景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金
2025年年度报告

2025年12月31日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026年3月27日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 25 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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 其他指标 8
3.4 过去三年基金的利润分配情况 8

§4 管理人报告 8

4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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遵规守信情况声明 15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见 15

§6 审计报告 15

6.1 审计报告基本信息 15
6.2 审计报告的基本内容 15

§7 年度财务报表 17

7.1 资产负债表 17
7.2 利润表 19
7.3 净资产变动表 20
7.4 报表附注 22

§8 投资组合报告 47

8.1 期末基金资产组合情况 47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 48
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 49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 62
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 63
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 63
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 63
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 63
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 63
8.12 投资组合报告附注 63

§9 基金份额持有人信息 64

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 64
9.2 期末上市基金前十名持有人 65
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 65
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 65
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 65

§10 开放式基金份额变动 65

§11 重大事件揭示 66

11.1 基金份额持有人大会决议 66
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 66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 66
11.4 基金投资策略的改变 66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 66
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 66
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 72

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 72

§13 备查文件目录 73

13.1 备查文件目录 73
13.2 存放地点 73
13.3 查阅方式 73

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城中证 500ETF
场内简称	中证 500ETF 景顺
基金主代码	159935
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 26 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	29,572,956.00 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	2014 年 1 月 21 日

注：自 2024 年 3 月 18 日起，本基金场内简称由“景顺中证 500ETF”变更为“中证 500ETF 景顺”。

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最小化。
投资策略	本基金以中证 500 指数为标的指数，采用完全复制法，即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。在因特殊情况（包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，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或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	中证 500　指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皞阳	许俊
	联系电话	0755-82370388	010-66596688
	电子邮箱	investor@igwfmc.com	fxjd_hq@bank-of-china.com

客户服务电话	4008888606	95566
传真	0755-22381339	010-66594942
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518048	100818
法定代表人	叶才	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfmc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	7,789,271.71	-2,715,676.63	-2,089,848.22
本期利润	16,462,451.52	3,022,749.61	-3,321,083.52
加权平均基金份额本期利润	0.5441	0.0955	-0.1094
本期加权平均净值利润率	27.74%	5.80%	-5.99%
本期基金份额净值增长率	31.16%	6.97%	-6.69%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	39,851,669.70	28,099,584.07	19,907,718.65
期末可供分配基金份额利润	1.3476	0.7899	0.6732
期末基金资产净值	69,424,625.70	63,672,540.07	49,480,674.65
期末基金份额净值	2.3476	1.7899	1.6732
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	134.76%	78.99%	67.32%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计

入基金资产。

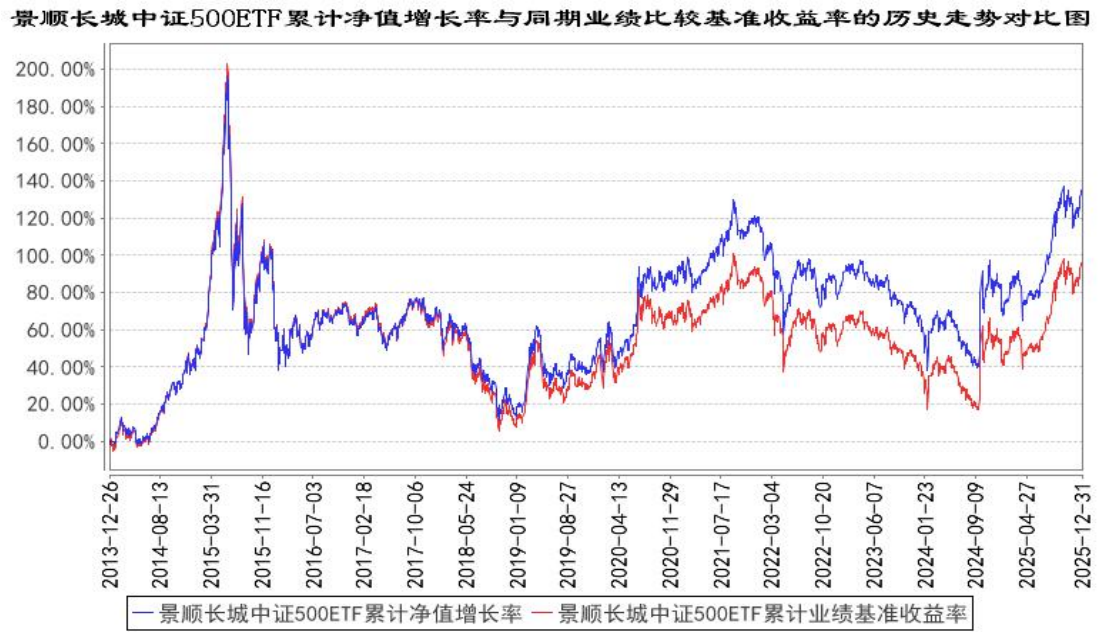
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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

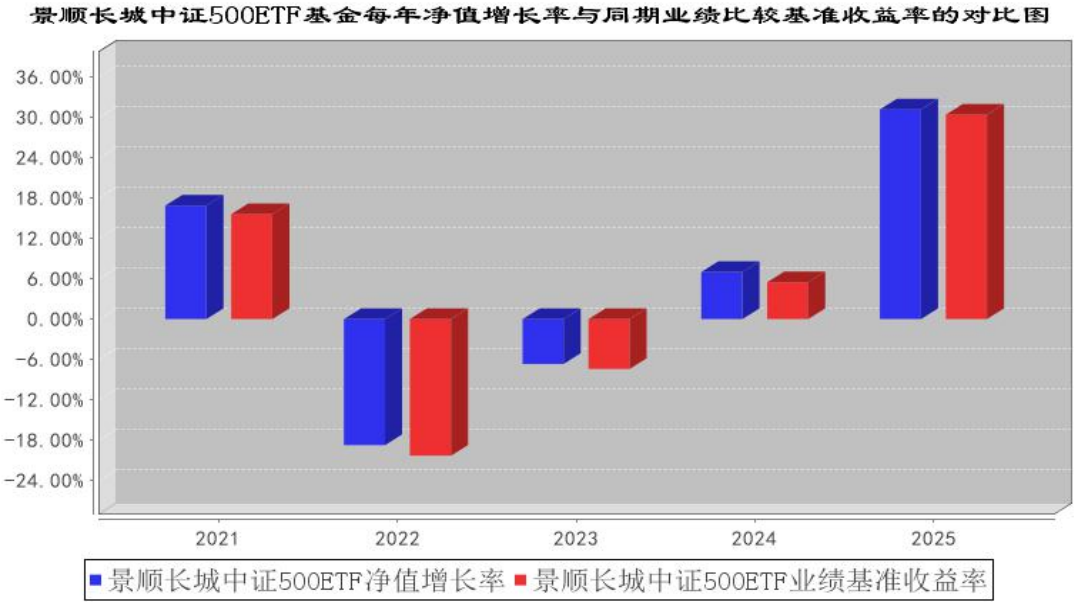
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.81%	1.22%	0.72%	1.24%	0.09%	-0.02%
过去六个月	26.28%	1.16%	26.21%	1.17%	0.07%	-0.01%
过去一年	31.16%	1.25%	30.39%	1.26%	0.77%	-0.01%
过去三年	30.92%	1.34%	27.30%	1.37%	3.62%	-0.03%
过去五年	24.32%	1.28%	17.25%	1.30%	7.07%	-0.02%
自基金合同生效起至今	134.76%	1.54%	96.03%	1.57%	38.73%	-0.03%

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



注：本基金的投资组合比例为：本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及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%。本基金的建仓期为自 2013 年 12 月 26 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字［2003］76 号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2025 年 12 月 31 日，本公司旗下共管理 210 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张晓南	本基金的基金助理	2023 年 9 月 13 日	-	15 年	经济学硕士，CFA，FRM。曾任鹏华基金管理有限公司产品规划部高级产品设计师，兴银基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资部基金经理。2020 年 2 月加入本公司，自 2020 年 4 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理。具有 15 年证券、基金行业从业经验。
龚丽丽	本基金的基金经理	2024 年 5 月 30 日	-	14 年	理学硕士。曾任华泰柏瑞基金管理有限公司指数投资部研究员、基金经理助理、基金经理，申万菱信基金管理有限公司指数投资部负责人、基金经理。2022 年 3 月加入本公司，担任 ETF 与创新投资部副总经理，自 2023 年 11 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理，现任 ETF 与创新投资部副总经理、基金经理，兼任投资经理。具有 14 年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
龚丽丽	公募基金	15	21,451,973,036.77	2023 年 11 月 15 日
	私募资产管理计划	3	853,105,586.53	2023 年 12 月 27 日
	其他组合	-	-	-
	合计	18	22,305,078,623.30	-

