

嘉实中证 A500 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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	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合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
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合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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真实、准确和完整发表意见	14
§ 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	16
7.1 资产负债表	16
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	53
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	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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	68
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	68
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	69
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	69
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
8.12 投资组合报告附注	69
§ 9 基金份额持有人信息	70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
9.2 期末上市基金前十名持有人	70
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
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	71
§ 10 开放式基金份额变动	71
§ 11 重大事件揭示	71
11.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	73
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	75
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	75
§ 13 备查文件目录	75
13.1 备查文件目录	75
13.2 存放地点	75
13.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中证 A500ETF
场内简称	A500ETF 嘉实
基金主代码	159351
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 9 月 20 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,798,123,357.00 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	2024 年 10 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争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%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，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。但因特殊情况（如流动性原因等）导致无法完全投资于标的指数成份股时，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。 具体投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭松
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95561
传真	(010)65215588	021-62159217

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	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
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	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	100020	200120
法定代表人	经雷	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.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 9 月 20 日（基金合同生效日） -2024 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,388,371,514.05	22,733,291.14
本期利润	2,804,056,988.40	-223,432,887.28
加权平均基金份额本期利润	0.2219	-0.0308
本期加权平均净值利润率	21.51%	-3.11%
本期基金份额净值增长率	25.06%	-2.32%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末
期末可供分配利润	1,116,988,220.21	-304,186,245.91
期末可供分配基金份额利润	0.1270	-0.0232
期末基金资产净值	10,589,064,926.25	12,834,937,111.09

期末基金份额净值	1.2036	0.9768
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末
基金份额累计净值增长率	22.16%	-2.32%

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）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	0.78%	1.06%	0.43%	1.05%	0.35%	0.01%
过去六个月	23.06%	1.00%	21.86%	1.00%	1.20%	0.00%
过去一年	25.06%	1.05%	22.43%	1.05%	2.63%	0.00%
自基金合同生效起至今	22.16%	1.16%	51.84%	1.39%	-29.68%	-0.23%

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

嘉实中证A500ETF份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2024年09月20日至2025年12月31日)

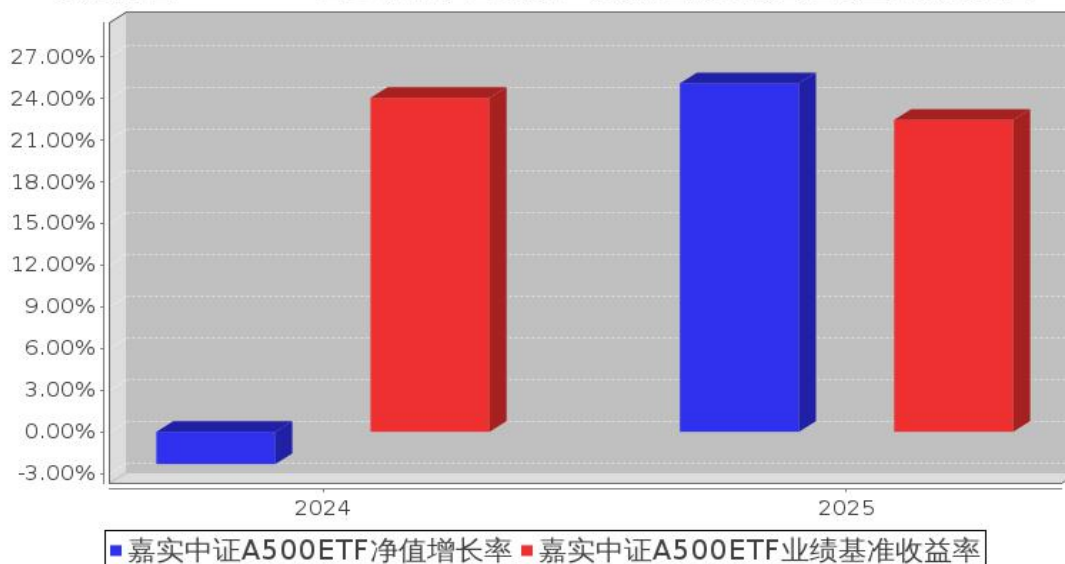


注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期，建仓期结束

时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

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

嘉实中证A500ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



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	0.1590	191,055,447.09	-	191,055,447.09	-
合计	0.1590	191,055,447.09	-	191,055,447.09	-

§ 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		
刘珈吟	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实沪深300ETF、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联接基金	2024年9月20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。

	经理				
张超梁	本基金、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实中证信息安全主题ETF、嘉实中证高端装备细分50ETF、嘉实中证细分化工产业主题ETF发起联接、嘉实中证高端装备细分50ETF发起联接、嘉实中证A500ETF联接、嘉实创业板50ETF、嘉实创业板50ETF联接、嘉实中证港股通创新药ETF、嘉实恒生港股通科技主题ETF、嘉实中证港股通创新药ETF发起联接、嘉实恒指港股通ETF、嘉实恒生港股	2024年9月20日	-	12年	曾任国金基金管理有限公司量化分析师助理、量化分析师、投资经理、基金经理助理，华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理，方正富邦基金管理有限公司指数投资部基金经理。2022年3月加入嘉实基金管理有限公司任 SmartBeta 和指数投资部投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

通科技主题 ETF 联接、嘉实中证细分化工产业主题 ETF 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。

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

截至报告期末，张超梁没有管理私募资产管理计划。张超梁管理的 1 个私募资产管理计划已于 2025 年 9 月 9 日离任。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《嘉实中证 A500 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

本基金跟踪中证 A500 指数，中证 A500 指数从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。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，剔除建仓期，本基金日均跟踪偏离为 0.01%，年化跟踪误差为 0.39%，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 1.2036 元；本报告期基金份额净值增长率为 25.06%，业

绩比较基准收益率为 22.43%。

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中证 A500 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中证 A500 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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]100Z0682 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	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“嘉实中证 A500ETF 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。</p> <p>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，公允反映了嘉实中证 A500ETF 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则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，我们独立于嘉实中证 A500ETF 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。</p>
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	<p>嘉实中证 A500ETF 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。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估嘉实中证 A500ETF 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中证 A500ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督嘉实中证 A500ETF 基金的财务报</p>

	告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对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，就可能对嘉实中证 A500ETF 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中证 A500ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p>
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：嘉实中证 A500 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	47,746,981.20	94,386,625.54
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	10,577,461,364.94	12,776,624,616.74
其中：股票投资		10,577,461,364.94	12,776,624,616.74
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		-	-
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		10,625,208,346.14	12,871,011,242.28
负债和净资产			
	附注号	本期末	上年度末
		2025年12月31日	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		34,169,960.86	33,956,296.22
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,301,825.28	1,520,629.47
应付托管费		433,941.75	506,876.50
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	237,692.00	90,329.00
负债合计		36,143,419.89	36,074,131.19
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	8,798,123,357.00	13,139,123,357.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	1,790,941,569.25	-304,186,245.91
净资产合计		10,589,064,926.25	12,834,937,111.09
负债和净资产总计		10,625,208,346.14	12,871,011,242.28

