

景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金

2025 年年度报告

2025 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 27 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 25 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 2025 年 7 月 17 日（基金合同生效日）起至 2025 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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、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	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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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	16
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	21
7.4 报表附注	23

§ 8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	70
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	70
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	70
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	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	70
§ 9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
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	72
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	72
§ 10 开放式基金份额变动	73
§ 11 重大事件揭示	73
11.1 基金份额持有人大会决议	73
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	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4 基金投资策略的改变	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8 其他重大事件	75
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	76
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	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§ 13 备查文件目录	77
13.1 备查文件目录	77
13.2 存放地点	77
13.3 查阅方式	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	景顺长城中证 A500 指数增强	
基金主代码	023957	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 7 月 17 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	60,620,597.04 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 A500 指数增强 A	景顺长城中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023957	023958
报告期末下属分级基金的份额总额	23,400,032.83 份	37,220,564.21 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要包括：</p> <p>（一）资产配置策略</p> <p>本基金为指数基金，股票投资比例范围为基金资产的 80%-95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。</p> <p>1、指数化被动投资策略</p> <p>指数化被动投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出相应调整，力争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%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>2、量化增强策略</p> <p>本基金主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，优选个股产出投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。</p>

3、本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整，但并不保证能因此避免该成份证券对本基金基金财产的影响。

4、本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

（三）债券投资策略

债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。

（四）股指期货投资策略

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

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

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

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

（五）国债期货投资策略

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

（六）股票期权投资策略

本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他股票期权品种，本基金将在履行适当程序后，纳入投资范围并制定相应投资策略。

（七）资产支持证券投资策略

本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

（八）参与融资及转融通证券出借业务的投资策略

本基金参与融资业务将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束，合理利用融资发掘可能的增值机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，对冲系统性风险，实现保值和锁定收益。

	<p>(九) 信用衍生品投资策略</p> <p>本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。同时，本基金将加强基金投资信用衍生品的交易对手方、创设机构的风险管理，合理分散交易对手方、创设机构的集中度，对交易对手方、创设机构的财务状况、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。</p>
业绩比较基准	中证 A500 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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	朱萍
	联系电话	0755-82370388	021-31888888
	电子邮箱	investor@igwfm.com	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		4008888606	95528
传真		0755-22381339	021-63602540
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	上海市中山东一路 12 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	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		518048	200126
法定代表人		叶才	张为忠

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	2025 年 7 月 17 日(基金合同生效日)-2025 年 12 月 31 日	
	景顺长城中证 A500 指数增强 A	景顺长城中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	14,927,972.38	22,624,990.11
本期利润	16,731,105.85	23,998,235.94
加权平均基金份额本期利润	0.2797	0.2699
本期加权平均净值利润率	25.87%	24.90%
本期基金份额净值增长率	18.72%	18.61%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	
期末可供分配利润	4,381,233.27	6,928,173.31
期末可供分配基金份额利润	0.1872	0.1861
期末基金资产净值	27,781,266.10	44,148,737.52
期末基金份额净值	1.1872	1.1861
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	
基金份额累计净值增长率	18.72%	18.61%

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。

5、本基金基金合同生效日为 2025 年 07 月 17 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城中证 A500 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	2.19%	0.97%	0.43%	1.00%	1.76%	-0.03%
自基金合同生效起至今	18.72%	0.96%	18.84%	0.99%	-0.12%	-0.03%

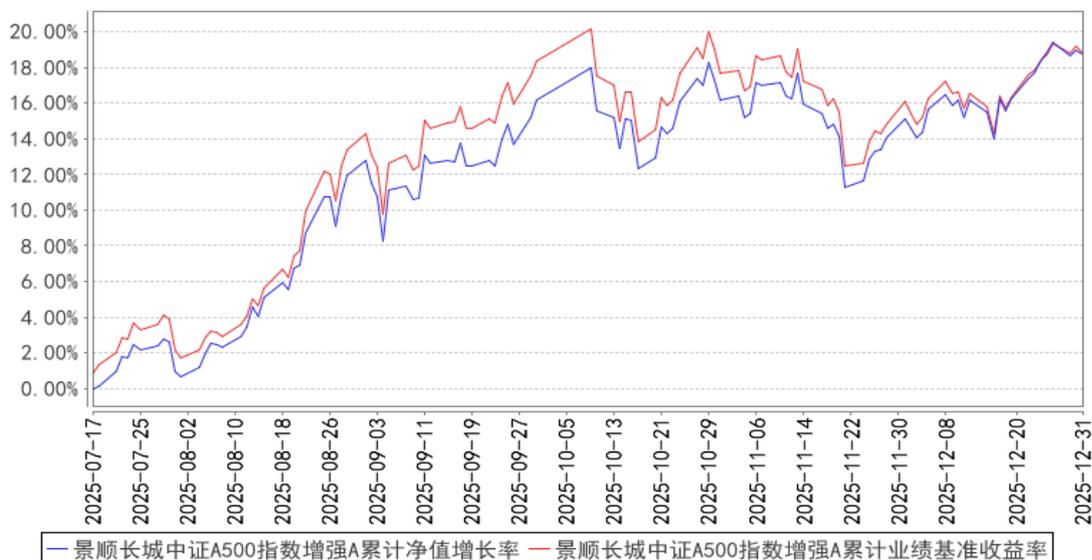
景顺长城中证 A500 指数增强 C

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	2.14%	0.97%	0.43%	1.00%	1.71%	-0.03%

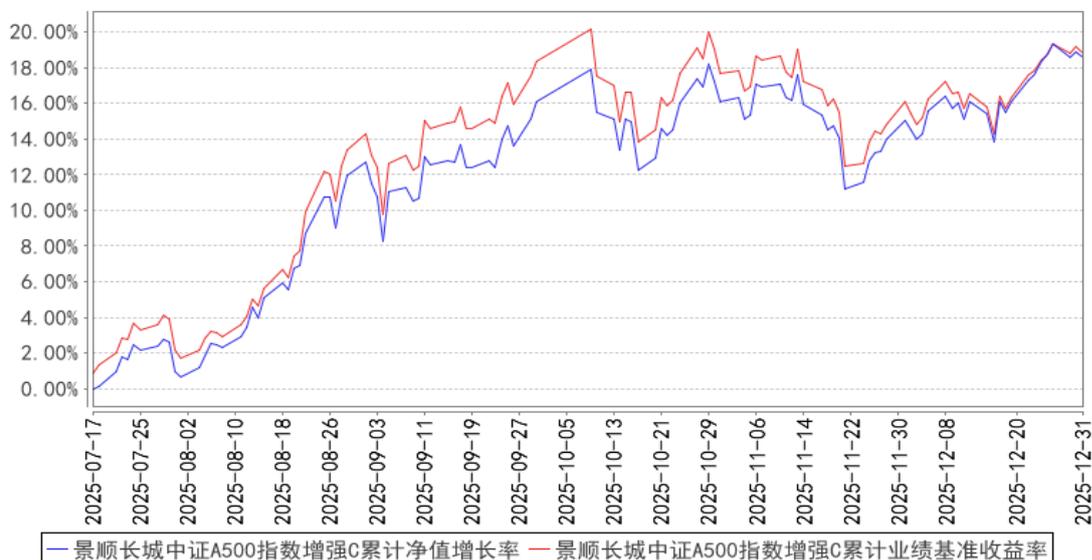
自基金合同生效起至今	18.61%	0.96%	18.84%	0.99%	-0.23%	-0.03%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

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A500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A500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

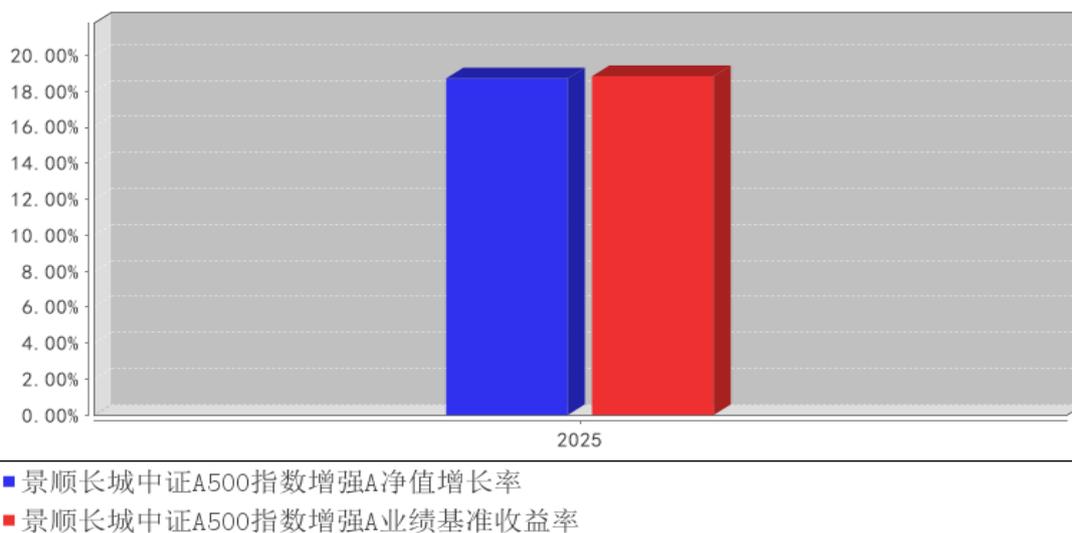


注：基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自 2025 年 7 月 17 日基金合同生效日起 6 个月。截至本报告