注：报告期内，龚丽丽女士所管理的景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金产品清盘，并于 2025 年 7 月 24 日完成剩余财产分配。

4.1.4 基金经理薪酬机制

兼任基金经理薪酬激励与其所管理的私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩；公司对兼任基金经理进行考核，结合其中长期产品业绩、风险控制及合规表现等综合确定最终考核结果，并根据最终考核结果对其薪酬激励进行评定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本基金的基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，建立了相关制度及流程，并对同一基金经理兼任私募资产管理计划投资经理管理的多个投资组合加强交易管理、监控和分析，防范不公平交易行为。本报告期内，本基金管理人对不同的时间窗下同向交易和反向交易的交易价差进行监控和分析，并结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析，未发现不公平交易的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的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%的交易共有 25 次，为公司旗下的指数量化投资组合与其他组合因投资策略需要而发生的同日反向交易，或为公司管理的投资组合与公司担任投资顾问的 MOM 组合因投资策略不同而发生的同日反向交易。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2025 年 A 股市场一波三折：开年第一天大跌后，受到科技板块的带动出现起色，但 4 月再次因美国新一届政府关税政策的影响出现较大下跌，后续则随着关税谈判的进行逐渐企稳回升，并在下半年震荡上行，整体表现较为出色。全年以成长风格为主，但板块之间也存在轮动，AI、新能源、电网设备、商业航天等概念此起彼伏。主要宽基指数涨跌幅及排序为：创业板 50(57.45%)>科创 50(35.92%)>中证 500(30.39%)>沪深 300(17.66%)。市值维度同样中小盘占优，规模指数涨跌幅及排序为：中证 2000(36.42%)>中证 500(30.39%)>中证 1000(27.49%)>沪深 300(17.66%)。风格维度继续分化，中信风格指数涨跌幅及排序为：成长(43.90%)>周期(35.44%)>金融(11.57%)>消费(6.60%)>稳定(-0.03%)。行业维度，中信证券一级行业指数涨跌幅前五为：有色金属(96.91%)>通信(88.29%)>电子(44.93%)>国防军工(41.33%)>机械(40.70%)，后五为：食品饮料(-6.64%)<煤炭(-2.25%)<房地产(1.15%)<交通运输(3.29%)<商贸零售(4.57%)。

宏观数据层面，2025 年 12 月工业增加值同比增长 5.2%，前值 4.8%；12 月社会消费品零售总额同比增长 0.9%，前值 1.3%。通胀指标：12 月 PPI 同比-1.9%，前值-2.2%；12 月 CPI 同比 0.8%，前值 0.7%。货币金融指标：12 月 M2 同比增长 8.5%，前值 8.0%；12 月社会融资规模同比增长 8.3%，前值 8.5%。总体来看，增长斜率保持稳定，继续保持良好的复苏态势，同时通胀仍处在低位区间运行。

2025 年中国经济以 5%的实际增速收官，但平减指数全年下滑 1%，名义增速仅 4%，经济内部结构与年初预期出现明显偏离。出口在短暂扰动后展现出显著韧性，全年增长 5.5%，体现出产业竞争力、新兴经济体产能投资以及全球 AI 大周期的共同支撑。投资成为全年最弱项，但“十五五”开局带来重大项目靠前落地，新型政策性金融工具将在 2026 年形成更明显的托底力量。房地产调整接近尾声，2026 年初二手房成交已有回暖迹象。政策层面从“超常规逆周期”转向“加大逆周期和跨周期调节力度”，财政强调保持必要规模，货币政策强调灵活高效，结构性工具围绕促进消费、支持民营企业与扩大服务业供给持续加码。国务院常务会议提出规范税收优惠与财政补贴政策，继续推进反内卷与统一大市场建设，并强调“国内供强需弱矛盾突出”，政策在 2026 年将更重视物价回升与名义修复。整体来看，A 股在名义增速改善、政策托底与外需韧性的共同作用下，具备更均衡的盈利修复基础。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 31.16%，业绩比较基准收益率为 30.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年 A 股宽基的核心逻辑来自盈利的全面修复。2025 年经济呈现“出口强、投资弱、地产拖累”的结构性分化，但随着全球制造业周期回暖、国内重大项目靠前落地以及名义增速回升，这种分化有望在 2026 年逐步缓和。出口结构将更加均衡，投资在政策性金融工具支持下企稳，地产调整进入尾声后对企业盈利的拖累将显著收敛。财政金融协同政策持续推进，服务业供给改善与消费修复将增强企业收入端的稳定性。在盈利回升与估值温和修复的组合下，宽基指数仍是承接经济复苏预期的高效配置工具。

本基金采用复制标的指数的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。在报告期内，本基金结合申购赎回情况、标的指数成分调整情况定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪。

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，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门（如需）。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI(Key Performance Indicator 主要绩效指标)为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险

进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部

负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在景顺长城中证 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，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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认真的复核，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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、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	安永华明（2026）审字第 70015711_B15 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	景顺长城中证 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	我们审计了景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 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，后附的景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。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。
其他信息	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括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	管理层负责按照企业会计准则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，管理层负责评估景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认

	为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价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，就可能导致对景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	张武	郭劲扬
会计师事务所的地址	中国　　北京	
审计报告日期	2026 年 3 月 25 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	1,033,448.37	873,726.26

结算备付金		39,609.49	12,956.91
存出保证金		7,251.29	7,797.07
交易性金融资产	7.4.7.2	68,666,462.35	63,018,314.59
其中：股票投资		68,660,462.26	63,018,314.59
基金投资		-	-
债券投资		6,000.09	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		2,242,956.02	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		71,989,727.52	63,912,794.83
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 12 月 31 日**	**上年度末 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		1,773,050.79	135,597.06
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		24,241.58	28,216.84
应付托管费		4,848.33	5,643.35
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	762,961.12	70,797.51
负债合计		2,565,101.82	240,254.76
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	29,572,956.00	35,572,956.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-

未分配利润	7.4.7.12	39,851,669.70	28,099,584.07
净资产合计		69,424,625.70	63,672,540.07
负债和净资产总计		71,989,727.52	63,912,794.83

注:报告截止日 2025 年 12 月 31 日,基金份额净值人民币 2.3476 元,基金份额总额 29,572,956.00 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		16,913,201.60	3,440,999.33
1.利息收入		2,867.03	4,225.75
其中：存款利息收入	7.4.7.13	2,867.03	4,225.75
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,205,646.34	-2,407,124.15
其中：股票投资收益	7.4.7.14	7,297,029.62	-3,429,987.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	21,353.54	439.24
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	887,263.18	1,022,424.35
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	8,673,179.81	5,738,426.24
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	31,508.42	105,471.49
减：二、营业总支出		450,750.08	418,249.72

1．管理人报酬	7.4.10.2.1	297,698.75	259,744.78
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	7.4.10.2.2	59,539.82	51,948.93
3．销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7．税金及附加		-	-
8．其他费用	7.4.7.23	93,511.51	106,556.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,462,451.52	3,022,749.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,462,451.52	3,022,749.61
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		16,462,451.52	3,022,749.61

7.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	35,572,956.00	-	28,099,584.07	63,672,540.07
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	35,572,956.00	-	28,099,584.07	63,672,540.07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,000,000.00	-	11,752,085.63	5,752,085.63
（一）、综合收益总额	-	-	16,462,451.52	16,462,451.52
（二）、本期基金份额交易产生的	-6,000,000.00	-	-4,710,365.89	-10,710,365.89

