

中创 400 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商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 01 月 01 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	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 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	16
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22

§ 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	49
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	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61
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	61
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	61
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
8.12 投资组合报告附注	62
§ 9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末上市基金前十名持有人	63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
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	63
§ 10 开放式基金份额变动	64
§ 11 重大事件揭示	64
11.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4 基金投资策略的改变	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
11.8 其他重大事件	72
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
§ 13 备查文件目录	73
13.1 备查文件目录	73
13.2 存放地点	73
13.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中创 400 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中创 400ETF
场内简称	中创 400ETF
基金主代码	159918
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 3 月 22 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	40,561,264.00 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	2012 年 5 月 11 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，在正常市场情况下，本基金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。但在因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，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。 在正常市场情况下，本基金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%。如因标的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正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。 对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。
业绩比较基准	中创 400 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场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		嘉实基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露	姓名	郭松	郭明

负责人	联系电话	(010)65215588	(010)66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95588
传真		(010)65215588	(010)66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100020	100140
法定代表人		经雷	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	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	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
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	2023 年	2022 年
本期已实现收益	-4,257,024.26	537,234.53	-4,727.86
本期利润	3,552,733.01	-2,156,878.35	-17,934,252.19
加权平均基金份额本期利润	0.0960	-0.0630	-0.5363
本期加权平均净值利润率	6.01%	-3.43%	-28.49%
本期基金份额净值增长率	6.49%	-3.80%	-23.64%

3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	32,842,799.69	24,871,905.80	25,727,443.36
期末可供分配基金份额利润	0.8097	0.6994	0.7666
期末基金资产净值	73,404,063.69	60,433,169.80	59,288,707.36
期末基金份额净值	1.8097	1.6994	1.7666
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	80.97%	69.94%	76.66%

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。

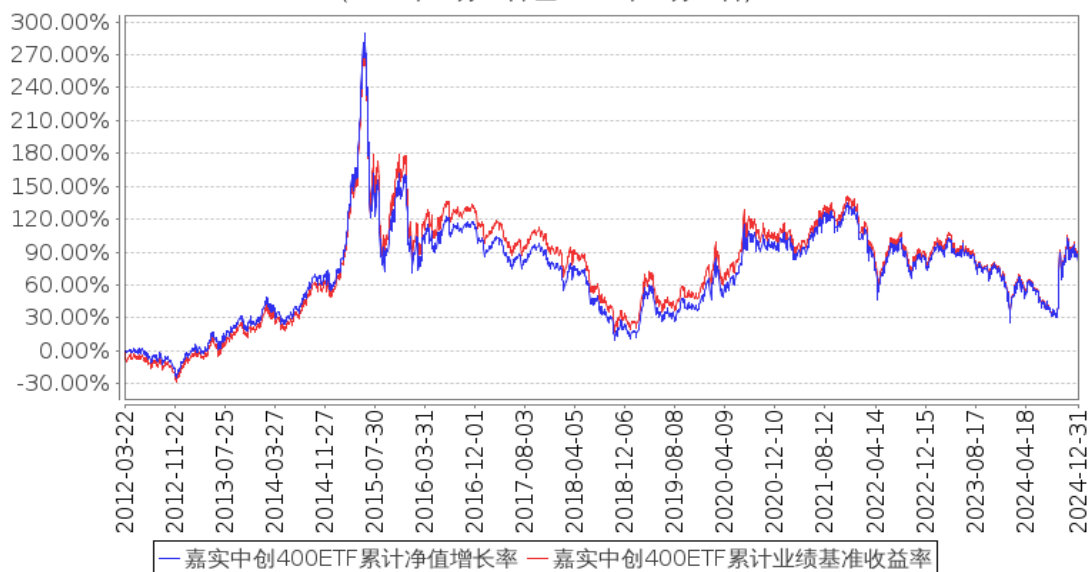
3.2 基金净值表现

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	4.98%	2.54%	5.31%	2.57%	-0.33%	-0.03%
过去六个月	24.45%	2.38%	25.19%	2.42%	-0.74%	-0.04%
过去一年	6.49%	2.19%	6.61%	2.23%	-0.12%	-0.04%
过去三年	-21.77%	1.66%	-23.19%	1.69%	1.42%	-0.03%
过去五年	19.91%	1.62%	13.10%	1.64%	6.81%	-0.02%
自基金合同生效起至今	80.97%	1.70%	83.14%	1.73%	-2.17%	-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

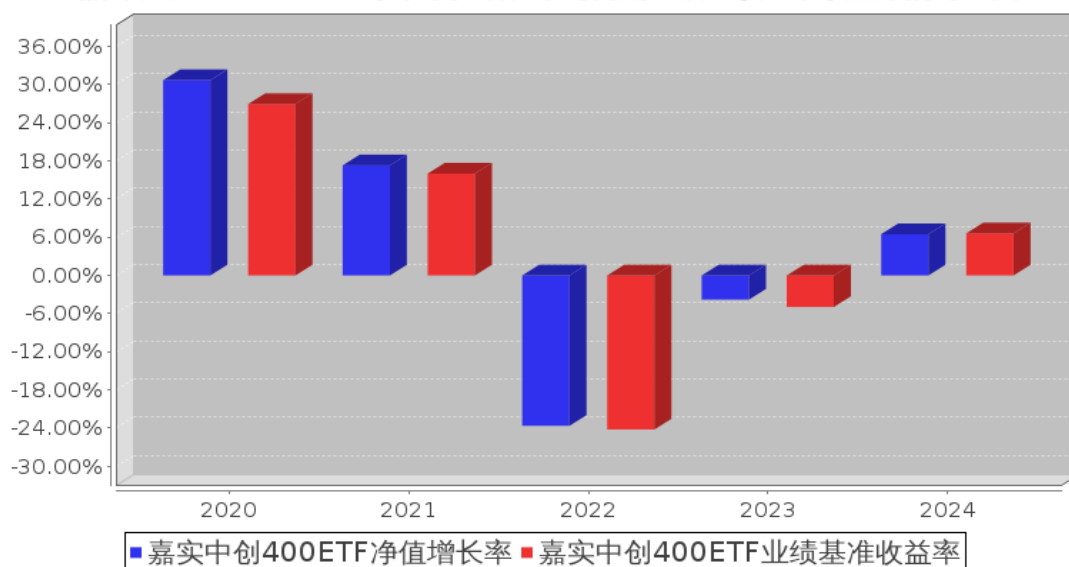
嘉实中创400ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年03月22日至2024年12月31日)