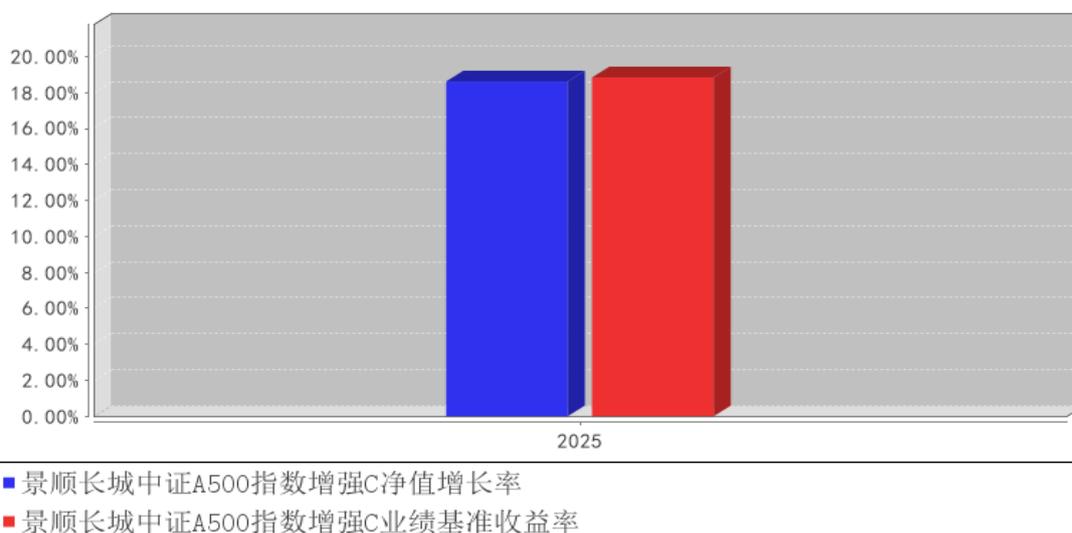
期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2025 年 7 月 17 日）起至本报告期末不满一年。

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

景顺长城中证A500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A500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：2025 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间为 2025 年 07 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2025年07月17日（基金合同生效日）至本报告期末未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII等业务资格，截至2025年12月31日，本公司旗下共管理210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		
徐喻军	本基金的基金经理	2025年7月17日	-	15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15年证券、基金行业从业经验。
黎海威	本基金的基金经理	2025年7月17日	-	22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22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 A500 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责任公司公平交易指引》,该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下:

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

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

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度,将投资管理职能和交易执行职能相隔离;建立公平的交易分配机

制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

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

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

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，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 25 次，为公司旗下的指数量化投资组合与其他组合因投资策略需要而发生的同日反向交易，或为公司管理的投资组合与公司担任投资顾问的 MOM 组合因投资策略不同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 2025 年，国内经济总体保持平稳运行，出口的韧性远超市场预期，展现出我国强劲的产业竞争力。从数据来看，2025 年全年 GDP 增长 5.0%，出口全年实现 5.5% 的增速，出口依然是经济增长的重要引擎。2025 年 10 月至 12 月国内制造业 PMI 依次为 49、49.2、50.1，制造业景气度持续改善，2026 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。2026 年 1 月 CPI 同比上涨 0.20%，环比上涨 0.20%，PPI 同比下滑 1.40%，环比上涨 0.40%，价格水平的改善有望支撑企业盈利回暖。2026 年 1 月 M1 同比增长 4.90%，M2 同比增长 9.0%，流动性环境改善为经济复苏提供了支撑。2025 年 A 股市场呈现震荡向上格局，风格上成长优于价值，上证指数上涨 18.41%，沪深 300 指数和创业板指数分别上涨 17.66% 和 49.57%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 18.72%，业绩比较基准收益率为 18.84%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 18.61%，业绩比较基准收益率为 18.84%。

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，2026 年作为“十五五”规划的开局之年，期待国内政策发力，叠加欧美日韩财政共振，以及联储降息带动全球金融条件的进一步放松，我们认为 2026 年实现经济开门红概率较高。随着“反内卷”政策的推进以及需求的逐步回升，价格水平有望得到修复，企业盈利也将进一步改善；在经济新旧动能转换的过程中，新质生产力相关产业有望迎来快速发展，权益市场依然具有较多结构性的投资机会。相对宽松的流动性环境，市场层面相对分散的结构化行情，这对于我们量化选股模型是相对有利的。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 A500 指数为基准的指数增强基金，从基准的角度来看，中证 A500 指数汇聚了国内各行业的头部企业，行业分布更加均匀，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续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽

职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现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

本报告期内，由景顺长城基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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（2026）审字第 70015711_B95 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的景顺长城中证 A500 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 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于景顺长城中证 A500 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。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金管理层对其他

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

	<p>我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	张武	郭劲扬
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2026 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	4,433,901.96
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	67,684,342.35
其中：股票投资		67,684,342.35
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	7.4.7.6	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		612,863.49

递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		72,731,107.80
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		651,104.69
应付管理人报酬		50,864.56
应付托管费		9,537.14
应付销售服务费		7,597.79
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	82,000.00
负债合计		801,104.18
净资产:		
实收基金	7.4.7.10	60,620,597.04
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	11,309,406.58
净资产合计		71,930,003.62
负债和净资产总计		72,731,107.80

注：1、报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 60,620,597.04 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 1.1872 元，基金份额 23,400,032.83 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.1861 元，基金份额 37,220,564.21 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2025 年 07 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年7月17日（基金合同生效日）至 2025年12月31日
一、营业总收入		41,580,916.84

1. 利息收入		19,917.89
其中：存款利息收入	7.4.7.13	19,917.89
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）		38,380,034.47
其中：股票投资收益	7.4.7.14	37,384,402.87
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	477.49
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-
股利收益	7.4.7.19	995,154.11
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	3,176,379.30
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	4,585.18
减：二、营业总支出		851,575.05
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	575,103.91
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	107,831.99
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	86,237.41
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.23	82,401.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		40,729,341.79
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		40,729,341.79
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		40,729,341.79

7.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	307,709,649.74	-	-	307,709,649.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-247,089,052.70	-	11,309,406.58	-235,779,646.12
（一）、综合收益总额	-	-	40,729,341.79	40,729,341.79
（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）	-247,089,052.70	-	-29,419,935.21	-276,508,987.91
其中：1. 基金申购款	24,267,548.21	-	3,434,453.35	27,702,001.56
2. 基金赎回款	-271,356,600.91	-	-32,854,388.56	-304,210,989.47
（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	60,620,597.04	-	11,309,406.58	71,930,003.62

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 A500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]594 号《关于准予景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 307,635,731.17 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2025）验字第 70015711_H13 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 7 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 307,709,649.74 份基金份额，其中认购资金利息折合 73,918.57 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》和《景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用，且不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产净值中计提销售服务，但不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证，下同），此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金将根据法律法规的规定参与转融

通证券出借及融资业务。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份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、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 A500 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 2026 年 3 月 25 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2025 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确

定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、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。

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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 2025年12月31日
活期存款	1,421,037.20
等于：本金	1,420,844.96
加：应计利息	192.24
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	3,012,864.76
等于：本金	3,012,784.35
加：应计利息	80.41
减：坏账准备	-
合计	4,433,901.96

注：其他存款为存放在证券经纪商经纪专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	64,507,963.05	-	67,684,342.35	3,176,379.30
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	64,507,963.05	-	67,684,342.35	3,176,379.30

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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资**7.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

7.4.7.6 其他债权投资**7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

7.4.7.7 其他权益工具投资**7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	82,000.00
合计	82,000.00

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城中证 A500 指数增强 A

项目	本期 2025 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	127,487,069.76	127,487,069.76
本期申购	7,225,479.72	7,225,479.72
本期赎回（以“-”号填列）	-111,312,516.65	-111,312,516.65
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	23,400,032.83	23,400,032.83

景顺长城中证 A500 指数增强 C

项目	本期 2025 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	180,222,579.98	180,222,579.98
本期申购	17,042,068.49	17,042,068.49
本期赎回（以“-”号填列）	-160,044,084.26	-160,044,084.26
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	37,220,564.21	37,220,564.21

注：（1）申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

（2）本基金合同于 2025 年 7 月 17 日生效。首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 307,635,731.17 元，折合 307,635,731.17 份基金份额（其中 A 类基金份额 127,449,380.08 份，C 类基金份额 180,186,351.09 份）；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 73,918.57 元，折合 73,918.57 份基金份额（其中 A 类基金份额 37,689.68 份，C 类基金份额 36,228.89 份）。以上收到的实收基金共计人民币 307,709,649.74 元，折合 307,709,649.74 份基金份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城中证 A500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	14,927,972.38	1,803,133.47	16,731,105.85
本期基金份额交易产生的变动数	-8,700,499.71	-3,649,372.87	-12,349,872.58
其中：基金申购款	1,350,040.56	-304,386.54	1,045,654.02
基金赎回款	-10,050,540.27	-3,344,986.33	-13,395,526.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,227,472.67	-1,846,239.40	4,381,233.27

景顺长城中证 A500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	22,624,990.11	1,373,245.83	23,998,235.94
本期基金份额交易产生的变动数	-12,761,632.49	-4,308,430.14	-17,070,062.63
其中：基金申购款	3,107,760.39	-718,961.06	2,388,799.33
基金赎回款	-15,869,392.88	-3,589,469.08	-19,458,861.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,863,357.62	-2,935,184.31	6,928,173.31

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年7月17日（基金合同生效日）至2025年12月31日
活期存款利息收入	15,850.76
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,050.95
结算备付金利息收入	-
其他	16.18
合计	19,917.89

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
	2025年7月17日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	37,384,402.87

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	37,384,402.87

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
	2025年7月17日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出股票成交总额	566,605,065.01
减：卖出股票成本总额	528,643,737.77
减：交易费用	576,924.37
买卖股票差价收入	37,384,402.87

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
	2025年7月17日（基金合同生效日）至2025年12月31日
债券投资收益——利息收入	0.11
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	477.38
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	477.49