净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	34,000,000.00	-	35,617,674.47	69,617,674.47
2.基金赎回款	-40,000,000.00	-	-40,328,040.36	-80,328,040.36
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	29,572,956.00	-	39,851,669.70	69,424,625.70
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	29,572,956.00	-	19,907,718.65	49,480,674.65
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	29,572,956.00	-	19,907,718.65	49,480,674.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,000,000.00	-	8,191,865.42	14,191,865.42
（一）、综合收益总额	-	-	3,022,749.61	3,022,749.61
（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）	6,000,000.00	-	5,169,115.81	11,169,115.81
其中：1.基金申购款	14,000,000.00	-	10,823,778.61	24,823,778.61
2.基金赎回款	-8,000,000.00	-	-5,654,662.80	-13,654,662.80

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	35,572,956.00	-	28,099,584.07	63,672,540.07

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：

康乐	吴建军	邵媛媛
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

景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]1501 号《关于核准景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式指数基金，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 512,538,347.00 元（含募集股票市值），业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2013）第 887 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 512,572,956.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 34,609.00 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2014]第 17 号文审核同意，本基金 512,572,956.00 份基金份额于 2014 年 1 月 21 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证 500 指数，追求跟踪偏

离度和跟踪误差最小化。投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及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%。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票及存托凭证）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。

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

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2026 年 3 月 25 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于 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度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。

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

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

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处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以

单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

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。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负

债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；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，应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，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应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，应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，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占净资产比例计算的

金额。未实现损益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利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）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，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外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的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）本基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

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等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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。基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，本基金的基金管理人可进行收益分配；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确定收益分配。本基金收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

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）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）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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征

收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4）印花税（如适用）

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	1,033,448.37	873,726.26
等于：本金	1,033,362.43	873,641.54
加：应计利息	85.94	84.72
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 个月（含）-3 个月	-	-
存款期限 3 个月（含）至 1 年	-	-
存款期限 1 年（含）以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	1,033,448.37	873,726.26

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		61,633,171.64	-	68,660,462.26	7,027,290.62
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	6,000.00	0.09	6,000.09	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	6,000.00	0.09	6,000.09	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		61,639,171.64	0.09	68,666,462.35	7,027,290.62
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		64,664,203.78	-	63,018,314.59	-1,645,889.19
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	64,664,203.78	-	63,018,314.59	-1,645,889.19

注：股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

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

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末的买入返售金融资产余额为零。

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买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末的债权投资余额为零。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末及上年度末的债权投资余额为零。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末的其他债权投资余额为零。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末及上年度末的其他债权投资余额为零。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末的其他权益工具投资余额为零。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末的其他权益工具投资余额为零。

7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末及上年度末的其他资产余额为零。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 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	9,933.60	6,848.55
其中：交易所市场	9,933.60	6,848.55
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	88,000.00	62,427.24
应付指数使用费	-	1,521.72
应退替代款	665,027.52	-
合计	762,961.12	70,797.51

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,572,956.00	35,572,956.00
本期申购	34,000,000.00	34,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-40,000,000.00	-40,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	29,572,956.00	29,572,956.00

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	54,614,995.47	-26,515,411.40	28,099,584.07

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	54,614,995.47	-26,515,411.40	28,099,584.07
本期利润	7,789,271.71	8,673,179.81	16,462,451.52
本期基金份额交易产生的变动数	-8,368,529.96	3,658,164.07	-4,710,365.89
其中：基金申购款	55,420,850.26	-19,803,175.79	35,617,674.47
基金赎回款	-63,789,380.22	23,461,339.86	-40,328,040.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	54,035,737.22	-14,184,067.52	39,851,669.70

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	2,674.76	3,814.81
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	177.42	377.73
其他	14.85	33.21
合计	2,867.03	4,225.75

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,589,247.74	-2,924,464.05
股票投资收益——赎回差价收入	3,707,781.88	-505,523.69
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	7,297,029.62	-3,429,987.74

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12

	月 31 日	月 31 日
卖出股票成交总额	64,384,559.08	25,687,237.97
减：卖出股票成本总额	60,730,530.39	28,569,390.85
减：交易费用	64,780.95	42,311.17
买卖股票差价收入	3,589,247.74	-2,924,464.05

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
赎回基金份额对价总额	80,328,040.36	13,654,662.80
减：现金支付赎回款总额	39,804,156.36	6,870,349.80
减：赎回股票成本总额	36,816,102.12	7,289,836.69
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	3,707,781.88	-505,523.69

7.4.7.14.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	6.98	0.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	21,346.56	438.97
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	21,353.54	439.24

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月

	日	31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	87,456.83	4,339.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	66,100.00	3,900.00
减：应计利息总额	6.89	0.39
减：交易费用	3.38	0.17
买卖债券差价收入	21,346.56	438.97

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	887,263.18	1,022,424.35
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	887,263.18	1,022,424.35

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	8,673,179.81	5,738,426.24
股票投资	8,673,179.81	5,738,426.24
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	8,673,179.81	5,738,426.24

注：公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益。

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	31,508.42	105,471.49
合计	31,508.42	105,471.49

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

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	8,000.00	5,705.55
信息披露费	80,000.00	56,721.69
证券出借违约金	-	-

银行划款手续费	1,400.20	1,247.60
指数使用费	4,070.93	42,842.93
存托服务费	40.38	38.24
合计	93,511.51	106,556.01

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03%的年费率计提，逐日累计，按季支付。根据《关于景顺长城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》，自 2025 年 3 月 21 日起，本基金指数使用费调整为基金管理人承担。

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

截至财务报表报出日，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
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司
景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“景顺长城中证 500ETF 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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

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股票交易。

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 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	297,698.75	259,744.78
其中：应支付销售机构的客户维护费	20,778.37	11,358.91
应支付基金管理人的净管理费	276,920.38	248,385.87

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	59,539.82	51,948.93

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

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银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金的基金管理人于本报告期和上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 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（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
景顺长城中证 500ETF 联接	18,973,600.00	64.16	26,225,900.00	73.72

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期	1,033,448.37	2,674.76	873,726.26	3,814.81

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有 11,900.00 股长城证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 116,748.57 元，估值总额为人民币 121,380.00 元，占基金净资产的比例为 0.17%(于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有 14,500.00 股长城证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 143,292.40 元，估值总额为人民币 118,900.00 元，占基金净资产的比例为 0.19%)。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

7.4.12 期末（2025 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：债券										
证券代码	证券	成功认购	受限期	流通受限	认购价格	期末估值	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

	名称	日		类型		单价	位：张）			
118063	金05转债	2025年12月26日	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	60	6,000.00	6,000.09	-

注：以上限售证券的实际流通日期以上市公司的公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天3	2023年8月30日	重大事项停牌	0.11	-	-	41,300	104,332.59	4,543.00	-

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

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

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

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管

理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

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的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，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与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 0.01%（上年度末：0.00%）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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对其管理的所有开放式基金于开放期内，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

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

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因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约

规定的重新定价日或到期日进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,033,448.37	-	-	-	-	-	1,033,448.37
结算备付金	39,609.49	-	-	-	-	-	39,609.49
存出保证金	7,251.29	-	-	-	-	-	7,251.29
交易性金融资产	-	-	-	-	6,000.09	68,660,462.26	68,666,462.35
应收清算款	-	-	-	-	-	2,242,956.02	2,242,956.02
资产总计	1,080,309.15	-	-	-	6,000.09	70,903,418.28	71,989,727.52
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	24,241.58	24,241.58
应付托管费	-	-	-	-	-	4,848.33	4,848.33
应付清算款	-	-	-	-	-	1,773,050.79	1,773,050.79
其他负债	-	-	-	-	-	762,961.12	762,961.12
负债总计	-	-	-	-	-	2,565,101.82	2,565,101.82
利率敏感度缺口	1,080,309.15	-	-	-	6,000.09	-	-
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	873,726.26	-	-	-	-	-	873,726.26
结算备付金	12,956.91	-	-	-	-	-	12,956.91
存出保证金	7,797.07	-	-	-	-	-	7,797.07
交易性金融资产	-	-	-	-	-	63,018,314.59	63,018,314.59
资产总计	894,480.24	-	-	-	-	63,018,314.59	63,912,794.83
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,216.84	28,216.84
应付托管费	-	-	-	-	-	5,643.35	5,643.35
应付清算款	-	-	-	-	-	135,597.06	135,597.06
其他负债	-	-	-	-	-	70,797.51	70,797.51
负债总计	-	-	-	-	-	240,254.76	240,254.76
利率敏感度缺口	894,480.24	-	-	-	-	-	-

