

摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
2024 年年度报告
2024 年 12 月 31 日

基金管理人：摩根基金管理（中国）有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年三月三十一日

§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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准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 9 月 24 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
§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	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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 审计意见	17
6.2 形成审计意见的基础	17
6.3 其他信息	17
6.4 管理层对财务报表的责任	17
6.5 注册会计师的责任	18
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	64
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	64
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	64
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	64
8.12 本报告期投资基金情况	64
8.13 投资组合报告附注	64
§9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末上市基金前十名持有人	66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	66
§10 开放式基金份额变动	66
§11 重大事件揭示	67
11.1 基金份额持有人大会决议	67
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	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8 其他重大事件	69
12 影响投资者决策的其他重要信息	69
§13 备查文件目录	69
13.1 备查文件目录	69
13.2 存放地点	70
13.3 查阅方式	70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	摩根中证 A500ETF
场内简称	A500ETF
基金主代码	560530
交易代码	560530
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 9 月 24 日
基金管理人	摩根基金管理（中国）有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	11,599,623,668.00 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	2024 年 10 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用复制策略、替代策略及其他适当的策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。 1、复制策略 本基金主要采用完全复制法，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。 （1）定期调整 本基金所构建的投资组合将定期根据所跟踪标的指数成份股的调整进行相应的跟踪调整。指数调整方案公布后，本基金将及时对现有组合的构成

	进行相应的调整，若成份股的集中调整短期内会对跟踪误差产生较大影响，将采用逐步调整的方式。 （2）不定期调整 1）根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据标的指数权重比例的变化，进行相应调整。 2）当标的指数成份股因停牌、流动性不足等因素导致基金无法按照指数权重进行配置，基金管理人将综合考虑跟踪误差和投资者利益，选择相关股票进行适当的替代。 3）本基金将根据申购和赎回情况对股票投资组合进行调整，保证基金正常运行，从而有效跟踪标的指数。 2、替代策略 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红、长期停牌等行为时，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，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或法律法规的限制无法投资某只成份股，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金经理将配合使用其他合理的投资方法作为完全复制法的补充，构建本基金实际的投资组合，以追求尽可能贴近标的指数的表现，有效控制跟踪误差。本基金将根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代。 3、其他投资策略：包括股指期货投资策略、股票期权投资策略、债券投资策略、融资及转融通证券出借策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数，即中证 A500 指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	摩根基金管理（中国）有限公	平安银行股份有限公司

		司	
信 息 披 露 负责人	姓名	邹树波	潘琦
	联系电话	021-38794888	0755-22168257
	电子邮箱	services@jpmamc.com	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-889-4888	95511-3
传真		021-20628400	0755-82080387
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号42层和43层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号42层和43层	广东省深圳市福田区益田路 5023号平安金融中心B座
邮政编码		200120	518001
法定代表人		王琼慧	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	am.jpmorgan.com/cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

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）	中国 · 北京市
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
---------------	--

本期已实现收益	28,704,683.55
本期利润	-229,137,942.41
加权平均基金份额本期利润	-0.0280
本期加权平均净值利润率	-2.81%
本期基金份额净值增长率	-1.60%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末
期末可供分配利润	-186,015,116.44
期末可供分配基金份额利润	-0.0160
期末基金资产净值	11,413,608,551.56
期末基金份额净值	0.9840
3.1.3 累计期末指标	2024 年末
基金份额累计净值增长率	-1.60%

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，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、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.基金合同在当期生效。

3.2 基金净值表现

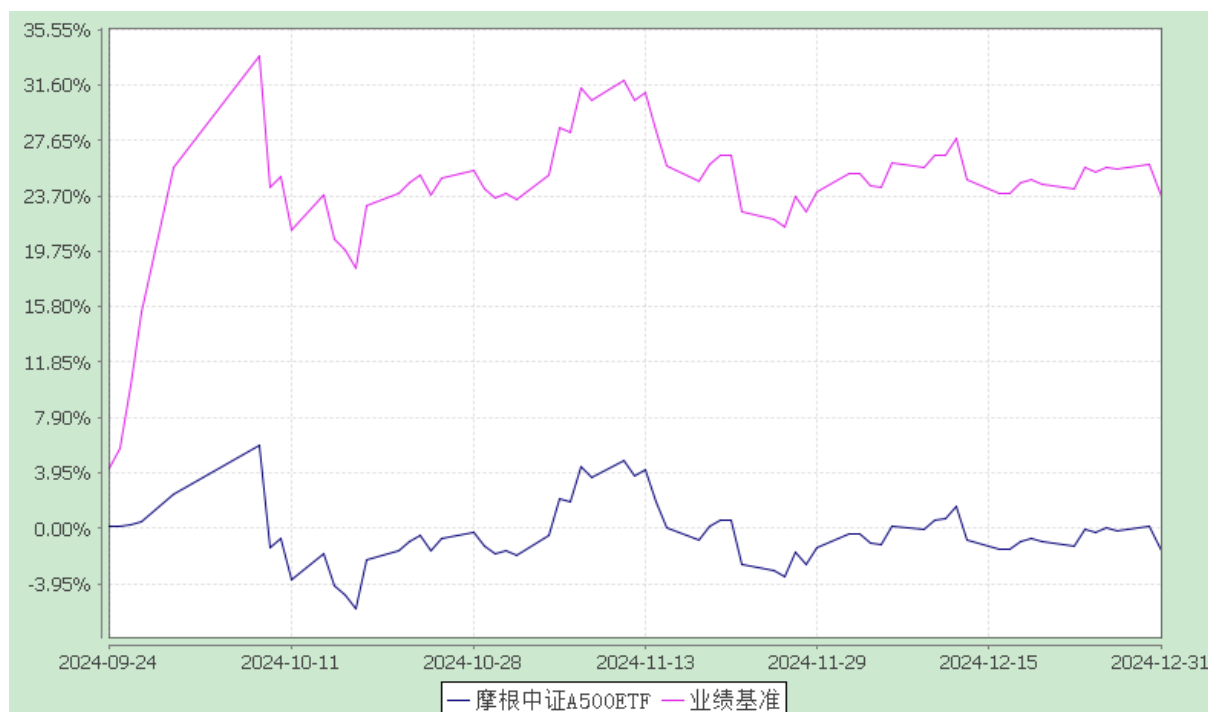
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-3.96%	1.63%	-1.62%	1.78%	-2.34%	-0.15%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-1.60%	1.58%	23.70%	2.23%	-25.30%	-0.65%

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

摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2024 年 9 月 24 日至 2024 年 12 月 31 日)



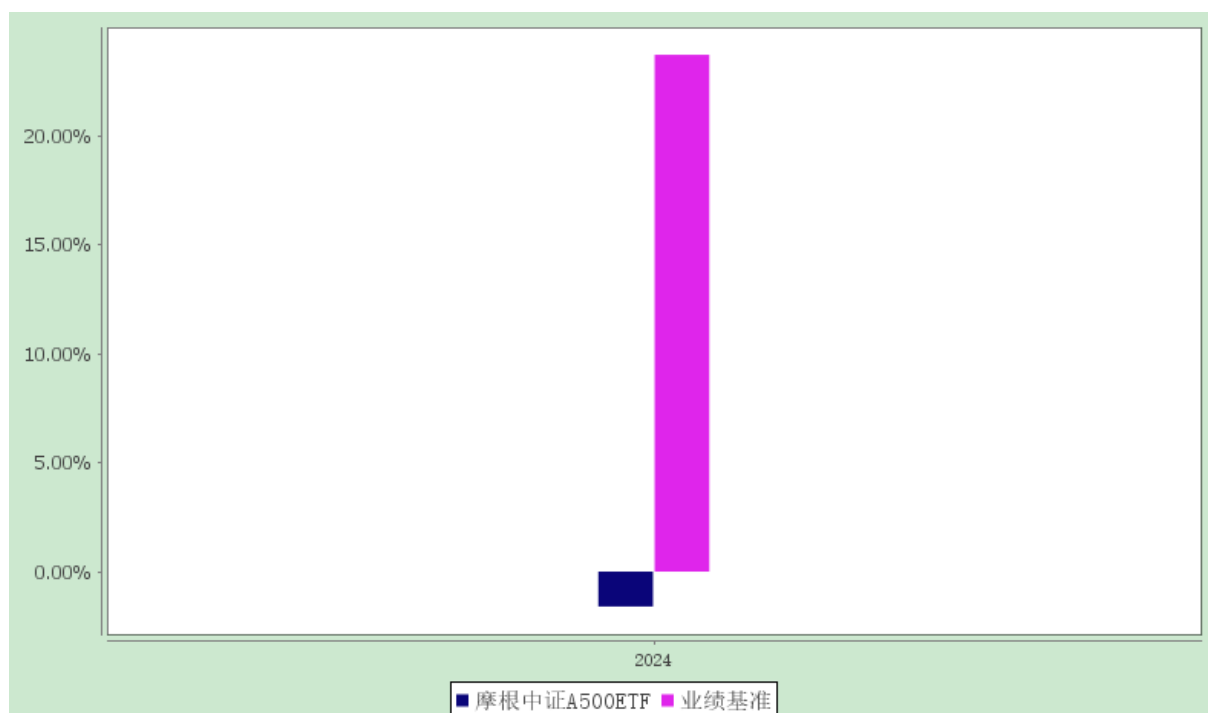
注：本基金合同生效日为 2024 年 9 月 24 日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年。