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2036 元，基金份额总额 8,798,123,357.00 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实中证 A500 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 9 月 20 日（基金合 同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		2,830,356,574.21	-219,499,295.94
1. 利息收入		90,152.74	229,758.36
其中：存款利息收入	7.4.7.13	90,152.74	229,758.36
债券利息收入		-	-
资产支持证券 利息收入		-	-
买入返售金融 资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		1,385,409,839.18	8,901,318.09
其中：股票投资收益	7.4.7.14	1,076,704,532.59	-10,215,666.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	1,671,802.07	22,586.05
资产支持证券 投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收 益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	307,033,504.52	19,094,398.95
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益	7.4.7.20	1,415,685,474.35	-246,166,178.42

(损失以“-”号填列)			
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.21	29,171,107.94	17,535,806.03
减：二、营业总支出		26,299,585.81	3,933,591.34
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	19,582,649.81	2,882,109.05
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	6,527,549.92	960,703.01
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		1.70	0.28
8. 其他费用	7.4.7.23	189,384.38	90,779.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,804,056,988.40	-223,432,887.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,804,056,988.40	-223,432,887.28
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,804,056,988.40	-223,432,887.28

7.3 净资产变动表

会计主体：嘉实中证 A500 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	13,139,123,357.00	-	-304,186,245.91	12,834,937,111.09
二、本期期初净资产	13,139,123,357.00	-	-304,186,245.91	12,834,937,111.09
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,341,000,000.00	-	2,095,127,815.16	-2,245,872,184.84
(一)、综合收益总额	-	-	2,804,056,988.	2,804,056,988.4

			40	0
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-4,341,000,000.00	-	-517,873,726.15	-4,858,873,726.15
其中: 1. 基金申购款	20,883,000,000.00	-	482,006,334.05	21,365,006,334.05
2. 基金赎回款	-25,224,000,000.00	-	-999,880,060.20	-26,223,880,060.20
(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)	-	-	-191,055,447.09	-191,055,447.09
四、本期期末净资产	8,798,123,357.00	-	1,790,941,569.25	10,589,064,926.25
项目	上年度可比期间			
	2024年9月20日(基金合同生效日)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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,000,123,357.00	-	-	2,000,123,357.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	11,139,000,000.00	-	-304,186,245.91	10,834,813,754.09
(一)、综合收益总额	-	-	-223,432,887.28	-223,432,887.28
(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)	11,139,000,000.00	-	-80,753,358.63	11,058,246,641.37
其中: 1. 基金申购款	12,996,000,000.00	-	-104,046,581.01	12,891,953,418.99

2. 基金赎回款	-1,857,000,000.00	-	23,293,222.38	-1,833,706,777.62
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	13,139,123,357.00	-	-304,186,245.91	12,834,937,111.09

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：

<u>经雷</u>	<u>梁凯</u>	<u>李袁</u>
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

嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]1263 号《关于准予嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,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《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 9 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,000,123,357.00 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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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。比较财务报表的实际编制期间为 2024 年 9 月 20 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日。

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 and 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、托管费等费用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，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。基金管理人有权根据实际情况决定是否进行分红，但满足以下条件，本基金每季度至少进行一次收益分配：每季度最后一个交易日对基金相对标的指数的超额收益率进行评价；计算基金份额净

值增长率、标的指数同期增长率、超额收益率；当超额收益率大于 0 时，本基金将进行收益分配，收益分配比例不低于超额收益率的 60%，基金管理人将在次季度起的 15 个工作日内拟定收益分配方案；当超额收益率小于或等于 0 时，本基金将不进行收益分配。

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) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)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	1,401,181.05	379,895.06
等于：本金	1,401,029.37	379,855.43
加：应计利息	151.68	39.63
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	46,345,800.15	94,006,730.48
等于：本金	46,344,085.76	94,003,139.92
加：应计利息	1,714.39	3,590.56
减：坏账准备	-	-
合计	47,746,981.20	94,386,625.54

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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		9,407,942,069.01	-	10,577,461,364.94	1,169,519,295.93
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		9,407,942,069.01	-	10,577,461,364.94	1,169,519,295.93
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		13,022,790,795.16	-	12,776,624,616.74	-246,166,178.42
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		13,022,790,795.16	-	12,776,624,616.74	-246,166,178.42

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

无。

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

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	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	188,000.00	90,329.00
其他	49,692.00	-
合计	237,692.00	90,329.00

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	13,139,123,357.00	13,139,123,357.00
本期申购	20,883,000,000.00	20,883,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-25,224,000,000.00	-25,224,000,000.00
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	8,798,123,357.00	8,798,123,357.00

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	37,171,956.34	-341,358,202.25	-304,186,245.91
本期期初	37,171,956.34	-341,358,202.25	-304,186,245.91
本期利润	1,388,371,514.05	1,415,685,474.35	2,804,056,988.40
本期基金份额交易产生的变动数	-117,499,803.09	-400,373,923.06	-517,873,726.15
其中：基金申购款	301,075,093.13	180,931,240.92	482,006,334.05
基金赎回款	-418,574,896.22	-581,305,163.98	-999,880,060.20
本期已分配利润	-191,055,447.09	-	-191,055,447.09
本期末	1,116,988,220.21	673,953,349.04	1,790,941,569.25

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年9月20日（基金合同生效日）至2024年12月31日
活期存款利息收入	6,585.63	72,296.69
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	83,567.11	157,461.67
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	-
合计	90,152.74	229,758.36

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9月20日（基金合同生效日）至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	535,143,029.19	-4,926,695.87
股票投资收益——赎回差价收入	541,561,503.40	-5,288,971.04
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	1,076,704,532.59	-10,215,666.91

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9月20日（基金合同生效日）至2024年12月31日
卖出股票成交总额	17,974,920,047.91	2,534,545,978.53
减：卖出股票成本总额	17,422,444,099.81	2,534,872,291.12
减：交易费用	17,332,918.91	4,600,383.28
买卖股票差价收入	535,143,029.19	-4,926,695.87

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9月20日（基金合同生效日）至2024年12月31日
----	-----------------------------	--

赎回基金份额对价总额	26,223,880,060.20	1,833,706,777.62
减：现金支付赎回款总额	14,760,626,898.20	1,037,852,620.62
减：赎回股票成本总额	10,921,691,658.60	801,143,128.04
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	541,561,503.40	-5,288,971.04

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9月20日（基金合同生效日）至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	465.41	78.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,671,336.66	22,507.93
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	1,671,802.07	22,586.05

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年9月20日（基金合同生效日）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	7,465,489.49	511,613.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,793,300.00	489,000.00

减：应计利息总额	479.64	80.38
减：交易费用	373.19	25.58
买卖债券差价收入	1,671,336.66	22,507.93

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

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9月20日（基金合同生效日）至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	307,033,504.52	19,094,398.95
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	307,033,504.52	19,094,398.95

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9月20日（基金合同生效日）至2024年12月31日
1. 交易性金融资产	1,415,685,474.35	-246,166,178.42
股票投资	1,415,685,474.35	-246,166,178.42
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	1,415,685,474.35	-246,166,178.42

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9月20日（基金合同生效日）至2024年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	29,171,107.94	17,535,806.03
合计	29,171,107.94	17,535,806.03

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	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年9月20日（基金合同生效日）至2024年12月31日
审计费用	68,000.00	48,000.00
信息披露费	120,000.00	42,329.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	1,384.38	50.00
其他	-	400.00
合计	189,384.38	90,779.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据相关法律法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至2026年1月16日登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，每10份基金份额派发红利0.0550元。