注：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起 3 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实中创400ETF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：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		
张超梁	本基金、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、嘉实中证 A500ETF 联接基金经理	2024 年 2 月 1 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。

田光远	本基金、嘉实中证软件服务ETF、嘉实中证稀土产业ETF、嘉实中证电池主题ETF、嘉实中证稀土产业ETF联接、嘉实中证新能源ETF、嘉实中证稀有金属主题ETF、嘉实中证软件服务ETF联接、嘉实中证海外中国互联网30ETF（QDII）、嘉实中证稀有金属主题ETF发起联接、嘉实中证芯片产业指数发起式、嘉实中证电池主题ETF发起联接、嘉实上证科创板芯片ETF、嘉实上证科创板芯片ETF发起联接、嘉实北证50	2021年9月4日	2024年2月1日	9年	曾任华创证券有限责任公司资产管理部量化研究员，2017年4月加入嘉实基金管理有限公司指数投资部，从事指数基金投资研究工作。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
-----	--	-----------	-----------	----	---

	成份指数、嘉实中证全指集成电路ETF、嘉实中证机器人ETF基金经理				
--	-----------------------------------	--	--	--	--

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、《中创 400 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

本基金跟踪中小创业企业 400 指数，由中创 500 指数剔除同期中创 100 指数成份股后余下的 400 只股票组成，反映中小板和创业板中正处于高成长阶段的企业整体状况。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。

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.04%，年化跟踪误差为 0.69%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.20% 的限制。

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 1.8097 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.49%，业绩

比较基准收益率为 6.61%。

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，财富效应有助于进一步刺激内需。

本基金作为一只投资于中小创业企业 400 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小创业企业 400 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

报告期内，本基金存在连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2024 年 8 月 1 日至 2024 年 9 月 25 日；未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情形。

§ 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(25)第 P00461 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	中创 400 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	我们审计了中创 400 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了中创 400 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中创 400 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括中创 400 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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而导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中创 400 交易型开放式指数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，除非基金管理人管理层计划清算中创 400 交易型开放式指数证券投资

	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中创 400 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价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，就可能导致对中创 400 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中创 400 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与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	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	汪芳	姜金玲
会计师事务所的地址	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼	
审计报告日期	2025 年 03 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中创 400 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	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	869,085.30	1,158,138.53
结算备付金		3,260.15	785.49
存出保证金		453.55	427.32
交易性金融资产	7.4.7.2	72,643,953.63	59,494,142.34
其中：股票投资		72,643,953.63	59,494,142.34
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		-	7,420.61
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		73,516,752.63	60,660,914.29
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		32,736.42	25,263.30
应付托管费		6,547.29	5,052.64
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	73,405.23	197,428.55
负债合计		112,688.94	227,744.49
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	40,561,264.00	35,561,264.00
未分配利润	7.4.7.12	32,842,799.69	24,871,905.80
净资产合计		73,404,063.69	60,433,169.80
负债和净资产总计		73,516,752.63	60,660,914.29

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.8097 元，基金份额总额 40,561,264.00 份。

7.2 利润表

会计主体：中创 400 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		4,130,994.98	-1,518,753.08
1. 利息收入		4,129.93	4,354.55
其中：存款利息收入	7.4.7.13	4,129.93	4,354.55
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）		-3,691,113.41	1,171,371.29
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-4,479,719.08	573,297.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	8,242.43
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	788,605.67	589,831.79
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	7,809,757.27	-2,694,112.88
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	8, 221. 19	-366. 04
减：二、营业总支出		578, 261. 97	638, 125. 27
1. 管理人报酬	7. 4. 10. 2. 1	295, 306. 15	314, 934. 35
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7. 4. 10. 2. 2	59, 061. 22	62, 986. 92
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		-	-
8. 其他费用	7. 4. 7. 23	223, 894. 60	260, 204. 00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		3, 552, 733. 01	-2, 156, 878. 35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		3, 552, 733. 01	-2, 156, 878. 35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3, 552, 733. 01	-2, 156, 878. 35

7.3 净资产变动表

会计主体：中创 400 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	35, 561, 264. 00	-	24, 871, 905. 80	60, 433, 169. 80
二、本期期初净资产	35, 561, 264. 00	-	24, 871, 905. 80	60, 433, 169. 80
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	5, 000, 000. 00	-	7, 970, 893. 89	12, 970, 893. 89
（一）、综合收益总额	-	-	3, 552, 733. 01	3, 552, 733. 01
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以	5, 000, 000. 00	-	4, 418, 160. 88	9, 418, 160. 88

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	30,000,000.00	-	18,350,325.51	48,350,325.51
2. 基金赎回款	-25,000,000.00	-	-13,932,164.63	-38,932,164.63
(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	40,561,264.00	-	32,842,799.69	73,404,063.69
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	33,561,264.00	-	25,727,443.36	59,288,707.36
二、本期期初净资产	33,561,264.00	-	25,727,443.36	59,288,707.36
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,000,000.00	-	-855,537.56	1,144,462.44
(一)、综合收益总额	-	-	-2,156,878.35	-2,156,878.35
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列)	2,000,000.00	-	1,301,340.79	3,301,340.79
其中：1. 基金申购款	7,000,000.00	-	6,034,614.92	13,034,614.92
2. 基金赎回款	-5,000,000.00	-	-4,733,274.13	-9,733,274.13
(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	35,561,264.00	-	24,871,905.80	60,433,169.80

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

中创 400 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[2012]13 号《关于核准中创 400 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,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《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型交易型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 3 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 286,561,264.00 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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、应用指南、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”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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。

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

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以

公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分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。

金融资产的合同条款规定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，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产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。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

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。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产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，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为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。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，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的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准

备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)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

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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，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) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

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，且目前可执行该种法定权利，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基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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。

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认列，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) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

(3) 公允价值变动收益

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。

(4) 信用减值损失

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信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

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

(1) 每份基金份额享有同等分配权；

(2) 基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管

理人有权进行收益分配；

(3) 在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 6 次，每次基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(4) 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，即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；

(5) 本基金收益分配采取现金方式；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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、债券免征增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税;

