

南方沪深 300 指数增强型证券投资基金 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：招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。

基金托管人招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	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	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的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	55
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	57
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.....	72
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.....	72
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.....	72
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.....	72
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.....	72
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	73
8.12 投资组合报告附注.....	73
§ 9 基金份额持有人信息.....	74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	75
§ 10 开放式基金份额变动.....	75
§ 11 重大事件揭示.....	75
11.1 基金份额持有人大会决议.....	75
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.....	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76
11.4 基金投资策略的改变.....	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	76
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	77
11.8 其他重大事件.....	79
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	80
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	81
§ 13 备查文件目录.....	81
13.1 备查文件目录.....	81
13.2 存放地点.....	81
13.3 查阅方式.....	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	南方沪深 300 指数增强	
基金主代码	009059	
交易代码	009059	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 23 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	255,374,574.91 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方沪深 300 指数增强 A	南方沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	009059	009060
报告期末下属分级基金的份 额总额	125,651,340.59 份	129,723,234.32 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，立足价值投资理念深入研究筛选，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过主动投资基本面优秀、估值合理的个股的方式实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金通过指数复制和主动选股相结合的策略，追求接近或超过标的指数的业绩表现。本基金为增强型指数基金，股票投资比例为基金资产的 90%-95%，其中沪深 300 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 80%。除因分红或基金持有人赎回或申购等原因，本基金将保持相对固定的股票投资比例。如因特殊情况导致基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的 实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。本基金力争使日均跟踪 偏离度不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，一般而言，其预期风险收益水平高于混合型基金、 债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备 选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有 限公司	招商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	鲍文革	张姗
	联系电话	0755-82763888	400-61-95555
	电子邮箱	manager@southernfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-889-8899	400-61-95555
传真		0755-82763889	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518017	518040
法定代表人		周易	缪建民

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	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

§ 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

1、南方沪深 300 指数增强 A

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	42,090,520.08	10,882,907.90	-8,544,163.49
本期利润	49,847,093.78	24,051,441.53	-11,565,532.74
加权平均基金份额本期利润	0.2645	0.1608	-0.1041
本期加权平均净值利润率	21.10%	14.63%	-9.39%
本期基金份额净值增长率	22.51%	17.56%	-9.25%
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	53,375,735.74	34,586,671.33	1,469,170.51
期末可供分配基金份额利润	0.4247	0.1499	0.0130
期末基金资产净值	183,341,163.31	274,789,023.00	113,874,620.79
期末基金份额净值	1.4591	1.1910	1.0131
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	45.91%	19.10%	1.31%

2、南方沪深 300 指数增强 C

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	46,208,215.16	4,147,558.22	-4,213,167.87
本期利润	47,937,723.81	11,124,993.58	-5,131,612.64
加权平均基金份额本期利润	0.2922	0.1667	-0.1093
本期加权平均净值利润率	23.43%	15.50%	-10.02%
本期基金份额净值增长率	22.02%	17.10%	-9.62%
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	50,830,805.38	16,191,118.60	-100,167.22
期末可供分配基金份额利润	0.3918	0.1277	-0.0018
期末基金资产净值	185,028,163.05	148,117,012.57	56,418,918.16
期末基金份额净值	1.4263	1.1689	0.9982
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	42.63%	16.89%	-0.18%

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

南方沪深 300 指数增强 A

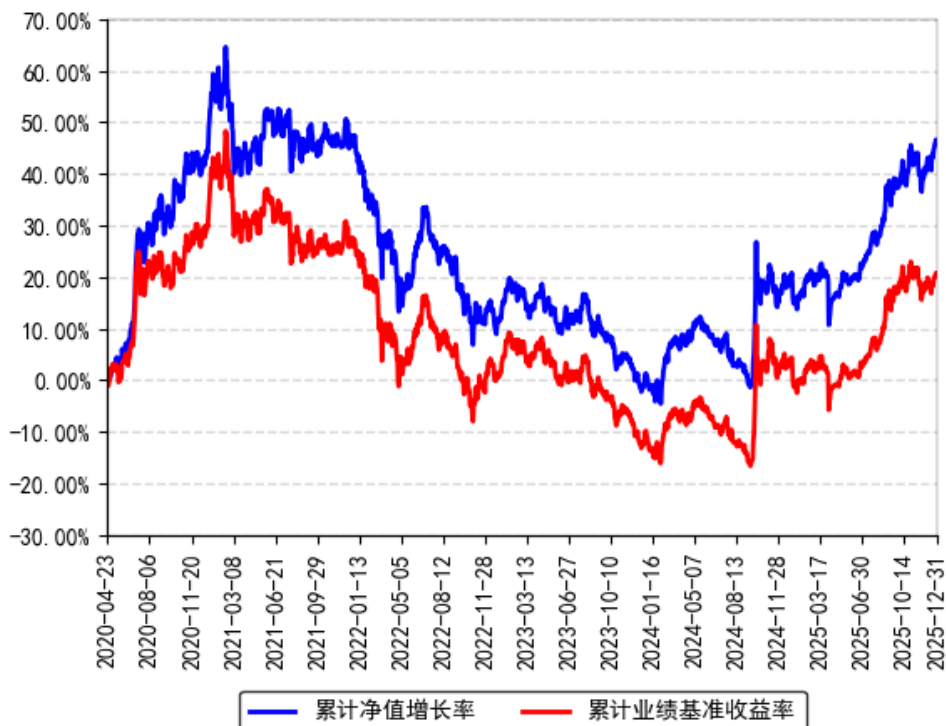
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.70%	0.92%	-0.20%	0.90%	3.90%	0.02%
过去六个月	19.33%	0.84%	16.72%	0.86%	2.61%	-0.02%
过去一年	22.51%	0.91%	16.79%	0.91%	5.72%	0.00%
过去三年	30.70%	0.96%	18.82%	1.02%	11.88%	-0.06%
过去五年	-2.12%	1.05%	-10.22%	1.08%	8.10%	-0.03%
自基金合同生效起至今	45.91%	1.07%	20.10%	1.09%	25.81%	-0.02%