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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	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
嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“嘉实中证 A500ETF 联接”）	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9月20日（基金合同生效日）至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	19,582,649.81	2,882,109.05
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,489,357.84	197,506.22
应支付基金管理人的净管理费	18,093,291.97	2,684,602.83

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9月20日（基金合同生效日）至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,527,549.92	960,703.01

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

份额单位：份

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9月20日（基金合 同生效日）至2024年12月 31日
基金合同生效日（2024年9月20日）持有的基金份额	-	200,013,611.00
报告期初持有的基金份额	200,013,611.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	200,013,611.00	200,013,611.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.27%	1.52%

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

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（%）
嘉实中证 A500ETF联接	1,519,080,000.00	17.27	4,754,000,000.00	36.18
中诚信托	165,177,374.00	1.88	239,779,674.00	1.82

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9月20日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司_活期	1,401,181.05	6,585.63	379,895.06	72,296.69

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6,240,800股兴业银行的A股普通股，估值总额为人民币131,431,248.00元，占基金资产净值的比例为1.24%(2024年12月31日：8,220,500股，估值总额为人民币157,504,780.00元，占基金资产净值的比例为1.23%)。

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1月15日	2025年1月16日	-	0.0100	13,604,117.60	-	13,604,117.60	2024年年度收益分配于2025年实施
2	2025年4月15日	2025年4月16日	-	0.0100	16,109,119.43	-	16,109,119.43	-
3	2025年7月14日	2025年7月15日	-	0.0640	87,008,786.20	-	87,008,786.20	-
4	2025年10月21日	2025年10月22日	-	0.0750	74,333,423.86	-	74,333,423.86	-

合计	-	-	-	0.1590	191,055,447.09	-	191,055,447.09	-
----	---	---	---	--------	----------------	---	----------------	---

注：根据相关法律法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2026 年 1 月 16 日登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.0550 元。

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	2025	6个月	新	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	-

	网数字	年11月11日	月	股锁定						
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	2025	6个	新	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-

	富龙	年7月30日	月	股锁定						
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	156,698	32,247,491.71	42,734,678.56	-
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	245,200	17,768,797.31	19,324,212.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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 risk 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2025 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	47,746,981.20	-	-	-	47,746,981.20
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	10,577,461,364.94	10,577,461,364.94
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
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	47,746,981.20	-	-	10,577,461,364.94	10,625,208,346.14
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	-	-	-	34,169,960.86	34,169,960.86
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,301,825.28	1,301,825.28
应付托管费	-	-	-	433,941.75	433,941.75
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	-	-	-	237,692.00	237,692.00
负债总计	-	-	-	36,143,419.89	36,143,419.89
利率敏感度缺口	47,746,981.20	-	-	10,541,317,945.05	10,589,064,926.25
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	94,386,625.54	-	-	-	94,386,625.54
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	12,776,624,616.74	12,776,624,616.74
衍生金融资产	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
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	94,386,625.54	-	12,776,624,616.74	12,871,011,242.28
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	-	-	33,956,296.22	33,956,296.22
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	1,520,629.47	1,520,629.47
应付托管费	-	-	506,876.50	506,876.50
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	-	-	90,329.00	90,329.00
负债总计	-	-	36,074,131.19	36,074,131.19
利率敏感度缺口	94,386,625.54	-	12,740,550,485.55	12,834,937,111.09

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	10,577,461,364.94	99.89	12,776,624,616.74	99.55
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	10,577,461,364.94	99.89	12,776,624,616.74	99.55

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%	528,849,062.34	352,918,205.10
	业绩比较基准下降5%	-528,849,062.34	-352,918,205.10

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	10,510,154,156.12	12,758,637,430.74
第二层次	62,058,890.56	17,987,186.00
第三层次	5,248,318.26	-

合计	10,577,461,364.94	12,776,624,616.74
----	-------------------	-------------------

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9月20日（基金合同生效日）至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-

当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
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	-	-	-
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
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	10,577,461,364.94	99.55
	其中：股票	10,577,461,364.94	99.55
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	47,746,981.20	0.45
8	其他各项资产	-	-
9	合计	10,625,208,346.14	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	55,141,266.06	0.52
B	采矿业	616,247,517.47	5.82
C	制造业	6,624,174,321.95	62.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	256,217,027.12	2.42
E	建筑业	157,504,301.60	1.49
F	批发和零售业	66,755,918.68	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	292,897,140.50	2.77
H	住宿和餐饮业	8,437,294.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	634,305,472.30	5.99
J	金融业	1,447,635,913.06	13.67
K	房地产业	88,690,188.00	0.84
L	租赁和商务服务	117,749,404.47	1.11

	业		
M	科学研究和技术服务业	117,517,290.97	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	22,148,300.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,981,594.00	0.05
Q	卫生和社会工作	29,551,125.50	0.28
R	文化、体育和娱乐业	19,801,895.00	0.19
S	综合	12,455,379.00	0.12
	合计	10,572,211,349.68	99.84

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	0.05
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	0.05

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	973,563	357,550,747.38	3.38
2	600519	贵州茅台	231,764	319,180,745.52	3.01
3	601318	中国平安	3,928,400	268,702,560.00	2.54
4	300308	中际旭创	407,929	248,836,690.00	2.35
5	601899	紫金矿业	6,074,100	209,374,227.00	1.98
6	600036	招商银行	4,565,500	192,207,550.00	1.82
7	300502	新易盛	365,360	157,426,316.80	1.49
8	000333	美的集团	1,814,536	141,805,988.40	1.34
9	601166	兴业银行	6,240,800	131,431,248.00	1.24
10	600900	长江电力	4,508,900	122,596,991.00	1.16
11	300059	东方财富	4,661,959	108,064,209.62	1.02
12	002475	立讯精密	1,877,541	106,475,350.11	1.01
13	688256	寒武纪	76,517	103,722,619.35	0.98
14	600030	中信证券	3,597,309	103,278,741.39	0.98
15	600276	恒瑞医药	1,648,044	98,173,981.08	0.93
16	002594	比亚迪	999,877	97,707,980.44	0.92
17	601398	工商银行	11,930,000	94,604,900.00	0.89
18	300274	阳光电源	535,840	91,650,073.60	0.87
19	688981	中芯国际	739,467	90,828,731.61	0.86
20	601211	国泰海通	4,164,696	85,584,502.80	0.81
21	603259	药明康德	911,400	82,609,296.00	0.78
22	601288	农业银行	10,592,800	81,352,704.00	0.77
23	688041	海光信息	346,613	77,783,423.33	0.73
24	000858	五粮液	718,065	76,071,806.10	0.72
25	002371	北方华创	161,675	74,221,759.00	0.70
26	601328	交通银行	9,837,365	71,320,896.25	0.67
27	600887	伊利股份	2,332,280	66,703,208.00	0.63
28	000651	格力电器	1,653,812	66,516,318.64	0.63
29	300476	胜宏科技	225,655	64,893,864.90	0.61
30	603993	洛阳钼业	3,218,900	64,378,000.00	0.61
31	600000	浦发银行	4,913,025	61,118,031.00	0.58
32	000725	京东方A	13,538,047	56,995,177.87	0.54
33	601816	京沪高铁	10,823,600	55,741,540.00	0.53
34	600150	中国船舶	1,666,259	55,419,774.34	0.52
35	600309	万华化学	690,900	52,978,212.00	0.50

