

天弘中证 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:天弘基金管理有限公司

基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

送出日期:2025 年 03 月 31 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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年03月27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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	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	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	64
8.1 期末基金资产组合情况	64
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	65
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	67
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	84
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	86
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	86
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	87
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	87
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	87
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	87

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	87
8.12 投资组合报告附注	87
§9 基金份额持有人信息	89
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	89
9.2 期末上市基金前十名持有人	89
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	90
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	90
§10 开放式基金份额变动	90
§11 重大事件揭示	90
11.1 基金份额持有人大会决议	90
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	91
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	91
11.4 基金投资策略的改变	91
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	91
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	91
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	91
11.8 其他重大事件	94
§12 影响投资者决策的其他重要信息	98
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	98
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	99
§13 备查文件目录	99
13.1 备查文件目录	99
13.2 存放地点	99
13.3 查阅方式	99

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	天弘中证500ETF
场内简称	中证500ETF天弘
基金主代码	159820
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年08月07日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,396,408,470.00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	2020年08月24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。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构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。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。为使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如股指期货以及其他与标的指数或标的指数成份

	股相关的衍生工具。本基金产品投资策略仍包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	中证500指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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		天弘基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	帅芳
	联系电话	022-83310208	021-38031815
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tgrxp@tg.gtja.com
客户服务电话		95046	021-38917599-5
传真		022-83865564	021-38677819
注册地址		天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦23层	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	上海市静安区新闻路669号博华广场19楼
邮政编码		300203	200041
法定代表人		黄辰立	朱健

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网	www.thfund.com.cn

址	
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

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)	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼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	-86,464,914.80	-74,694,463.11	-26,024,855.91
本期利润	192,956,419.21	-116,721,018.08	-439,857,950.03
加权平均基金份额本期利润	0.0771	-0.0490	-0.1886
本期加权平均净值利润率	8.88%	-5.08%	-19.04%
本期基金份额净值增长率	7.54%	-5.74%	-18.38%
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	-106,909,815.63	-276,892,037.56	-142,437,349.55
期末可供分配基金份额利润	-0.0446	-0.1116	-0.0575
期末基金资产净值	2,289,498,654.37	2,204,516,432.44	2,333,971,120.45
期末基金份额净值	0.9554	0.8884	0.9425
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	-4.46%	-11.16%	-5.75%
-----------------	--------	---------	--------

注：1、所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（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3、期末可供分配利润为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	-0.18%	2.01%	-0.30%	2.03%	0.12%	-0.02%
过去六个月	16.78%	2.00%	15.84%	2.01%	0.94%	-0.01%
过去一年	7.54%	1.81%	5.46%	1.82%	2.08%	-0.01%
过去三年	-17.27%	1.40%	-22.20%	1.40%	4.93%	0.00%
自基金合同 生效日起至 今	-4.46%	1.28%	-15.43%	1.30%	10.97%	-0.02%

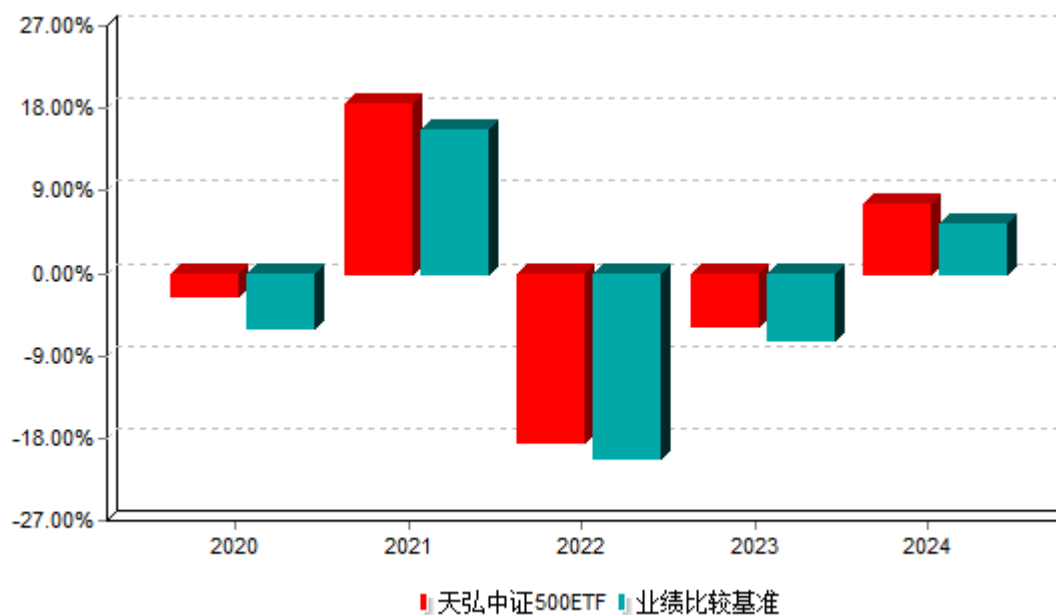
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同于2020年08月07日生效。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

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



注：本基金合同于2020年08月07日生效。基金合同生效当年2020年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§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

天弘基金管理有限公司（以下简称"公司"或"本基金管理人"）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立，注册资本为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、深圳、四川、浙江设有分公司。公司股权结构为：

股东名称	股权比例
蚂蚁科技集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

截至2024年12月31日，公司共管理运作210只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

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		
陈瑶	本基金基金经理	2020年08月	-	13年	女，金融学硕士。2011年7月加盟本公司，历任交易员、交易主管，从事交易管理、程序化交易策略、基差

					交易策略、融资融券交易策略等研究工作。
尤聪	本基金基金经理助理	2024年08月	-	11年	女，计算金融与风险管理专业硕士。历任华盛顿大学资产管理公司量化研究员、北美信托银行信用风险管理顾问、北美信托资产管理公司股票量化投资经理。2021年10月加盟本公司。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、本基金经理助理协助基金经理进行投资、研究、头寸管理等日常工作。

3、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地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。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在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

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则，严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的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%的交易次数为2次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

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

报告期内本基金秉承合规第一、风控第一的原则，在运作过程中严格遵守基金合同，对指数基金采取被动复制的方式跟踪指数，完全复制标的指数，力争基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

出于基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的需要，基于谨慎原则，报告期内本基金运用股指期货工具对基金投资组合进行管理。根据风险管理的原则，本基金在报告期内运用股指期货工具旨在提高投资效率，控制基金投资组合风险水平，力求更好地实现本基金的投资目标。

报告期内，本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回、打新、成分股调整导致的权重偏离因素。当由于申赎等情况可能对指数跟踪效果带来影响时，本基金坚持既定的指数化投资策略，对指数基金采取被动复制与组合优化相结合的方式跟踪指数，同时紧密跟踪成分股的权息事件，及时有效处理，避免权重偏离造成跟踪误差的扩大。

报告期内，本基金整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2024年12月31日,本基金份额净值为0.9554元,本报告期份额净值增长率7.54%,同期业绩比较基准增长率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

2025年中国经济GDP增速目标可能维持在5%左右。尽管全球经济地缘政治的不确定性增加,但中国经济基本面修复的弹性仍存,当前基建投资保持稳定,房地产市场的止跌回稳初现迹象,消费修复依然是2025年的主要看点。政策方面,预计宏观政策基调整体仍维持宽松,政策核心仍是稳增长。财政政策方面,预计2025年广义财政赤字率有可能提升,货币政策适度宽松,降息和降准的概率仍然存在。

对股票市场而言,2025年仍然存在一定不确定因素,包括中美关系博弈、经济基本面修复的成色、政策预期的波动等。短期来看,市场整体的情绪在年初偏保守防御,市场关注的焦点在于美国关税政策和国内的政策应对,如两会的政策窗口期。中长期来看,驱动股票市场表现更为核心的变量来自于经济基本面的实质改善,而在此之前,市场也会重点关注稳增长政策的发力情况。因此2025年,我们认为股票市场与政策的联动性仍然较高。我们认为2025年仍有政策窗口期值得期待,同时也期待基本面数据去验证政策的实施效果。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发,由独立的内控合规部门按照规定的权限和程序,认真履行职责,对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行定期和不定期监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善,及时与有关人员沟通,并定期制作监察稽核报告报公司董事会。公司经理层面成立了风险管理委员会,根据公司总体风险控制目标,分配各业务和各环节风险控制目标和要求;落实公司重大风险管理的决定或决议;听取并讨论会议成员的报告;对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点,在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施;对潜在风险点分析讨论,拟定应对措施;对发生的风险事件和重大差错,分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任,向总经理办公会报告。

同时,本基金管理人根据全面性原则、独立性原则、相互制约原则、定性和定量相结合原则、重要性原则建立了一套比较完整的内部控制体系,该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成,具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息和沟通、监控等要素。本基金管理人已通过了ISAE3402(《国际鉴证业务准则第3402号》)认证,获得无保留意见的控制设计适当性报告。

本报告期，本基金管理人全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资、营销及后台运作等各环节的合法合规。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，完善内部控制，基金运作没有出现违规行为。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

1、在研究环节，加强研究业务独立性，注重程序合规和质量控制；在关注研究报告形式与内容的合法性基础上，跟踪检查投资备选库的入选、维护依据；进一步规范新股、新债询价、申购流程；定期检查关联方关系以及关联交易的日常维护；定期评估研究对投资的支持程度，对投资业绩的贡献度；

2、在投资交易环节，对投资运作过程中的风险点进行识别和监控，预防和控制由内部或外部流程、人员和系统失控而造成的损失；根据法律法规要求、基金合同约定、投资决策委员会的决定，适时提出增加或优化交易系统风控指标的建议，通过投资交易系统控制投资风险；跟踪每日的交易行为和交易结果，发现预警信息通过电话、邮件及合规提示及时提醒，保障投资环节的合规运作；监督检查各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的合规执行情况，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；