南方沪深 300 指数增强 C

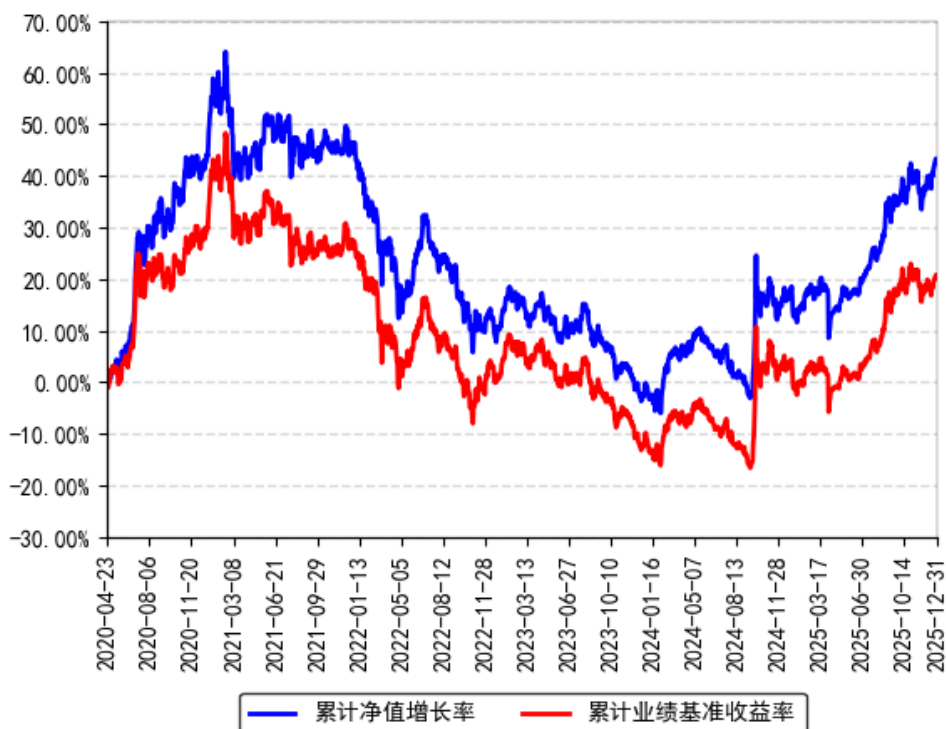
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.60%	0.91%	-0.20%	0.90%	3.80%	0.01%
过去六个月	19.10%	0.84%	16.72%	0.86%	2.38%	-0.02%
过去一年	22.02%	0.91%	16.79%	0.91%	5.23%	0.00%
过去三年	29.15%	0.96%	18.82%	1.02%	10.33%	-0.06%
过去五年	-4.06%	1.05%	-10.22%	1.08%	6.16%	-0.03%
自基金合同生效起至今	42.63%	1.07%	20.10%	1.09%	22.53%	-0.02%