36	603986	兆易创新	246,900	52,898,325.00	0.50
37	601601	中国太保	1,260,500	52,827,555.00	0.50
38	300124	汇川技术	695,050	52,358,116.50	0.49
39	002714	牧原股份	1,009,607	51,065,922.06	0.48
40	688008	澜起科技	424,790	50,040,262.00	0.47
41	601088	中国神华	1,215,401	49,223,740.50	0.46
42	603019	中科曙光	540,100	46,254,164.00	0.44
43	600031	三一重工	2,185,100	46,171,163.00	0.44
44	002050	三花智控	825,670	45,667,807.70	0.43
45	000063	中兴通讯	1,187,800	44,946,352.00	0.42
46	601857	中国石油	4,177,800	43,490,898.00	0.41
47	600111	北方稀土	932,200	42,993,064.00	0.41
48	002230	科大讯飞	852,700	42,882,283.00	0.40
49	300760	迈瑞医疗	224,600	42,775,070.00	0.40
50	688012	中微公司	156,698	42,734,678.56	0.40
51	600089	特变电工	1,861,330	41,358,752.60	0.39
52	000001	平安银行	3,576,500	40,807,865.00	0.39
53	601012	隆基绿能	2,236,900	40,711,580.00	0.38
54	002415	海康威视	1,353,389	40,385,127.76	0.38
55	002384	东山精密	474,500	40,166,425.00	0.38
56	000425	徐工机械	3,467,400	40,152,492.00	0.38
57	603501	豪威集团	311,875	39,265,062.50	0.37
58	601668	中国建筑	7,617,420	39,077,364.60	0.37
59	600660	福耀玻璃	590,700	38,259,639.00	0.36
60	603799	华友钴业	559,600	38,198,296.00	0.36
61	601127	赛力斯	300,900	36,396,864.00	0.34
62	002463	沪电股份	497,800	36,374,246.00	0.34
63	600690	海尔智家	1,384,483	36,121,161.47	0.34
64	601728	中国电信	5,726,500	36,076,950.00	0.34
65	601600	中国铝业	2,922,800	35,716,616.00	0.34
66	002028	思源电气	230,500	35,632,995.00	0.34
67	601919	中远海控	2,324,900	35,291,982.00	0.33
68	300394	天孚通信	173,788	35,284,177.64	0.33
69	000100	TCL 科技	7,668,475	34,814,876.50	0.33
70	000338	潍柴动力	1,997,800	34,362,160.00	0.32
71	601888	中国中免	358,900	33,937,584.00	0.32
72	002352	顺丰控股	884,600	33,897,872.00	0.32
73	600941	中国移动	332,300	33,578,915.00	0.32
74	600406	国电南瑞	1,480,408	33,279,571.84	0.31
75	600028	中国石化	5,370,960	33,192,532.80	0.31
76	000792	盐湖股份	1,170,550	32,962,688.00	0.31
77	600183	生益科技	449,900	32,127,359.00	0.30
78	600418	江淮汽车	643,300	31,843,350.00	0.30

79	000568	泸州老窖	271,600	31,565,352.00	0.30
80	601766	中国中车	4,483,400	30,576,788.00	0.29
81	601225	陕西煤业	1,430,300	30,493,996.00	0.29
82	300014	亿纬锂能	460,819	30,303,457.44	0.29
83	601988	中国银行	5,278,000	30,242,940.00	0.29
84	600050	中国联通	5,765,100	29,459,661.00	0.28
85	000988	华工科技	369,599	29,320,288.67	0.28
86	601628	中国人寿	613,800	27,927,900.00	0.26
87	002027	分众传媒	3,728,671	27,480,305.27	0.26
88	002625	光启技术	556,540	27,136,890.40	0.26
89	600938	中国海油	881,800	26,612,724.00	0.25
90	002460	赣锋锂业	419,103	26,357,387.67	0.25
91	002241	歌尔股份	914,600	26,276,458.00	0.25
92	601985	中国核电	3,031,800	26,225,070.00	0.25
93	600104	上汽集团	1,696,300	25,817,686.00	0.24
94	688111	金山办公	84,047	25,808,312.29	0.24
95	600547	山东黄金	665,100	25,746,021.00	0.24
96	000807	云铝股份	768,900	25,250,676.00	0.24
97	300033	同花顺	78,100	25,162,258.00	0.24
98	000977	浪潮信息	377,651	25,151,556.60	0.24
99	600489	中金黄金	1,073,800	25,083,968.00	0.24
100	601689	拓普集团	319,997	24,697,368.46	0.23
101	000408	藏格矿业	289,500	24,433,800.00	0.23
102	002709	天赐材料	525,800	24,360,314.00	0.23
103	600019	宝钢股份	3,212,500	23,933,125.00	0.23
104	002837	英维克	215,500	23,034,795.00	0.22
105	601006	大秦铁路	4,456,000	22,992,960.00	0.22
106	603288	海天味业	614,663	22,754,824.26	0.21
107	300408	三环集团	496,000	22,692,000.00	0.21
108	688271	联影医疗	179,458	22,521,979.00	0.21
109	002916	深南电路	96,848	22,496,821.92	0.21
110	300433	蓝思科技	737,100	22,312,017.00	0.21
111	601658	邮储银行	4,065,900	22,159,155.00	0.21
112	300136	信维通信	355,800	22,059,600.00	0.21
113	601100	恒立液压	199,200	21,894,072.00	0.21
114	000625	长安汽车	1,829,000	21,691,940.00	0.20
115	002558	巨人网络	500,700	21,675,303.00	0.20
116	600905	三峡能源	5,270,200	21,555,118.00	0.20
117	002466	天齐锂业	379,876	21,037,532.88	0.20
118	600362	江西铜业	381,100	20,930,012.00	0.20
119	002738	中矿资源	266,400	20,925,720.00	0.20
120	601390	中国中铁	3,775,800	20,427,078.00	0.19
121	600879	航天电子	958,000	20,424,560.00	0.19