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.01%（上年度末：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：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

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格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证券，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。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024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	68,660,462.26	98.90	63,018,314.59	98.97
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	68,660,462.26	98.90	63,018,314.59	98.97

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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（2025 年 12 月 31 日）	上年度末 （2024 年 12 月 31 日 ）
	沪深 300 指数上升 5%	4,114,974.45	3,572,959.38
	沪深 300 指数下降 5%	-4,114,974.45	-3,572,959.38

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	68,655,919.26	63,013,771.59
第二层次	6,000.09	-
第三层次	4,543.00	4,543.00
合计	68,666,462.35	63,018,314.59

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	4,543.00	4,543.00
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	4,543.00	4,543.00

期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	4,543.00	4,543.00
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	4,543.00	4,543.00
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

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

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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

无。

§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	68,660,462.26	95.38
	其中：股票	68,660,462.26	95.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,000.09	0.01
	其中：债券	6,000.09	0.01
	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	1,073,057.86	1.49
8	其他各项资产	2,250,207.31	3.13
9	合计	71,989,727.52	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	324,916.00	0.47
B	采矿业	2,870,990.60	4.14
C	制造业	46,987,023.30	67.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,979,468.71	2.85
E	建筑业	554,683.50	0.80
F	批发和零售业	1,037,566.22	1.49
G	交通运输、仓储和邮政业	1,022,165.64	1.47
H	住宿和餐饮业	85,918.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,602,004.28	8.07
J	金融业	5,051,355.34	7.28
K	房地产业	483,044.20	0.70
L	租赁和商务服务业	857,579.20	1.24
M	科学研究和技术服务业	458,725.06	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	297,617.80	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	98,640.00	0.14
Q	卫生和社会工作	213,183.41	0.31
R	文化、体育和娱乐业	484,308.00	0.70
S	综合	246,730.00	0.36
	合计	68,655,919.26	98.89

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,543.00	0.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,543.00	0.01

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002837	英维克	4,200	448,938.00	0.65
2	300136	信维通信	7,000	434,000.00	0.63
3	002558	巨人网络	9,800	424,242.00	0.61
4	002738	中矿资源	5,320	417,886.00	0.60
5	600879	航天电子	19,292	411,305.44	0.59
6	600118	中国卫星	4,300	408,285.00	0.59
7	300450	先导智能	8,000	399,840.00	0.58
8	600580	卧龙电驱	8,032	394,371.20	0.57
9	600988	赤峰黄金	12,100	378,004.00	0.54
10	000426	兴业银锡	10,400	370,240.00	0.53
11	600487	亨通光电	14,500	358,585.00	0.52
12	002202	金风科技	17,575	358,530.00	0.52
13	002156	通富微电	8,900	335,530.00	0.48

14	601168	西部矿业	12,100	334,444.00	0.48
15	300604	长川科技	3,300	334,323.00	0.48
16	600549	厦门钨业	8,100	332,586.00	0.48
17	002532	天山铝业	20,300	328,454.00	0.47
18	300115	长盈精密	6,900	320,850.00	0.46
19	002353	杰瑞股份	4,500	318,735.00	0.46
20	000933	神火股份	11,600	318,652.00	0.46
21	301308	江波龙	1,300	318,292.00	0.46
22	600096	云天化	9,400	314,054.00	0.45
23	002340	格林美	37,238	311,309.68	0.45
24	300395	菲利华	3,100	310,930.00	0.45
25	002261	拓维信息	9,300	307,830.00	0.44
26	300058	蓝色光标	26,060	300,211.20	0.43
27	600143	金发科技	15,300	298,962.00	0.43
28	002851	麦格米特	3,300	297,231.00	0.43
29	002195	岩山科技	41,322	292,972.98	0.42
30	300339	润和软件	5,900	292,050.00	0.42
31	688347	华虹公司	2,693	290,493.91	0.42
32	300857	协创数据	1,700	286,756.00	0.41
33	300207	欣旺达	10,800	282,420.00	0.41
34	688525	佰维存储	2,439	279,972.81	0.40
35	002131	利欧股份	49,400	278,616.00	0.40
36	600885	宏发股份	9,127	277,460.80	0.40
37	002517	恺英网络	12,400	271,188.00	0.39
38	688120	华海清科	1,800	270,144.00	0.39
39	002966	苏州银行	32,560	269,922.40	0.39
40	300751	迈为股份	1,300	267,787.00	0.39
41	603228	景旺电子	3,652	266,924.68	0.38
42	300223	北京君正	2,500	265,100.00	0.38
43	002402	和而泰	6,700	262,104.00	0.38
44	601555	东吴证券	28,890	261,743.40	0.38
45	002436	兴森科技	12,300	260,391.00	0.38
46	002281	光迅科技	3,669	256,646.55	0.37
47	600601	方正科技	21,800	255,496.00	0.37
48	000831	中国稀土	5,500	255,420.00	0.37
49	002273	水晶光电	10,124	254,314.88	0.37
50	002595	豪迈科技	3,000	253,530.00	0.37
51	002008	大族激光	6,100	251,259.00	0.36
52	600157	永泰能源	158,800	249,316.00	0.36
53	600673	东阳光	11,000	246,730.00	0.36
54	688469	芯联集成	36,618	244,974.42	0.35
55	002130	沃尔核材	9,300	244,776.00	0.35
56	688122	西部超导	3,273	244,100.34	0.35

57	688002	睿创微纳	2,374	239,299.20	0.34
58	688099	晶晨股份	2,721	237,352.83	0.34
59	002472	双环传动	5,000	237,050.00	0.34
60	689009	九号公司	4,237	235,534.83	0.34
61	002126	银轮股份	6,200	234,360.00	0.34
62	688777	中控技术	4,712	232,490.08	0.33
63	002465	海格通信	14,600	229,950.00	0.33
64	688361	中科飞测	1,497	229,026.03	0.33
65	002128	电投能源	8,200	228,862.00	0.33
66	300390	天华新能	4,190	228,815.90	0.33
67	603129	春风动力	800	222,944.00	0.32
68	600699	均胜电子	7,080	222,028.80	0.32
69	301358	湖南裕能	3,400	219,844.00	0.32
70	600392	盛和资源	10,195	219,498.35	0.32
71	300346	南大光电	5,100	218,790.00	0.32
72	601162	天风证券	51,400	213,824.00	0.31
73	603659	璞泰来	7,800	213,252.00	0.31
74	603979	金诚信	2,800	213,220.00	0.31
75	002138	顺络电子	6,000	213,180.00	0.31
76	002797	第一创业	30,700	210,909.00	0.30
77	300054	鼎龙股份	5,600	210,560.00	0.30
78	000878	云南铜业	10,200	209,202.00	0.30
79	300454	深信服	1,800	207,288.00	0.30
80	601108	财通证券	23,700	206,664.00	0.30
81	688578	艾力斯	1,981	206,321.15	0.30
82	600021	上海电力	10,300	206,206.00	0.30
83	300037	新宙邦	3,920	205,408.00	0.30
84	002850	科达利	1,300	205,218.00	0.30
85	002185	华天科技	18,700	205,139.00	0.30
86	601099	太平洋	49,500	203,445.00	0.29
87	000021	深科技	8,030	202,998.40	0.29
88	600352	浙江龙盛	19,000	202,540.00	0.29
89	000960	锡业股份	7,200	200,736.00	0.29
90	002294	信立泰	4,000	198,200.00	0.29
91	600141	兴发集团	5,720	197,797.60	0.28
92	300474	景嘉微	2,750	197,642.50	0.28
93	000783	长江证券	24,200	197,230.00	0.28
94	601198	东兴证券	14,200	197,096.00	0.28
95	688213	思特威	2,072	197,026.48	0.28
96	688235	百济神州	730	196,078.00	0.28
97	688385	复旦微电	2,637	194,346.90	0.28
98	601717	中创智领	7,910	194,190.50	0.28
99	600498	烽火通信	6,000	192,480.00	0.28

