

国寿安保中证 500 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：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 29 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 28 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。

本报告中的财务资料经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 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	6
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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 审计报告	12
6.1 审计报告基本信息	12
6.2 审计报告的基本内容	12
§ 7 年度财务报表	14
7.1 资产负债表	14
7.2 利润表	16
7.3 净资产变动表	17
7.4 报表附注	18
§ 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	46
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	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	61
§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	62
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
§10 开放式基金份额变动	63
§11 重大事件揭示	63
11.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
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	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 其他重大事件	66
§12 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§13 备查文件目录	66
13.1 备查文件目录	66
13.2 存放地点	67
13.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国寿安保中证 500ETF
场内简称	国寿 500ETF
基金主代码	510560
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 29 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	128,318,687.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 7 月 3 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求偏离度和误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法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近的风险收益特征。

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		国寿安保基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	韩占锋	任航
	联系电话	010-50850744	010-66060069
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4009-258-258	95599
传真		010-50850776	010-68121816
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100033	100031
法定代表人		于泳	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
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	-2,946,979.54	-4,666,306.91	-2,144,783.77
本期利润	14,769,694.31	-11,820,792.45	-51,427,151.03
加权平均基金份额本期利润	0.1119	-0.0848	-0.2991
本期加权平均净值利润率	9.30%	-6.35%	-21.56%
本期基金份额净值增长率	9.36%	-6.45%	-19.02%
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	-105,021,699.64	-130,955,930.13	-117,397,141.64
期末可供分配基金份额利润	-0.8184	-0.9333	-0.8487
期末基金资产净值	172,105,572.52	172,087,499.27	181,326,928.22
期末基金份额净值	1.3412	1.2264	1.3109
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	-37.90%	-43.21%	-39.30%

注：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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.23%	2.01%	-0.30%	2.03%	1.53%	-0.02%

过去六个月	18.69%	1.99%	15.84%	2.01%	2.85%	-0.02%
过去一年	9.36%	1.81%	5.46%	1.82%	3.90%	-0.01%
过去三年	-17.15%	1.39%	-22.20%	1.40%	5.05%	-0.01%
过去五年	18.88%	1.36%	8.70%	1.37%	10.18%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-37.90%	1.59%	-41.98%	1.61%	4.08%	-0.02%

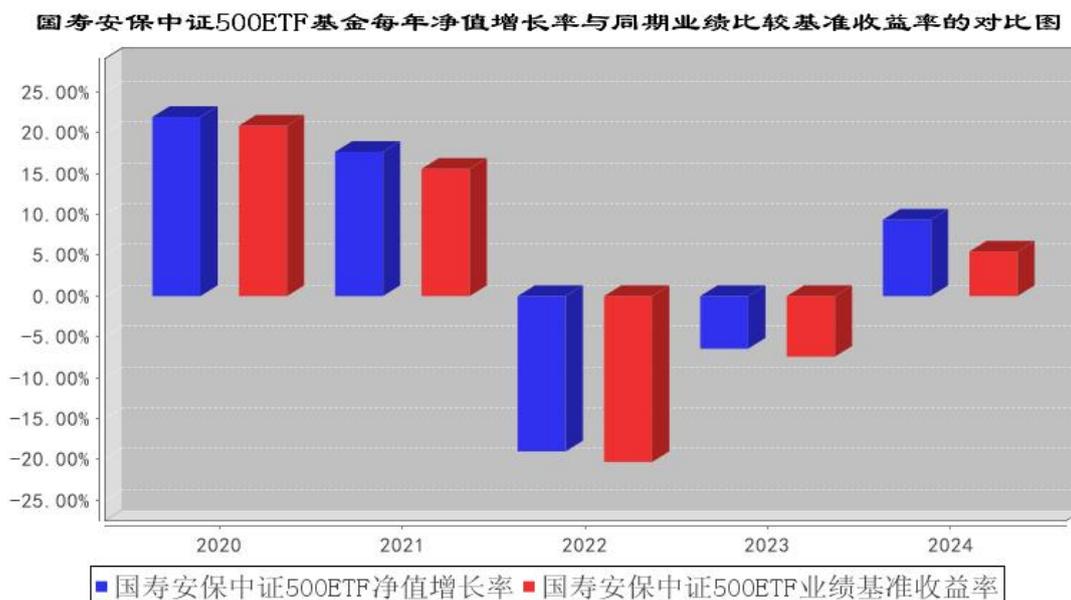
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国寿安保中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2015 年 05 月 29 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为 2015 年 05 月 29 日至 2024 年 12 月 31 日。

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



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

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可（2013）1308 号文核准，于 2013 年 10 月 29 日设立，公司注册资本 12.88 亿元人民币，公司股东为中国人寿资产管理有限公司，其持有股份 85.03%，National Mutual Funds Management Ltd.（国家共同基金管理有限公司），其持有股份 14.97%。

截至 2024 年 12 月 31 日，公司共管理 103 只公募证券投资基金和部分私募资产管理计划，公司管理资产总规模为 4191.06 亿元，其中公募证券投资基金管理规模为 3487.63 亿元。

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		
李康	基金经理	2015年5月29日	-	15年	博士研究生，曾任中国国际金融有限公司量化投资研究员、长盛基金管理有限公司金融工程研究员。2013年11月加入国寿安保基金管理有限公司，历任基金经理助理、基金经理，现任国寿安保沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保沪深300交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选88交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证沪港深300交易型开放式指数证券投资基金和国寿安保中证沪港深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金和国寿安保稳泽两年持有期混合型证券投资基金基金经理。

注：任职日期为基金合同生效日。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于基金份额持有人为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，不存在违反基金合同和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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《国寿安保基金管理有限公司公平交易制度》以及其配套实施细则。公司以科学、制衡的投资决策体系，通过完善集中交易制度、优化工作流程、加强技术手段，保证公平交易原则的实现。同时，公司通过监察稽核、盘中监控、事后分析和信息披露来加强对于公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平

交易相关制度。

本基金管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3日内、5日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了T分布检验。经分析，本报告期未发现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；且不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

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

报告期内，本基金严格遵守基金合同，紧密追踪标的指数。

本基金跟踪误差主要源自股票停牌和成份股调整等因素引起的成份股权重偏离。日常申赎和市场波动等因素，也带来一定的跟踪误差。本基金管理人采用量化分析手段，通过适当的策略尽量克服对跟踪误差不利因素的影响。并且，逐日跟踪实际组合与标的指数表现的偏离，定期分析优化跟踪偏离度管理方案。

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 1.3412 元；本报告期基金份额净值增长率为 9.36%，业绩比较基准收益率为 5.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年权益市场先抑后扬，三季末受益政策驱动叠加联储开启降息周期，市场快速上行，全年沪深 300 指数、中证 500 指数、中证 1000 指数分别上涨 14.7%、5.5% 和 1.2%，创业板指上涨 13.2%，风格方面大盘蓝筹占优。行业分化明显，银行、非银和通信等涨幅居前，医药生物、农林牧渔和食品饮料等表现一般。

展望 2025 年，前期政策稳增长带来阶段性数据企稳，市场逐步走出底部。国内经济转型高质量发展效果显著，科技行业快速赶超，后续产业升级、提振内需和财政政策发力共同作用下的经济修复路径是市场延续反弹趋势的关键。货币预计保持宽松，流动性驱动的估值提升有望转化为 ROE 驱动的盈利改善实现经济修复。外部因素

方面，美国大选落地科技封锁和关税影响不确定性增加，但联储开启降息周期外资回流新兴市场概率上升，国产替代也存在投资机会。从历史数据看，低利率背景下，当前股债收益差仍具有较高性价比，中长期资金入市也有望带来边际增量，使得 A 股市场有较好的中长期配置价值，其中受益扩大内需政策的行业、成长风格尤其是高端制造和人工智能为代表的科技创新类板块投资机会相对显著。

本基金将严格遵守基金合同，力争将对标的指数的跟踪误差降低到最小程度。

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，本基金管理人根据监管要求的发展变化以及公司业务开展情况，不断推进相关业务制度及流程的建立和完善，进一步完善公司内部控制制度体系；针对投资交易业务，建立了事前、事中、事后三层监控体系，保障基金投资交易合法合规；对基金产品的宣传推介、销售协议、营销活动等市场营销方面展开各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续秉承以基金份额持有人利益优先的原则，以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设有基金估值委员会，估值委员会负责人由主管运营工作的公司领导担任，委员由运营管理部负责人、合规管理部负责人、研究部负责人以及各投资部门负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。