122	600438	通威股份	994,100	20,398,932.00	0.19
123	600118	中国卫星	214,700	20,385,765.00	0.19
124	688072	拓荆科技	61,223	20,203,590.00	0.19
125	605499	东鹏饮料	75,539	20,198,373.21	0.19
126	300450	先导智能	402,488	20,116,350.24	0.19
127	601727	上海电气	2,325,900	20,025,999.00	0.19
128	600010	包钢股份	8,346,700	19,865,146.00	0.19
129	600893	航发动力	492,800	19,726,784.00	0.19
130	600580	卧龙电驱	401,500	19,713,650.00	0.19
131	600584	长电科技	528,700	19,445,586.00	0.18
132	600585	海螺水泥	884,700	19,339,542.00	0.18
133	002049	紫光国微	245,200	19,324,212.00	0.18
134	600160	巨化股份	499,020	19,172,348.40	0.18
135	600988	赤峰黄金	613,100	19,153,244.00	0.18
136	300015	爱尔眼科	1,719,744	18,882,789.12	0.18
137	600115	中国东航	3,139,800	18,838,800.00	0.18
138	000426	兴业银锡	524,700	18,679,320.00	0.18
139	000538	云南白药	328,399	18,639,927.24	0.18
140	600436	片仔癀	109,559	18,491,368.02	0.17
141	688521	芯原股份	133,588	18,297,548.36	0.17
142	000938	紫光股份	740,300	18,211,380.00	0.17
143	600522	中天科技	1,004,700	18,205,164.00	0.17
144	002202	金风科技	890,600	18,168,240.00	0.17
145	600487	亨通光电	729,900	18,050,427.00	0.17
146	000630	铜陵有色	2,965,841	17,824,704.41	0.17
147	300803	指南针	134,800	17,641,276.00	0.17
148	600760	中航沈飞	313,300	17,591,795.00	0.17
149	600346	恒力石化	780,100	17,575,653.00	0.17
150	600426	华鲁恒升	548,500	17,239,355.00	0.16
151	601168	西部矿业	614,600	16,987,544.00	0.16
152	002156	通富微电	449,800	16,957,460.00	0.16
153	600570	恒生电子	559,100	16,856,865.00	0.16
154	300604	长川科技	165,696	16,786,661.76	0.16
155	600549	厦门钨业	408,000	16,752,480.00	0.16
156	002532	天山铝业	1,031,300	16,686,434.00	0.16
157	002179	中航光电	470,445	16,672,570.80	0.16
158	600795	国电电力	3,286,900	16,565,976.00	0.16
159	601669	中国电建	3,176,300	16,516,760.00	0.16
160	600415	小商品城	1,013,400	16,163,730.00	0.15
161	600048	保利发展	2,647,900	16,152,190.00	0.15
162	002353	杰瑞股份	227,500	16,113,825.00	0.15
163	600066	宇通客车	491,200	16,062,240.00	0.15
164	000933	神火股份	580,500	15,946,335.00	0.15

165	600989	宝丰能源	812,200	15,943,486.00	0.15
166	600029	南方航空	1,988,500	15,927,885.00	0.15
167	300442	润泽科技	301,100	15,898,080.00	0.15
168	000157	中联重科	1,830,300	15,795,489.00	0.15
169	600096	云天化	472,300	15,779,543.00	0.15
170	002340	格林美	1,884,111	15,751,167.96	0.15
171	601058	赛轮轮胎	968,500	15,670,330.00	0.15
172	300395	菲利华	156,200	15,666,860.00	0.15
173	002074	国轩高科	397,800	15,557,958.00	0.15
174	000547	航天发展	468,800	15,475,088.00	0.15
175	688126	沪硅产业	704,813	15,252,153.32	0.14
176	600143	金发科技	779,200	15,225,568.00	0.14
177	600176	中国巨石	885,400	15,140,340.00	0.14
178	600009	上海机场	460,700	15,092,532.00	0.14
179	002407	多氟多	441,176	14,960,278.16	0.14
180	000975	山金国际	613,900	14,936,187.00	0.14
181	300058	蓝色光标	1,295,060	14,919,091.20	0.14
182	002195	岩山科技	2,090,048	14,818,440.32	0.14
183	002851	麦格米特	164,300	14,798,501.00	0.14
184	300339	润和软件	293,600	14,533,200.00	0.14
185	601360	三六零	1,288,600	14,393,662.00	0.14
186	002001	新和成	566,800	14,277,692.00	0.13
187	300207	欣旺达	545,557	14,266,315.55	0.13
188	600885	宏发股份	458,489	13,938,065.60	0.13
189	600219	南山铝业	2,570,200	13,827,676.00	0.13
190	688036	传音控股	208,890	13,820,162.40	0.13
191	002236	大华股份	729,400	13,814,836.00	0.13
192	002131	利欧股份	2,442,600	13,776,264.00	0.13
193	002517	恺英网络	629,500	13,767,165.00	0.13
194	300418	昆仑万维	323,600	13,494,120.00	0.13
195	688120	华海清科	89,841	13,483,337.28	0.13
196	002555	三七互娱	571,100	13,477,960.00	0.13
197	300223	北京君正	127,100	13,477,684.00	0.13
198	688002	睿创微纳	133,621	13,468,996.80	0.13
199	002436	兴森科技	626,100	13,254,537.00	0.13
200	002456	欧菲光	1,236,850	13,135,347.00	0.12
201	000768	中航西飞	513,788	13,039,939.44	0.12
202	002920	德赛西威	108,302	13,028,730.60	0.12
203	601186	中国铁建	1,697,400	13,019,058.00	0.12
204	002938	鹏鼎控股	256,900	12,994,002.00	0.12
205	601111	中国国航	1,383,100	12,959,647.00	0.12
206	002493	荣盛石化	1,105,950	12,950,674.50	0.12
207	002273	水晶光电	513,800	12,906,656.00	0.12

208	000963	华东医药	322,800	12,734,460.00	0.12
209	000831	中国稀土	274,100	12,729,204.00	0.12
210	002595	豪迈科技	149,700	12,651,147.00	0.12
211	600157	永泰能源	8,046,800	12,633,476.00	0.12
212	002281	光迅科技	180,197	12,604,780.15	0.12
213	300751	迈为股份	60,900	12,544,791.00	0.12
214	600895	张江高科	285,600	12,537,840.00	0.12
215	002008	大族激光	303,500	12,501,165.00	0.12
216	600196	复星医药	470,400	12,460,896.00	0.12
217	600673	东阳光	555,300	12,455,379.00	0.12
218	002252	上海莱士	1,959,400	12,422,596.00	0.12
219	600839	四川长虹	1,363,200	12,405,120.00	0.12
220	002812	恩捷股份	218,433	12,372,045.12	0.12
221	688122	西部超导	165,040	12,308,683.20	0.12
222	002130	沃尔核材	466,400	12,275,648.00	0.12
223	600460	士兰微	431,900	12,270,279.00	0.12
224	002422	科伦药业	415,100	12,183,185.00	0.12
225	600011	华能国际	1,624,000	12,115,040.00	0.11
226	002601	龙佰集团	614,900	12,039,742.00	0.11
227	600372	中航机载	891,800	11,967,956.00	0.11
228	600745	闻泰科技	320,800	11,959,424.00	0.11
229	002472	双环传动	251,200	11,909,392.00	0.11
230	300390	天华新能	215,560	11,771,731.60	0.11
231	605117	德业股份	136,246	11,744,405.20	0.11
232	301236	软通动力	246,608	11,696,617.44	0.11
233	000002	万科A	2,511,700	11,679,405.00	0.11
234	600741	华域汽车	581,200	11,624,000.00	0.11
235	600886	国投电力	885,200	11,613,824.00	0.11
236	002128	电投能源	415,920	11,608,327.20	0.11
237	002465	海格通信	734,300	11,565,225.00	0.11
238	001979	招商蛇口	1,331,800	11,506,752.00	0.11
239	300782	卓胜微	140,460	11,444,680.80	0.11
240	688169	石头科技	75,226	11,438,865.56	0.11
241	000661	长春高新	123,000	11,383,650.00	0.11
242	688777	中控技术	229,706	11,333,694.04	0.11
243	600699	均胜电子	359,200	11,264,512.00	0.11
244	601868	中国能建	4,781,100	11,235,585.00	0.11
245	600515	海南机场	2,105,300	11,221,249.00	0.11
246	688235	百济神州	41,755	11,215,393.00	0.11
247	600392	盛和资源	518,000	11,152,540.00	0.11
248	300661	圣邦股份	161,552	11,088,929.28	0.10
249	601877	正泰电器	394,600	11,005,394.00	0.10
250	301358	湖南裕能	170,200	11,005,132.00	0.10