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

南方沪深300指数增强A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

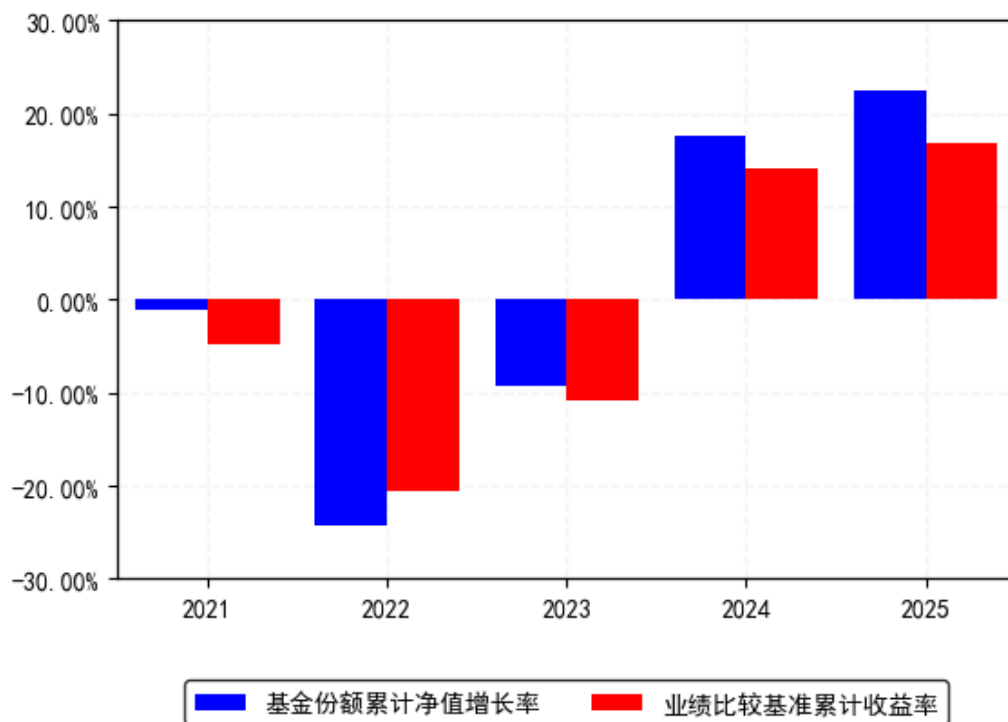


南方沪深300指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

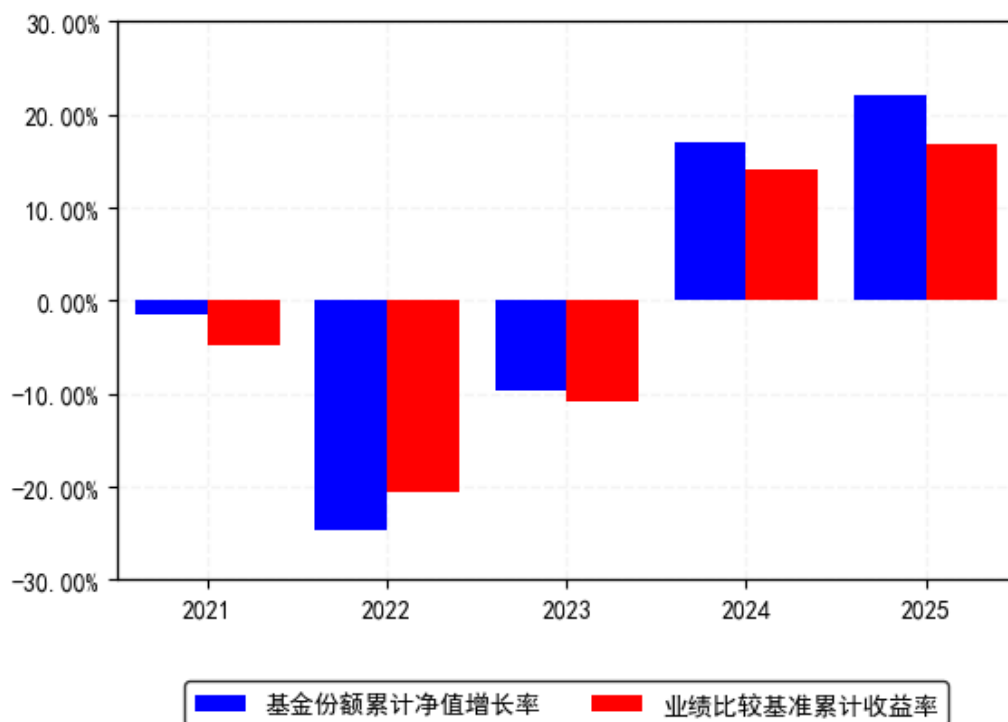


3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方沪深300指数增强A每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



南方沪深300指数增强C每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

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		
解锐	本基金基金经理	2022 年 2 月 18 日	-	8 年	中国国籍，清华大学金融专业硕士，具有基金从业资格。2017 年 7 月加入南方基金，任量化投资部量化研究员；2020 年 8 月 10 日至 2022 年 2 月 18 日，任投资经理；2022 年 2 月 18 日至今，任南方沪深 300 增强、大数据 300 基金经理；2024 年 12 月 6 日至今，任南方大数据 100 指数基金经理；2025 年 9 月 9 日至今，任南方中证 A500 指数增强基金经理。

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合规守信情况的说明

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

全年市场大幅上涨。具体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000、创业板指表现分别为 17.66%、30.39%、27.49% 和 49.57%。风格方面，成长好于价值，动量弱于反转，小盘好于大盘。行业层面，有色金属、通信和电子涨幅居前，分别上涨 94.73%、84.75%、47.88%。另一方面，食品饮料、煤炭、美容护理表现欠佳，分别录得 -9.69%、-5.72%、0.39%。资金方面，全年全 A 日均成交约 1.7 万亿，环比明显增长。两融余额约 2.6 万亿，较上年末大幅上行，融资买入占比回升。本基金投资以量化指数增强模型选股投资为主。量化选股股票投资部分：使用多因子，量化基本面，事件驱动等模型，以多策略融合模型进行股票投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.4591 元，报告期内，份额净值增长率为 22.51%，同期业绩基准增长率为 16.79%；本基金 C 份额净值为 1.4263 元，报告期内，份额净值增长率为 22.02%，同期业绩基准增长率为 16.79%。

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 年是十五五开局之年，是夯实基础、全面发力的关键年份。宏观经济预计平稳开局，伴随着反内卷政策的实施，上市公司的盈利基本面预计平稳修复。当前，估值处于中性合理位置。政策高度重视资本市场，长期资金或继续入市，市场流动性整体充裕，均有助于 A 股走强。结构上，关注具备高景气的泛科技行业、供需格局改善的材料和中游制造环节；部分消费品估值消化已较为充分，虽然增速欠佳但已出现左侧布局机会。本基金为指数增强基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度，力求实现在对沪深 300 指数有效跟踪的前提下，为投资者提供稳健的超额收益。