上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司分别签署服务协议，其中中债金融估值中心有限公司按约定提供固定收益品种信用减值数据和在银行间同业市场交易的固定收益品种估值数据，中证指数有限公司提供在交易所市场交易的固定收益品种估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—国寿安保基金管理有限公司 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2500807 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	国寿安保中证 500 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	<p>我们审计了后附的国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“该基金”)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。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 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”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“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,我们独立于该基金,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。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>该基金管理人国寿安保基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 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。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,该基金管理人管理层负责评估该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,除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报</p>

	<p>表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价该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。</p> <p>(4) 对该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，就可能导致对该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该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该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。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	龚凯 胡东方
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
审计报告日期	2025 年 3 月 28 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国寿安保中证 500 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	2,915,921.05	2,101,931.78
结算备付金		16,379.08	10,629.17
存出保证金		6,177.49	2,762.69
交易性金融资产	7.4.7.2	169,438,460.54	170,314,102.49

其中：股票投资		169,438,460.54	170,300,902.08
基金投资		-	-
债券投资		-	13,200.41
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		-	1,358,958.00
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		172,376,938.16	173,788,384.13
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		-	1,384,953.78
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		75,255.71	72,286.24
应付托管费		15,051.14	14,457.25
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	181,058.79	229,187.59
负债合计		271,365.64	1,700,884.86
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	277,127,272.16	303,043,429.40
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-105,021,699.64	-130,955,930.13
净资产合计		172,105,572.52	172,087,499.27
负债和净资产总计		172,376,938.16	173,788,384.13

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3412 元，基金份额总额 128,318,687.00 份。

7.2 利润表

会计主体：国寿安保中证 500 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		16,001,846.64	-10,411,738.09
1. 利息收入		14,423.46	13,971.78
其中：存款利息收入	7.4.7.13	14,423.46	13,971.78
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）		-1,717,316.46	-3,268,455.71
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-4,909,860.78	-6,362,725.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	9,594.79	39,657.05
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	3,182,949.53	3,054,612.87
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-” 号填列）	7.4.7.20	17,716,673.85	-7,154,485.54
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	-11,934.21	-2,768.62
减：二、营业总支出		1,232,152.33	1,409,054.36
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	794,970.67	931,293.98
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	158,994.11	186,258.85
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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		0.06	0.11
8. 其他费用	7.4.7.23	278,187.49	291,501.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,769,694.31	-11,820,792.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,769,694.31	-11,820,792.45
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		14,769,694.31	-11,820,792.45

7.3 净资产变动表

会计主体：国寿安保中证 500 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	303,043,429.40	-	-130,955,930.13	172,087,499.27
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	303,043,429.40	-	-130,955,930.13	172,087,499.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-25,916,157.24	-	25,934,230.49	18,073.25
（一）、综合收益总额	-	-	14,769,694.31	14,769,694.31
（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）	-25,916,157.24	-	11,164,536.18	-14,751,621.06
其中：1. 基金申购款	4,319,359.53	-	-1,725,851.79	2,593,507.74
2. 基金赎回款	-30,235,516.77	-	12,890,387.97	-17,345,128.80
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	277,127,272.16	-	-105,021,699.64	172,105,572.52
	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
项目	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	298,724,069.86	-	-117,397,141.64	181,326,928.22

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	298,724,069.86	-	-117,397,141.64	181,326,928.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,319,359.54	-	-13,558,788.49	-9,239,428.95
（一）、综合收益总额	-	-	-11,820,792.45	-11,820,792.45
（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）	4,319,359.54	-	-1,737,996.04	2,581,363.50
其中：1. 基金申购款	8,638,719.07	-	-3,506,046.75	5,132,672.32
2. 基金赎回款	-4,319,359.53	-	1,768,050.71	-2,551,308.82
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	303,043,429.40	-	-130,955,930.13	172,087,499.27

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：

鄂华
基金管理人负责人

王文英
主管会计工作负责人

于晓树
会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国寿安保中证 500 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[2015]485 号《关于准予国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》注册,由国寿安保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《国寿安保中证 500 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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 665,796,867.00 元(含募集股票市值),业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2015)验字第 61090605_A03 号予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 05 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 665,869,631.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 72,764.00 份基金份额。本基金的基金管理人为国寿安保基金管理有限公司(以下简称“国寿安保”),基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书 [2015]268 号核准, 本基金 308, 318, 687.00 份基金份额于 2015 年 7 月 3 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标, 本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。在建仓完成后, 本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%, 其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于交易保证金一倍的现金, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为: 标的指数, 本基金标的指数为中证 500 指数。

本基金的基金管理人国寿安保基金管理有限公司以本基金为目标 ETF, 募集成立了国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“国寿安保中证 500ETF 联接”)。国寿中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金, 投资目标与本基金类似, 将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人国寿安保于 2025 年 3 月 28 日批准报出。

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》、《国寿安保中证 500 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

本基金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间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

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。本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。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，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

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。本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。

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

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 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。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。

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

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。

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扣除按票面利率(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后的净额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。

本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

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费（若有）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

本基金的每份基金份额享有同等分配权。本基金收益分配采取现金分红。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，基金管理人可以进行收益分配。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 12 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 个月则可不进行收益分配。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。基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本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，本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(可转换债券和可交换债券除外)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。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，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。本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

本基金在本报告期间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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。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。

(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	上年度末
	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
活期存款	2,915,921.05	2,101,931.78
等于：本金	2,915,313.10	2,101,468.11
加：应计利息	607.95	463.67
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	2,915,921.05	2,101,931.78

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	177,266,840.27	-	169,438,460.54	-7,828,379.73	
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	177,266,840.27	-	169,438,460.54	-7,828,379.73	
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	195,845,955.66	-	170,300,902.08	-25,545,053.58	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	13,200.00	0.41	13,200.41	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	13,200.00	0.41	13,200.41	0.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	195,859,155.66	0.41	170,314,102.49	-25,545,053.58

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

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	9,858.79	44,187.59
其中：交易所市场	9,858.79	44,187.59
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	136,200.00	150,000.00
应付指数使用费	35,000.00	35,000.00
合计	181,058.79	229,187.59

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	140,318,687.00	303,043,429.40
本期申购	2,000,000.00	4,319,359.53
本期赎回（以“-”号填列）	-14,000,000.00	-30,235,516.77
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	128,318,687.00	277,127,272.16

7.4.7.11 其他综合收益

本基金于本报告期末及上年度末均无其他综合收益。

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	-63,137,147.67	-67,818,782.46	-130,955,930.13
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-63,137,147.67	-67,818,782.46	-130,955,930.13
本期利润	-2,946,979.54	17,716,673.85	14,769,694.31
本期基金份额交易产生的变动数	5,562,429.21	5,602,106.97	11,164,536.18
其中：基金申购款	-956,140.71	-769,711.08	-1,725,851.79
基金赎回款	6,518,569.92	6,371,818.05	12,890,387.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-60,521,698.00	-44,500,001.64	-105,021,699.64

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	13,801.62	12,995.50
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	546.09	856.03

其他	75.75	120.25
合计	14,423.46	13,971.78

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	-3,607,085.74	-6,196,165.63
股票投资收益——赎回差价收入	-1,302,775.04	-166,560.00
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	-4,909,860.78	-6,362,725.63

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	52,270,850.41	47,778,094.73
减：卖出股票成本总额	55,794,739.91	53,851,082.46
减：交易费用	83,196.24	123,177.90
买卖股票差价收入	-3,607,085.74	-6,196,165.63

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	17,345,128.80	2,551,308.82
减：现金支付赎回款总额	8,466,322.80	1,286,688.82
减：赎回股票成本总额	10,181,581.04	1,431,180.00
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-1,302,775.04	-166,560.00

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2024年1月1日至2024 年12月31日	2023年1月1日至2023 年12月31日
债券投资收益——利息收入	21.18	31.47
债券投资收益——买卖债券(债转股及 债券到期兑付)差价收入	9,573.61	39,625.58
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	9,594.79	39,657.05