本基金建仓期为本基金合同生效日起 6 个月，截至本报告期末本基金仍处于建仓期。

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

摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 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

摩根基金管理（中国）有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2004 年 5 月 12 日正式成立，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。2023 年 1 月 19 日，经中国证监会批准，本公司原股东之一上海国际信托有限公司将其持有的本公司 51% 股权，与原另一股东 JPMorgan Asset Management (UK) Limited 将其持有的本公司 49% 股权转让给摩根资产管理控股公司 (JPMorgan Asset Management Holdings Inc.)，从而摩根资产管理控股公司取得本公司全部股权。2023 年 4 月 10 日，基金管理人的名称由“上投摩根基金管理有限公司”变更为“摩根基金管理（中国）有限公司”。截至 2024 年 12 月底，公司旗下运作的基金共有一百零二只，均为开放式基金，分别是：摩根中国优势证券投资基金、摩根货币市场基金、摩根阿尔法混合型证券投资基金、摩根双息平衡混合型证券投资基金、摩根成长先锋混合型证券投资基金、摩根内需动力混合型证券投资基金、摩根亚太优势混合型证券投资基金(QDII)、摩根双核平衡混合型证券投资基金、摩根中小盘混合型证券投资基金、摩根纯债债券型证券投资基金、摩根行业轮动混合型证券投资基金、摩根大盘蓝筹股票型证券投资

基金、摩根全球新兴市场混合型证券投资基金(QDII)、摩根新兴动力混合型证券投资基金、摩根强化回报债券型证券投资基金、摩根健康品质生活混合型证券投资基金、摩根全球天然资源混合型证券投资基金(QDII)、摩根核心优选混合型证券投资基金、摩根智选 30 混合型证券投资基金、摩根成长动力混合型证券投资基金、摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、摩根双债增利债券型证券投资基金、摩根核心成长股票型证券投资基金、摩根民生需求股票型证券投资基金、摩根纯债丰利债券型证券投资基金、摩根天添盈货币市场基金、摩根天添宝货币市场基金、摩根安全战略股票型证券投资基金、摩根卓越制造股票型证券投资基金、摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金、摩根智慧互联股票型证券投资基金、摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、摩根新兴服务股票型证券投资基金、摩根医疗健康股票型证券投资基金、摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)、摩根全球多元配置证券投资基金(QDII-FOF)、摩根安通回报混合型证券投资基金、摩根丰瑞债券型证券投资基金、摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金、摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、摩根安隆回报混合型证券投资基金、摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金、摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金(QDII)、摩根香港精选港股通混合型证券投资基金、摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)、摩根安裕回报混合型证券投资基金、摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金(QDII)、摩根核心精选股票型证券投资基金、摩根动力精选混合型证券投资基金、摩根中国生物医药混合型证券投资基金(QDII)、摩根领先优选混合型证券投资基金、摩根日本精选股票型证券投资基金(QDII)、摩根锦程均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根瑞益纯债债券型证券投资基金、摩根慧选成长股票型证券投资基金、摩根瑞泰 38 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根锦程稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、摩根研究驱动股票型证券投资基金、摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、摩根瑞盛 87 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根慧见两年持有期混合型证券投资基金、摩根远见两年持有期混合型证券投资基金、摩根安享回报一年持有期债券型证券投资基金、摩根行业睿选股票型证券投资基金、摩根优势成长混合型证券投资基金、摩根安荣回报混合型证券投资基金、摩根中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、摩根景气甄选混合型证券投资基金、摩根均衡优选混合型证券投资基金、摩根月月盈 30 天滚动持有发起式短债债券型证券投资基金、摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、摩根全景优势股票型证券投资基金、摩根沃享远见一年持有期混合型证券投资基金、摩根鑫睿优选一年持有期混合型证券投资基金、摩根博睿均衡一年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、摩根慧享成长混合型证券投资基金、摩根时代睿选股票型证券投资基金、摩根瑞享纯债债券型证券投资基金、摩根中证碳

中和 60 交易型开放式指数证券投资基金、摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、摩根标普 500 指数型发起式证券投资基金(QDII)、摩根锦颐养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、摩根海外稳健配置混合型证券投资基金(QDII-FOF)、摩根双季鑫 6 个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)、摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)、摩根世代趋势混合型发起式证券投资基金、摩根纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)、摩根瑞锦纯债债券型证券投资基金、摩根标普港股通低波红利交易型开放式指数证券投资基金、摩根中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、摩根中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、摩根悦享回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、摩根中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、摩根瑞欣利率债债券型证券投资基金、摩根红利优选股票型证券投资基金、摩根均衡精选混合型证券投资基金、摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、摩根共同分类目录绿色债券债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
韩秀一	本基金基金经理	2024-09-24	-	5 年	韩秀一先生曾任中国国际金融股份有限公司资产管理部分析员。自 2020 年 7 月加入摩根基金管理（中国）有限公司（原上投摩根基金管理有限公司），历任研究员、研究员兼投资经理助理，现任指数及量化投资部基金经理。

注：1.对基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期；对非首任基金经理，"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，在控制风险的前提下，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求，制订了《公平交易制度》，规范了公司所管理的所有投资组合的股票、债券等投资品种的投资管理活动，同时涵盖了授权、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，以确保本公司管理的不同投资组合均得到公平对待。

公司执行自上而下的三级授权体系，依次为投资决策委员会、投资总监、经理人，经理人在其授权范围内自主决策，投资决策委员会和投资总监均不得干预其授权范围内的投资活动。公司已建立客观的研究方法，严禁利用内幕信息作为投资依据，各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立集中交易制度，执行公平交易分配。对于交易所市场投资活动，不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易机会；对于银行间市场投资活动，通过交易对手库控制和交易室询价机制，严格防范交易对手风险并抽检价格公允性；对于一级市场申购投资行为，遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

公司通过系统和人工相结合的方式投资交易行为的监控分析，并执行异常交易行为监控分析记录工作机制，确保公平交易可稽核。公司分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异及不同时间窗下同向交易的交易价差进行分析，并留存报告备查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行上述公平交易制度和控制方法，开展公平交易工作。通过对不同投资组合之间的收益率差异、以及不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易时机和交易价差等方面的监控分析，公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

其中，在同向交易的监控和分析方面，根据法规要求，公司对不同投资组合的同日和临近交易日的同向交易行为进行监控，通过定期抽查前述的同向交易行为，定性分析交易时机、对比不同投资组合长期的交易趋势，重点关注任何可能导致不公平交易的情形。对于识别的异常情况，由相关投资组合经理对异常交易情况进行合理解释。同时，公司根据法规的要求，通过系统模块定期对连续四个季度内不同投资组合在不同时间窗内（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行分析，采用概率统计方法，主要关注不同投资组合之间同向交易价差均值为零的显著性检验，以及同向交易价格占优的交易次数占比分析。

报告期内，通过前述分析方法，未发现不同投资组合之间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，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，公司未发现存在异常交易行为。

报告期内，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：无。

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

中证 A500 指数于今年 2024 年 9 月 23 日发布。中证 A500 全收益指数从发布到 2024 年结束上涨 24.38%，跑赢沪深 300 同期 23.4% 的涨幅。截至 2024 年年底，全市场挂钩中证 A500 指数的 ETF 最新规模已经超过 3500 亿，仅次于沪深 300。越来越多的客户重视中证 A500 指数的投资价值，后面也有望看到基金业绩基准向中证 A500 指数迁移。

今年以来，主要宽基指数先稳健上涨，后近几个月受到经济弱复苏，企业盈利疲弱的影响，主要宽基指数出现回落。同时外部环境不确定性也在加剧，8 月初因为日本央行加息预期，全球市场出现巨震。9 月 24 日以来连续的“政策组合拳”密集落地之下，市场风险偏好快速修复。市场从悲观情绪中扭转主要有三大因素，一是资本市场政策红利超预期，二是政策以需求侧为发力重点，三是宏观政策逆周期调节力度超预期。市场在密集组合拳之下，9 月 24 日到 10 月 8 日期间大幅反弹，市场青睐成长风格的核心资产，期间中证 A500 指数反弹 33.74%。

国务院国资委近日印发了《关于改进和加强中央企业控股上市公司市值管理工作的若干意见》。《意见》共九条，其中特别指出引导控股上市公司牢固树立投资者回报意识，增加现金分红频次、优化现金分红节奏、提高现金分红比例；推动中央企业和控股上市公司建立常态化股票回购增持机制，规范减持行为，积极解决控股上市公司长期破净问题。该意见相比新“国九条”的基础上，对中央企业提出了更高的股东回报的要求，公司通过提升分红的稳定性和派息率的水平来回馈股东。我们有望看到以央国企为主的核心资产估值逻辑重塑。此外前期证监会正式发布市值管理指引，包括中证 A500 指数在内的重要宽基指数中，存在长期破净的，20 个交易日跌 20% 的，最近一年回撤 50% 的成分股需要加大市值管理力度。我们有望看到在政策组合拳的推动下，中证 A500 的成分股提高股东回报水平，尤其是提高在市场回撤时加大市值管理力度。

本基金采用被动投资的方法跟踪标的指数，争取跟踪误差保持在合理范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期摩根中证 A500ETF 份额净值增长率为:-1.60%，同期业绩比较基准收益率为:23.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

