

嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资 基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 24 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。

本报告期自 2024 年 09 月 20 日（基金合同生效日）起至 2024 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	14
4.10 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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	20

§ 8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	59
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	59
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	59
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
8.12 投资组合报告附注	60
§ 9 基金份额持有人信息	60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
9.2 期末上市基金前十名持有人	61
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	61
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	62
§ 10 开放式基金份额变动	62
§ 11 重大事件揭示	62
11.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
11.4 基金投资策略的改变	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
11.8 其他重大事件	64
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
§ 13 备查文件目录	66
13.1 备查文件目录	66
13.2 存放地点	66
13.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中证 A500ETF
场内简称	A500 指数 ETF
基金主代码	159351
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 9 月 20 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	13,139,123,357.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易 所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 10 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如流动性原因等）导致无法完全投资于标的指数成份股时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。 具体投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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		嘉实基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	郭松	冯萌
	联系电话	(010)65215588	021-52629999-213310
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95561
传真		(010)65215588	021-62159217

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	100020	200120
法定代表人	经雷	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年 9 月 20 日（基金合同生效日）-2024 年 12 月 31 日
本期已实现收益	22,733,291.14
本期利润	-223,432,887.28
加权平均基金份额本期利润	-0.0308
本期加权平均净值利润率	-3.11%
本期基金份额净值增长率	-2.32%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末
期末可供分配利润	-304,186,245.91
期末可供分配基金份额利润	-0.0232
期末基金资产净值	12,834,937,111.09
期末基金份额净值	0.9768
3.1.3 累计期末指标	2024 年末
基金份额累计净值增长率	-2.32%

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）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) 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。

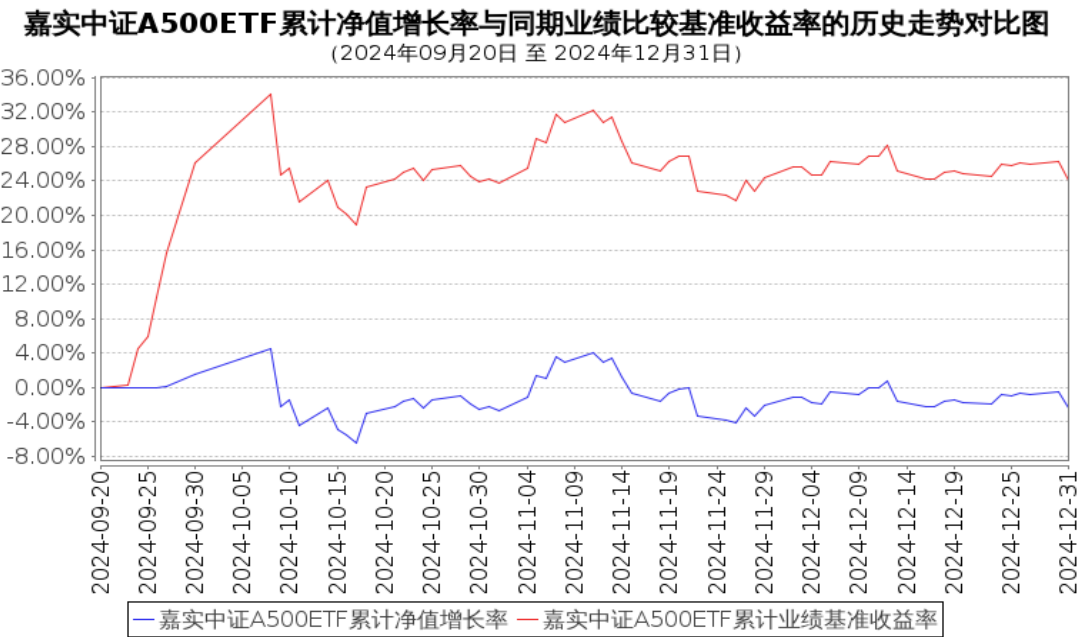
(4) 本基金合同生效日为 2024 年 09 月 20 日，本报告期自 2024 年 09 月 20 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-3.84%	1.58%	-1.62%	1.78%	-2.22%	-0.20%
自基金合同生效起至今	-2.32%	1.51%	24.02%	2.20%	-26.34%	-0.69%

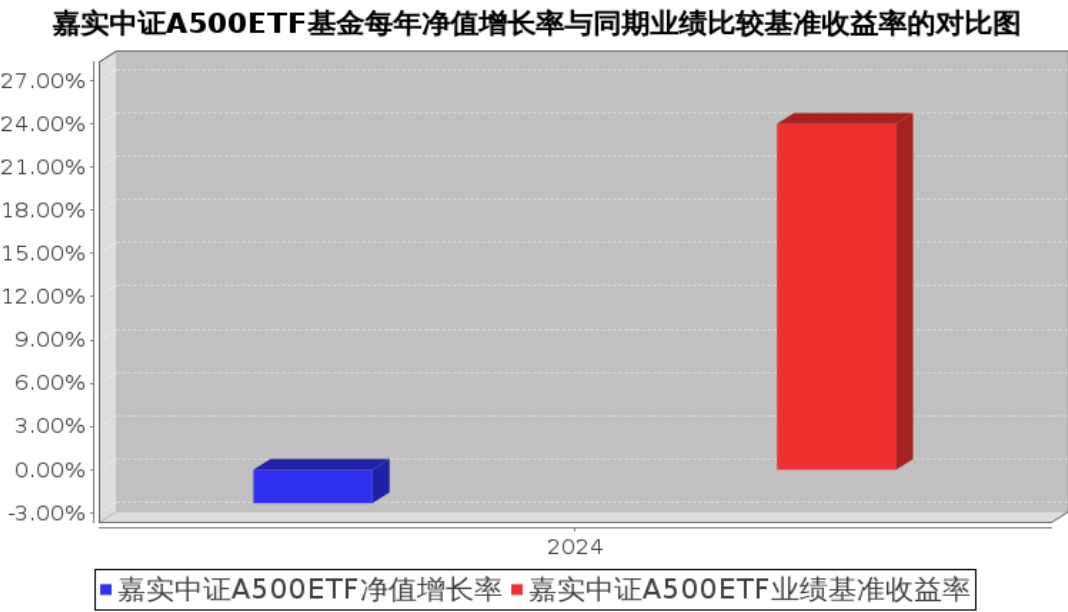
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：(1) 本基金合同生效日 2024 年 09 月 20 日至报告期末未满 1 年。

(2) 按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日 6 个月为建仓期，本报告期处于建仓期内。

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



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 和特定资产管理业务等资格。

截止 2024 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 355 只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

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		
刘珈吟	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实沪深300ETF、嘉实中证主要消费ETF、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实央企创新驱动ETF、嘉实央企创新驱动ETF联接、嘉实中证主要消费ETF发起联接、嘉实中证全指家用电器指数发起式、嘉实中证国新央企现代能源ETF、嘉实中证国新央企现代能源ETF联接、嘉实中证A500ETF联接基金经理	2024年9月20日	-	15年	2009年加入嘉实基金管理有限公司，曾任指数投资部指数研究员。现任指数投资部负责人。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
张超梁	本基金、嘉实中创400ETF、	2024年9月20日	-	11年	曾任国金基金管理有限公司量化分析师助理、量化分析师、投资经理、基金经理助理，华夏基金管理有限公司研究发展部产

嘉实中创400ETF联接、嘉实中证信息安全主题ETF、嘉实中证高端装备细分50ETF、嘉实中证高端装备细分50ETF发起联接、嘉实中证A500ETF联接基金经理					品经理，方正富邦基金管理有限公司指数投资部基金经理。2022年3月加入嘉实基金管理有限公司任SmartBeta和指数投资部投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
--	--	--	--	--	--