3、投资管理人员管理环节，加强对投资管理人员即时聊天工具、办公电话、移动电话、终端设备网上交易的合规监控，监督投资管理人员及其配偶、利害关系人股票交易申报制度、交易时间移动电话集中保管制度的有效执行，采取各种有效方式杜绝老鼠仓、不公平交易及各种形式的利益输送行为；

4、基金募集与营销环节，对基金宣传推介材料及定投、费率优惠等基金销售业务活动进行事前合规检查，做到事前防范风险，保障基金营销合法合规。在基金利用互联网平台营销方面，对各类新兴业务的活动方案进行事前合规评估，保证业务开展的同时注重事前风险防范；

5、基金运营环节，加强对注册登记、会计核算、基金清算、估值业务的稽核力度，保证基金运营安全、准确；

6、信息披露环节，严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，保证信息披露的真实、准确、完整、及时。

报告期内，本基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施逐步完善，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续以合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，提高内部控制和风险管理的科学性和有效性，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

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监

督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会成员由公司分管投资的高级管理人员、督察长、首席风控官、分管估值业务高级管理人员以及研究管理人员组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理（投资经理）、股票/债券研究员、基金运营部、风险管理部和内控合规部的相关人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§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，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计

算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§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2506409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	天弘中证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	我们审计了后附的天弘中证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。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。
形成审计意见的基础	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。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	该基金管理人天弘基金管理有限公司(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。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	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。 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。

	该基金管理人治理层负责监督该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。 (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。 (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。	
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	左艳霞	李瑞丛
会计师事务所的地址	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8层	
审计报告日期	2025-03-27	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘中证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	26,941,322.72	18,144,345.68
结算备付金		11,995,582.51	64,244,903.92
存出保证金		5,388,718.26	10,640,785.13
交易性金融资产	7.4.7.2	2,247,213,007.85	2,113,302,063.13
其中：股票投资		2,247,213,007.85	2,113,138,158.10
基金投资		-	-
债券投资		-	163,905.03
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	-	-
应收清算款		1,277,671.47	9,105,378.05
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	132,673.59
资产总计		2,292,816,302.81	2,215,570,149.50
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		1,279,106.56	9,242,508.41
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,009,968.75	923,303.65
应付托管费		201,993.74	184,660.74
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		235,837.50	12,049.76
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	590,741.89	691,194.50
负债合计		3,317,648.44	11,053,717.06
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	2,396,408,470.00	2,481,408,470.00
未分配利润	7.4.7.8	-106,909,815.63	-276,892,037.56
净资产合计		2,289,498,654.37	2,204,516,432.44

负债和净资产总计		2,292,816,302.81	2,215,570,149.50
----------	--	------------------	------------------

注：报告截止日2024年12月31日，基金份额净值0.9554元，基金份额总额2,396,408,470.00份。

7.2 利润表

会计主体：天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2 023年12月31日
一、营业总收入		207,151,270.60	-101,732,211.89
1.利息收入		815,032.33	342,337.55
其中：存款利息收入	7.4.7.9	815,032.33	342,337.55
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）		-74,732,911.91	-60,272,222.65
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-142,729,683.44	-97,968,854.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	142,948.24	459,935.94
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	21,999,780.19	-4,738,379.78
股利收益	7.4.7.15	42,947,098.27	35,920,059.60
其他投资收益		2,906,944.83	6,055,015.89
3.公允价值变动收益（损失	7.4.7.16	279,421,334.01	-42,026,554.97

以“-”号填列)			
4.汇兑收益（损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列)	7.4.7.17	1,647,816.17	224,228.18
减：二、营业总支出		14,194,851.39	14,988,806.19
1.管理人报酬		10,899,508.01	11,505,758.08
2.托管费		2,179,901.58	2,301,151.65
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	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		106,999.73	40,248.40
8.其他费用	7.4.7.19	1,008,442.07	1,141,648.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		192,956,419.21	-116,721,018.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		192,956,419.21	-116,721,018.08
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		192,956,419.21	-116,721,018.08

7.3 净资产变动表

会计主体：天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2024年01月01日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	2,481,408,470.00	-276,892,037.56	2,204,516,432.44
二、本期期初净资产	2,481,408,470.00	-276,892,037.56	2,204,516,432.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-85,000,000.00	169,982,221.93	84,982,221.93
（一）、综合收益总额	-	192,956,419.21	192,956,419.21
（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）	-85,000,000.00	-22,974,197.28	-107,974,197.28
其中：1.基金申购款	592,500,000.00	-70,644,032.40	521,855,967.60
2.基金赎回款	-677,500,000.00	47,669,835.12	-629,830,164.88
（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	2,396,408,470.00	-106,909,815.63	2,289,498,654.37
项 目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,476,408,470.00	-142,437,349.55	2,333,971,120.45
二、本期期初净资产	2,476,408,470.00	-142,437,349.55	2,333,971,120.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,000,000.00	-134,454,688.01	-129,454,688.01

填列)			
(一)、综合收益总额	-	-116,721,018.08	-116,721,018.08
(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)	5,000,000.00	-17,733,669.93	-12,733,669.93
其中: 1.基金申购款	242,500,000.00	-16,923,363.32	225,576,636.68
2.基金赎回款	-237,500,000.00	-810,306.61	-238,310,306.61
(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	2,481,408,470.00	-276,892,037.56	2,204,516,432.44

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:

高阳

薄贺龙

薄贺龙

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

天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]1193号《关于准予天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的准许，由基金管理人天弘基金管理有限公司向社会公开发行人募集，基金合同于2020年08月07日生效，首次设立募集规模为333,908,470.00份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

根据《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，经深圳证券交易所(以下简称“深

交所”)深证上[2020]735号文审核同意,本基金333,908,470.00份基金份额于2020年08月24日在深交所挂牌交易。

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现基金的投资目标,本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2025年03月27日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年度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

本基金根据管理金融资产的业务模式和合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产划分为以摊余成本计量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。本基金未持有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 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；
- 该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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有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。

(2) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债。本基金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。

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(2) 金融工具的后续计量

初始确认后，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以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息、股利收入和利息费用)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

初始确认后，对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

(3) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；

- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

(4) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

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。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，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证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，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的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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；

本基金收益分配方式为现金分红；

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；在收益评价日，基金管理人对于基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法如下：基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算、拆分或合并，则以基金份额折算日、经拆分或合并调整后的基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算、拆分或合并，则以基金份额折算日、经拆分或合并调整后的基金份额折算日为初始日重新计算）；

本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，无需召开基金份额持有人大会。

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

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干

优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、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号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《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》、财政部 税务总局公告2024年第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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

d) 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。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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	26,941,322.72	18,144,345.68
等于：本金	26,932,290.82	18,135,538.61
加：应计利息	9,031.90	8,807.07
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	26,941,322.72	18,144,345.68

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	2,323,997,302.86	-	2,247,213,007.85	-76,784,295.01
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		2,323,997,302.86	-	2,247,213,007.85	-76,784,295.01
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		2,468,287,067.12	-	2,113,138,158.10	-355,148,909.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	163,900.00	5.03	163,905.03	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	163,900.00	5.03	163,905.03	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,468,450,967.12	5.03	2,113,302,063.13	-355,148,909.02

注：1、股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。
2、股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日
----	--------------------

	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	41,000,840.00	-	-	-
--股指期货	41,000,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	41,000,840.00	-	-	-
项目	上年度末 2023年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	88,818,240.00	-	-	-
--股指期货	88,818,240.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	88,818,240.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2501	IC2501	35.00	40,037,200.00	-963,640.00
合计				-963,640.00
减：可抵销 期货暂收款				-963,640.00
净额				-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末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

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

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
应收利息	-	-
其他应收款	-	132,673.59
待摊费用	-	-
合计	-	132,673.59

7.4.7.6 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	204,140.00	224,644.83
其中：交易所市场	204,140.00	224,644.83
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	203,000.00	300,000.00
其他应付款	183,601.89	166,549.67
合计	590,741.89	691,194.50

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,481,408,470.00	2,481,408,470.00
本期申购	592,500,000.00	592,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-677,500,000.00	-677,500,000.00
本期末	2,396,408,470.00	2,396,408,470.00

7.4.7.8 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	162,296,173.03	-439,188,210.59	-276,892,037.56
本期期初	162,296,173.03	-439,188,210.59	-276,892,037.56
本期利润	-86,464,914.80	279,421,334.01	192,956,419.21
本期基金份额交易产生的变动数	-1,652,385.87	-21,321,811.41	-22,974,197.28
其中：基金申购款	22,577,401.94	-93,221,434.34	-70,644,032.40
基金赎回款	-24,229,787.81	71,899,622.93	47,669,835.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	74,178,872.36	-181,088,687.99	-106,909,815.63

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
活期存款利息收入	309,608.10	313,970.43
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	499,306.92	23,734.66
其他	6,117.31	4,632.46

合计	815,032.33	342,337.55
----	------------	------------

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-117,691,494.37	-88,428,065.90
股票投资收益——赎回差价收入	-25,038,189.07	-9,540,788.40
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	-142,729,683.44	-97,968,854.30

7.4.7.10.2 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01月01日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日
卖出股票成交总额	1,041,652,307.91	768,550,519.89
减：卖出股票成本总额	1,158,118,538.06	855,615,164.20
减：交易费用	1,225,264.22	1,363,421.59
买卖股票差价收入	-117,691,494.37	-88,428,065.90

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日
赎回基金份额对价总额	629,830,164.88	238,310,306.61
减：现金支付赎回款总额	319,922,997.88	122,838,505.61
减：赎回股票成本总额	334,945,356.07	125,012,589.40

减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-25,038,189.07	-9,540,788.40

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
债券投资收益——利息收入	335.14	413.87
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	142,613.10	459,522.07
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	142,948.24	459,935.94

7.4.7.11.2 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01月01日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年01月01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	1,867,937.90	2,624,099.11
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	1,724,900.00	2,164,000.00
减：应计利息总额	350.08	472.08
减：交易费用	74.72	104.96

