

南方中证 500 增强策略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：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

目录

§ 1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§ 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.....	6
3.3 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.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	13
§ 5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§ 6 审计报告.....	13
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§ 7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 净资产变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§ 8 投资组合报告.....	49
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	50

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	62
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.....	62
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.....	62
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.....	62
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
8.12 投资组合报告附注.....	63
§ 9 基金份额持有人信息.....	63
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	64
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
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.....	64
§ 10 开放式基金份额变动.....	64
§ 11 重大事件揭示.....	65
11.1 基金份额持有人大会决议.....	65
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.....	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
11.4 基金投资策略的改变.....	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
11.8 其他重大事件.....	68
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
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.....	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
§ 13 备查文件目录.....	69
13.1 备查文件目录.....	69
13.2 存放地点.....	70
13.3 查阅方式.....	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 500 增强策略 ETF
场内简称	中证 500 增强 ETF 南方
基金主代码	560100
交易代码	560100
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 1 月 26 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	67,080,333.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2022 年 2 月 16 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强策略交易型开放式指数证券投资基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.5%。
投资策略	本基金主要通过量化投资模型，在控制组合跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。主要投资策略包括：1、以增强指数投资收益为目的的股票投资策略；2、金融衍生品投资策略；3、债券投资策略；4、转融通证券出借业务投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、存托凭证投资策略
业绩比较基准	比较基准的标的指数：中证 500 指数 本基金的业绩比较基准：中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，一般而言，其风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革
	联系电话	0755-82763888
		郭明
		(010) 66105799

	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	(010) 66105798
注册地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518017	100140
法定代表人		周易	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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

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	19,309,527.34	8,850,474.39	-3,683,327.86
本期利润	22,291,737.15	12,391,396.33	-2,301,712.23
加权平均基金份额本期利润	0.2854	0.1050	-0.0187
本期加权平均净值利润率	27.39%	12.00%	-2.02%
本期基金份额净值增长率	30.89%	9.98%	-3.87%
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	16,690,058.21	-4,795,394.57	-17,230,140.90
期末可供分配基金份额利润	0.2488	-0.0459	-0.1325
期末基金资产净值	83,770,391.21	99,784,938.43	112,850,192.10
期末基金份额净值	1.2488	0.9541	0.8675
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	24.88%	-4.59%	-13.25%

注：基金业绩指标不包括持有人认（申）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；

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；

对期末可供分配利润，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

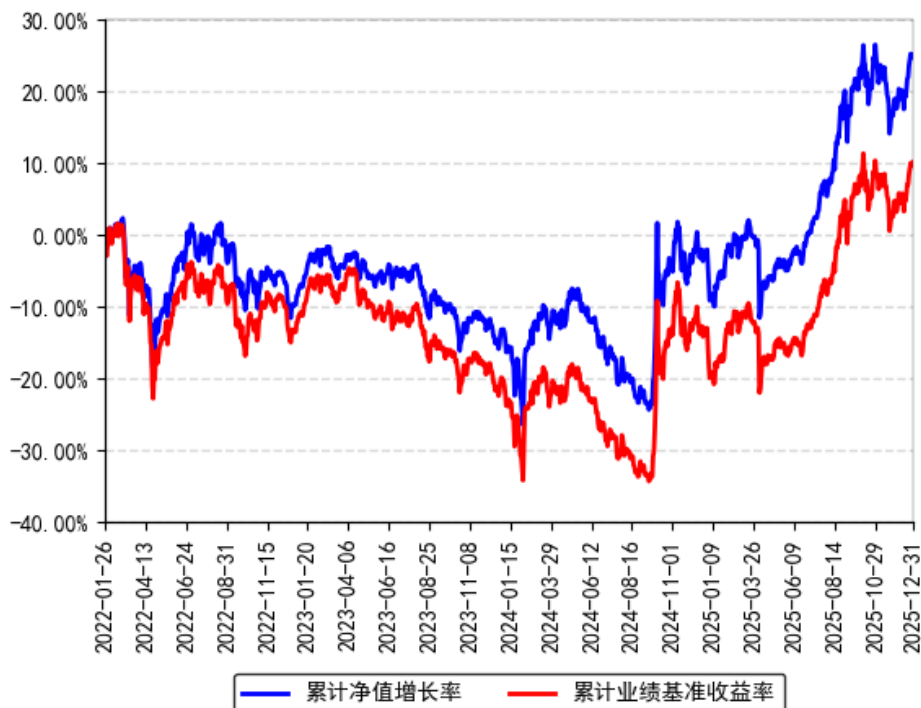
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.42%	1.21%	0.72%	1.24%	-0.30%	-0.03%
过去六个月	25.14%	1.15%	26.21%	1.17%	-1.07%	-0.02%
过去一年	30.89%	1.22%	30.39%	1.26%	0.50%	-0.04%
过去三年	38.39%	1.28%	27.30%	1.37%	11.09%	-0.09%
自基金合同生效起至今	24.88%	1.29%	10.07%	1.37%	14.81%	-0.08%

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

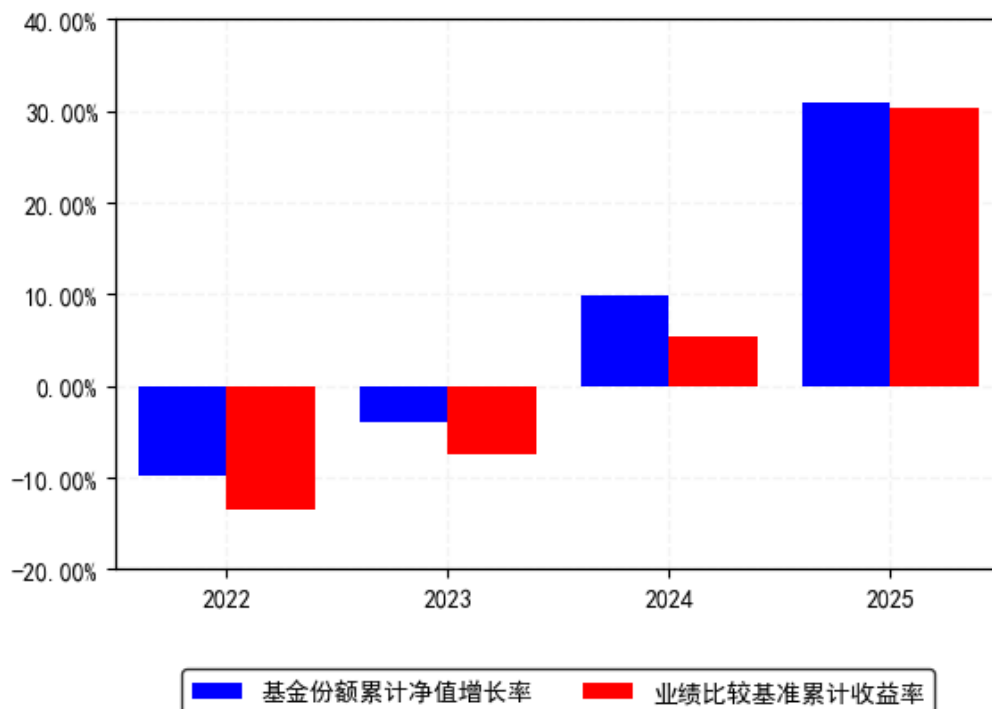
准收益率变动的比较

南方中证500增强策略ETF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



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

南方中证500增强策略ETF每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

南方基金管理股份有限公司旗下管理公募基金、全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合，已发展成为产品种类丰富、业务领域全面、经营业绩优秀、资产管理规模位居前列的基金管理公司之一。