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
	2025年7月17日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,477.55
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,000.00
减：应计利息总额	0.11
减：交易费用	0.06
买卖债券差价收入	477.38

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	995,154.11
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	995,154.11

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	3,176,379.30
股票投资	3,176,379.30
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-

权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,176,379.30

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年7月17日（基金合同生效日）至2025 年12月31日
基金赎回费收入	4,582.51
基金转换费收入	2.67
合计	4,585.18

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 2025年7月17日（基金合同生效日）至2025年 12月31日
审计费用	22,000.00
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	-
其他	400.00
存托服务费	1.74
合计	82,401.74

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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	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
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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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

本基金本报告期未有应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年7月17日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	575,103.91
其中：应支付销售机构的客户维护费	278,814.04
应支付基金管理人的净管理费	296,289.87

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年7月17日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	107,831.99

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/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 2025 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 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 A500 指数增强 A	景顺长城中证 A500 指数增强 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	99.92	99.92
浦发银行	-	49,883.60	49,883.60
长城证券	-	-	-
合计	-	49,983.52	49,983.52

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：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期末与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期末与关联方发生转融通证券出借业务交易。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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末运用自有资金投资本基金。

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 2025 年 7 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入

浦发银行-活期	1,421,037.20	15,850.76
---------	--------------	-----------

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有 13,300.00 股浦发银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 151,571.94 元，估值总额为人民币 165,452.00 元，占基金净资产的比例为 0.23%。

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（2025 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
301563	云汉芯城	2025年9月23日	6个月	新股流通受限	27.00	133.69	105	2,835.00	14,037.45	-
301584	建发致新	2025年9月18日	6个月	新股流通受限	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
301668	昊创瑞通	2025年9月15日	6个月	新股流通受限	21.00	44.80	155	3,255.00	6,944.00	-
601026	道生天合	2025年10月9日	6个月	新股流通受限	5.98	14.28	249	1,489.02	3,555.72	-
603092	德力佳	2025年10月30日	6个月	新股流通受限	46.68	55.66	28	1,307.04	1,558.48	-
603175	超颖电子	2025年10月17日	6个月	新股流通受限	17.08	48.56	69	1,178.52	3,350.64	-
603370	华新精科	2025年8月	6个月	新股流通	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-

		27 日		受限						
--	--	------	--	----	--	--	--	--	--	--

注：以上限售证券的实际流通日期以上市公司的公告为准。

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
688012	中微公司	2025 年 12 月 19 日	重大事项停牌	283.76	2026 年 1 月 5 日	278.00	800	204,237.00	227,008.00	-
002049	紫光国微	2025 年 12 月 30 日	重大事项停牌	78.81	2026 年 1 月 15 日	86.69	2,600	212,807.33	204,906.00	-

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 2025 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 2025 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，本基金未持有债券和资产支持证券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025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	4,433,901.96	-	-	-	-	-	4,433,901.96
交易性金融资产	-	-	-	-	-	67,684,342.35	67,684,342.35
应收申购款	-	-	-	-	-	612,863.49	612,863.49
资产总计	4,433,901.96	-	-	-	-	68,297,205.84	72,731,107.80
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	651,104.69	651,104.69
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	50,864.56	50,864.56
应付托管费	-	-	-	-	-	9,537.14	9,537.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,597.79	7,597.79
其他负债	-	-	-	-	-	82,000.00	82,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	801,104.18	801,104.18
利率敏感度缺口	4,433,901.96	-	-	-	-	-	-

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	67,684,342.35	94.10
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	67,684,342.35	94.10

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（2025 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	3,672,186.54
沪深 300 指数下降 5%	-3,672,186.54	

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 2025 年 12 月 31 日
第一层次	67,207,192.82
第二层次	431,914.00
第三层次	45,235.53
合计	67,684,342.35

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 2025年7月17日（基金合同生效日）至2025年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	14,741.13	14,741.13
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	30,494.40	30,494.40
其中：计入损益的利得或损失	-	30,494.40	30,494.40
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	45,235.53	45,235.53
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	-	30,494.40	30,494.40

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	45,235.53	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2086-3.0323	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	67,684,342.35	93.06
	其中：股票	67,684,342.35	93.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,433,901.96	6.10
8	其他各项资产	612,863.49	0.84
9	合计	72,731,107.80	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	40,464.00	0.06
B	采矿业	4,500,194.00	6.26
C	制造业	36,220,763.66	50.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	627,874.00	0.87
E	建筑业	811,354.00	1.13
F	批发和零售业	236,823.00	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	937,374.00	1.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,956,206.19	2.72
J	金融业	7,327,808.00	10.19
K	房地产业	885,462.00	1.23
L	租赁和商务服务业	851,401.00	1.18
M	科学研究和技术服务业	885,890.00	1.23
N	水利、环境和公共设施管理业	215,124.00	0.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	55,496,737.85	77.15

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	12,208.00	0.02
B	采矿业	183,561.00	0.26
C	制造业	7,175,415.52	9.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	678,974.00	0.94
E	建筑业	289,356.00	0.40
F	批发和零售业	231,550.99	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	113,746.00	0.16
H	住宿和餐饮业	36,484.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,196,008.14	1.66
J	金融业	1,473,907.00	2.05
K	房地产业	147,182.00	0.20
L	租赁和商务服务业	75,208.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	486,384.85	0.68
N	水利、环境和公共设施管理业	14,228.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	42,795.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	1,406.00	0.00
S	综合	29,190.00	0.04
	合计	12,187,604.50	16.94

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	300750	宁德时代	5,300	1,946,478.00	2.71
2	600519	贵州茅台	1,400	1,928,052.00	2.68
3	601318	中国平安	26,800	1,833,120.00	2.55
4	300308	中际旭创	2,900	1,769,000.00	2.46
5	601899	紫金矿业	45,800	1,578,726.00	2.19
6	300502	新易盛	3,200	1,378,816.00	1.92

7	600030	中信证券	32,500	933,075.00	1.30
8	600036	招商银行	21,600	909,360.00	1.26
9	601166	兴业银行	40,300	848,718.00	1.18
10	000333	美的集团	10,300	804,945.00	1.12
11	600276	恒瑞医药	12,000	714,840.00	0.99
12	603259	药明康德	7,600	688,864.00	0.96
13	002475	立讯精密	11,800	669,178.00	0.93
14	000338	潍柴动力	30,300	521,160.00	0.72
15	000725	京东方 A	119,000	500,990.00	0.70
16	000792	盐湖股份	16,900	475,904.00	0.66
17	601088	中国神华	11,400	461,700.00	0.64
18	000100	TCL 科技	100,600	456,724.00	0.63
19	600150	中国船舶	13,618	452,934.68	0.63
20	600309	万华化学	5,900	452,412.00	0.63
21	601601	中国太保	10,500	440,055.00	0.61
22	600104	上汽集团	28,300	430,726.00	0.60
23	002558	巨人网络	9,700	419,913.00	0.58
24	600011	华能国际	55,800	416,268.00	0.58
25	688008	澜起科技	3,500	412,300.00	0.57
26	601168	西部矿业	14,800	409,072.00	0.57
27	688981	中芯国际	3,300	405,339.00	0.56
28	002340	格林美	48,100	402,116.00	0.56
29	300059	东方财富	17,300	401,014.00	0.56
30	601225	陕西煤业	18,300	390,156.00	0.54
31	600690	海尔智家	14,900	388,741.00	0.54
32	600031	三一重工	18,000	380,340.00	0.53
33	601919	中远海控	24,400	370,392.00	0.51
34	601628	中国人寿	8,100	368,550.00	0.51
35	002371	北方华创	800	367,264.00	0.51
36	002008	大族激光	8,900	366,591.00	0.51
37	601328	交通银行	49,300	357,425.00	0.50
38	000975	山金国际	13,800	335,754.00	0.47
39	300124	汇川技术	4,400	331,452.00	0.46
40	603501	豪威集团	2,600	327,340.00	0.46
41	000408	藏格矿业	3,800	320,720.00	0.45
42	603799	华友钴业	4,600	313,996.00	0.44
43	000568	泸州老窖	2,700	313,794.00	0.44
44	600487	亨通光电	12,500	309,125.00	0.43
45	300014	亿纬锂能	4,700	309,072.00	0.43
46	002281	光迅科技	4,400	307,780.00	0.43
47	002414	高德红外	20,900	306,603.00	0.43
48	002027	分众传媒	40,900	301,433.00	0.42
49	601857	中国石油	28,300	294,603.00	0.41