截止到 2024 年末,中证 A500 指数最新估值回落到 14.82 倍左右,股息率在 2.4%—2.5%区间内,仍然处于合理区间。在短期增量政策真空、政策落地效果逐步兑现的宏观环境下,核心资产的短期相对价值提升。我们认为有望看到 2025 年核心资产率先在利润端企稳反弹,加之中证 A500 指数目前估值和股息保护仍相当有竞争力。海外方面,美联储降息周期启动,随着海外流动性压力的缓解,压制海外投资者配置 A 股的负面因素或将逐步得到缓解。外资仓位的回补或将驱动资金持续回流中国。

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,本基金管理人在内部监察稽核工作中以继续坚持“建立风险综合防控机制、保障合规诚信、支持业务发展、提高工作水平”为总体目标,一切从合规运作、保障基金份额持有人利益出发,由独立的监察稽核部门按照工作计划结合实际情况对公司各项业务进行全面的监察稽核工作,保障和促进公司各项业务合法合规运作,推动内部控制机制的完善与优化,协助各项法规和管理制度的落实,发现问题及时提出建议并督促有关部门改进。

在本报告期内,本基金管理人内部监察稽核工作贯穿三条主线:

1. 注意密切追踪监管法规政策变化和监管新要求,组织员工学习理解监管精神,不断加强公司合规制度建设,同时推动公司各部门完善制度建设和业务流程,防范日常运作中的违规行为发生。
2. 继续紧抓员工行为、公平交易、利益冲突等方面的日常监控,坚守“三条底线”不动摇;进一步加强内部合规培训和合规宣传,提供合规支持和审查,强化合规意识,规范员工行为操守,严格防范利益冲突。
3. 针对风险控制的需求和重点执行合规检查,提高检查工作的水平和效果;按照监管部门的要求,严格推行风险控制自我评估制度,对控制不足的风险点,制订进一步的控制措施。

在本报告期内的监察稽核工作中,未发现基金投资运作存在违法违规或未履行基金合同承诺从而影响基金份额持有人利益的情形。

公司自成立以来,各项业务运作正常,内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。本基金运作合法合规,保障了基金份额持有人的利益。我们将继续以合规运作和风险管理为核心,提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,切实保障基金份额持有人的利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责,根据相关的法律法规规定、基金合同的约定,制定了内部控制措施,对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制,目的是保证基

金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括投资、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理可参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在直接的重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§6 审计报告

毕马威华振审字第 2500849 号

摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了后附的摩根中证 A500 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, 自 2024 年 9 月 24 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照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 日的财务状况以及自 2024 年 9 月 24 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.2 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。

6.3 其他信息

该基金管理人摩根基金管理(中国)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。

6.4 管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。

6.5 注册会计师的责任

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。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

王国蓓 倪益

中国·北京市

2025 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	7.4.7.1	91,602,250.48
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	11,414,793,270.85
其中：股票投资		11,414,793,270.85
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		11,506,395,521.33
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日
负 债：		

短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		33,200,859.56
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,544,330.93
应付托管费		514,776.97
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	7.4.7.6	57,527,002.31
负债合计		92,786,969.77
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	11,599,623,668.00
未分配利润	7.4.7.8	-186,015,116.44
净资产合计		11,413,608,551.56
负债和净资产总计		11,506,395,521.33

注：1.报告截止日 2024 年 12 月 31 日,基金份额净值:0.9840 元,基金份额总额:11,599,623,668.00 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2024 年 9 月 24 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注	本期
----	----	----

	号	2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-224,818,194.60
1.利息收入		616,782.29
其中：存款利息收入	7.4.7.9	616,782.29
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）		16,657,171.40
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-4,135,756.09
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.12	-
股利收益	7.4.7.13	20,792,927.49
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-257,842,625.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	15,750,477.67
减：二、营业总支出		4,319,747.81
1. 管理人报酬		3,157,010.89
2. 托管费		1,052,336.92
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-

6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.16	110,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-229,137,942.41
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-229,137,942.41
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-229,137,942.41

7.3 净资产变动表

会计主体：摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	1,999,623,668.00	-	1,999,623,668.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	9,600,000,000.00	-186,015,116.44	9,413,984,883.56
（一）、综合收益总额	-	-229,137,942.41	-229,137,942.41
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净	9,600,000,000.00	43,122,825.97	9,643,122,825.97

资产减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	12,066,000,000.00	40,797,449.96	12,106,797,449.96
2.基金赎回款	-2,466,000,000.00	2,325,376.01	-2,463,674,623.99
(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	11,599,623,668.00	-186,015,116.44	11,413,608,551.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：王琼慧，主管会计工作负责人：王敏，会计机构负责人：俞文涵

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]1262 号《关于准予摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由摩根基金管理(中国)有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，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 1,999,539,550.00 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)安永华明验字(2024)第 70042058_B02 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 9 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,999,623,668.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 84,118.00 份基金份额。本基金的基金管理人为摩根基金管理(中国)有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2024]132 号文核准同意, 本基金 1,999,623,668.00 份基金份额于 2024 年 10 月 15 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《摩根中证 A500 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及备选成份股。为更好地实现投资目标, 本基金可少量投资于非成份股、存托凭证、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单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相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为: 投资于标的指数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%, 因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为: 中证 A500 指数收益率。

本基金的基金管理人摩根基金管理(中国)有限公司以本基金为目标 ETF, 成立了摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“摩根中证 A500ETF 联接基金”)。摩根中证 A500ETF 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。

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》、《摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 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、自 2024 年 9 月 24 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2024 年 9 月 24 日 (基金合同生效日) 至 2024 年 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。

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，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。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。

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

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率大于 0%以上时,可进行收益分配;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。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;本基金每季度至少进行一次收益分配。

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、债券投资和资产支持证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)对于证券交易所上市的非标的指数成份股票和债券，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《中国证监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。

(2)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。

(3)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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

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》、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
活期存款	2,115,169.78
等于：本金	2,114,742.18
加：应计利息	427.60
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	89,487,080.70
等于：本金	89,485,934.36
加：应计利息	1,146.34
合计	91,602,250.48

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

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		11,672,635,896.81	-	11,414,793,270.85	-257,842,625.96
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		11,672,635,896.81	-	11,414,793,270.85	-257,842,625.96

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	110,000.00
应退退补款	57,402,706.71
可退退补款	14,295.60
合计	57,527,002.31

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,999,623,668.00	1,999,623,668.00
本期申购	12,066,000,000.00	12,066,000,000.00

本期赎回（以“-”号填列）	-2,466,000,000.00	-2,466,000,000.00
本期末	11,599,623,668.00	11,599,623,668.00

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
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	28,704,683.55	-257,842,625.96	-229,137,942.41
本期基金份额交易产生的变动数	41,767,961.23	1,354,864.74	43,122,825.97
其中：基金申购款	56,426,232.96	-15,628,783.00	40,797,449.96
基金赎回款	-14,658,271.73	16,983,647.74	2,325,376.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	70,472,644.78	-256,487,761.22	-186,015,116.44

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	55,365.56
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	115,613.54
结算备付金利息收入	-
其他	445,803.19
合计	616,782.29

注：其他存款利息收入为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款产生的利息收入。

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 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,254,743.53
股票投资收益——赎回差价收入	-2,881,012.56
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	-4,135,756.09

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 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,226,788,180.09
减：卖出股票成本总额	2,224,117,057.48
减：交易费用	3,925,866.14
买卖股票差价收入	-1,254,743.53

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 9 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	2,463,674,623.99
减：现金支付赎回款总额	1,096,142,092.99
减：赎回股票成本总额	1,370,413,543.56
减：交易费用	-
赎回差价收入	-2,881,012.56

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.12 衍生工具收益

无。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年9月24日（基金合同生效日）至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	20,792,927.49
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	20,792,927.49

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年9月24日（基金合同生效日）至2024年12月31日
1.交易性金融资产	-257,842,625.96
——股票投资	-257,842,625.96
——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	-257,842,625.96

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年9月24日（基金合同生效日）至2024年12月31日
基金赎回费收入	-
其他	-
替代损益	15,750,477.67
合计	15,750,477.67

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年9月24日（基金合同生效日）至2024年12月31日
审计费用	30,000.00
信息披露费	80,000.00
证券出借违约金	-
开户费	400.00
合计	110,400.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

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

本基金的基金管理人于 2025 年 1 月 6 日宣告 2024 年度第一次分红，向截至 2025 年 1 月 8 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利人民币 0.018 元。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

摩根基金管理（中国）有限公司	基金管理人、基金销售机构
平安银行股份有限公司(平安银行)	基金托管人、基金销售机构
摩根资产管理控股公司(JPMorgan Asset Management Holdings Inc.)	基金管理人的股东
摩根大通公司(JPMorgan Chase &Co.)	基金管理人的实际控制人
尚腾资本管理有限公司	基金管理人的子公司（2024 年 10 月 11 日前）
上投摩根资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司
摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、尚腾资本管理有限公司已于 2024 年 10 月 11 日注销。

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

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年9月24日（基金合同生效日）至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,157,010.89
其中：应支付销售机构的客户维护费	418,991.12
应支付基金管理人的净管理费	2,738,019.77

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.15%/ 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年9月24日（基金合同生效日）至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,052,336.92