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		
崔蕾	本基金基金经理	2022 年 1 月 26 日	-	10 年	中国国籍，女，康奈尔大学金融工程硕士，具有基金从业资格。2015 年 2 月加入南方基金，历任数量化投资部助理研究员、研究员，指数投资部研究员；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 4 月 23 日，任南方小康 ETF、南方小康 ETF 联接基金经理；2019 年 6 月 28 日至 2022 年 2 月 18 日，任大数据 300 基金经理；2020 年 3 月 26 日至 2023 年 3 月 27 日，任南方粤港澳大湾区联接基金经理；2019 年 11 月 29 日至 2023 年 7 月 4 日，任南方粤港澳大湾区 ETF 基金经理；2018 年 11 月 8 日至 2023 年 12 月 29 日，任南方中证 500 增强基金经理；2022 年 12 月 1 日至 2023 年 12 月 29 日，任南方上证科创板 50 成份增强策略 ETF 基金经理；2019 年 6 月 12 日至 2025 年 6 月 6 日，

				任南方顶峰 TOPIX ETF (QDII) 基金经理; 2019 年 7 月 12 日至今, 任南方中证申万有色金属 ETF、南方中证申万有色金属 ETF 发起联接、南方中证 1000ETF 基金经理; 2020 年 1 月 17 日至今, 任南方标普中国 A 股大盘红利低波 50ETF 基金经理; 2020 年 1 月 21 日至今, 任南方标普中国 A 股大盘红利低波 50ETF 联接基金经理; 2021 年 6 月 24 日至今, 任南方中证科创创业 50ETF 基金经理; 2021 年 8 月 19 日至今, 任南方中证科创创业 50ETF 联接基金经理; 2021 年 9 月 27 日至今, 任南方中证 1000ETF 发起联接基金经理; 2021 年 12 月 29 日至今, 任南方国证在线消费 ETF 基金经理; 2022 年 1 月 26 日至今, 任南方中证 500 增强策略 ETF 基金经理; 2022 年 11 月 23 日至今, 任南方国证交通运输行业 ETF 基金经理; 2023 年 11 月 24 日至今, 任南方国证交通运输行业 ETF 发起联接基金经理。
--	--	--	--	---

注: 1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日, 后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告(生效)日期;

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

4.1.3 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下如有基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的, 其薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩, 具体根据其对产品长期业绩与团队综合贡献、个人绩效考核等情况实施分配。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定, 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。本报告期内, 本基金运作整体合法合规, 没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，建立和完善了兼任相关的制度及流程，确保兼任基金经理公平对待其管理的所有投资组合。通过对基金经理的投资交易行为进行监控和分析，本报告期内，两两组合间各项操作、流程及事后分析均正常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 138 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

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

本报告期内指数涨跌幅 30.39%，产品净值涨跌幅 30.86%。2025 年该产品超额收益欠佳，主因使用的策略严控各类风险暴露，且风格较为均衡，一方面价值因子大幅跑输指数，另一方面中证 500 内量价因子逐渐失效，拖累基金业绩。自四季度起该基金对原有模型进行调整，加入新策略和因子。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.2488 元，报告期内，份额净值增长率为 30.89%，同期业绩基准增长率为 30.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年为十五五的开局之年，尤其是上半年中美关系较为稳定，全球仍处于弱美元的大环境，利好风险资产，国内政策预期和宏观流动宽松对市场风险偏好形成支撑，市场将围绕“涨价”和“科技”两条主线博弈。但自 2024 年 9 月以来 A 股本轮牛市已持续近一年半，市场部分行业板块估值不便宜，因市场不缺资金，一些热门主题或者有基本面的行业容易快速增加拥挤度，导致波动率大增，因此建议投资者短期应谨慎追高，切忌追涨杀跌。进入下半年后，宏观不确定因素逐渐增加，美国进入中期选举时间段，降息周期或将结束，对风险类资产或有压制。因此上半年该基金将适当放宽成长、分析师等风格暴露，降低传统量价类因子的使用，力争做到超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、自律规则、监管要求和业务发展情况，严格遵守包括《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》在内的公募基金行业各项法律法规及其他规范要求，有效落实了 2025 年度发布的《推动公募基金高质量发展行动方案》

《基金经营机构及其工作人员廉洁从业实施细则》和《公开募集证券投资基金管理人参与上市公司治理管理规则》等公募基金相关新法律法规。

本基金管理人坚持从保护基金份额持有人利益出发，树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础、合规为先、行稳致远”的合规理念。严守合规底线，贯彻落实行业高质量发展要求，以全面覆盖法律法规和监管要求为出发点，推动实现公司合规内控体系迭代升级，强化落实全面风险管理要求，确保各项法规和管理制度的落实，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人积极推动监管新规落实，持续完善内控体系制度及业务流程，制订和修订了包括公司《廉洁从业内部控制制度》《防控内幕交易管理制度》《信息和保密管理制度》《反洗钱和反恐怖融资基本制度》等一系列与监察稽核和合规内控相关的公司管理制度。

在进一步优化制度体系的基础上，坚持“看不清管不住则不展业”原则，切实推动“合规创造价值”理念走深走实，强化新规及监管政策的内化落实，推进落实全面风险管理与全员合规管理要求，提升公司业务发展内在稳定性。持续夯实投研交易长效管控基础，着力加强日常风险监测预警与应对处置，切实防范各环节业务风险；紧跟监管动态，精准强化产品运作及市场营销各环节关键机制，系统性强化风险防范及排查，确保监管要求及政策精神的贯彻落实；对投研交易、市场销售、运营管理及人员管理等业务和相关部门通过专项稽核和合规检查工作，促进公司业务合规运作、稳健经营；厚植公司廉洁从业合规文化根基，强化智能高效的人员检查机制，丰富文化建设和宣导形式，有效规范人员从业行为；持续完善信息披露工作机制，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；落实提升投资者获得感，持续加强投资者教育及保护力度，监督和落实客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人高度重视反洗钱工作，贯彻风险为本，持续提升内控建设及风险防范有效性。从制度建设、系统数据管理、业务流程规范建设、宣传培训等方面入手，依据新《反洗钱法》持续增强公司反洗钱制度机制有效性，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程，提升公司洗钱风险防范水平。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全各项内控管理制度，不断提高监察稽核及合规管理工作的科学性和有效性，筑牢全员合规防线，落实全面风险管理与全员合规管理要求，持续构建高效赋能的合规数智化体系，努力防范和管理各类风险，确保各项业务稳健运行，切实维护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括财务负责人、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、现金及债券指数投资部总经理、国际业务部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2025 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2026)审字第 70027797_H119 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	南方中证 500 增强策略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>我们审计了南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</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《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何</p>

	<p>事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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，就可能导致对南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的</p>

	值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	高 鹤	邓 雯
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层	
审计报告日期	2026 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方中证 500 增强策略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	4,537,676.64	3,459,984.89
结算备付金		2,388,203.95	3,968,511.67
存出保证金		906,798.56	982,429.39
交易性金融资产	7.4.7.2	75,945,313.97	91,659,015.75
其中：股票投资		75,945,313.97	91,651,015.50
基金投资		-	-
债券投资		-	8,000.25
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		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		344,545.59	190,342.00
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		84,122,538.71	100,260,283.70

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		93,230.70	0.03
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		33,842.71	46,559.40
应付托管费		3,384.27	4,655.93
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,700.57	50,916.73
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	217,989.25	373,213.18
负债合计		352,147.50	475,345.27
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	67,080,333.00	104,580,333.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	16,690,058.21	-4,795,394.57
净资产合计		83,770,391.21	99,784,938.43
负债和净资产总计		84,122,538.71	100,260,283.70