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	163,802.21	212,666.66
减：卖出债券(债转股及债券到期兑 付)成本总额	154,200.00	173,000.00
减：应计利息总额	22.05	32.57
减：交易费用	6.55	8.51
买卖债券差价收入	9,573.61	39,625.58

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资产生的收益/损失。

7.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期间及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期间及上年度可比期间均无衍生工具产生的收益/损失。

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	3,182,949.53	3,054,612.87
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,182,949.53	3,054,612.87

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至 2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至 2023年12月31日
1. 交易性金融资产	17,716,673.85	-7,154,485.54
股票投资	17,716,673.85	-7,154,485.54
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	17,716,673.85	-7,154,485.54

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	-11,934.21	-2,768.62
合计	-11,934.21	-2,768.62

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

7.4.7.22 信用减值损失

本基金于本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

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	16,200.00	30,000.00

信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	1,987.49	1,501.42
指数使用费	140,000.00	140,000.00
合计	278,187.49	291,501.42

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保	基金管理人
农业银行	基金托管人
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
国家共同基金管理有限公司（简称“国家共同基金”）	基金管理人的股东
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	基金管理人的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	与基金管理人同受集团公司控制的公司
国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”）	基金管理人的子公司
国寿安保中证 500ETF 联接	本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

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	794,970.67	931,293.98
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	794,970.67	931,293.98

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费

率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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	158,994.11	186,258.85

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均无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。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均无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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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（%）
国寿安保中证 500ETF联接	125,137,586.00	97.52	136,446,586.00	97.24

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
农业银行	2,915,921.05	13,801.62	2,101,931.78	12,995.50

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期间未进行利润分配。

7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限 期	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位： 股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备 注

001279	强邦新材	2024年9月27日	6个月	新股流通受限	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
001391	国货航	2024年12月23日	6个月	新股流通受限	2.30	6.80	1,243	2,858.90	8,452.40	-
301522	上大股份	2024年10月9日	6个月	新股流通受限	6.88	24.84	483	3,323.04	11,997.72	-
301551	无线传媒	2024年9月19日	6个月	新股流通受限	9.40	43.23	560	5,264.00	24,208.80	-
301552	科力装备	2024年7月15日	6个月	新股流通受限	30.00	56.87	117	3,510.00	6,653.79	-
301571	国科天成	2024年8月14日	6个月	新股流通受限	11.14	40.83	258	2,874.12	10,534.14	-
301585	蓝宇股份	2024年12月10日	6个月	新股流通受限	23.95	35.85	192	4,598.40	6,883.20	-
301586	佳力奇	2024年8月21日	6个月	新股流通受限	18.09	53.14	202	3,654.18	10,734.28	-
301603	乔锋智能	2024年7月3日	6个月	新股流通受限	26.50	41.98	129	3,418.50	5,415.42	-
301606	绿联科技	2024年7月17日	6个月	新股流通受限	21.21	36.49	171	3,626.91	6,239.79	-
301607	富特科技	2024年8月28日	6个月	新股流通受限	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301608	博实结	2024年7月25日	6个月	新股流通受限	44.50	65.38	83	3,693.50	5,426.54	-
301611	珂玛科技	2024年8月7日	6个月	新股流通受限	8.00	56.10	451	3,608.00	25,301.10	-
301613	新铝时代	2024年10月18日	6个月	新股流通受限	27.70	41.77	145	4,016.50	6,056.65	-
301617	博苑股份	2024年12月3日	6个月	新股流通受限	27.76	39.79	155	4,302.80	6,167.45	-
301622	英思特	2024年11月26日	6个月	新股流通受限	22.36	44.92	219	4,896.84	9,837.48	-
301626	苏州天脉	2024年10月17日	6个月	新股流通受限	21.23	65.78	622	13,205.06	40,915.16	-
301631	壹连科技	2024年11月12日	6个月	新股流通受限	72.99	101.96	65	4,744.35	6,627.40	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	7日	新股未上市	12.30	12.30	1,217	14,969.10	14,969.10	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月	新股流通受限	12.30	12.30	136	1,672.80	1,672.80	-
603091	众鑫股份	2024年9月10日	6个月	新股流通受限	26.50	44.43	66	1,749.00	2,932.38	-
603194	中力股份	2024年12	6个月	新股流	20.32	28.13	129	2,621.28	3,628.77	-

		月 17 日		通受限						
603205	健尔康	2024 年 10 月 29 日	6 个月	新股流通受限	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-
603207	小方制药	2024 年 8 月 19 日	6 个月	新股流通受限	12.47	26.65	151	1,882.97	4,024.15	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	18.65	22.61	72	1,342.80	1,627.92	-
603310	巍华新材	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股流通受限	17.39	17.95	77	1,339.03	1,382.15	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通受限	20.56	36.17	74	1,521.44	2,676.58	-
603391	力聚热能	2024 年 7 月 24 日	6 个月	新股流通受限	40.00	41.35	55	2,200.00	2,274.25	-
603395	红四方	2024 年 11 月 19 日	6 个月	新股流通受限	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688449	联芸科技	2024 年 11 月 20 日	6 个月	新股流通受限	11.25	29.44	673	7,571.25	19,813.12	-
688605	先锋精科	2024 年 12 月 4 日	6 个月	新股流通受限	11.29	53.68	600	6,774.00	32,208.00	-
688615	合合信息	2024 年 9 月 19 日	6 个月	新股流通受限	55.18	165.78	83	4,579.94	13,759.74	-
688708	佳驰科技	2024 年 11 月 27 日	6 个月	新股流通受限	27.08	48.95	286	7,744.88	13,999.70	-
688710	益诺思	2024 年 8 月 27 日	6 个月	新股流通受限	19.06	33.58	210	4,002.60	7,051.80	-
688721	龙图光罩	2024 年 7 月 30 日	6 个月	新股流通受限	18.50	56.85	202	3,737.00	11,483.70	-
688750	金天钛业	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股流通受限	7.16	15.44	1,032	7,389.12	15,934.08	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

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风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会负责公司整体风险的预防和控制，确定公司风险战略，审核、监督公司风险控制制度的有效执行，对有效的风险管理承担最终责任。董事会下设风险管理委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的风险控制及合法合规性进行审议、监督和检查。监事会对董事会、管理层履职情况进行监督。管理层对有效的风险管理承担直接责任，保证风险管理体系的持续有效运转，使公司风险管理的战略和政策要求及其各方面的具体工作落到实处。公司设督察长一名，负责牵头开展风险管理工作，监督检查公司内部风险控制情况，参与各项决策的风险评估及审批。公司设立合规管理部、监察稽核部两个独立的风险管理职能部门，由督察长领导，对督察长负责，并向督察长汇报工作。

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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本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，因而与银行存款相关的信用风

险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业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。

7.4.13.3 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，除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，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未来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	2,915,921.05	-	-	-	2,915,921.05
结算备付金	16,379.08	-	-	-	16,379.08
存出保证金	6,177.49	-	-	-	6,177.49
交易性金融资产	-	-	-	169,438,460.54	169,438,460.54
资产总计	2,938,477.62	-	-	169,438,460.54	172,376,938.16
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	75,255.71	75,255.71
应付托管费	-	-	-	15,051.14	15,051.14
其他负债	-	-	-	181,058.79	181,058.79
负债总计	-	-	-	271,365.64	271,365.64
利率敏感度缺口	2,938,477.62	-	-	169,167,094.90	172,105,572.52

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	2,101,931.78	-	-	-	2,101,931.78
结算备付金	10,629.17	-	-	-	10,629.17
存出保证金	2,762.69	-	-	-	2,762.69
交易性金融资产	-	-	13,200.41	170,300,902.08	170,314,102.49
应收清算款	-	-	-	1,358,958.00	1,358,958.00
资产总计	2,115,323.64	-	13,200.41	171,659,860.08	173,788,384.13
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	72,286.24	72,286.24
应付托管费	-	-	-	14,457.25	14,457.25
应付清算款	-	-	-	1,384,953.78	1,384,953.78
其他负债	-	-	-	229,187.59	229,187.59
负债总计	-	-	-	1,700,884.86	1,700,884.86
利率敏感度缺口	2,115,323.64	-	13,200.41	169,958,975.22	172,087,499.27