100	600298	安琪酵母	4,400	192,456.00	0.28
101	603179	新泉股份	2,600	192,088.00	0.28
102	000893	亚钾国际	4,000	191,880.00	0.28
103	300724	捷佳伟创	2,000	191,200.00	0.28
104	601615	明阳智能	13,200	191,136.00	0.28
105	002078	太阳纸业	12,120	190,890.00	0.27
106	300073	当升科技	3,300	190,740.00	0.27
107	002271	东方雨虹	14,000	190,260.00	0.27
108	000657	中钨高新	6,800	188,428.00	0.27
109	600536	中国软件	4,042	187,144.60	0.27
110	603606	东方电缆	3,100	185,225.00	0.27
111	603087	甘李药业	2,700	183,789.00	0.26
112	300017	网宿科技	17,900	183,475.00	0.26
113	688676	金盘科技	2,028	183,209.52	0.26
114	300496	中科创达	2,700	182,250.00	0.26
115	601696	中银证券	12,100	181,379.00	0.26
116	002414	高德红外	12,360	181,321.20	0.26
117	601233	桐昆股份	10,500	180,705.00	0.26
118	601665	齐鲁银行	31,300	179,662.00	0.26
119	002080	中材科技	4,900	178,066.00	0.26
120	002444	巨星科技	5,211	177,278.22	0.26
121	600884	杉杉股份	13,100	176,981.00	0.25
122	300458	全志科技	4,200	176,526.00	0.25
123	600109	国金证券	18,900	175,770.00	0.25
124	002157	正邦科技	53,900	174,636.00	0.25
125	002085	万丰奥威	10,900	174,509.00	0.25
126	688183	生益电子	1,816	173,773.04	0.25
127	300748	金力永磁	5,040	171,914.40	0.25
128	688608	恒玄科技	754	171,112.76	0.25
129	601128	常熟银行	24,195	170,332.80	0.25
130	600363	联创光电	2,700	170,262.00	0.25
131	601179	中国西电	18,700	170,170.00	0.25
132	601577	长沙银行	17,500	169,750.00	0.24
133	002155	湖南黄金	8,040	169,563.60	0.24
134	688568	中科星图	2,863	168,917.00	0.24
135	688220	翱捷科技	2,027	167,450.47	0.24
136	300024	机器人	9,200	167,348.00	0.24
137	000423	东阿阿胶	3,400	166,872.00	0.24
138	300002	神州泰岳	14,400	165,888.00	0.24
139	300012	华测检测	12,200	165,310.00	0.24
140	002223	鱼跃医疗	4,326	165,296.46	0.24
141	000559	万向钱潮	9,600	165,120.00	0.24
142	300699	光威复材	4,160	164,153.60	0.24

143	688019	安集科技	753	164,093.76	0.24
144	300757	罗博特科	700	163,310.00	0.24
145	300373	扬杰科技	2,400	163,200.00	0.24
146	002683	广东宏大	3,400	162,520.00	0.23
147	002624	完美世界	9,900	162,261.00	0.23
148	300919	中伟新材	3,500	162,155.00	0.23
149	603596	伯特利	3,160	162,013.20	0.23
150	300285	国瓷材料	5,900	161,719.00	0.23
151	600497	驰宏锌锗	22,100	161,551.00	0.23
152	688017	绿的谐波	837	160,787.70	0.23
153	002064	华峰化学	14,600	160,600.00	0.23
154	000034	神州数码	4,100	159,531.00	0.23
155	000728	国元证券	19,100	159,485.00	0.23
156	688599	天合光能	9,561	158,234.55	0.23
157	603160	汇顶科技	2,000	158,000.00	0.23
158	002409	雅克科技	2,100	155,610.00	0.22
159	600765	中航重机	8,105	155,291.80	0.22
160	603920	世运电路	3,200	154,912.00	0.22
161	002673	西部证券	19,600	154,644.00	0.22
162	600079	ST 人福	8,400	152,124.00	0.22
163	000733	振华科技	2,900	151,989.00	0.22
164	002756	永兴材料	2,800	151,900.00	0.22
165	002410	广联达	12,000	150,960.00	0.22
166	688027	国盾量子	299	150,633.21	0.22
167	300570	太辰光	1,300	150,215.00	0.22
168	002065	东华软件	16,400	150,060.00	0.22
169	002335	科华数据	2,700	149,931.00	0.22
170	601799	星宇股份	1,200	148,044.00	0.21
171	300003	乐普医疗	9,300	147,033.00	0.21
172	603766	隆鑫通用	9,100	146,601.00	0.21
173	600862	中航高科	6,200	146,506.00	0.21
174	000997	新 大 陆	5,152	145,904.64	0.21
175	600873	梅花生物	14,400	145,872.00	0.21
176	688322	奥比中光	1,620	145,265.40	0.21
177	688065	凯赛生物	2,913	145,067.40	0.21
178	002318	久立特材	5,000	144,750.00	0.21
179	601231	环旭电子	4,800	144,000.00	0.21
180	600637	东方明珠	14,600	143,810.00	0.21
181	000528	柳　　工	12,000	142,440.00	0.21
182	000932	华菱钢铁	25,200	141,624.00	0.20
183	000683	博源化工	19,000	141,360.00	0.20
184	000703	恒逸石化	13,100	141,087.00	0.20
185	600060	海信视像	5,800	140,824.00	0.20

186	300972	万辰集团	700	140,749.00	0.20
187	300627	华测导航	4,000	139,640.00	0.20
188	000830	鲁西化工	8,407	139,303.99	0.20
189	605358	立昂微	4,000	139,280.00	0.20
190	300001	特锐德	5,400	138,672.00	0.20
191	605589	圣泉集团	4,900	138,670.00	0.20
192	600909	华安证券	20,420	138,447.60	0.20
193	000750	国海证券	32,590	138,181.60	0.20
194	603486	科沃斯	1,700	137,156.00	0.20
195	688234	天岳先进	1,536	136,519.68	0.20
196	000039	中集集团	13,440	135,609.60	0.20
197	000623	吉林敖东	6,900	134,757.00	0.19
198	000887	中鼎股份	5,800	134,618.00	0.19
199	688375	国博电子	1,444	134,450.84	0.19
200	688180	君实生物	3,933	134,351.28	0.19
201	600737	中粮糖业	7,800	134,238.00	0.19
202	000400	许继电气	5,194	133,537.74	0.19
203	000060	中金岭南	22,700	132,795.00	0.19
204	300677	英科医疗	3,400	132,260.00	0.19
205	300383	光环新网	10,500	131,355.00	0.19
206	600332	白云山	5,100	131,274.00	0.19
207	002821	凯莱英	1,400	130,102.00	0.19
208	600369	西南证券	29,000	129,920.00	0.19
209	000009	中国宝安	13,180	129,823.00	0.19
210	688387	信科移动	10,044	129,567.60	0.19
211	688629	华丰科技	1,290	129,077.40	0.19
212	600521	华海药业	7,600	128,972.00	0.19
213	600177	雅戈尔	16,900	128,440.00	0.19
214	600171	上海贝岭	4,100	128,125.00	0.18
215	001696	宗申动力	5,900	127,971.00	0.18
216	300567	精测电子	1,400	127,680.00	0.18
217	300142	沃森生物	11,700	127,647.00	0.18
218	601990	南京证券	16,100	127,512.00	0.18
219	603444	吉比特	300	127,155.00	0.18
220	002152	广电运通	9,200	127,052.00	0.18
221	002203	海亮股份	10,000	126,600.00	0.18
222	600704	物产中大	22,700	126,439.00	0.18
223	601212	白银有色	21,600	126,360.00	0.18
224	603568	伟明环保	4,978	126,341.64	0.18
225	688778	厦钨新能	1,631	126,190.47	0.18
226	300432	富临精工	7,500	125,250.00	0.18
227	601997	贵阳银行	21,300	125,031.00	0.18
228	600378	昊华科技	3,900	124,644.00	0.18