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2488 元，基金份额总额 67,080,333.00 份。

7.2 利润表

会计主体：南方中证 500 增强策略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		22,849,721.65	13,127,944.52
1.利息收入		50,636.58	76,897.84
其中：存款利息收入	7.4.7.9	50,636.58	76,897.84
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）		19,748,122.69	9,290,387.07
其中：股票投资收益	7.4.7.10	16,323,184.63	5,199,412.34
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	30,123.24	9,123.59
资产支持证券投资 投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	2,011,135.74	1,875,127.83
股利收益	7.4.7.15	1,383,679.08	2,206,723.31
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.16	2,982,209.81	3,540,921.94
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.17	68,752.57	219,737.67
减：二、营业总支出		557,984.50	736,548.19
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	409,430.02	517,669.59
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	40,943.02	51,766.89
3.销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		7,249.77	6,761.25
8.其他费用	7.4.7.18	100,361.69	160,350.46
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		22,291,737.15	12,391,396.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		22,291,737.15	12,391,396.33
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		22,291,737.15	12,391,396.33

7.3 净资产变动表

会计主体：南方中证 500 增强策略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	104,580,333.00	-	-4,795,394.57	99,784,938.43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	104,580,333.00	-	-4,795,394.57	99,784,938.43
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-37,500,000.00	-	21,485,452.78	-16,014,547.22
(一)、综合收益总额	-	-	22,291,737.15	22,291,737.15
(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)	-37,500,000.00	-	-806,284.37	-38,306,284.37
其中：1.基金申购款	151,500,000.00	-	14,565,687.98	166,065,687.98
2.基金赎回款	-189,000,000.00	-	-15,371,972.35	-204,371,972.35
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	67,080,333.00	-	16,690,058.21	83,770,391.21
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	130,080,333.00	-	-17,230,140.90	112,850,192.10
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	130,080,333.00	-	-17,230,140.90	112,850,192.10
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-25,500,000.00	-	12,434,746.33	-13,065,253.67
(一)、综合收益总额	-	-	12,391,396.33	12,391,396.33
(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)	-25,500,000.00	-	43,350.00	-25,456,650.00
其中：1.基金申购款	192,000,000.00	-	-26,833,566.38	165,166,433.62
2.基金赎回款	-217,500,000.00	-	26,876,916.38	-190,623,083.62
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	104,580,333.00	-	-4,795,394.57	99,784,938.43

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：

____杨小松____ ____蔡忠评____ ____徐超____
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

南方中证 500 增强策略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[2021]3580 号《关于准予南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 增强策略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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 746,577,500.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0042 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2022 年 1 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 746,580,333.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 2,833.00 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2022]38 号审核同意,本基金 746,580,333.00 份基金份额于 2022 年 2 月 16 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上,力争实现超越目标指数的投资收益;主要投资于标的指数成份股、备选成份股。此外,本基金可少量投资于非成份股(包含主板、创业板及其他经中国证监会核准/注册发行的股票)、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可投资存托凭证。基金管理人根据相关规定可参与转融通证券出借业务。本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%,投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产净值的 80%。每个交易日日终,在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 0.35%,年跟踪误差不超过 6.5%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2026 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业

会计准则”) 编制, 同时, 在信息披露和估值方面, 也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金于 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度, 即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外, 均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产;

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

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

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

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

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

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融

资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

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

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察

输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损

益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，本基金的基金管理人可进行收益分配；以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则确定收益分配。本基金收益每年最多分配 12 次，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产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及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种,按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

(1) 增值税及附加

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人。

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

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

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

（2）企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）

的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

（4）印花税（如适用）

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

（5）境外投资

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	4,537,676.64	3,459,984.89
等于：本金	4,537,234.80	3,459,559.07
加：应计利息	441.84	425.82
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	4,537,676.64	3,459,984.89
----	--------------	--------------

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		72,718,843.66	-	75,945,313.97	3,226,470.31
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		72,718,843.66	-	75,945,313.97	3,226,470.31
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		90,828,035.00	-	91,651,015.50	822,980.50
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	8,000.00	0.25	8,000.25	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,000.00	0.25	8,000.25	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		90,836,035.00	0.25	91,659,015.75	822,980.50

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	7,005,360.00	-	-	-
-股指期货	7,005,360.00	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	7,005,360.00	-	-	-
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	8,163,040.00	-	-	-
—股指期货	8,163,040.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,163,040.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2603	IC2603	5.00	7,366,600.00	361,240.00
合计				361,240.00
减：可抵销期货暂收款				361,240.00
净额				0.00

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的利率/货币/权益/其他衍生工具为国债/外汇/股指/商品期货投资，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国债/外汇/股指/商品期货投资合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债/外汇/股指/商品期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 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	21,218.56	30,472.07
其中：交易所市场	21,218.56	30,472.07
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应退退补款	96,770.69	182,531.31
预提费用	100,000.00	160,000.00
应付指数使用费	-	-
可退替代款	-	209.80
合计	217,989.25	373,213.18

7.4.7.7 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	104,580,333.00	104,580,333.00
本期申购	151,500,000.00	151,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-189,000,000.00	-189,000,000.00
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	67,080,333.00	67,080,333.00

注：本基金申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）；赎回含转出份额（如有）。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-41,172.22	-4,754,222.35	-4,795,394.57
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-41,172.22	-4,754,222.35	-4,795,394.57
本期利润	19,309,527.34	2,982,209.81	22,291,737.15
本期基金份额交易产生的变动数	-76,298.23	-729,986.14	-806,284.37
其中：基金申购款	21,714,355.65	-7,148,667.67	14,565,687.98
基金赎回款	-21,790,653.88	6,418,681.53	-15,371,972.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,192,056.89	-2,501,998.68	16,690,058.21

7.4.7.9 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	11,983.48	10,711.80
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	38,554.11	65,861.82
其他	98.99	324.22
合计	50,636.58	76,897.84

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 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	13,628,568.01	4,223,338.68
股票投资收益——赎回差价收入	2,694,616.62	976,073.66
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	16,323,184.63	5,199,412.34

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	440,225,431.35	472,449,809.31
减：卖出股票成本总额	426,234,081.65	467,836,537.15
减：交易费用	362,781.69	389,933.48
买卖股票差价收入	13,628,568.01	4,223,338.68

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	204,371,972.35	190,623,083.62
减：现金支付赎回款总额	97,633,343.35	83,875,458.62

减：赎回股票成本总额	104,044,012.38	105,771,551.34
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	2,694,616.62	976,073.66

7.4.7.11 基金投资收益

无。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	6.65	5.47
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差 价收入	30,116.59	9,118.12
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	30,123.24	9,123.59

7.4.7.12.2 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	106,027.75	51,625.63
减: 卖出债券(债转股及债券 到期兑付)成本总额	75,900.00	42,500.00
减: 应计利息总额	6.91	5.42
减: 交易费用	4.25	2.09
买卖债券差价收入	30,116.59	9,118.12

注：上述交易费用(如有)包含债券买卖产生的交易费用。

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 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	2,011,135.74	1,875,127.83

7.4.7.15 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	1,383,679.08	2,206,723.31
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	1,383,679.08	2,206,723.31

7.4.7.16 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	2,403,489.81	3,747,708.61
——股票投资	2,403,489.81	3,747,708.61
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	578,720.00	-206,786.67
——权证投资	-	-
——期货投资	578,720.00	-206,786.67
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	2,982,209.81	3,540,921.94