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

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有的交易性债券投资和资产支持证券投资（2023 年 12 月 31 日本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.01%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2023 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指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。本基金主要投资于标的指数成分股、备选成分股，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	169,438,460.54	98.45	170,300,902.08	98.96
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	13,200.41	0.01
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	169,438,460.54	98.45	170,314,102.49	98.97

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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）
	+5%	8,523,381.95	8,518,289.23
	-5%	-8,523,381.95	-8,518,289.23

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	169,071,877.47	170,300,902.08

第二层次	16,641.90	13,200.41
第三层次	349,941.17	-
合计	169,438,460.54	170,314,102.49

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，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、债券和基金的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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	148,669.15	148,669.15
转出第三层次	-	32,365.78	32,365.78
当期利得或损失总额	-	233,637.80	233,637.80
其中：计入损益的利得或损失	-	233,637.80	233,637.80
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	349,941.17	349,941.17
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	-	214,623.44	214,623.44
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	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	5,237.96	5,237.96
转出第三层次	-	6,156.38	6,156.38

当期利得或损失总额	-	918.42	918.42
其中：计入损益的利得或损失	-	918.42	918.42
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	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
交易型金融资产— 流通受限股票	349,941.17	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	26.65%-574.44%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 (2023 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	169,438,460.54	98.30
	其中：股票	169,438,460.54	98.30
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	2,932,300.13	1.70
8	其他各项资产	6,177.49	0.00
9	合计	172,376,938.16	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	979,709.00	0.57
B	采矿业	5,948,665.24	3.46
C	制造业	105,047,387.92	61.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,236,592.00	3.62
E	建筑业	1,841,192.00	1.07
F	批发和零售业	4,048,341.83	2.35
G	交通运输、仓储和邮政业	2,600,722.26	1.51
H	住宿和餐饮业	536,093.40	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,949,751.79	8.69
J	金融业	17,581,470.94	10.22
K	房地产业	2,170,972.20	1.26
L	租赁和商务服务业	1,475,007.00	0.86
M	科学研究和技术服务业	1,180,126.80	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	820,934.89	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	404,940.00	0.24
Q	卫生和社会工作	986,090.20	0.57
R	文化、体育和娱乐业	2,219,507.07	1.29
S	综合	410,956.00	0.24
	合计	169,438,460.54	98.45

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资港股通股票。

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

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	002625	光启技术	36,400	1,739,920.00	1.01
2	600418	江淮汽车	42,200	1,582,500.00	0.92
3	000988	华工科技	24,300	1,052,190.00	0.61
4	300339	润和软件	19,300	965,579.00	0.56
5	002384	东山精密	33,000	963,600.00	0.56
6	600157	永泰能源	537,300	918,783.00	0.53
7	600839	四川长虹	89,300	861,745.00	0.50
8	002797	第一创业	101,600	848,360.00	0.49
9	600487	亨通光电	47,700	821,394.00	0.48
10	301236	软通动力	13,800	810,198.00	0.47
11	002340	格林美	124,000	809,720.00	0.47
12	300207	欣旺达	35,700	796,467.00	0.46
13	688777	中控技术	15,300	759,951.00	0.44
14	002156	通富微电	25,700	759,435.00	0.44
15	601162	天风证券	167,500	750,400.00	0.44
16	601555	东吴证券	96,130	749,814.00	0.44
17	002273	水晶光电	33,629	747,236.38	0.43
18	002966	苏州银行	90,960	737,685.60	0.43
19	002185	华天科技	61,900	718,659.00	0.42
20	601099	太平洋	164,800	702,048.00	0.41
21	601933	永辉超市	109,700	695,498.00	0.40
22	600096	云天化	31,000	691,300.00	0.40
23	002202	金风科技	66,800	690,044.00	0.40
24	000423	东阿阿胶	10,900	683,648.00	0.40
25	000066	中国长城	46,800	681,876.00	0.40
26	600536	中国软件	14,381	671,448.89	0.39
27	601168	西部矿业	40,366	648,681.62	0.38
28	600352	浙江龙盛	63,000	648,270.00	0.38
29	600079	人福医药	27,600	645,288.00	0.37
30	600885	宏发股份	20,176	642,000.32	0.37
31	601108	财通证券	78,500	641,345.00	0.37
32	600988	赤峰黄金	40,300	629,083.00	0.37
33	300017	网宿科技	59,000	623,630.00	0.36
34	002738	中矿资源	17,480	620,540.00	0.36
35	300476	胜宏科技	14,600	614,514.00	0.36
36	002138	顺络电子	19,500	613,860.00	0.36
37	601577	长沙银行	68,100	605,409.00	0.35
38	002078	太阳纸业	40,600	603,722.00	0.35
39	002281	光迅科技	11,500	599,955.00	0.35
40	300136	信维通信	23,400	595,296.00	0.35
41	300474	景嘉微	6,300	588,987.00	0.34
42	002085	万丰奥威	30,800	583,660.00	0.34

43	600879	航天电子	63,900	572,544.00	0.33
44	002517	恺英网络	41,600	566,176.00	0.33
45	300803	指南针	5,900	566,105.00	0.33
46	300058	蓝色光标	61,000	566,080.00	0.33
47	002444	巨星科技	17,400	562,890.00	0.33
48	603893	瑞芯微	5,100	561,306.00	0.33
49	300223	北京君正	8,200	559,240.00	0.32
50	601615	明阳智能	43,900	553,579.00	0.32
51	601128	常熟银行	72,890	551,777.30	0.32
52	688099	晶晨股份	8,000	549,440.00	0.32
53	300002	神州泰岳	47,400	549,366.00	0.32
54	600109	国金证券	62,800	548,244.00	0.32
55	002353	杰瑞股份	14,800	547,452.00	0.32
56	688120	华海清科	3,357	547,157.43	0.32
57	000783	长江证券	80,200	546,964.00	0.32
58	002195	岩山科技	137,485	545,815.45	0.32
59	300024	机器人	30,300	543,885.00	0.32
60	603160	汇顶科技	6,600	531,564.00	0.31
61	002128	电投能源	27,140	531,401.20	0.31
62	002223	鱼跃医疗	14,550	530,929.50	0.31
63	002532	天山铝业	67,400	530,438.00	0.31
64	300496	中科创达	8,900	530,084.00	0.31
65	600298	安琪酵母	14,700	529,935.00	0.31
66	000728	国元证券	63,200	528,352.00	0.31
67	002673	西部证券	64,800	528,120.00	0.31
68	002465	海格通信	48,000	527,040.00	0.31
69	603606	东方电缆	10,000	525,500.00	0.31
70	688469	芯联集成	102,400	525,312.00	0.31
71	601567	三星医疗	17,000	522,920.00	0.30
72	688072	拓荆科技	3,400	522,478.00	0.30
73	688213	思特威	6,700	520,724.00	0.30
74	688617	惠泰医疗	1,395	519,400.35	0.30
75	601198	东兴证券	47,000	517,470.00	0.30
76	688047	龙芯中科	3,900	515,892.00	0.30
77	600765	中航重机	25,080	513,387.60	0.30
78	600862	中航高科	20,200	510,252.00	0.30
79	300114	中航电测	7,100	509,638.00	0.30
80	300383	光环新网	34,800	507,732.00	0.30
81	002008	大族激光	20,300	507,500.00	0.29
82	300012	华测检测	40,600	504,658.00	0.29
83	002472	双环传动	16,400	502,168.00	0.29
84	000831	中国稀土	17,900	502,095.00	0.29
85	600895	张江高科	18,700	501,160.00	0.29