50	002625	光启技术	6,000	292,560.00	0.41
51	600887	伊利股份	10,000	286,000.00	0.40
52	601398	工商银行	35,900	284,687.00	0.40
53	001979	招商蛇口	32,800	283,392.00	0.39
54	002028	思源电气	1,800	278,262.00	0.39
55	002594	比亚迪	2,800	273,616.00	0.38
56	688002	睿创微纳	2,685	270,648.00	0.38
57	000807	云铝股份	8,200	269,288.00	0.37
58	600415	小商品城	16,500	263,175.00	0.37
59	000063	中兴通讯	6,900	261,096.00	0.36
60	000425	徐工机械	22,200	257,076.00	0.36
61	002244	滨江集团	25,500	256,275.00	0.36
62	002916	深南电路	1,100	255,519.00	0.36
63	000538	云南白药	4,500	255,420.00	0.36
64	000938	紫光股份	10,100	248,460.00	0.35
65	002463	沪电股份	3,400	248,438.00	0.35
66	600426	华鲁恒升	7,600	238,868.00	0.33
67	002241	歌尔股份	8,300	238,459.00	0.33
68	300567	精测电子	2,600	237,120.00	0.33
69	300433	蓝思科技	7,800	236,106.00	0.33
70	600160	巨化股份	6,100	234,362.00	0.33
71	601117	中国化学	30,900	232,677.00	0.32
72	688012	中微公司	800	227,008.00	0.32
73	300136	信维通信	3,600	223,200.00	0.31
74	000415	渤海租赁	55,100	223,155.00	0.31
75	002128	电投能源	7,700	214,907.00	0.30
76	002001	新和成	8,500	214,115.00	0.30
77	603019	中科曙光	2,500	214,100.00	0.30
78	605499	东鹏饮料	800	213,912.00	0.30
79	000977	浪潮信息	3,200	213,120.00	0.30
80	600988	赤峰黄金	6,800	212,432.00	0.30
81	300073	当升科技	3,600	208,080.00	0.29
82	002049	紫光国微	2,600	204,906.00	0.28
83	002273	水晶光电	8,100	203,472.00	0.28
84	002384	东山精密	2,400	203,160.00	0.28
85	688041	海光信息	900	201,969.00	0.28
86	000858	五粮液	1,900	201,286.00	0.28
87	688271	联影医疗	1,600	200,800.00	0.28
88	000708	中信特钢	12,200	199,714.00	0.28
89	603568	伟明环保	7,800	197,964.00	0.28
90	601668	中国建筑	37,600	192,888.00	0.27
91	002202	金风科技	9,400	191,760.00	0.27
92	601319	中国人保	21,300	190,635.00	0.27

93	300760	迈瑞医疗	1,000	190,450.00	0.26
94	002532	天山铝业	11,700	189,306.00	0.26
95	601012	隆基绿能	10,300	187,460.00	0.26
96	002595	豪迈科技	2,200	185,922.00	0.26
97	603596	伯特利	3,600	184,572.00	0.26
98	688578	艾力斯	1,700	177,055.00	0.25
99	000423	东阿阿胶	3,600	176,688.00	0.25
100	002074	国轩高科	4,500	175,995.00	0.24
101	300347	泰格医药	3,100	175,770.00	0.24
102	002223	鱼跃医疗	4,600	175,766.00	0.24
103	688180	君实生物	5,100	174,216.00	0.24
104	000733	振华科技	3,300	172,953.00	0.24
105	600039	四川路桥	17,300	172,135.00	0.24
106	601360	三六零	15,100	168,667.00	0.23
107	688169	石头科技	1,100	167,266.00	0.23
108	603129	春风动力	600	167,208.00	0.23
109	600000	浦发银行	13,300	165,452.00	0.23
110	600332	白云山	6,200	159,588.00	0.22
111	002517	恺英网络	7,100	155,277.00	0.22
112	300438	鹏辉能源	2,900	154,338.00	0.21
113	300274	阳光电源	900	153,936.00	0.21
114	002851	麦格米特	1,700	153,119.00	0.21
115	002624	完美世界	9,100	149,149.00	0.21
116	600547	山东黄金	3,800	147,098.00	0.20
117	300413	芒果超媒	6,000	146,520.00	0.20
118	600570	恒生电子	4,800	144,720.00	0.20
119	600989	宝丰能源	7,300	143,299.00	0.20
120	600325	华发股份	33,900	143,058.00	0.20
121	600879	航天电子	6,700	142,844.00	0.20
122	300394	天孚通信	700	142,121.00	0.20
123	300496	中科创达	2,100	141,750.00	0.20
124	002353	杰瑞股份	2,000	141,660.00	0.20
125	002410	广联达	11,200	140,896.00	0.20
126	000932	华菱钢铁	25,000	140,500.00	0.20
127	601658	邮储银行	25,500	138,975.00	0.19
128	002493	荣盛石化	11,700	137,007.00	0.19
129	002459	晶澳科技	11,700	133,965.00	0.19
130	000967	盈峰环境	18,200	133,588.00	0.19
131	601600	中国铝业	10,900	133,198.00	0.19
132	002648	卫星化学	7,400	130,832.00	0.18
133	002841	视源股份	3,300	130,779.00	0.18
134	002436	兴森科技	6,100	129,137.00	0.18
135	300033	同花顺	400	128,872.00	0.18

136	603993	洛阳钼业	6,200	124,000.00	0.17
137	600096	云天化	3,700	123,617.00	0.17
138	000630	铜陵有色	20,500	123,205.00	0.17
139	600660	福耀玻璃	1,900	123,063.00	0.17
140	300207	欣旺达	4,700	122,905.00	0.17
141	688111	金山办公	400	122,828.00	0.17
142	601868	中国能建	52,200	122,670.00	0.17
143	605117	德业股份	1,400	120,680.00	0.17
144	300395	菲利华	1,200	120,360.00	0.17
145	000623	吉林敖东	6,000	117,180.00	0.16
146	002152	广电运通	8,300	114,623.00	0.16
147	600118	中国卫星	1,200	113,940.00	0.16
148	600418	江淮汽车	2,300	113,850.00	0.16
149	601872	招商轮船	12,200	109,556.00	0.15
150	601988	中国银行	19,100	109,443.00	0.15
151	002185	华天科技	9,900	108,603.00	0.15
152	002155	湖南黄金	5,100	107,559.00	0.15
153	600795	国电电力	21,300	107,352.00	0.15
154	600522	中天科技	5,900	106,908.00	0.15
155	000887	中鼎股份	4,600	106,766.00	0.15
156	300223	北京君正	1,000	106,040.00	0.15
157	600998	九州通	20,600	105,472.00	0.15
158	300751	迈为股份	500	102,995.00	0.14
159	300866	安克创新	900	102,951.00	0.14
160	600208	衢州发展	26,500	102,555.00	0.14
161	603806	福斯特	7,300	101,908.00	0.14
162	001965	招商公路	9,900	99,792.00	0.14
163	601288	农业银行	12,900	99,072.00	0.14
164	600585	海螺水泥	4,500	98,370.00	0.14
165	603486	科沃斯	1,200	96,816.00	0.13
166	601111	中国国航	10,200	95,574.00	0.13
167	002292	奥飞娱乐	10,600	93,810.00	0.13
168	002236	大华股份	4,800	90,912.00	0.13
169	601633	长城汽车	4,000	90,520.00	0.13
170	688063	派能科技	1,554	88,298.28	0.12
171	000301	东方盛虹	8,100	88,209.00	0.12
172	002709	天赐材料	1,900	88,027.00	0.12
173	600019	宝钢股份	11,800	87,910.00	0.12
174	300390	天华新能	1,600	87,376.00	0.12
175	002064	华峰化学	7,900	86,900.00	0.12
176	300476	胜宏科技	300	86,274.00	0.12
177	600549	厦门钨业	2,100	86,226.00	0.12
178	600018	上港集团	15,800	85,636.00	0.12

179	600938	中国海油	2,800	84,504.00	0.12
180	601390	中国中铁	15,400	83,314.00	0.12
181	601766	中国中车	12,100	82,522.00	0.11
182	300972	万辰集团	400	80,428.00	0.11
183	002245	蔚蓝锂芯	4,500	80,100.00	0.11
184	688599	天合光能	4,758	78,744.90	0.11
185	002415	海康威视	2,600	77,584.00	0.11
186	601689	拓普集团	1,000	77,180.00	0.11
187	601100	恒立液压	700	76,937.00	0.11
188	300003	乐普医疗	4,700	74,307.00	0.10
189	600183	生益科技	1,000	71,410.00	0.10
190	600498	烽火通信	2,200	70,576.00	0.10
191	000933	神火股份	2,500	68,675.00	0.10
192	603885	吉祥航空	4,600	68,448.00	0.10
193	688072	拓荆科技	200	66,000.00	0.09
194	600674	川投能源	4,700	65,330.00	0.09
195	002821	凯莱英	700	65,051.00	0.09
196	603986	兆易创新	300	64,275.00	0.09
197	600489	中金黄金	2,700	63,072.00	0.09
198	002812	恩捷股份	1,100	62,304.00	0.09
199	688223	晶科能源	10,900	61,476.00	0.09
200	002156	通富微电	1,600	60,320.00	0.08
201	688120	华海清科	400	60,032.00	0.08
202	300418	昆仑万维	1,400	58,380.00	0.08
203	300474	景嘉微	800	57,496.00	0.08
204	000830	鲁西化工	3,400	56,338.00	0.08
205	300450	先导智能	1,100	54,978.00	0.08
206	688126	沪硅产业	2,500	54,100.00	0.08
207	600028	中国石化	8,700	53,766.00	0.07
208	002837	英维克	500	53,445.00	0.07
209	600115	中国东航	8,800	52,800.00	0.07
210	002318	久立特材	1,800	52,110.00	0.07
211	300558	贝达药业	1,100	51,359.00	0.07
212	300058	蓝色光标	4,400	50,688.00	0.07
213	002405	四维图新	5,500	49,555.00	0.07
214	688213	思特威	500	47,545.00	0.07
215	002738	中矿资源	600	47,130.00	0.07
216	000001	平安银行	3,900	44,499.00	0.06
217	000039	中集集团	4,400	44,396.00	0.06
218	600219	南山铝业	8,100	43,578.00	0.06
219	002601	龙佰集团	2,200	43,076.00	0.06
220	000617	中油资本	4,400	42,240.00	0.06
221	601058	赛轮轮胎	2,600	42,068.00	0.06