(2) 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,暂不缴纳企业所得税;

(3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，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)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；对于基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税；

(5)本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	869,085.30	1,158,138.53
等于：本金	868,993.43	1,158,026.50
加：应计利息	91.87	112.03
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	869,085.30	1,158,138.53

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		72,057,549.10	-	72,643,953.63	586,404.53
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		72,057,549.10	-	72,643,953.63	586,404.53
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		66,717,495.08	-	59,494,142.34	-7,223,352.74
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		66,717,495.08	-	59,494,142.34	-7,223,352.74

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	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	3,405.23	7,428.55
其中：交易所市场	3,405.23	7,428.55
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	35,000.00	120,000.00
应付指数使用费	35,000.00	70,000.00

合计	73,405.23	197,428.55
----	-----------	------------

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,561,264.00	35,561,264.00
本期申购	30,000,000.00	30,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-25,000,000.00	-25,000,000.00
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	40,561,264.00	40,561,264.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	35,163,371.31	-10,291,465.51	24,871,905.80
本期期初	35,163,371.31	-10,291,465.51	24,871,905.80
本期利润	-4,257,024.26	7,809,757.27	3,552,733.01
本期基金份额交易产生的变动数	4,689,246.59	-271,085.71	4,418,160.88
其中：基金申购款	26,895,078.55	-8,544,753.04	18,350,325.51
基金赎回款	-22,205,831.96	8,273,667.33	-13,932,164.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,595,593.64	-2,752,793.95	32,842,799.69

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	3,980.55	4,222.78
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	145.08	123.84
其他	4.30	7.93

合计	4,129.93	4,354.55
----	----------	----------

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	959,131.92	354,092.18
股票投资收益——赎回差价收入	-5,438,851.00	219,204.89
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	-4,479,719.08	573,297.07

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出股票成交总额	15,775,001.49	12,078,229.08
减：卖出股票成本总额	14,792,779.84	11,697,278.85
减：交易费用	23,089.73	26,858.05
买卖股票差价收入	959,131.92	354,092.18

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1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
赎回基金份额对价总额	38,932,164.63	9,733,274.13
减：现金支付赎回款总额	59,959.63	27,542.13
减：赎回股票成本总额	44,311,056.00	9,486,527.11
减：交易费用	-	-

赎回差价收入	-5,438,851.00	219,204.89
--------	---------------	------------

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1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	-	2.96
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	8,239.47
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	-	8,242.43

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	33,443.76
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	25,200.00
减：应计利息总额	-	2.96
减：交易费用	-	1.33
买卖债券差价收入	-	8,239.47

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 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	788,605.67	589,831.79

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	788,605.67	589,831.79

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	7,809,757.27	-2,694,112.88
股票投资	7,809,757.27	-2,694,112.88
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	7,809,757.27	-2,694,112.88

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	8,221.19	-366.04
合计	8,221.19	-366.04

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	35,000.00	40,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-

银行划款手续费	269.00	204.00
指数使用费	108,625.60	140,000.00
合计	223,894.60	260,204.00

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

无。

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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
嘉实中创 400 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“嘉实中创 400ETF 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 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	295,306.15	314,934.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	86.73	-
应支付基金管理人的净管理费	295,219.42	314,934.35

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 0.50%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×0.50%/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 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	59,061.22	62,986.92

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/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

无。

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		上年度末 2023 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（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
嘉实中创 400ETF联接	34,787,908.00	85.77	31,414,808.00	88.34

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限 公司_活期	869,085.30	3,980.55	1,158,138.53	4,222.78

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

无。

7.4.11 利润分配情况

本期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日），本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务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行合同责任，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约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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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	869,085.30	-	-	-	869,085.30
结算备付金	3,260.15	-	-	-	3,260.15
存出保证金	453.55	-	-	-	453.55
交易性金融资产	-	-	-	72,643,953.63	72,643,953.63
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	872,799.00	-	-	72,643,953.63	73,516,752.63
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	32,736.42	32,736.42
应付托管费	-	-	-	6,547.29	6,547.29
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	-	-	-	73,405.23	73,405.23
负债总计	-	-	-	112,688.94	112,688.94
利率敏感度缺口	872,799.00	-	-	72,531,264.69	73,404,063.69
上年度末 2023 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	1,158,138.53	-	-	-	1,158,138.53
结算备付金	785.49	-	-	-	785.49
存出保证金	427.32	-	-	-	427.32
交易性金融资产	-	-	-	59,494,142.34	59,494,142.34
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	7,420.61	7,420.61
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	1,159,351.34	-	-	59,501,562.95	60,660,914.29
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	25,263.30	25,263.30
应付托管费	-	-	-	5,052.64	5,052.64
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	-	-	-	197,428.55	197,428.55
负债总计	-	-	-	227,744.49	227,744.49
利率敏感度缺口	1,159,351.34	-	-	59,273,818.46	60,433,169.80

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）	上年度末（2023 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）	上年度末（2023 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		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	72,643,953.63	98.96	59,494,142.34	98.45
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	72,643,953.63	98.96	59,494,142.34	98.45

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）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	3,610,843.33	2,949,420.78
	业绩比较基准下降 5%	-3,610,843.33	-2,949,420.78

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	72,643,953.63	59,421,247.58
第二层次	-	-
第三层次	-	72,894.76
合计	72,643,953.63	59,494,142.34

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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，本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

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	72,894.76	72,894.76
当期购买	-	-	-

当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	62,609.22	62,609.22
当期利得或损失总额	-	-10,285.54	-10,285.54
其中：计入损益的利得或损失	-	-10,285.54	-10,285.54
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
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	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	61,092.77	61,092.77
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	11,801.99	11,801.99
其中：计入损益的利得或损失	-	11,801.99	11,801.99
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	72,894.76	72,894.76
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	-	11,801.99	11,801.99

注：1. 本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。

2. 计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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	采用的估值	不可观察输入值
----	-------	-------	---------

	价值	技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	72,894.76	平均价格亚式期权模型	预期波动率	14.62%-58.19%	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

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(上年度末：无)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