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

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

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	3,104,407,142.00	26.76%

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2024年9月24日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行	2,115,169.78	55,365.56

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有 4,892,700 股平安银行的普通股，成本总额为人民币 57,242,097.42 元，估值总额为人民币 57,244,590.00 元，占基金资产净值的比例为 0.50%

7.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未实施利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末估 值单价	复牌 日期	复牌 开 盘单 价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
002252	上海莱士	2024-12-23	重要事项	7.22	2025-01-07	6.93	2,478,500.00	18,730,130.61	17,894,770.00	

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型指数基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金采用完全复制法，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期或不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律、法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责建立并完善公司市场风险、流动性风险、信用风险管理框架，运用系统化分析工具对以上进行分析和识别，提升公司风险科技水平。运营风险管理部负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行控管，并提出内控建议。投资准则管理部负责执行和管控投资准则，通过设立投资准则、事前管控、事后管控，保障基金投资运作符合法规、合同及公司内部要求。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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。本基金的货币资金存放于信用良好的银行，与货币资金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。

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资。

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 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 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的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指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	91,602,250.48	-	-	-	91,602,250.48
交易性金融资产	-	-	-	11,414,793,270.85	11,414,793,270.85
资产总计	91,602,250.48	-	-	11,414,793,270.85	11,506,395,521.33
负债					
应付清算款	-	-	-	33,200,859.56	33,200,859.56
应付管理人报酬	-	-	-	1,544,330.93	1,544,330.93
应付托管费	-	-	-	514,776.97	514,776.97
其他负债	-	-	-	57,527,002.31	57,527,002.31
负债总计	-	-	-	92,786,969.77	92,786,969.77
利率敏感度缺口	91,602,250.48	-	-	11,322,006,301.08	11,413,608,551.56

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，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用完全复制法，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。

但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将运用其他方法建立实际组合，力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中标的指数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 80%。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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	11,414,793,270.85	100.01
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	-	-
合计	11,414,793,270.85	100.01

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(附注 7.4.1)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：人民币万元）
		本期末 2024 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 19,292
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 19,292

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	11,396,898,500.85
第二层次	17,894,770.00
第三层次	-
合计	11,414,793,270.85

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，确定相关股票和债券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

本基金在本报告期内未持有第三层次公允价值资产。

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。

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	11,414,793,270.85	99.20
	其中：股票	11,414,793,270.85	99.20
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	91,602,250.48	0.80
8	其他各项资产	-	-
9	合计	11,506,395,521.33	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	--------------

A	农、林、牧、渔业	58,796,747.00	0.52
B	采矿业	529,305,794.80	4.64
C	制造业	6,785,957,982.21	59.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	387,112,688.50	3.39
E	建筑业	234,840,503.20	2.06
F	批发和零售业	75,120,833.00	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	404,340,749.00	3.54
H	住宿和餐饮业	11,005,327.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	725,843,038.94	6.36
J	金融业	1,725,171,066.00	15.12
K	房地产业	122,588,458.20	1.07
L	租赁和商务服务业	124,330,927.00	1.09
M	科学研究和技术服务业	113,359,353.00	0.99
N	水利、环境和公共设施管理业	30,400,363.00	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	8,440,160.00	0.07
Q	卫生和社会工作	49,636,796.00	0.43
R	文化、体育和娱乐业	28,542,484.00	0.25
S	综合	-	-
	合计	11,414,793,270.85	100.01

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

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	占基金资产净
----	------	------	-------	------	--------

					值比例(%)
1	600519	贵州茅台	315,000.00	480,060,000.00	4.21
2	300750	宁德时代	1,337,130.00	355,676,580.00	3.12
3	601318	中国平安	5,427,900.00	285,778,935.00	2.50
4	600036	招商银行	6,245,400.00	245,444,220.00	2.15
5	000333	美的集团	2,469,900.00	185,785,878.00	1.63
6	600900	长江电力	6,169,100.00	182,296,905.00	1.60
7	300059	东方财富	6,373,400.00	164,561,188.00	1.44
8	600030	中信证券	4,920,900.00	143,542,653.00	1.26
9	601166	兴业银行	7,333,100.00	140,502,196.00	1.23
10	000858	五粮液	974,400.00	136,454,976.00	1.20
11	002594	比亚迪	458,500.00	129,599,610.00	1.14
12	601899	紫金矿业	8,301,800.00	125,523,216.00	1.10
13	601398	工商银行	17,669,200.00	122,270,864.00	1.07
14	002475	立讯精密	2,546,200.00	103,783,112.00	0.91
15	600276	恒瑞医药	2,250,100.00	103,279,590.00	0.90
16	000651	格力电器	2,258,000.00	102,626,100.00	0.90
17	600887	伊利股份	3,214,000.00	96,998,520.00	0.85
18	688981	中芯国际	999,183.00	94,542,695.46	0.83
19	601328	交通银行	11,873,200.00	92,254,764.00	0.81
20	601816	京沪高铁	14,866,700.00	91,578,872.00	0.80
21	601288	农业银行	16,101,900.00	85,984,146.00	0.75
22	000725	京东方 A	18,628,100.00	81,777,359.00	0.72
23	300760	迈瑞医疗	303,800.00	77,469,000.00	0.68
24	600919	江苏银行	7,400,600.00	72,673,892.00	0.64
25	601088	中国神华	1,666,500.00	72,459,420.00	0.63
26	688256	寒武纪	108,073.00	71,112,034.00	0.62
27	603259	药明康德	1,265,000.00	69,625,600.00	0.61
28	688041	海光信息	460,943.00	69,044,651.97	0.60
29	600309	万华化学	954,400.00	68,096,440.00	0.60
30	000063	中兴通讯	1,626,700.00	65,718,680.00	0.58
31	002371	北方华创	164,800.00	64,436,800.00	0.56
32	300124	汇川技术	1,084,000.00	63,500,720.00	0.56
33	601668	中国建筑	10,503,100.00	63,018,600.00	0.55
34	600000	浦发银行	5,924,000.00	60,957,960.00	0.53
35	601601	中国太保	1,731,100.00	58,995,888.00	0.52
36	601988	中国银行	10,614,700.00	58,486,997.00	0.51
37	000001	平安银行	4,892,700.00	57,244,590.00	0.50
38	002415	海康威视	1,861,900.00	57,160,330.00	0.50
39	601728	中国电信	7,837,900.00	56,589,638.00	0.50
40	300308	中际旭创	453,940.00	56,066,129.40	0.49
41	600941	中国移动	456,700.00	53,963,672.00	0.47
42	300274	阳光电源	730,240.00	53,913,619.20	0.47

43	600690	海尔智家	1,889,900.00	53,805,453.00	0.47
44	603019	中科曙光	737,600.00	53,343,232.00	0.47
45	002714	牧原股份	1,373,500.00	52,797,340.00	0.46
46	601766	中国中车	6,128,900.00	51,360,182.00	0.45
47	600406	国电南瑞	2,028,200.00	51,151,204.00	0.45
48	601857	中国石油	5,711,900.00	51,064,386.00	0.45
49	601127	赛力斯	380,500.00	50,754,895.00	0.44
50	600660	福耀玻璃	810,000.00	50,544,000.00	0.44
51	601919	中远海控	3,219,700.00	49,905,350.00	0.44
52	601985	中国核电	4,762,000.00	49,667,660.00	0.44
53	600031	三一重工	2,990,100.00	49,276,848.00	0.43
54	600028	中国石化	7,357,600.00	49,148,768.00	0.43
55	002352	顺丰控股	1,217,200.00	49,053,160.00	0.43
56	600104	上汽集团	2,334,300.00	48,460,068.00	0.42
57	601012	隆基绿能	3,058,600.00	48,050,606.00	0.42
58	000100	TCL 科技	9,456,200.00	47,564,686.00	0.42
59	000568	泸州老窖	371,100.00	46,461,720.00	0.41
60	601225	陕西煤业	1,955,300.00	45,480,278.00	0.40
61	002230	科大讯飞	938,000.00	45,324,160.00	0.40
62	603501	韦尔股份	429,996.00	44,895,882.36	0.39
63	688012	中微公司	225,600.00	42,674,496.00	0.37
64	600050	中国联通	8,022,900.00	42,601,599.00	0.37
65	300502	新易盛	356,800.00	41,238,944.00	0.36
66	600150	中国船舶	1,126,900.00	40,523,324.00	0.36
67	688008	澜起科技	570,471.00	38,734,980.90	0.34
68	603288	海天味业	843,300.00	38,707,470.00	0.34
69	000338	潍柴动力	2,740,200.00	37,540,740.00	0.33
70	002625	光启技术	759,300.00	36,294,540.00	0.32
71	002027	分众传媒	5,094,200.00	35,812,226.00	0.31
72	603986	兆易创新	333,200.00	35,585,760.00	0.31
73	601628	中国人寿	840,800.00	35,246,336.00	0.31
74	688111	金山办公	119,897.00	34,337,301.83	0.30
75	000625	长安汽车	2,508,200.00	33,509,552.00	0.29
76	600436	片仔癀	156,200.00	33,504,900.00	0.29
77	601888	中国中免	496,000.00	33,236,960.00	0.29
78	600418	江淮汽车	885,300.00	33,198,750.00	0.29
79	601390	中国中铁	5,185,300.00	33,134,067.00	0.29
80	000425	徐工机械	4,170,500.00	33,072,065.00	0.29
81	600089	特变电工	2,542,800.00	32,395,272.00	0.28
82	600048	保利发展	3,632,500.00	32,183,950.00	0.28
83	000938	紫光股份	1,153,200.00	32,093,556.00	0.28
84	300033	同花顺	111,300.00	31,998,750.00	0.28
85	601658	邮储银行	5,595,600.00	31,783,008.00	0.28
86	002241	歌尔股份	1,228,700.00	31,712,747.00	0.28