222	600563	法拉电子	400	41,980.00	0.06
223	600486	扬农化工	600	41,634.00	0.06
224	002714	牧原股份	800	40,464.00	0.06
225	002176	江特电机	4,100	39,934.00	0.06
226	002130	沃尔核材	1,500	39,480.00	0.05
227	000963	华东医药	1,000	39,450.00	0.05
228	688017	绿的谐波	200	38,420.00	0.05
229	600233	圆通速递	2,300	37,766.00	0.05
230	002129	TCL 中环	4,400	37,708.00	0.05
231	688266	泽璟制药	400	37,080.00	0.05
232	003816	中国广核	9,800	36,848.00	0.05
233	601567	三星医疗	1,600	36,832.00	0.05
234	300408	三环集团	800	36,600.00	0.05
235	601155	新城控股	2,600	36,270.00	0.05
236	603606	东方电缆	600	35,850.00	0.05
237	688099	晶晨股份	400	34,892.00	0.05
238	300454	深信服	300	34,548.00	0.05
239	300832	新产业	600	33,750.00	0.05
240	300083	创世纪	3,600	33,156.00	0.05
241	300088	长信科技	5,400	32,724.00	0.05
242	001914	招商积余	3,000	32,040.00	0.04
243	603260	合盛硅业	600	31,620.00	0.04
244	600406	国电南瑞	1,400	31,472.00	0.04
245	600521	华海药业	1,800	30,546.00	0.04
246	600941	中国移动	300	30,315.00	0.04
247	600048	保利发展	4,900	29,890.00	0.04
248	600089	特变电工	1,300	28,886.00	0.04
249	002465	海格通信	1,800	28,350.00	0.04
250	600166	福田汽车	9,700	28,324.00	0.04
251	600316	洪都航空	800	27,928.00	0.04
252	688521	芯原股份	200	27,394.00	0.04
253	603087	甘李药业	400	27,228.00	0.04
254	600176	中国巨石	1,500	25,650.00	0.04
255	002294	信立泰	500	24,775.00	0.03
256	600816	建元信托	8,600	24,338.00	0.03
257	601127	赛力斯	200	24,192.00	0.03
258	600741	华域汽车	1,200	24,000.00	0.03
259	000988	华工科技	300	23,799.00	0.03
260	688188	柏楚电子	171	23,237.19	0.03
261	603979	金诚信	300	22,845.00	0.03
262	605589	圣泉集团	800	22,640.00	0.03
263	300573	兴齐眼药	320	22,492.80	0.03
264	002409	雅克科技	300	22,230.00	0.03

265	300316	晶盛机电	600	22,050.00	0.03
266	300068	南都电源	1,300	20,202.00	0.03
267	300759	康龙化成	700	19,901.00	0.03
268	688166	博瑞医药	400	19,624.00	0.03
269	002460	赣锋锂业	300	18,867.00	0.03
270	002422	科伦药业	600	17,610.00	0.02
271	600323	瀚蓝环境	600	17,160.00	0.02
272	000960	锡业股份	600	16,728.00	0.02
273	600009	上海机场	500	16,380.00	0.02
274	600893	航发动力	400	16,012.00	0.02
275	300699	光威复材	400	15,784.00	0.02
276	002312	川发龙蟒	1,400	15,302.00	0.02
277	300896	爱美客	100	14,172.00	0.02
278	601877	正泰电器	500	13,945.00	0.02
279	600153	建发股份	1,400	12,950.00	0.02
280	600050	中国联通	2,400	12,264.00	0.02
281	600460	士兰微	400	11,364.00	0.02
282	603288	海天味业	300	11,106.00	0.02
283	603939	益丰药房	400	8,688.00	0.01
284	000157	中联重科	1,000	8,630.00	0.01
285	000651	格力电器	200	8,044.00	0.01
286	601186	中国铁建	1,000	7,670.00	0.01
287	600864	哈投股份	1,100	7,293.00	0.01
288	600141	兴发集团	200	6,916.00	0.01
289	600177	雅戈尔	900	6,840.00	0.01
290	600352	浙江龙盛	600	6,396.00	0.01
291	601728	中国电信	1,000	6,300.00	0.01
292	600482	中国动力	300	6,210.00	0.01
293	600438	通威股份	300	6,156.00	0.01
294	603816	顾家家居	200	6,148.00	0.01
295	600499	科达制造	400	5,548.00	0.01
296	603659	璞泰来	200	5,468.00	0.01
297	600588	用友网络	400	5,304.00	0.01
298	300442	润泽科技	100	5,280.00	0.01
299	000831	中国稀土	100	4,644.00	0.01
300	600111	北方稀土	100	4,612.00	0.01
301	601233	桐昆股份	200	3,442.00	0.00
302	600497	驰宏锌锗	400	2,924.00	0.00
303	600704	物产中大	500	2,785.00	0.00
304	600803	新奥股份	100	2,076.00	0.00
305	600007	中国国贸	100	1,982.00	0.00
306	300012	华测检测	100	1,355.00	0.00
307	601816	京沪高铁	200	1,030.00	0.00

308	000009	中国宝安	100	985.00	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	600919	江苏银行	31,000	322,400.00	0.45
2	688372	伟测科技	2,465	268,906.85	0.37
3	002396	星网锐捷	8,700	263,610.00	0.37
4	600027	华电国际	45,100	223,696.00	0.31
5	688484	南芯科技	4,979	202,446.14	0.28
6	600970	中材国际	15,900	165,201.00	0.23
7	000791	甘肃能源	25,000	161,250.00	0.22
8	600578	京能电力	31,200	159,120.00	0.22
9	002284	亚太股份	10,400	155,272.00	0.22
10	000997	新大陆	5,000	141,600.00	0.20
11	601963	重庆银行	12,600	136,458.00	0.19
12	600132	重庆啤酒	2,500	130,600.00	0.18
13	601231	环旭电子	4,200	126,000.00	0.18
14	601939	建设银行	13,200	122,496.00	0.17
15	002913	奥士康	2,800	119,672.00	0.17
16	603296	华勤技术	1,300	117,962.00	0.16
17	603890	春秋电子	7,100	114,523.00	0.16
18	300739	明阳电路	6,200	113,956.00	0.16
19	600016	民生银行	29,300	112,219.00	0.16
20	601108	财通证券	12,800	111,616.00	0.16
21	601995	中金公司	3,100	108,500.00	0.15
22	688612	威迈斯	3,200	105,504.00	0.15
23	002039	黔源电力	5,700	103,569.00	0.14
24	600496	精工钢构	24,600	102,090.00	0.14
25	688185	康希诺	1,600	100,560.00	0.14
26	601336	新华保险	1,400	97,580.00	0.14
27	688557	兰剑智能	2,600	94,718.00	0.13
28	601998	中信银行	12,100	93,170.00	0.13
29	300296	利亚德	14,600	92,272.00	0.13
30	688798	艾为电子	1,200	91,332.00	0.13
31	688153	唯捷创芯	2,400	90,336.00	0.13
32	002117	东港股份	6,500	89,765.00	0.12
33	002461	珠江啤酒	9,600	89,184.00	0.12
34	601077	渝农商行	13,700	88,502.00	0.12
35	688520	神州细胞	2,000	86,620.00	0.12
36	002324	普利特	5,400	86,346.00	0.12
37	300409	道氏技术	3,800	85,462.00	0.12
38	002048	宁波华翔	2,700	84,942.00	0.12
39	002402	和而泰	2,100	82,152.00	0.11

40	300363	博腾股份	3,500	81,340.00	0.11
41	301263	泰恩康	2,800	81,172.00	0.11
42	688127	蓝特光学	2,100	80,829.00	0.11
43	000703	恒逸石化	7,500	80,775.00	0.11
44	002110	三钢闽光	18,300	80,337.00	0.11
45	000555	神州信息	4,700	77,785.00	0.11
46	688311	盟升电子	1,700	77,520.00	0.11
47	603171	税友股份	1,400	77,182.00	0.11
48	600750	江中药业	3,300	76,461.00	0.11
49	601818	光大银行	21,200	73,988.00	0.10
50	601229	上海银行	7,200	72,720.00	0.10
51	601717	中创智领	2,900	71,195.00	0.10
52	300762	上海瀚讯	1,700	70,856.00	0.10
53	002428	云南锗业	2,200	69,850.00	0.10
54	000603	盛达资源	2,200	68,112.00	0.09
55	300166	东方国信	6,600	67,452.00	0.09
56	000925	众合科技	7,400	66,452.00	0.09
57	002527	新时达	3,700	65,638.00	0.09
58	601699	潞安环能	5,500	64,900.00	0.09
59	002419	天虹股份	11,600	64,148.00	0.09
60	603569	长久物流	7,800	59,670.00	0.08
61	600295	鄂尔多斯	4,800	59,328.00	0.08
62	603920	世运电路	1,200	58,092.00	0.08
63	300765	新诺威	1,600	57,712.00	0.08
64	002346	柘中股份	2,800	56,868.00	0.08
65	300113	顺网科技	2,800	56,672.00	0.08
66	600761	安徽合力	2,700	56,403.00	0.08
67	603766	隆鑫通用	3,300	53,163.00	0.07
68	688522	纳睿雷达	1,300	51,909.00	0.07
69	688116	天奈科技	1,100	51,865.00	0.07
70	603712	七一二	2,400	49,848.00	0.07
71	601138	工业富联	800	49,640.00	0.07
72	600315	上海家化	2,200	49,544.00	0.07
73	688177	百奥泰	2,100	48,594.00	0.07
74	002970	锐明技术	1,000	48,500.00	0.07
75	603929	亚翔集成	500	47,750.00	0.07
76	688383	新益昌	600	46,962.00	0.07
77	600869	远东股份	5,800	46,690.00	0.06
78	600459	贵研铂业	2,500	46,525.00	0.06
79	603915	国茂股份	2,500	46,025.00	0.06
80	002736	国信证券	3,500	45,920.00	0.06
81	601226	华电科工	5,800	45,472.00	0.06
82	605567	春雪食品	4,100	45,100.00	0.06