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	72,643,953.63	98.81
	其中：股票	72,643,953.63	98.81
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	872,345.45	1.19
8	其他各项资产	453.55	0.00
9	合计	73,516,752.63	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	980,324.02	1.34
B	采矿业	842,280.00	1.15
C	制造业	49,291,369.71	67.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	288,955.04	0.39
E	建筑业	458,252.60	0.62
F	批发和零售业	1,434,170.15	1.95
G	交通运输、仓储和邮政业	384,412.60	0.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,566,594.22	14.40
J	金融业	3,665,479.25	4.99
K	房地产业	260,727.00	0.36
L	租赁和商务服务业	1,187,618.86	1.62
M	科学研究和技术服务业	1,011,418.00	1.38
N	水利、环境和公共设施管理业	337,656.00	0.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	307,020.00	0.42
Q	卫生和社会工作	419,578.00	0.57
R	文化、体育和娱乐业	1,193,213.18	1.63
S	综合	-	-
	合计	72,629,068.63	98.94

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,885.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,885.00	0.02

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	300339	润和软件	14,500	725,435.00	0.99
2	002456	欧菲光	54,000	646,920.00	0.88
3	002797	第一创业	73,500	613,725.00	0.84
4	002185	华天科技	48,700	565,407.00	0.77
5	002273	水晶光电	22,880	508,393.60	0.69
6	002966	苏州银行	59,760	484,653.60	0.66
7	002281	光迅科技	9,212	480,590.04	0.65
8	002085	万丰奥威	25,300	479,435.00	0.65
9	300476	胜宏科技	11,080	466,357.20	0.64
10	002517	恺英网络	33,700	458,657.00	0.62
11	300803	指南针	4,700	450,965.00	0.61
12	300058	蓝色光标	48,200	447,296.00	0.61
13	300474	景嘉微	4,750	444,077.50	0.60
14	300757	罗博特科	1,900	428,108.00	0.58
15	002444	巨星科技	13,200	427,020.00	0.58
16	002738	中矿资源	12,000	426,000.00	0.58
17	002851	麦格米特	6,900	424,074.00	0.58

18	002353	杰瑞股份	11,400	421,686.00	0.57
19	002138	顺络电子	13,094	412,199.12	0.56
20	300017	网宿科技	38,800	410,116.00	0.56
21	300002	神州泰岳	35,000	405,650.00	0.55
22	002405	四维图新	41,900	403,916.00	0.55
23	300024	机器人	22,400	402,080.00	0.55
24	300496	中科创达	6,700	399,052.00	0.54
25	002195	岩山科技	99,400	394,618.00	0.54
26	002008	大族激光	15,600	390,000.00	0.53
27	300136	信维通信	15,300	389,232.00	0.53
28	002465	海格通信	35,400	388,692.00	0.53
29	002595	豪迈科技	7,740	388,470.60	0.53
30	300114	中航电测	5,400	387,612.00	0.53
31	002472	双环传动	12,500	382,750.00	0.52
32	002673	西部证券	46,600	379,790.00	0.52
33	300383	光环新网	26,000	379,340.00	0.52
34	002157	正邦科技	128,000	373,760.00	0.51
35	300142	沃森生物	30,700	370,856.00	0.51
36	002261	拓维信息	19,700	360,707.00	0.49
37	300346	南大光电	9,270	357,729.30	0.49
38	300037	新宙邦	9,280	347,443.20	0.47
39	301358	湖南裕能	7,600	344,432.00	0.47
40	300699	光威复材	9,940	344,421.00	0.47
41	002837	英维克	8,490	342,996.00	0.47
42	300604	长川科技	7,700	339,801.00	0.46
43	300054	鼎龙股份	13,029	339,014.58	0.46
44	002131	利欧股份	109,354	337,903.86	0.46
45	300458	全志科技	8,630	334,498.80	0.46
46	300012	华测检测	26,600	330,638.00	0.45
47	002850	科达利	3,300	322,344.00	0.44
48	300724	捷佳伟创	5,000	316,050.00	0.43
49	002436	兴森科技	28,328	314,724.08	0.43
50	300073	当升科技	7,700	310,156.00	0.42
51	300857	协创数据	2,900	309,981.00	0.42
52	300085	银之杰	8,100	309,825.00	0.42
53	002409	雅克科技	5,300	307,135.00	0.42
54	002607	中公教育	90,300	307,020.00	0.42
55	002410	广联达	26,000	305,760.00	0.42
56	300395	菲利华	8,100	304,641.00	0.42
57	300459	汤姆猫	53,023	304,352.02	0.41
58	002583	海能达	21,390	303,951.90	0.41
59	300001	特锐德	13,674	300,144.30	0.41
60	300679	电连技术	5,000	298,500.00	0.41

61	002558	巨人网络	23,100	293,139.00	0.40
62	002065	东华软件	40,000	290,400.00	0.40
63	002312	川发龙蟒	20,000	289,400.00	0.39
64	300623	捷捷微电	8,350	285,236.00	0.39
65	002152	广电运通	24,400	284,504.00	0.39
66	002739	万达电影	23,200	281,648.00	0.38
67	002318	久立特材	11,900	278,579.00	0.38
68	300315	掌趣科技	50,200	276,100.00	0.38
69	002568	百润股份	9,800	274,498.00	0.37
70	300627	华测导航	6,560	274,208.00	0.37
71	002139	拓邦股份	20,100	273,561.00	0.37
72	002402	和而泰	15,100	273,461.00	0.37
73	300364	中文在线	11,100	272,283.00	0.37
74	002126	银轮股份	14,534	272,076.48	0.37
75	300666	江丰电子	3,900	270,855.00	0.37
76	002624	完美世界	25,800	266,514.00	0.36
77	002841	视源股份	7,200	265,752.00	0.36
78	002984	森麒麟	10,620	261,889.20	0.36
79	002385	大北农	60,200	260,666.00	0.36
80	300558	贝达药业	4,800	258,864.00	0.35
81	300454	深信服	4,500	258,300.00	0.35
82	002025	航天电器	5,304	257,562.24	0.35
83	300763	锦浪科技	4,200	256,494.00	0.35
84	002044	美年健康	55,300	253,827.00	0.35
85	300088	长信科技	38,800	253,752.00	0.35
86	300390	天华新能	11,000	253,550.00	0.35
87	300285	国瓷材料	14,800	252,192.00	0.34
88	300255	常山药业	12,500	249,875.00	0.34
89	002262	恩华药业	10,253	249,660.55	0.34
90	300296	利亚德	38,300	246,652.00	0.34
91	002958	青农商行	80,900	245,936.00	0.34
92	002432	九安医疗	6,000	244,680.00	0.33
93	300182	捷成股份	41,614	244,274.18	0.33
94	300253	卫宁健康	34,000	243,440.00	0.33
95	002155	湖南黄金	15,400	242,242.00	0.33
96	300115	长盈精密	14,866	241,423.84	0.33
97	300529	健帆生物	8,200	240,588.00	0.33
98	300373	扬杰科技	5,500	239,360.00	0.33
99	002222	福晶科技	7,380	239,112.00	0.33
100	002407	多氟多	19,880	238,560.00	0.32
101	002429	兆驰股份	41,000	236,980.00	0.32
102	300567	精测电子	3,600	231,480.00	0.32
103	002500	山西证券	36,580	229,722.40	0.31