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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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	安永华明（2026）审字第 70027797_H86 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	南方沪深 300 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了南方沪深 300 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的南方沪深 300 指数增强型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，公允反映了南方沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于南方沪深 300 指数增强型证券投资基金，

	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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>南方沪深 300 指数增强型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，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<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沪深 300 指数增强型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沪深 300 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
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，就可能导致对南方沪深 300 指数增强型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沪深 300 指数增强型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。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
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：南方沪深 300 指数增强型证券投资基金

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	24,259,365.03	29,188,280.82
结算备付金		1,957,905.12	1,657,272.58
存出保证金		62,392.26	32,789.47
交易性金融资产	7.4.7.2	338,349,443.13	393,128,674.88
其中：股票投资		338,304,438.99	393,128,674.88
基金投资		-	-
债券投资		45,004.14	-
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		119,201.83	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,488,980.74	107,123.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		370,237,288.11	424,114,141.73
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		-	0.08
应付赎回款		1,350,371.49	684,283.61
应付管理人报酬		153,700.20	168,465.97
应付托管费		30,740.04	33,693.17
应付销售服务费		62,843.36	42,195.49
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.22	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	270,306.44	279,467.84
负债合计		1,867,961.75	1,208,106.16
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	255,374,574.91	357,443,116.58
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	112,994,751.45	65,462,918.99
净资产合计		368,369,326.36	422,906,035.57
负债和净资产总计		370,237,288.11	424,114,141.73

注 报告截止日 2025 年 12 月 31 日，南方沪深 300 指数增强 A 份额净值 1.4591 元，基金份额总额 125,651,340.59 份；南方沪深 300 指数增强 C 份额净值 1.4263 元，基金份额总额 129,723,234.32 份；总份额合计 255,374,574.91 份。

7.2 利润表

会计主体：南方沪深 300 指数增强型证券投资基金

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		101,418,149.11	37,235,839.17
1.利息收入		117,000.39	100,428.04
其中：存款利息收入	7.4.7.9	117,000.39	100,428.04
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）		91,520,911.36	16,735,679.34
其中：股票投资收益	7.4.7.10	80,204,520.24	10,737,057.75
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	11,591.25	1,402.82
资产支持证券投资	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	11,304,799.87	5,997,218.77
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	9,486,082.35	20,145,968.99
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	294,155.01	253,762.80
减：二、营业总支出		3,633,331.52	2,059,404.06

1.管理人报酬	7.4.10.2.1	2,197,387.69	1,171,952.19
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	439,477.57	234,390.44
3.销售服务费	7.4.10.2.3	812,142.48	286,793.44
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		0.02	-
8.其他费用	7.4.7.18	184,323.76	366,267.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		97,784,817.59	35,176,435.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		97,784,817.59	35,176,435.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		97,784,817.59	35,176,435.11

7.3 净资产变动表

会计主体：南方沪深 300 指数增强型证券投资基金

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	357,443,116.58	-	65,462,918.99	422,906,035.57
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	357,443,116.58	-	65,462,918.99	422,906,035.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-102,068,541.67	-	47,531,832.46	-54,536,709.21
（一）、综合收益总额	-	-	97,784,817.59	97,784,817.59
（二）、本期基金份额交易产	-102,068,541.67	-	-50,252,985.13	-152,321,526.80

生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	262,764,314.56	-	65,430,391.50	328,194,706.06
2.基金赎回款	-364,832,856.23	-	-115,683,376.63	-480,516,232.86
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	255,374,574.91	-	112,994,751.45	368,369,326.36
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	168,924,535.66	-	1,369,003.29	170,293,538.95
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	168,924,535.66	-	1,369,003.29	170,293,538.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	188,518,580.92	-	64,093,915.70	252,612,496.62
（一）、综合收益总额	-	-	35,176,435.11	35,176,435.11
（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）	188,518,580.92	-	28,917,480.59	217,436,061.51
其中：1.基金申购款	302,961,952.65	-	42,161,200.78	345,123,153.43
2.基金赎回款	-114,443,371.73	-	-13,243,720.19	-127,687,091.92
（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	357,443,116.58	-	65,462,918.99	422,906,035.57

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

南方沪深 300 指数增强型证券投资基金(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[2019]1755 号《关于准予南方沪深 300 指数增强型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《南方沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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 240,092,766.41 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(2020)第 0327 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 240,219,327.82 份基金份额,其中认购资金利息折合 126,561.41 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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用、不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票以及存托凭

证)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金管理人根据相关规定可参与转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:股票(含存托凭证)资产投资比例不低于基金资产的 90%,投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

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

本基金同一类别的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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。基金收益分配后任一类基金份额净

值不能低于面值,即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

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) 对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种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	24,259,365.03	29,188,280.82
等于：本金	24,256,875.00	29,185,154.33
加：应计利息	2,490.03	3,126.49
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	24,259,365.03	29,188,280.82

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	318,511,036.26	-	338,304,438.99	19,793,402.73
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	45,000.00	4.14	45,004.14
	银行间	-	-	-

	市场				
	合计	45,000.00	4.14	45,004.14	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		318,556,036.26	4.14	338,349,443.13	19,793,402.73
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		382,821,354.50	-	393,128,674.88	10,307,320.38
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		382,821,354.50	-	393,128,674.88	10,307,320.38

