.07	57.19
景顺长城 中证 500 指数增强 C	1,612	74,917.52	112,822,441.64	93.42	7,944,606.62	6.58
合计	50,230	15,974.26	404,603,463.52	50.42	397,783,457.69	49.58

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 500 指数增强 A	123,663.44	0.018143
	景顺长城中证 500 指数增强 C	20.27	0.000017
	合计	123,683.71	0.015414

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持有本开放式基金	景顺长城中证 500 指数增强 A	—
	景顺长城中证 500 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 500 指数增强 A	10~50
	景顺长城中证 500 指数增强 C	-
	合计	10~50

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 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C
基金合同生效日 (2019 年 3 月 25 日) 基金份额总额	1,508,879,568.71	-
本报告期期初基金份 额总额	951,133,966.87	2,665,166.33
本报告期基金总申购 份额	255,432,862.44	161,761,760.20
减：本报告期基金总 赎回份额	524,946,956.36	43,659,878.27
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	681,619,872.95	120,767,048.26

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：

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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 6 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 65,000.00 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员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 (%)	
华泰证券股份有限公司	1	2,797,227,072.08	18.81	1,328,599.13	15.35	未变更
长城证券股份有限公司	3	1,808,604,097.07	12.16	498,657.93	5.76	未变更
中信证券股份有限公司	4	1,332,694,919.10	8.96	259,901.40	3.00	未变更
招商证券股份有限公司	2	1,303,072,348.18	8.76	1,232,569.47	14.24	未变更
中泰证券股份有限公司	1	1,302,505,785.80	8.76	371,640.40	4.29	未变更
中国银河证券股份	1	1,271,710,556.46	8.55	619,160.60	7.15	未变更

有限公司						
东方证券股份有限公司	2	928,874,933.33	6.25	878,624.21	10.15	未变更
德邦证券股份有限公司	1	834,880,644.07	5.62	789,727.43	9.12	未变更
海通证券股份有限公司	2	611,761,905.86	4.11	578,667.72	6.68	未变更
中国国际金融股份有限公司	1	609,680,781.20	4.10	489,586.33	5.66	未变更
华西证券股份有限公司	1	597,958,789.85	4.02	565,617.63	6.53	未变更
浙商证券股份有限公司	1	550,372,757.27	3.70	520,601.18	6.01	未变更
平安证券股份有限公司	1	461,013,462.52	3.10	89,898.02	1.04	未变更
国盛证券有限责任公司	1	259,464,973.23	1.75	245,413.57	2.84	未变更
信达证券股份有限公司	1	120,714,785.94	0.81	114,184.88	1.32	未变更
广发证券股份有限公司	2	77,645,742.57	0.52	73,445.46	0.85	未变更
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
华宝证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个

中信建投 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 (%)
华泰证 券股份 有限公司	3,999,840.00	94.73	-	-	-	-
长城证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证 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	-	-	-	-	-	-
中国银 河证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
东方证 券股份 有限公	-	-	-	-	-	-

司						
德邦证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
海通证 券股份 有限公 司	222, 510. 62	5. 27	-	-	-	-
中国国 际金融 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
华西证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
浙商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
平安证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国盛证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
信达证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
广发证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东吴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东兴证 券股份 有限公	-	-	-	-	-	-

司						
华宝证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华福证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券 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 500 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
5	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
6	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
7	景顺长城中证 500 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
8	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
9	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
10	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
11	景顺长城中证 500 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
12	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
13	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
14	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资	中国证监会指定报刊及	2024 年 6 月 14 日

	资基金基金产品资料概要更新	网站	
15	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
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 6 月 29 日
17	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
18	景顺长城中证 500 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
19	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
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 7 月 22 日
21	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
22	景顺长城中证 500 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
23	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
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
27	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
28	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
29	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
30	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
31	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
32	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
33	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	
34	景顺长城中证 500 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
35	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
36	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
37	景顺长城中证 500 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
38	景顺长城中证 500 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
39	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	20240101-20241027;20241119-20241231	354,322,713.06	177,445,330.48	354,322,713.06	177,445,330.48	22.11
	2	20241028-20241118	29,819,021.28	124,238,251.86	0.00	154,057,273.14	19.20
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险： 1、大额申购风险 在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。 2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险： （1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险； （2）如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响； （3）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平； （4）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动； （5）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略； （6）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。							

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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 500 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 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证 500 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