104	002926	华西证券	27,600	229,356.00	0.31
105	300251	光线传媒	24,100	227,504.00	0.31
106	300068	南都电源	14,075	227,170.50	0.31
107	002203	海亮股份	21,100	226,825.00	0.31
108	002756	永兴材料	6,000	226,320.00	0.31
109	300487	蓝晓科技	4,725	226,185.75	0.31
110	002497	雅化集团	19,278	225,552.60	0.31
111	300568	星源材质	23,037	223,919.64	0.31
112	002683	广东宏大	8,400	222,432.00	0.30
113	300229	拓尔思	10,500	219,870.00	0.30
114	002617	露笑科技	28,600	218,790.00	0.30
115	002389	航天彩虹	12,082	218,080.10	0.30
116	002506	协鑫集成	81,300	217,071.00	0.30
117	300762	上海瀚讯	10,212	214,758.36	0.29
118	002151	北斗星通	8,077	214,363.58	0.29
119	002176	江特电机	28,800	213,408.00	0.29
120	300432	富临精工	13,800	212,244.00	0.29
121	002145	中核钛白	49,495	209,858.80	0.29
122	300212	易华录	8,917	208,657.80	0.28
123	002439	启明星辰	13,000	205,660.00	0.28
124	002507	涪陵榨菜	14,510	205,026.30	0.28
125	300677	英科医疗	8,100	204,768.00	0.28
126	300748	金力永磁	11,440	204,547.20	0.28
127	300118	东方日升	16,848	201,839.04	0.27
128	300735	光弘科技	7,200	201,528.00	0.27
129	300601	康泰生物	11,700	200,655.00	0.27
130	300070	碧水源	39,600	200,376.00	0.27
131	002416	爱施德	12,300	200,121.00	0.27
132	002373	千方科技	19,700	199,758.00	0.27
133	300674	宇信科技	10,220	199,494.40	0.27
134	002936	郑州银行	94,746	198,966.60	0.27
135	002056	横店东磁	15,300	198,288.00	0.27
136	002807	江阴银行	45,582	198,281.70	0.27
137	002075	沙钢股份	31,600	197,816.00	0.27
138	002245	蔚蓝锂芯	18,400	196,696.00	0.27
139	002831	裕同科技	7,240	196,204.00	0.27
140	002423	中粮资本	14,500	194,155.00	0.26
141	300777	中简科技	6,800	192,372.00	0.26
142	300045	华力创通	9,200	192,188.00	0.26
143	300438	鹏辉能源	6,800	191,148.00	0.26
144	002003	伟星股份	13,400	189,878.00	0.26
145	002430	杭氧股份	8,700	189,660.00	0.26
146	002701	奥瑞金	33,400	189,378.00	0.26

147	300676	华大基因	4,500	188,865.00	0.26
148	002698	博实股份	11,100	188,700.00	0.26
149	002508	老板电器	8,800	188,584.00	0.26
150	002120	韵达股份	24,900	187,248.00	0.26
151	002240	盛新锂能	13,500	186,030.00	0.25
152	002572	索菲亚	10,800	185,544.00	0.25
153	300009	安科生物	21,288	183,928.32	0.25
154	002747	埃斯顿	9,900	183,150.00	0.25
155	002249	大洋电机	30,888	181,312.56	0.25
156	002368	太极股份	7,651	181,175.68	0.25
157	300083	创世纪	27,800	180,978.00	0.25
158	300672	国科微	2,700	180,225.00	0.25
159	300294	博雅生物	5,950	180,166.00	0.25
160	002484	江海股份	10,200	179,316.00	0.24
161	002036	联创电子	18,976	178,374.40	0.24
162	002244	滨江集团	20,700	178,227.00	0.24
163	300199	翰宇药业	13,800	177,882.00	0.24
164	300827	上能电气	4,045	177,575.50	0.24
165	300595	欧普康视	9,300	176,235.00	0.24
166	300624	万兴科技	2,777	175,367.55	0.24
167	002268	电科网安	10,791	175,353.75	0.24
168	002221	东华能源	18,400	174,616.00	0.24
169	300638	广和通	8,626	173,813.90	0.24
170	002080	中材科技	13,200	172,656.00	0.24
171	301050	雷电微力	3,340	172,277.20	0.23
172	300181	佐力药业	11,200	172,032.00	0.23
173	300773	拉卡拉	9,700	171,690.00	0.23
174	300101	振芯科技	7,900	171,114.00	0.23
175	300783	三只松鼠	4,600	169,602.00	0.23
176	002270	华明装备	10,000	168,900.00	0.23
177	300573	兴齐眼药	2,416	168,588.48	0.23
178	002557	洽洽食品	5,800	168,490.00	0.23
179	300133	华策影视	23,200	167,504.00	0.23
180	301078	孩子王	14,700	167,286.00	0.23
181	300776	帝尔激光	2,608	165,816.64	0.23
182	300475	香农芯创	5,800	165,242.00	0.23
183	002335	科华数据	5,700	164,844.00	0.22
184	300775	三角防务	6,600	164,538.00	0.22
185	300035	中科电气	11,000	164,450.00	0.22
186	300456	赛微电子	9,550	164,069.00	0.22
187	300525	博思软件	10,420	162,343.60	0.22
188	002396	星网锐捷	8,493	161,282.07	0.22
189	300168	万达信息	20,300	161,182.00	0.22