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。

7.4.7.4 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	889.04	315.09

应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	109,417.40	69,152.75
其中：交易所市场	109,417.40	69,152.75
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	160,000.00	160,000.00
应付指数使用费	-	50,000.00
合计	270,306.44	279,467.84

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方沪深 300 指数增强 A		
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	230,725,603.12	230,725,603.12
本期申购	58,637,818.33	58,637,818.33
本期赎回（以“-”号填列）	-163,712,080.86	-163,712,080.86
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	125,651,340.59	125,651,340.59

南方沪深 300 指数增强 C		
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	126,717,513.46	126,717,513.46
本期申购	204,126,496.23	204,126,496.23
本期赎回（以“-”号填列）	-201,120,775.37	-201,120,775.37
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	129,723,234.32	129,723,234.32

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

南方沪深 300 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34,586,671.33	9,476,748.55	44,063,419.88

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	34,586,671.33	9,476,748.55	44,063,419.88
本期利润	42,090,520.08	7,756,573.70	49,847,093.78
本期基金份额交易产生的变动数	-23,301,455.67	-12,919,235.27	-36,220,690.94
其中：基金申购款	14,287,218.99	1,546,596.20	15,833,815.19
基金赎回款	-37,588,674.66	-14,465,831.47	-52,054,506.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,375,735.74	4,314,086.98	57,689,822.72

南方沪深 300 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,191,118.60	5,208,380.51	21,399,499.11
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	16,191,118.60	5,208,380.51	21,399,499.11
本期利润	46,208,215.16	1,729,508.65	47,937,723.81
本期基金份额交易产生的变动数	-11,568,528.38	-2,463,765.81	-14,032,294.19
其中：基金申购款	38,504,644.96	11,091,931.35	49,596,576.31
基金赎回款	-50,073,173.34	-13,555,697.16	-63,628,870.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,830,805.38	4,474,123.35	55,304,928.73

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	100,159.88	76,103.04
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	11,904.13	22,447.16
其他	4,936.38	1,877.84
合计	117,000.39	100,428.04

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	80,204,520.24	10,737,057.75
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
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	80,204,520.24	10,737,057.75

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	2,546,733,772.04	913,342,126.16
减：卖出股票成本总额	2,464,445,030.42	901,443,430.07
减：交易费用	2,084,221.38	1,161,638.34
买卖股票差价收入	80,204,520.24	10,737,057.75

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

7.4.7.11 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	10.81	0.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	11,580.44	1,402.53
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	11,591.25	1,402.82

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	32,188.59	3,502.96
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	20,600.00	2,100.00
减：应计利息总额	6.87	0.29
减：交易费用	1.28	0.14
买卖债券差价收入	11,580.44	1,402.53

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

无。

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	11,304,799.87	5,997,218.77
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	11,304,799.87	5,997,218.77

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	9,486,082.35	20,145,968.99
——股票投资	9,486,082.35	20,145,968.99

——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-	-
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	9,486,082.35	20,145,968.99

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	194,358.35	209,065.04
基金转换费收入	99,796.66	44,697.76
合计	294,155.01	253,762.80

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	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	15,525.14	200,000.00
银行费用	8,789.15	6,245.02
其他	9.47	22.97
合计	184,323.76	366,267.99

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、登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
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
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	282,770,344.68	5.72%	206,852,566.95	10.20%
兴业证券	-	-	4,761,221.67	0.23%

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	-	-	1,352.91	38.62%

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	28,243.30	5.72%	4,403.41	4.02%
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	20,670.35	3.60%	6,397.28	9.25%
兴业证券	475.95	0.08%	-	-

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	2,197,387.69	1,171,952.19
其中：应支付销售机构的客户维护费	524,948.98	371,769.46
应支付基金管理人的净管理费	1,672,438.71	800,182.73

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% ÷ 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托 管费	439,477.57	234,390.44

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% \div \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方沪深 300 指数增 强 A	南方沪深 300 指数增 强 C	合计
华泰证券	-	3,571.62	3,571.62
南方基金	-	414,065.43	414,065.43
招商银行	-	43,799.92	43,799.92
合计	-	461,436.97	461,436.97
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方沪深 300 指数增 强 A	南方沪深 300 指数增 强 C	合计
华泰证券	-	3,006.05	3,006.05
南方基金	-	63,251.36	63,251.36
招商银行	-	33,926.00	33,926.00
合计	-	100,183.41	100,183.41

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.40\% \div \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

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
招商银行	24,259,365.03	100,159.88	29,188,280.82	76,103.04

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（单位：股/张）	总金额
华泰联合	600930	华电新能	网下申购	135,693	431,503.74
华泰联合	688802	沐曦股份	网下申购	1,484	155,315.44
华泰联合	301458	钧崑电子	网下申购	7,005	72,852.00
华泰联合	603014	威高血净	网下申购	2,045	54,192.50
华泰联合	688757	胜科纳米	网下申购	5,357	48,641.56
华泰联合	603092	德力佳	网下申购	846	39,491.28
华泰联合	603370	华新精科	网下申购	811	15,084.60
华泰联合	127110	广核转债	配债	80	8,000.00
兴业证券	301609	山大电力	网下申购	2,762	40,490.92

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	7,433	83,918.57
华泰联合	301622	英思特	网下申购	3,056	68,332.16