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
张超梁	公募基金	7	19,230,358,924.13	2024年1月25日
	私募资产管理计划	1	604,849.42	2024年7月15日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	19,230,963,773.55	-

注：1. “任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间；

2. 报告期内，张超梁管理的1个私募资产管理计划已于2024年8月27日离任，3个私募资产管理计划已分别于2024年11月1日、2024年11月26日、2024年12月11日终止。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理兼任私募资产管理计划投资经理，其薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩。公司依据其中长期业绩、投资者利益、团队贡献及合规管理等要素综合评估基金经理的绩效结果并核定激励，同时按照监管要求落实递延及跟投机制。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉

实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，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，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

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

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易、境外投资以及投资管理过程中各个相关环节应当符合公平交易的监管要求，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司严格执行《公平交易管理制度》，各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部门集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

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

本基金基金经理兼任私募资产管理计划投资经理，为防范兼任行为潜在利益冲突，公司增加了公平交易管理环节、公平交易执行力度。

(1) 加强投资指令管理：基金经理管理的多个组合，同日购入或出售同一证券时尽量同时发送投资指令，并通过公平交易系统进行价差监控管理。

(2) 加强对交易行为管理：兼任组合间不得进行同日反向交易，对多个组合间同日及临近日同向交易的价差强化控制和监测。

(3) 加强交易监测和分析：对不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内、10 日内）反向交易和同向交易价差监控的分析，结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素，对是否存在不公平对待的情形进行分析。

(4) 加强事后报告机制：对同一基金经理管理的多个组合的收益率差异进行分析，并对公平交易机制的潜在问题和完善情况进行说明。

报告期内，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，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，合计 11 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

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

本基金跟踪中证 A500 指数，中证 A500 指数从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

2024 年，经济复苏态势曲折向好。一季度，1-2 月信贷弱于预期，但制造业开始回暖，为后续发展奠定基础。3 月制造业景气上升并延续到 4 月，期间出口拉动需求，经济超预期恢复，不过受稳增长政策落地效果滞后影响，5、6 月制造业 PMI 回落至荣枯线以下。三季度，7、8 月为制造业淡季，受多种因素影响 PMI 降幅较大，好在大型企业等处于扩张区间，外需也在支撑总需求，9 月政策发力使 PMI 超季节性回升。至 11 月，前期逆周期调节政策效果逐步显现，PMI 明显回升，企业生产和市场需求均有修复迹象，需求侧订单指数好转。海外方面，美国经济的韧性与通胀是决定市场对降息预期的主要因素，也进一步影响着市场走势。上半年通胀整体呈降温态势，但经济活动的疲软推动美联储降息预期上升，市场整体上行；三季度全球制造业走弱，9 月 PMI 创 15 个月以来新低，宏观经济承压促使美联储开启降息周期，但市场早已计入降息溢价，总体表现以震荡为主；四季度承压的经济有部分好转，全球制造业 PMI 在连续 5 个月下行后开始回升，欧美主要市场震荡上行。

报告期内，本基金仍处于 6 个月建仓期内。作为 ETF 基金，本基金秉承指数化被动投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低基金的跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9768 元；本报告期基金份额净值增长率为-2.32%，业绩比较基准收益率为 24.02%。

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 2025 年，积极的财政政策仍将持续，宽松的货币环境或逐渐转化为信用端的扩张，促进企业盈利的进一步修复。在相关部门的大力推动下，保险等长线资金持续流入资本市场，财富效应应有助于进一步刺激内需，宏观经济有望持续复苏，资本市场表现有望向好。

本基金作为一只投资于中证 A500 指数的被动投资管理产品，我们继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证 A500 指数的投资工具。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关监察稽核工作情况如下：

（1）继续内控前置。在基金营销、投资交易、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持新业务开展，对新产品、新投资工具等进行合规性判断。在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

（2）全流程动态开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，IT 事前设置，建立禁限库，合规培训、承诺书等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中实时监控等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、处理建议并督促改正。优化和升级合规风控系统，不断提高自动化监控能力，保障各类组合合规运作，保护投资者利益。

（3）按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

（4）基金法务工作。包括合同、协议审查，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，重点防控新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

（5）加强差错管理。继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表以及专题报告。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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	容诚审字[2025]100Z0778 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	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“嘉实中证 A500ETF 基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了嘉实中证 A500ETF 基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于嘉实中证 A500ETF 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。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	嘉实中证 A500ETF 基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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，基金管理人管理层负责评估嘉实中证 A500ETF 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，除非基金管理人管理层计划清算嘉实中证 A500ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督嘉实中证 A500ETF 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）评价基金管理人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）对基金管理人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，就可能导致对嘉实中证 A500ETF 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嘉实中证 A500ETF 基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报、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。 我们与基金管理人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	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	蔡晓慧	柴瀚英
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26	
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：嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	7.4.7.1	94,386,625.54
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	12,776,624,616.74
其中：股票投资		12,776,624,616.74
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		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		12,871,011,242.28
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		33,956,296.22
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,520,629.47
应付托管费		506,876.50
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-

递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	90,329.00
负债合计		36,074,131.19
净资产：		
实收基金	7.4.7.10	13,139,123,357.00
未分配利润	7.4.7.12	-304,186,245.91
净资产合计		12,834,937,111.09
负债和净资产总计		12,871,011,242.28

注：本基金合同生效日为 2024 年 09 月 20 日，本报告期自基金合同生效日 2024 年 09 月 20 日起至 2024 年 12 月 31 日止。报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9768 元，基金份额总额 13,139,123,357.00 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 9 月 20 日（基金合同 生效日）至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-219,499,295.94
1. 利息收入		229,758.36
其中：存款利息收入	7.4.7.13	229,758.36
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）		8,901,318.09
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-10,215,666.91
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	22,586.05
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	19,094,398.95
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	-246,166,178.42
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	17,535,806.03
减：二、营业总支出		3,933,591.34
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,882,109.05

其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	960,703.01
3. 销售服务费		-
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		0.28
8. 其他费用	7.4.7.23	90,779.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-223,432,887.28
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-223,432,887.28
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-223,432,887.28

7.3 净资产变动表

会计主体：嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,000,123,357.00	-	-	2,000,123,357.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	11,139,000,000.00	-	-304,186,245.91	10,834,813,754.09
（一）、综合收益总额	-	-	-223,432,887.28	-223,432,887.28
（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）	11,139,000,000.00	-	-80,753,358.63	11,058,246,641.37
其中：1. 基金申购款	12,996,000,000.00	-	-104,046,581.01	12,891,953,418.99
2. 基金赎回款	-1,857,000,000.00	-	23,293,222.38	-1,833,706,777.62

（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、本期期末净资产	13,139,123,357.00	-	-304,186,245.91	12,834,937,111.09

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：

经雷梁凯李袁

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

嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(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[2024]1263 号《关于准予嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由嘉实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《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限不定。经向中国证监会备案，《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 9 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,000,123,357.00 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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本报告期末的财务状况以及本报告期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 2024 年 9 月 20 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为衍生金融资产/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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。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,相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,确认为应计利息,包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本 and 努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息,以发生违约的风险为权重,计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额,确认预期信用损失。

于每个资产负债表日,本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的,处于第一阶段,本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备;金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的,处于第二阶段,本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备;金融工具自初始确认后已经发生信用减值的,处于第三阶段,本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具,本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加,认定为处于第一阶段的金融工具,按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算确认。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。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占净资产比例计算的金额。未实现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未实现损益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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，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由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

每份基金份额享有同等分配权。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，基金收益分配基准日(即收益评价日)的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值。本基金收益分配采取现金方式。基金管理人有权根据实际情况决定是否进行分红，但满足以下条件，本基金每季度至少进行一次收益分配：每季度最后一个交易日对基金相对标的指数的超额收益率进行评价；计算基金份额净