83	688257	新锐股份	1,300	44,564.00	0.06
84	300768	迪普科技	2,400	44,472.00	0.06
85	002023	海特高新	3,200	43,328.00	0.06
86	688349	三一重能	1,711	43,254.08	0.06
87	301080	百普赛斯	800	43,200.00	0.06
88	300244	迪安诊断	2,700	42,795.00	0.06
89	300357	我武生物	1,500	42,525.00	0.06
90	603663	三祥新材	1,200	42,420.00	0.06
91	603444	吉比特	100	42,385.00	0.06
92	300098	高新兴	6,900	42,090.00	0.06
93	688003	天准科技	711	41,877.90	0.06
94	002668	TCL 智家	4,000	41,520.00	0.06
95	300682	朗新科技	2,700	41,067.00	0.06
96	002988	豪美新材	1,100	40,480.00	0.06
96	688208	道通科技	1,100	40,480.00	0.06
97	600388	龙净环保	2,400	39,144.00	0.05
98	300725	药石科技	1,000	38,560.00	0.05
99	001227	兰州银行	16,100	37,352.00	0.05
100	003031	中瓷电子	500	36,580.00	0.05
101	301073	君亭酒店	1,400	36,484.00	0.05
102	603379	三美股份	600	36,432.00	0.05
103	002487	大金重工	700	36,351.00	0.05
104	688131	皓元医药	500	36,040.00	0.05
105	600100	同方股份	4,000	35,680.00	0.05
106	300681	英搏尔	1,400	35,084.00	0.05
107	605598	上海港湾	500	34,740.00	0.05
108	601137	博威合金	1,600	34,192.00	0.05
109	001228	永泰运	1,300	34,112.00	0.05
110	301286	侨源股份	800	33,832.00	0.05
111	605118	力鼎光电	1,100	33,121.00	0.05
112	601126	四方股份	1,100	33,088.00	0.05
113	300709	精研科技	700	33,012.00	0.05
114	301589	诺瓦星云	200	32,910.00	0.05
115	688295	中复神鹰	1,000	32,810.00	0.05
116	300687	赛意信息	1,400	32,158.00	0.04
117	601777	千里科技	3,000	31,890.00	0.04
118	301004	嘉益股份	600	31,230.00	0.04
119	301005	超捷股份	200	31,054.00	0.04
120	000029	深深房 A	1,400	30,828.00	0.04
121	688160	步科股份	200	30,500.00	0.04
122	002886	沃特股份	1,400	30,408.00	0.04
123	300579	数字认证	900	30,249.00	0.04
124	600851	海欣股份	4,400	30,052.00	0.04

125	603730	岱美股份	3,400	29,784.00	0.04
126	300770	新媒股份	700	29,687.00	0.04
127	600391	航发科技	800	29,680.00	0.04
128	000833	粤桂股份	1,500	29,190.00	0.04
129	300909	汇创达	600	28,860.00	0.04
130	603236	移远通信	300	28,623.00	0.04
131	300432	富临精工	1,700	28,390.00	0.04
132	002222	福晶科技	500	28,170.00	0.04
133	000917	电广传媒	2,700	27,756.00	0.04
134	301550	斯菱智驱	200	27,740.00	0.04
135	002943	宇晶股份	700	27,720.00	0.04
136	600403	大有能源	3,900	27,222.00	0.04
137	000006	深振业 A	2,700	26,865.00	0.04
138	300723	一品红	800	26,840.00	0.04
139	688182	灿勤科技	900	26,568.00	0.04
140	000596	古井贡酒	200	26,520.00	0.04
141	300222	科大智能	2,400	26,256.00	0.04
142	688591	泰凌微	600	25,536.00	0.04
143	002426	胜利精密	6,500	24,895.00	0.03
144	688625	呈和科技	600	24,720.00	0.03
145	000553	安道麦 A	4,500	24,660.00	0.03
146	301238	瑞泰新材	1,200	24,480.00	0.03
147	003011	海象新材	1,100	24,244.00	0.03
148	688510	航亚科技	900	24,210.00	0.03
149	001267	汇绿生态	1,100	24,090.00	0.03
150	002392	北京利尔	3,200	23,936.00	0.03
151	600057	厦门象屿	2,800	23,856.00	0.03
152	688598	金博股份	800	23,488.00	0.03
153	600748	上实发展	4,300	23,306.00	0.03
154	688595	芯海科技	700	22,960.00	0.03
155	688639	华恒生物	700	22,806.00	0.03
156	300005	探路者	2,100	22,743.00	0.03
157	600237	铜峰电子	2,500	22,400.00	0.03
158	002935	天奥电子	1,000	22,350.00	0.03
159	688070	纵横股份	400	22,160.00	0.03
160	000012	南玻 A	5,000	22,150.00	0.03
161	600212	绿能慧充	2,700	21,735.00	0.03
162	688046	药康生物	1,400	21,504.00	0.03
163	002552	宝鼎科技	1,300	21,463.00	0.03
164	300740	水羊股份	900	21,456.00	0.03
165	000600	建投能源	2,500	21,325.00	0.03
166	688277	天智航	1,400	21,266.00	0.03
167	000612	焦作万方	1,900	20,938.00	0.03

168	002947	恒铭达	400	20,808.00	0.03
169	000589	贵州轮胎	4,000	20,720.00	0.03
170	688515	裕太微	200	20,510.00	0.03
171	301162	国能日新	400	20,504.00	0.03
172	688352	硕中科技	1,600	20,176.00	0.03
173	688359	三孚新科	300	19,989.00	0.03
174	603010	万盛股份	1,900	19,988.00	0.03
175	002204	大连重工	2,600	19,890.00	0.03
176	688553	汇宇制药	1,100	19,569.00	0.03
177	000825	太钢不锈	4,000	19,560.00	0.03
178	301498	乖宝宠物	300	19,545.00	0.03
179	688190	云路股份	200	19,480.00	0.03
180	688678	福立旺	800	19,344.00	0.03
181	688345	博力威	593	18,501.60	0.03
182	688016	心脉医疗	200	18,332.00	0.03
183	603848	好太太	1,000	18,270.00	0.03
184	688103	国力电子	300	18,177.00	0.03
185	601107	四川成渝	2,900	17,632.00	0.02
186	002062	宏润建设	1,900	17,575.00	0.02
187	002993	奥海科技	400	17,484.00	0.02
188	002181	粤传媒	2,000	17,240.00	0.02
189	600188	兖矿能源	1,300	17,095.00	0.02
190	603121	华培动力	800	16,928.00	0.02
191	002876	三利谱	700	16,758.00	0.02
192	688371	菲沃泰	900	16,623.00	0.02
193	002937	兴瑞科技	700	16,520.00	0.02
194	002965	祥鑫科技	400	16,272.00	0.02
195	603969	银龙股份	1,600	16,176.00	0.02
196	688176	亚虹医药	1,400	16,114.00	0.02
197	688331	荣昌生物	200	15,558.00	0.02
198	688680	海优新材	400	15,300.00	0.02
199	000036	华联控股	2,300	15,180.00	0.02
200	301220	亚香股份	400	15,100.00	0.02
201	688001	华兴源创	500	15,090.00	0.02
202	002912	中新赛克	500	15,070.00	0.02
203	688168	安博通	200	15,032.00	0.02
204	000863	三湘印象	2,400	14,952.00	0.02
205	688486	龙迅股份	200	14,862.00	0.02
206	002468	申通快递	1,100	14,762.00	0.02
207	300813	泰林生物	600	14,742.00	0.02
208	000778	新兴铸管	3,500	14,630.00	0.02
209	688567	孚能科技	916	14,335.40	0.02
210	603200	上海洗霸	200	14,228.00	0.02

211	300548	长芯博创	100	14,200.00	0.02
212	301563	云汉芯城	105	14,037.45	0.02
213	603615	茶花股份	600	14,028.00	0.02
214	600993	马应龙	500	14,000.00	0.02
215	600533	栖霞建设	5,400	13,824.00	0.02
216	002919	名臣健康	600	13,794.00	0.02
217	605186	健麾信息	700	13,755.00	0.02
218	600084	中信尼雅	2,600	13,650.00	0.02
219	688058	宝兰德	500	13,615.00	0.02
220	300323	华灿光电	1,700	13,566.00	0.02
221	301087	可孚医疗	300	13,401.00	0.02
222	600981	苏豪汇鸿	4,200	13,188.00	0.02
223	002645	华宏科技	900	13,176.00	0.02
224	300926	博俊科技	400	13,112.00	0.02
225	002697	红旗连锁	2,200	13,068.00	0.02
226	600064	南京高科	1,500	13,020.00	0.02
227	688439	振华风光	200	12,920.00	0.02
228	688772	珠海冠宇	600	12,918.00	0.02
229	600961	株冶集团	800	12,880.00	0.02
229	688739	成大生物	500	12,880.00	0.02
230	688369	致远互联	500	12,715.00	0.02
231	002979	雷赛智能	300	12,621.00	0.02
232	600621	华鑫股份	800	12,192.00	0.02
233	002523	天桥起重	2,800	12,012.00	0.02
234	301584	建发致新	447	11,988.54	0.02
235	002773	康弘药业	400	11,988.00	0.02
236	603590	康辰药业	300	11,925.00	0.02
237	000050	深天马 A	1,300	11,739.00	0.02
238	688321	微芯生物	400	11,688.00	0.02
239	688102	斯瑞新材	300	11,622.00	0.02
240	688202	美迪西	200	11,280.00	0.02
241	002948	青岛银行	2,500	11,200.00	0.02
242	688007	光峰科技	600	11,142.00	0.02
243	689009	九号公司	200	11,118.00	0.02
244	002311	海大集团	200	11,076.00	0.02
245	002545	东方铁塔	600	11,070.00	0.02
246	603005	晶方科技	400	11,064.00	0.02
247	000950	重药控股	1,900	11,058.00	0.02
248	600756	浪潮软件	600	11,052.00	0.02
249	603897	长城科技	400	10,880.00	0.02
250	600623	华谊集团	1,400	10,794.00	0.02
251	601698	中国卫通	300	10,719.00	0.01
252	300577	开润股份	500	10,685.00	0.01