7.4.7.17 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	68,752.57	219,737.67
合计	68,752.57	219,737.67

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

7.4.7.18 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	20,000.00	40,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	359.00	333.00
其他	2.69	17.46
合计	100,361.69	160,350.46

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

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司(“厦门国际信托”)	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司(“深圳投资控股”)	基金管理人的股东
厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公司

南方资本管理有限公司(“南方资本”)	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司(“南方东英”)	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	366,162,002.34	42.11%	286,782,097.77	30.64%
兴业证券	-	-	153,007,623.54	16.35%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	15,961.44	15.05%	1,887.60	3.66%

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 基金交易

无。

7.4.10.1.5 权证交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	36,569.83	42.10%	7,323.44	34.51%
兴业证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			

	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	28,665.08	30.64%	3,500.03	11.49%
兴业证券	15,303.99	16.36%	-	-

注：1. 上述佣金费率参考市场价格确定。

2. 该类佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（中国证券监督管理委员会公告（2024）3号）相关规定。《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》生效后，被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

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	409,430.02	517,669.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	22,145.04	19,157.27
应支付基金管理人的净管理费	387,284.98	498,512.32

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

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% \div \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	40,943.02	51,766.89

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

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

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

7.4.10.4.2 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
华泰证券股份有限公司	1,104,500.00	1.65%	2,695,400.00	2.58%

注：本基金其他关联方投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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
中国工商银行	4,537,676.64	11,983.48	3,459,984.89	10,711.80

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单）	总金额

				位：股/张)	
兴业证券	110099	福能转债	配债	130	13,000.00

上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	688605	先锋精科	网下申购	4,406	49,743.74

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：本期无。本基金报告期后分红情况（如有）详见本报告“资产负债表日后事项”部分内容。

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

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

本基金是指数型基金，其风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。紧密跟踪中证 500 指数，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。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现

超越目标指数的投资收益。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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，将风险控制可在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金净资产的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于本期末，本基金无债券投资（上期末：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金净资产的比例为 0.0080%）。

7.4.13.3 流动性风险

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行期货投资，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用期货的杠杆作用，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。

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。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	4,537,676.64	-	-	-	4,537,676.64
结算备付金	2,388,203.95	-	-	-	2,388,203.95
存出保证金	22,806.56	-	-	883,992.00	906,798.56
交易性金融资产	-	-	-	75,945,313.97	75,945,313.97
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	344,545.59	344,545.59
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,948,687.15	-	-	77,173,851.56	84,122,538.71
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	-	-	-	93,230.70	93,230.70
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	33,842.71	33,842.71
应付托管费	-	-	-	3,384.27	3,384.27
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3,700.57	3,700.57
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	217,989.25	217,989.25
负债总计	-	-	-	352,147.50	352,147.50
利率敏感度缺口	6,948,687.15	-	-	76,821,704.06	83,770,391.21
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	3,459,984.89	-	-	-	3,459,984.89
结算备付金	3,968,511.67	-	-	-	3,968,511.67
存出保证金	28,962.19	-	-	953,467.20	982,429.39
交易性金融资产	-	-	8,000.25	91,651,015.50	91,659,015.75
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	190,342.00	190,342.00
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	7,457,458.75	-	8,000.25	92,794,824.70	100,260,283.70
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	-	-	-	0.03	0.03
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	46,559.40	46,559.40
应付托管费	-	-	-	4,655.93	4,655.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	50,916.73	50,916.73
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	373,213.18	373,213.18
负债总计	-	-	-	475,345.27	475,345.27
利率敏感度缺口	7,457,458.75	-	8,000.25	92,319,479.43	99,784,938.43

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)
	1.市场利率平行上升25个基点	0.00	0.00
2.市场利率平行下降25个基点	0.00	0.00	

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。本基金本期末的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于股票，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。

本基金为增强型股票指数基金，在力求对跟踪的标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，利用量化投资模型，控制组合跟踪误差。

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，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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	75,945,313.97	90.66	91,651,015.50	91.85
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	75,945,313.97	90.66	91,651,015.50	91.85

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

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2025年12月31日)	上年度末(2024年12月31日)
	1.组合自身基准上升 5%	3,974,042.34	4,571,558.61
2.组合自身基准下降 5%	-3,974,042.34	-4,571,558.61	

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	75,945,313.97	91,587,493.86
第二层次	-	8,000.25
第三层次	-	63,521.64
合计	75,945,313.97	91,659,015.75

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资,若出现交易不活跃、非公开发行等情况,本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次,并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次,确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位:人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	63,521.64	63,521.64
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	73,597.58	73,597.58
当期利得或损失总额	-	10,075.94	10,075.94
其中:计入损益的利得或损失	-	10,075.94	10,075.94

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	-	-	-
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	-	25,089.98	25,089.98
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	28,650.28	28,650.28
转出第三层次	-	36,953.18	36,953.18
当期利得或损失总额	-	46,734.56	46,734.56
其中：计入损益的利得或损失	-	46,734.56	46,734.56
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	63,521.64	63,521.64
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	-	41,619.74	41,619.74

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	-	-	-	-	-
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
限售股票	63,521.64	平均价格法	预期波动率	1.4783~4.964	负相关

		式期权模型		8	
--	--	-------	--	---	--

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（上年度末：同）。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	75,945,313.97	90.28
	其中：股票	75,945,313.97	90.28
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	6,925,880.59	8.23
8	其他各项资产	1,251,344.15	1.49
9	合计	84,122,538.71	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而行业分类的合计项中不含可退替代款估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	130,065.00	0.16
B	采矿业	2,770,204.00	3.31
C	制造业	53,800,441.28	64.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,937,218.00	3.51
E	建筑业	685,351.00	0.82
F	批发和零售业	2,130,024.48	2.54
G	交通运输、仓储和邮政业	1,227,426.00	1.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,225,013.87	6.24
J	金融业	3,946,017.60	4.71
K	房地产业	1,130,549.00	1.35
L	租赁和商务服务业	686,664.00	0.82
M	科学研究和技术服务业	422,996.92	0.50
N	水利、环境和公共设施管理业	162,631.82	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	253,323.00	0.30
R	文化、体育和娱乐业	437,388.00	0.52
S	综合	-	-
	合计	75,945,313.97	90.66

8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

无。

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 报告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	002558	巨人网络	16,900	731,601.00	0.87
2	002532	天山铝业	38,800	627,784.00	0.75
3	002738	中矿资源	7,800	612,690.00	0.73
4	600143	金发科技	29,700	580,338.00	0.69
5	300450	先导智能	11,600	579,768.00	0.69
6	601168	西部矿业	20,600	569,384.00	0.68