买卖债券差价收入	142,613.10	459,522.07
----------	------------	------------

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未取得买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
期货投资	21,999,780.19	-4,738,379.78

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
股票投资产生的股利收益	42,947,098.27	35,920,059.60
其中：证券出借权益补偿收入	4,786,500.27	3,614,761.84
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	42,947,098.27	35,920,059.60

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年12	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12
------	---------------------------	--------------------------------

	月31日	月31日
1.交易性金融资产	278,364,614.01	-44,109,034.97
——股票投资	278,364,614.01	-44,121,502.77
——债券投资	-	12,467.80
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	1,056,720.00	2,082,480.00
——权证投资	-	-
——期货投资	1,056,720.00	2,082,480.00
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	279,421,334.01	-42,026,554.97

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
基金赎回费收入	-	-
基金转换费收入	-	-
ETF基金替代损益	1,647,816.17	224,228.18
合计	1,647,816.17	224,228.18

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024年01月01日至2024年 12月31日	2023年01月01日至2023年 12月31日
审计费用	63,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	653,970.50	690,345.44
IOPV计算发布费	20,000.00	100,000.00
ETF登记结算费	150,000.00	150,000.00
存托服务费	1,471.57	1,302.62
合计	1,008,442.07	1,141,648.06

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人
国泰君安证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
蚂蚁科技集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	1,704,002,165.49	79.76%	226,090,567.96	14.72%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	1,822,635.50	97.57%	-	-

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	374,559.26	66.01%	204,140.00	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	55,396.37	8.84%	50,182.32	22.34%

注: 1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。该类佣金协议已根据此规定完成了更新。

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01月01日至20	上年度可比期间 2023年01月01日至20
----	----------------------	---------------------------

	24年12月31日	23年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,899,508.01	11,505,758.08
其中：应支付销售机构的客户维护费	81,712.07	60,400.41
应支付基金管理人的净管理费	10,817,795.94	11,445,357.67

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×该日适用费率/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,179,901.58	2,301,151.65

注:支付基金托管人国泰君安证券股份有限公司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×该日适用费率/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行过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

单位：人民币元

本期 2024年01月01日至2024年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务 余额	期末应收利息 余额

-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务 余额	期末应收利息 余额
国泰君安证券股份有 限公司	440,928,90 5.00	286,722. 23	-	-

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

单位：人民币元

本期 2024年01月01日至2024年12月31日						
关联方名称	交易金额	费率区间(%)	加权平均费率(%)	利息收入	期末证券出借 业务余额	期末应收利息 余额
国泰君安证 券股份有限 公司	2,857,901,63 3.00	1.10~2.00	1.65	1,622,456.39	-	-
上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日						
关联方名称	交易金额	费率区间(%)	加权平均费率(%)	利息收入	期末证券出借 业务余额	期末应收利息 余额
国泰君安证 券股份有限 公司	2,368,466,24 5.00	1.60~9.50	2.02	1,769,300.47	261,410,490.00	93,580.88

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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	持有的基金份额	持有的基金份 额占基金总份

		额的比例		额的比例
天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,257,160,769.00	94.19%	2,361,606,069.00	95.17%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年01月01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
国泰君安证券股份有限公司	26,941,322.72	309,608.10	18,144,345.68	313,970.43

注：本基金由基金托管人国泰君安证券股份有限公司保管的银行存款，存放在具有基金托管资格的银行，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

金额单位：人民币元

本期 2024年01月01日至2024年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	601033	永兴股份	网下申购	12,577	203,747.40
国泰君安证券股份	603082	北自科技	网下申购	1,070	22,769.60

有限公司					
国泰君安 证券股份 有限公司	301591	肯特股份	网下申购	2,184	42,435.12
国泰君安 证券股份 有限公司	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
国泰君安 证券股份 有限公司	603285	键邦股份	网下申购	1,287	24,002.55
国泰君安 证券股份 有限公司	301571	国科天成	网下申购	3,499	38,978.86
国泰君安 证券股份 有限公司	301607	富特科技	网下申购	2,567	35,938.00
国泰君安 证券股份 有限公司	301556	托普云农	网下申购	2,663	38,613.50
国泰君安 证券股份 有限公司	603194	中力股份	网下申购	2,904	59,009.28
上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日					
关联方名 称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张 /股）	总金额
国泰君安 证券股份 有限公司	001314	亿道信息	网下申购	508	17,780.00
国泰君安 证券股份 有限公司	001311	多利科技	网下申购	499	30,873.13

国泰君安证券股份有限公司	603065	宿迁联盛	网下申购	581	7,465.85
国泰君安证券股份有限公司	603135	中重科技	网下申购	6,273	111,659.40
国泰君安证券股份有限公司	688479	友车科技	网下申购	3,318	112,778.82
国泰君安证券股份有限公司	688361	中科飞测	网下申购	8,303	195,950.80
国泰君安证券股份有限公司	688543	国科军工	网下申购	4,094	178,784.98
国泰君安证券股份有限公司	301499	维科精密	网下申购	3,709	72,325.50
国泰君安证券股份有限公司	688651	盛邦安全	网下申购	1,778	70,942.20
国泰君安证券股份有限公司	300904	威力传动	网下申购	3,037	107,540.17
国泰君安证券股份有限公司	301500	飞南资源	网下申购	4,550	109,063.50
国泰君安证券股份有限公司	603276	恒兴新材	网下申购	1,336	34,375.28
国泰君安证券股份有限公司	603273	天元智能	网下申购	1,772	16,834.00

国泰君安证券股份有限公司	688652	京仪装备	网下申购	4,157	132,816.15
国泰君安证券股份有限公司	601083	锦江航运	网下申购	12,630	142,087.50
国泰君安证券股份有限公司	001239	永达股份	网下申购	1,887	22,738.35

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金（因追踪指数成份股而被动）持有君正集团的股票1,079,900股（上年度末：1,116,600股），估值总额为人民币5,680,274.00元（上年度末：4,176,084.00元），占基金净资产的比例为0.25%（上年度末：0.19%）。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

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
301626	苏州天脉	2024-10-17	6个月	创业板打新限售	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
688615	合合信息	2024-09-19	6个月	科创板打新限售	55.18	165.78	289	15,947.02	47,910.42	-
3016	珂玛	2024	6个月	创业	8.00	56.10	804	6,43	45,10	-

11	科技	-08-07		板打 新限售				2.00	4.40	
688449	联芸科技	2024-11-20	6个月	科创板打 新限售	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-
688605	先锋精科	2024-12-04	6个月	科创板打 新限售	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688708	佳驰科技	2024-11-27	6个月	科创板打 新限售	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-
688726	拉普拉斯	2024-10-22	6个月	科创板打 新限售	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-
001391	N国货航	2024-12-23	6个月	新股 锁定	2.30	6.80	4,686	10,777.80	31,864.80	-
301551	无线传媒	2024-09-19	6个月	创业板打 新限售	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
688750	金天钛业	2024-11-12	6个月	科创板打 新限售	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-
603072	天和磁材	2024-12-24	1个月内 (含)	新股 未上市	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
3015	上大	2024	6个月	创业	6.88	24.84	816	5,61	20,26	-

22	股份	-10-09		板打 新限售				4.08	9.44	
688721	龙图 光罩	2024-07-30	6个月	科创板打 新限售	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
301556	托普 云农	2024-10-10	6个月	创业板打 新限售	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301631	壹连 科技	2024-11-12	6个月	创业板打 新限售	72.99	101.96	153	11,167.47	15,599.88	-
301606	绿联 科技	2024-07-17	6个月	创业板打 新限售	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301571	国科 天成	2024-08-14	6个月	创业板打 新限售	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301622	英思 特	2024-11-26	6个月	创业板打 新限售	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301608	博实 结	2024-07-25	6个月	创业板打 新限售	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301613	新铝 时代	2024-10-18	6个月	创业板打 新限售	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-

				售						
301586	佳力奇	2024-08-21	6个月	创业板打新限售	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
688710	益诺思	2024-08-27	6个月	科创板打新限售	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
301617	博苑股份	2024-12-03	6个月	创业板打新限售	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301603	乔锋智能	2024-07-03	6个月	创业板打新限售	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301607	富特科技	2024-08-28	6个月	创业板打新限售	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
603194	C中力	2024-12-17	6个月	新股锁定	20.32	28.13	291	5,913.12	8,185.83	-
301552	科力装备	2024-07-15	6个月	创业板打新限售	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301585	蓝宇股份	2024-12-10	6个月	创业板打新限售	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
001279	强邦新材	2024-09-2	6个月	新股锁定	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-

		7								
603395	红四方	2024-11-19	6个月	新股锁定	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
603207	小方制药	2024-08-19	6个月	新股锁定	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603310	巍华新材	2024-08-07	6个月	新股锁定	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603091	众鑫股份	2024-09-10	6个月	新股锁定	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603391	力聚热能	2024-07-24	6个月	新股锁定	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
603350	安乃达	2024-06-26	6个月	新股锁定	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603205	健尔康	2024-10-29	6个月	新股锁定	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月	新股锁定	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6个月	新股锁定	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2024年12月31日，本基金未持有银行间市场债券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

截至本报告期末2024年12月31日，本基金未持有交易所市场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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是被动式投资的股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似，本基金预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪标的指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(比如流动性不足等)导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责拟定公司风险管理战略，经董事会批准后组织实施；组织实施经董事会批准的年度风险预算、风险可容忍度限额及其他量化风险管理工具；根据公司总体风险控制目标，制定各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司就重大风险管理作出的决定或决议；听取并讨论会议议题，就重大风险管理事项形成决议；拟定或批准公司风险管理制度、流程。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，内控合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易

等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、大类风险的识别、计量和控制。风险管理部向公司首席风控官进行汇报。内审部对公司内部控制和风险管理的有效性，经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇报。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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人国泰君安证券股份有限公司开立于具有基金托管资格的银行的托管账户及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为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出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	163,905.03
未评级	-	-
合计	-	163,905.03