190	002544	普天科技	7,484	160,382.12	0.22
191	300130	新国都	7,300	158,118.00	0.22
192	002839	张家港行	36,180	158,106.60	0.22
193	300113	顺网科技	9,400	158,014.00	0.22
194	002299	圣农发展	10,900	157,832.00	0.22
195	300811	铂科新材	2,900	156,339.00	0.21
196	300236	上海新阳	4,150	155,085.50	0.21
197	002745	木林森	17,700	154,344.00	0.21
198	002317	众生药业	12,700	154,305.00	0.21
199	002487	大金重工	7,500	153,675.00	0.21
200	300298	三诺生物	5,900	152,279.00	0.21
201	002063	远光软件	26,350	151,776.00	0.21
202	300769	德方纳米	4,100	151,208.00	0.21
203	002332	仙琚制药	15,200	151,088.00	0.21
204	300166	东方国信	16,056	150,926.40	0.21
205	300026	红日药业	39,700	150,463.00	0.20
206	002183	怡亚通	33,500	150,415.00	0.20
207	003031	中瓷电子	2,860	149,835.40	0.20
208	002372	伟星新材	11,848	149,640.24	0.20
209	002127	南极电商	33,800	148,720.00	0.20
210	300888	稳健医疗	3,520	148,121.60	0.20
211	002239	奥特佳	48,500	147,925.00	0.20
212	300087	荃银高科	12,510	147,618.00	0.20
213	002019	亿帆医药	13,700	146,864.00	0.20
214	300618	寒锐钴业	4,340	146,561.80	0.20
215	300655	晶瑞电材	15,579	145,819.44	0.20
216	301301	川宁生物	12,200	144,692.00	0.20
217	002292	奥飞娱乐	16,700	144,455.00	0.20
218	300185	通裕重工	56,100	144,177.00	0.20
219	002675	东诚药业	11,700	142,974.00	0.19
220	300036	超图软件	8,400	142,632.00	0.19
221	002948	青岛银行	36,620	142,085.60	0.19
222	002865	钧达股份	2,778	141,955.80	0.19
223	002597	金禾实业	6,200	141,546.00	0.19
224	300034	钢研高纳	9,000	140,400.00	0.19
225	002670	国盛金控	10,675	139,735.75	0.19
226	002212	天融信	21,300	137,385.00	0.19
227	002266	浙富控股	44,000	137,280.00	0.19
228	002171	楚江新材	16,700	136,940.00	0.19
229	002531	天顺风能	17,300	136,843.00	0.19
230	300049	福瑞股份	4,300	135,622.00	0.18
231	002182	宝武镁业	12,020	135,585.60	0.18
232	300576	容大感光	3,000	135,540.00	0.18

233	300327	中颖电子	5,488	134,291.36	0.18
234	002832	比音勒芬	6,262	134,069.42	0.18
235	300910	瑞丰新材	2,780	132,300.20	0.18
236	002091	江苏国泰	18,045	132,089.40	0.18
237	300079	数码视讯	24,300	131,463.00	0.18
238	002351	漫步者	7,900	130,350.00	0.18
239	300188	国投智能	9,420	129,901.80	0.18
240	300685	艾德生物	5,690	129,732.00	0.18
241	300633	开立医疗	4,400	129,316.00	0.18
242	002906	华阳集团	4,200	129,150.00	0.18
243	002100	天康生物	19,700	129,035.00	0.18
244	300613	富瀚微	2,205	128,992.50	0.18
245	002015	协鑫能科	16,600	128,816.00	0.18
246	300682	朗新集团	10,550	128,710.00	0.18
247	002541	鸿路钢构	7,110	127,482.30	0.17
248	300457	赢合科技	6,650	127,281.00	0.17
249	002004	华邦健康	28,100	127,012.00	0.17
250	002643	万润股份	10,550	126,600.00	0.17
251	002895	川恒股份	5,100	125,460.00	0.17
252	002668	TCL 智家	9,500	124,640.00	0.17
253	002192	融捷股份	3,900	124,410.00	0.17
254	002773	康弘药业	6,300	123,480.00	0.17
255	002458	益生股份	12,782	122,835.02	0.17
256	002408	齐翔腾达	24,399	122,726.97	0.17
257	002706	良信股份	15,980	122,726.40	0.17
258	301029	怡合达	4,888	120,831.36	0.16
259	002539	云图控股	15,400	120,428.00	0.16
260	002847	盐津铺子	1,910	119,566.00	0.16
261	002468	申通快递	11,800	119,534.00	0.16
262	300957	贝泰妮	2,800	119,532.00	0.16
263	002011	盾安环境	11,000	118,910.00	0.16
264	002567	唐人神	23,100	117,810.00	0.16
265	300398	飞凯材料	7,360	115,993.60	0.16
266	002324	普利特	12,100	115,313.00	0.16
267	300323	华灿光电	13,700	113,436.00	0.15
268	300747	锐科激光	5,912	113,273.92	0.15
269	002867	周大生	7,775	112,970.75	0.15
270	300641	正丹股份	4,500	111,780.00	0.15
271	002226	江南化工	20,500	111,110.00	0.15
272	002048	宁波华翔	8,800	111,056.00	0.15
273	300482	万孚生物	4,936	110,615.76	0.15
274	002605	姚记科技	4,100	109,306.00	0.15
275	002153	石基信息	15,260	108,956.40	0.15

