嘉实沪深300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：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026年3月30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 03 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2025 年 01 月 01 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 6
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 8
3.3 其他指标 9
3.4 过去三年基金的利润分配情况 9

§4 管理人报告 9

4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 14
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 14

§5 托管人报告 14

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 14
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 18
7.3 净资产变动表 19
7.4 报表附注 21

§8 投资组合报告 53
8.1 期末基金资产组合情况 53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 54
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 55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 63
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
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 65
8.12 投资组合报告附注 65
§9 基金份额持有人信息 66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 66
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基金的情况 67
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 67
§10 开放式基金份额变动 67
§11 重大事件揭示 68
11.1 基金份额持有人大会决议 68
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 68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 68
11.4 基金投资策略的改变 68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 68
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 69
11.8 其他重大事件 79
§12 影响投资者决策的其他重要信息 80
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 80
§13 备查文件目录 80
13.1 备查文件目录 80
13.2 存放地点 81
13.3 查阅方式 81

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实沪深 300ETF
场内简称	沪深 300ETF 嘉实
基金主代码	159919
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 7 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
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	40,818,816,676.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012 年 5 月 28 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。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。对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭松	许俊
	联系电话	(010)65215588	010-66596688
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010)65215588	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100020	100818
法定代表人		经雷	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	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
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	11,061,989,630.20	4,315,610,706.60	-878,013,988.10
本期利润	36,123,207,366.22	25,475,565,737.03	-3,108,718,338.12
加权平均基金	0.8959	0.8276	-0.4666

份额本期利润			
本期加权平均净值利润率	20.58%	21.92%	-11.99%
本期基金份额净值增长率	20.77%	17.31%	-9.52%
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	100,971,816,935.67	67,103,695,797.82	14,028,401,285.39
期末可供分配基金份额利润	2.4737	1.7704	1.2099
期末基金资产净值	197,123,986,939.38	156,389,101,563.81	41,341,206,761.81
期末基金份额净值	4.8292	4.1260	3.5655
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	124.58%	85.96%	58.52%

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

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

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

3.2 基金净值表现

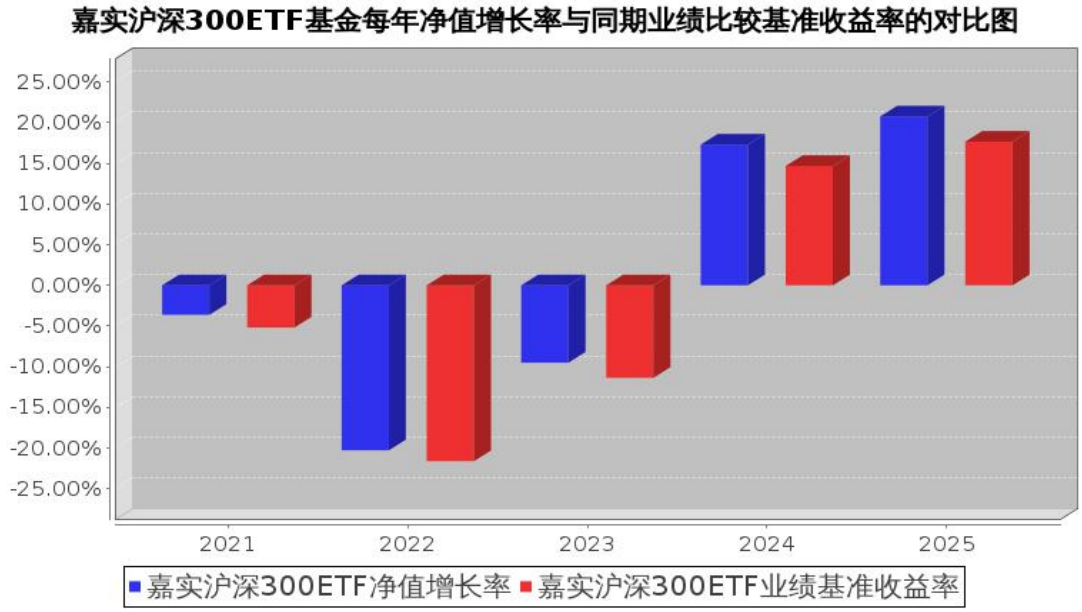
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.19%	0.95%	-0.23%	0.95%	0.42%	0.00%
过去六个月	19.24%	0.91%	17.63%	0.91%	1.61%	0.00%
过去一年	20.77%	0.96%	17.66%	0.96%	3.11%	0.00%
过去三年	28.18%	1.07%	19.59%	1.07%	8.59%	0.00%
过去五年	-1.53%	1.14%	-11.16%	1.14%	9.63%	0.00%
自基金合同生效起至今	124.58%	1.34%	70.48%	1.35%	54.10%	-0.01%

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：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 3 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2025 年	1.389	5,393,987,272.86	-	5,393,987,272.86	-
2024 年	0.453	1,664,811,969.60	-	1,664,811,969.60	-
合计	1.842	7,058,799,242.46	-	7,058,799,242.46	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 和特定资产管理业务等资格。

截止 2025 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 380 只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、不动产基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何如	本基金、嘉实沪深300ETF 联接(LOF)、嘉实中证500ETF 、嘉实中证500ETF 联接、嘉实国证通信ETF 发起联接、嘉实中证A50ETF 联接基金经理	2016 年 1 月 5 日	-	19 年	曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司(IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司(Franklin Templeton Investments Corp.)。2007 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。加拿大国籍。
刘珈吟	本基金、嘉实沪深300ETF 联接(LOF)、嘉实中证主要消费ETF、嘉实富时中国A50ETF 联接、嘉实富时中国A50ETF 、嘉实央企创新驱动ETF、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实中证主要消费ETF 发起联接、嘉实中证全指家用电器指数发	2021 年 9 月 24 日	-	16 年	2009 年加入嘉实基金管理有限公司，曾任指数投资部指数研究员。现任指数投资总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	起式、嘉实中证国新央企现代能源ETF、嘉实中证国新央企现代能源ETF联接、嘉实中证A500ETF、嘉实中证A500ETF联接基金经理				

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

（3）2026 年 1 月 14 日，本基金管理人发布《关于嘉实沪深 300ETF 基金经理变更的公告》，何如女士不再担任本基金基金经理，本基金将由刘珈吟女士单独管理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易、境外投资以及投资管理过程中各个相关环节应当符合公平交易的监管要求，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司严格执行《公平交易管理制度》，各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交

易部门集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 8 次，其中 2 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，另 6 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪沪深 300 指数，沪深 300 指数由上海和深圳证券市场中市值大、流动性好的 300 只股票组成，综合反映中国 A 股市场上市股票价格的整体表现。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

2025 年国内宏观经济在“破立并举”中呈现出前低后稳、结构优化的运行特征。尽管上半年“抢出口”效应消退及房地产市场的深度调整使经济基本面承压，但随着下半年“反内卷”政策的全面深化与落实，供给侧恶性竞争得到有效遏制，物价水平逐步回升，企业盈利预期改善。外贸方面，尽管“关税战 2.0”带来了显著的外部扰动，但得益于对非美市场的成功拓展，出口展现出极强韧性。随着年底重要会议对“十五五”规划方向的定调以及中美元首会晤带来的外部环境阶段性缓和，经济基本面在政策托底与结构转型的双轮驱动下，确立了企稳向好的长期趋势。