华泰联合	301606	绿联科技	网下申购	2,863	60,724.23
华泰联合	688709	成都华微	网下申购	3,413	53,549.97
华泰联合	301587	中瑞股份	网下申购	2,231	48,479.63
华泰联合	603341	龙旗科技	网下申购	945	24,570.00
华泰联合	603312	西典新能	网下申购	609	17,673.18
兴业证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80

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

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
600930	华电新能	2025 年 7 月 9 日	6 个月	新股锁定	3.18	6.24	94,986	302,055.48	592,712.64	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股锁定	114.28	416.02	1,280	146,278.40	532,505.60	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁定	104.66	399.40	965	100,996.90	385,421.00	-
301656	联合动力	2025 年 9 月 17 日	6 个月	新股锁定	12.48	25.46	3,051	38,076.48	77,678.46	-
001280	中国铀业	2025 年 11 月	6 个月	新股锁定	17.89	45.36	1,321	23,632.69	59,920.56	-

		月 25 日		期							
688729	屹唐股份	2025 年 7 月 1 日	6 个月	新 股 定 锁 期	8.45	24.28	2,197	18,564.65	53,343.16	-	
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	6 个月	新 股 定 锁 期	83.06	117.19	232	19,269.92	27,188.08	-	
688809	强一股份	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新 股 定 锁 期	85.09	203.31	107	9,104.63	21,754.17	-	
301638	南网数字	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新 股 定 锁 期	5.69	14.21	1,445	8,222.05	20,533.45	-	
688727	恒坤新材	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新 股 定 锁 期	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-	
688807	优迅股份	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新 股 定 锁 期	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-	
001386	马可波罗	2025 年 10 月 15 日	6 个月	新 股 定 锁 期	13.75	18.53	941	12,938.75	17,436.73	-	
301632	广东建科	2025 年 8 月 5 日	6 个月	新 股 定 锁 期	6.56	23.68	656	4,303.36	15,534.08	-	
688796	百奥赛图	2025 年 12 月 2 日	6 个月	新 股 定 锁 期	26.68	42.25	338	9,017.84	14,280.50	-	
301491	汉桑科技	2025 年 7 月 29 日	6 个月	新 股 定 锁 期	28.91	55.11	245	7,082.95	13,501.95	-	
688783	西安奕材	2025 年 10 月	6 个月	新 股 定 锁 期	8.62	18.36	677	5,835.74	12,429.72	-	

		月 20 日		期							
001233	海安集团	2025 年 11 月 18 日	6 个月	新 股 定 锁 期	48.00	51.88	232	11,136.00	12,036.16	-	
301584	建发致新	2025 年 9 月 18 日	6 个月	新 股 定 锁 期	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-	
301609	山大电力	2025 年 7 月 16 日	6 个月	新 股 定 锁 期	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-	
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新 股 定 锁 期	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-	
001221	悍高集团	2025 年 7 月 23 日	6 个月	新 股 定 锁 期	15.43	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-	
301667	纳百川	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新 股 定 锁 期	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-	
688805	健信超导	2025 年 12 月 17 日	6 个月	新 股 定 锁 期	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-	
603175	超颖电子	2025 年 10 月 17 日	6 个月	新 股 定 锁 期	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-	
001369	双欣环保	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新 股 定 锁 期	6.85	12.89	597	4,089.45	7,695.33	-	
603418	友升股份	2025 年 9 月 16 日	6 个月	新 股 定 锁 期	46.36	59.06	127	5,887.72	7,500.62	-	
301668	昊创瑞通	2025 年 9 月	6 个月	新 股 定 锁 期	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-	

		月 15 日		期							
301449	天溯计量	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新 股 定 锁 期	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-	
001285	瑞立科密	2025 年 9 月 23 日	6 个月	新 股 定 锁 期	42.28	56.08	122	5,158.16	6,841.76	-	
601026	道生天合	2025 年 10 月 9 日	6 个月	新 股 定 锁 期	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-	
301575	艾芬达	2025 年 9 月 3 日	6 个月	新 股 定 锁 期	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-	
603406	天富龙	2025 年 7 月 30 日	6 个月	新 股 定 锁 期	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-	
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	6 个月	新 股 定 锁 期	29.06	52.62	100	2,906.00	5,262.00	-	
603092	德力佳	2025 年 10 月 30 日	6 个月	新 股 定 锁 期	46.68	55.66	85	3,967.80	4,731.10	-	
603262	技源集团	2025 年 7 月 16 日	6 个月	新 股 定 锁 期	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-	
603248	锡华科技	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新 股 定 锁 期	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-	
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新 股 定 锁 期	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-	
603370	华新精科	2025 年 8 月	6 个月	新 股 定 锁 期	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-	

		月 27 日		期						
603376	大明电子	2025 年 10 月 28 日	6 个月	新 股 定 锁 期	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603334	丰倍生物	2025 年 10 月 29 日	6 个月	新 股 定 锁 期	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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: 张)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
111024	澳弘转债	2025 年 12 月 12 日	1-6 个月 (含)	配 债 未 上 市	100.00	100.01	450	45,000.00	45,004.14	-

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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	13,500	1,108,173.34	1,063,935.00	-
688012	中微公司	2025 年 12 月 19 日	重大事项停牌	283.75	2026 年 1 月 5 日	278.00	2,369	613,576.78	672,203.75	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。本基金为指数型基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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。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 0.01%（上期末：本基金无债券投资）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本期末，本基金的卖出回购金融资产款（若有）计息且利息金额不重大；除此之外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，该部分账面余额即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《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。

本基金的基金管理人对于基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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	24,259,365.03	-	-	-	24,259,365.03
结算备付金	1,957,905.12	-	-	-	1,957,905.12
存出保证金	62,392.26	-	-	-	62,392.26
交易性金融	-	-	45,004.14	338,304,438.	338,349,443.