229	000738	航发控制	5,800	123,598.00	0.18
230	002841	视源股份	3,100	122,853.00	0.18
231	688114	华大智造	2,019	122,674.44	0.18
232	002429	兆驰股份	16,500	122,430.00	0.18
233	002739	万达电影	10,800	122,256.00	0.18
234	600801	华新建材	4,951	121,497.54	0.18
235	600486	扬农化工	1,750	121,432.50	0.17
236	300763	锦浪科技	1,700	121,397.00	0.17
237	002939	长城证券	11,900	121,380.00	0.17
238	002007	华兰生物	8,000	121,040.00	0.17
239	688266	泽璟制药	1,297	120,231.90	0.17
240	301611	珂玛科技	1,400	120,022.00	0.17
241	601611	中国核建	8,900	119,972.00	0.17
242	002044	美年健康	22,700	119,856.00	0.17
243	600208	衢州发展	30,900	119,583.00	0.17
244	603699	纽威股份	2,300	119,531.00	0.17
245	600435	北方导航	7,720	119,042.40	0.17
246	603345	安井食品	1,500	118,920.00	0.17
247	601216	君正集团	24,600	118,572.00	0.17
248	688617	惠泰医疗	484	117,742.68	0.17
249	600563	法拉电子	1,119	117,439.05	0.17
250	601567	三星医疗	5,100	117,402.00	0.17
251	688166	博瑞医药	2,392	117,351.52	0.17
252	600516	方大炭素	20,500	116,645.00	0.17
253	600153	建发股份	12,600	116,550.00	0.17
254	600499	科达制造	8,400	116,508.00	0.17
255	603605	珀莱雅	1,700	116,416.00	0.17
256	002056	横店东磁	5,964	116,298.00	0.17
257	000729	燕京啤酒	10,300	115,669.00	0.17
258	001389	广合科技	1,400	114,282.00	0.16
259	688052	纳芯微	721	114,047.78	0.16
260	603816	顾家家居	3,700	113,738.00	0.16
261	000519	中兵红箭	6,227	113,393.67	0.16
262	688702	盛科通信	794	112,501.86	0.16
263	600038	中直股份	3,100	112,003.00	0.16
264	600316	洪都航空	3,200	111,712.00	0.16
265	600642	申能股份	14,300	111,254.00	0.16
266	300487	蓝晓科技	1,800	111,150.00	0.16
267	002430	杭氧股份	3,700	110,519.00	0.16
268	688278	特宝生物	1,319	110,373.92	0.16
269	688772	珠海冠宇	5,086	109,501.58	0.16
270	000415	渤海租赁	27,000	109,350.00	0.16
271	603156	养元饮品	3,800	109,250.00	0.16

272	601958	金钼股份	7,000	109,060.00	0.16
273	603728	鸣志电器	1,500	108,525.00	0.16
274	000155	川能动力	9,300	108,345.00	0.16
275	600348	华阳股份	13,100	108,206.00	0.16
276	603379	三美股份	1,780	108,081.60	0.16
277	002926	华西证券	11,600	107,648.00	0.16
278	688582	芯动联科	1,623	107,296.53	0.15
279	688538	和辉光电	40,309	107,221.94	0.15
280	300679	电连技术	2,200	107,096.00	0.15
281	600863	内蒙华电	23,800	106,624.00	0.15
282	002262	恩华药业	4,400	106,172.00	0.15
283	603806	福斯特	7,600	106,096.00	0.15
284	600967	内蒙一机	6,300	105,840.00	0.15
285	002603	以岭药业	6,200	105,834.00	0.15
286	000723	美锦能源	22,500	105,750.00	0.15
287	003031	中瓷电子	1,440	105,350.40	0.15
288	600398	海澜之家	17,400	105,270.00	0.15
289	000629	钒钛股份	33,800	104,780.00	0.15
290	688297	中无人机	2,181	104,731.62	0.15
291	600562	国睿科技	3,700	104,562.00	0.15
292	600312	平高电气	6,000	104,100.00	0.15
293	600901	江苏金租	16,980	103,917.60	0.15
294	600820	隧道股份	16,000	103,840.00	0.15
294	601699	潞安环能	8,800	103,840.00	0.15
295	688018	乐鑫科技	610	103,700.00	0.15
296	603298	杭叉集团	3,900	103,623.00	0.15
297	300623	捷捷微电	3,800	103,246.00	0.15
298	600170	上海建工	38,700	102,555.00	0.15
299	603338	浙江鼎力	1,800	101,952.00	0.15
300	603077	和邦生物	44,943	101,571.18	0.15
301	600166	福田汽车	34,600	101,032.00	0.15
302	002958	青农商行	32,400	100,440.00	0.14
303	002385	大北农	25,100	100,400.00	0.14
304	601399	国机重装	21,000	100,380.00	0.14
305	002025	航天电器	2,000	100,260.00	0.14
306	601106	中国一重	25,000	99,750.00	0.14
307	688188	柏楚电子	733	99,607.37	0.14
308	603737	三棵树	2,148	99,387.96	0.14
309	003021	兆威机电	800	99,344.00	0.14
310	300100	双林股份	2,500	99,050.00	0.14
311	002607	中公教育	36,000	98,640.00	0.14
312	600970	中材国际	9,450	98,185.50	0.14
313	000050	深天马 A	10,800	97,524.00	0.14

314	603885	吉祥航空	6,500	96,720.00	0.14
315	600008	首创环保	32,070	96,210.00	0.14
316	002432	九安医疗	2,400	96,096.00	0.14
317	603290	斯达半导	1,000	96,090.00	0.14
318	002984	森麒麟	4,500	95,265.00	0.14
319	300676	华大基因	2,100	95,256.00	0.14
320	300144	宋城演艺	11,600	95,004.00	0.14
321	601991	大唐发电	27,100	94,579.00	0.14
322	603939	益丰药房	4,348	94,438.56	0.14
323	600282	南钢股份	17,900	94,154.00	0.14
324	600998	九州通	18,380	94,105.60	0.14
325	002500	山西证券	15,660	93,803.40	0.14
326	600329	达仁堂	2,055	93,749.10	0.14
327	601155	新城控股	6,700	93,465.00	0.13
328	600763	通策医疗	2,321	93,327.41	0.13
329	603589	口子窖	3,100	93,155.00	0.13
330	000513	丽珠集团	2,703	93,145.38	0.13
331	688615	合合信息	409	93,080.22	0.13
332	600095	湘财股份	8,400	92,904.00	0.13
333	002244	滨江集团	9,224	92,701.20	0.13
334	600380	健康元	7,992	92,307.60	0.13
335	600390	五矿资本	16,400	91,020.00	0.13
336	002312	川发龙蟒	8,300	90,719.00	0.13
337	002583	海能达	8,000	90,560.00	0.13
338	000987	越秀资本	11,030	89,784.20	0.13
339	000591	太阳能	20,100	89,244.00	0.13
340	300146	汤臣倍健	7,400	88,874.00	0.13
341	600132	重庆啤酒	1,700	88,808.00	0.13
342	600583	海油工程	16,100	88,389.00	0.13
343	601608	中信重工	13,400	88,306.00	0.13
344	600685	中船防务	3,100	88,195.00	0.13
345	600602	云赛智联	4,700	87,843.00	0.13
346	600985	淮北矿业	7,900	87,769.00	0.13
347	601865	福莱特	5,600	87,752.00	0.13
348	600995	南网储能	6,900	86,733.00	0.12
349	600977	中国电影	5,500	86,460.00	0.12
350	600754	锦江酒店	3,400	85,918.00	0.12
351	601880	辽港股份	53,599	85,758.40	0.12
352	300718	长盛轴承	1,000	85,360.00	0.12
353	688728	格科微	5,701	85,172.94	0.12
354	603225	新凤鸣	4,372	85,079.12	0.12
355	002568	百润股份	3,900	85,059.00	0.12
356	601666	平煤股份	10,800	84,996.00	0.12