7	600118	中国卫星	5,800	550,710.00	0.66
8	002202	金风科技	26,000	530,400.00	0.63
9	002595	豪迈科技	6,200	523,962.00	0.63
10	002436	兴森科技	24,700	522,899.00	0.62
11	600549	厦门钨业	12,400	509,144.00	0.61
12	300604	长川科技	4,800	486,288.00	0.58
13	002294	信立泰	9,700	480,635.00	0.57
14	000960	锡业股份	17,000	473,960.00	0.57
15	300857	协创数据	2,800	472,304.00	0.56
16	600352	浙江龙盛	44,200	471,172.00	0.56
17	301308	江波龙	1,900	465,196.00	0.56
18	600487	亨通光电	18,800	464,924.00	0.55
19	601717	中创智领	18,700	459,085.00	0.55
20	300395	菲利华	4,500	451,350.00	0.54
21	000657	中钨高新	16,200	448,902.00	0.54
22	002414	高德红外	30,500	447,435.00	0.53
23	688002	睿创微纳	4,393	442,814.40	0.53
24	300339	润和软件	8,800	435,600.00	0.52
25	002156	通富微电	11,500	433,550.00	0.52
26	002080	中材科技	11,900	432,446.00	0.52
27	688525	佰维存储	3,699	424,608.21	0.51
28	688183	生益电子	4,423	423,236.87	0.51
29	000878	云南铜业	20,600	422,506.00	0.50
30	002402	和而泰	10,800	422,496.00	0.50
31	603920	世运电路	8,700	421,167.00	0.50
32	600601	方正科技	35,400	414,888.00	0.50
33	300207	欣旺达	15,800	413,170.00	0.49
34	603766	隆鑫通用	25,600	412,416.00	0.49
35	603444	吉比特	970	411,134.50	0.49
36	002673	西部证券	51,900	409,491.00	0.49
37	600096	云天化	12,200	407,602.00	0.49
38	300748	金力永磁	11,900	405,909.00	0.48
39	300058	蓝色光标	35,000	403,200.00	0.48
40	600060	海信视像	16,301	395,788.28	0.47
41	000932	华菱钢铁	70,400	395,648.00	0.47
42	000783	长江证券	48,200	392,830.00	0.47
43	000887	中鼎股份	16,800	389,928.00	0.47
44	002126	银轮股份	10,300	389,340.00	0.46
45	688213	思特威	4,070	387,016.30	0.46
46	601233	桐昆股份	22,300	383,783.00	0.46
47	601990	南京证券	47,900	379,368.00	0.45
48	600801	华新建材	15,402	377,965.08	0.45
49	300458	全志科技	8,980	377,429.40	0.45

50	603699	纽威股份	7,200	374,184.00	0.45
51	603979	金诚信	4,900	373,135.00	0.45
52	600392	盛和资源	17,300	372,469.00	0.44
53	300454	深信服	3,200	368,512.00	0.44
54	600885	宏发股份	12,000	364,800.00	0.44
55	002837	英维克	3,400	363,426.00	0.43
56	603816	顾家家居	11,800	362,732.00	0.43
57	002056	横店东磁	18,600	362,700.00	0.43
58	600021	上海电力	18,100	362,362.00	0.43
59	603129	春风动力	1,300	362,284.00	0.43
60	000423	东阿阿胶	7,300	358,284.00	0.43
61	603298	杭叉集团	13,360	354,975.20	0.42
62	001696	宗申动力	16,300	353,547.00	0.42
63	000703	恒逸石化	32,700	352,179.00	0.42
64	300751	迈为股份	1,700	350,183.00	0.42
65	601231	环旭电子	11,600	348,000.00	0.42
66	688578	艾力斯	3,336	347,444.40	0.41
67	002244	滨江集团	34,400	345,720.00	0.41
68	600141	兴发集团	9,900	342,342.00	0.41
69	600873	梅花生物	33,599	340,357.87	0.41
70	600390	五矿资本	60,500	335,775.00	0.40
71	002008	大族激光	8,100	333,639.00	0.40
72	600282	南钢股份	63,400	333,484.00	0.40
73	000060	中金岭南	56,800	332,280.00	0.40
74	600332	白云山	12,800	329,472.00	0.39
75	600126	杭钢股份	39,900	325,584.00	0.39
76	600704	物产中大	58,100	323,617.00	0.39
77	000951	中国重汽	19,100	322,790.00	0.39
78	002841	视源股份	8,100	321,003.00	0.38
79	000062	深圳华强	13,000	320,060.00	0.38
80	002624	完美世界	19,400	317,966.00	0.38
81	601958	金铂股份	20,100	313,158.00	0.37
82	600699	均胜电子	9,900	310,464.00	0.37
83	600038	中直股份	8,500	307,105.00	0.37
84	603233	大参林	17,300	304,826.00	0.36
85	603565	中谷物流	30,300	304,212.00	0.36
86	300003	乐普医疗	19,100	301,971.00	0.36
87	300972	万辰集团	1,500	301,605.00	0.36
88	603659	璞泰来	11,000	300,740.00	0.36
89	002603	以岭药业	17,600	300,432.00	0.36
90	002430	杭氧股份	10,000	298,700.00	0.36
91	603486	科沃斯	3,700	298,516.00	0.36
92	600170	上海建工	112,500	298,125.00	0.36

93	603858	步长制药	18,900	295,596.00	0.35
94	000750	国海证券	69,600	295,104.00	0.35
95	600998	九州通	57,559	294,702.08	0.35
96	600563	法拉电子	2,800	293,860.00	0.35
97	002500	山西证券	48,200	288,718.00	0.34
98	002185	华天科技	25,900	284,123.00	0.34
99	688778	厦钨新能	3,665	283,561.05	0.34
100	601099	太平洋	68,800	282,768.00	0.34
101	600580	卧龙电驱	5,700	279,870.00	0.33
102	600848	上海临港	23,800	278,460.00	0.33
103	002318	久立特材	9,600	277,920.00	0.33
104	600298	安琪酵母	6,328	276,786.72	0.33
105	603341	龙旗科技	6,500	274,690.00	0.33
106	002078	太阳纸业	17,300	272,475.00	0.33
107	300073	当升科技	4,700	271,660.00	0.32
108	688772	珠海冠宇	12,566	270,545.98	0.32
109	300496	中科创达	4,000	270,000.00	0.32
110	603379	三美股份	4,440	269,596.80	0.32
111	600131	国网信通	16,700	269,538.00	0.32
112	300724	捷佳伟创	2,800	267,680.00	0.32
113	000883	湖北能源	58,900	267,406.00	0.32
114	000709	河钢股份	115,300	266,343.00	0.32
115	000027	深圳能源	40,200	262,104.00	0.31
116	603737	三棵树	5,620	260,037.40	0.31
117	603939	益丰药房	11,920	258,902.40	0.31
118	002155	湖南黄金	12,200	257,298.00	0.31
119	603606	东方电缆	4,300	256,925.00	0.31
120	601155	新城控股	18,400	256,680.00	0.31
121	601991	大唐发电	73,400	256,166.00	0.31
122	600132	重庆啤酒	4,900	255,976.00	0.31
123	601333	广深铁路	84,100	255,664.00	0.31
124	600763	通策医疗	6,300	253,323.00	0.30
125	000426	兴业银锡	7,100	252,760.00	0.30
126	000959	首钢股份	51,500	252,350.00	0.30
127	300373	扬杰科技	3,700	251,600.00	0.30
128	600995	南网储能	20,000	251,400.00	0.30
129	601019	山东出版	28,300	244,512.00	0.29
130	603228	景旺电子	3,308	241,781.72	0.29
131	300567	精测电子	2,600	237,120.00	0.28
132	300001	特锐德	9,200	236,256.00	0.28
133	002670	国盛证券	14,000	235,760.00	0.28
134	601799	星宇股份	1,900	234,403.00	0.28
135	600486	扬农化工	3,310	229,680.90	0.27