本报告期内，本基金日均跟踪偏离为 0.01%，年化跟踪误差为 0.40%，符合基金合同约定的年化跟踪误差不超过 2.00%的限制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 4.8292 元；本报告期基金份额净值增长率为 20.77%，业绩比较基准收益率为 17.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，国内权益市场在“十五五”开局之年有望在多重积极因素共振下延续结构性行情，核心驱动力将从估值修复转向盈利改善。宏观政策有望维持宽松，为市场提供支撑。全球货币政策趋向宽松、美元预期走弱，有望改善新兴市场流动性，吸引全球资金加大对中国资产的配置。同时，国内居民资产向权益市场迁移、险资等长期资金入市，将提供重要的增量流动性。

本基金作为一只投资于沪深 300 指数的被动投资管理产品，我们继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的沪深 300 指数的投资工具。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关监察稽核工作情况如下：

（1）继续内控前置。在基金营销、投资交易、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持新业务开展，对新产品、新投资工具等进行合规性判断。在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

（2）全流程动态开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，合规风控设置，建立禁限投库，合规培训，合规承诺书签署等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中实时监控等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、提供处理建议并督促改正。优化和升级合规风控系统，不断提高自动化　监控能力，保障各类组合合规运作，保护投资者利益。

（3）按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应合规检查报告及其后续改进跟踪。同时聘请并配合外部审计机构完成公司及基金的审计、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等项目。

（4）基金法务工作。包括合同、协议审查，主动发现并解决各项法律文件以及实务运作中存在的潜在法律风险隐患，重点防控新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

（5）加强差错管理，持续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识

别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表以及专题报告。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金实施了利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11　利润分配情况”。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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”）在嘉实沪深 300 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	容诚审字[2026]100Z0550 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	嘉实沪深 300 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	我们审计了嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“嘉实沪深 300ETF 基金”）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，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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，公允反映了嘉实沪深 300ETF 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职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于嘉实沪深 300ETF 基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	嘉实沪深 300ETF 基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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，基金管理人管理层负责评估嘉实沪深 300ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算嘉实沪深 300ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督嘉实沪深 300ETF 基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对嘉实沪深 300ETF 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嘉实沪深 300ETF 基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	蔡晓慧　　柴瀚英
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
审计报告日期	2026 年 3 月 26 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实沪深 300 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	1,030,754,672.97	1,539,549,108.91
结算备付金		312,162,463.92	217,110,135.32
存出保证金		137,044,911.00	217,154,485.79
交易性金融资产	7.4.7.2	195,887,249,511.90	154,610,657,457.86
其中：股票投资		195,887,249,511.90	154,610,657,457.86
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		54,945,509.44	46,007,828.29
应收股利		3,960,600.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		197,426,117,669.23	156,630,479,016.17
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		259,935,159.78	201,613,388.79
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		24,874,728.50	19,900,087.10
应付托管费		8,291,576.18	6,633,362.37
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7,143,774.29	561.24
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	1,885,491.10	13,230,052.86
负债合计		302,130,729.85	241,377,452.36
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	96,152,170,003.71	89,285,405,765.99
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	100,971,816,935.67	67,103,695,797.82
净资产合计		197,123,986,939.38	156,389,101,563.81
负债和净资产总计		197,426,117,669.23	156,630,479,016.17

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 4.8292 元，基金份额总额 40,818,816,676.00 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实沪深 300 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		36,488,204,249.69	26,143,584,794.07
1.利息收入		15,238,094.25	20,491,681.30
其中：存款利息收入	7.4.7.13	10,620,858.55	6,213,479.14
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		4,617,235.70	10,449,482.36
其他利息收入		-	3,828,719.80
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,482,973,832.46	4,947,293,645.02
其中：股票投资收益	7.4.7.14	6,070,632,743.72	1,512,579,686.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	5,606,626.73	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收	7.4.7.17	-	-

益			
衍生工具收益	7.4.7.18	593,313,818.36	3,623,350.96
股利收益	7.4.7.19	4,813,420,643.65	3,431,090,607.55
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	25,061,217,736.02	21,159,955,030.43
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	-71,225,413.04	15,844,437.32
减：二、营业总支出		364,996,883.47	668,019,057.04
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	262,862,523.82	524,196,140.99
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	7.4.10.2.2	87,620,841.30	108,163,200.25
3．销售服务费		-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7．税金及附加		2,138,137.09	149,983.24
8．其他费用	7.4.7.23	12,375,381.26	35,509,732.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		36,123,207,366.22	25,475,565,737.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		36,123,207,366.22	25,475,565,737.03
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		36,123,207,366.22	25,475,565,737.03

7.3 净资产变动表

会计主体：嘉实沪深 300 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	89,285,405,765.99	-	67,103,695,797.82	156,389,101,563.81
二、本期期初净	89,285,405,765	-	67,103,695,797	156,389,101,563

资产	.99		.82	.81
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	6,866,764,237.72	-	33,868,121,137.85	40,734,885,375.57
（一）、综合收益总额	-	-	36,123,207,366.22	36,123,207,366.22
（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）	6,866,764,237.72	-	3,138,901,044.49	10,005,665,282.21
其中：1.基金申购款	25,904,597,798.04	-	19,331,937,428.13	45,236,535,226.17
2.基金赎回款	-19,037,833,560.32	-	-16,193,036,383.64	-35,230,869,943.96
（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）	-	-	-5,393,987,272.86	-5,393,987,272.86
四、本期期末净资产	96,152,170,003.71	-	100,971,816,935.67	197,123,986,939.38

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	27,312,805,476.42	-	14,028,401,285.39	41,341,206,761.81
二、本期期初净资产	27,312,805,476.42	-	14,028,401,285.39	41,341,206,761.81
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	61,972,600,289.57	-	53,075,294,512.43	115,047,894,802.00
（一）、综合收益总额	-	-	25,475,565,737.03	25,475,565,737.03
（二）、本期基金份额交易产生的	61,972,600,289	-	29,264,540,745	91,237,141,034.

净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	.57		.00	57
其中：1.基金申购款	80,459,227,089.11	-	40,986,569,035.32	121,445,796,124.43
2.基金赎回款	-18,486,626,799.54	-	-11,722,028,290.32	-30,208,655,089.86
（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）	-	-	-1,664,811,969.60	-1,664,811,969.60
四、本期期末净资产	89,285,405,765.99	-	67,103,695,797.82	156,389,101,563.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷	梁凯	李袁
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]393 号《关于核准嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准，由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实沪深 300 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基金，存续期限不定。经向中国证监会备案，《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 19,333,307,392.00 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会

计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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。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。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、资产支持证券投资和基金投资，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)金融负债的分类

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。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和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、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

本基金持有的以公允价值计量的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同

时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算确认。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。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，

申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，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

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。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

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及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税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。

基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每份基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下，本基金

收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日(即收益评价日)的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值。本基金收益分配采取现金方式。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

无。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，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，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(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值

业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融　房地产开发　教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)　资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。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，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	1,030,754,672.97	1,539,549,108.91
等于：本金	1,030,657,268.47	1,539,475,114.74
加：应计利息	97,404.50	73,994.17
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-

存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	1,030,754,672.97	1,539,549,108.91

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		154,177,744,653.73	-	195,887,249,511.90	41,709,504,858.17
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		154,177,744,653.73	-	195,887,249,511.90	41,709,504,858.17
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		137,945,843,766.63	-	154,610,657,457.86	16,664,813,691.23
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		137,945,843,766.63	-	154,610,657,457.86	16,664,813,691.23