资产				99	13
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	-	-	-	119,201.83	119,201.83
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	4,336.50	-	-	5,484,644.24	5,488,980.74
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	26,283,998.91	-	45,004.14	343,908,285.06	370,237,288.11
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,350,371.49	1,350,371.49
应付管理人报酬	-	-	-	153,700.20	153,700.20
应付托管费	-	-	-	30,740.04	30,740.04
应付销售服务费	-	-	-	62,843.36	62,843.36
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.22	0.22
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	270,306.44	270,306.44
负债总计	-	-	-	1,867,961.75	1,867,961.75
利率敏感度缺口	26,283,998.91	-	45,004.14	342,040,323.31	368,369,326.36

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	29,188,280.8 2	-	-	-	29,188,280.8 2
结算备付金	1,657,272.58	-	-	-	1,657,272.58
存出保证金	32,789.47	-	-	-	32,789.47
交易性金融资产	-	-	-	393,128,674. 88	393,128,674. 88
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	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	6,464.00	-	-	100,659.98	107,123.98
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	30,884,806.8 7	-	-	393,229,334. 86	424,114,141. 73
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	-	-	-	0.08	0.08
应付赎回款	-	-	-	684,283.61	684,283.61
应付管理人报酬	-	-	-	168,465.97	168,465.97
应付托管费	-	-	-	33,693.17	33,693.17
应付销售服务费	-	-	-	42,195.49	42,195.49
应付投资顾问	-	-	-	-	-

问费					
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税 负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	279,467.84	279,467.84
负债总计	-	-	-	1,208,106.16	1,208,106.16
利率敏感度 缺口	30,884,806.8 7	-	-	392,021,228. 70	422,906,035. 57

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	公允价值	占基金资产

		净值比例 (%)		净值比例 (%)
交易性金融资产- 股票投资	338,304,438.99	91.84	393,128,674.88	92.96
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	338,304,438.99	91.84	393,128,674.88	92.96

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%	17,934,664.27	19,325,802.06
	2.组合自身基准下降 5%	-17,934,664.27	-19,325,802.06

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	334,518,387.67	392,444,714.10
第二层次	1,781,142.89	272,494.50
第三层次	2,049,912.57	411,466.28
合计	338,349,443.13	393,128,674.88

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	-	411,466.28	411,466.28
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	953,381.28	953,381.28
转出第三层次	-	926,549.61	926,549.61
当期利得或损失总额	-	1,611,614.62	1,611,614.62
其中：计入损益的利得或损失	-	1,611,614.62	1,611,614.62
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,049,912.57	2,049,912.57
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	-	1,242,683.53	1,242,683.53
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	-	382,816.02	382,816.02
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	245,951.37	245,951.37
转出第三层次	-	479,602.88	479,602.88
当期利得或损失总额	-	262,301.77	262,301.77
其中：计入损益的利	-	262,301.77	262,301.77

得或损失			
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	411,466.28	411,466.28
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	-	244,896.82	244,896.82

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	2,049,912.57	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1628-3.0323	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
限售股票	411,466.28	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2665~4.9648	负相关

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	338,304,438.99	91.38
	其中：股票	338,304,438.99	91.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	45,004.14	0.01
	其中：债券	45,004.14	0.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	26,217,270.15	7.08
8	其他各项资产	5,670,574.83	1.53
9	合计	370,237,288.11	100.00

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	-	-
B	采矿业	22,839,458.00	6.20
C	制造业	159,100,153.30	43.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,781,587.64	2.38
E	建筑业	5,867,266.00	1.59
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	8,670,248.00	2.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,467,603.44	2.30
J	金融业	76,210,216.48	20.69
K	房地产业	899,334.00	0.24
L	租赁和商务服务业	6,386,886.00	1.73
M	科学研究和技术服务业	5,601,099.44	1.52
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	302,823,852.30	82.21

8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

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	63,581.00	0.02
B	采矿业	1,460,054.56	0.40
C	制造业	24,165,827.91	6.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,387,160.00	0.65
E	建筑业	64,722.00	0.02
F	批发和零售业	891,128.54	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	204,484.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,369,878.55	0.64
J	金融业	1,436,783.00	0.39
K	房地产业	327,926.00	0.09
L	租赁和商务服务业	488,400.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	368,871.34	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	559,283.79	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	345,216.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	347,270.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	35,480,586.69	9.63

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	300750	宁德时代	36,300	13,331,538.00	3.62
2	601318	中国平安	169,600	11,600,640.00	3.15
3	601899	紫金矿业	303,500	10,461,645.00	2.84
4	600519	贵州茅台	6,200	8,538,516.00	2.32