136	600499	科达制造	16,400	227,468.00	0.27
137	300888	稳健医疗	6,000	227,040.00	0.27
138	600378	昊华科技	7,100	226,916.00	0.27
139	603529	爱玛科技	7,600	225,720.00	0.27
140	000729	燕京啤酒	19,800	222,354.00	0.27
141	300763	锦浪科技	3,100	221,371.00	0.26
142	600879	航天电子	10,200	217,464.00	0.26
143	300136	信维通信	3,500	217,000.00	0.26
144	600562	国睿科技	7,600	214,776.00	0.26
145	301200	大族数控	1,800	213,786.00	0.26
146	002353	杰瑞股份	3,000	212,490.00	0.25
147	002608	江苏国信	28,300	209,137.00	0.25
148	688295	中复神鹰	6,204	203,553.24	0.24
149	600095	湘财股份	18,400	203,504.00	0.24
150	688347	华虹公司	1,865	201,177.55	0.24
151	600685	中船防务	7,000	199,150.00	0.24
152	601865	福莱特	12,700	199,009.00	0.24
153	688819	天能股份	5,860	194,669.20	0.23
154	002299	圣农发展	11,708	193,650.32	0.23
155	000987	越秀资本	23,700	192,918.00	0.23
156	600183	生益科技	2,700	192,807.00	0.23
157	601138	工业富联	3,100	192,355.00	0.23
158	601918	新集能源	29,000	191,690.00	0.23
159	300223	北京君正	1,800	190,872.00	0.23
160	600578	京能电力	37,300	190,230.00	0.23
161	688561	奇安信	5,335	189,819.30	0.23
162	603899	晨光股份	7,000	189,420.00	0.23
163	000733	振华科技	3,600	188,676.00	0.23
164	002916	深南电路	800	185,832.00	0.22
165	300308	中际旭创	300	183,000.00	0.22
166	600906	财达证券	27,100	180,757.00	0.22
167	688025	杰普特	1,268	179,510.76	0.21
168	600032	浙江新能	23,900	177,099.00	0.21
169	300115	长盈精密	3,800	176,700.00	0.21
170	002734	利民股份	11,000	175,340.00	0.21
171	002273	水晶光电	6,900	173,328.00	0.21
172	600098	广州发展	26,500	173,310.00	0.21
173	601577	长沙银行	17,600	170,720.00	0.20
174	600927	永安期货	10,500	168,735.00	0.20
175	002195	岩山科技	23,300	165,197.00	0.20
176	000997	新大陆	5,800	164,256.00	0.20
177	002851	麦格米特	1,800	162,126.00	0.19
178	002335	科华数据	2,900	161,037.00	0.19

179	002152	广电运通	11,400	157,434.00	0.19
180	002261	拓维信息	4,700	155,570.00	0.19
181	002517	恺英网络	7,100	155,277.00	0.19
182	600177	雅戈尔	20,300	154,280.00	0.18
183	300677	英科医疗	3,920	152,488.00	0.18
184	300953	震裕科技	900	151,218.00	0.18
185	301345	涛涛车业	600	150,792.00	0.18
186	300570	太辰光	1,300	150,215.00	0.18
187	601216	君正集团	30,900	148,938.00	0.18
188	300442	润泽科技	2,800	147,840.00	0.18
189	002612	朗姿股份	7,200	147,168.00	0.18
190	300750	宁德时代	400	146,904.00	0.18
191	600066	宇通客车	4,400	143,880.00	0.17
192	603929	亚翔集成	1,500	143,250.00	0.17
193	688321	微芯生物	4,890	142,885.80	0.17
194	300681	英搏尔	5,700	142,842.00	0.17
195	600901	江苏金租	23,080	141,249.60	0.17
196	603629	利通电子	5,300	141,245.00	0.17
197	002074	国轩高科	3,600	140,796.00	0.17
198	300619	金银河	3,200	140,480.00	0.17
199	603185	弘元绿能	4,600	140,300.00	0.17
200	002487	大金重工	2,700	140,211.00	0.17
201	600195	中牧股份	17,800	140,086.00	0.17
202	601686	友发集团	22,300	140,044.00	0.17
203	688099	晶晨股份	1,605	140,004.15	0.17
204	300596	利安隆	3,300	139,293.00	0.17
205	001309	德明利	600	139,134.00	0.17
206	001389	广合科技	1,700	138,771.00	0.17
207	688072	拓荆科技	420	138,600.00	0.17
208	600008	首创环保	46,100	138,300.00	0.17
209	600057	厦门象屿	16,200	138,024.00	0.16
210	688582	芯动联科	2,083	137,707.13	0.16
211	000600	建投能源	16,100	137,333.00	0.16
212	601020	华钰矿业	5,100	136,986.00	0.16
213	600329	达仁堂	3,000	136,860.00	0.16
214	300850	新强联	3,300	136,521.00	0.16
215	605499	东鹏饮料	500	133,695.00	0.16
216	300438	鹏辉能源	2,500	133,050.00	0.16
217	002568	百润股份	6,100	133,041.00	0.16
218	600602	云赛智联	7,100	132,699.00	0.16
219	002939	长城证券	13,000	132,600.00	0.16
220	300620	光库科技	900	132,345.00	0.16
221	600598	北大荒	8,700	130,065.00	0.16

222	000831	中国稀土	2,800	130,032.00	0.16
223	300718	长盛轴承	1,500	128,040.00	0.15
224	601001	晋控煤业	9,700	127,555.00	0.15
225	601866	中远海发	50,400	127,008.00	0.15
226	600655	豫园股份	24,700	126,711.00	0.15
227	301536	星宸科技	2,100	125,811.00	0.15
228	600663	陆家嘴	15,800	124,978.00	0.15
229	002138	顺络电子	3,500	124,355.00	0.15
230	300529	健帆生物	6,300	123,921.00	0.15
231	002265	建设工业	4,600	123,372.00	0.15
232	002465	海格通信	7,600	119,700.00	0.14
233	600062	华润双鹤	6,500	118,885.00	0.14
234	000021	深科技	4,700	118,816.00	0.14
235	000559	万向钱潮	6,800	116,960.00	0.14
236	600498	烽火通信	3,600	115,488.00	0.14
237	600720	中交设计	15,900	114,798.00	0.14
238	300390	天华新能	2,100	114,681.00	0.14
239	002340	格林美	13,700	114,532.00	0.14
240	688519	南亚新材	1,394	112,718.84	0.13
241	601179	中国西电	11,900	108,290.00	0.13
242	600497	驰宏锌锗	14,600	106,726.00	0.13
243	002064	华峰化学	9,600	105,600.00	0.13
244	000034	神州数码	2,700	105,057.00	0.13
245	688297	中无人机	2,166	104,011.32	0.12
246	000039	中集集团	10,100	101,909.00	0.12
247	000830	鲁西化工	6,100	101,077.00	0.12
248	000528	柳工	8,400	99,708.00	0.12
249	000623	吉林敖东	5,000	97,650.00	0.12
250	600637	东方明珠	9,900	97,515.00	0.12
251	688018	乐鑫科技	568	96,560.00	0.12
252	603156	养元饮品	3,300	94,875.00	0.11
253	600171	上海贝岭	3,000	93,750.00	0.11
254	600516	方大炭素	16,200	92,178.00	0.11
255	601567	三星医疗	4,000	92,080.00	0.11
256	600153	建发股份	9,900	91,575.00	0.11
257	300676	华大基因	2,000	90,720.00	0.11
258	600642	申能股份	11,600	90,248.00	0.11
259	002025	航天电器	1,800	90,234.00	0.11
260	002262	恩华药业	3,700	89,281.00	0.11
261	600820	隧道股份	13,600	88,264.00	0.11
262	000723	美锦能源	18,700	87,890.00	0.10
263	600398	海澜之家	14,500	87,725.00	0.10
264	300679	电连技术	1,800	87,624.00	0.10