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,113,153,840.00	-	-	-
其中：股指期货投资	1,113,153,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,113,153,840.00	-	-	-

项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,650,443,809.08	-	-	-
其中：股指期货投资	1,650,443,809.08	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,650,443,809.08	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2603	IF2603	820.00	1,129,927,200.00	16,773,360.00
合计				16,773,360.00
减：可抵销期货暂收款				16,773,360.00
净额				0.00

注：衍生金融资产/负债项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度

下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产/负债项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	1,655,419.46	997,853.81
其中：交易所市场	1,655,419.46	997,853.81
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	188,000.00	188,000.00
应付指数使用费	-	12,005,274.38
其他	42,071.64	38,924.67
合计	1,885,491.10	13,230,052.86

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	37,903,716,676.00	89,285,405,765.99
本期申购	10,997,100,000.00	25,904,597,798.04
本期赎回（以“-”号填列）	-8,082,000,000.00	-19,037,833,560.32
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	40,818,816,676.00	96,152,170,003.71

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	144,746,019,435.55	-77,642,323,637.73	67,103,695,797.82
本期期初	144,746,019,435.55	-77,642,323,637.73	67,103,695,797.82
本期利润	11,061,989,630.20	25,061,217,736.02	36,123,207,366.22
本期基金份额交易产生的变动数	10,921,438,828.49	-7,782,537,784.00	3,138,901,044.49
其中：基金申购款	42,234,227,457.96	-22,902,290,029.83	19,331,937,428.13
基金赎回款	-31,312,788,629.47	15,119,752,245.83	-16,193,036,383.64
本期已分配利润	-5,393,987,272.86	-	-5,393,987,272.86

本期末	161,335,460,621.38	-60,363,643,685.71	100,971,816,935.67

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	7,300,873.82	1,974,505.21
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	3,296,156.65	3,980,314.19
其他	23,828.08	258,659.74
合计	10,620,858.55	6,213,479.14

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	3,992,554,324.88	1,043,619,091.29
股票投资收益——赎回差价收入	2,078,078,418.84	468,960,595.22
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	6,070,632,743.72	1,512,579,686.51

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 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	37,520,389,328.42	34,774,716,474.44
减：卖出股票成本总额	33,501,031,197.38	33,689,452,659.78
减：交易费用	26,803,806.16	41,644,723.37
买卖股票差价收入	3,992,554,324.88	1,043,619,091.29

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	上年度可比期间

	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
赎回基金份额对价总额	35,230,869,943.96	30,208,655,089.86
减：现金支付赎回款总额	22,717,564,286.96	19,491,077,764.86
减：赎回股票成本总额	10,435,227,238.16	10,248,616,729.78
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	2,078,078,418.84	468,960,595.22

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 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	2,469.20	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,604,157.53	-
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	5,606,626.73	-

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日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	35,317,914.01	-
减：卖出债券（债转股	29,709,800.00	-

及债券到期兑付）成本总额		
减：应计利息总额	2,543.21	-
减：交易费用	1,413.27	-
买卖债券差价收入	5,604,157.53	-

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

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
股指期货投资收益	593,313,818.36	3,623,350.96

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	4,813,420,643.65	3,431,090,607.55
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	4,813,420,643.65	3,431,090,607.55

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	25,044,691,166.94	21,157,845,299.51
股票投资	25,044,691,166.94	21,157,845,299.51
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	16,526,569.08	2,109,730.92
权证投资	-	-
期货投资	16,526,569.08	2,109,730.92
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	25,061,217,736.02	21,159,955,030.43

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	-71,230,067.72	15,827,017.04

其他	4,654.68	17,420.28
合计	-71,225,413.04	15,844,437.32

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	68,000.00	68,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	105,885.96	124,190.54
指数使用费	10,075,948.29	34,941,939.23
其他	2,005,547.01	255,602.79
合计	12,375,381.26	35,509,732.56

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司(“嘉实基金”)	基金管理人
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司(“嘉实资本”)	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司(“嘉实财富”)	基金管理人的控股子公司
嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)(“嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)”)	本基金的联接基金

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	262,862,523.82	524,196,140.99
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,663,145.46	195,894.37
应支付基金管理人的净管理费	261,199,378.36	524,000,246.62

注：1.支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%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×0.15%/当年天数。

2.根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	87,620,841.30	108,163,200.25

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：日托管费＝前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 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（%）
嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)	1,533,528,920.00	3.76	1,796,137,320.00	4.74

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

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
中国银行股份有限公司_活期	1,030,754,672.97	7,300,873.82	1,539,549,108.91	1,974,505.21

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

报告期末(2025 年 12 月 31 日)，本基金持有 110,971,129 股中国银行的 A 股普通股，估值总额为人民币 635,864,569.17 元，占基金资产净值的比例为 0.32%(2024 年 12 月 31 日：158,078,129

股，估值总额为人民币 871,010,490.79 元，占基金资产净值的比例为 0.56%)。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2025 年 3 月 28 日	2025 年 3 月 31 日	-	0.661	2,435,415,919.59	-	2,435,415,919.59	-
2	2025 年 12 月 05 日	2025 年 12 月 8 日	-	0.728	2,958,571,353.27	-	2,958,571,353.27	-
合计	-	-	-	1.389	5,393,987,272.86	-	5,393,987,272.86	-

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：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001280	中国铀业	2025 年 11 月 25 日	6 个月	新股锁定	17.89	45.36	2,277	40,735.53	103,284.72	-
001285	瑞立科密	2025 年 9 月 23 日	6 个月	新股锁定	42.28	56.08	137	5,792.36	7,682.96	-
001369	双欣环保	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定	6.85	12.89	897	6,144.45	11,562.33	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-

301449	天溯计量	2025年12月16日	6个月	新股锁定	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
301491	汉桑科技	2025年7月29日	6个月	新股锁定	28.91	55.11	245	7,082.95	13,501.95	-
301563	云汉芯城	2025年9月23日	6个月	新股锁定	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301638	南网数字	2025年11月11日	6个月	新股锁定	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	-
301667	纳百川	2025年12月10日	6个月	新股锁定	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
301668	昊创瑞通	2025年9月15日	6个月	新股锁定	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股锁定	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
603092	德力佳	2025年10月30日	6个月	新股锁定	46.68	55.66	146	6,815.28	8,126.36	-
603175	超颖电子	2025年10月17日	6个月	新股锁定	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603248	锡华科技	2025年12月16日	6个月	新股锁定	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
603262	技源集团	2025年7月16日	6个月	新股锁定	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-

603334	丰倍生物	2025年10月29日	6个月	新股锁定	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
603370	华新精科	2025年8月27日	6个月	新股锁定	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025年10月28日	6个月	新股锁定	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603406	天富龙	2025年7月30日	6个月	新股锁定	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
603418	友升股份	2025年9月16日	6个月	新股锁定	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	-
688727	恒坤新材	2025年11月11日	6个月	新股锁定	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-
688729	屹唐股份	2025年7月1日	6个月	新股锁定	8.45	24.28	3,505	29,617.25	85,101.40	-
688790	昂瑞微	2025年12月9日	9个月	新股锁定	83.06	117.07	2,319	192,616.14	271,485.33	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	9个月	新股锁定	114.28	416.02	10,828	1,237,423.84	4,504,664.56	-
688796	百奥赛图	2025年12月2日	6个月	新股锁定	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
688805	健信超导	2025年12月17日	6个月	新股锁定	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-