87	000792	盐湖股份	1,919,200.00	31,590,032.00	0.28
88	600905	三峡能源	7,219,500.00	31,549,215.00	0.28
89	300015	爱尔眼科	2,356,700.00	31,226,275.00	0.27
90	601006	大秦铁路	4,601,700.00	31,199,526.00	0.27
91	600019	宝钢股份	4,440,500.00	31,083,500.00	0.27
92	600938	中国海油	1,051,900.00	31,041,569.00	0.27
93	600438	通威股份	1,356,400.00	29,990,004.00	0.26
94	601600	中国铝业	4,007,600.00	29,455,860.00	0.26
95	600584	长电科技	720,000.00	29,419,200.00	0.26
96	600585	海螺水泥	1,211,100.00	28,799,958.00	0.25
97	300014	亿纬锂能	615,300.00	28,759,122.00	0.25
98	600760	中航沈飞	560,500.00	28,428,560.00	0.25
99	600893	航发动力	670,900.00	27,808,805.00	0.24
100	601989	中国重工	5,755,500.00	27,683,955.00	0.24
101	000977	浪潮信息	524,100.00	27,190,308.00	0.24
102	600111	北方稀土	1,276,864.00	27,095,054.08	0.24
103	000538	云南白药	451,160.00	27,047,042.00	0.24
104	688271	联影医疗	213,300.00	26,961,120.00	0.24
105	605499	东鹏饮料	107,800.00	26,790,456.00	0.23
106	002463	沪电股份	672,100.00	26,648,765.00	0.23
107	002050	三花智控	1,126,900.00	26,493,419.00	0.23
108	300408	三环集团	675,100.00	25,998,101.00	0.23
109	002179	中航光电	636,800.00	25,026,240.00	0.22
110	600886	国投电力	1,503,900.00	24,994,818.00	0.22
111	000002	万科 A	3,437,400.00	24,955,524.00	0.22
112	601669	中国电建	4,345,200.00	23,724,792.00	0.21
113	603993	洛阳钼业	3,564,900.00	23,706,585.00	0.21
114	002028	思源电气	310,800.00	22,595,160.00	0.20
115	688036	传音控股	235,500.00	22,372,500.00	0.20
116	000988	华工科技	509,600.00	22,065,680.00	0.19
117	002049	紫光国微	342,100.00	22,020,977.00	0.19
118	300433	蓝思科技	1,000,500.00	21,910,950.00	0.19
119	600570	恒生电子	764,964.00	21,411,342.36	0.19
120	601186	中国铁建	2,321,800.00	21,290,906.00	0.19
121	600009	上海机场	623,100.00	21,278,865.00	0.19
122	600010	包钢股份	11,421,000.00	21,243,060.00	0.19
123	600547	山东黄金	913,300.00	20,667,979.00	0.18
124	601727	上海电气	2,543,400.00	20,626,974.00	0.18
125	600795	国电电力	4,484,100.00	20,537,178.00	0.18
126	002460	赣锋锂业	576,000.00	20,165,760.00	0.18
127	300339	润和软件	401,600.00	20,092,048.00	0.18
128	002384	东山精密	685,500.00	20,016,600.00	0.18
129	603799	华友钴业	682,800.00	19,978,728.00	0.18
130	002456	欧菲光	1,666,800.00	19,968,264.00	0.17

131	000768	中航西飞	698,700.00	19,731,288.00	0.17
132	002422	科伦药业	643,800.00	19,268,934.00	0.17
133	601058	赛轮轮胎	1,329,900.00	19,057,467.00	0.17
134	001979	招商蛇口	1,829,700.00	18,736,128.00	0.16
135	601800	中国交建	1,792,400.00	18,730,580.00	0.16
136	600989	宝丰能源	1,107,900.00	18,657,036.00	0.16
137	600415	小商品城	1,375,400.00	18,444,114.00	0.16
138	601360	三六零	1,765,300.00	18,270,855.00	0.16
139	000157	中联重科	2,504,400.00	18,106,812.00	0.16
140	600839	四川长虹	1,865,600.00	18,003,040.00	0.16
141	002252	上海莱士	2,478,500.00	17,894,770.00	0.16
142	600029	南方航空	2,717,200.00	17,634,628.00	0.15
143	600489	中金黄金	1,465,800.00	17,633,574.00	0.15
144	600066	宇通客车	665,300.00	17,550,614.00	0.15
145	300782	卓胜微	193,500.00	17,356,950.00	0.15
146	600115	中国东航	4,326,700.00	17,306,800.00	0.15
147	002466	天齐锂业	523,500.00	17,275,500.00	0.15
148	002001	新 和 成	781,800.00	17,176,146.00	0.15
149	600487	亨通光电	991,100.00	17,066,742.00	0.15
150	600745	闻泰科技	439,400.00	17,039,932.00	0.15
151	600674	川投能源	980,450.00	16,912,762.50	0.15
152	002340	格林美	2,574,500.00	16,811,485.00	0.15
153	301236	软通动力	285,800.00	16,779,318.00	0.15
154	688169	石头科技	76,400.00	16,753,756.00	0.15
155	300418	昆仑万维	435,000.00	16,738,800.00	0.15
156	300207	欣旺达	744,200.00	16,603,102.00	0.15
157	601689	拓普集团	338,180.00	16,570,820.00	0.15
158	000661	长春高新	166,100.00	16,516,984.00	0.14
159	601633	长城汽车	624,800.00	16,450,984.00	0.14
160	003816	中国广核	3,965,800.00	16,378,754.00	0.14
161	600160	巨化股份	678,500.00	16,365,420.00	0.14
162	600346	恒力石化	1,063,900.00	16,330,865.00	0.14
163	688777	中控技术	326,800.00	16,232,156.00	0.14
164	600426	华鲁恒升	751,100.00	16,231,271.00	0.14
165	002648	卫星化学	852,600.00	16,020,354.00	0.14
166	002156	通富微电	539,100.00	15,930,405.00	0.14
167	002236	大华股份	993,800.00	15,900,800.00	0.14
168	600196	复星医药	639,500.00	15,891,575.00	0.14
169	002920	德赛西威	144,000.00	15,855,840.00	0.14
170	300122	智飞生物	598,600.00	15,743,180.00	0.14
171	300394	天孚通信	171,440.00	15,662,758.40	0.14
172	688126	沪硅产业	832,044.00	15,659,068.08	0.14
173	600256	广汇能源	2,325,400.00	15,649,942.00	0.14
174	000786	北新建材	513,300.00	15,558,123.00	0.14

175	002273	水晶光电	697,600.00	15,500,672.00	0.14
176	000963	华东医药	445,200.00	15,403,920.00	0.13
177	601117	中国化学	1,852,600.00	15,358,054.00	0.13
178	600460	士兰微	580,600.00	15,107,212.00	0.13
179	600372	中航机载	1,225,100.00	15,105,483.00	0.13
180	002185	华天科技	1,300,800.00	15,102,288.00	0.13
181	600011	华能国际	2,220,800.00	15,034,816.00	0.13
182	601868	中国能建	6,525,700.00	14,943,853.00	0.13
183	002601	龙佰集团	845,600.00	14,941,752.00	0.13
184	601111	中国国航	1,888,000.00	14,934,080.00	0.13
185	600183	生益科技	610,500.00	14,682,525.00	0.13
186	002129	TCL 中环	1,635,400.00	14,505,998.00	0.13
187	688223	晶科能源	2,019,200.00	14,356,512.00	0.13
188	001965	招商公路	1,027,600.00	14,335,020.00	0.13
189	002202	金风科技	1,387,700.00	14,334,941.00	0.13
190	600096	云天化	642,500.00	14,327,750.00	0.13
191	300896	爱美客	78,480.00	14,322,600.00	0.13
192	002180	纳思达	505,700.00	14,245,569.00	0.12
193	000807	云铝股份	1,048,000.00	14,179,440.00	0.12
194	000066	中国长城	972,800.00	14,173,696.00	0.12
195	300347	泰格医药	259,000.00	14,146,580.00	0.12
196	601100	恒立液压	266,500.00	14,063,205.00	0.12
197	600085	同仁堂	346,200.00	14,052,258.00	0.12
198	600482	中国动力	574,100.00	14,048,227.00	0.12
199	600741	华域汽车	797,400.00	14,042,214.00	0.12
200	300661	圣邦股份	171,600.00	14,033,448.00	0.12
201	000423	东阿阿胶	223,600.00	14,024,192.00	0.12
202	601021	春秋航空	243,000.00	14,013,810.00	0.12
203	600176	中国巨石	1,215,300.00	13,842,267.00	0.12
204	002493	荣盛石化	1,526,300.00	13,813,015.00	0.12
205	600219	南山铝业	3,518,800.00	13,758,508.00	0.12
206	300832	新产业	193,700.00	13,723,645.00	0.12
207	002459	晶澳科技	996,000.00	13,695,000.00	0.12
208	300759	康龙化成	529,700.00	13,613,290.00	0.12
209	601168	西部矿业	842,100.00	13,532,547.00	0.12
210	600352	浙江龙盛	1,313,300.00	13,513,857.00	0.12
211	600885	宏发股份	422,300.00	13,437,586.00	0.12
212	000933	神火股份	792,100.00	13,386,490.00	0.12
213	002709	天赐材料	675,700.00	13,324,804.00	0.12
214	002916	深南电路	106,400.00	13,300,000.00	0.12
215	603392	万泰生物	186,600.00	13,147,836.00	0.12
216	600988	赤峰黄金	840,800.00	13,124,888.00	0.11
217	600515	海南机场	3,464,000.00	13,093,920.00	0.11
218	300017	网宿科技	1,238,400.00	13,089,888.00	0.11