265	603225	新凤鸣	4,500	87,570.00	0.10
266	002958	青农商行	28,200	87,420.00	0.10
267	600970	中材国际	8,400	87,276.00	0.10
268	688361	中科飞测	567	86,745.33	0.10
269	000513	丽珠集团	2,500	86,150.00	0.10
270	603589	口子窖	2,800	84,140.00	0.10
271	300146	汤臣倍健	7,000	84,070.00	0.10
272	600985	淮北矿业	7,500	83,325.00	0.10
273	600535	天士力	5,500	82,885.00	0.10
274	688120	华海清科	552	82,844.16	0.10
275	601666	平煤股份	10,500	82,635.00	0.10
276	601000	唐山港	21,400	82,176.00	0.10
277	000921	海信家电	3,300	81,873.00	0.10
278	000598	兴蓉环境	11,400	81,738.00	0.10
279	603927	中科软	4,280	81,705.20	0.10
280	600483	福能股份	8,400	79,548.00	0.09
281	600582	天地科技	13,600	79,288.00	0.09
282	600566	济川药业	3,000	78,900.00	0.09
283	600546	山煤国际	7,800	78,702.00	0.09
284	601598	中国外运	12,900	78,174.00	0.09
285	688172	燕东微	2,691	77,877.54	0.09
286	000582	北部湾港	8,300	77,854.00	0.09
287	601098	中南传媒	6,900	77,694.00	0.09
288	600871	石化油服	35,600	76,896.00	0.09
289	600528	中铁工业	9,400	76,892.00	0.09
290	600764	中国海防	2,800	76,552.00	0.09
291	688709	成都华微	1,659	76,297.41	0.09
292	688385	复旦微电	1,032	76,058.40	0.09
293	600968	海油发展	19,800	76,032.00	0.09
294	688563	航材股份	1,299	75,926.55	0.09
295	600295	鄂尔多斯	6,100	75,396.00	0.09
296	601928	凤凰传媒	7,500	75,300.00	0.09
297	688425	铁建重工	14,831	75,193.17	0.09
298	002032	苏泊尔	1,700	74,936.00	0.09
299	688100	威胜信息	1,883	74,001.90	0.09
300	601965	中国汽研	4,400	73,040.00	0.09
301	600688	上海石化	25,900	72,002.00	0.09
302	002372	伟星新材	6,900	71,967.00	0.09
303	603658	安图生物	2,030	71,902.60	0.09
304	000429	粤高速 A	6,000	70,680.00	0.08
305	601139	深圳燃气	10,600	69,960.00	0.08
306	688318	财富趋势	526	69,600.32	0.08
307	600007	中国国贸	3,500	69,370.00	0.08

308	688019	安集科技	315	68,644.80	0.08
309	300274	阳光电源	400	68,416.00	0.08
310	002444	巨星科技	2,000	68,040.00	0.08
311	002461	珠江啤酒	7,200	66,888.00	0.08
312	688475	萤石网络	2,218	66,783.98	0.08
313	600299	安迪苏	7,300	65,481.00	0.08
314	300017	网宿科技	6,300	64,575.00	0.08
315	688234	天岳先进	726	64,526.88	0.08
316	300349	金卡智能	4,100	64,083.00	0.08
317	603700	宁水集团	4,700	63,873.00	0.08
318	002932	明德生物	3,300	63,294.00	0.08
319	002850	科达利	400	63,144.00	0.08
320	603726	朗迪集团	2,600	62,920.00	0.08
321	002683	广东宏大	1,300	62,140.00	0.07
322	603886	元祖股份	4,400	61,468.00	0.07
323	002658	雪迪龙	6,700	60,501.00	0.07
324	002416	爱施德	4,800	60,384.00	0.07
325	300834	星辉环材	2,600	60,268.00	0.07
326	603897	长城科技	2,200	59,840.00	0.07
327	000725	京东方 A	14,200	59,782.00	0.07
328	603357	设计总院	7,300	59,495.00	0.07
329	002315	焦点科技	1,300	59,488.00	0.07
330	000100	TCL 科技	13,100	59,474.00	0.07
331	000544	中原环保	7,100	59,072.00	0.07
332	603006	联明股份	4,500	59,040.00	0.07
333	600479	千金药业	5,800	58,928.00	0.07
334	603937	丽岛新材	4,900	58,751.00	0.07
335	002533	金杯电工	4,700	58,656.00	0.07
336	600261	阳光照明	17,400	58,638.00	0.07
337	600737	中粮糖业	3,400	58,514.00	0.07
338	688057	金达莱	4,781	58,423.82	0.07
339	002030	达安基因	9,800	58,408.00	0.07
340	002573	清新环境	15,600	58,344.00	0.07
341	300230	永利股份	12,200	58,316.00	0.07
342	002274	华昌化工	10,300	58,195.00	0.07
343	603115	海星股份	3,100	58,001.00	0.07
344	688065	凯赛生物	1,162	57,867.60	0.07
345	002774	快意电梯	6,200	57,536.00	0.07
346	002728	特一药业	5,300	57,505.00	0.07
347	688615	合合信息	252	57,350.16	0.07
348	002900	哈三联	4,600	57,316.00	0.07
349	601369	陕鼓动力	5,700	57,057.00	0.07
350	000523	红棉股份	15,000	56,550.00	0.07

351	600208	衢州发展	14,300	55,341.00	0.07
352	688375	国博电子	589	54,841.79	0.07
353	603605	珀莱雅	800	54,784.00	0.07
354	600863	内蒙华电	12,100	54,208.00	0.06
355	000415	渤海租赁	13,300	53,865.00	0.06
356	600967	内蒙一机	3,200	53,760.00	0.06
357	002385	大北农	13,100	52,400.00	0.06
358	601156	东航物流	2,800	51,548.00	0.06
359	300100	双林股份	1,300	51,506.00	0.06
360	002773	康弘药业	1,700	50,949.00	0.06
361	600583	海油工程	9,200	50,508.00	0.06
362	601880	辽港股份	31,300	50,080.00	0.06
363	002130	沃尔核材	1,900	50,008.00	0.06
364	688728	格科微	3,338	49,869.72	0.06
365	003021	兆威机电	400	49,672.00	0.06
366	600004	白云机场	5,200	49,192.00	0.06
367	002367	康力电梯	6,100	49,166.00	0.06
368	688278	特宝生物	586	49,036.48	0.06
369	000563	陕国投 A	14,000	48,300.00	0.06
370	002439	启明星辰	3,400	48,008.00	0.06
371	300070	碧水源	11,700	45,864.00	0.05
372	688363	华熙生物	1,050	45,864.00	0.05
373	688577	浙海德曼	473	45,814.78	0.05
374	688248	南网科技	1,008	45,097.92	0.05
375	603516	淳中科技	200	44,700.00	0.05
376	688336	三生国健	744	44,320.08	0.05
377	001286	陕西能源	4,700	43,757.00	0.05
378	301301	川宁生物	4,300	43,602.00	0.05
379	603286	日盈电子	600	41,496.00	0.05
380	601228	广州港	12,700	41,148.00	0.05
381	688520	神州细胞	927	40,148.37	0.05
382	601921	浙版传媒	5,100	39,882.00	0.05
383	003035	南网能源	8,700	39,846.00	0.05
384	001213	中铁特货	9,800	39,690.00	0.05
385	688228	开普云	200	38,922.00	0.05
386	605196	华通线缆	1,100	38,214.00	0.05
387	603993	洛阳钼业	1,900	38,000.00	0.05
388	301061	匠心家居	400	37,920.00	0.05
389	300539	横河精密	900	37,818.00	0.05
390	603216	梦天家居	800	37,600.00	0.04
391	002768	国恩股份	700	36,876.00	0.04
392	688611	杭州柯林	718	36,510.30	0.04
393	688191	智洋创新	1,114	35,848.52	0.04