688807	优迅股份	2025年12月10日	6个月	新股锁定	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-
688809	强一股份	2025年12月23日	6个月	新股锁定	85.09	203.31	259	22,038.31	52,657.29	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

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
688012	中微公司	2025年12月19日	重大事项停牌	272.72	2026年1月5日	278.00	3,396,496	622,750,183.63	926,292,389.12	-
002049	紫光国微	2025年12月30日	重大事项停牌	78.81	2026年1月15日	86.69	5,249,921	348,575,848.42	413,746,274.01	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基

金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和风险管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允

价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,030,754,672.97	-	-	-	1,030,754,672.97
结算备付金	312,162,463.92	-	-	-	312,162,463.92
存出保证金	1,453,647.00	-	-	135,591,264.00	137,044,911.00
交易性金融资产	-	-	-	195,887,249,511.90	195,887,249,511.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	54,945,509.44	54,945,509.44
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	3,960,600.00	3,960,600.00
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,344,370,783.89	-	-	196,081,746,885.34	197,426,117,669.23
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	259,935,159.78	259,935,159.78

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	24,874,728.50	24,874,728.50
应付托管费	-	-	-	8,291,576.18	8,291,576.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	7,143,774.29	7,143,774.29
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,885,491.10	1,885,491.10
负债总计	-	-	-	302,130,729.85	302,130,729.85
利率敏感度缺口	1,344,370,783.89	-	-	195,779,616,155.49	197,123,986,939.38
上年度末 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	1,539,549,108.91	-	-	-	1,539,549,108.91
结算备付金	217,110,135.32	-	-	-	217,110,135.32
存出保证金	19,071,613.79	-	-	198,082,872.00	217,154,485.79
交易性金融资产	-	-	-	154,610,657,457.86	154,610,657,457.86
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	46,007,828.29	46,007,828.29
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,775,730,858.02	-	-	154,854,748,158.15	156,630,479,016.17
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	201,613,388.79	201,613,388.79
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	19,900,087.10	19,900,087.10
应付托管费	-	-	-	6,633,362.37	6,633,362.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	561.24	561.24
应付利润	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	13,230,052.86	13,230,052.86
负债总计	-	-	-	241,377,452.36	241,377,452.36
利率敏感度缺口	1,775,730,858.02	-	-	154,613,370,705.79	156,389,101,563.81

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 12 月 31 日）	上年度末 （2024 年 12 月 31 日 ）
	市场利率上升 25 个基点	-	-
	市场利率下降 25 个基点	-	-

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 12 月 31 日）	上年度末 （2024 年 12 月 31 日 ）
	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	195,887,249,511.90	99.37	154,610,657,457.86	98.86
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	195,887,249,511.90	99.37	154,610,657,457.86	98.86

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

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 12 月 31 日）	上年度末 （2024 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准上升 5%	9,861,736,105.22	7,810,605,747.39
	业绩比较基准下降	-9,861,736,105.22	-7,810,605,747.39

	5%		

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	194,541,962,530.51	154,360,430,004.62
第二层次	1,340,038,663.13	250,227,453.24
第三层次	5,248,318.26	-
合计	195,887,249,511.90	154,610,657,457.86

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，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 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	-	-	-

当期购买	-	1,635,015.15	1,635,015.15
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	-	3,613,303.11	3,613,303.11
其中：计入损益的利得或损失	-	3,613,303.11	3,613,303.11
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	5,248,318.26	5,248,318.26
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	-	3,613,303.11	3,613,303.11

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	-	3,383,270.11	3,383,270.11
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,732,917.82	2,732,917.82
当期利得或损失总额	-	-650,352.29	-650,352.29
其中：计入损益的利得或损失	-	-650,352.29	-650,352.29
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

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

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

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价	采用的估	不可观察输入值

	值	值技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	5,248,318.26	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.00%-295.88%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：无)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，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	195,887,249,511.90	99.22
	其中：股票	195,887,249,511.90	99.22
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	1,342,917,136.89	0.68
8	其他各项资产	195,951,020.44	0.10
9	合计	197,426,117,669.23	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,767,935,917.26	0.90
B	采矿业	11,551,475,166.71	5.86
C	制造业	108,677,081,108.21	55.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,599,509,341.69	2.84
E	建筑业	2,915,020,038.68	1.48
F	批发和零售业	422,487,279.05	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	5,770,956,719.90	2.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,877,189,873.32	4.50
J	金融业	44,829,519,397.54	22.74
K	房地产业	1,062,351,862.79	0.54
L	租赁和商务服务业	1,632,827,798.37	0.83
M	科学研究和技术服务业	2,192,627,622.38	1.11
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	396,751,352.94	0.20
R	文化、体育和娱乐业	186,163,614.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	195,881,897,092.84	99.37

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	103,284.72	0.00
C	制造业	5,072,154.51	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,705.90	0.00

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	32,995.62	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	25,177.51	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,248,318.26	0.00

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	300750	宁德时代	20,503,365	7,530,065,829.90	3.82
2	600519	贵州茅台	4,853,924	6,684,727,054.32	3.39
3	601318	中国平安	82,636,144	5,652,312,249.60	2.87
4	300308	中际旭创	8,616,370	5,255,985,700.00	2.67
5	601899	紫金矿业	127,681,680	4,401,187,509.60	2.23
6	600036	招商银行	95,948,489	4,039,431,386.90	2.05
7	300502	新易盛	7,706,292	3,320,487,096.96	1.68
8	000333	美的集团	38,170,100	2,982,993,315.00	1.51
9	601166	兴业银行	131,241,924	2,763,954,919.44	1.40
10	600900	长江电力	94,837,578	2,578,633,745.82	1.31
11	300059	东方财富	98,026,742	2,272,259,879.56	1.15
12	002475	立讯精密	39,523,184	2,241,359,764.64	1.14
13	688256	寒武纪	1,633,842	2,214,754,523.10	1.12
14	600030	中信证券	75,675,511	2,172,643,920.81	1.10