值增长率、标的指数同期增长率、超额收益率；当超额收益率大于 0 时，本基金将进行收益分配，收益分配比例不低于超额收益率的 60%，基金管理人将在次季度起的 15 个工作日内拟定收益分配方案；当超额收益率小于或等于 0 时，本基金将不进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

无。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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) 本基金的基金管理人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) 本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴

20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	379,895.06
等于：本金	379,855.43
加：应计利息	39.63
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 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	94,006,730.48
等于：本金	94,003,139.92
加：应计利息	3,590.56
减：坏账准备	-
合计	94,386,625.54

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		13,022,790,795.16	-	12,776,624,616.74	-246,166,178.42
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		13,022,790,795.16	-	12,776,624,616.74	-246,166,178.42

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

无。

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

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

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

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

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

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	90,329.00
合计	90,329.00

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,000,123,357.00	2,000,123,357.00
本期申购	12,996,000,000.00	12,996,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,857,000,000.00	-1,857,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	13,139,123,357.00	13,139,123,357.00

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 2024 年 09 月 20 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,000,123,357.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 123,568.00 份基金份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	22,733,291.14	-246,166,178.42	-223,432,887.28
本期基金份额交易产生的变动数	14,438,665.20	-95,192,023.83	-80,753,358.63
其中：基金申购款	17,666,578.59	-121,713,159.60	-104,046,581.01
基金赎回款	-3,227,913.39	26,521,135.77	23,293,222.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,171,956.34	-341,358,202.25	-304,186,245.91

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年9月20日（基金合同生效日）至2024年12月31日
活期存款利息收入	72,296.69
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	157,461.67
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	229,758.36

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年9月20日（基金合同生效日）至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,926,695.87
股票投资收益——赎回差价收入	-5,288,971.04
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	-10,215,666.91

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,534,545,978.53
减：卖出股票成本总额	2,534,872,291.12
减：交易费用	4,600,383.28
买卖股票差价收入	-4,926,695.87

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年9月20日（基金合同生效日）至2024年12月31日
赎回基金份额对价总额	1,833,706,777.62
减：现金支付赎回款总额	1,037,852,620.62
减：赎回股票成本总额	801,143,128.04
减：交易费用	-
赎回差价收入	-5,288,971.04

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14.5 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9月20日（基金合同生效日）至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	78.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	22,507.93
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	22,586.05

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9月20日（基金合同生效日）至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	511,613.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	489,000.00

本总额	
减：应计利息总额	80.38
减：交易费用	25.58
买卖债券差价收入	22,507.93

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

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。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	19,094,398.95
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	19,094,398.95

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-246,166,178.42
股票投资	-246,166,178.42
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	-246,166,178.42

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-
替代损益	17,535,806.03
合计	17,535,806.03

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

审计费用	48,000.00
信息披露费	42,329.00
证券出借违约金	-
银行划款手续费	50.00
其他	400.00
合计	90,779.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据相关法律法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2025 年 1 月 15 日登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.0100 元。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司（“嘉实资本”）	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司（“嘉实财富”）	基金管理人的控股子公司
嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“嘉实中证 A500ETF 联接”）	本基金的联接基金

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,882,109.05
其中：应支付销售机构的客户维护费	197,506.22
应支付基金管理人的净管理费	2,684,602.83

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	960,703.01

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

无。

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2024 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2024 年 9 月 20 日）持有的基金份额	200,013,611.00
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	200,013,611.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.52%

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末	
	2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
嘉实中证A500ETF联接	4,754,000,000.00	36.18
中诚信托	239,779,674.00	1.82

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2024 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司_活期	379,895.06	72,296.69

注：本基金的上述存款，按银行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

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

报告期末(2024 年 12 月 31 日)，本基金持有 8,220,500 股兴业银行的 A 股普通股，估值总额为人民币 157,504,780.00 元，占基金资产净值的比例为 1.23%。

7.4.11 利润分配情况

本期（2024 年 9 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日），本基金未实施利润分配。根据相关法律法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2025 年 1 月 15 日登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.0100 元。

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

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2024 年 12 月 23 日	重大事项停牌	7.22	2025 年 01 月 07 日	6.93	2,491,300	18,730,108.98	17,987,186.00	-

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

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的基金

管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和风险管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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相关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。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与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上述比例限制)。

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，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

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

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的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。

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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	94,386,625.54	-	-	-	94,386,625.54
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	12,776,624,616.74	12,776,624,616.74
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	94,386,625.54	-	-	12,776,624,616.74	12,871,011,242.28
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	33,956,296.22	33,956,296.22
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,520,629.47	1,520,629.47
应付托管费	-	-	-	506,876.50	506,876.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	90,329.00	90,329.00
负债总计	-	-	-	36,074,131.19	36,074,131.19
利率敏感度缺口	94,386,625.54	-	-	12,740,550,485.55	12,834,937,111.09

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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）	
	市场利率上升 25 个基点	-	
	市场利率下降 25 个基点	-	

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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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）	
	所有外币相对人民币升值 5%	-	
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交

易的股票、债券及基金，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。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	12,776,624,616.74	99.55
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	12,776,624,616.74	99.55

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准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）
	业绩比较基准上升 5%	352,918,205.10
	业绩比较基准下降 5%	-352,918,205.10

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	12,758,637,430.74
第二层次	17,987,186.00
第三层次	-
合计	12,776,624,616.74

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

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

无。

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

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债。

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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	12,776,624,616.74	99.27
	其中：股票	12,776,624,616.74	99.27
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	94,386,625.54	0.73
8	其他各项资产	-	-
9	合计	12,871,011,242.28	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

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	65,974,546.00	0.51
B	采矿业	592,975,036.28	4.62
C	制造业	7,594,020,578.88	59.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	433,940,198.60	3.38
E	建筑业	263,059,925.00	2.05
F	批发和零售业	84,289,146.00	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	453,600,539.01	3.53
H	住宿和餐饮业	12,478,570.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	809,424,251.96	6.31
J	金融业	1,932,786,141.62	15.06
K	房地产业	137,148,046.00	1.07
L	租赁和商务服务	139,265,415.41	1.09

	业		
M	科学研究和技术服务业	126,726,449.18	0.99
N	水利、环境和公共设施管理业	34,103,202.00	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	9,485,660.00	0.07
Q	卫生和社会工作	55,216,033.80	0.43
R	文化、体育和娱乐业	32,130,877.00	0.25
S	综合	-	-
	合计	12,776,624,616.74	99.55

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
无。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	354,805	540,722,820.00	4.21
2	300750	宁德时代	1,494,357	397,498,962.00	3.10
3	601318	中国平安	6,084,200	320,333,130.00	2.50
4	600036	招商银行	6,995,500	274,923,150.00	2.14
5	000333	美的集团	2,764,730	207,962,990.60	1.62
6	600900	长江电力	6,914,200	204,314,610.00	1.59
7	300059	东方财富	7,139,562	184,343,490.84	1.44
8	600030	中信证券	5,517,109	160,934,069.53	1.25
9	601166	兴业银行	8,220,500	157,504,780.00	1.23
10	000858	五粮液	1,096,300	153,525,852.00	1.20
11	002594	比亚迪	512,263	144,796,259.58	1.13
12	601899	紫金矿业	9,311,900	140,795,928.00	1.10
13	601398	工商银行	19,810,000	137,085,200.00	1.07
14	002475	立讯精密	2,858,900	116,528,764.00	0.91
15	600276	恒瑞医药	2,523,944	115,849,029.60	0.90
16	000651	格力电器	2,532,900	115,120,305.00	0.90
17	600887	伊利股份	3,599,180	108,623,252.40	0.85
18	688981	中芯国际	1,123,355	106,291,850.10	0.83