394	300478	杭州高新	1,100	35,530.00	0.04
395	603650	彤程新材	800	35,312.00	0.04
396	301448	开创电气	700	34,888.00	0.04
397	605598	上海港湾	500	34,740.00	0.04
398	603151	邦基科技	1,900	34,238.00	0.04
399	603122	合富中国	1,400	34,160.00	0.04
400	603087	甘李药业	500	34,035.00	0.04
401	301529	福赛科技	300	33,930.00	0.04
402	002384	东山精密	400	33,860.00	0.04
403	605580	恒盛能源	1,500	33,840.00	0.04
404	000408	藏格矿业	400	33,760.00	0.04
405	002345	潮宏基	2,700	33,750.00	0.04
406	605287	德才股份	1,300	33,696.00	0.04
407	688109	品茗科技	263	33,427.30	0.04
408	301183	东田微	200	31,018.00	0.04
409	000573	粤宏远 A	7,000	28,910.00	0.03
410	300548	长芯博创	200	28,400.00	0.03
411	002068	黑猫股份	3,200	28,224.00	0.03
412	300346	南大光电	600	25,740.00	0.03
413	688777	中控技术	468	23,091.12	0.03
414	002472	三环传动	400	18,964.00	0.02
415	002052	同洲电子	1,400	17,850.00	0.02
416	002065	东华软件	1,400	12,810.00	0.02
417	300054	鼎龙股份	200	7,520.00	0.01
418	300037	新宙邦	100	5,240.00	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

无。

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	300476	胜宏科技	4,872,212.00	4.88
2	000988	华工科技	2,515,653.00	2.52
3	002414	高德红外	2,266,197.00	2.27
4	002436	兴森科技	2,207,016.00	2.21
5	300724	捷佳伟创	2,108,193.00	2.11
6	300748	金力永磁	2,053,510.00	2.06
7	002281	光迅科技	2,010,335.15	2.01

8	000423	东阿阿胶	1,982,233.17	1.99
9	300207	欣旺达	1,940,001.00	1.94
10	002558	巨人网络	1,931,627.00	1.94
11	300450	先导智能	1,889,102.00	1.89
12	002294	信立泰	1,886,759.00	1.89
13	002532	天山铝业	1,779,363.00	1.78
14	300373	扬杰科技	1,765,045.00	1.77
15	002624	完美世界	1,727,285.00	1.73
16	002080	中材科技	1,683,078.00	1.69
17	000623	吉林敖东	1,673,564.00	1.68
18	002202	金风科技	1,662,607.00	1.67
19	300677	英科医疗	1,647,522.60	1.65
20	002056	横店东磁	1,629,062.00	1.63

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300476	胜宏科技	7,254,475.51	7.27
2	000988	华工科技	3,345,356.00	3.35
3	300866	安克创新	2,448,794.29	2.45
4	300724	捷佳伟创	2,413,317.00	2.42
5	002281	光迅科技	2,395,868.00	2.40
6	002414	高德红外	2,195,586.00	2.20
7	000997	新大陆	2,185,436.00	2.19
8	002558	巨人网络	2,140,717.00	2.15
9	002517	恺英网络	2,039,769.00	2.04
10	002138	顺络电子	2,034,540.66	2.04
11	000423	东阿阿胶	2,003,019.00	2.01
12	300373	扬杰科技	1,997,351.00	2.00
13	000623	吉林敖东	1,991,598.00	2.00
14	300677	英科医疗	1,968,946.00	1.97
15	300207	欣旺达	1,951,648.00	1.96
16	002202	金风科技	1,862,236.00	1.87
17	002436	兴森科技	1,858,672.00	1.86
18	002532	天山铝业	1,849,927.00	1.85
19	000034	神州数码	1,804,725.07	1.81
20	002294	信立泰	1,790,573.00	1.79

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	429,304,347.51
卖出股票收入（成交）总额	440,225,431.35

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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。通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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 声明本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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

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

8.12.2 声明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。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票（如有）没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

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（元）
1	存出保证金	906,798.56
2	应收清算款	344,545.59
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,251,344.15

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,258	53,323.00	27,989,233.00	41.72%	39,091,100.00	58.28%

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	中信建投证券股份有限公司	17,971,900.00	26.79%
2	中信证券股份有限公司	2,509,933.00	3.74%
3	杜爱明	2,296,300.00	3.42%
4	申万宏源证券有限公司	2,247,200.00	3.35%
5	黄时博	1,550,000.00	2.31%
6	徐红	1,500,000.00	2.24%
7	刘伟	1,233,600.00	1.84%
8	东方证券股份有限公司	1,129,190.00	1.68%
9	华泰证券股份有限公司	1,104,500.00	1.65%
10	UBS AG	1,085,700.00	1.62%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

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

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022 年 1 月 26 日)基金份额总额	746,580,333.00
本报告期期初基金份额总额	104,580,333.00

本报告期基金总申购份额	151,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	189,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	67,080,333.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期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

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内无涉及基金财产的诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化；目前安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 2 年，本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 20,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	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	2025-10-17； 2025-11-18
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局；

	国家外汇管理局深圳市分局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施； 行政处罚
受到的具体措施类型	责令改正； 警告、罚款
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作、人员管理、其他问题(销售管理)； 其他问题(外汇登记)
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》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》； 《中华人民共和国外汇管理条例》
管理人采取整改措施的情况	截至报告期末公司已通过完善制度、优化流程等整改措施完成整改，整改成果已经中国证监会深圳监管局验收通过； 截至报告期末公司已完成整改，整改成果已向国家外汇管理局深圳市分局报告并通过
其他	-

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到调查或处罚等措施的时间	2025-10-17
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局
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	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理、其他问题(销售管理)
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》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》
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通过完善制度、优化流程等整改措施完成整改，整改成果已经中国证监会深圳监管局验收通过
其他	-

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人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

本报告期内托管人相关从业人员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	
华泰证券	2	366,162,002.34	42.11%	36,569.83	42.10%	-
招商证券	1	268,649,494.10	30.90%	26,841.84	30.90%	-
中信证券	2	177,814,707.14	20.45%	17,767.85	20.45%	-
国信证券	1	53,987,552.88	6.21%	5,393.89	6.21%	-
国泰海通	2	2,916,022.40	0.34%	291.43	0.34%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：根据 2024 年 7 月 1 日起施行的《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告〔2024〕3 号），基金管理人制定了证券公司交易单元的选择标准和程序：

1、选择标准

基金管理人建立了选择机制，选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易，并制定了定性与定量相结合的具体标准。

2、选择程序

（1）基金管理人根据上述标准对证券公司进行评估，与符合标准的证券公司签订证券综合研究服务协议后将其入库，并对入库的证券公司开展动态管理，定期检视其是否持续符合选择标准；

（2）基金管理人根据其建立的服务评价及交易量分配机制，定期对证券公司开展评价后，根据评价结果进行交易量的分配。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：新增交易单元：无；减少交易单元：国泰海通。

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	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	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
华泰证 券	15,961.44	15.05%	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	19,395.27	18.29%	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
国泰海 通	70,671.04	66.65%	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-

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	南方基金关于直销平台相关业务费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-01
2	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加华金证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-08
3	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加瑞银证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-02-20
4	南方基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31
5	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加东莞证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-07-04
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投	证券日报、基金管理	2025-10-16

	资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	人网站、中国证监会基金电子披露网站	
7	南方基金管理股份有限公司关于旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-11-24

§ 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	202511-24-202511-26,202511-51208-202512-09,202511-202512-31	681,100.00	238,356,900.00	221,066,100.00	17,971,900.00	26.79%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20% 的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告》原文。

13.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>