276	300772	运达股份	8,220	108,832.80	0.15
277	300463	迈克生物	8,200	108,240.00	0.15
278	002233	塔牌集团	14,100	108,147.00	0.15
279	003021	兆威机电	1,460	107,908.60	0.15
280	300224	正海磁材	8,753	107,749.43	0.15
281	300151	昌红科技	6,300	107,100.00	0.15
282	002761	浙江建投	12,100	106,238.00	0.14
283	002237	恒邦股份	10,500	106,050.00	0.14
284	301039	中集车辆	11,700	105,885.00	0.14
285	300357	我武生物	5,200	105,664.00	0.14
286	301291	明阳电气	2,400	105,408.00	0.14
287	002061	浙江交科	25,740	105,019.20	0.14
288	301091	深城交	2,200	104,962.00	0.14
289	300602	飞荣达	5,461	104,960.42	0.14
290	002265	建设工业	4,500	104,715.00	0.14
291	002737	葵花药业	5,100	104,499.00	0.14
292	002010	传化智联	22,800	103,284.00	0.14
293	300761	立华股份	5,300	103,138.00	0.14
294	300446	航天智造	6,200	102,362.00	0.14
295	002254	泰和新材	10,840	101,896.00	0.14
296	300725	药石科技	3,030	101,808.00	0.14
297	301165	锐捷网络	1,400	101,080.00	0.14
298	002726	龙大美食	12,760	101,059.20	0.14
299	300770	新媒股份	2,500	101,025.00	0.14
300	300244	迪安诊断	8,900	101,015.00	0.14
301	002815	崇达技术	9,831	100,276.20	0.14
302	300363	博腾股份	6,300	99,351.00	0.14
303	002518	科士达	4,400	99,132.00	0.14
304	002099	海翔药业	19,172	98,927.52	0.13
305	002390	信邦制药	21,700	98,735.00	0.13
306	002563	森马服饰	13,900	97,578.00	0.13
307	300260	新莱应材	3,580	96,982.20	0.13
308	300171	东富龙	7,300	96,944.00	0.13
309	301219	腾远钴业	2,140	96,749.40	0.13
310	002635	安洁科技	6,050	96,316.00	0.13
311	002243	力合科创	11,800	95,108.00	0.13
312	301071	力量钻石	2,620	94,975.00	0.13
313	301498	乖宝宠物	1,200	93,984.00	0.13
314	002081	金螳螂	26,300	93,891.00	0.13
315	300393	中来股份	15,000	93,750.00	0.13
316	301095	广立微	1,800	93,726.00	0.13
317	002038	双鹭药业	12,500	93,375.00	0.13
318	300841	康华生物	1,700	92,684.00	0.13

319	300705	九典制药	5,100	91,545.00	0.12
320	301155	海力风电	1,700	90,627.00	0.12
321	300855	图南股份	4,090	89,652.80	0.12
322	002690	美亚光电	5,960	88,327.20	0.12
323	301035	润丰股份	1,800	87,696.00	0.12
324	002993	奥海科技	2,100	86,100.00	0.12
325	002608	江苏国信	11,200	85,904.00	0.12
326	002626	金达威	5,600	84,560.00	0.12
327	003022	联泓新科	6,100	83,997.00	0.11
328	003035	南网能源	20,000	83,600.00	0.11
329	002511	中顺洁柔	12,240	83,354.40	0.11
330	300820	英杰电气	1,500	82,875.00	0.11
331	002146	荣盛发展	50,000	82,500.00	0.11
332	002705	新宝股份	5,400	81,000.00	0.11
333	301510	固高科技	3,100	80,910.00	0.11
334	002727	一心堂	6,200	80,724.00	0.11
335	002960	青鸟消防	6,890	80,406.30	0.11
336	002967	广电计量	4,900	80,360.00	0.11
337	002925	盈趣科技	5,130	80,335.80	0.11
338	002060	广东建工	21,900	80,154.00	0.11
339	002985	北摩高科	3,359	78,936.50	0.11
340	002859	洁美科技	3,780	78,435.00	0.11
341	300726	宏达电子	2,500	77,750.00	0.11
342	002320	海峡股份	11,852	77,630.60	0.11
343	002258	利尔化学	9,340	77,241.80	0.11
344	002101	广东鸿图	6,400	76,672.00	0.10
345	002158	汉钟精机	4,100	75,932.00	0.10
346	301205	联特科技	1,000	75,690.00	0.10
347	002041	登海种业	6,900	75,141.00	0.10
348	301363	美好医疗	2,300	74,566.00	0.10
349	002498	汉缆股份	21,900	74,241.00	0.10
350	002216	三全食品	6,160	73,920.00	0.10
351	002051	中工国际	8,940	72,950.40	0.10
352	300140	节能环保	12,000	71,880.00	0.10
353	002204	大连重工	14,400	71,712.00	0.10
354	300850	新强联	3,750	71,662.50	0.10
355	300821	东岳硅材	9,200	71,392.00	0.10
356	002545	东方铁塔	10,100	71,003.00	0.10
357	301487	盟固利	3,300	70,191.00	0.10
358	301589	诺瓦星云	400	69,440.00	0.09
359	002461	珠江啤酒	6,900	68,241.00	0.09
360	002840	华统股份	5,400	68,094.00	0.09
361	002434	万里扬	10,900	67,580.00	0.09

362	300257	开山股份	7,400	67,488.00	0.09
363	300768	迪普科技	3,850	67,375.00	0.09
364	300428	立中集团	4,100	66,830.00	0.09
365	301238	瑞泰新材	4,200	65,772.00	0.09
366	300492	华图山鼎	900	65,520.00	0.09
367	301267	华夏眼科	3,400	64,736.00	0.09
368	301536	星辰科技	800	63,920.00	0.09
369	002302	西部建设	9,600	63,168.00	0.09
370	300406	九强生物	4,700	62,792.00	0.09
371	002612	朗姿股份	3,800	62,168.00	0.08
372	300856	科思股份	2,400	61,488.00	0.08
373	300861	美畅股份	3,080	61,446.00	0.08
374	002096	易普力	4,900	58,212.00	0.08
375	301153	中科江南	2,080	58,115.20	0.08
376	301015	百洋医药	2,400	58,104.00	0.08
377	002755	奥赛康	4,500	57,195.00	0.08
378	300080	易成新能	13,000	56,810.00	0.08
379	002053	云南能投	4,900	55,860.00	0.08
380	301047	义翘神州	900	55,665.00	0.08
381	003012	东鹏控股	8,400	55,524.00	0.08
382	300723	一品红	3,200	54,592.00	0.07
383	301327	华宝新能	700	53,697.00	0.07
384	002959	小熊电器	1,100	52,701.00	0.07
385	002791	坚朗五金	2,300	52,302.00	0.07
386	002242	九阳股份	5,000	51,800.00	0.07
387	301207	华兰疫苗	2,850	49,903.50	0.07
388	301217	铜冠铜箔	4,500	49,860.00	0.07
389	301371	敷尔佳	1,200	45,348.00	0.06
390	002946	新乳业	3,000	43,530.00	0.06
391	002913	奥士康	1,800	43,398.00	0.06
392	300755	华致酒行	2,400	42,816.00	0.06
393	002911	佛燃能源	3,286	41,535.04	0.06
394	002901	大博医疗	1,300	40,092.00	0.05
395	002978	安宁股份	1,400	39,788.00	0.05
396	002534	西子洁能	3,500	38,885.00	0.05
397	301090	华润材料	5,400	37,476.00	0.05
398	003039	顺控发展	2,500	32,700.00	0.04
399	301381	赛维时代	1,400	31,864.00	0.04
400	301262	海看股份	900	22,383.00	0.03