19	601328	交通银行	13,309,400	103,414,038.00	0.81
20	601816	京沪高铁	16,652,700	102,580,632.00	0.80
21	601288	农业银行	18,047,700	96,374,718.00	0.75
22	000725	京东方 A	20,889,100	91,703,149.00	0.71
23	300760	迈瑞医疗	342,400	87,312,000.00	0.68
24	600919	江苏银行	8,297,500	81,481,450.00	0.63
25	601088	中国神华	1,865,001	81,090,243.48	0.63
26	688041	海光信息	524,113	78,506,886.27	0.61
27	688256	寒武纪	118,428	77,925,624.00	0.61
28	603259	药明康德	1,413,900	77,821,056.00	0.61
29	600309	万华化学	1,065,700	76,037,695.00	0.59
30	000063	中兴通讯	1,821,900	73,604,760.00	0.57
31	300124	汇川技术	1,217,300	71,309,434.00	0.56
32	601668	中国建筑	11,758,620	70,551,720.00	0.55
33	002371	北方华创	179,200	70,067,200.00	0.55
34	600000	浦发银行	6,636,125	68,285,726.25	0.53
35	601601	中国太保	1,935,500	65,961,840.00	0.51
36	601988	中国银行	11,915,300	65,653,303.00	0.51
37	000001	平安银行	5,484,500	64,168,650.00	0.50
38	002415	海康威视	2,087,589	64,088,982.30	0.50
39	601728	中国电信	8,777,200	63,371,384.00	0.49
40	300308	中际旭创	507,400	62,668,974.00	0.49
41	300274	阳光电源	819,840	60,528,787.20	0.47
42	600690	海尔智家	2,121,283	60,392,927.01	0.47
43	600941	中国移动	510,700	60,344,312.00	0.47
44	603019	中科曙光	827,000	59,808,640.00	0.47
45	002714	牧原股份	1,544,100	59,355,204.00	0.46
46	601766	中国中车	6,876,000	57,620,880.00	0.45
47	601857	中国石油	6,407,000	57,278,580.00	0.45
48	600406	国电南瑞	2,270,344	57,258,075.68	0.45
49	601127	赛力斯	426,800	56,930,852.00	0.44
50	600660	福耀玻璃	905,800	56,521,920.00	0.44
51	601919	中远海控	3,607,400	55,914,700.00	0.44
52	601985	中国核电	5,336,600	55,660,738.00	0.43
53	600031	三一重工	3,353,200	55,260,736.00	0.43
54	600028	中国石化	8,242,860	55,062,304.80	0.43
55	002352	顺丰控股	1,361,600	54,872,480.00	0.43
56	600104	上汽集团	2,616,900	54,326,844.00	0.42
57	601012	隆基绿能	3,427,000	53,838,170.00	0.42
58	000100	TCL 科技	10,616,500	53,400,995.00	0.42
59	000568	泸州老窖	416,000	52,083,200.00	0.41
60	601225	陕西煤业	2,192,300	50,992,898.00	0.40
61	002230	科大讯飞	1,046,200	50,552,384.00	0.39

62	603501	韦尔股份	481,335	50,256,187.35	0.39
63	600050	中国联通	8,988,000	47,726,280.00	0.37
64	688012	中微公司	247,182	46,756,947.12	0.36
65	300502	新易盛	400,600	46,301,348.00	0.36
66	600150	中国船舶	1,264,000	45,453,440.00	0.35
67	688008	澜起科技	645,053	43,799,098.70	0.34
68	603288	海天味业	943,363	43,300,361.70	0.34
69	000338	潍柴动力	3,067,900	42,030,230.00	0.33
70	002625	光启技术	852,540	40,751,412.00	0.32
71	002027	分众传媒	5,715,247	40,178,186.41	0.31
72	603986	兆易创新	375,300	40,082,040.00	0.31
73	601628	中国人寿	942,000	39,488,640.00	0.31
74	688111	金山办公	131,214	37,578,377.46	0.29
75	000625	长安汽车	2,807,700	37,510,872.00	0.29
76	601390	中国中铁	5,807,200	37,108,008.00	0.29
77	000425	徐工机械	4,675,400	37,075,922.00	0.29
78	600418	江淮汽车	988,200	37,057,500.00	0.29
79	601888	中国中免	552,300	37,009,623.00	0.29
80	600436	片仔癀	171,159	36,713,605.50	0.29
81	600089	特变电工	2,855,730	36,382,000.20	0.28
82	000938	紫光股份	1,293,500	35,998,105.00	0.28
83	600048	保利发展	4,059,800	35,969,828.00	0.28
84	601658	邮储银行	6,277,100	35,653,928.00	0.28
85	002241	歌尔股份	1,375,800	35,509,398.00	0.28
86	000792	盐湖股份	2,149,800	35,385,708.00	0.28
87	600905	三峡能源	8,087,200	35,341,064.00	0.28
88	300033	同花顺	122,100	35,103,750.00	0.27
89	601006	大秦铁路	5,159,300	34,980,054.00	0.27
90	300015	爱尔眼科	2,636,400	34,932,300.00	0.27
91	600938	中国海油	1,182,800	34,904,428.00	0.27
92	600019	宝钢股份	4,970,900	34,796,300.00	0.27
93	600438	通威股份	1,526,200	33,744,282.00	0.26
94	600584	长电科技	809,100	33,059,826.00	0.26
95	601600	中国铝业	4,482,000	32,942,700.00	0.26
96	300014	亿纬锂能	693,119	32,396,382.06	0.25
97	600585	海螺水泥	1,356,900	32,267,082.00	0.25
98	600760	中航沈飞	623,900	31,644,208.00	0.25
99	600893	航发动力	753,100	31,215,995.00	0.24
100	601989	中国重工	6,444,800	30,999,488.00	0.24
101	600111	北方稀土	1,431,000	30,365,820.00	0.24
102	000977	浪潮信息	583,100	30,251,228.00	0.24
103	000538	云南白药	504,584	30,249,810.80	0.24
104	002463	沪电股份	756,800	30,007,120.00	0.23

105	002050	三花智控	1,265,900	29,761,309.00	0.23
106	688271	联影医疗	233,805	29,552,952.00	0.23
107	605499	东鹏饮料	118,039	29,335,052.28	0.23
108	300408	三环集团	758,000	29,190,580.00	0.23
109	002179	中航光电	718,408	28,233,434.40	0.22
110	600886	国投电力	1,685,400	28,011,348.00	0.22
111	000002	万科 A	3,847,800	27,935,028.00	0.22
112	601669	中国电建	4,868,200	26,580,372.00	0.21
113	603993	洛阳钼业	3,994,900	26,566,085.00	0.21
114	002028	思源电气	349,800	25,430,460.00	0.20
115	002049	紫光国微	384,100	24,724,517.00	0.19
116	300433	蓝思科技	1,126,100	24,661,590.00	0.19
117	000988	华工科技	569,000	24,637,700.00	0.19
118	688036	传音控股	258,805	24,586,475.00	0.19
119	600009	上海机场	702,800	24,000,620.00	0.19
120	600570	恒生电子	856,600	23,976,234.00	0.19
121	600010	宝钢股份	12,831,700	23,866,962.00	0.19
122	601186	中国铁建	2,601,100	23,852,087.00	0.19
123	601727	上海电气	2,861,000	23,202,710.00	0.18
124	600547	山东黄金	1,022,200	23,132,386.00	0.18
125	600795	国电电力	5,040,600	23,085,948.00	0.18
126	300339	润和软件	450,300	22,528,509.00	0.18
127	002384	东山精密	771,200	22,519,040.00	0.18
128	603799	华友钴业	767,200	22,448,272.00	0.17
129	002456	欧菲光	1,870,100	22,403,798.00	0.17
130	002460	赣锋锂业	639,303	22,381,998.03	0.17
131	000768	中航西飞	786,000	22,196,640.00	0.17
132	002422	科伦药业	723,800	21,663,334.00	0.17
133	601058	赛轮轮胎	1,487,400	21,314,442.00	0.17
134	601800	中国交建	2,010,800	21,012,860.00	0.16
135	001979	招商蛇口	2,048,400	20,975,616.00	0.16
136	600989	宝丰能源	1,243,200	20,935,488.00	0.16
137	600415	小商品城	1,549,300	20,776,113.00	0.16
138	601360	三六零	1,977,800	20,470,230.00	0.16
139	000157	中联重科	2,808,800	20,307,624.00	0.16
140	600839	四川长虹	2,087,400	20,143,410.00	0.16
141	600066	宇通客车	750,500	19,798,190.00	0.15
142	600489	中金黄金	1,643,800	19,774,914.00	0.15
143	600029	南方航空	3,046,800	19,773,732.00	0.15
144	600115	中国东航	4,837,700	19,350,800.00	0.15
145	002466	天齐锂业	585,100	19,308,300.00	0.15
146	600487	亨通光电	1,114,900	19,198,578.00	0.15
147	002001	新和成	873,700	19,195,189.00	0.15