253	688682	霍莱沃	200	10,582.00	0.01
254	603699	纽威股份	200	10,394.00	0.01
255	603336	宏辉果蔬	1,200	10,272.00	0.01
256	688187	时代电气	200	10,258.00	0.01
257	300911	亿田智能	300	9,990.00	0.01
258	688088	虹软科技	200	9,900.00	0.01
259	600335	国机汽车	1,500	9,765.00	0.01
260	603888	新华网	500	9,715.00	0.01
261	000852	石化机械	1,300	9,451.00	0.01
262	601881	中国银河	600	9,432.00	0.01
263	001289	龙源电力	600	9,024.00	0.01
264	300790	宇瞳光学	300	8,973.00	0.01
265	688248	南网科技	200	8,948.00	0.01
266	000048	京基智农	500	8,800.00	0.01
267	600386	北巴传媒	2,000	8,780.00	0.01
268	688141	杰华特	200	8,686.00	0.01
269	603950	长源东谷	300	8,685.00	0.01
270	603337	杰克科技	200	8,666.00	0.01
271	688636	智明达	200	8,568.00	0.01
272	300443	金雷股份	300	8,439.00	0.01
273	688259	创耀科技	200	8,360.00	0.01
274	600999	招商证券	500	8,320.00	0.01
275	688663	新风光	200	7,754.00	0.01
276	600926	杭州银行	500	7,640.00	0.01
277	002317	众生药业	400	7,592.00	0.01
278	300158	振东制药	1,300	7,553.00	0.01
279	688097	博众精工	200	7,550.00	0.01
280	603167	渤海轮渡	800	7,544.00	0.01
281	600860	京城股份	600	7,524.00	0.01
282	603811	诚意药业	700	7,350.00	0.01
283	301095	广立微	100	7,171.00	0.01
284	002550	千红制药	900	7,074.00	0.01
285	300639	凯普生物	1,300	6,994.00	0.01
286	301668	昊创瑞通	155	6,944.00	0.01
287	301219	腾远钴业	100	6,828.00	0.01
288	000823	超声电子	500	6,780.00	0.01
289	301047	义翘神州	100	6,760.00	0.01
290	002440	闰土股份	900	6,723.00	0.01
291	600326	西藏天路	600	6,618.00	0.01
292	300835	龙磁科技	100	6,558.00	0.01
293	688380	中微半导	200	6,430.00	0.01
294	300206	理邦仪器	500	6,395.00	0.01
295	002345	潮宏基	500	6,250.00	0.01

296	601958	金钼股份	400	6,232.00	0.01
297	603489	八方股份	200	6,116.00	0.01
298	688262	国芯科技	200	6,070.00	0.01
299	600933	爱柯迪	300	6,030.00	0.01
300	688192	迪哲医药	100	5,760.00	0.01
301	301096	百诚医药	100	5,714.00	0.01
302	603713	密尔克卫	100	5,577.00	0.01
303	605222	起帆电缆	300	5,517.00	0.01
304	000799	酒鬼酒	100	5,458.00	0.01
305	603267	鸿远电子	100	5,443.00	0.01
306	300292	吴通控股	1,200	5,412.00	0.01
307	688618	三旺通信	200	5,332.00	0.01
308	002016	世荣兆业	900	5,202.00	0.01
309	688687	凯因科技	200	4,984.00	0.01
310	300679	电连技术	100	4,868.00	0.01
311	300146	汤臣倍健	400	4,804.00	0.01
312	301129	瑞纳智能	200	4,770.00	0.01
313	603858	步长制药	300	4,692.00	0.01
314	688207	格灵深瞳	300	4,560.00	0.01
315	301316	慧博云通	100	4,468.00	0.01
316	601083	锦江航运	400	4,464.00	0.01
317	600935	华塑股份	1,800	4,410.00	0.01
318	301171	易点天下	100	4,050.00	0.01
319	300025	华星创业	700	4,032.00	0.01
320	600649	城投控股	900	4,005.00	0.01
321	000959	首钢股份	800	3,920.00	0.01
322	300772	运达股份	200	3,812.00	0.01
323	603370	华新精科	82	3,800.70	0.01
324	300302	同有科技	200	3,628.00	0.01
325	601026	道生天合	249	3,555.72	0.00
326	600097	开创国际	300	3,408.00	0.00
327	603175	超颖电子	69	3,350.64	0.00
328	603063	禾望电气	100	3,307.00	0.00
329	300696	爱乐达	100	3,191.00	0.00
330	300861	美畅股份	200	2,986.00	0.00
331	603191	望变电气	200	2,962.00	0.00
332	603181	皇马科技	200	2,858.00	0.00
333	600785	新华百货	200	2,710.00	0.00
334	603303	得邦照明	200	2,578.00	0.00
335	603013	亚普股份	100	2,467.00	0.00
336	002838	道恩股份	100	2,408.00	0.00
337	601518	吉林高速	800	2,256.00	0.00
338	000776	广发证券	100	2,202.00	0.00

339	605016	百龙创园	100	2,160.00	0.00
340	300079	数码视讯	400	2,156.00	0.00
341	601515	衢州东峰	500	2,150.00	0.00
342	603051	鹿山新材	100	2,119.00	0.00
343	002690	美亚光电	100	2,057.00	0.00
344	603499	翔港科技	100	2,044.00	0.00
345	603429	集友股份	200	1,982.00	0.00
346	601156	东航物流	100	1,841.00	0.00
347	600967	内蒙一机	100	1,680.00	0.00
348	002803	吉宏股份	100	1,636.00	0.00
349	603092	德力佳	28	1,558.48	0.00
350	603999	读者传媒	200	1,406.00	0.00
351	000576	甘化科工	100	1,053.00	0.00
352	002588	史丹利	100	998.00	0.00
353	000899	赣能股份	100	990.00	0.00
354	600966	博汇纸业	100	683.00	0.00
355	601003	柳钢股份	100	503.00	0.00
356	601678	滨化股份	100	424.00	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	11,760,219.00	16.35
2	300750	宁德时代	11,178,311.00	15.54
3	601318	中国平安	9,513,190.00	13.23
4	600036	招商银行	6,485,516.00	9.02
5	601899	紫金矿业	5,956,051.00	8.28
6	000333	美的集团	5,235,450.00	7.28
7	600030	中信证券	4,912,266.20	6.83
8	601166	兴业银行	4,778,778.00	6.64
9	300308	中际旭创	4,549,902.70	6.33
10	600276	恒瑞医药	4,535,384.80	6.31
11	300502	新易盛	4,444,617.00	6.18
12	600150	中国船舶	3,917,745.54	5.45
13	300059	东方财富	3,692,658.00	5.13
14	603259	药明康德	3,675,478.00	5.11
15	000725	京东方 A	3,647,209.00	5.07
16	600900	长江电力	3,495,479.00	4.86
17	002594	比亚迪	3,477,462.00	4.83
18	002475	立讯精密	3,398,324.00	4.72
19	688012	中微公司	3,389,330.11	4.71
20	601328	交通银行	3,323,969.00	4.62
21	600660	福耀玻璃	3,228,104.00	4.49

22	688256	寒武纪	3,099,946.00	4.31
23	000651	格力电器	2,873,612.00	4.00
24	601600	中国铝业	2,833,633.00	3.94
25	600219	南山铝业	2,768,053.00	3.85
26	600887	伊利股份	2,753,548.00	3.83
27	600690	海尔智家	2,663,780.00	3.70
28	600166	福田汽车	2,643,471.00	3.68
29	688981	中芯国际	2,595,992.47	3.61
30	000858	五粮液	2,540,305.00	3.53
31	688008	澜起科技	2,528,837.07	3.52
32	300124	汇川技术	2,526,568.00	3.51
33	600011	华能国际	2,490,275.00	3.46
34	601988	中国银行	2,468,966.00	3.43
35	601766	中国中车	2,458,222.00	3.42
36	600031	三一重工	2,449,020.00	3.40
37	601628	中国人寿	2,409,998.00	3.35
38	300760	迈瑞医疗	2,404,727.00	3.34
39	000100	TCL 科技	2,387,304.00	3.32
40	601398	工商银行	2,316,007.00	3.22
41	601857	中国石油	2,249,656.00	3.13
42	600489	中金黄金	2,201,129.00	3.06
43	000001	平安银行	2,163,597.00	3.01
44	600028	中国石化	2,148,814.00	2.99
45	688235	百济神州	2,080,535.29	2.89
46	000630	铜陵有色	2,070,970.00	2.88
47	601919	中远海控	2,061,561.00	2.87
48	601989	中国重工	2,021,654.00	2.81
49	000338	潍柴动力	2,004,735.00	2.79
50	000425	徐工机械	1,993,671.00	2.77
51	300476	胜宏科技	1,989,350.00	2.77
52	601668	中国建筑	1,936,936.00	2.69
53	600941	中国移动	1,934,648.00	2.69
54	300274	阳光电源	1,893,434.00	2.63
55	601088	中国神华	1,888,288.00	2.63
56	002415	海康威视	1,878,583.50	2.61
57	600919	江苏银行	1,877,710.00	2.61
58	603501	豪威集团	1,852,001.00	2.57
59	688041	海光信息	1,826,787.30	2.54
60	600050	中国联通	1,823,565.00	2.54
61	601633	长城汽车	1,800,474.00	2.50
62	600104	上汽集团	1,788,097.00	2.49
63	600795	国电电力	1,782,291.00	2.48
64	600406	国电南瑞	1,714,684.00	2.38