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于2024年12月31日，本基金所承担的全部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，因此账面余额即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《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合持仓集中度指标、流通受限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。

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

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交易对手管理制度：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。

本基金的管理人定期对组合中债券投资和资产支持证券投资部分面临的利率风险进行监控，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	26,941,322.72	-	-	-	26,941,322.72
结算备付金	11,993,039.0	-	-	2,543.47	11,995,582.51

	4				
存出保证金	584,254.26	-	-	4,804,464.00	5,388,718.26
交易性金融资产	-	-	-	2,247,213,007.85	2,247,213,007.85
应收清算款	-	-	-	1,277,671.47	1,277,671.47
资产总计	39,518,616.02	-	-	2,253,297,686.79	2,292,816,302.81
负债					
应付清算款	-	-	-	1,279,106.56	1,279,106.56
应付管理人报酬	-	-	-	1,009,968.75	1,009,968.75
应付托管费	-	-	-	201,993.74	201,993.74
应交税费	-	-	-	235,837.50	235,837.50
其他负债	-	-	-	590,741.89	590,741.89
负债总计	-	-	-	3,317,648.44	3,317,648.44
利率敏感度缺口	39,518,616.02	-	-	2,249,980,038.35	2,289,498,654.37
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	18,144,345.68	-	-	-	18,144,345.68
结算备付金	130,819.57	-	-	64,114,084.35	64,244,903.92
存出保证金	225,039.53	-	-	10,415,745.60	10,640,785.13
交易性金融资产	-	-	163,905.03	2,113,138,158.10	2,113,302,063.13
应收清算款	-	-	-	9,105,378.05	9,105,378.05
其他资产	-	-	-	132,673.59	132,673.59
资产总计	18,500,204.78	-	163,905.03	2,196,906,039.69	2,215,570,149.50
负债					
应付清算款	-	-	-	9,242,508.41	9,242,508.41
应付管理人报酬	-	-	-	923,303.65	923,303.65
应付托管费	-	-	-	184,660.74	184,660.74
应交税费	-	-	-	12,049.76	12,049.76
其他负债	-	-	-	691,194.50	691,194.50
负债总计	-	-	-	11,053,717.06	11,053,717.06

利率敏感度缺口	18,500,204.78	-	163,905.03	2,185,852,322.63	2,204,516,432.44
---------	---------------	---	------------	------------------	------------------

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，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例为0.00%(2023年12月31日：0.01%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金原则上采用完全复制法，跟踪中证500指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

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	2,247,213,007.85	98.15	2,113,138,158.10	95.85

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	2,247,213,007.85	98.15	2,113,138,158.10	95.85

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较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%	116,545,784.25	111,303,423.82
	业绩比较基准下降5%	-116,545,784.25	-111,303,423.82

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	上年度末
---------------	-----	------

	2024年12月31日	2023年12月31日
第一层次	2,246,541,305.49	2,111,830,099.79
第二层次	27,736.50	163,905.03
第三层次	643,965.86	1,308,058.31
合计	2,247,213,007.85	2,113,302,063.13

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。

对于公开市场交易的证券投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期		
	2024年01月01日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,308,058.31	1,308,058.31
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	530,388.08	530,388.08
转出第三层次	-	1,609,691.33	1,609,691.33
当期利得或损失总额	-	415,210.80	415,210.80
其中：计入损益的利得或损失	-	415,210.80	415,210.80
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	643,965.86	643,965.86

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	-	383,244.77	383,244.77
项目	上年度可比期间 2023年01月01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	-	1,763,234.28	1,763,234.28
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	4,167,283.20	4,167,283.20
转出第三层次	-	4,083,432.51	4,083,432.51
当期利得或损失总额	-	-539,026.66	-539,026.66
其中：计入损益的利得或损失	-	-539,026.66	-539,026.66
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,308,058.31	1,308,058.31
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	-	-294,168.95	-294,168.95

注：于2024年12月31日，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。于2024年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。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	采用的估值技	不可观察输入值
----	-------	--------	---------

	价值	术	名称	范围/加权 平均值	与公允价值之 间的关系
股票 投资	643,965.86	平均价格亚式 期权模型	预期年化 波动率	0.2665~5.74 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
股票 投资	1,308,058.31	平均价格亚式 期权模型	预期年化 波动率	0.1962~2.19 88	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	2,247,213,007.85	98.01
	其中：股票	2,247,213,007.85	98.01
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	38,936,905.23	1.70
8	其他各项资产	6,666,389.73	0.29
9	合计	2,292,816,302.81	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	12,964,702.00	0.57
B	采矿业	78,762,765.00	3.44
C	制造业	1,395,243,126.93	60.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	82,496,683.90	3.60
E	建筑业	24,394,685.00	1.07
F	批发和零售业	53,539,064.86	2.34
G	交通运输、仓储和邮政业	34,311,649.00	1.50
H	住宿和餐饮业	7,072,180.00	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	197,152,510.25	8.61
J	金融业	232,696,527.45	10.16
K	房地产业	28,763,499.00	1.26
L	租赁和商务服务业	19,548,004.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	15,563,898.80	0.68
N	水利、环境和公共设施管理业	10,844,579.70	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	5,366,560.00	0.23
Q	卫生和社会工作	13,028,472.60	0.57
R	文化、体育和娱乐业	29,349,488.00	1.28
S	综合	5,442,909.00	0.24
	合计	2,246,541,305.49	98.12

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	495,433.63	0.02
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	31,864.80	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	133,255.37	0.01
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	11,148.56	0.00
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	671,702.36	0.03
--	----	------------	------

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	002625	光启技术	482,600	23,068,280.00	1.01
2	600418	江淮汽车	559,000	20,962,500.00	0.92
3	000988	华工科技	321,700	13,929,610.00	0.61
4	002384	东山精密	436,617	12,749,216.40	0.56
5	300339	润和软件	254,800	12,747,644.00	0.56
6	600157	永泰能源	7,107,900	12,154,509.00	0.53
7	600839	四川长虹	1,181,500	11,401,475.00	0.50
8	002797	第一创业	1,344,600	11,227,410.00	0.49
9	600487	亨通光电	631,300	10,870,986.00	0.47
10	301236	软通动力	182,900	10,738,059.00	0.47
11	002340	格林美	1,640,000	10,709,200.00	0.47
12	300207	欣旺达	472,400	10,539,244.00	0.46
13	688777	中控技术	202,400	10,053,208.00	0.44
14	002156	通富微电	339,800	10,041,090.00	0.44
15	601162	天风证券	2,218,000	9,936,640.00	0.43
16	601555	东吴证券	1,271,770	9,919,806.00	0.43
17	002273	水晶光电	444,900	9,885,678.00	0.43
18	002966	苏州银行	1,204,489	9,768,405.79	0.43
19	002185	华天科技	820,290	9,523,566.90	0.42
20	601099	太平洋	2,180,900	9,290,634.00	0.41
21	601933	永辉超市	1,451,900	9,205,046.00	0.40
22	600096	云天化	410,901	9,163,092.30	0.40
23	002202	金风科技	883,500	9,126,555.00	0.40

24	000423	东阿阿胶	144,200	9,044,224.00	0.40
25	000066	中国长城	619,200	9,021,744.00	0.39
26	600536	中国软件	190,398	8,889,682.62	0.39
27	601168	西部矿业	533,600	8,574,952.00	0.37
28	600352	浙江龙盛	832,600	8,567,454.00	0.37
29	600079	人福医药	365,600	8,547,728.00	0.37
30	601108	财通证券	1,039,900	8,495,983.00	0.37
31	600885	宏发股份	266,860	8,491,485.20	0.37
32	600988	赤峰黄金	532,300	8,309,203.00	0.36
33	300017	网宿科技	781,100	8,256,227.00	0.36
34	002738	中矿资源	230,840	8,194,820.00	0.36
35	300476	胜宏科技	193,200	8,131,788.00	0.36
36	002138	顺络电子	257,900	8,118,692.00	0.35
37	601577	长沙银行	900,500	8,005,445.00	0.35
38	002078	太阳纸业	536,479	7,977,442.73	0.35
39	002281	光迅科技	152,300	7,945,491.00	0.35
40	300136	信维通信	309,600	7,876,224.00	0.34
41	300474	景嘉微	83,560	7,812,024.40	0.34
42	002085	万丰奥威	407,600	7,724,020.00	0.34
43	689009	九号公司	160,600	7,628,500.00	0.33
44	600879	航天电子	844,400	7,565,824.00	0.33
45	300803	指南针	78,400	7,522,480.00	0.33
46	300058	蓝色光标	808,300	7,501,024.00	0.33
47	002517	恺英网络	551,000	7,499,110.00	0.33
48	002444	巨星科技	230,858	7,468,256.30	0.33
49	688120	华海清科	45,406	7,400,723.94	0.32
50	603893	瑞芯微	66,900	7,363,014.00	0.32
51	300223	北京君正	107,900	7,358,780.00	0.32
52	688099	晶晨股份	107,129	7,357,619.72	0.32
53	601615	明阳智能	581,400	7,331,454.00	0.32
54	601128	常熟银行	964,650	7,302,400.50	0.32