15	600276	恒瑞医药	34,626,166	2,062,680,708.62	1.05
16	002594	比亚迪	21,070,819	2,059,040,432.68	1.04
17	601398	工商银行	250,800,450	1,988,847,568.50	1.01
18	300274	阳光电源	11,251,977	1,924,538,146.08	0.98
19	601138	工业富联	30,795,345	1,910,851,157.25	0.97
20	688981	中芯国际	15,500,973	1,903,984,513.59	0.97
21	601211	国泰海通	87,585,613	1,799,884,347.15	0.91
22	603259	药明康德	19,172,940	1,737,835,281.60	0.88
23	601288	农业银行	222,727,997	1,710,551,016.96	0.87
24	688041	海光信息	7,208,627	1,617,687,985.07	0.82
25	000858	五 粮 液	15,045,236	1,593,892,301.84	0.81
26	002371	北方华创	3,357,147	1,541,199,044.76	0.78
27	601328	交通银行	206,817,046	1,499,423,583.50	0.76
28	600887	伊利股份	49,033,374	1,402,354,496.40	0.71
29	000651	格力电器	34,746,558	1,397,506,562.76	0.71
30	300476	胜宏科技	4,721,826	1,357,902,721.08	0.69
31	603993	洛阳钼业	67,677,358	1,353,547,160.00	0.69
32	600000	浦发银行	103,273,311	1,284,719,988.84	0.65
33	000725	京东方 A	284,610,271	1,198,209,240.91	0.61
34	600919	江苏银行	113,806,410	1,183,586,664.00	0.60
35	601816	京沪高铁	227,544,984	1,171,856,667.60	0.59
36	600150	中国船舶	35,002,418	1,164,180,422.68	0.59
37	600309	万华化学	14,560,490	1,116,498,373.20	0.57
38	601601	中国太保	26,530,733	1,111,903,020.03	0.56
39	603986	兆易创新	5,177,255	1,109,226,883.75	0.56
40	300124	汇川技术	14,648,197	1,103,448,680.01	0.56
41	002714	牧原股份	21,182,959	1,071,434,066.22	0.54
42	601688	华泰证券	45,319,573	1,069,088,727.07	0.54
43	688008	澜起科技	8,877,062	1,045,717,903.60	0.53
44	601088	中国神华	25,578,083	1,035,912,361.50	0.53
45	603019	中科曙光	11,354,566	972,405,032.24	0.49
46	600031	三一重工	45,985,070	971,664,529.10	0.49
47	002050	三花智控	17,317,011	957,803,878.41	0.49
48	000063	中兴通讯	24,993,601	945,757,861.84	0.48
49	688012	中微公司	3,396,496	926,292,389.12	0.47
50	601857	中国石油	87,854,206	914,562,284.46	0.46
51	600111	北方稀土	19,616,981	904,735,163.72	0.46
52	002230	科大讯飞	17,913,876	900,888,824.04	0.46
53	300760	迈瑞医疗	4,699,292	894,980,161.40	0.45
54	600089	特变电工	39,168,352	870,320,781.44	0.44
55	000001	平安银行	75,190,793	857,926,948.13	0.44
56	601012	隆基绿能	46,995,989	855,326,999.80	0.43
57	002415	海康威视	28,417,818	847,987,689.12	0.43

58	000425	徐工机械	72,864,701	843,773,237.58	0.43
59	002384	东山精密	9,938,900	841,327,885.00	0.43
60	603501	豪威集团	6,562,317	826,195,710.30	0.42
61	601668	中国建筑	160,155,132	821,595,827.16	0.42
62	600660	福耀玻璃	12,428,706	805,007,287.62	0.41
63	603799	华友钴业	11,769,187	803,364,704.62	0.41
64	601229	上海银行	77,102,859	778,738,875.90	0.40
65	601127	赛力斯	6,330,591	765,748,287.36	0.39
66	002463	沪电股份	10,435,920	762,552,674.40	0.39
67	600690	海尔智家	29,084,225	758,807,430.25	0.38
68	601728	中国电信	120,355,200	758,237,760.00	0.38
69	601600	中国铝业	61,448,765	750,903,908.30	0.38
70	002028	思源电气	4,827,127	746,225,562.93	0.38
71	601919	中远海控	48,875,238	741,926,112.84	0.38
72	600016	民生银行	192,428,778	737,002,219.74	0.37
73	300394	天孚通信	3,620,927	735,156,808.81	0.37
74	000100	TCL 科技	161,231,503	731,991,023.62	0.37
75	000338	潍柴动力	41,987,164	722,179,220.80	0.37
76	002142	宁波银行	25,589,681	718,814,139.29	0.36
77	601888	中国中免	7,576,104	716,396,394.24	0.36
78	002352	顺丰控股	18,596,980	712,636,273.60	0.36
79	600941	中国移动	7,009,461	708,306,034.05	0.36
80	600406	国电南瑞	31,131,824	699,843,403.52	0.36
81	600028	中国石化	112,956,359	698,070,298.62	0.35
82	300498	温氏股份	41,261,958	696,501,851.04	0.35
83	000792	盐湖股份	24,608,977	692,988,792.32	0.35
84	600183	生益科技	9,415,200	672,339,432.00	0.34
85	000568	泸州老窖	5,705,311	663,071,244.42	0.34
86	600809	山西汾酒	3,786,838	650,200,084.60	0.33
87	601766	中国中车	94,293,166	643,079,392.12	0.33
88	601225	陕西煤业	30,061,363	640,908,259.16	0.33
89	601988	中国银行	110,971,129	635,864,569.17	0.32
90	300014	亿纬锂能	9,646,748	634,370,148.48	0.32
91	601169	北京银行	114,734,891	628,747,202.68	0.32
92	600050	中国联通	121,179,222	619,225,824.42	0.31
93	601939	建设银行	65,682,959	609,537,859.52	0.31
94	600926	杭州银行	39,335,126	601,040,725.28	0.30
95	601628	中国人寿	12,913,561	587,567,025.50	0.30
96	002027	分众传媒	78,349,699	577,437,281.63	0.29
97	002625	光启技术	11,701,197	570,550,365.72	0.29
98	600938	中国海油	18,542,600	559,615,668.00	0.28
99	002241	歌尔股份	19,240,134	552,769,049.82	0.28
100	601985	中国核电	63,776,600	551,667,590.00	0.28

101	688111	金山办公	1,794,665	551,087,781.55	0.28
102	002460	赣锋锂业	8,753,744	550,522,960.16	0.28
103	601009	南京银行	47,920,081	547,726,525.83	0.28
104	600104	上汽集团	35,643,957	542,501,025.54	0.28
105	600547	山东黄金	14,009,469	542,306,544.99	0.28
106	300033	同花顺	1,666,405	536,882,362.90	0.27
107	000977	浪潮信息	7,974,786	531,120,747.60	0.27
108	000807	云铝股份	16,129,329	529,687,164.36	0.27
109	600489	中金黄金	22,545,540	526,663,814.40	0.27
110	601689	拓普集团	6,735,393	519,837,631.74	0.26
111	000408	藏格矿业	6,086,380	513,690,472.00	0.26
112	002709	天赐材料	11,036,732	511,331,793.56	0.26
113	600019	宝钢股份	67,541,021	503,180,606.45	0.26
114	000776	广发证券	22,844,848	503,043,552.96	0.26
115	601818	光大银行	143,896,309	502,198,118.41	0.25
116	601006	大秦铁路	93,707,025	483,528,249.00	0.25
117	688271	联影医疗	3,835,804	481,393,402.00	0.24
118	002916	深南电路	2,066,667	480,066,077.43	0.24
119	603288	海天味业	12,931,340	478,718,206.80	0.24
120	600999	招商证券	28,767,785	478,695,942.40	0.24
121	300408	三环集团	10,399,742	475,788,196.50	0.24
122	300433	蓝思科技	15,450,462	467,685,484.74	0.24
123	601658	邮储银行	85,474,500	465,836,025.00	0.24
124	601100	恒立液压	4,157,427	456,942,801.57	0.23
125	000625	长安汽车	38,456,119	456,089,571.34	0.23
126	600905	三峡能源	110,803,738	453,187,288.42	0.23
127	601336	新华保险	6,466,882	450,741,675.40	0.23
128	002466	天齐锂业	8,014,442	443,839,797.96	0.23
129	600958	东方证券	40,531,869	441,797,372.10	0.22
130	600362	江西铜业	8,043,214	441,733,312.88	0.22
131	002600	领益智造	28,317,634	440,056,032.36	0.22
132	605499	东鹏饮料	1,611,864	430,996,314.96	0.22
133	600438	通威股份	20,938,840	429,664,996.80	0.22
134	601390	中国中铁	79,393,862	429,520,793.42	0.22
135	600010	包钢股份	175,536,375	417,776,572.50	0.21
136	601825	沪农商行	44,857,600	416,727,104.00	0.21
137	002049	紫光国微	5,249,921	413,746,274.01	0.21
138	600893	航发动力	10,332,018	413,590,680.54	0.21
139	600584	长电科技	11,097,639	408,171,162.42	0.21
140	600585	海螺水泥	18,603,340	406,669,012.40	0.21
141	600160	巨化股份	10,464,415	402,042,824.30	0.20
142	601377	兴业证券	53,556,046	397,385,861.32	0.20
143	300015	爱尔眼科	36,134,003	396,751,352.94	0.20