86	301358	湖南裕能	11,000	498,520.00	0.29
87	600177	雅戈尔	56,000	498,400.00	0.29
88	300866	安克创新	5,100	497,964.00	0.29
89	603605	珀莱雅	5,800	491,260.00	0.29
90	300699	光威复材	14,080	487,872.00	0.28
91	002595	豪迈科技	9,700	486,843.00	0.28
92	600873	梅花生物	48,400	485,452.00	0.28
93	601233	桐昆股份	40,700	480,260.00	0.28
94	300037	新宙邦	12,800	479,232.00	0.28
95	300395	菲利华	12,600	473,886.00	0.28
96	000400	许继电气	17,200	473,516.00	0.28
97	300054	鼎龙股份	18,100	470,962.00	0.27
98	688122	西部超导	10,940	468,450.80	0.27
99	300604	长川科技	10,600	467,778.00	0.27
100	300142	沃森生物	38,700	467,496.00	0.27
101	601990	南京证券	53,500	463,310.00	0.27
102	000750	国海证券	107,920	461,897.60	0.27
103	603596	伯特利	10,300	459,277.00	0.27
104	000009	中国宝安	49,880	456,402.00	0.27
105	688249	晶合集成	19,500	455,130.00	0.26
106	002436	兴森科技	40,900	454,399.00	0.26
107	600369	西南证券	96,500	450,655.00	0.26
108	600642	申能股份	47,400	449,826.00	0.26
109	601696	中银证券	40,300	449,748.00	0.26
110	002850	科达利	4,600	449,328.00	0.26
111	600153	建发股份	42,700	449,204.00	0.26
112	688525	佰维存储	7,200	446,184.00	0.26
113	688521	芯原股份	8,500	445,655.00	0.26
114	002261	拓维信息	24,300	444,933.00	0.26
115	600143	金发科技	51,000	440,640.00	0.26
116	600398	海澜之家	58,100	435,750.00	0.25
117	002821	凯莱英	5,700	433,713.00	0.25
118	000021	深科技	22,600	430,756.00	0.25
119	601216	君正集团	81,500	428,690.00	0.25
120	601997	贵阳银行	70,600	423,600.00	0.25
121	300724	捷佳伟创	6,700	423,507.00	0.25
122	000738	航发控制	19,000	422,560.00	0.25
123	000932	华菱钢铁	100,280	419,170.40	0.24
124	002294	信立泰	13,500	417,555.00	0.24
125	002558	巨人网络	32,700	414,963.00	0.24
126	600909	华安证券	68,190	413,231.40	0.24
127	600529	山东药玻	16,000	412,320.00	0.24
128	000878	云南铜业	33,800	412,022.00	0.24

129	600497	驰宏锌锗	73,800	411,066.00	0.24
130	600673	东阳光	36,400	410,956.00	0.24
131	000729	燕京啤酒	34,100	410,564.00	0.24
132	300919	中伟股份	11,300	408,156.00	0.24
133	603345	安井食品	5,000	407,400.00	0.24
134	600141	兴发集团	18,680	405,356.00	0.24
135	002607	中公教育	119,100	404,940.00	0.24
136	688002	睿创微纳	8,600	404,286.00	0.23
137	688188	柏楚电子	2,072	402,486.00	0.23
138	002409	雅克科技	6,900	399,855.00	0.23
139	000623	吉林敖东	23,100	398,937.00	0.23
140	688361	中科飞测	4,549	398,264.95	0.23
141	600155	华创云信	53,800	398,120.00	0.23
142	000997	新大陆	19,919	397,384.05	0.23
143	600549	厦门钨业	20,600	396,962.00	0.23
144	000733	振华科技	9,400	396,398.00	0.23
145	000034	神州数码	11,300	396,065.00	0.23
146	300073	当升科技	9,800	394,744.00	0.23
147	002065	东华软件	54,300	394,218.00	0.23
148	603338	浙江鼎力	6,100	393,572.00	0.23
149	300001	特锐德	17,900	392,905.00	0.23
150	002064	华峰化学	48,000	392,640.00	0.23
151	600563	法拉电子	3,300	392,436.00	0.23
152	601665	齐鲁银行	70,100	391,859.00	0.23
153	601456	国联证券	28,900	390,728.00	0.23
154	600118	中国卫星	14,300	390,390.00	0.23
155	002318	久立特材	16,600	388,606.00	0.23
156	002432	九安医疗	9,500	387,410.00	0.23
157	603087	甘李药业	8,700	383,670.00	0.22
158	002739	万达电影	31,600	383,624.00	0.22
159	600820	隧道股份	53,100	381,789.00	0.22
160	600521	华海药业	21,300	380,631.00	0.22
161	600704	物产中大	75,200	380,512.00	0.22
162	600580	卧龙电驱	22,100	379,899.00	0.22
163	600637	东方明珠	48,800	378,688.00	0.22
164	600312	平高电气	19,700	378,240.00	0.22
165	600060	海信视像	18,900	376,866.00	0.22
166	601179	中国西电	49,500	375,705.00	0.22
167	002410	广联达	31,900	375,144.00	0.22
168	600699	均胜电子	23,860	373,886.20	0.22
169	002841	视源股份	10,100	372,791.00	0.22
170	600132	重庆啤酒	5,900	371,818.00	0.22
171	002984	森麒麟	14,900	367,434.00	0.21

172	002385	大北农	83,500	361,555.00	0.21
173	300003	乐普医疗	31,800	360,612.00	0.21
174	601666	平煤股份	35,900	359,718.00	0.21
175	002262	恩华药业	14,700	357,945.00	0.21
176	300751	迈为股份	3,400	357,510.00	0.21
177	603568	伟明环保	16,483	356,527.29	0.21
178	002568	百润股份	12,700	355,727.00	0.21
179	603939	益丰药房	14,724	355,290.12	0.21
180	300763	锦浪科技	5,800	354,206.00	0.21
181	300144	宋城演艺	38,100	353,949.00	0.21
182	000683	远兴能源	63,200	353,288.00	0.21
183	688180	君实生物	12,900	352,557.00	0.20
184	600390	五矿资本	54,400	350,880.00	0.20
185	603179	新泉股份	8,200	350,140.00	0.20
186	002152	广电运通	30,000	349,800.00	0.20
187	600008	首创环保	106,520	349,385.60	0.20
188	002044	美年健康	75,800	347,922.00	0.20
189	600392	盛和资源	33,795	347,412.60	0.20
190	000039	中集集团	44,633	346,798.41	0.20
191	002407	多氟多	28,840	346,080.00	0.20
192	603129	春风动力	2,200	345,554.00	0.20
193	000513	丽珠集团	9,053	344,014.00	0.20
194	300373	扬杰科技	7,900	343,808.00	0.20
195	600863	内蒙华电	78,900	341,637.00	0.20
196	603589	口子窖	8,700	341,388.00	0.20
197	600170	上海建工	128,700	341,055.00	0.20
198	300529	健帆生物	11,600	340,344.00	0.20
199	600486	扬农化工	5,856	338,886.72	0.20
200	002624	完美世界	32,800	338,824.00	0.20
201	601717	郑煤机	26,100	338,778.00	0.20
202	601000	唐山港	71,746	337,923.66	0.20
203	600763	通策医疗	7,603	337,573.20	0.20
204	000960	锡业股份	23,900	335,317.00	0.19
205	300251	光线传媒	35,500	335,120.00	0.19
206	600872	中炬高新	15,200	334,704.00	0.19
207	600316	洪都航空	10,400	334,048.00	0.19
208	000426	兴业银锡	30,000	333,600.00	0.19
209	600816	建元信托	95,200	333,200.00	0.19
210	000703	恒逸石化	53,000	332,840.00	0.19
211	600498	烽火通信	17,100	332,766.00	0.19
212	000723	美锦能源	73,300	330,583.00	0.19
213	688578	艾力斯	5,500	329,450.00	0.19
214	300558	贝达药业	6,100	328,973.00	0.19