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	400256	鹏都 5	57,250	14,885.00	0.02

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只积极投资股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002738	中矿资源	478,926.00	0.79
2	300496	中科创达	445,978.00	0.74
3	300142	沃森生物	429,124.00	0.71
4	002157	正邦科技	410,745.00	0.68
5	300085	银之杰	389,739.00	0.64
6	300757	罗博特科	387,826.00	0.64
7	002841	视源股份	294,715.00	0.49
8	300454	深信服	292,373.00	0.48
9	300724	捷佳伟创	276,082.00	0.46
10	002756	永兴材料	263,229.00	0.44
11	300255	常山药业	261,558.00	0.43
12	002432	九安医疗	257,816.00	0.43
13	002410	广联达	251,179.00	0.42
14	300601	康泰生物	220,468.00	0.36
15	300083	创世纪	217,937.00	0.36
16	300364	中文在线	207,510.00	0.34
17	301358	湖南裕能	194,304.00	0.32
18	300181	佐力药业	190,808.00	0.32
19	300763	锦浪科技	187,943.00	0.31
20	002270	华明装备	183,129.00	0.30

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002625	光启技术	1,134,980.80	1.88
2	300502	新易盛	1,021,895.50	1.69
3	002463	沪电股份	754,912.60	1.25
4	002028	思源电气	661,905.00	1.10
5	002156	通富微电	617,768.68	1.02
6	300394	天孚通信	457,752.60	0.76
7	002078	太阳纸业	454,011.00	0.75
8	002223	鱼跃医疗	422,933.00	0.70
9	002532	天山铝业	413,938.00	0.68
10	301236	软通动力	404,060.00	0.67
11	002128	电投能源	400,762.00	0.66
12	300866	安克创新	397,021.80	0.66

13	002294	信立泰	317,212.00	0.52
14	300379	东方通	205,099.80	0.34
15	301308	江波龙	200,008.00	0.33
16	300765	新诺威	191,823.00	0.32
17	002653	海思科	172,101.00	0.28
18	300573	兴齐眼药	151,630.00	0.25
19	002326	永太科技	135,416.92	0.22
20	300451	创业慧康	130,796.70	0.22

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	16,938,065.26
卖出股票收入（成交）总额	15,775,001.49

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，苏州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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	453.55
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	453.55

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

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
353	114,904.43	38,099,160.00	93.93	2,462,104.00	6.07

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（%）
嘉实中创 400 交易型开放式 指数证券投资基金联接基金	34,787,908.00	85.77

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	中信证券股份有限公司	2,595,482.00	6.40
2	海通证券股份有限公司	707,470.00	1.74
3	骆华星	215,355.00	0.53
4	沈慧娟	123,700.00	0.30
5	贾慧星	120,300.00	0.30
6	陶文明	119,100.00	0.29
7	徐隽婵	103,270.00	0.25
8	谭惠玲	100,009.00	0.25
9	李岩峰	73,800.00	0.18
10	刘亦男	63,600.00	0.16
11	嘉实中创 400 交易型开 放式指数证券投资基 金联接基金	34,787,908.00	85.77

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

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

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（2012 年 3 月 22 日） 基金份额总额	286,561,264.00
本报告期期初基金份额总额	35,561,264.00
本报告期基金总申购份额	30,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	25,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	40,561,264.00

§ 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，改聘德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）会计师事务所为本基金提供审计服务。报告年度应支付德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 35,000.00 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

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国信证券股份有限公司	2	18,875,774.36	57.70	3,519.00	26.85	-
中国国际金融股份有限公司	2	10,026,852.35	30.65	7,018.93	53.56	-
海通证券股份有限公司	2	1,087,186.19	3.32	761.07	5.81	-
开源证券股份有限公司	3	1,029,076.42	3.15	664.67	5.07	-
招商证券股份有限公司	2	850,433.26	2.60	595.36	4.54	-
广发证券股份有限公司	5	813,492.00	2.49	525.47	4.01	-
华泰证券股份有限公司	3	16,524.08	0.05	10.66	0.08	-
长江证券	2	9,853.46	0.03	6.91	0.05	-

股份有限 公司						
国泰君安 证券股份 有限公司	2	2,584.39	0.01	1.82	0.01	-
浙商证券 股份有限 公司	2	1,290.24	0.00	0.83	0.01	-
财通证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
德邦证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东方财富 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
高盛（中 国）证券有 限责任公 司	2	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国都证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国联证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国盛证券 有限责任	4	-	-	-	-	-

公司						
国投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华源证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

证券股份 有限公司						
--------------	--	--	--	--	--	--

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. 报告期内，本基金退租以下交易单元：国盛证券有限责任公司退租交易单元 2 个。国投证券股份有限公司退租交易单元 1 个。天风证券股份有限公司退租交易单元 2 个。中国中金财富证券有限公司退租交易单元 1 个。中银国际证券股份有限公司退租交易单元 1 个。

4. 报告期内，本基金新增以下交易单元：中信证券股份有限公司新增交易单元 1 个。

5. 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(%)
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
开源证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
招商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
广发证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
长江证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
财通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
德邦证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
东方证 券股份 有限公	-	-	-	-	-	-

司						
东吴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东兴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
高盛(中 国)证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
光大证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国都证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国联证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国盛证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
国投证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华宝证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华福证 券有限 责任公	-	-	-	-	-	-

司						
华金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华源证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
民生证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券 有限公 司	-	-	-	-	-	-
天风证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
兴业证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国银 河证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中国中 金财富 证券有 限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中信证 券股份 有限公	-	-	-	-	-	-

司						
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 8 日
2	关于嘉实中创 400ETF 基金经理变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 2 月 1 日
3	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、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 19 日
4	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	上海证券报、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
5	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、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 4 日
6	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、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 19 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	2024-01-01 至 2024-12-31	31,414,808.00	11,000,000.00	7,626,900.00	34,787,908.00	85.77
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) 中国证监会批准中创 400 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- (2) 《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《中创 400 交易型开放式指数证券投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内中创 400 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