144	600115	中国东航	65,987,400	395,924,400.00	0.20
145	600436	片仔癀	2,339,635	394,883,595.30	0.20
146	000538	云南白药	6,925,998	393,119,646.48	0.20
147	600522	中天科技	21,165,025	383,510,253.00	0.19
148	000938	紫光股份	15,519,859	381,788,531.40	0.19
149	000630	铜陵有色	62,364,859	374,812,802.59	0.19
150	600760	中航沈飞	6,593,795	370,241,589.25	0.19
151	600346	恒力石化	16,369,434	368,803,348.02	0.19
152	000166	申万宏源	69,889,991	368,320,252.57	0.19
153	300803	指南针	2,791,861	365,370,849.07	0.19
154	600426	华鲁恒升	11,520,639	362,093,683.77	0.18
155	002311	海大集团	6,448,922	357,141,300.36	0.18
156	601916	浙商银行	116,907,100	355,397,584.00	0.18
157	600570	恒生电子	11,745,921	354,139,518.15	0.18
158	002179	中航光电	9,852,139	349,159,806.16	0.18
159	600795	国电电力	69,130,375	348,417,090.00	0.18
160	601669	中国电建	66,767,477	347,190,880.40	0.18
161	600048	保利发展	55,676,655	339,627,595.50	0.17
162	600015	华夏银行	49,348,289	339,022,745.43	0.17
163	600415	小商品城	21,253,550	338,994,122.50	0.17
164	600066	宇通客车	10,297,700	336,734,790.00	0.17
165	600989	宝丰能源	17,053,900	334,768,057.00	0.17
166	600029	南方航空	41,788,987	334,729,785.87	0.17
167	300442	润泽科技	6,333,396	334,403,308.80	0.17
168	000157	中联重科	38,493,236	332,196,626.68	0.17
169	601058	赛轮轮胎	20,390,600	329,919,908.00	0.17
170	002074	国轩高科	8,393,841	328,283,121.51	0.17
171	688126	沪硅产业	14,858,842	321,545,340.88	0.16
172	600176	中国巨石	18,619,294	318,389,927.40	0.16
173	601838	成都银行	19,713,969	317,789,180.28	0.16
174	601995	中金公司	9,066,000	317,310,000.00	0.16
175	601998	中信银行	41,078,913	316,307,630.10	0.16
176	600009	上海机场	9,644,694	315,960,175.44	0.16
177	000975	山金国际	12,914,441	314,208,349.53	0.16
178	002736	国信证券	23,810,218	312,390,060.16	0.16
179	601360	三六零	27,129,890	303,040,871.30	0.15
180	002001	新 和 成	11,906,505	299,924,860.95	0.15
181	688036	传音控股	4,464,255	295,355,110.80	0.15
182	603893	瑞芯微	1,630,878	290,752,929.84	0.15
183	600219	南山铝业	54,016,800	290,610,384.00	0.15
184	002236	大华股份	15,283,706	289,473,391.64	0.15
185	603296	华勤技术	3,156,912	286,458,194.88	0.15
186	300418	昆仑万维	6,812,516	284,081,917.20	0.14

187	002304	洋河股份	4,670,966	283,714,474.84	0.14
188	002920	德赛西威	2,313,339	278,294,681.70	0.14
189	601186	中国铁建	35,668,644	273,578,499.48	0.14
190	000768	中航西飞	10,778,493	273,558,152.34	0.14
191	002938	鹏鼎控股	5,388,988	272,575,013.04	0.14
192	601111	中国国航	29,053,447	272,230,798.39	0.14
193	002493	荣盛石化	23,230,126	272,024,775.46	0.14
194	601066	中信建投	10,071,066	269,602,436.82	0.14
195	000963	华东医药	6,798,889	268,216,171.05	0.14
196	601788	光大证券	15,142,558	265,751,892.90	0.13
197	601077	渝农商行	41,133,200	265,720,472.00	0.13
198	601881	中国银河	16,844,700	264,798,684.00	0.13
199	600196	复星医药	9,853,541	261,020,301.09	0.13
200	002252	上海莱士	41,137,535	260,811,971.90	0.13
201	600460	士兰微	9,029,788	256,536,277.08	0.13
202	002422	科伦药业	8,670,865	254,489,887.75	0.13
203	600011	华能国际	34,100,700	254,391,222.00	0.13
204	002601	龙佰集团	12,937,247	253,311,296.26	0.13
205	600372	中航机载	18,755,473	251,698,447.66	0.13
206	601901	方正证券	31,907,319	248,877,088.20	0.13
207	301236	软通动力	5,171,056	245,263,186.08	0.12
208	000002	万　　科A	52,730,261	245,195,713.65	0.12
209	600741	华域汽车	12,219,334	244,386,680.00	0.12
210	688169	石头科技	1,606,321	244,257,171.26	0.12
211	600886	国投电力	18,615,122	244,230,400.64	0.12
212	605117	德业股份	2,823,867	243,417,335.40	0.12
213	001979	招商蛇口	27,950,976	241,496,432.64	0.12
214	300782	卓胜微	2,911,151	237,200,583.48	0.12
215	601868	中国能建	100,554,100	236,302,135.00	0.12
216	600515	海南机场	44,283,700	236,032,121.00	0.12
217	000661	长春高新	2,540,247	235,099,859.85	0.12
218	601698	中国卫通	6,546,118	233,892,796.14	0.12
219	601877	正泰电器	8,329,044	232,297,037.16	0.12
220	002648	卫星化学	13,056,411	230,837,346.48	0.12
221	300661	圣邦股份	3,356,653	230,400,661.92	0.12
222	601878	浙商证券	21,272,989	229,961,011.09	0.12
223	600875	东方电气	9,458,500	229,652,380.00	0.12
224	003816	中国广核	60,988,850	229,318,076.00	0.12
225	300759	康龙化成	8,011,666	227,771,664.38	0.12
226	601800	中国交建	27,572,423	227,196,765.52	0.12
227	300347	泰格医药	4,003,892	227,020,676.40	0.12
228	601021	春秋航空	3,791,744	225,608,768.00	0.11
229	601872	招商轮船	25,036,564	224,828,344.72	0.11