55	300002	神州泰岳	627,900	7,277,361.00	0.32
56	002353	杰瑞股份	196,600	7,272,234.00	0.32
57	600109	国金证券	831,400	7,258,122.00	0.32
58	000783	长江证券	1,061,700	7,240,794.00	0.32
59	002195	岩山科技	1,817,769	7,216,542.93	0.32
60	300024	机器人	400,710	7,192,744.50	0.31
61	603160	汇顶科技	88,000	7,087,520.00	0.31
62	002532	天山铝业	892,900	7,027,123.00	0.31
63	002128	电投能源	358,600	7,021,388.00	0.31
64	002223	鱼跃医疗	192,409	7,021,004.41	0.31
65	300496	中科创达	117,800	7,016,168.00	0.31
66	600298	安琪酵母	194,500	7,011,725.00	0.31
67	000728	国元证券	837,700	7,003,172.00	0.31
68	002673	西部证券	858,100	6,993,515.00	0.31
69	002465	海格通信	635,155	6,974,001.90	0.30
70	688617	惠泰医疗	18,710	6,966,294.30	0.30
71	688469	芯联集成	1,355,000	6,951,150.00	0.30
72	688213	思特威	89,405	6,948,556.60	0.30
73	601567	三星医疗	225,700	6,942,532.00	0.30
74	603606	东方电缆	132,100	6,941,855.00	0.30
75	688072	拓荆科技	44,600	6,853,682.00	0.30
76	601198	东兴证券	620,600	6,832,806.00	0.30
77	688047	龙芯中科	51,400	6,799,192.00	0.30
78	600765	中航重机	331,740	6,790,717.80	0.30
79	300114	中航电测	94,500	6,783,210.00	0.30
80	600862	中航高科	267,400	6,754,524.00	0.30
81	002008	大族激光	269,300	6,732,500.00	0.29
82	300383	光环新网	460,100	6,712,859.00	0.29
83	300012	华测检测	538,360	6,691,814.80	0.29
84	000831	中国稀土	237,611	6,664,988.55	0.29
85	600895	张江高科	247,700	6,638,360.00	0.29

86	300866	安克创新	67,980	6,637,567.20	0.29
87	002472	双环传动	216,400	6,626,168.00	0.29
88	301358	湖南裕能	145,300	6,584,996.00	0.29
89	600177	雅戈尔	739,500	6,581,550.00	0.29
90	300699	光威复材	186,240	6,453,216.00	0.28
91	603605	珀莱雅	76,100	6,445,670.00	0.28
92	002595	豪迈科技	128,000	6,424,320.00	0.28
93	600873	梅花生物	639,000	6,409,170.00	0.28
94	601233	桐昆股份	539,900	6,370,820.00	0.28
95	300037	新宙邦	168,760	6,318,374.40	0.28
96	300395	菲利华	167,100	6,284,631.00	0.27
97	000400	许继电气	228,200	6,282,346.00	0.27
98	300054	鼎龙股份	240,100	6,247,402.00	0.27
99	688122	西部超导	145,600	6,234,592.00	0.27
100	300604	长川科技	140,400	6,195,852.00	0.27
101	300142	沃森生物	511,800	6,182,544.00	0.27
102	601990	南京证券	707,600	6,127,816.00	0.27
103	000750	国海证券	1,430,000	6,120,400.00	0.27
104	603596	伯特利	135,840	6,057,105.60	0.26
105	000009	中国宝安	660,200	6,040,830.00	0.26
106	002436	兴森科技	540,600	6,006,066.00	0.26
107	688249	晶合集成	256,700	5,991,378.00	0.26
108	688525	佰维存储	96,500	5,980,105.00	0.26
109	600369	西南证券	1,275,700	5,957,519.00	0.26
110	600153	建发股份	565,800	5,952,216.00	0.26
111	601696	中银证券	533,100	5,949,396.00	0.26
112	600642	申能股份	626,300	5,943,587.00	0.26
113	002850	科达利	60,600	5,919,408.00	0.26
114	002261	拓维信息	321,600	5,888,496.00	0.26
115	688521	芯原股份	112,100	5,877,403.00	0.26
116	600549	厦门钨业	304,800	5,873,496.00	0.26

117	600143	金发科技	674,900	5,831,136.00	0.25
118	002821	凯莱英	76,200	5,798,058.00	0.25
119	600398	海澜之家	768,300	5,762,250.00	0.25
120	000021	深科技	299,600	5,710,376.00	0.25
121	601216	君正集团	1,079,900	5,680,274.00	0.25
122	300724	捷佳伟创	89,000	5,625,690.00	0.25
123	000738	航发控制	252,500	5,615,600.00	0.25
124	601997	贵阳银行	935,700	5,614,200.00	0.25
125	000932	华菱钢铁	1,326,200	5,543,516.00	0.24
126	002294	信立泰	178,300	5,514,819.00	0.24
127	002558	巨人网络	433,200	5,497,308.00	0.24
128	600529	山东药玻	212,300	5,470,971.00	0.24
129	000878	云南铜业	448,700	5,469,653.00	0.24
130	600909	华安证券	901,610	5,463,756.60	0.24
131	600497	驰宏锌锗	977,500	5,444,675.00	0.24
132	600673	东阳光	482,100	5,442,909.00	0.24
133	000729	燕京啤酒	450,900	5,428,836.00	0.24
134	300919	中伟股份	149,900	5,414,388.00	0.24
135	688002	睿创微纳	114,704	5,392,235.04	0.24
136	688361	中科飞测	61,400	5,375,570.00	0.23
137	002607	中公教育	1,578,400	5,366,560.00	0.23
138	600141	兴发集团	247,000	5,359,900.00	0.23
139	603345	安井食品	65,700	5,353,236.00	0.23
140	002409	雅克科技	91,400	5,296,630.00	0.23
141	000623	吉林敖东	306,100	5,286,347.00	0.23
142	000997	新大陆	264,200	5,270,790.00	0.23
143	600155	华创云信	711,600	5,265,840.00	0.23
144	000034	神州数码	149,900	5,253,995.00	0.23
145	000733	振华科技	124,200	5,237,514.00	0.23
146	603338	浙江鼎力	81,000	5,226,120.00	0.23
147	300073	当升科技	129,700	5,224,316.00	0.23

148	002065	东华软件	717,900	5,211,954.00	0.23
149	002064	华峰化学	635,100	5,195,118.00	0.23
150	601665	齐鲁银行	928,300	5,189,197.00	0.23
151	300001	特锐德	236,400	5,188,980.00	0.23
152	601456	国联证券	382,200	5,167,344.00	0.23
153	600118	中国卫星	189,100	5,162,430.00	0.23
154	600563	法拉电子	43,100	5,125,452.00	0.22
155	002318	久立特材	218,900	5,124,449.00	0.22
156	688188	柏楚电子	26,376	5,123,538.00	0.22
157	002432	九安医疗	125,500	5,117,890.00	0.22
158	603087	甘李药业	115,400	5,089,140.00	0.22
159	002739	万达电影	418,400	5,079,376.00	0.22
160	600820	隧道股份	704,100	5,062,479.00	0.22
161	600704	物产中大	996,800	5,043,808.00	0.22
162	600521	华海药业	281,500	5,030,405.00	0.22
163	600580	卧龙电驱	291,700	5,014,323.00	0.22
164	600637	东方明珠	645,300	5,007,528.00	0.22
165	600312	平高电气	260,500	5,001,600.00	0.22
166	600060	海信视像	250,500	4,994,970.00	0.22
167	601179	中国西电	655,900	4,978,281.00	0.22
168	002410	广联达	422,700	4,970,952.00	0.22
169	600699	均胜电子	315,500	4,943,885.00	0.22
170	002841	视源股份	133,700	4,934,867.00	0.22
171	600132	重庆啤酒	77,400	4,877,748.00	0.21
172	002984	森麒麟	197,602	4,872,865.32	0.21
173	002385	大北农	1,106,700	4,792,011.00	0.21
174	300003	乐普医疗	421,300	4,777,542.00	0.21
175	601666	平煤股份	475,100	4,760,502.00	0.21
176	002262	恩华药业	195,100	4,750,685.00	0.21
177	603568	伟明环保	218,190	4,719,449.70	0.21
178	002568	百润股份	167,900	4,702,879.00	0.21

179	688180	君实生物	171,600	4,689,828.00	0.20
180	300751	迈为股份	44,600	4,689,690.00	0.20
181	300763	锦浪科技	76,700	4,684,069.00	0.20
182	000683	远兴能源	837,600	4,682,184.00	0.20
183	603939	益丰药房	193,956	4,680,158.28	0.20
184	300144	宋城演艺	503,500	4,677,515.00	0.20
185	603179	新泉股份	109,100	4,658,570.00	0.20
186	600390	五矿资本	719,600	4,641,420.00	0.20
187	002152	广电运通	397,350	4,633,101.00	0.20
188	600008	首创环保	1,409,450	4,622,996.00	0.20
189	600392	盛和资源	448,600	4,611,608.00	0.20
190	002044	美年健康	1,001,800	4,598,262.00	0.20
191	000039	中集集团	589,350	4,579,249.50	0.20
192	603129	春风动力	29,100	4,570,737.00	0.20
193	002407	多氟多	380,820	4,569,840.00	0.20
194	300373	扬杰科技	104,300	4,539,136.00	0.20
195	603589	口子窖	115,200	4,520,448.00	0.20
196	600170	上海建工	1,705,800	4,520,370.00	0.20
197	600863	内蒙华电	1,043,900	4,520,087.00	0.20
198	600486	扬农化工	78,040	4,516,174.80	0.20
199	000513	丽珠集团	118,832	4,515,616.00	0.20
200	300529	健帆生物	153,300	4,497,822.00	0.20
201	002624	完美世界	434,400	4,487,352.00	0.20
202	601717	郑煤机	345,400	4,483,292.00	0.20
203	601000	唐山港	948,100	4,465,551.00	0.20
204	600763	通策医疗	100,184	4,448,169.60	0.19
205	000960	锡业股份	315,900	4,432,077.00	0.19
206	300251	光线传媒	469,200	4,429,248.00	0.19
207	600498	烽火通信	227,500	4,427,150.00	0.19
208	600316	洪都航空	137,700	4,422,924.00	0.19
209	000426	兴业银锡	397,700	4,422,424.00	0.19