148	600745	闻泰科技	491,300	19,052,614.00	0.15
149	600674	川投能源	1,101,600	19,002,600.00	0.15
150	301236	软通动力	322,808	18,952,057.68	0.15
151	002340	格林美	2,896,700	18,915,451.00	0.15
152	300782	卓胜微	210,740	18,903,378.00	0.15
153	300418	昆仑万维	487,600	18,762,848.00	0.15
154	601689	拓普集团	381,025	18,670,225.00	0.15
155	300207	欣旺达	834,680	18,621,710.80	0.15
156	601633	长城汽车	703,692	18,528,210.36	0.14
157	600160	巨化股份	762,700	18,396,324.00	0.14
158	688169	石头科技	83,847	18,386,808.63	0.14
159	003816	中国广核	4,447,600	18,368,588.00	0.14
160	600346	恒力石化	1,193,400	18,318,690.00	0.14
161	000661	长春高新	182,700	18,167,688.00	0.14
162	600426	华鲁恒升	840,100	18,154,561.00	0.14
163	002252	上海莱士	2,491,300	17,987,186.00	0.14
164	002648	卫星化学	952,492	17,897,324.68	0.14
165	002236	大华股份	1,116,100	17,857,600.00	0.14
166	600196	复星医药	718,300	17,849,755.00	0.14
167	688777	中控技术	358,852	17,824,178.84	0.14
168	300122	智飞生物	675,900	17,776,170.00	0.14
169	002156	通富微电	601,200	17,765,460.00	0.14
170	688126	沪硅产业	932,016	17,540,541.12	0.14
171	600256	广汇能源	2,598,100	17,485,213.00	0.14
172	002273	水晶光电	785,900	17,462,698.00	0.14
173	000786	北新建材	573,600	17,385,816.00	0.14
174	002920	德赛西威	157,502	17,342,545.22	0.14
175	601117	中国化学	2,071,700	17,174,393.00	0.13
176	000963	华东医药	496,100	17,165,060.00	0.13
177	600460	士兰微	657,800	17,115,956.00	0.13
178	300394	天孚通信	187,000	17,084,320.00	0.13
179	600372	中航机载	1,368,000	16,867,440.00	0.13
180	600011	华能国际	2,486,400	16,832,928.00	0.13
181	002185	华天科技	1,449,800	16,832,178.00	0.13
182	601868	中国能建	7,330,900	16,787,761.00	0.13
183	601111	中国国航	2,118,500	16,757,335.00	0.13
184	002601	龙佰集团	944,600	16,691,082.00	0.13
185	600183	生益科技	686,000	16,498,300.00	0.13
186	002129	TCL 中环	1,828,800	16,221,456.00	0.13
187	600096	云天化	725,400	16,176,420.00	0.13
188	001965	招商公路	1,156,200	16,128,990.00	0.13
189	002202	金风科技	1,560,300	16,117,899.00	0.13
190	688223	晶科能源	2,262,699	16,087,789.89	0.13

191	300347	泰格医药	293,039	16,005,790.18	0.12
192	601100	恒立液压	302,800	15,978,756.00	0.12
193	000423	东阿阿胶	254,200	15,943,424.00	0.12
194	000066	中国长城	1,093,404	15,930,896.28	0.12
195	601021	春秋航空	276,103	15,922,860.01	0.12
196	000807	云铝股份	1,175,800	15,908,574.00	0.12
197	002180	纳思达	562,700	15,851,259.00	0.12
198	600085	同仁堂	387,500	15,728,625.00	0.12
199	600741	华域汽车	891,000	15,690,510.00	0.12
200	300896	爱美客	85,900	15,676,750.00	0.12
201	300832	新产业	221,200	15,672,020.00	0.12
202	600482	中国动力	637,279	15,594,217.13	0.12
203	002493	荣盛石化	1,717,200	15,540,660.00	0.12
204	600176	中国巨石	1,358,000	15,467,620.00	0.12
205	002459	晶澳科技	1,121,938	15,426,647.50	0.12
206	600219	南山铝业	3,939,300	15,402,663.00	0.12
207	300661	圣邦股份	185,732	15,189,162.96	0.12
208	601168	西部矿业	943,300	15,158,831.00	0.12
209	600352	浙江龙盛	1,472,000	15,146,880.00	0.12
210	300759	康龙化成	588,600	15,127,020.00	0.12
211	603392	万泰生物	213,780	15,062,938.80	0.12
212	000933	神火股份	890,200	15,044,380.00	0.12
213	600885	宏发股份	471,592	15,006,057.44	0.12
214	002709	天赐材料	758,900	14,965,508.00	0.12
215	600988	赤峰黄金	940,900	14,687,449.00	0.11
216	600515	海南机场	3,874,200	14,644,476.00	0.11
217	300017	网宿科技	1,380,198	14,588,692.86	0.11
218	002916	深南电路	116,400	14,550,000.00	0.11
219	000975	山金国际	942,100	14,480,077.00	0.11
220	002738	中矿资源	407,700	14,473,350.00	0.11
221	300476	胜宏科技	341,100	14,356,899.00	0.11
222	002138	顺络电子	455,900	14,351,732.00	0.11
223	600188	兖矿能源	1,012,100	14,341,457.00	0.11
224	002938	鹏鼎控股	393,100	14,340,288.00	0.11
225	600845	宝信软件	488,800	14,302,288.00	0.11
226	002271	东方雨虹	1,101,100	14,292,278.00	0.11
227	601877	正泰电器	608,000	14,233,280.00	0.11
228	688396	华润微	300,375	14,174,696.25	0.11
229	002078	太阳纸业	948,200	14,099,734.00	0.11
230	000630	铜陵有色	4,339,100	14,015,293.00	0.11
231	002281	光迅科技	268,600	14,012,862.00	0.11
232	300136	信维通信	547,400	13,925,856.00	0.11
233	300474	景嘉微	148,300	13,864,567.00	0.11