230	000301	东方盛虹	20,498,686	223,230,690.54	0.11
231	601319	中国人保	24,773,000	221,718,350.00	0.11
232	601633	长城汽车	9,673,123	218,902,773.49	0.11
233	600233	圆通速递	13,265,500	217,819,510.00	0.11
234	688396	华润微	4,118,786	217,719,027.96	0.11
235	601117	中国化学	28,404,300	213,884,379.00	0.11
236	000895	双汇发展	8,056,005	213,242,452.35	0.11
237	600588	用友网络	15,892,301	210,731,911.26	0.11
238	600674	川投能源	15,115,424	210,104,393.60	0.11
239	688506	百利天恒	639,899	206,751,366.90	0.10
240	688047	龙芯中科	1,553,741	205,264,723.51	0.10
241	603369	今世缘	5,799,374	201,702,227.72	0.10
242	600039	四川路桥	20,235,220	201,340,439.00	0.10
243	000786	北新建材	7,916,768	197,681,696.96	0.10
244	300866	安克创新	1,661,887	190,103,253.93	0.10
245	000617	中油资本	19,596,401	188,125,449.60	0.10
246	300316	晶盛机电	5,075,526	186,525,580.50	0.09
247	300251	光线传媒	11,365,300	186,163,614.00	0.09
248	600188	兖矿能源	13,865,025	182,325,078.75	0.09
249	302132	中航成飞	2,290,249	180,929,671.00	0.09
250	600482	中国动力	8,734,491	180,803,963.70	0.09
251	301269	华大九天	1,690,617	179,763,305.61	0.09
252	601898	中煤能源	14,189,177	176,513,361.88	0.09
253	002459	晶澳科技	15,394,268	176,264,368.60	0.09
254	300122	智飞生物	9,275,206	175,023,137.22	0.09
255	688223	晶科能源	31,023,591	174,973,053.24	0.09
256	300832	新产业	3,053,229	171,744,131.25	0.09
257	600085	同仁堂	5,315,956	171,492,740.56	0.09
258	688472	阿特斯	11,435,679	170,505,973.89	0.09
259	600600	青岛啤酒	2,757,944	168,786,172.80	0.09
260	000596	古井贡酒	1,266,458	167,932,330.80	0.09
261	300896	爱美客	1,172,376	166,149,126.72	0.08
262	601618	中国中冶	55,357,010	164,410,319.70	0.08
263	000876	新 希 望	17,449,574	160,885,072.28	0.08
264	600918	中泰证券	24,553,380	159,596,970.00	0.08
265	001965	招商公路	15,797,168	159,235,453.44	0.08
266	600023	浙能电力	31,182,800	154,354,860.00	0.08
267	601607	上海医药	8,637,800	154,271,108.00	0.08
268	600027	华电国际	30,680,300	152,174,288.00	0.08
269	600061	国投资本	19,826,730	151,674,484.50	0.08
270	600026	中远海能	12,927,500	150,993,200.00	0.08
271	600803	新奥股份	7,201,900	149,511,444.00	0.08
272	000999	华润三九	5,159,271	146,832,852.66	0.07

273	603260	合盛硅业	2,758,667	145,381,750.90	0.07
274	600930	华电新能	22,635,569	142,377,729.01	0.07
275	300413	芒果超媒	5,800,528	141,648,893.76	0.07
276	000983	山西焦煤	21,995,785	141,212,939.70	0.07
277	601238	广汽集团	17,170,965	140,115,074.40	0.07
278	300628	亿联网络	3,927,328	140,009,243.20	0.07
279	600845	宝信软件	6,657,654	137,880,014.34	0.07
280	688303	大全能源	5,010,326	134,376,943.32	0.07
281	601059	信达证券	7,541,400	133,558,194.00	0.07
282	300999	金龙鱼	4,622,928	132,862,950.72	0.07
283	603392	万泰生物	2,950,559	132,598,121.46	0.07
284	600025	华能水电	14,442,865	131,141,214.20	0.07
285	688082	盛美上海	740,663	130,393,721.15	0.07
286	000708	中信特钢	7,818,040	127,981,314.80	0.06
287	600161	天坛生物	7,663,763	125,225,887.42	0.06
288	601456	国联民生	12,180,752	123,878,247.84	0.06
289	600018	上港集团	21,656,650	117,379,043.00	0.06
290	688009	中国通号	20,049,370	109,670,053.90	0.06
291	601018	宁波港	30,161,300	109,485,519.00	0.06
292	688187	时代电气	2,021,289	103,671,912.81	0.05
293	601236	红塔证券	10,969,711	89,841,933.09	0.05
294	603195	公牛集团	2,115,723	86,384,970.09	0.04
295	601136	首创证券	4,237,600	79,624,504.00	0.04
296	300979	华利集团	1,357,360	68,153,045.60	0.03
297	601808	中海油服	4,589,853	64,441,536.12	0.03
298	600377	宁沪高速	3,845,100	46,564,161.00	0.02
299	601298	青岛港	5,450,500	45,457,170.00	0.02
300	001391	国货航	7,566,400	44,793,088.00	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

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	688795	摩尔线程	10,828	4,504,664.56	0.00
2	688790	昂瑞微	2,319	271,485.33	0.00
3	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.00
4	688729	屹唐股份	3,505	85,101.40	0.00
5	688809	强一股份	259	52,657.29	0.00
6	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.00
7	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
8	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
9	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
10	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
11	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
12	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00

13	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
14	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
15	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
16	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
17	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
18	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
19	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
20	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
21	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
22	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
23	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
24	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
25	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
26	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
27	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
28	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,960,056,689.75	1.25
2	300476	胜宏科技	1,415,984,693.07	0.91
3	601211	国泰海通	1,290,303,761.80	0.83
4	601318	中国平安	1,222,040,886.49	0.78
5	600036	招商银行	1,116,116,551.31	0.71
6	601166	兴业银行	1,082,724,855.11	0.69
7	300308	中际旭创	947,608,211.11	0.61
8	600150	中国船舶	885,814,794.07	0.57
9	002384	东山精密	802,346,236.06	0.51
10	600900	长江电力	766,863,305.52	0.49
11	601899	紫金矿业	699,635,838.69	0.45
12	002625	光启技术	605,672,695.09	0.39
13	601328	交通银行	599,841,679.72	0.38
14	688012	中微公司	588,384,089.45	0.38
15	601398	工商银行	563,158,862.70	0.36
16	600030	中信证券	554,979,379.84	0.35
17	600276	恒瑞医药	518,283,868.03	0.33
18	601825	沪农商行	506,036,953.99	0.32
19	688271	联影医疗	485,138,313.40	0.31
20	688981	中芯国际	476,131,755.57	0.30

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,720,516,606.28	1.10
2	601318	中国平安	1,203,115,828.43	0.77
3	600036	招商银行	1,026,026,691.77	0.66
4	600837	海通证券	823,906,542.22	0.53
5	601899	紫金矿业	700,727,105.70	0.45
6	601398	工商银行	686,499,540.03	0.44
7	600900	长江电力	679,873,336.62	0.43
8	601288	农业银行	598,802,586.13	0.38
9	601166	兴业银行	597,353,520.45	0.38
10	688012	中微公司	577,858,917.14	0.37
11	601988	中国银行	554,564,948.70	0.35
12	601989	中国重工	523,329,587.08	0.33
13	600030	中信证券	522,150,516.87	0.33
14	600276	恒瑞医药	488,189,238.16	0.31
15	688981	中芯国际	444,958,562.71	0.28
16	688041	海光信息	394,120,689.48	0.25
17	688271	联影医疗	388,075,149.66	0.25
18	603259	药明康德	388,038,698.24	0.25
19	601328	交通银行	360,850,168.34	0.23
20	601211	国泰海通	357,740,634.08	0.23

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	44,634,998,101.01
卖出股票收入（成交）总额	37,520,389,328.42

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。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，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，目的在于满足基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，招商银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	137,044,911.00
2	应收清算款	54,945,509.44
3	应收股利	3,960,600.00
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	195,951,020.44