210	000703	恒逸石化	703,800	4,419,864.00	0.19
211	600872	中炬高新	200,500	4,415,010.00	0.19
212	600816	建元信托	1,259,900	4,409,650.00	0.19
213	000723	美锦能源	969,000	4,370,190.00	0.19
214	600516	方大炭素	901,700	4,355,211.00	0.19
215	603816	顾家家居	157,800	4,352,124.00	0.19
216	300285	国瓷材料	255,208	4,348,744.32	0.19
217	603979	金诚信	119,800	4,348,740.00	0.19
218	300558	贝达药业	80,300	4,330,579.00	0.19
219	002500	山西证券	689,136	4,327,774.08	0.19
220	002958	青农商行	1,422,300	4,323,792.00	0.19
221	688578	艾力斯	72,000	4,312,800.00	0.19
222	300390	天华新能	186,030	4,287,991.50	0.19
223	000830	鲁西化工	366,700	4,286,723.00	0.19
224	000921	海信家电	148,200	4,282,980.00	0.19
225	000629	钒钛股份	1,487,100	4,282,848.00	0.19
226	002603	以岭药业	267,200	4,277,872.00	0.19
227	002025	航天电器	87,700	4,258,712.00	0.19
228	605358	立昂微	171,800	4,255,486.00	0.19
229	000636	风华高科	296,100	4,249,035.00	0.19
230	002155	湖南黄金	269,300	4,236,089.00	0.19
231	002939	长城证券	516,300	4,233,660.00	0.18
232	601966	玲珑轮胎	234,200	4,224,968.00	0.18
233	000893	亚钾国际	208,100	4,195,296.00	0.18
234	002926	华西证券	503,900	4,187,409.00	0.18
235	002429	兆驰股份	724,200	4,185,876.00	0.18
236	000591	太阳能	876,500	4,172,140.00	0.18
237	688052	纳芯微	32,000	4,169,600.00	0.18
238	601880	辽港股份	2,398,900	4,150,097.00	0.18
239	600535	天士力	286,800	4,147,128.00	0.18
240	600021	上海电力	450,500	4,131,085.00	0.18

241	600511	国药股份	120,700	4,130,354.00	0.18
242	600998	九州通	806,603	4,129,807.36	0.18
243	002203	海亮股份	383,700	4,124,775.00	0.18
244	600348	华阳股份	577,100	4,091,639.00	0.18
245	002414	高德红外	546,668	4,061,743.24	0.18
246	600325	华发股份	704,500	4,057,920.00	0.18
247	600380	健康元	359,700	4,053,819.00	0.18
248	600038	中直股份	104,900	4,044,944.00	0.18
249	603927	中科软	186,156	4,039,585.20	0.18
250	603077	和邦生物	1,977,700	4,034,508.00	0.18
251	600208	衢州发展	1,361,500	4,030,040.00	0.18
252	600655	豫园股份	623,100	4,006,533.00	0.17
253	600970	中材国际	422,600	4,006,248.00	0.17
254	002423	中粮资本	294,900	3,948,711.00	0.17
255	601016	节能风电	1,242,670	3,939,263.90	0.17
256	300567	精测电子	61,200	3,935,160.00	0.17
257	688385	复旦微电	102,500	3,934,975.00	0.17
258	300146	汤臣倍健	326,500	3,934,325.00	0.17
259	300748	金力永磁	219,720	3,928,593.60	0.17
260	600754	锦江酒店	146,200	3,926,932.00	0.17
261	000060	中金岭南	837,200	3,926,468.00	0.17
262	600859	王府井	254,200	3,917,222.00	0.17
263	002756	永兴材料	103,500	3,904,020.00	0.17
264	603000	人民网	176,900	3,898,876.00	0.17
265	300487	蓝晓科技	81,200	3,887,044.00	0.17
266	600901	江苏金租	741,400	3,870,108.00	0.17
267	600583	海油工程	707,300	3,868,931.00	0.17
268	002683	广东宏大	145,900	3,863,432.00	0.17
269	000519	中兵红箭	267,300	3,862,485.00	0.17
270	603885	吉祥航空	281,400	3,855,180.00	0.17
271	688278	特宝生物	52,200	3,829,914.00	0.17

272	600166	福田汽车	1,520,000	3,815,200.00	0.17
273	600707	彩虹股份	459,300	3,775,446.00	0.16
274	300212	易华录	161,180	3,771,612.00	0.16
275	000998	隆平高科	337,100	3,765,407.00	0.16
276	600546	山煤国际	317,100	3,751,293.00	0.16
277	600282	南钢股份	789,100	3,700,879.00	0.16
278	002439	启明星辰	233,900	3,700,298.00	0.16
279	603156	养元饮品	161,900	3,697,796.00	0.16
280	300601	康泰生物	214,400	3,676,960.00	0.16
281	601001	晋控煤业	267,700	3,659,459.00	0.16
282	300677	英科医疗	144,700	3,658,016.00	0.16
283	002507	涪陵榨菜	258,414	3,651,389.82	0.16
284	600004	白云机场	378,600	3,634,560.00	0.16
285	600131	国网信通	192,200	3,634,502.00	0.16
286	000598	兴蓉环境	477,400	3,623,466.00	0.16
287	688065	凯赛生物	93,200	3,616,160.00	0.16
288	688220	翱捷科技	66,800	3,613,212.00	0.16
289	002373	千方科技	353,900	3,588,546.00	0.16
290	300765	新诺威	134,900	3,586,991.00	0.16
291	600867	通化东宝	443,800	3,577,028.00	0.16
292	603899	晨光股份	118,200	3,575,550.00	0.16
293	002653	海思科	107,506	3,574,574.50	0.16
294	601918	新集能源	497,200	3,569,896.00	0.16
295	000050	深天马 A	393,100	3,549,693.00	0.16
296	600483	福能股份	355,800	3,547,326.00	0.15
297	300070	碧水源	695,700	3,520,242.00	0.15
298	688017	绿的谐波	32,446	3,506,114.76	0.15
299	300118	东方日升	291,800	3,495,764.00	0.15
300	000563	陕国投 A	981,673	3,494,755.88	0.15
301	600737	中粮糖业	342,200	3,493,862.00	0.15
302	002120	韵达股份	463,800	3,487,776.00	0.15

303	601611	中国核建	385,400	3,484,016.00	0.15
304	688772	珠海冠宇	216,388	3,479,519.04	0.15
305	601231	环旭电子	210,100	3,466,650.00	0.15
306	601155	新城控股	289,400	3,461,224.00	0.15
307	603486	科沃斯	73,600	3,459,200.00	0.15
308	601098	中南传媒	229,900	3,450,799.00	0.15
309	603290	斯达半导	38,300	3,440,106.00	0.15
310	301308	江波龙	40,000	3,440,000.00	0.15
311	600566	济川药业	118,000	3,431,440.00	0.15
312	002430	杭氧股份	157,400	3,431,320.00	0.15
313	002244	滨江集团	398,300	3,429,363.00	0.15
314	601156	东航物流	203,200	3,427,984.00	0.15
315	688005	容百科技	108,100	3,410,555.00	0.15
316	603529	爱玛科技	82,700	3,392,354.00	0.15
317	601991	大唐发电	1,189,600	3,390,360.00	0.15
318	000987	越秀资本	481,630	3,381,042.60	0.15
319	002056	横店东磁	260,200	3,372,192.00	0.15
320	600598	北大荒	227,500	3,355,625.00	0.15
321	600416	湘电股份	296,800	3,350,872.00	0.15
322	300676	华大基因	79,800	3,349,206.00	0.15
323	603228	景旺电子	119,400	3,324,096.00	0.15
324	000818	航锦科技	173,800	3,319,580.00	0.14
325	000887	中鼎股份	252,600	3,314,112.00	0.14
326	601866	中远海发	1,266,900	3,306,609.00	0.14
327	002368	太极股份	139,620	3,306,201.60	0.14
328	600435	北方导航	336,600	3,285,216.00	0.14
329	600582	天地科技	529,700	3,273,546.00	0.14
330	300595	欧普康视	172,100	3,261,295.00	0.14
331	300009	安科生物	375,460	3,243,974.40	0.14
332	603658	安图生物	74,300	3,242,452.00	0.14
333	002670	国盛金控	247,700	3,242,393.00	0.14

334	600271	航天信息	355,600	3,239,516.00	0.14
335	002508	老板电器	151,000	3,235,930.00	0.14
336	002831	裕同科技	119,100	3,227,610.00	0.14
337	002240	盛新锂能	234,200	3,227,276.00	0.14
338	600755	厦门国贸	485,400	3,223,056.00	0.14
339	000958	电投产融	516,800	3,219,664.00	0.14
340	002572	索菲亚	184,800	3,174,864.00	0.14
341	000155	川能动力	295,400	3,154,872.00	0.14
342	688363	华熙生物	61,800	3,154,272.00	0.14
343	600258	首旅酒店	214,400	3,145,248.00	0.14
344	300888	稳健医疗	74,560	3,137,484.80	0.14
345	300573	兴齐眼药	44,800	3,126,144.00	0.14
346	688114	华大智造	66,632	3,117,711.28	0.14
347	601958	金钼股份	309,800	3,116,588.00	0.14
348	600685	中船防务	131,400	3,114,180.00	0.14
349	000883	湖北能源	624,000	3,107,520.00	0.14
350	600995	南网储能	306,800	3,104,816.00	0.14
351	600848	上海临港	306,400	3,094,640.00	0.14
352	600129	太极集团	124,700	3,082,584.00	0.13
353	688538	和辉光电	1,327,494	3,079,786.08	0.13
354	002268	电科网安	189,300	3,076,125.00	0.13
355	600378	昊华科技	106,400	3,076,024.00	0.13
356	000739	普洛药业	187,000	3,040,620.00	0.13
357	600739	辽宁成大	293,600	3,038,760.00	0.13
358	003031	中瓷电子	57,740	3,024,998.60	0.13
359	600517	国网英大	548,800	3,023,888.00	0.13
360	603444	吉比特	13,800	3,019,992.00	0.13
361	603379	三美股份	78,140	2,999,013.20	0.13
362	603298	杭叉集团	167,600	2,998,364.00	0.13
363	000403	派林生物	140,400	2,966,652.00	0.13
364	601118	海南橡胶	547,800	2,963,598.00	0.13