215	300285	国瓷材料	19,300	328,872.00	0.19
216	600516	方大炭素	68,000	328,440.00	0.19
217	603816	顾家家居	11,900	328,202.00	0.19
218	002958	青农商行	107,600	327,104.00	0.19
219	603979	金诚信	9,000	326,700.00	0.19
220	002500	山西证券	51,990	326,497.20	0.19
221	000629	钒钛股份	112,500	324,000.00	0.19
222	000830	鲁西化工	27,700	323,813.00	0.19
223	000921	海信家电	11,200	323,680.00	0.19
224	300390	天华新能	14,040	323,622.00	0.19
225	002603	以岭药业	20,200	323,402.00	0.19
226	605358	立昂微	13,000	322,010.00	0.19
227	002939	长城证券	39,100	320,620.00	0.19
228	002025	航天电器	6,600	320,496.00	0.19
229	000636	风华高科	22,300	320,005.00	0.19
230	002155	湖南黄金	20,304	319,381.92	0.19
231	601966	玲珑轮胎	17,700	319,308.00	0.19
232	002429	兆驰股份	54,800	316,744.00	0.18
233	002926	华西证券	38,100	316,611.00	0.18
234	000893	亚钾国际	15,700	316,512.00	0.18
235	000591	太阳能	66,300	315,588.00	0.18
236	601880	辽港股份	181,640	314,237.20	0.18
237	600535	天士力	21,700	313,782.00	0.18
238	688052	纳芯微	2,400	312,720.00	0.18
239	600998	九州通	61,048	312,565.76	0.18
240	600021	上海电力	34,000	311,780.00	0.18
241	002203	海亮股份	29,000	311,750.00	0.18
242	600511	国药股份	9,100	311,402.00	0.18
243	600348	华阳股份	43,550	308,769.50	0.18
244	600380	健康元	27,296	307,625.92	0.18
245	600038	中直股份	7,969	307,284.64	0.18
246	600325	华发股份	53,170	306,259.20	0.18
247	002414	高德红外	41,200	306,116.00	0.18
248	603077	和邦生物	149,560	305,102.40	0.18
249	603927	中科软	14,020	304,234.00	0.18
250	600208	衢州发展	102,700	303,992.00	0.18
251	600655	豫园股份	47,200	303,496.00	0.18
252	600970	中材国际	31,900	302,412.00	0.18
253	002423	中粮资本	22,300	298,597.00	0.17
254	600754	锦江酒店	11,100	298,146.00	0.17
255	300146	汤臣倍健	24,700	297,635.00	0.17
256	601016	节能风电	93,840	297,472.80	0.17
257	000060	中金岭南	63,200	296,408.00	0.17

258	300567	精测电子	4,600	295,780.00	0.17
259	300748	金力永磁	16,540	295,735.20	0.17
260	688385	复旦微电	7,700	295,603.00	0.17
261	600859	王府井	19,175	295,486.75	0.17
262	002756	永兴材料	7,800	294,216.00	0.17
263	603000	人民网	13,300	293,132.00	0.17
264	600583	海油工程	53,500	292,645.00	0.17
265	300487	蓝晓科技	6,100	292,007.00	0.17
266	600901	江苏金租	55,900	291,798.00	0.17
267	000519	中兵红箭	20,162	291,340.90	0.17
268	002683	广东宏大	11,000	291,280.00	0.17
269	603885	吉祥航空	21,200	290,440.00	0.17
270	600166	福田汽车	114,900	288,399.00	0.17
271	300212	易华录	12,240	286,416.00	0.17
272	600707	彩虹股份	34,800	286,056.00	0.17
273	000998	隆平高科	25,500	284,835.00	0.17
274	600546	山煤国际	24,000	283,920.00	0.16
275	688278	特宝生物	3,864	283,501.68	0.16
276	603156	养元饮品	12,300	280,932.00	0.16
277	600282	南钢股份	59,600	279,524.00	0.16
278	002439	启明星辰	17,600	278,432.00	0.16
279	300601	康泰生物	16,200	277,830.00	0.16
280	601001	晋控煤业	20,300	277,501.00	0.16
281	600131	国网信通	14,600	276,086.00	0.16
282	300677	英科医疗	10,920	276,057.60	0.16
283	600004	白云机场	28,700	275,520.00	0.16
284	688065	凯赛生物	7,100	275,480.00	0.16
285	002507	涪陵榨菜	19,430	274,545.90	0.16
286	000598	兴蓉环境	36,100	273,999.00	0.16
287	002373	千方科技	26,800	271,752.00	0.16
288	300765	新诺威	10,200	271,218.00	0.16
289	688220	翱捷科技	5,000	270,450.00	0.16
290	688017	绿的谐波	2,500	270,150.00	0.16
291	600867	通化东宝	33,500	270,010.00	0.16
292	002653	海思科	8,100	269,325.00	0.16
293	601918	新集能源	37,500	269,250.00	0.16
294	603899	晨光股份	8,900	269,225.00	0.16
295	000050	深天马A	29,700	268,191.00	0.16
296	600483	福能股份	26,800	267,196.00	0.16
297	300070	碧水源	52,700	266,662.00	0.15
298	002120	韵达股份	35,100	263,952.00	0.15
299	000563	陕国投A	74,100	263,796.00	0.15
300	300118	东方日升	22,000	263,560.00	0.15

301	600737	中粮糖业	25,800	263,418.00	0.15
302	603486	科沃斯	5,600	263,200.00	0.15
303	601611	中国核建	29,100	263,064.00	0.15
304	601231	环旭电子	15,900	262,350.00	0.15
305	688772	珠海冠宇	16,300	262,104.00	0.15
306	601098	中南传媒	17,400	261,174.00	0.15
307	601155	新城控股	21,800	260,728.00	0.15
308	603290	斯达半导	2,900	260,478.00	0.15
309	002430	杭氧股份	11,900	259,420.00	0.15
310	002244	滨江集团	30,100	259,161.00	0.15
311	600566	济川药业	8,900	258,812.00	0.15
312	603529	爱玛科技	6,300	258,426.00	0.15
313	601156	东航物流	15,300	258,111.00	0.15
314	301308	江波龙	3,000	258,000.00	0.15
315	601991	大唐发电	90,000	256,500.00	0.15
316	688005	容百科技	8,100	255,555.00	0.15
317	000987	越秀资本	36,330	255,036.60	0.15
318	002056	横店东磁	19,600	254,016.00	0.15
319	600598	北大荒	17,200	253,700.00	0.15
320	600416	湘电股份	22,400	252,896.00	0.15
321	603228	景旺电子	9,068	252,453.12	0.15
322	000818	航锦科技	13,200	252,120.00	0.15
323	300676	华大基因	6,000	251,820.00	0.15
324	000887	中鼎股份	19,100	250,592.00	0.15
325	601866	中远海发	96,000	250,560.00	0.15
326	002368	太极股份	10,558	250,013.44	0.15
327	600435	北方导航	25,400	247,904.00	0.14
328	600582	天地科技	39,900	246,582.00	0.14
329	300595	欧普康视	13,000	246,350.00	0.14
330	002670	国盛金控	18,736	245,254.24	0.14
331	600271	航天信息	26,900	245,059.00	0.14
332	300009	安科生物	28,332	244,788.48	0.14
333	002831	裕同科技	9,020	244,442.00	0.14
334	603658	安图生物	5,600	244,384.00	0.14
335	002508	老板电器	11,400	244,302.00	0.14
336	000958	电投产融	39,200	244,216.00	0.14
337	002240	盛新锂能	17,700	243,906.00	0.14
338	600755	厦门国贸	36,600	243,024.00	0.14
339	002572	索菲亚	13,900	238,802.00	0.14
340	688114	华大智造	5,100	238,629.00	0.14
341	000155	川能动力	22,300	238,164.00	0.14
342	600258	首旅酒店	16,220	237,947.40	0.14
343	300573	兴齐眼药	3,400	237,252.00	0.14