357	000921	海信家电	3,419	84,825.39	0.12
358	601156	东航物流	4,600	84,686.00	0.12
359	300735	光弘科技	3,400	84,524.00	0.12
360	300558	贝达药业	1,800	84,042.00	0.12
361	301536	星宸科技	1,400	83,874.00	0.12
362	688301	奕瑞科技	825	83,415.75	0.12
363	601000	唐山港	21,611	82,986.24	0.12
364	600535	天士力	5,500	82,885.00	0.12
365	601016	节能风电	28,020	82,659.00	0.12
366	688281	华秦科技	1,120	82,656.00	0.12
367	600004	白云机场	8,700	82,302.00	0.12
368	000825	太钢不锈	16,700	81,663.00	0.12
369	601001	晋控煤业	6,200	81,530.00	0.12
370	600816	建元信托	28,600	80,938.00	0.12
371	002773	康弘药业	2,700	80,919.00	0.12
372	600848	上海临港	6,900	80,730.00	0.12
373	600126	杭钢股份	9,840	80,294.40	0.12
374	600511	国药股份	2,786	80,097.50	0.12
375	603927	中科软	4,176	79,719.84	0.11
376	603650	彤程新材	1,800	79,452.00	0.11
377	000032	深桑达 A	4,100	79,335.00	0.11
378	002266	浙富控股	19,045	79,227.20	0.11
379	601966	玲珑轮胎	5,400	78,462.00	0.11
380	688561	奇安信	2,204	78,418.32	0.11
381	002423	中粮资本	6,700	78,390.00	0.11
382	000598	兴蓉环境	10,900	78,153.00	0.11
383	603786	科博达	1,000	78,100.00	0.11
384	600598	北大荒	5,200	77,740.00	0.11
385	002831	裕同科技	2,720	77,547.20	0.11
386	000563	陕国投 A	22,430	77,383.50	0.11
387	000958	电投产融	11,900	76,993.00	0.11
388	600483	福能股份	8,100	76,707.00	0.11
389	000062	深圳华强	3,100	76,322.00	0.11
390	603000	人民网	4,000	76,200.00	0.11
391	601333	广深铁路	24,800	75,392.00	0.11
392	601918	新集能源	11,400	75,354.00	0.11
393	600517	国网英大	12,500	75,125.00	0.11
394	600578	京能电力	14,700	74,970.00	0.11
395	002439	启明星辰	5,300	74,836.00	0.11
396	002299	圣农发展	4,500	74,430.00	0.11
397	600739	辽宁成大	6,600	73,788.00	0.11
398	600655	豫园股份	14,300	73,359.00	0.11
399	603899	晨光股份	2,700	73,062.00	0.11

400	600808	马钢股份	17,300	73,006.00	0.11
401	600546	山煤国际	7,200	72,648.00	0.10
402	601118	海南橡胶	12,400	72,540.00	0.10
403	300601	康泰生物	4,900	72,373.00	0.10
404	603341	龙旗科技	1,700	71,842.00	0.10
405	002120	韵达股份	10,600	71,444.00	0.10
406	603688	石英股份	1,950	71,331.00	0.10
407	601866	中远海发	28,300	71,316.00	0.10
408	600566	济川药业	2,700	71,010.00	0.10
409	000951	中国重汽	4,200	70,980.00	0.10
410	688709	成都华微	1,543	70,962.57	0.10
411	300529	健帆生物	3,600	70,812.00	0.10
412	002670	国盛证券	4,201	70,744.84	0.10
413	600582	天地科技	12,000	69,960.00	0.10
414	000883	湖北能源	15,400	69,916.00	0.10
415	000709	河钢股份	30,200	69,762.00	0.10
416	688192	迪哲医药	1,208	69,580.80	0.10
417	600131	国网信通	4,300	69,402.00	0.10
418	601598	中国外运	11,400	69,084.00	0.10
419	600663	陆家嘴	8,700	68,817.00	0.10
420	000739	普洛药业	4,200	68,334.00	0.10
421	000967	盈峰环境	9,300	68,262.00	0.10
422	600707	彩虹股份	10,500	68,145.00	0.10
423	688363	华熙生物	1,556	67,966.08	0.10
424	000027	深圳能源	10,420	67,938.40	0.10
425	002508	老板电器	3,500	67,725.00	0.10
426	603833	欧派家居	1,300	67,717.00	0.10
427	688692	达梦数据	258	67,407.66	0.10
428	000088	盐 田 港	15,100	67,195.00	0.10
429	688336	三生国健	1,121	66,777.97	0.10
430	688172	燕东微	2,306	66,735.64	0.10
431	600528	中铁工业	8,100	66,258.00	0.10
432	002153	石基信息	6,030	65,304.90	0.09
433	301498	乖宝宠物	1,000	65,150.00	0.09
434	000582	北部湾港	6,900	64,722.00	0.09
435	600871	石化油服	29,600	63,936.00	0.09
436	688563	航材股份	1,091	63,768.95	0.09
437	600906	财达证券	9,400	62,698.00	0.09
438	600959	江苏有线	18,200	62,608.00	0.09
439	603858	步长制药	4,000	62,560.00	0.09
440	603565	中谷物流	6,200	62,248.00	0.09
441	300888	稳健医疗	1,640	62,057.60	0.09
442	300070	碧水源	15,800	61,936.00	0.09

443	002265	建设工业	2,300	61,686.00	0.09
444	688248	南网科技	1,369	61,249.06	0.09
445	688425	铁建重工	11,849	60,074.43	0.09
446	603233	大参林	3,388	59,696.56	0.09
447	601098	中南传媒	5,300	59,678.00	0.09
448	003022	联泓新科	3,000	59,430.00	0.09
449	300957	贝泰妮	1,500	59,415.00	0.09
450	301200	大族数控	500	59,385.00	0.09
451	601061	中信金属	4,100	59,040.00	0.09
452	600764	中国海防	2,100	57,414.00	0.08
453	002032	苏 泊 尔	1,300	57,304.00	0.08
454	600968	海油发展	14,700	56,448.00	0.08
455	603529	爱玛科技	1,900	56,430.00	0.08
456	601928	凤凰传媒	5,600	56,224.00	0.08
457	600062	华润双鹤	3,062	56,003.98	0.08
458	000959	首钢股份	11,400	55,860.00	0.08
459	688318	财富趋势	421	55,706.72	0.08
460	600295	鄂尔多斯	4,300	53,148.00	0.08
461	000785	居然智家	18,100	52,852.00	0.08
462	001286	陕西能源	5,513	51,326.03	0.07
463	600606	绿地控股	30,600	50,796.00	0.07
464	600098	广州发展	7,700	50,358.00	0.07
465	000537	绿发电力	6,100	50,081.00	0.07
466	688349	三一重能	1,981	50,079.68	0.07
467	601965	中国汽研	3,000	49,800.00	0.07
468	301301	川宁生物	4,900	49,686.00	0.07
469	603658	安图生物	1,400	49,588.00	0.07
470	600720	中交设计	6,800	49,096.00	0.07
471	688520	神州细胞	1,115	48,290.65	0.07
472	002372	伟星新材	4,610	48,082.30	0.07
473	688295	中复神鹰	1,454	47,705.74	0.07
474	688100	威胜信息	1,192	46,845.60	0.07
475	000429	粤高速 A	3,900	45,942.00	0.07
476	600688	上海石化	16,000	44,480.00	0.06
477	000898	鞍钢股份	17,500	44,275.00	0.06
478	601139	深圳燃气	6,400	42,240.00	0.06
479	000937	冀中能源	7,700	41,426.00	0.06
480	002608	江苏国信	5,576	41,206.64	0.06
481	600339	中油工程	12,100	40,535.00	0.06
482	600032	浙江新能	5,300	39,273.00	0.06
483	603049	中策橡胶	700	39,165.00	0.06
484	601019	山东出版	4,500	38,880.00	0.06
485	688475	萤石网络	1,272	38,299.92	0.06