234	600233	圆通速递	974,100	13,822,479.00	0.11
235	601319	中国人保	1,806,300	13,764,006.00	0.11
236	600161	天坛生物	670,032	13,735,656.00	0.11
237	002555	三七互娱	877,700	13,727,228.00	0.11
238	002085	万丰奥威	719,705	13,638,409.75	0.11
239	600879	航天电子	1,492,800	13,375,488.00	0.10
240	601618	中国中冶	4,036,400	13,320,120.00	0.10
241	300058	蓝色光标	1,428,900	13,260,192.00	0.10
242	002517	恺英网络	973,900	13,254,779.00	0.10
243	601607	上海医药	630,600	13,242,600.00	0.10
244	002444	巨星科技	407,800	13,192,330.00	0.10
245	688120	华海清科	80,588	13,135,038.12	0.10
246	688099	晶晨股份	190,065	13,053,664.20	0.10
247	002074	国轩高科	611,900	12,984,518.00	0.10
248	601615	明阳智能	1,027,900	12,961,819.00	0.10
249	002405	四维图新	1,342,200	12,938,808.00	0.10
250	300223	北京君正	189,700	12,937,540.00	0.10
251	000999	华润三九	289,960	12,856,826.40	0.10
252	300002	神州泰岳	1,108,800	12,850,992.00	0.10
253	002353	杰瑞股份	347,000	12,835,530.00	0.10
254	002195	岩山科技	3,212,448	12,753,418.56	0.10
255	300024	机器人	707,500	12,699,625.00	0.10
256	300346	南大光电	325,200	12,549,468.00	0.10
257	600588	用友网络	1,158,500	12,430,705.00	0.10
258	605117	德业股份	146,540	12,426,592.00	0.10
259	300450	先导智能	620,500	12,422,410.00	0.10
260	002128	电投能源	634,400	12,421,552.00	0.10
261	002532	天山铝业	1,577,300	12,413,351.00	0.10
262	002223	鱼跃医疗	339,600	12,392,004.00	0.10
263	000408	藏格矿业	446,800	12,389,764.00	0.10
264	300496	中科创达	207,300	12,346,788.00	0.10
265	688617	惠泰医疗	33,156	12,344,973.48	0.10
266	002465	海格通信	1,121,800	12,317,364.00	0.10
267	000301	东方盛虹	1,495,700	12,279,697.00	0.10
268	601567	三星医疗	398,700	12,264,012.00	0.10
269	603606	东方电缆	232,606	12,223,445.30	0.10
270	688072	拓荆科技	78,957	12,133,322.19	0.09
271	600362	江西铜业	587,200	12,119,808.00	0.09
272	688047	龙芯中科	91,008	12,038,538.24	0.09
273	300114	中航电测	167,600	12,030,328.00	0.09
274	600765	中航重机	586,700	12,009,749.00	0.09
275	600862	中航高科	472,700	11,940,402.00	0.09
276	002008	大族激光	476,000	11,900,000.00	0.09

277	688599	天合光能	615,064	11,870,735.20	0.09
278	300383	光环新网	812,800	11,858,752.00	0.09
279	300012	华测检测	951,700	11,829,631.00	0.09
280	002131	利欧股份	3,826,900	11,825,121.00	0.09
281	601872	招商轮船	1,841,500	11,804,015.00	0.09
282	300316	晶盛机电	370,000	11,803,000.00	0.09
283	300866	安克创新	120,630	11,778,313.20	0.09
284	000831	中国稀土	419,900	11,778,195.00	0.09
285	600895	张江高科	437,800	11,733,040.00	0.09
286	002472	双环传动	382,200	11,702,964.00	0.09
287	601238	广汽集团	1,252,600	11,699,284.00	0.09
288	600177	雅戈尔	1,306,900	11,631,410.00	0.09
289	603605	珀莱雅	134,900	11,426,030.00	0.09
290	600803	新奥股份	525,600	11,395,008.00	0.09
291	300699	光威复材	328,640	11,387,376.00	0.09
292	300413	芒果超媒	423,000	11,374,470.00	0.09
293	600332	白云山	397,300	11,291,266.00	0.09
294	601233	桐昆股份	954,500	11,263,100.00	0.09
295	300037	新宙邦	297,720	11,146,636.80	0.09
296	000400	许继电气	403,100	11,097,343.00	0.09
297	603260	合盛硅业	199,700	11,095,332.00	0.09
298	300395	菲利华	294,800	11,087,428.00	0.09
299	688122	西部超导	258,025	11,048,630.50	0.09
300	300054	鼎龙股份	424,300	11,040,286.00	0.09
301	300628	亿联网络	285,300	11,012,580.00	0.09
302	300999	金龙鱼	336,827	10,983,928.47	0.09
303	300142	沃森生物	904,300	10,923,944.00	0.09
304	300604	长川科技	247,396	10,917,585.48	0.09
305	601799	星宇股份	81,100	10,825,228.00	0.08
306	600027	华电国际	1,924,700	10,797,567.00	0.08
307	600039	四川路桥	1,478,200	10,761,296.00	0.08
308	000009	中国宝安	1,166,000	10,668,900.00	0.08
309	603596	伯特利	239,163	10,664,278.17	0.08
310	002436	兴森科技	955,500	10,615,605.00	0.08
311	002812	恩捷股份	329,100	10,527,909.00	0.08
312	600153	建发股份	1,000,100	10,521,052.00	0.08
313	688235	百济神州	65,280	10,511,385.60	0.08
314	002007	华兰生物	621,000	10,463,850.00	0.08
315	600549	厦门钨业	538,900	10,384,603.00	0.08
316	600143	金发科技	1,192,000	10,298,880.00	0.08
317	002821	凯莱英	135,200	10,287,368.00	0.08
318	600398	海澜之家	1,356,800	10,176,000.00	0.08
319	601216	君正集团	1,908,700	10,039,762.00	0.08

320	300724	捷佳伟创	157,900	9,980,859.00	0.08
321	000738	航发控制	446,200	9,923,488.00	0.08
322	000617	中油资本	1,429,800	9,851,322.00	0.08
323	000932	华菱钢铁	2,343,400	9,795,412.00	0.08
324	002294	信立泰	314,700	9,733,671.00	0.08
325	002558	巨人网络	765,300	9,711,657.00	0.08
326	600018	上港集团	1,578,800	9,662,256.00	0.08
327	000878	云南铜业	792,600	9,661,794.00	0.08
328	600529	山东药玻	374,900	9,661,173.00	0.08
329	603659	璞泰来	604,635	9,619,742.85	0.07
330	600497	驰宏锌锗	1,726,900	9,618,833.00	0.07
331	688002	睿创微纳	203,565	9,569,590.65	0.07
332	300919	中伟股份	264,320	9,547,238.40	0.07
333	002607	中公教育	2,789,900	9,485,660.00	0.07
334	600141	兴发集团	436,600	9,474,220.00	0.07
335	002409	雅克科技	162,100	9,393,695.00	0.07
336	000623	吉林敖东	540,300	9,330,981.00	0.07
337	002312	川发龙蟒	641,600	9,283,952.00	0.07
338	000034	神州数码	264,400	9,267,220.00	0.07
339	000733	振华科技	218,500	9,214,145.00	0.07
340	002065	东华软件	1,268,400	9,208,584.00	0.07
341	300073	当升科技	228,400	9,199,952.00	0.07
342	002064	华峰化学	1,121,500	9,173,870.00	0.07
343	300001	特锐德	417,700	9,168,515.00	0.07
344	688009	中国通号	1,462,618	9,155,988.68	0.07
345	300459	汤姆猫	1,589,500	9,123,730.00	0.07
346	600118	中国卫星	333,900	9,115,470.00	0.07
347	600026	中远海能	785,500	9,111,800.00	0.07
348	600563	法拉电子	76,600	9,109,272.00	0.07
349	300088	长信科技	1,387,800	9,076,212.00	0.07
350	688188	柏楚电子	46,628	9,057,489.00	0.07
351	002318	久立特材	386,500	9,047,965.00	0.07
352	002432	九安医疗	220,898	9,008,220.44	0.07
353	002739	万达电影	738,800	8,969,032.00	0.07
354	603087	甘李药业	203,100	8,956,710.00	0.07
355	600820	隧道股份	1,243,700	8,942,203.00	0.07
356	600704	物产中大	1,761,300	8,912,178.00	0.07
357	600521	华海药业	497,800	8,895,686.00	0.07
358	600637	东方明珠	1,139,700	8,844,072.00	0.07
359	688303	大全能源	365,144	8,814,576.16	0.07
360	601179	中国西电	1,158,600	8,793,774.00	0.07
361	002410	广联达	746,700	8,781,192.00	0.07
362	600699	均胜电子	557,900	8,742,293.00	0.07