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688795	摩尔线程	4,504,664.56	0.00	新股锁定
2	688790	昂瑞微	271,485.33	0.00	新股锁定
3	001280	中国铀业	103,284.72	0.00	新股锁定
4	688729	屹唐股份	85,101.40	0.00	新股锁定
5	688809	强一股份	52,657.29	0.00	新股锁定

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
83,666	487,878.19	39,774,074,879.00	97.44	1,044,741,797.00	2.56

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）	1,533,528,920.00	3.76

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	中央汇金投资有限责任公司	19,543,686,916.00	47.88
2	中央汇金资产管理有限责任公司	15,954,808,069.00	39.09
3	友邦人寿保险有限公司－传统	373,973,237.00	0.92

4	大家人寿保险股份有限公司－万能产品	169,477,215.00	0.42
5	北京诚旸投资有限公司－诚旸灵活配置私募证券投资基金	157,519,700.00	0.39
6	北京诚通金控投资有限公司	124,001,926.00	0.30
7	中国平安人寿保险股份有限公司－自有资金	114,615,500.00	0.28
8	大家人寿保险股份有限公司－传统产品	113,679,400.00	0.28
9	中国平安人寿保险股份有限公司－分红－个险分红	105,846,902.00	0.26
10	友邦人寿保险有限公司－分红	86,447,445.00	0.21
11	嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	1,533,528,920.00	3.76

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	17,000.00	0.00

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 5 月 7 日）基金份额总额	19,333,307,392.00
本报告期期初基金份额总额	37,903,716,676.00
本报告期基金总申购份额	10,997,100,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	8,082,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	40,818,816,676.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动情况

2025 年 5 月 22 日本基金管理人发布公告，刘伟先生任公司首席信息官、杨竞霜先生离任公司副总经理、首席信息官。

2025 年 7 月 5 日本基金管理人发布公告，李明先生离任财务负责人，经雷先生任财务负责人（兼）。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，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

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付容诚会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 68,000.00 元，该审计机构已连续 2 年为本基金提供审计服务。

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

管理人受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 3 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京证监局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正并暂停受理固定收益类公募基金产品注册 3 个月
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作、公司治理
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资

	基金信息披露管理办法》、《基金管理公司子公司管理规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	截至报告期末，公司已从加强制度建设、完善流程机制、优化系统功能、加强人员培训等方面完成整改，并向北京证监局提交了整改完成情况报告。
其他	-

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，基金管理人相关从业人员无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	占当期佣金总量的比例(%)	
国泰海通证券股份有限公司	7	18,043,552,810.92	22.67	1,372,522.32	38.32	-
中信证券股份有限公司	8	12,562,453,487.42	15.78	451,047.03	12.59	-
方正证券股份有限公司	5	11,778,492,865.56	14.80	422,853.02	11.80	-
国信证券股份有限公司	1	10,196,906,914.23	12.81	366,107.30	10.22	-
招商证券股份有限公司	2	7,741,474,312.57	9.73	277,948.01	7.76	-
平安证券股份有限公司	4	7,007,195,879.15	8.80	251,550.52	7.02	-
广发证券股份有限公司	6	4,782,597,032.33	6.01	171,716.84	4.79	-
华泰证券	6	4,289,369,44	5.39	154,045.02	4.30	-

股份有限公司		2.26				
中信建投证券股份有限公司	4	1,795,018,880.90	2.26	64,446.31	1.80	-
光大证券股份有限公司	2	888,437,521.93	1.12	31,892.36	0.89	-
中国银河证券股份有限公司	3	499,415,391.43	0.63	17,930.80	0.50	-
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
诚通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-

东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
高盛高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国新证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
华福证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华林证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华龙证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
联储证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	4	-	-	-	-	-
山西证券股份有限	2	-	-	-	-	-

公司						
申万宏源证券有限公司	3	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
天府证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
万联证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
野村东方国际证券有限公司	2	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
粤开证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	5	-	-	-	-	-
中国中金	1	-	-	-	-	-

财富证券有限公司						
中航证券有限公司	2	-	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	5	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中邮证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-

注：1.本表"佣金"指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2.交易单元的选择标准和程序

（1）经营行为规范；

（2）财务状况良好；

（3）合规风控能力较强；

（4）交易服务能力较强。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3.国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日完成吸收合并海通证券股份有限公司，并自 2025 年 4 月 3 日起更名为国泰海通证券股份有限公司。上表中列示的国泰海通证券股份有限公司相关数据包含了被合并后的海通证券股份有限公司相关数据。华福证券有限责任公司更名为华福证券股份有限公司。宏信证券有限责任公司更名为天府证券有限责任公司。

4.报告期内，本基金退租以下交易单元：德邦证券股份有限公司退租交易单元 2 个。东兴证券股份有限公司退租交易单元 1 个。方正证券股份有限公司退租交易单元 3 个。华宝证券股份有限公司退租交易单元 1 个。华福证券股份有限公司退租交易单元 1 个。瑞银证券有限责任公司退租交易单元 2 个。英大证券有限责任公司退租交易单元 1 个。长城证券股份有限公司退租交易单元 2 个。

5.报告期内，本基金新增以下交易单元：瑞银证券有限责任公司新增交易单元 2 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国泰海通证券股份有限公司	-	-	1,500,000,000.00	2.44	-	-
中信证券股份有限公司	22,672.64	0.06	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	44,200,000,000.00	71.75	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	15,900,000,000.00	25.81	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	10,165,628.59	28.78	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	25,129,612.78	71.15	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证	-	-	-	-	-	-

券股份有限公司						
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
诚通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
高盛高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国新证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华福证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华林证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华龙证券股份有限公	-	-	-	-	-	-

司						
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
联储证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天府证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
万联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公	-	-	-	-	-	-

司						
湘财证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券有限公司	-	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
粤开证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中邮证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实基金管理有限公司关于调整证券投资基金主流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 1 月 23 日
2	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 2 月 28 日
3	嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第一次收益分配公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 15 日
4	关于嘉实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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 19 日
5	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 5 月 22 日
6	嘉实基金管理有限公司关于调整证券投资基金主流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 6 月 25 日
7	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 6 月 30 日
8	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 7 月 5 日
9	关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 8 月 1 日
10	嘉实基金管理有限公司关于调整证券投资基金主流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 9 月 24 日

11	关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金调整收益分配数额的确定原则并相应修订基金合同的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 10 月 15 日
12	嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第二次收益分配公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 11 月 22 日
13	关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 12 月 16 日
14	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 12 月 31 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（%）
机构	1	2025-01-01 至 2025-12-31	19,543,686,916.00	-	-	19,543,686,916.00	47.88
	2	2025-01-01 至 2025-12-31	10,297,802,662.00	5,657,005,407.00	-	15,954,808,069.00	39.09
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

注：申购份额包括申购、转换转入、红利再投或份额拆分等导致增加的份额，赎回份额包括赎回、转换转出或份额合并等导致减少的份额。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

（1）中国证监会批准嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；

（2）《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

（3）《嘉实沪深 300 交易型开放式指数投资基金招募说明书》；

（4）《嘉实沪深 300 交易型开放式指数投资基金基金托管协议》；

（5）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（6）报告期内嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

13.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

13.3 查阅方式

（1）书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

（2）网站查询：基金管理人网址：http://www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2026 年 3 月 30 日