486	003035	南网能源	8,300	38,014.00	0.05
487	688819	天能股份	1,100	36,542.00	0.05
488	601228	广州港	11,000	35,640.00	0.05
489	600927	永安期货	2,100	33,747.00	0.05
490	603707	健友股份	3,664	33,085.92	0.05
491	002945	华林证券	2,000	30,660.00	0.04
492	002461	珠江啤酒	3,300	30,657.00	0.04
493	300140	节能环境	4,448	30,112.96	0.04
494	000539	粤电力 A	6,592	29,136.64	0.04
495	600007	中国国贸	1,400	27,748.00	0.04
496	600299	安迪苏	3,000	26,910.00	0.04
497	001213	中铁特货	6,600	26,730.00	0.04
498	601921	浙版传媒	3,300	25,806.00	0.04
499	001221	悍高集团	300	17,373.00	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	400174	中天 3	41,300	4,543.00	0.01

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	603893	瑞芯微	656,055.00	1.03
2	688777	中控技术	454,785.05	0.71
3	688347	华虹公司	439,634.21	0.69
4	600988	赤峰黄金	424,185.00	0.67
5	603345	安井食品	421,309.00	0.66
6	688617	惠泰医疗	393,179.93	0.62
7	689009	九号公司	387,352.45	0.61
8	603605	珀莱雅	387,019.00	0.61
9	600536	中国软件	378,515.00	0.59
10	688122	西部超导	378,274.86	0.59
11	603486	科沃斯	360,111.00	0.57
12	688120	华海清科	357,473.59	0.56
13	603160	汇顶科技	351,963.00	0.55
14	600118	中国卫星	350,577.00	0.55
15	688235	百济神州	349,869.21	0.55
16	688608	恒玄科技	344,547.44	0.54
17	600363	联创光电	339,994.00	0.53
18	600580	卧龙电驱	338,778.60	0.53
19	600487	亨通光电	337,962.00	0.53
20	601555	东吴证券	320,375.00	0.50

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

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	300476	胜宏科技	1,156,470.00	1.82
2	603893	瑞芯微	988,184.00	1.55
3	600418	江淮汽车	855,481.46	1.34
4	688521	芯原股份	608,752.12	0.96
5	600839	四川长虹	558,236.00	0.88
6	688777	中控技术	501,993.52	0.79
7	000988	华工科技	497,403.72	0.78
8	600988	赤峰黄金	477,058.00	0.75
9	002625	光启技术	465,863.00	0.73
10	688617	惠泰医疗	460,772.00	0.72
11	603345	安井食品	444,942.00	0.70
12	600536	中国软件	444,086.00	0.70
13	688072	拓荆科技	427,611.93	0.67
14	603605	珀莱雅	425,239.00	0.67
15	600895	张江高科	422,842.00	0.66
16	688122	西部超导	412,862.14	0.65
17	689009	九号公司	395,695.87	0.62
18	603486	科沃斯	388,691.00	0.61
19	603160	汇顶科技	384,166.00	0.60
20	601555	东吴证券	384,151.00	0.60

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

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	61,379,162.15
卖出股票收入（成交）总额	64,384,559.08

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	6,000.09	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,000.09	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	118063	金 05 转债	60	6,000.09	0.01

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

本报告期内未出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或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	7,251.29
2	应收清算款	2,242,956.02
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	2,250,207.31

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中不存在流通受限的情况。

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	400174	中天 3	4,543.00	0.01	重大事项停牌

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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		中国银行股份有限公司-景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		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（%）
401	73,748.02	8,600,922.00	29.08	1,998,434.00	6.76	18,973,600.00	64.16

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	浙江瑗尔德投资管理有限公司－瑗尔德润禾 2 号私募证券投资基金	3,404,100.00	11.51
2	浙江瑗尔德投资管理有限公司－瑗尔德润鑫 9 号私募证券投资基金	2,000,000.00	6.76
3	中信建投证券股份有限公司	1,765,200.00	5.97
4	中信证券股份有限公司	868,722.00	2.94
5	简街香港有限公司－JSQB 有限公司（R）	344,100.00	1.16
6	秦琴	100,000.00	0.34
6	吴飞飞	100,000.00	0.34
8	BARCLAYS BANK PLC	89,000.00	0.30
9	梁勇	82,300.00	0.28
10	上海或然投资管理有限公司－或然赋益私募证券投资基金	82,000.00	0.28
-	景顺长城中证 500ETF 联接	18,973,600.00	64.16

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有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

1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

2、本期末基金的基金经理未持有本基金。

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

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
龚丽丽	公募基金	50~100
	私募资产管理计划	-
	合计	50~100

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 12 月 26 日）基金份额总额	512,572,956.00
本报告期期初基金份额总额	35,572,956.00
本报告期基金总申购份额	34,000,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	40,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	29,572,956.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，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

基金管理人重大人事变动：

本基金管理人于 2025 年 4 月 2 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任卫学文先生担任本公司副总经理。本基金管理人于 2025 年 5 月 30 日发布公告，因李进董事长任期届满，由本公司总经理康乐先生代为履行本公司董事长一职。本基金管理人于 2025 年 8 月 6 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任叶才先生担任本公司董事长。本基金管理人于 2025 年 8 月 15 日发布公告，经深圳市市场监督管理局核准，景顺长城基金管理有限公司法定代表人变更为叶才先生。有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

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，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 2 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 8,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金管理人受调查或处罚等情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金量的比例(%)	
中信证券股份有限公司	4	100,515,193.15	79.92	19,600.74	79.92	未变更
中国国际金融股份有限公司	1	25,248,528.08	20.08	4,925.42	20.08	未变更
长城证券股份有限公司	3	-	-	-	-	未变更
德邦证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
国盛证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国泰海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
华宝证券股份有限公司	-	-	-	-	-	本期报告退租 2 个
华福证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中信建投证券股份有限	2	-	-	-	-	未变更

公司						

注：1、基金管理人选择交易单元的标准为：交易单元所属券商财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强。

2、基金管理人选择交易单元参与证券交易的程序为：基金管理人定期对符合上述标准的券商进行测评，测评结果是决定后期使用各证券公司交易单元参与证券交易的依据。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券股份有限公司	20,934.24	23.94	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	20,770.21	23.75	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	10,161.11	11.62	-	-	-	-
国盛证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰海通	15,798.27	18.06	-	-	-	-

证券股份有限公司						
华宝证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	11,989.11	13.71	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	7,803.89	8.92	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于不法分子冒用景顺长城基金 APP 及员工名义进行非法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 3 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 22 日
3	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 22 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定报刊及	2025 年 1 月 24 日

	部分基金新增西部证券为一级交易商的公告	网站	
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江海证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 2 月 6 日
6	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 19 日
7	关于景顺长城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	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 19 日
8	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 19 日
9	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 21 日
10	景顺长城中证 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	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 21 日
11	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 28 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 28 日
13	景顺长城基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 31 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 2 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增甬兴证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 11 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新或完善身份信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 14 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 22 日
18	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 22 日
19	关于不法分子冒用景顺长城基金及股东方 APP 进行非法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 20 日
20	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 24 日
21	景顺长城中证 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	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 24 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于董事	中国证监会指定报刊及	2025 年 5 月 30 日

	长离任及总经理代行董事长职务的公告	网站	
23	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东莞证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 6 月 9 日
24	景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 7 月 1 日
25	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 7 月 21 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 7 月 21 日
27	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增西南证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 8 月 4 日
28	景顺长城基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 8 月 6 日
29	景顺长城基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 8 月 15 日
30	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 8 月 29 日
31	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 8 月 29 日
32	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 9 月 5 日
33	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增瑞银证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 9 月 8 日
34	景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 9 月 27 日
35	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 10 月 15 日
36	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 10 月 28 日
37	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 10 月 28 日
38	景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新或完善身份信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 10 月 31 日
39	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民生证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 12 月 16 日
40	景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 12 月 27 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
本基金的联接基金	1	20250101-20251231	26,225,900.00	804,900.00	8,057,200.00	18,973,600.00	64.16

产品特有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险：

1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

（1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

（2）如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

（3）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

（4）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

（5）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

（6）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

为降低投资者的理财成本，经与基金托管人协商一致，自 2025 年 3 月 21 日起，本基金指数使用费调整为基金管理人承担，并相应修订各基金基金合同有关内容。本次调整后，基金管理人旗下全部指数基金指数使用费均由基金管理人承担。详情请参阅本基金管理人于 2025 年 3 月 20 日发布的《关于景顺长城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、中国证监会准予景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；

2、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

4、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；

6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2026 年 3 月 27 日