251	002648	卫星化学	620,492	10,970,298.56	0.10
252	300346	南大光电	255,384	10,955,973.60	0.10
253	003816	中国广核	2,901,000	10,907,760.00	0.10
254	300347	泰格医药	192,034	10,888,327.80	0.10
255	601021	春秋航空	181,943	10,825,608.50	0.10
256	603129	春风动力	38,800	10,812,784.00	0.10
257	300759	康龙化成	379,819	10,798,254.17	0.10
258	601800	中国交建	1,309,300	10,788,632.00	0.10
259	603659	璞泰来	392,335	10,726,438.90	0.10
260	603979	金诚信	140,400	10,691,460.00	0.10
261	601872	招商轮船	1,190,500	10,690,690.00	0.10
262	688099	晶晨股份	122,277	10,666,222.71	0.10
263	000878	云南铜业	518,200	10,628,282.00	0.10
264	000301	东方盛虹	973,600	10,602,504.00	0.10
265	002497	雅化集团	427,400	10,578,150.00	0.10
266	002138	顺络电子	297,200	10,559,516.00	0.10
267	300454	深信服	91,670	10,556,717.20	0.10
268	601319	中国人保	1,177,800	10,541,310.00	0.10
269	300054	鼎龙股份	278,800	10,482,880.00	0.10
270	601633	长城汽车	461,992	10,454,878.96	0.10
271	002185	华天科技	944,200	10,357,874.00	0.10
272	600233	圆通速递	630,300	10,349,526.00	0.10
273	000066	中国长城	716,204	10,320,499.64	0.10
274	002294	信立泰	206,828	10,248,327.40	0.10
275	002129	TCL 中环	1,192,225	10,217,368.25	0.10
276	600352	浙江龙盛	958,400	10,216,544.00	0.10
277	688578	艾力斯	97,986	10,205,241.90	0.10
278	300037	新宙邦	194,494	10,191,485.60	0.10
279	688396	华润微	192,711	10,186,703.46	0.10
280	601117	中国化学	1,352,700	10,185,831.00	0.10
281	000960	锡业股份	363,000	10,120,440.00	0.10
282	600588	用友网络	757,800	10,048,428.00	0.09
283	600674	川投能源	721,400	10,027,460.00	0.09
284	300474	景嘉微	137,341	9,870,697.67	0.09
285	600141	兴发集团	284,800	9,848,384.00	0.09
286	002078	太阳纸业	617,800	9,730,350.00	0.09
287	688608	恒玄科技	42,855	9,725,513.70	0.09
288	688213	思特威	102,083	9,707,072.47	0.09
289	688506	百利天恒	29,967	9,682,337.70	0.09
290	300724	捷佳伟创	101,200	9,674,720.00	0.09
291	601615	明阳智能	665,800	9,640,784.00	0.09
292	688047	龙芯中科	72,764	9,612,852.04	0.09
293	600039	四川路桥	960,600	9,557,970.00	0.09

294	002271	东方雨虹	702,800	9,551,052.00	0.09
295	600498	烽火通信	295,000	9,463,600.00	0.09
296	300073	当升科技	162,600	9,398,280.00	0.09
297	000786	北新建材	375,300	9,371,241.00	0.09
298	300496	中科创达	138,200	9,328,500.00	0.09
299	300017	网宿科技	906,298	9,289,554.50	0.09
300	002414	高德红外	629,200	9,230,364.00	0.09
301	603606	东方电缆	154,306	9,219,783.50	0.09
302	601233	桐昆股份	532,800	9,169,488.00	0.09
303	603087	甘李药业	134,600	9,162,222.00	0.09
304	002444	巨星科技	264,600	9,001,692.00	0.09
305	688017	绿的谐波	46,573	8,946,673.30	0.08
306	000617	中油资本	931,400	8,941,440.00	0.08
307	300866	安克创新	77,930	8,914,412.70	0.08
308	300316	晶盛机电	242,200	8,900,850.00	0.08
309	300251	光线传媒	541,500	8,869,770.00	0.08
310	002085	万丰奥威	548,505	8,781,565.05	0.08
311	600482	中国动力	418,079	8,654,235.30	0.08
312	300748	金力永磁	253,000	8,629,830.00	0.08
313	601179	中国西电	944,000	8,590,400.00	0.08
314	300757	罗博特科	36,500	8,515,450.00	0.08
315	002223	鱼跃医疗	222,800	8,513,188.00	0.08
316	300699	光威复材	215,740	8,513,100.40	0.08
317	002155	湖南黄金	401,633	8,470,439.97	0.08
318	300024	机器人	463,700	8,434,703.00	0.08
319	302132	中航成飞	106,700	8,429,300.00	0.08
320	002459	晶澳科技	734,438	8,409,315.10	0.08
321	300012	华测检测	619,900	8,399,645.00	0.08
322	300002	神州泰岳	727,616	8,382,136.32	0.08
323	300122	智飞生物	443,500	8,368,845.00	0.08
324	688223	晶科能源	1,475,406	8,321,289.84	0.08
325	300832	新产业	147,100	8,274,375.00	0.08
326	000423	东阿阿胶	168,100	8,250,348.00	0.08
327	002624	完美世界	502,000	8,227,780.00	0.08
328	000034	神州数码	211,032	8,211,255.12	0.08
329	600085	同仁堂	253,400	8,174,684.00	0.08
330	600497	驰宏锌锗	1,115,900	8,157,229.00	0.08
331	603596	伯特利	158,594	8,131,114.38	0.08
332	600256	广汇能源	1,651,400	8,124,888.00	0.08
333	688472	阿特斯	544,600	8,119,986.00	0.08
334	300919	中伟股份	174,773	8,097,233.09	0.08
335	002064	华峰化学	734,100	8,075,100.00	0.08
336	300285	国瓷材料	294,000	8,058,540.00	0.08