219	688396	华润微	275,100.00	12,981,969.00	0.11
220	002738	中矿资源	364,800.00	12,950,400.00	0.11
221	000975	山金国际	841,200.00	12,929,244.00	0.11
222	600845	宝信软件	438,100.00	12,818,806.00	0.11
223	600188	兖矿能源	903,900.00	12,808,263.00	0.11
224	002138	顺络电子	406,800.00	12,806,064.00	0.11
225	601877	正泰电器	546,500.00	12,793,565.00	0.11
226	300476	胜宏科技	303,300.00	12,765,897.00	0.11
227	002938	鹏鼎控股	349,700.00	12,757,056.00	0.11
228	002271	东方雨虹	974,900.00	12,654,202.00	0.11
229	002078	太阳纸业	848,100.00	12,611,247.00	0.11
230	300474	景嘉微	134,850.00	12,607,126.50	0.11
231	000630	铜陵有色	3,857,700.00	12,460,371.00	0.11
232	300136	信维通信	488,800.00	12,435,072.00	0.11
233	600233	圆通速递	874,500.00	12,409,155.00	0.11
234	002281	光迅科技	236,800.00	12,353,856.00	0.11
235	601319	中国人保	1,606,900.00	12,244,578.00	0.11
236	002555	三七互娱	780,400.00	12,205,456.00	0.11
237	600161	天坛生物	594,460.00	12,186,430.00	0.11
238	002085	万丰奥威	636,500.00	12,061,675.00	0.11
239	600879	航天电子	1,340,200.00	12,008,192.00	0.11
240	688120	华海清科	73,600.00	11,996,064.00	0.11
241	601618	中国中冶	3,620,600.00	11,947,980.00	0.10
242	601607	上海医药	567,400.00	11,915,400.00	0.10
243	300058	蓝色光标	1,279,500.00	11,873,760.00	0.10
244	688099	晶晨股份	172,700.00	11,861,036.00	0.10
245	300223	北京君正	173,900.00	11,859,980.00	0.10
246	002517	恺英网络	870,300.00	11,844,783.00	0.10
247	002444	巨星科技	364,900.00	11,804,515.00	0.10
248	002074	国轩高科	549,100.00	11,651,902.00	0.10
249	601615	明阳智能	923,200.00	11,641,552.00	0.10
250	002405	四维图新	1,199,600.00	11,564,144.00	0.10
251	002195	岩山科技	2,879,000.00	11,429,630.00	0.10
252	002353	杰瑞股份	308,600.00	11,415,114.00	0.10
253	300002	神州泰岳	984,500.00	11,410,355.00	0.10
254	300496	中科创达	191,200.00	11,387,872.00	0.10
255	000999	华润三九	256,600.00	11,377,644.00	0.10
256	605117	德业股份	133,400.00	11,312,320.00	0.10
257	300024	机器人	628,500.00	11,281,575.00	0.10
258	688617	惠泰医疗	30,224.00	11,253,301.92	0.10
259	300450	先导智能	558,800.00	11,187,176.00	0.10
260	300346	南大光电	288,824.00	11,145,718.16	0.10
261	002128	电投能源	568,800.00	11,137,104.00	0.10
262	000408	藏格矿业	399,800.00	11,086,454.00	0.10

263	002532	天山铝业	1,408,000.00	11,080,960.00	0.10
264	688072	拓荆科技	72,000.00	11,064,240.00	0.10
265	600588	用友网络	1,029,700.00	11,048,681.00	0.10
266	002223	鱼跃医疗	302,500.00	11,038,225.00	0.10
267	002465	海格通信	1,000,100.00	10,981,098.00	0.10
268	000301	东方盛虹	1,336,000.00	10,968,560.00	0.10
269	601567	三星医疗	356,400.00	10,962,864.00	0.10
270	300114	中航电测	152,600.00	10,953,628.00	0.10
271	688047	龙芯中科	82,621.00	10,929,105.88	0.10
272	600362	江西铜业	525,200.00	10,840,128.00	0.09
273	600765	中航重机	529,300.00	10,834,771.00	0.09
274	603606	东方电缆	204,000.00	10,720,200.00	0.09
275	300866	安克创新	109,600.00	10,701,344.00	0.09
276	600862	中航高科	423,200.00	10,690,032.00	0.09
277	002008	大族激光	424,100.00	10,602,500.00	0.09
278	300012	华测检测	849,200.00	10,555,556.00	0.09
279	300383	光环新网	722,700.00	10,544,193.00	0.09
280	688599	天合光能	545,089.00	10,520,217.70	0.09
281	601872	招商轮船	1,640,500.00	10,515,605.00	0.09
282	002131	利欧股份	3,401,900.00	10,511,871.00	0.09
283	300316	晶盛机电	328,400.00	10,475,960.00	0.09
284	601238	广汽集团	1,119,300.00	10,454,262.00	0.09
285	000831	中国稀土	372,700.00	10,454,235.00	0.09
286	603605	珀莱雅	123,249.00	10,439,190.30	0.09
287	600895	张江高科	389,000.00	10,425,200.00	0.09
288	002472	双环传动	338,100.00	10,352,622.00	0.09
289	600177	雅戈尔	1,159,600.00	10,320,440.00	0.09
290	600803	新奥股份	472,200.00	10,237,296.00	0.09
291	603260	合盛硅业	182,900.00	10,161,924.00	0.09
292	300413	芒果超媒	377,800.00	10,159,042.00	0.09
293	300699	光威复材	292,600.00	10,138,590.00	0.09
294	688122	西部超导	236,200.00	10,114,084.00	0.09
295	601233	桐昆股份	852,600.00	10,060,680.00	0.09
296	600332	白云山	353,900.00	10,057,838.00	0.09
297	300037	新宙邦	264,400.00	9,899,136.00	0.09
298	300054	鼎龙股份	380,400.00	9,898,008.00	0.09
299	000400	许继电气	357,700.00	9,847,481.00	0.09
300	300395	菲利华	261,600.00	9,838,776.00	0.09
301	601799	星宇股份	73,500.00	9,810,780.00	0.09
302	300142	沃森生物	807,600.00	9,755,808.00	0.09
303	300999	金龙鱼	297,700.00	9,707,997.00	0.09
304	300628	亿联网络	251,500.00	9,707,900.00	0.09
305	300604	长川科技	218,200.00	9,629,166.00	0.08
306	600027	华电国际	1,712,600.00	9,607,686.00	0.08

307	600039	四川路桥	1,316,740.00	9,585,867.20	0.08
308	688235	百济神州	59,400.00	9,564,588.00	0.08
309	002436	兴森科技	857,000.00	9,521,270.00	0.08
310	000009	中国宝安	1,035,300.00	9,472,995.00	0.08
311	600153	建发股份	893,500.00	9,399,620.00	0.08
312	002007	华兰生物	556,200.00	9,371,970.00	0.08
313	600549	厦门钨业	485,200.00	9,349,804.00	0.08
314	002812	恩捷股份	292,200.00	9,347,478.00	0.08
315	002821	凯莱英	122,800.00	9,343,852.00	0.08
316	603596	伯特利	208,800.00	9,310,392.00	0.08
317	600143	金发科技	1,061,000.00	9,167,040.00	0.08
318	600398	海澜之家	1,217,500.00	9,131,250.00	0.08
319	300724	捷佳伟创	143,200.00	9,051,672.00	0.08
320	601216	君正集团	1,714,600.00	9,018,796.00	0.08
321	000617	中油资本	1,280,400.00	8,821,956.00	0.08
322	000738	航发控制	396,100.00	8,809,264.00	0.08
323	688002	睿创微纳	186,100.00	8,748,561.00	0.08
324	000932	华菱钢铁	2,084,700.00	8,714,046.00	0.08
325	002558	巨人网络	681,600.00	8,649,504.00	0.08
326	600529	山东药玻	334,200.00	8,612,334.00	0.08
327	603659	璞泰来	540,400.00	8,597,764.00	0.08
328	600018	上港集团	1,404,700.00	8,596,764.00	0.08
329	000878	云南铜业	704,900.00	8,592,731.00	0.08
330	002294	信立泰	277,700.00	8,589,261.00	0.08
331	600497	驰宏锌锗	1,539,600.00	8,575,572.00	0.08
332	002409	雅克科技	147,500.00	8,547,625.00	0.07
333	600141	兴发集团	389,800.00	8,458,660.00	0.07
334	002607	中公教育	2,482,400.00	8,440,160.00	0.07
335	300919	中伟股份	231,880.00	8,375,505.60	0.07
336	002312	川发龙鳞	578,000.00	8,363,660.00	0.07
337	600563	法拉电子	70,200.00	8,348,184.00	0.07
338	000623	吉林敖东	482,100.00	8,325,867.00	0.07
339	603087	甘李药业	187,900.00	8,286,390.00	0.07
340	688188	柏楚电子	42,379.00	8,232,120.75	0.07
341	002065	东华软件	1,131,100.00	8,211,786.00	0.07
342	300001	特锐德	372,500.00	8,176,375.00	0.07
343	688009	中国通号	1,301,700.00	8,148,642.00	0.07
344	300459	汤姆猫	1,419,400.00	8,147,356.00	0.07
345	002064	华峰化学	994,400.00	8,134,192.00	0.07
346	600118	中国卫星	297,200.00	8,113,560.00	0.07
347	000034	神州数码	231,000.00	8,096,550.00	0.07
348	600026	中远海能	697,500.00	8,091,000.00	0.07
349	000733	振华科技	191,700.00	8,083,989.00	0.07
350	688303	大全能源	334,000.00	8,062,760.00	0.07