365	000027	深圳能源	456,500	2,958,120.00	0.13
366	600906	财达证券	415,400	2,949,340.00	0.13
367	000778	新兴铸管	765,800	2,940,672.00	0.13
368	000709	河钢股份	1,322,600	2,922,946.00	0.13
369	603728	鸣志电器	53,600	2,894,400.00	0.13
370	601636	旗滨集团	515,200	2,890,272.00	0.13
371	603712	七一二	148,200	2,885,454.00	0.13
372	002299	圣农发展	198,900	2,880,072.00	0.13
373	603737	三棵树	67,440	2,872,944.00	0.13
374	000785	居然智家	804,400	2,871,708.00	0.13
375	600499	科达制造	368,100	2,871,180.00	0.13
376	600528	中铁工业	355,400	2,864,524.00	0.13
377	601399	国机重装	923,100	2,843,148.00	0.12
378	600606	绿地控股	1,349,500	2,833,950.00	0.12
379	002557	洽洽食品	97,339	2,827,697.95	0.12
380	601928	凤凰传媒	244,200	2,818,068.00	0.12
381	600373	中文传媒	224,400	2,816,220.00	0.12
382	688234	天岳先进	55,000	2,816,000.00	0.12
383	002080	中材科技	214,800	2,809,584.00	0.12
384	600329	达仁堂	91,200	2,808,960.00	0.12
385	603858	步长制药	177,000	2,796,600.00	0.12
386	600968	海油发展	650,500	2,777,635.00	0.12
387	600977	中国电影	238,900	2,773,629.00	0.12
388	688536	思瑞浦	29,785	2,755,112.50	0.12
389	688567	孚能科技	234,644	2,721,870.40	0.12
390	601598	中国外运	504,700	2,700,145.00	0.12
391	600884	杉杉股份	360,500	2,685,725.00	0.12
392	603650	彤程新材	76,700	2,682,199.00	0.12
393	600959	江苏有线	800,000	2,680,000.00	0.12
394	600871	石化油服	1,302,700	2,657,508.00	0.12
395	600056	中国医药	239,241	2,655,575.10	0.12

396	600062	华润双鹤	133,100	2,635,380.00	0.12
397	600095	湘财股份	366,000	2,635,200.00	0.12
398	601212	白银有色	947,400	2,633,772.00	0.12
399	688297	中无人机	64,900	2,614,172.00	0.11
400	688387	信科移动	437,382	2,606,796.72	0.11
401	002266	浙富控股	834,900	2,604,888.00	0.11
402	600801	华新水泥	215,100	2,602,710.00	0.11
403	000559	万向钱潮	422,860	2,600,589.00	0.11
404	600764	中国海防	91,000	2,577,120.00	0.11
405	002372	伟星新材	203,776	2,573,690.88	0.11
406	000032	深桑达 A	145,600	2,568,384.00	0.11
407	601106	中国一重	877,700	2,554,107.00	0.11
408	000825	太钢不锈	730,300	2,541,444.00	0.11
409	301301	川宁生物	213,900	2,536,854.00	0.11
410	002487	大金重工	122,500	2,510,025.00	0.11
411	002019	亿帆医药	233,600	2,504,192.00	0.11
412	603688	石英股份	86,700	2,490,891.00	0.11
413	600663	陆家嘴	251,700	2,476,728.00	0.11
414	688778	厦钨新能	54,000	2,464,560.00	0.11
415	601608	中信重工	586,200	2,462,040.00	0.11
416	603882	金域医学	88,900	2,447,417.00	0.11
417	688349	三一重能	78,418	2,421,547.84	0.11
418	688563	航材股份	43,200	2,412,288.00	0.11
419	600808	马钢股份	769,800	2,378,682.00	0.10
420	688561	奇安信	87,700	2,352,991.00	0.10
421	603456	九洲药业	171,900	2,351,592.00	0.10
422	600925	苏能股份	440,800	2,336,240.00	0.10
423	300957	贝泰妮	54,200	2,313,798.00	0.10
424	603556	海兴电力	62,500	2,311,875.00	0.10
425	600500	中化国际	574,200	2,308,284.00	0.10
426	002408	齐翔腾达	454,980	2,288,549.40	0.10

427	002531	天顺风能	287,600	2,274,916.00	0.10
428	601019	山东出版	200,300	2,273,405.00	0.10
429	601965	中国汽研	128,500	2,264,170.00	0.10
430	600578	京能电力	642,700	2,262,304.00	0.10
431	688425	铁建重工	511,868	2,252,219.20	0.10
432	001227	兰州银行	911,100	2,241,306.00	0.10
433	600350	山东高速	217,400	2,234,872.00	0.10
434	688390	固德威	54,443	2,226,718.70	0.10
435	001286	陕西能源	239,900	2,226,272.00	0.10
436	600612	老凤祥	40,600	2,203,362.00	0.10
437	603233	大参林	145,700	2,194,242.00	0.10
438	688301	奕瑞科技	22,932	2,191,611.24	0.10
439	688516	奥特维	50,496	2,186,981.76	0.10
440	603225	新凤鸣	195,100	2,171,463.00	0.09
441	600098	广州发展	336,600	2,160,972.00	0.09
442	000937	冀中能源	339,200	2,143,744.00	0.09
443	601568	北元集团	508,350	2,135,070.00	0.09
444	600688	上海石化	703,500	2,124,570.00	0.09
445	603185	弘元绿能	130,400	2,119,000.00	0.09
446	600126	杭钢股份	432,400	2,066,872.00	0.09
447	603707	健友股份	154,991	2,056,730.57	0.09
448	002867	周大生	140,350	2,039,285.50	0.09
449	000967	盈峰环境	405,300	2,014,341.00	0.09
450	603883	老百姓	121,726	1,992,654.62	0.09
451	600720	中交设计	220,400	1,952,744.00	0.09
452	601139	深圳燃气	276,200	1,949,972.00	0.09
453	600339	中油工程	536,100	1,919,238.00	0.08
454	601992	金隅集团	1,067,200	1,899,616.00	0.08
455	002153	石基信息	262,072	1,871,194.08	0.08
456	002608	江苏国信	241,700	1,853,839.00	0.08
457	600295	鄂尔多斯	189,700	1,851,472.00	0.08

458	000898	鞍钢股份	765,300	1,836,720.00	0.08
459	002563	森马服饰	258,600	1,815,372.00	0.08
460	000537	中绿电	198,300	1,808,496.00	0.08
461	688032	禾迈股份	15,939	1,795,368.96	0.08
462	300140	节能环境	297,600	1,782,624.00	0.08
463	000401	冀东水泥	340,100	1,778,723.00	0.08
464	003022	联泓新科	128,200	1,765,314.00	0.08
465	688248	南网科技	54,200	1,739,278.00	0.08
466	688281	华秦科技	18,643	1,735,663.30	0.08
467	688331	荣昌生物	56,800	1,710,248.00	0.07
468	600032	浙江新能	230,900	1,708,660.00	0.07
469	002690	美亚光电	112,990	1,674,511.80	0.07
470	601228	广州港	483,000	1,637,370.00	0.07
471	600299	安迪苏	128,800	1,616,440.00	0.07
472	603786	科博达	25,900	1,600,620.00	0.07
473	600007	中国国贸	64,400	1,575,224.00	0.07
474	301165	锐捷网络	21,800	1,573,960.00	0.07
475	688520	神州细胞	42,746	1,548,687.58	0.07
476	688172	燕东微	76,800	1,539,840.00	0.07
477	600928	西安银行	426,500	1,539,665.00	0.07
478	301267	华夏眼科	80,600	1,534,624.00	0.07
479	600361	创新新材	394,300	1,521,998.00	0.07
480	688475	萤石网络	50,344	1,519,885.36	0.07
481	003035	南网能源	363,500	1,519,430.00	0.07
482	000959	首钢股份	497,700	1,517,985.00	0.07
483	603056	德邦股份	98,500	1,411,505.00	0.06
484	002945	华林证券	86,400	1,324,512.00	0.06
485	301498	乖宝宠物	16,700	1,307,944.00	0.06
486	000539	粤电力 A	284,900	1,290,597.00	0.06
487	001203	大中矿业	144,700	1,253,102.00	0.05
488	601061	中信金属	172,400	1,251,624.00	0.05

489	600927	永安期货	93,100	1,227,989.00	0.05
490	688375	国博电子	24,789	1,223,585.04	0.05
491	603826	坤彩科技	62,920	1,211,210.00	0.05
492	688819	天能股份	43,600	1,186,792.00	0.05
493	601858	中国科传	50,600	1,031,228.00	0.05
494	688276	百克生物	39,864	1,000,985.04	0.04
495	688153	唯捷创芯	27,500	920,150.00	0.04
496	601158	重庆水务	184,300	903,070.00	0.04
497	603341	龙旗科技	16,400	766,700.00	0.03
498	600956	新天绿能	98,500	742,690.00	0.03
499	603868	飞科电器	15,400	639,408.00	0.03
500	688295	中复神鹰	31,692	631,621.56	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	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.00
2	688615	合合信息	289	47,910.42	0.00
3	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.00
4	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00
5	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.00
6	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
7	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
8	001391	N国货航	4,686	31,864.80	0.00
9	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
10	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
11	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.00
12	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
13	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00

14	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
15	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
16	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
17	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
18	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
19	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
20	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
21	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
22	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
23	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
24	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
25	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
26	603194	C中力	291	8,185.83	0.00
27	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
28	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
29	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
30	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
31	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
32	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
33	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
34	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
35	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
36	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
37	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)