363	603806	福斯特	590,500	8,739,400.00	0.07
364	002841	视源股份	235,400	8,688,614.00	0.07
365	300315	掌趣科技	1,543,000	8,486,500.00	0.07
366	601018	宁波港	2,199,200	8,466,920.00	0.07
367	601677	明泰铝业	702,500	8,451,075.00	0.07
368	300003	乐普医疗	743,800	8,434,692.00	0.07
369	300751	迈为股份	79,300	8,338,395.00	0.06
370	603568	伟明环保	385,300	8,334,039.00	0.06
371	688180	君实生物	304,386	8,318,869.38	0.06
372	300763	锦浪科技	136,000	8,305,520.00	0.06
373	000683	远兴能源	1,479,700	8,271,523.00	0.06
374	300144	宋城演艺	889,700	8,265,313.00	0.06
375	603939	益丰药房	342,400	8,262,112.00	0.06
376	300454	深信服	142,980	8,207,052.00	0.06
377	002152	广电运通	701,400	8,178,324.00	0.06
378	600008	首创环保	2,488,800	8,163,264.00	0.06
379	600392	盛和资源	792,500	8,146,900.00	0.06
380	002044	美年健康	1,770,300	8,125,677.00	0.06
381	603129	春风动力	51,600	8,104,812.00	0.06
382	000039	中集集团	1,041,800	8,094,786.00	0.06
383	002407	多氟多	672,300	8,067,600.00	0.06
384	600486	扬农化工	138,500	8,014,995.00	0.06
385	600170	上海建工	3,013,900	7,986,835.00	0.06
386	300068	南都电源	493,600	7,966,704.00	0.06
387	300529	健帆生物	270,300	7,930,602.00	0.06
388	002624	完美世界	767,300	7,926,209.00	0.06
389	601000	唐山港	1,674,400	7,886,424.00	0.06
390	000960	锡业股份	558,700	7,838,561.00	0.06
391	300251	光线传媒	829,100	7,826,704.00	0.06
392	600498	烽火通信	401,700	7,817,082.00	0.06
393	600763	通策医疗	175,987	7,813,822.80	0.06
394	600316	洪都航空	242,600	7,792,312.00	0.06
395	600816	建元信托	2,226,300	7,792,050.00	0.06
396	300627	华测导航	185,006	7,733,250.80	0.06
397	600516	方大炭素	1,592,600	7,692,258.00	0.06
398	300285	国瓷材料	451,000	7,685,040.00	0.06
399	300558	贝达药业	142,500	7,685,025.00	0.06
400	603816	顾家家居	278,200	7,672,756.00	0.06
401	603979	金诚信	210,800	7,652,040.00	0.06
402	002497	雅化集团	652,400	7,633,080.00	0.06
403	300390	天华新能	328,400	7,569,620.00	0.06
404	603613	国联股份	284,670	7,566,528.60	0.06
405	000629	钒钛股份	2,626,700	7,564,896.00	0.06

406	000830	鲁西化工	647,100	7,564,599.00	0.06
407	002603	以岭药业	472,400	7,563,124.00	0.06
408	002025	航天电器	155,600	7,555,936.00	0.06
409	605358	立昂微	303,200	7,510,264.00	0.06
410	601966	玲珑轮胎	413,600	7,461,344.00	0.06
411	300568	星源材质	758,800	7,375,536.00	0.06
412	300296	利亚德	1,143,400	7,363,496.00	0.06
413	601880	辽港股份	4,237,700	7,331,221.00	0.06
414	600535	天士力	507,000	7,331,220.00	0.06
415	600998	九州通	1,425,400	7,298,048.00	0.06
416	000069	华侨城 A	2,726,100	7,278,687.00	0.06
417	002414	高德红外	966,100	7,178,123.00	0.06
418	600325	华发股份	1,244,500	7,168,320.00	0.06
419	002176	江特电机	965,000	7,150,650.00	0.06
420	603833	欧派家居	103,700	7,149,078.00	0.06
421	603077	和邦生物	3,494,700	7,129,188.00	0.06
422	600038	中直股份	184,500	7,114,320.00	0.06
423	002389	航天彩虹	393,100	7,095,455.00	0.06
424	300253	卫宁健康	989,300	7,083,388.00	0.06
425	600655	豫园股份	1,099,700	7,071,071.00	0.06
426	300182	捷成股份	1,204,400	7,069,828.00	0.06
427	300567	精测电子	108,700	6,989,410.00	0.05
428	002245	蔚蓝锂芯	650,500	6,953,845.00	0.05
429	600754	锦江酒店	257,800	6,924,508.00	0.05
430	600859	王府井	449,200	6,922,172.00	0.05
431	603000	人民网	312,100	6,878,684.00	0.05
432	002756	永兴材料	181,930	6,862,399.60	0.05
433	000519	中兵红箭	472,500	6,827,625.00	0.05
434	603885	吉祥航空	497,400	6,814,380.00	0.05
435	600166	福田汽车	2,685,200	6,739,852.00	0.05
436	300212	易华录	284,400	6,654,960.00	0.05
437	000998	隆平高科	592,600	6,619,342.00	0.05
438	002439	启明星辰	413,200	6,536,824.00	0.05
439	600323	瀚蓝环境	276,000	6,519,120.00	0.05
440	002151	北斗星通	245,200	6,507,608.00	0.05
441	000708	中信特钢	570,256	6,506,620.96	0.05
442	300601	康泰生物	378,720	6,495,048.00	0.05
443	002145	中核钛白	1,530,700	6,490,168.00	0.05
444	600131	国网信通	339,400	6,418,054.00	0.05
445	600004	白云机场	668,300	6,415,680.00	0.05
446	600867	通化东宝	783,900	6,318,234.00	0.05
447	603899	晨光股份	208,001	6,292,030.25	0.05
448	300070	碧水源	1,229,000	6,218,740.00	0.05

449	300118	东方日升	515,900	6,180,482.00	0.05
450	002120	韵达股份	819,100	6,159,632.00	0.05
451	603486	科沃斯	130,661	6,141,067.00	0.05
452	601155	新城控股	511,500	6,117,540.00	0.05
453	603290	斯达半导	67,960	6,104,167.20	0.05
454	688005	容百科技	191,843	6,052,646.65	0.05
455	300676	华大基因	141,600	5,942,952.00	0.05
456	000887	中鼎股份	446,600	5,859,392.00	0.05
457	000818	航锦科技	306,700	5,857,970.00	0.05
458	601866	中远海发	2,238,900	5,843,529.00	0.05
459	002368	太极股份	245,981	5,824,830.08	0.05
460	600667	太极实业	833,400	5,767,128.00	0.04
461	300595	欧普康视	303,700	5,755,115.00	0.04
462	002508	老板电器	266,300	5,706,809.00	0.04
463	002240	盛新锂能	413,900	5,703,542.00	0.04
464	600755	厦门国贸	857,700	5,695,128.00	0.04
465	002831	裕同科技	209,600	5,680,160.00	0.04
466	002572	索菲亚	326,200	5,604,116.00	0.04
467	300438	鹏辉能源	198,400	5,577,024.00	0.04
468	300573	兴齐眼药	79,600	5,554,488.00	0.04
469	600258	首旅酒店	378,600	5,554,062.00	0.04
470	002268	电科网安	334,300	5,432,375.00	0.04
471	600129	太极集团	219,600	5,428,512.00	0.04
472	000547	航天发展	722,200	5,279,282.00	0.04
473	600771	广誉远	276,200	5,209,132.00	0.04
474	600399	抚顺特钢	892,000	5,173,600.00	0.04
475	601636	旗滨集团	910,400	5,107,344.00	0.04
476	600499	科达制造	651,300	5,080,140.00	0.04
477	002544	普天科技	230,100	4,931,043.00	0.04
478	000035	中国天楹	990,100	4,821,787.00	0.04
479	603650	彤程新材	136,000	4,755,920.00	0.04
480	600884	杉杉股份	637,700	4,750,865.00	0.04
481	300769	德方纳米	127,200	4,691,136.00	0.04
482	002266	浙富控股	1,475,600	4,603,872.00	0.04
483	002372	伟星新材	359,800	4,544,274.00	0.04
484	603688	石英股份	153,750	4,417,237.50	0.03
485	603882	金域医学	157,800	4,344,234.00	0.03
486	002292	奥飞娱乐	501,800	4,340,570.00	0.03
487	300457	赢合科技	219,500	4,201,230.00	0.03
488	002541	鸿路钢构	233,350	4,183,965.50	0.03
489	603456	九洲药业	303,200	4,147,776.00	0.03
490	002091	江苏国泰	552,400	4,043,568.00	0.03
491	688390	固德威	96,347	3,940,592.30	0.03