65	600115	中国东航	1,712,464.00	2.38
66	300033	同花顺	1,708,310.00	2.37
67	601728	中国电信	1,693,668.00	2.35
68	000301	东方盛虹	1,688,516.00	2.35
69	600332	白云山	1,687,236.00	2.35
70	000157	中联重科	1,684,056.00	2.34
71	600885	宏发股份	1,648,876.00	2.29
72	688617	惠泰医疗	1,642,505.67	2.28
73	002008	大族激光	1,636,857.00	2.28
74	601658	邮储银行	1,614,327.00	2.24
75	600183	生益科技	1,605,440.00	2.23
76	000988	华工科技	1,600,318.00	2.22
77	000538	云南白药	1,584,001.00	2.20
78	002241	歌尔股份	1,564,199.00	2.17
79	603993	洛阳钼业	1,556,599.00	2.16
80	600418	江淮汽车	1,552,154.00	2.16
81	601117	中国化学	1,548,103.00	2.15
82	600089	特变电工	1,538,977.00	2.14
83	000408	藏格矿业	1,534,537.00	2.13
84	002396	星网锐捷	1,523,367.00	2.12
85	000807	云铝股份	1,516,886.00	2.11
86	600019	宝钢股份	1,510,804.00	2.10
87	000063	中兴通讯	1,507,868.00	2.10
88	002920	德赛西威	1,476,284.00	2.05
89	002405	四维图新	1,472,759.00	2.05
90	600352	浙江龙盛	1,452,761.00	2.02
91	603019	中科曙光	1,438,828.42	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	10,999,341.00	15.29
2	600519	贵州茅台	9,960,946.00	13.85
3	601318	中国平安	8,285,389.00	11.52
4	601899	紫金矿业	6,103,907.00	8.49
5	300502	新易盛	6,053,031.00	8.42
6	300308	中际旭创	5,435,343.00	7.56
7	600036	招商银行	5,273,996.53	7.33
8	688256	寒武纪	4,672,393.61	6.50
9	000333	美的集团	4,582,402.00	6.37
10	600030	中信证券	4,258,026.00	5.92
11	600276	恒瑞医药	4,158,663.00	5.78
12	688012	中微公司	3,745,328.74	5.21

13	300059	东方财富	3,690,132.00	5.13
14	601166	兴业银行	3,584,110.00	4.98
15	603259	药明康德	3,496,616.00	4.86
16	600660	福耀玻璃	3,439,745.00	4.78
17	600150	中国船舶	3,434,861.00	4.78
18	600900	长江电力	3,375,514.00	4.69
19	000725	京东方 A	3,253,750.00	4.52
20	002594	比亚迪	3,141,991.00	4.37
21	601600	中国铝业	3,095,509.00	4.30
22	002475	立讯精密	3,001,555.00	4.17
23	600219	南山铝业	2,914,001.00	4.05
24	601328	交通银行	2,751,795.00	3.83
25	300476	胜宏科技	2,729,297.00	3.79
26	688008	澜起科技	2,651,943.95	3.69
27	000651	格力电器	2,649,001.00	3.68
28	688981	中芯国际	2,643,053.10	3.67
29	600166	福田汽车	2,538,077.00	3.53
30	600887	伊利股份	2,506,428.00	3.48
31	600489	中金黄金	2,406,956.36	3.35
32	300124	汇川技术	2,387,286.00	3.32
33	000858	五粮液	2,380,989.00	3.31
34	600690	海尔智家	2,378,598.00	3.31
35	601766	中国中车	2,372,750.00	3.30
36	000630	铜陵有色	2,315,112.00	3.22
37	601988	中国银行	2,314,245.00	3.22
38	300760	迈瑞医疗	2,289,645.00	3.18
39	600031	三一重工	2,269,408.00	3.16
40	688235	百济神州	2,229,165.60	3.10
41	601989	中国重工	2,207,153.54	3.07
42	601628	中国人寿	2,149,237.00	2.99
43	600011	华能国际	2,128,808.00	2.96
44	600028	中国石化	2,048,191.00	2.85
45	000001	平安银行	2,042,156.00	2.84
46	601857	中国石油	2,004,005.00	2.79
47	603993	洛阳钼业	2,002,187.00	2.78
48	601398	工商银行	1,983,784.00	2.76
49	300274	阳光电源	1,940,711.00	2.70
50	000100	TCL 科技	1,939,508.00	2.70
51	600183	生益科技	1,919,131.00	2.67
52	002415	海康威视	1,877,238.00	2.61
53	000988	华工科技	1,863,441.00	2.59
54	600941	中国移动	1,857,778.00	2.58
55	600050	中国联通	1,849,446.00	2.57

56	300033	同花顺	1,841,236.00	2.56
57	601633	长城汽车	1,832,647.00	2.55
58	600089	特变电工	1,814,279.43	2.52
59	000425	徐工机械	1,797,449.00	2.50
60	688041	海光信息	1,793,097.46	2.49
61	600115	中国东航	1,783,354.00	2.48
62	600885	宏发股份	1,740,732.00	2.42
63	600795	国电电力	1,700,050.00	2.36
64	000157	中联重科	1,692,941.00	2.35
65	601919	中远海控	1,691,418.00	2.35
66	600406	国电南瑞	1,683,455.00	2.34
67	601668	中国建筑	1,681,054.00	2.34
68	000301	东方盛虹	1,671,487.00	2.32
69	601728	中国电信	1,644,814.00	2.29
70	002241	歌尔股份	1,610,312.00	2.24
71	002920	德赛西威	1,595,181.00	2.22
72	601138	工业富联	1,589,900.73	2.21
73	600418	江淮汽车	1,587,067.00	2.21
74	688617	惠泰医疗	1,568,249.14	2.18
75	000338	潍柴动力	1,556,159.00	2.16
76	002008	大族激光	1,545,646.00	2.15
77	002405	四维图新	1,520,783.00	2.11
78	603501	豪威集团	1,515,524.00	2.11
79	601088	中国神华	1,512,692.80	2.10
80	000807	云铝股份	1,511,100.00	2.10
81	600332	白云山	1,509,146.00	2.10
82	002202	金风科技	1,503,717.00	2.09
83	600584	长电科技	1,492,527.00	2.07
84	601658	邮储银行	1,491,440.00	2.07
85	600352	浙江龙盛	1,479,789.00	2.06
86	600919	江苏银行	1,453,343.00	2.02
87	002138	顺络电子	1,445,491.00	2.01
88	600176	中国巨石	1,438,954.00	2.00

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	593,151,700.82
卖出股票收入（成交）总额	566,605,065.01

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

8.12 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地方交通运输局、国家金融监督管理总局处罚。

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监管局处

罚。

上海南芯半导体科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方公安局处罚。

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	612,863.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	612,863.49

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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		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 A500 指数增强 A	336	69,642.95	-	-	23,400,032.83	100.00
景顺长城 中证 A500 指数增强 C	1,239	30,040.81	140,010.11	0.38	37,080,554.10	99.62
合计	1,575	38,489.27	140,010.11	0.23	60,480,586.93	99.77

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 A500 指数增强 A	234,005.90	1.000024
	景顺长城中证 A500 指数增强 C	-	-
	合计	234,005.90	0.386017

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 A500 指数增 强 A	10~50
	景顺长城中证 A500 指数增 强 C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有 本开放式基金	景顺长城中证 A500 指数增 强 A	10~50
	景顺长城中证 A500 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 A500 指数增强 A	景顺长城中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日 (2025 年 7 月 17 日) 基金份额总额	127,487,069.76	180,222,579.98
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	7,225,479.72	17,042,068.49
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	111,312,516.65	160,044,084.26
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期末基金份 额总额	23,400,032.83	37,220,564.21

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：

本基金管理人于 2025 年 4 月 2 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任卫学文先生担任本公司副总经理。本基金管理人于 2025 年 5 月 30 日发布公告，因李进董事长任期届满，由本公司总经理康乐先生代为履行本公司董事长一职。本基金管理人于 2025 年 8 月 6 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任叶才先生担任本公司董事长。本基金管理人于 2025 年 8 月 15 日发布公告，经深圳市市场监督管理局核准，景顺长城基金管理有限公司法定代表人变更为叶才先生。有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

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、本基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 1 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 22,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金管理人受调查或处罚等情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金托管人受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

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 (%)	
申万宏源证券有限公司	3	1,156,125,522.62	100.00	220,187.71	100.00	本期报告新增 3 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 (%)
申万宏源证券有限公司	1,477.55	100.00	-	-	-	-

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	-	-	-
2	景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 6 月 24 日
3	景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 6 月 24 日
4	景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 6 月 24 日
5	景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 6 月 24 日
6	景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 6 月 24 日
7	景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金新增肯特瑞等多家销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 6 月 27 日
8	景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金新增平安证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 7 月 1 日
9	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	2025 年 7 月 1 日
10	关于景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金合同生效的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 7 月 18 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增利得基金为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 7 月 21 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 8 月 6 日
13	关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金新增广源达信为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 8 月 13 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 8 月 15 日
15	关于景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金参加部分销售机构申购及或定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 8 月 26 日

16	关于景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金关于开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 8 月 26 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	2025 年 9 月 5 日
18	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	2025 年 9 月 27 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于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	2025 年 10 月 15 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 10 月 28 日
21	景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 10 月 28 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 10 月 29 日
23	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	2025 年 10 月 31 日
24	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	2025 年 11 月 17 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 12 月 1 日
26	关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金新增易方达财富为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 12 月 5 日
27	关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金新增微众银行为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 12 月 15 日
28	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增阳光人寿为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 12 月 26 日
29	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	2025 年 12 月 27 日
30	关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金新增中国工商银行为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 12 月 30 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中证 A500 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 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证 A500 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

2026 年 3 月 27 日