344	300888	稳健医疗	5,580	234,806.40	0.14
345	600995	南网储能	23,200	234,784.00	0.14
345	688363	华熙生物	4,600	234,784.00	0.14
346	600685	中船防务	9,900	234,630.00	0.14
347	601958	金铂股份	23,300	234,398.00	0.14
348	600848	上海临港	23,200	234,320.00	0.14
349	000883	湖北能源	47,000	234,060.00	0.14
350	688538	和辉光电	100,600	233,392.00	0.14
351	002268	电科网安	14,300	232,375.00	0.14
352	600129	太极集团	9,400	232,368.00	0.14
353	600378	昊华科技	8,000	231,280.00	0.13
354	000739	普洛药业	14,200	230,892.00	0.13
355	600739	辽宁成大	22,300	230,805.00	0.13
356	600517	国网英大	41,500	228,665.00	0.13
357	603379	三美股份	5,940	227,977.20	0.13
358	003031	中瓷电子	4,340	227,372.60	0.13
359	603298	杭叉集团	12,700	227,203.00	0.13
360	000027	深圳能源	34,620	224,337.60	0.13
361	000403	派林生物	10,600	223,978.00	0.13
362	601118	海南橡胶	41,400	223,974.00	0.13
363	600906	财达证券	31,300	222,230.00	0.13
364	000778	新兴铸管	57,800	221,952.00	0.13
365	603728	鸣志电器	4,100	221,400.00	0.13
366	000709	河钢股份	99,800	220,558.00	0.13
367	603737	三棵树	5,140	218,964.00	0.13
368	603444	吉比特	1,000	218,840.00	0.13
369	603712	七一二	11,200	218,064.00	0.13
370	601636	旗滨集团	38,800	217,668.00	0.13
371	600499	科达制造	27,900	217,620.00	0.13
372	002299	圣农发展	15,000	217,200.00	0.13
373	000785	居然智家	60,700	216,699.00	0.13
374	600528	中铁工业	26,847	216,386.82	0.13
375	002557	洽洽食品	7,400	214,970.00	0.12
376	688234	天岳先进	4,198	214,937.60	0.12
377	601399	国机重装	69,700	214,676.00	0.12
378	600606	绿地控股	102,000	214,200.00	0.12
379	600373	中文传媒	17,000	213,350.00	0.12
380	600329	达仁堂	6,900	212,520.00	0.12
381	601928	凤凰传媒	18,400	212,336.00	0.12
382	002080	中材科技	16,200	211,896.00	0.12
383	603858	步长制药	13,400	211,720.00	0.12
384	688536	思瑞浦	2,273	210,252.50	0.12
385	600977	中国电影	18,087	209,990.07	0.12

386	600968	海油发展	49,000	209,230.00	0.12
387	688567	孚能科技	17,600	204,160.00	0.12
388	601598	中国外运	38,100	203,835.00	0.12
389	600884	杉杉股份	27,300	203,385.00	0.12
390	603650	彤程新材	5,800	202,826.00	0.12
391	600959	江苏有线	60,400	202,340.00	0.12
392	688297	中无人机	5,000	201,400.00	0.12
393	600056	中国医药	18,060	200,466.00	0.12
394	600871	石化油服	98,200	200,328.00	0.12
395	600095	湘财股份	27,700	199,440.00	0.12
396	601212	白银有色	71,600	199,048.00	0.12
397	600062	华润双鹤	10,032	198,633.60	0.12
398	688387	信科移动	33,200	197,872.00	0.11
399	002266	浙富控股	63,380	197,745.60	0.11
400	600801	华新水泥	16,272	196,891.20	0.11
401	000559	万向钱潮	32,000	196,800.00	0.11
402	600764	中国海防	6,900	195,408.00	0.11
403	002372	伟星新材	15,400	194,502.00	0.11
404	000032	深桑达 A	11,000	194,040.00	0.11
405	601106	中国一重	66,100	192,351.00	0.11
406	000825	太钢不锈	55,000	191,400.00	0.11
407	301301	川宁生物	16,100	190,946.00	0.11
408	002019	亿帆医药	17,700	189,744.00	0.11
409	002487	大金重工	9,200	188,508.00	0.11
410	603688	石英股份	6,550	188,181.50	0.11
411	600663	陆家嘴	19,100	187,944.00	0.11
412	601608	中信重工	44,300	186,060.00	0.11
413	603882	金域医学	6,700	184,451.00	0.11
414	688563	航材股份	3,300	184,272.00	0.11
415	688349	三一重能	5,900	182,192.00	0.11
416	688778	厦钨新能	3,990	182,103.60	0.11
417	600808	马钢股份	58,236	179,949.24	0.10
418	603456	九洲药业	13,000	177,840.00	0.10
419	688561	奇安信	6,600	177,078.00	0.10
420	600925	苏能股份	33,200	175,960.00	0.10
421	300957	贝泰妮	4,100	175,029.00	0.10
422	600500	中化国际	43,320	174,146.40	0.10
423	603556	海兴电力	4,700	173,853.00	0.10
424	002408	齐翔腾达	34,493	173,499.79	0.10
425	601019	山东出版	15,200	172,520.00	0.10
426	002531	天顺风能	21,800	172,438.00	0.10
427	601965	中国汽研	9,700	170,914.00	0.10
428	600578	京能电力	48,500	170,720.00	0.10

429	001227	兰州银行	69,100	169,986.00	0.10
430	688425	铁建重工	38,600	169,840.00	0.10
431	001286	陕西能源	18,200	168,896.00	0.10
432	600350	山东高速	16,400	168,592.00	0.10
433	600612	老凤祥	3,100	168,237.00	0.10
434	688390	固德威	4,078	166,790.20	0.10
435	603233	大参林	11,056	166,503.36	0.10
436	603225	新凤鸣	14,740	164,056.20	0.10
437	688516	奥特维	3,783	163,841.73	0.10
438	600098	广州发展	25,500	163,710.00	0.10
439	000937	冀中能源	25,700	162,424.00	0.09
440	601568	北元集团	38,470	161,574.00	0.09
441	603185	弘元绿能	9,900	160,875.00	0.09
442	688301	奕瑞科技	1,680	160,557.60	0.09
443	600688	上海石化	53,000	160,060.00	0.09
444	600126	杭钢股份	32,630	155,971.40	0.09
445	603707	健友股份	11,726	155,604.02	0.09
446	002867	周大生	10,600	154,018.00	0.09
447	000967	盈峰环境	30,600	152,082.00	0.09
448	603883	老百姓	9,232	151,127.84	0.09
449	600720	中交设计	16,700	147,962.00	0.09
450	601139	深圳燃气	20,900	147,554.00	0.09
451	600339	中油工程	40,400	144,632.00	0.08
452	601992	金隅集团	80,500	143,290.00	0.08
453	002608	江苏国信	18,400	141,128.00	0.08
454	002153	石基信息	19,720	140,800.80	0.08
455	600295	鄂尔多斯	14,300	139,568.00	0.08
456	688032	禾迈股份	1,239	139,560.96	0.08
457	000898	鞍钢股份	57,600	138,240.00	0.08
458	002563	森马服饰	19,500	136,890.00	0.08
459	000537	中绿电	14,900	135,888.00	0.08
460	000401	冀东水泥	25,800	134,934.00	0.08
461	300140	节能环保	22,500	134,775.00	0.08
462	688281	华秦科技	1,440	134,064.00	0.08
463	003022	联泓新科	9,600	132,192.00	0.08
464	688248	南网科技	4,100	131,569.00	0.08
465	688331	荣昌生物	4,300	129,473.00	0.08
466	600032	浙江新能	17,400	128,760.00	0.07
467	002690	美亚光电	8,540	126,562.80	0.07
468	601228	广州港	36,300	123,057.00	0.07
469	600299	安迪苏	9,700	121,735.00	0.07
470	688520	神州细胞	3,300	119,559.00	0.07
471	603786	科博达	1,900	117,420.00	0.07

472	600007	中国国贸	4,800	117,408.00	0.07
473	600928	西安银行	32,300	116,603.00	0.07
474	301267	华夏眼科	6,100	116,144.00	0.07
475	301165	锐捷网络	1,600	115,520.00	0.07
476	600361	创新新材	29,900	115,414.00	0.07
477	000959	首钢股份	37,700	114,985.00	0.07
478	688172	燕东微	5,700	114,285.00	0.07
479	003035	南网能源	27,300	114,114.00	0.07
480	688475	萤石网络	3,700	111,703.00	0.06
481	603056	德邦股份	7,400	106,042.00	0.06
482	002945	华林证券	6,600	101,178.00	0.06
483	000539	粤电力 A	21,700	98,301.00	0.06
484	601061	中信金属	13,100	95,106.00	0.06
485	001203	大中矿业	10,900	94,394.00	0.05
486	301498	乖宝宠物	1,200	93,984.00	0.05
487	600927	永安期货	7,000	92,330.00	0.05
488	603826	坤彩科技	4,760	91,630.00	0.05
489	688375	国博电子	1,839	90,773.04	0.05
490	688819	天能股份	3,300	89,826.00	0.05
491	601858	中国科传	3,800	77,444.00	0.04
492	688276	百克生物	2,924	73,421.64	0.04
493	601158	重庆水务	13,900	68,110.00	0.04
494	688153	唯捷创芯	2,000	66,920.00	0.04
495	603341	龙旗科技	1,200	56,100.00	0.03
496	600956	新天绿能	7,400	55,796.00	0.03
497	603868	飞科电器	1,200	49,824.00	0.03
498	688295	中复神鹰	2,419	48,210.67	0.03
499	301626	苏州天脉	622	40,915.16	0.02
500	688605	先锋精科	600	32,208.00	0.02
501	301611	珂玛科技	451	25,301.10	0.01
502	301551	无线传媒	560	24,208.80	0.01
503	688449	联芸科技	673	19,813.12	0.01
504	603072	天和磁材	1,353	16,641.90	0.01
505	688750	金天钛业	1,032	15,934.08	0.01
506	688708	佳驰科技	286	13,999.70	0.01
507	688615	合合信息	83	13,759.74	0.01
508	301522	上大股份	483	11,997.72	0.01
509	688721	龙图光罩	202	11,483.70	0.01
510	301586	佳力奇	202	10,734.28	0.01
511	301571	国科天成	258	10,534.14	0.01
512	301622	英思特	219	9,837.48	0.01
513	301607	富特科技	257	9,287.98	0.01
514	001391	国货航	1,243	8,452.40	0.00