492	688063	派能科技	97,448	3,902,792.40	0.03
493	603588	高能环境	688,100	3,605,644.00	0.03
494	000967	盈峰环境	715,400	3,555,538.00	0.03
495	002081	金螳螂	900,600	3,215,142.00	0.03
496	600315	上海家化	189,200	3,199,372.00	0.02
497	600167	联美控股	517,720	2,966,535.60	0.02
498	600007	中国国贸	114,400	2,798,224.00	0.02
499	001914	招商积余	239,100	2,527,287.00	0.02
500	600335	国机汽车	337,900	2,105,117.00	0.02

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

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	772,914,494.06	6.02
2	601318	中国平安	411,929,815.98	3.21
3	600036	招商银行	308,890,819.42	2.41
4	600900	长江电力	225,508,424.48	1.76
5	600030	中信证券	197,301,387.62	1.54
6	601899	紫金矿业	180,145,079.12	1.40
7	601166	兴业银行	178,217,359.38	1.39
8	600276	恒瑞医药	146,609,093.89	1.14
9	601398	工商银行	142,785,529.66	1.11
10	688981	中芯国际	131,466,517.69	1.02
11	601328	交通银行	130,171,573.90	1.01
12	688041	海光信息	122,038,505.67	0.95
13	600887	伊利股份	119,851,793.96	0.93
14	601816	京沪高铁	109,618,574.00	0.85
15	300750	宁德时代	104,605,871.58	0.82
16	601288	农业银行	101,396,549.00	0.79
17	600309	万华化学	95,075,005.17	0.74
18	601601	中国太保	88,441,041.51	0.69
19	601088	中国神华	87,899,547.00	0.68
20	603259	药明康德	87,695,825.41	0.68

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	600519	贵州茅台	211,577,733.20	1.65

2	002371	北方华创	89,397,449.16	0.70
3	601318	中国平安	65,075,011.80	0.51
4	688041	海光信息	56,728,694.55	0.44
5	600036	招商银行	41,831,956.04	0.33
6	601328	交通银行	33,075,185.00	0.26
7	688981	中芯国际	32,674,769.88	0.25
8	002304	洋河股份	32,659,861.00	0.25
9	600900	长江电力	31,439,544.00	0.24
10	600030	中信证券	29,937,638.55	0.23
11	000858	五粮液	28,871,738.00	0.22
12	688008	澜起科技	28,449,451.13	0.22
13	601899	紫金矿业	26,300,374.00	0.20
14	601166	兴业银行	24,499,426.00	0.19
15	300394	天孚通信	24,474,612.00	0.19
16	600157	永泰能源	23,913,305.00	0.19
17	300760	迈瑞医疗	23,085,427.30	0.18
18	600276	恒瑞医药	22,804,038.76	0.18
19	601398	工商银行	20,212,708.00	0.16
20	300782	卓胜微	19,717,620.80	0.15

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	10,796,537,832.47
卖出股票收入（成交）总额	2,534,545,978.53

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，中信证券股份有限公司出现本期被监管部门立案调查，中信证券股份有限公司、招商银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

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中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

无。

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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

无。

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

无。

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

9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户	户均持有的	持有人结构
------	-------	-------

数（户）	基金份额	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（%）
22,278	589,780.20	12,095,580,750.00	92.06	1,043,542,607.00	7.94

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	4,754,000,000.00	36.18

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	国泰君安证券股份有限公司	787,668,725.00	5.99
2	大家人寿保险股份有限公司—万能产品	403,946,500.00	3.07
3	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	313,280,249.00	2.38
4	华泰证券股份有限公司	259,449,273.00	1.97
5	中国国际金融股份有限公司	253,420,104.00	1.93
6	中诚信托有限责任公司	239,779,674.00	1.82
7	新华人寿保险股份有限公司	222,228,683.00	1.69
8	中信证券股份有限公司	210,519,854.00	1.60
9	方正证券股份有限公司	203,550,290.00	1.55
10	嘉实基金管理有限公司	200,013,611.00	1.52
11	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	4,754,000,000.00	36.18

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	21,001.00	0.00

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
张超梁	公募基金	0
	私募资产管理计划	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024 年 9 月 20 日）基金份额总额	2,000,123,357.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	12,996,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,857,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,139,123,357.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内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

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2024 年 8 月 9 日本基金管理人发布公告，赵学军先生辞任公司董事长，由联席董事长安国勇先生代行公司董事长职责。

2024 年 9 月 19 日本基金管理人发布公告，安国勇先生任公司董事长。

2024 年 12 月 4 日本基金管理人发布公告，张峰先生离任公司副总经理、郭杰先生离任机构首席投资官。

2024 年 12 月 19 日本基金管理人发布公告，鲁令飞先生任公司副总经理、张敏女士任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，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

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

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

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）会计师事务所为本基金提供审计服务，自 2024 年 11 月 16 日起，改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）会计师事务所为本基金提供审计服务。报告年度应支付容诚会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 48,000.00 元，该审计机构第 1 年提供审计服务。

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，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰君安证券股份有限公司	8	13,331,083,811.00	100.00	2,478,362.48	100.00	新增

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；

- (3) 合规风控能力较强；
- (4) 交易服务能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3. 本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《嘉实基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

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(%)
国泰君安证券股份有限公司	511,613.89	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	关于增加中信建投等为嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金网下认购销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 9 月 10 日
2	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金提前结束募集的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 9 月 13 日
3	关于嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金认购申请确认比例结果的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 9 月 14 日
4	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 9 月 21 日
5	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 10 月 10 日
6	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 10 月 10 日
7	关于嘉实中证 A500 交易型开放式指	中国证券报、基金管理	2024 年 10 月 15 日

	数证券投资基金流动性服务商的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
8	关于嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 10 月 15 日
9	关于嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 10 月 30 日
10	关于嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 4 日
11	关于嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 7 日
12	关于嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 11 日
13	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 16 日
14	关于嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 29 日
15	关于嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 6 日
16	关于嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 30 日
17	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 31 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(%)
联接基金	1	2024-11-14 至 2024-12-31	-	4,878,000,000.00	124,000,000.00	4,754,000,000.00	36.18
产品特有风险							

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

注：申购份额包括申购、转换转入、红利再投或份额拆分等导致增加的份额，赎回份额包括赎回、转换转出或份额合并等导致减少的份额。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

13.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

13.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2025 年 3 月 28 日