337	688599	天合光能	483,752	8,006,095.60	0.08
338	002405	四维图新	874,100	7,875,641.00	0.07
339	601618	中国中冶	2,632,900	7,819,713.00	0.07
340	300896	爱美客	54,960	7,788,931.20	0.07
341	600765	中航重机	404,900	7,757,884.00	0.07
342	002409	雅克科技	103,700	7,684,170.00	0.07
343	002756	永兴材料	141,500	7,676,375.00	0.07
344	600079	ST人福	423,800	7,675,018.00	0.07
345	002410	广联达	608,700	7,657,446.00	0.07
346	000733	振华科技	145,368	7,618,736.88	0.07
347	002245	蔚蓝锂芯	427,200	7,604,160.00	0.07
348	300568	星源材质	498,400	7,600,600.00	0.07
349	001965	招商公路	753,600	7,596,288.00	0.07
350	002065	东华软件	828,100	7,577,115.00	0.07
351	300003	乐普医疗	477,431	7,548,184.11	0.07
352	688617	惠泰医疗	30,709	7,470,578.43	0.07
353	002180	纳思达	365,900	7,398,498.00	0.07
354	601607	上海医药	414,100	7,395,826.00	0.07
355	600637	东方明珠	745,800	7,346,130.00	0.07
356	002318	久立特材	252,800	7,318,560.00	0.07
357	600862	中航高科	307,900	7,275,677.00	0.07
358	600026	中远海能	614,500	7,177,360.00	0.07
359	000932	华菱钢铁	1,272,000	7,148,640.00	0.07
360	300627	华测导航	204,313	7,132,566.83	0.07
361	000683	博源化工	958,100	7,128,264.00	0.07
362	600803	新奥股份	341,937	7,098,612.12	0.07
363	605589	圣泉集团	250,300	7,083,490.00	0.07
364	300438	鹏辉能源	132,400	7,046,328.00	0.07
365	603260	合盛硅业	133,300	7,024,910.00	0.07
366	000830	鲁西化工	423,800	7,022,366.00	0.07
367	000999	华润三九	246,156	7,005,599.76	0.07
368	300001	特锐德	272,700	7,002,936.00	0.07
369	300972	万辰集团	34,308	6,898,309.56	0.07
370	000623	吉林敖东	350,300	6,841,359.00	0.06
371	000039	中集集团	677,800	6,839,002.00	0.06
372	601677	明泰铝业	460,400	6,809,316.00	0.06
373	603486	科沃斯	84,161	6,790,109.48	0.06
374	000400	许继电气	263,300	6,769,443.00	0.06
375	000887	中鼎股份	291,207	6,758,914.47	0.06
376	002821	凯莱英	72,600	6,746,718.00	0.06
377	300413	芒果超媒	276,100	6,742,362.00	0.06
378	300628	亿联网络	188,400	6,716,460.00	0.06
379	600332	白云山	259,700	6,684,678.00	0.06

380	601238	广汽集团	817,600	6,671,616.00	0.06
381	688180	君实生物	194,694	6,650,747.04	0.06
382	300383	光环新网	531,000	6,642,810.00	0.06
383	600845	宝信软件	316,300	6,550,573.00	0.06
384	000009	中国宝安	664,500	6,545,325.00	0.06
385	600521	华海药业	385,000	6,533,450.00	0.06
386	688065	凯赛生物	130,883	6,517,973.40	0.06
387	300567	精测电子	71,147	6,488,606.40	0.06
388	600177	雅戈尔	852,700	6,480,520.00	0.06
389	300142	沃森生物	589,600	6,432,536.00	0.06
390	688005	容百科技	181,568	6,427,507.20	0.06
391	603392	万泰生物	142,320	6,395,860.80	0.06
392	603568	伟明环保	252,000	6,395,760.00	0.06
393	601799	星宇股份	51,842	6,395,747.54	0.06
394	600704	物产中大	1,144,400	6,374,308.00	0.06
395	002152	广电运通	459,780	6,349,561.80	0.06
396	688303	大全能源	233,557	6,263,998.74	0.06
397	688266	泽璟制药	67,246	6,233,704.20	0.06
398	000738	航发控制	290,900	6,199,079.00	0.06
399	300763	锦浪科技	86,700	6,191,247.00	0.06
400	002841	视源股份	156,100	6,186,243.00	0.06
401	002739	万达电影	545,600	6,176,192.00	0.06
402	600486	扬农化工	88,300	6,127,137.00	0.06
403	002176	江特电机	628,500	6,121,590.00	0.06
404	002389	航天彩虹	254,800	6,110,104.00	0.06
405	002044	美年健康	1,154,800	6,097,344.00	0.06
406	002007	华兰生物	402,569	6,090,868.97	0.06
407	600208	衢州发展	1,571,600	6,082,092.00	0.06
408	000708	中信特钢	370,756	6,069,275.72	0.06
409	601216	君正集团	1,243,400	5,993,188.00	0.06
410	601567	三星医疗	259,500	5,973,690.00	0.06
411	300459	汤姆猫	1,294,400	5,941,296.00	0.06
412	600161	天坛生物	363,432	5,938,478.88	0.06
413	600153	建发股份	640,600	5,925,550.00	0.06
414	600516	方大炭素	1,041,100	5,923,859.00	0.06
415	600499	科达制造	426,800	5,919,716.00	0.06
416	603605	珀莱雅	86,300	5,909,824.00	0.06
417	300253	卫宁健康	652,200	5,752,404.00	0.05
418	688188	柏楚电子	41,914	5,695,693.46	0.05
419	300083	创世纪	613,400	5,649,414.00	0.05
420	603816	顾家家居	183,400	5,637,716.00	0.05
421	600316	洪都航空	160,700	5,610,037.00	0.05
422	000519	中兵红箭	307,800	5,605,038.00	0.05

423	600018	上港集团	1,032,200	5,594,524.00	0.05
424	300088	长信科技	920,200	5,576,412.00	0.05
425	000415	渤海租赁	1,369,600	5,546,880.00	0.05
426	600038	中直股份	153,300	5,538,729.00	0.05
427	600398	海澜之家	885,200	5,355,460.00	0.05
428	603806	福斯特	383,300	5,350,868.00	0.05
429	000629	钒钛股份	1,713,500	5,311,850.00	0.05
430	688166	博瑞医药	107,484	5,273,165.04	0.05
431	600820	隧道股份	812,500	5,273,125.00	0.05
432	002544	普天科技	152,700	5,266,623.00	0.05
433	002603	以岭药业	307,800	5,254,146.00	0.05
434	600170	上海建工	1,967,000	5,212,550.00	0.05
435	688009	中国通号	952,403	5,209,644.41	0.05
436	601018	宁波港	1,435,000	5,209,050.00	0.05
437	600323	瀚蓝环境	182,100	5,208,060.00	0.05
438	600312	平高电气	300,000	5,205,000.00	0.05
439	603077	和邦生物	2,280,300	5,153,478.00	0.05
440	600563	法拉电子	49,000	5,142,550.00	0.05
441	300068	南都电源	330,600	5,137,524.00	0.05
442	600166	福田汽车	1,751,500	5,114,380.00	0.05
443	002607	中公教育	1,818,100	4,981,594.00	0.05
444	002025	航天电器	99,200	4,972,896.00	0.05
445	300118	东方日升	335,600	4,919,896.00	0.05
446	002432	九安医疗	122,698	4,912,827.92	0.05
447	600529	山东药玻	245,400	4,890,822.00	0.05
448	600008	首创环保	1,625,900	4,877,700.00	0.05
449	603939	益丰药房	224,500	4,876,140.00	0.05
450	300676	华大基因	106,300	4,821,768.00	0.05
451	002145	钛能化学	980,940	4,806,606.00	0.05
452	603885	吉祥航空	321,700	4,786,896.00	0.05
453	300144	宋城演艺	580,700	4,755,933.00	0.04
454	600998	九州通	928,800	4,755,456.00	0.04
455	601155	新城控股	332,800	4,642,560.00	0.04
456	002244	滨江集团	460,800	4,631,040.00	0.04
457	002312	川发龙蟒	420,500	4,596,065.00	0.04
458	600763	通策医疗	113,678	4,570,992.38	0.04
459	600859	王府井	290,100	4,505,253.00	0.04
460	300573	兴齐眼药	62,617	4,401,348.93	0.04
461	601880	辽港股份	2,714,300	4,342,880.00	0.04
462	600667	太极实业	540,500	4,307,785.00	0.04
463	600754	锦江酒店	169,700	4,288,319.00	0.04
464	300558	贝达药业	91,700	4,281,473.00	0.04
465	601000	唐山港	1,093,600	4,199,424.00	0.04