1	300339	润和软件	15,436,893.00	0.70
2	600487	亨通光电	11,262,089.00	0.51
3	688777	中控技术	11,099,762.73	0.50
4	601099	太平洋	10,427,948.00	0.47
5	601567	三星医疗	9,468,695.00	0.43
6	300476	胜宏科技	8,572,932.00	0.39
7	688072	拓荆科技	8,507,753.45	0.39
8	688525	佰维存储	8,416,205.85	0.38
9	002085	万丰奥威	8,035,370.78	0.36
10	688469	芯联集成	7,885,147.87	0.36
11	601615	明阳智能	7,851,421.00	0.36
12	688047	龙芯中科	7,796,398.91	0.35
13	688617	惠泰医疗	7,769,450.64	0.35
14	688213	思特威	7,674,755.00	0.35
15	300223	北京君正	7,483,850.00	0.34
16	002202	金风科技	7,475,196.00	0.34
17	603979	金诚信	7,417,754.00	0.34
18	300496	中科创达	7,389,691.00	0.34
19	603345	安井食品	7,381,191.00	0.33
20	300142	沃森生物	7,331,506.95	0.33

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	31,685,392.00	1.44
2	601058	赛轮轮胎	16,789,025.80	0.76
3	002028	思源电气	15,882,379.00	0.72

4	002463	沪电股份	15,776,638.00	0.72
5	601077	渝农商行	15,102,827.00	0.69
6	300394	天孚通信	14,512,949.00	0.66
7	002422	科伦药业	14,371,837.00	0.65
8	600066	宇通客车	13,816,886.00	0.63
9	600160	巨化股份	11,837,091.87	0.54
10	000975	山金国际	11,825,442.92	0.54
11	688169	石头科技	11,460,443.16	0.52
12	300418	昆仑万维	10,340,771.00	0.47
13	000933	神火股份	10,129,138.00	0.46
14	600161	天坛生物	9,987,154.40	0.45
15	000630	铜陵有色	9,479,965.00	0.43
16	600415	小商品城	8,860,719.00	0.40
17	600482	中国动力	8,131,524.00	0.37
18	600985	淮北矿业	7,375,528.56	0.33
19	688072	拓荆科技	7,373,354.07	0.33
20	600418	江淮汽车	6,037,129.00	0.27

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	1,099,324,132.54
卖出股票收入（成交）总额	1,041,652,307.91

注：本项"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

在实际进行投资运作时，由于ETF基金一般需要满仓操作，同时基金需要备出一定的现金头寸应对申赎及费用等支付，因此仓位无法达到100%，这时基金仓位就存在裸露风险，通过套期保值方式买入期货合约，可以使基金仓位达到100%，避免仓位暴露的风险。股指期货在买入时总持仓量采用双限制策略，一是限制基金组合中总的股指期货持仓量不能超过向中金所申请并获批的套保总量；二是限制基金组合持有的股指期货合约价值加上基金组合中其他有价证券市值占基金净资产的比例不能超过法规规定的上限，并在股指期货的交易过程中严格遵守基金合同的约束和中金所的规定。根据本基金的基金合同、投资范围、投资目标、投资策略以及对市场走势研判的基础上，结合基金日常的申购赎回情况，制定套期保值交易的合理期限。套期保值的期限一般不超过股指期货当前的最远到期日合约，即次季合约。按照交易月份相近的原则，综合考虑并动态跟踪不同到期日的期货合约的流动性、价差状况和展期风险等因素，选择合适月份的期货合约进行开仓和展期交易来实现远期套保的目的。另外对于交割月的股指期货，通常情况下，最晚在合约交割日进行平仓，尽量避免进行交割。在未来的股指期货交易过程中，本基金将严格遵守《证券投资基金参与股指期货交易指引》，以及中国金融期货交易所颁布的《中国金融期货交易所交易规则》《中国金融期货交易所套期保值与套利交易管理办法》等相关规定，以套期保值为主要目的参与股指期货，严格控制交易中的各种风险。

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 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现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，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

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	5,388,718.26
2	应收清算款	1,277,671.47
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	6,666,389.73

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产 净值比例(%)	流通受限情况说 明
1	301626	苏州天脉	62,951.46	0.00	创业板打新限售
2	688615	合合信息	47,910.42	0.00	科创板打新限售
3	301611	珂玛科技	45,104.40	0.00	创业板打新限售
4	688449	联芸科技	41,392.64	0.00	科创板打新限售
5	688605	先锋精科	39,937.92	0.00	科创板打新限售

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

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		联接基金	
		持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总 份额 比例
5,048	474,724.34	14,058,574.00	0.59%	125,189,127.00	5.22%	2,257,160,769.00	94.19%

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	浙商证券股份有限公司	4,202,800.00	0.18%
2	张艺林	4,200,000.00	0.18%
3	韩充	3,364,800.00	0.14%
4	赵梦野	3,200,000.00	0.13%
5	公超	2,290,700.00	0.10%
6	中信建投证券股份有限公司	2,225,583.00	0.09%
7	李昕宇	2,029,700.00	0.08%

		0	
8	广发证券股份有限公司	2,025,973.00	0.08%
9	方正证券股份有限公司	2,012,051.00	0.08%
10	陈丽	2,000,900.00	0.08%
-	国泰君安证券股份有限公司-天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,257,160,769.00	94.19%

注：持有人为场内持有人。前十名持有人为除天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金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

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年08月07日)基金份额总额	333,908,470.00
本报告期期初基金份额总额	2,481,408,470.00
本报告期基金总申购份额	592,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	677,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,396,408,470.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，聂挺进先生新任公司副总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，黄辰立先生担任公司董事长，韩歆毅先生不再担任公司董事长，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于董事长变更的公告》。

本报告期内，熊军先生不再担任公司副总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，南翰仪同志任职国泰君安证券资产托管部副总经理(主持工作)。陈忠义同志任国泰君安证券公司副总裁，不再兼任资产托管部总经理职务。具体信息参见国泰君安证券资产托管与基金服务网站公告《关于国泰君安证券股份有限公司资产托管部负责人变更的公告》。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，未发生涉及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，本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，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）。本报告期内本基金应向毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费63,000.00元。截至本报告期末，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务4个月。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

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，本基金托管人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

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	
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	5	208,018,547.89	9.74%	92,793.91	16.35%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	8	1,704,002,165.49	79.76%	374,559.26	66.01%	-
国投证券	3	104,059,256.48	4.87%	46,410.12	8.18%	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
开源	1	795,512.81	0.04%	354.80	0.06%	-

证券						
平安证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	36,763,344.11	1.72%	16,392.84	2.89%	-
中金财富	1	44,399,232.34	2.08%	19,797.97	3.49%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	37,359,195.65	1.75%	16,664.15	2.94%	-
中信建投证券	2	1,090,831.00	0.05%	486.41	0.09%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；具有较强的综合服务能力，能及时、全面提供高质量的关于宏观策略、行业、资本市场、个股分析的研究服务及丰富全面的信息咨询服务；具有较强的证券交易服务能力，能够提供安全、便捷、优质的证券交易服务及合理的佣金费率。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：平安证券上海交易单元1个，平安证券深圳交易单元1个，中金公司北交所交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：国泰君安证券深圳交易单元1个，国投证券上海交易单元1个，国投证券深圳交易单元1个，中泰证券上海交易单元2个。

5、本基金管理人严格落实《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》的要求，2024年6月30日前完成股票交易佣金费率的调整。6月30日前的股票交易佣金费率按照原费率执行，7月1日起按照调整后的费率执行。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1,822,635.50	97.57%	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	45,302.40	2.43%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	天弘基金管理有限公司关于	中国证监会规定媒介	2024-01-03

	指定旗下证券投资基金主流流动性服务商的公告		
2	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-01-13
3	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2024-01-22
4	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-01-25
5	天弘基金将严格落实《证监会新闻发言人就“两融”融券业务有关情况答记者问》相关要求	中国证监会规定媒介	2024-02-06
6	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-02-22
7	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-02-26
8	天弘基金管理有限公司关于天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2024-02-29
9	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2024-03-07
10	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2024-03-08
11	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金2023年年	中国证监会规定媒介	2024-03-29

	度报告		
12	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2024-03-30
13	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2024-04-22
14	关于天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	中国证监会规定媒介	2024-04-27
15	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2024-05-13
16	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2024-05-28
17	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2024-06-03
18	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2024-06-28
19	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-06-29
20	关于天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会规定媒介	2024-07-03
21	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2024-07-04
22	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金2024年第2季度报告	中国证监会规定媒介	2024-07-19

23	天弘基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2024-08-02
24	关于天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	中国证监会规定媒介	2024-08-05
25	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-08-16
26	天弘基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2024-08-20
27	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2024-08-21
28	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金2024年中期报告	中国证监会规定媒介	2024-08-30
29	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-08-30
30	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会规定媒介	2024-09-03
31	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-10-12
32	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金2024年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2024-10-25
33	天弘基金管理有限公司关于	中国证监会规定媒介	2024-11-08

	旗下部分基金新增申购赎回 代办证券公司的公告		
34	天弘基金管理有限公司关于 董事长变更的公告	中国证监会规定媒介	2024-11-15
35	天弘基金管理有限公司关于 旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-12-19
36	天弘基金管理有限公司关于 高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2024-12-26

§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	20240101-20241231	2,361,606,069.00	450,889,200.00	555,334,500.00	2,257,160,769.00	94.19%
产品特有风险							
基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%时，由此可能导致的特有风险主要包括： （1）超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险； （2）极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险； （3）持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风							

险；

（4）持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；

（5）极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

注：1、申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

2、份额占比精度处理方式四舍五入。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

在本报告截止日至报告批准送出日之间，为降低投资者的理财成本，基金管理人经与基金托管人协商一致，决定将本基金的指数使用费调整为基金管理人承担，并相应修订相关法律文件，修订后的《基金合同》、《托管协议》等法律文件自2025年3月21日正式生效。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《关于天弘基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

13.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二五年三月三十一日