515	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
516	688710	益诺思	210	7,051.80	0.00
517	301585	蓝宇股份	192	6,883.20	0.00
518	301552	科力装备	117	6,653.79	0.00
519	301631	壹连科技	65	6,627.40	0.00
520	301606	绿联科技	171	6,239.79	0.00
521	301617	博苑股份	155	6,167.45	0.00
522	301613	新铝时代	145	6,056.65	0.00
523	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
524	301608	博实结	83	5,426.54	0.00
525	301603	乔锋智能	129	5,415.42	0.00
526	603207	小方制药	151	4,024.15	0.00
527	603194	中力股份	129	3,628.77	0.00
528	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
529	603091	众鑫股份	66	2,932.38	0.00
530	603350	安乃达	74	2,676.58	0.00
531	603391	力聚热能	55	2,274.25	0.00
532	603285	键邦股份	72	1,627.92	0.00
533	603310	巍华新材	77	1,382.15	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300339	润和软件	1,186,211.00	0.69
2	600487	亨通光电	871,503.40	0.51
3	601099	太平洋	783,414.00	0.46
4	688777	中控技术	649,178.36	0.38
5	300476	胜宏科技	646,442.00	0.38
6	002085	万丰奥威	598,649.00	0.35
7	688047	龙芯中科	597,754.02	0.35
8	688469	芯联集成	595,935.30	0.35
9	601567	三星医疗	590,462.00	0.34
10	300496	中科创达	589,666.00	0.34
11	688072	拓荆科技	583,188.44	0.34
12	300223	北京君正	580,018.00	0.34
13	603605	珀莱雅	540,868.00	0.31
14	300142	沃森生物	531,823.00	0.31
15	002202	金风科技	531,707.00	0.31
16	688249	晶合集成	527,730.97	0.31
17	601615	明阳智能	489,037.00	0.28
18	688617	惠泰医疗	485,489.00	0.28

19	002436	兴森科技	484,688.00	0.28
20	603979	金诚信	472,510.00	0.27

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	300502	新易盛	2,443,491.00	1.42
2	002463	沪电股份	1,303,856.00	0.76
3	002028	思源电气	1,234,160.60	0.72
4	300394	天孚通信	1,136,645.80	0.66
5	002422	科伦药业	1,105,909.00	0.64
6	601058	赛轮轮胎	956,677.00	0.56
7	000975	山金国际	880,371.36	0.51
8	601077	渝农商行	869,891.00	0.51
9	300418	昆仑万维	796,656.00	0.46
10	600066	宇通客车	789,444.00	0.46
11	000933	神火股份	770,029.00	0.45
12	600160	巨化股份	759,217.00	0.44
13	000630	铜陵有色	733,878.00	0.43
14	688169	石头科技	693,071.40	0.40
15	600161	天坛生物	641,199.00	0.37
16	600415	小商品城	563,038.00	0.33
17	600482	中国动力	502,335.00	0.29
18	688072	拓荆科技	496,160.77	0.29
19	300088	长信科技	474,602.00	0.28
20	300296	利亚德	430,962.00	0.25

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	46,039,327.93
卖出股票收入（成交）总额	52,270,850.41

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（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

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

本基金投资的前十名证券的发行主体中，苏州东山精密制造股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方市场监督管理局、地方应急管理厅的处罚；永泰能源集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方应急管理厅的处罚；江苏亨通光电股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

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

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定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	6,177.49
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	6,177.49

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限制的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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 (%)
323	397,271.48	125,972,956.00	98.17	2,345,731.00	1.83

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	631,870.00	0.49
2	熊翌旭	250,000.00	0.19
3	姜晓平	235,683.00	0.18
4	王海利	216,000.00	0.17
5	贾慧星	212,100.00	0.17
6	新疆天业(集团)有限公司企业年金计划—交通银行股份有限公司	200,000.00	0.16
7	张红艳	197,700.00	0.15

8	陈妙琴	139,373.00	0.11
9	李淑清	69,455.00	0.05
10	钮冰融	46,303.00	0.04
11	中国农业银行股份有限公司—国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基	125,137,586.00	97.52

注：表中前十名持有人为除国寿安保中证 500ETF 联接基金之外的前十名持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本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、基金投资和研发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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 29 日）基金份额总额	665,869,631.00
本报告期期初基金份额总额	140,318,687.00
本报告期基金总申购份额	2,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	14,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	128,318,687.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期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

本报告期内，基金管理人于 2024 年 3 月 27 日发布公告，王大朋先生于 2024 年 3 月 25 日离任公司总经理助理；基金管理人于 2024 年 6 月 15 日发布公告，王文英女士于 2024 年 6 月 14 日任公司副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自 2024 年 12 月 12 日起，为本基金提供审计服务的机构由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）变更为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。本基金本报告期支付给会计师事务所的报酬为 16,200.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	2	73,477,592.09	75.83	33,354.02	65.61	-
海通证券	2	18,920,082.48	19.53	16,603.02	32.66	-
中金公司	2	3,429,269.00	3.54	671.57	1.32	-
兴业证券	2	1,071,973.00	1.11	210.04	0.41	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证券监督管理委员会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告〔2024〕3号）相关规定，本公司制定了基金专用交易单元的选择标准和程序，具体如下：

- 1、关于基金专用交易单元的选择标准：

- (1) 综合实力较强，市场信誉良好；
- (2) 财务状况良好、经营状况稳健；
- (3) 经营行为规范，合规风险控制能力较强，具备健全的内部控制制度，建立相关业务利益冲突防范机制，完善隔离墙制度，确保研究服务客观公正；
- (4) 研究实力较强，拥有独立的研究部门，研究范围覆盖宏观经济、金融市场和相关行业研究。并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；
- (5) 交易能力较强，具有费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能够提供全面的交易信息服务；
- (6) 从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、关于基金专用交易单元的选择程序：

- (1) 公司相关业务部门提出新增交易单元的需求，研究部根据公司《证券公司交易单元管理办法》的选择标准提出备选证券公司名单；
- (2) 备选的证券公司名单确定后，研究部会同投资相关部门组织证券公司就研究服务和佣金费率等展开评估，并对证券公司进行打分，最终按照综合分数排名情况确定入选的证券公司名单，合规管理部对谈判、打分及选择的过程进行合规性监督；
- (3) 入选证券公司名单确定后，研究部将全部协议内容以书面方式确定为合同文本，交由合规管理部审核后，与证券公司签署专用证券交易单元租用协议和综合服务协议，协议约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中信证券	149,170.58	91.07	-	-	-	-
海通证券	14,631.63	8.93	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
其他	1	20240101~20241231	136,446,586.00	0.00	11,309,000.00	125,137,586.00	97.52
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形,可能存在大额赎回的风险,并导致基金净值波动。此外,机构投资者赎回后,可能导致基金规模大幅减小,不利于基金的正常运作。</p> <p>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,并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

13.1.1 中国证监会批准国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

13.1.2 《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

13.1.3 《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

13.1.5 报告期内国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

13.1.6 中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司, 地址:北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心
2 号楼 11 层

13.3 查阅方式

13.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

13.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息: www.gsfunds.com.cn

13.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询: 4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2025 年 3 月 29 日