466	600535	天士力	275,600	4,153,292.00	0.04
467	600004	白云机场	438,600	4,149,156.00	0.04
468	600258	首旅酒店	247,700	4,148,975.00	0.04
469	600816	建元信托	1,452,000	4,109,160.00	0.04
470	000032	深桑达 A	211,000	4,082,850.00	0.04
471	000998	隆平高科	435,400	4,075,344.00	0.04
472	600511	国药股份	141,500	4,068,125.00	0.04
473	300457	赢合科技	145,000	4,038,250.00	0.04
474	002266	浙富控股	960,900	3,997,344.00	0.04
475	603650	彤程新材	89,500	3,950,530.00	0.04
476	601966	玲珑轮胎	270,100	3,924,553.00	0.04
477	002701	奥瑞金	659,500	3,924,025.00	0.04
478	688390	固德威	61,731	3,835,347.03	0.04
479	000818	航锦科技	196,200	3,786,660.00	0.04
480	603899	晨光股份	138,201	3,739,719.06	0.04
481	600655	豫园股份	720,100	3,694,113.00	0.03
482	000069	华侨城 A	1,481,500	3,674,120.00	0.03
483	300601	康泰生物	247,720	3,658,824.40	0.03
484	601866	中远海发	1,438,600	3,625,272.00	0.03
485	002120	韵达股份	535,200	3,607,248.00	0.03
486	600867	通化东宝	435,600	3,558,852.00	0.03
487	688063	派能科技	62,331	3,541,647.42	0.03
488	300529	健帆生物	178,400	3,509,128.00	0.03
489	603833	欧派家居	66,400	3,458,776.00	0.03
490	000967	盈峰环境	468,900	3,441,726.00	0.03
491	600325	华发股份	812,800	3,430,016.00	0.03
492	000035	中国天楹	615,900	3,399,768.00	0.03
493	002091	江苏国泰	359,100	3,242,673.00	0.03
494	300070	碧水源	802,900	3,147,368.00	0.03
495	600864	哈投股份	462,200	3,064,386.00	0.03
496	002572	索菲亚	214,300	2,916,623.00	0.03
497	002292	奥飞娱乐	326,600	2,890,410.00	0.03
498	002891	中宠股份	55,300	2,862,328.00	0.03
499	001914	招商积余	157,500	1,682,100.00	0.02
500	600007	中国国贸	73,200	1,450,824.00	0.01

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	0.04
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	1,170,724,042.08	9.12
2	601318	中国平安	542,990,560.88	4.23
3	600036	招商银行	490,573,937.06	3.82
4	601166	兴业银行	341,251,793.46	2.66
5	600900	长江电力	325,633,019.02	2.54
6	601899	紫金矿业	304,170,045.63	2.37
7	688041	海光信息	282,897,175.39	2.20
8	600030	中信证券	256,578,971.86	2.00
9	600276	恒瑞医药	232,622,595.18	1.81
10	601398	工商银行	230,211,115.00	1.79
11	688981	中芯国际	222,841,252.24	1.74
12	601328	交通银行	189,851,887.40	1.48
13	601288	农业银行	172,203,447.00	1.34
14	600887	伊利股份	161,805,533.78	1.26
15	603259	药明康德	160,457,971.45	1.25
16	601816	京沪高铁	150,234,273.00	1.17

17	688008	澜起科技	146,750,792.92	1.14
18	600000	浦发银行	136,413,977.27	1.06
19	600919	江苏银行	136,119,488.89	1.06
20	600150	中国船舶	126,296,432.61	0.98

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	1,341,205,507.05	10.45
2	601318	中国平安	670,913,180.45	5.23
3	600036	招商银行	597,964,462.64	4.66
4	600900	长江电力	396,128,837.33	3.09
5	601166	兴业银行	387,542,463.83	3.02
6	601899	紫金矿业	385,332,505.64	3.00
7	688041	海光信息	316,138,956.92	2.46
8	600030	中信证券	312,431,202.73	2.43
9	601398	工商银行	294,629,377.35	2.30
10	600276	恒瑞医药	294,283,277.72	2.29
11	688981	中芯国际	261,265,812.04	2.04
12	601288	农业银行	230,010,683.99	1.79
13	600919	江苏银行	227,624,712.01	1.77
14	601328	交通银行	216,073,854.50	1.68
15	603259	药明康德	211,946,860.74	1.65
16	600887	伊利股份	196,424,954.51	1.53
17	601816	京沪高铁	181,229,781.00	1.41
18	688008	澜起科技	171,764,914.71	1.34
19	600000	浦发银行	163,050,938.32	1.27
20	601088	中国神华	138,951,101.05	1.08

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	15,528,358,263.76
卖出股票收入（成交）总额	17,974,920,047.91

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
无。

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，兴业银行股份有限公司、招商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
无。

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	0.04	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 (%)
12,479	705,034.33	8,368,956,615.00	95.12	429,166,742.00	4.88

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 (%)
嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1,519,080,000.00	17.27

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中国人寿保险股份有限公司	1,433,219,700.00	16.29
2	新华人寿保险股份有限公司	415,415,835.00	4.72
3	大家人寿保险股份有限公司-万能产品	269,645,302.00	3.06
4	中国国际金融股份有限公司	257,302,142.00	2.92
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	243,154,200.00	2.76
6	方正证券股份有限公司	203,202,793.00	2.31
7	嘉实基金管理有限公司	200,013,611.00	2.27
8	中信证券股份有限公司	174,833,841.00	1.99

	司		
9	中诚信托有限责任公司	165,177,374.00	1.88
10	国泰海通证券股份有限公司	153,514,046.00	1.74
11	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1,519,080,000.00	17.27

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

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024年9月20日） 基金份额总额	2,000,123,357.00
本报告期期初基金份额总额	13,139,123,357.00
本报告期基金总申购份额	20,883,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	25,224,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,798,123,357.00

§ 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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无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

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无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	8	33,437,146,463.88	100.00	6,216,478.80	100.00	-

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) 交易等服务能力较强。

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。

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	7,465,489.49	100.00	-	-	-	-

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	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证	中国证券报、基金管理	2025 年 1 月 13 日

	券投资基金 2024 年第一次收益分配公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
2	关于嘉实中证 A500 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	中国证券报、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 24 日
3	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	中国证券报、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 5 日
4	关于嘉实中证 A500 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	中国证券报、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 3 日
5	关于嘉实中证 A500 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	中国证券报、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 28 日
6	关于嘉实中证 A500 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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 4 月 7 日
7	嘉实中证 A500 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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 4 月 11 日
8	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、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
9	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	中国证券报、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 23 日
10	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	中国证券报、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 28 日
11	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 变更场内简称的公告	中国证券报、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 16 日
12	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、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
13	嘉实中证 A500 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	中国证券报、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 10 日
14	关于嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	中国证券报、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 18 日
15	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	中国证券报、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 29 日

16	嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第三次收益分配公告	中国证券报、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 18 日
17	关于嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	中国证券报、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 30 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 (%)
联接基金	1	2025-01-01 至 2025-07-29	4,754,000,000.00	402,500,000.00	3,637,420,000.00	1,519,080,000.00	17.27
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

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) 中国证监会准予嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实中证 A500 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