351	300088	长信科技	1,231,800.00	8,055,972.00	0.07
352	300073	当升科技	199,200.00	8,023,776.00	0.07
353	002318	久立特材	342,700.00	8,022,607.00	0.07
354	600820	隧道股份	1,115,100.00	8,017,569.00	0.07
355	600521	华海药业	447,100.00	7,989,677.00	0.07
356	002739	万达电影	654,400.00	7,944,416.00	0.07
357	600704	物产中大	1,569,300.00	7,940,658.00	0.07
358	600637	东方明珠	1,014,600.00	7,873,296.00	0.07
359	600699	均胜电子	502,300.00	7,871,041.00	0.07
360	601179	中国西电	1,035,800.00	7,861,722.00	0.07
361	603806	福斯特	530,976.00	7,858,444.80	0.07
362	002432	九安医疗	192,200.00	7,837,916.00	0.07
363	002410	广联达	659,900.00	7,760,424.00	0.07
364	300751	迈为股份	72,800.00	7,654,920.00	0.07
365	300315	掌趣科技	1,379,200.00	7,585,600.00	0.07
366	300763	锦浪科技	124,100.00	7,578,787.00	0.07
367	002841	视源股份	205,200.00	7,573,932.00	0.07
368	601677	明泰铝业	628,100.00	7,556,043.00	0.07
369	688180	君实生物	276,000.00	7,543,080.00	0.07
370	601018	宁波港	1,955,400.00	7,528,290.00	0.07
371	300454	深信服	130,900.00	7,513,660.00	0.07
372	300003	乐普医疗	661,900.00	7,505,946.00	0.07
373	000683	远兴能源	1,334,600.00	7,460,414.00	0.07
374	603568	伟明环保	341,500.00	7,386,645.00	0.06
375	603129	春风动力	46,900.00	7,366,583.00	0.06
376	600486	扬农化工	127,200.00	7,361,064.00	0.06
377	300144	宋城演艺	791,400.00	7,352,106.00	0.06
378	603939	益丰药房	303,600.00	7,325,868.00	0.06
379	002044	美年健康	1,588,600.00	7,291,674.00	0.06
380	600008	首创环保	2,215,100.00	7,265,528.00	0.06
381	600392	盛和资源	706,100.00	7,258,708.00	0.06
382	000039	中集集团	928,600.00	7,215,222.00	0.06
383	002152	广电运通	618,700.00	7,214,042.00	0.06
384	002407	多氟多	599,700.00	7,196,400.00	0.06
385	600763	通策医疗	161,200.00	7,157,280.00	0.06
386	300068	南都电源	442,700.00	7,145,178.00	0.06
387	600170	上海建工	2,688,400.00	7,124,260.00	0.06
388	000960	锡业股份	503,900.00	7,069,717.00	0.06
389	300627	华测导航	168,900.00	7,060,020.00	0.06
390	300558	贝达药业	130,800.00	7,054,044.00	0.06
391	601000	唐山港	1,495,800.00	7,045,218.00	0.06
392	002624	完美世界	681,800.00	7,042,994.00	0.06
393	603979	金诚信	193,436.00	7,021,726.80	0.06
394	300529	健帆生物	238,800.00	7,006,392.00	0.06

395	300251	光线传媒	737,700.00	6,963,888.00	0.06
396	002025	航天电器	142,690.00	6,929,026.40	0.06
397	600498	烽火通信	355,800.00	6,923,868.00	0.06
398	600816	ST 安信	1,972,900.00	6,905,150.00	0.06
399	300285	国瓷材料	403,900.00	6,882,456.00	0.06
400	600316	洪都航空	213,700.00	6,864,044.00	0.06
401	600516	方大炭素	1,418,700.00	6,852,321.00	0.06
402	000830	鲁西化工	581,000.00	6,791,890.00	0.06
403	002603	以岭药业	423,900.00	6,786,639.00	0.06
404	000629	钒钛股份	2,354,000.00	6,779,520.00	0.06
405	002497	雅化集团	576,900.00	6,749,730.00	0.06
406	603816	顾家家居	244,400.00	6,740,552.00	0.06
407	300390	天华新能	291,810.00	6,726,220.50	0.06
408	601966	玲珑轮胎	369,800.00	6,671,192.00	0.06
409	603613	国联股份	250,700.00	6,663,606.00	0.06
410	300296	利亚德	1,023,300.00	6,590,052.00	0.06
411	605358	立昂微	265,900.00	6,586,343.00	0.06
412	603833	欧派家居	95,000.00	6,549,300.00	0.06
413	600038	中直股份	169,700.00	6,543,632.00	0.06
414	300568	星源材质	670,900.00	6,521,148.00	0.06
415	600535	天士力	450,500.00	6,514,230.00	0.06
416	601880	辽港股份	3,752,900.00	6,492,517.00	0.06
417	600998	九州通	1,268,000.00	6,492,160.00	0.06
418	000069	华侨城 A	2,426,500.00	6,478,755.00	0.06
419	002414	高德红外	869,700.00	6,461,871.00	0.06
420	600325	华发股份	1,118,600.00	6,443,136.00	0.06
421	300567	精测电子	99,802.00	6,417,268.60	0.06
422	300253	卫宁健康	891,200.00	6,380,992.00	0.06
423	603077	和邦生物	3,126,300.00	6,377,652.00	0.06
424	002176	江特电机	860,500.00	6,376,305.00	0.06
425	002756	永兴材料	168,400.00	6,352,048.00	0.06
426	600655	豫园股份	979,200.00	6,296,256.00	0.06
427	300182	捷成股份	1,070,200.00	6,282,074.00	0.06
428	002389	航天彩虹	347,000.00	6,263,350.00	0.05
429	002245	蔚蓝锂芯	581,300.00	6,214,097.00	0.05
430	603000	人民网	278,400.00	6,135,936.00	0.05
431	600859	王府井	397,500.00	6,125,475.00	0.05
432	600754	锦江酒店	226,600.00	6,086,476.00	0.05
433	000519	中兵红箭	419,400.00	6,060,330.00	0.05
434	603885	吉祥航空	441,200.00	6,044,440.00	0.05
435	000998	隆平高科	537,100.00	5,999,407.00	0.05
436	600166	福田汽车	2,377,000.00	5,966,270.00	0.05
437	300212	易华录	252,900.00	5,917,860.00	0.05
438	002439	启明星辰	369,800.00	5,850,236.00	0.05

439	603899	晨光股份	192,800.00	5,832,200.00	0.05
440	300601	康泰生物	339,300.00	5,818,995.00	0.05
441	002145	中核钛白	1,369,200.00	5,805,408.00	0.05
442	000708	中信特钢	508,300.00	5,799,703.00	0.05
443	600323	瀚蓝环境	245,000.00	5,786,900.00	0.05
444	002151	北斗星通	215,600.00	5,722,024.00	0.05
445	600131	国网信通	300,800.00	5,688,128.00	0.05
446	600004	白云机场	589,400.00	5,658,240.00	0.05
447	603486	科沃斯	119,100.00	5,597,700.00	0.05
448	300118	东方日升	464,800.00	5,568,304.00	0.05
449	600867	通化东宝	690,800.00	5,567,848.00	0.05
450	300070	碧水源	1,097,700.00	5,554,362.00	0.05
451	688005	容百科技	176,000.00	5,552,800.00	0.05
452	603290	斯达半导	61,300.00	5,505,966.00	0.05
453	601155	新城控股	459,300.00	5,493,228.00	0.05
454	002120	韵达股份	725,300.00	5,454,256.00	0.05
455	300676	华大基因	129,100.00	5,418,327.00	0.05
456	000887	中鼎股份	402,200.00	5,276,864.00	0.05
457	601866	中远海发	2,017,300.00	5,265,153.00	0.05
458	002831	裕同科技	193,100.00	5,233,010.00	0.05
459	000818	航锦科技	273,200.00	5,218,120.00	0.05
460	300438	鹏辉能源	183,300.00	5,152,563.00	0.05
461	600667	太极实业	741,500.00	5,131,180.00	0.04
462	002368	太极股份	214,200.00	5,072,256.00	0.04
463	300573	兴齐眼药	72,600.00	5,066,028.00	0.04
464	300595	欧普康视	267,200.00	5,063,440.00	0.04
465	600755	厦门国贸	760,900.00	5,052,376.00	0.04
466	002240	盛新锂能	364,800.00	5,026,944.00	0.04
467	002508	老板电器	233,900.00	5,012,477.00	0.04
468	002572	索菲亚	289,800.00	4,978,764.00	0.04
469	600258	首旅酒店	335,300.00	4,918,851.00	0.04
470	002268	电科网安	297,300.00	4,831,125.00	0.04
471	600129	太极集团	192,600.00	4,761,072.00	0.04
472	000547	航天发展	644,200.00	4,709,102.00	0.04
473	600771	广誉远	245,200.00	4,624,472.00	0.04
474	600399	抚顺特钢	795,200.00	4,612,160.00	0.04
475	601636	旗滨集团	804,200.00	4,511,562.00	0.04
476	600499	科达制造	575,400.00	4,488,120.00	0.04
477	603650	彤程新材	124,800.00	4,364,256.00	0.04
478	000035	中国天楹	892,400.00	4,345,988.00	0.04
479	002544	普天科技	201,500.00	4,318,145.00	0.04
480	300769	德方纳米	116,900.00	4,311,272.00	0.04
481	600884	杉杉股份	577,000.00	4,298,650.00	0.04
482	002266	浙富控股	1,309,800.00	4,086,576.00	0.04

483	603688	石英股份	140,100.00	4,025,073.00	0.04
484	002372	伟星新材	314,900.00	3,977,187.00	0.03
485	603882	金域医学	143,900.00	3,961,567.00	0.03
486	002292	奥飞娱乐	452,500.00	3,914,125.00	0.03
487	300457	赢合科技	192,300.00	3,680,622.00	0.03
488	002541	鸿路钢构	204,300.00	3,663,099.00	0.03
489	002091	江苏国泰	498,200.00	3,646,824.00	0.03
490	603456	九洲药业	265,400.00	3,630,672.00	0.03
491	688390	固德威	87,000.00	3,558,300.00	0.03
492	688063	派能科技	88,100.00	3,528,405.00	0.03
493	603588	高能环境	618,300.00	3,239,892.00	0.03
494	000967	盈峰环境	633,800.00	3,149,986.00	0.03
495	600315	上海家化	173,100.00	2,927,121.00	0.03
496	002081	金螳螂	793,500.00	2,832,795.00	0.02
497	600167	联美控股	459,000.00	2,630,070.00	0.02
498	600007	中国国贸	103,320.00	2,527,207.20	0.02
499	001914	招商积余	213,000.00	2,251,410.00	0.02
500	600335	国机汽车	301,400.00	1,877,722.00	0.02

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	478,234,808.63	4.19
2	000333	美的集团	222,293,023.26	1.95
3	000858	五粮液	210,211,510.70	1.84
4	300059	东方财富	197,340,998.66	1.73
5	002594	比亚迪	164,408,920.59	1.44
6	002475	立讯精密	137,016,785.32	1.20
7	300760	迈瑞医疗	127,808,459.01	1.12
8	000651	格力电器	127,723,165.21	1.12
9	600519	贵州茅台	102,312,004.00	0.90
10	000725	京东方 A	102,007,873.00	0.89
11	300274	阳光电源	84,401,305.18	0.74
12	300308	中际旭创	80,365,628.30	0.70
13	002714	牧原股份	79,238,063.03	0.69

14	300124	汇川技术	76,432,124.70	0.67
15	002415	海康威视	73,201,089.85	0.64
16	000001	平安银行	71,388,099.34	0.63
17	002371	北方华创	71,350,121.46	0.63
18	000568	泸州老窖	67,120,199.51	0.59
19	002352	顺丰控股	66,120,378.63	0.58
20	688256	寒武纪	63,822,953.98	0.56

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	131,764,169.58	1.15
2	600519	贵州茅台	99,032,165.50	0.87
3	000858	五粮液	61,016,175.62	0.53
4	300059	东方财富	41,952,071.50	0.37
5	300760	迈瑞医疗	41,855,670.21	0.37
6	000333	美的集团	39,545,860.00	0.35
7	002304	洋河股份	37,907,577.57	0.33
8	688041	海光信息	34,174,409.82	0.30
9	002475	立讯精密	29,785,667.57	0.26
10	002594	比亚迪	26,574,980.93	0.23
11	000651	格力电器	25,031,586.88	0.22
12	000792	盐湖股份	24,577,626.00	0.22
13	600157	永泰能源	23,102,872.00	0.20
14	002714	牧原股份	20,209,055.00	0.18
15	000725	京东方 A	19,435,442.00	0.17
16	688008	澜起科技	18,501,471.22	0.16
17	300782	卓胜微	18,146,725.65	0.16
18	601328	交通银行	17,675,965.00	0.15
19	300274	阳光电源	16,779,682.80	0.15
20	600309	万华化学	15,280,657.95	0.13

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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。

8.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	8,588,176,426.17
卖出股票的收入（成交）总额	2,226,788,180.09

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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 本报告期投资基金情况

8.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中信证券股份有限公司报告编制日前一年内曾受到

中国证监会的处罚，兴业银行股份有限公司报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局福建监管局的处罚，招商银行股份有限公司报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。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。

8.13.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.13.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末无其他资产构成。

8.13.4 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。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§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	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
28,914	401,176.72	9,692,449,006.00	83.56%	1,907,174,662.00	16.44%

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	中国平安人寿保险股份有限公司一分红一个险分红	1,060,689,220.00	9.14%
2	中国人寿保险股份有限公司	756,952,753.00	6.53%
3	中国平安人寿保险股份有限公司－自有资金	752,767,151.00	6.49%
4	华泰优逸五号混合型养老金产品－中国银行股份有限公司	429,000,000.00	3.70%
5	国泰君安证券股份有限公司	412,562,325.00	3.56%
6	招商证券股份有限公司	203,365,456.00	1.75%
7	新华人寿保险股份有限公司	189,945,837.00	1.64%
8	中国人寿再保险有限责任公司	178,704,624.00	1.54%
9	广发证券股份有限公司	150,823,202.00	1.30%
10	中国太平洋人寿保险股份有限公司－分红一个人分红	116,247,400.00	1.00%
11	摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	3,104,407,142.00	26.76%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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(2024 年 9 月 24 日)基金份额总额	1,999,623,668.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	12,066,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,466,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	11,599,623,668.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

基金管理人于 2024 年 10 月 26 日公告，自 2024 年 10 月 25 日起，郭海明女士、胡海兰女士担任公司副总经理。

基金托管人：

2024 年 12 月 9 日，根据工作安排，宋菁女士不再担任平安银行股份有限公司资产托管部副总经理。

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

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金改聘毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为其审计的会计师事务所。报告期内应支付给该事务所的报酬为 30,000.00 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，管理人未受稽查或处罚，亦未发现管理人的高级管理人员受稽查或处罚。

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，托管人未受稽查或处罚，亦未发现托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

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	

国信证券	4	10,814,964,606.26	100.00%	2,118,884.12	100.00%	-
------	---	-------------------	---------	--------------	---------	---

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 证券公司的选择标准：

- 1) 资本金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因发生重大违规行为而受到有关管理机关处罚。
- 3) 合规风控能力较强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- 5) 具备较完善的清算系统，能及时、高效地完成资金的结算交收。
- 6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3. 证券公司的选择程序：

- 1) 本基金管理人定期组织相关部门依据证券公司的选择标准对候选券商进行评估，确定选用的券商。
- 2) 本基金管理人与券商签订协议，并通知基金托管人。
- 4. 本基金本年度成立，所有席位均为新增。

5. 《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日起实施，2024年7月1日至2024年12月31日期间，本公司旗下管理基金的股票交易佣金费率符合法规要求，即被动股票型基金的股票交易佣金费率不得超过市场平均股票交易佣金费率，其他类型基金的股票交易佣金费率不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。市场平均股票交易佣金费率由中国证券业协会定期测算并向行业机构通报。

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		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	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	-	-	-	-	-	-

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	摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	基金管理人公司网站及 本基金选定的信息披露 报纸	2024-09-25
2	摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	同上	2024-10-10
3	摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	同上	2024-10-10
4	摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	同上	2024-10-10
5	摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	同上	2024-10-15
6	摩根基金管理（中国）有限公司关于增聘高级管理人员的公告	同上	2024-10-26
7	摩根基金管理（中国）有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	同上	2024-12-28

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	1	20240921-20241015	0.00	1,298,420,040.00	237,730,820.00	1,060,689,220.00	9.14%
联接基金	1	20241113-20241231	0.00	6,255,814,284.00	3,151,407,142.00	3,104,407,142.00	26.76%
产品特有风险							
本基金的集中度风险主要体现在有单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%，如果投资者发生大额赎回，可能出现基金可变现资产无法满足投资者赎回需要以及因为资产变现成本过高导致投资者的利益受到损害的风险。							

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)中国证监会准予摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- (二)摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同

(三)摩根中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议

(四)法律意见书

(五)基金管理人业务资格批件、营业执照

(六)基金托管人业务资格批件、营业执照

(七)摩根基金管理（中国）有限公司开放式基金业务规则

(八)中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

摩根基金管理（中国）有限公司

二〇二五年三月三十一日