5	300308	中际旭创	8,900	5,429,000.00	1.47
6	000333	美的集团	66,500	5,196,975.00	1.41
7	002142	宁波银行	181,820	5,107,323.80	1.39
8	600183	生益科技	68,800	4,913,008.00	1.33
9	600415	小商品城	305,800	4,877,510.00	1.32
10	300502	新易盛	11,200	4,825,856.00	1.31
11	601628	中国人寿	100,600	4,577,300.00	1.24
12	600919	江苏银行	434,500	4,518,800.00	1.23
13	601138	工业富联	69,863	4,334,999.15	1.18
14	601601	中国太保	102,700	4,304,157.00	1.17
15	603993	洛阳钼业	208,800	4,176,000.00	1.13
16	603259	药明康德	44,771	4,058,043.44	1.10
17	600066	宇通客车	123,313	4,032,335.10	1.09
18	601336	新华保险	56,700	3,951,990.00	1.07
19	600690	海尔智家	151,300	3,947,417.00	1.07
20	600019	宝钢股份	504,800	3,760,760.00	1.02
21	600011	华能国际	499,800	3,728,508.00	1.01
22	600030	中信证券	125,600	3,605,976.00	0.98
23	600926	杭州银行	219,652	3,356,282.56	0.91
24	601166	兴业银行	156,700	3,300,102.00	0.90
25	600989	宝丰能源	165,590	3,250,531.70	0.88
26	002475	立讯精密	56,500	3,204,115.00	0.87
27	601398	工商银行	380,400	3,016,572.00	0.82
28	600309	万华化学	38,900	2,982,852.00	0.81
29	600362	江西铜业	53,100	2,916,252.00	0.79
30	002916	深南电路	12,200	2,833,938.00	0.77
31	600887	伊利股份	93,300	2,668,380.00	0.72
32	600150	中国船舶	77,700	2,584,302.00	0.70
33	002415	海康威视	85,900	2,563,256.00	0.70
34	605499	东鹏饮料	9,370	2,505,444.30	0.68
35	000895	双汇发展	94,200	2,493,474.00	0.68
36	002938	鹏鼎控股	48,600	2,458,188.00	0.67
37	000157	中联重科	274,937	2,372,706.31	0.64
38	601211	国泰海通	112,100	2,303,655.00	0.63
39	300408	三环集团	49,100	2,246,325.00	0.61
40	000063	中兴通讯	59,300	2,243,912.00	0.61
41	601009	南京银行	195,700	2,236,851.00	0.61
42	600276	恒瑞医药	36,900	2,198,133.00	0.60
43	600039	四川路桥	215,240	2,141,638.00	0.58
44	000792	盐湖股份	75,100	2,114,816.00	0.57
45	601857	中国石油	202,400	2,106,984.00	0.57
46	601319	中国人保	234,100	2,095,195.00	0.57
47	600176	中国巨石	122,500	2,094,750.00	0.57

48	000100	TCL 科技	446,800	2,028,472.00	0.55
49	002736	国信证券	150,201	1,970,637.12	0.53
50	601328	交通银行	260,400	1,887,900.00	0.51
51	002028	思源电气	12,100	1,870,539.00	0.51
52	300442	润泽科技	34,000	1,795,200.00	0.49
53	300033	同花顺	5,500	1,771,990.00	0.48
54	601117	中国化学	234,400	1,765,032.00	0.48
55	603296	华勤技术	19,200	1,742,208.00	0.47
56	601288	农业银行	213,800	1,641,984.00	0.45
57	000338	潍柴动力	90,700	1,560,040.00	0.42
58	300059	东方财富	66,800	1,548,424.00	0.42
59	300274	阳光电源	9,000	1,539,360.00	0.42
60	002074	国轩高科	39,300	1,537,023.00	0.42
61	600795	国电电力	304,700	1,535,688.00	0.42
62	601816	京沪高铁	298,000	1,534,700.00	0.42
63	688256	寒武纪	1,130	1,531,771.50	0.42
64	002027	分众传媒	204,800	1,509,376.00	0.41
65	002236	大华股份	78,600	1,488,684.00	0.40
66	603501	豪威集团	11,800	1,485,620.00	0.40
67	601919	中远海控	97,100	1,473,978.00	0.40
68	600941	中国移动	14,400	1,455,120.00	0.40
69	688111	金山办公	4,442	1,364,004.94	0.37
70	601939	建设银行	144,300	1,339,104.00	0.36
71	601229	上海银行	130,700	1,320,070.00	0.36
72	688271	联影医疗	10,285	1,290,767.50	0.35
73	600027	华电国际	260,200	1,290,592.00	0.35
74	688008	澜起科技	10,828	1,275,538.40	0.35
75	300347	泰格医药	22,100	1,253,070.00	0.34
76	600160	巨化股份	31,300	1,202,546.00	0.33
77	000776	广发证券	54,000	1,189,080.00	0.32
78	603799	华友钴业	17,400	1,187,724.00	0.32
79	002463	沪电股份	15,210	1,111,394.70	0.30
80	000725	京东方 A	263,200	1,108,072.00	0.30
81	601088	中国神华	27,200	1,101,600.00	0.30
82	600900	长江电力	39,800	1,082,162.00	0.29
83	603019	中科曙光	12,600	1,079,064.00	0.29
84	002050	三花智控	19,500	1,078,545.00	0.29
85	002049	紫光国微	13,500	1,063,935.00	0.29
86	002625	光启技术	20,800	1,014,208.00	0.28
87	000975	山金国际	41,500	1,009,695.00	0.27
88	600009	上海机场	30,100	986,076.00	0.27
89	600233	圆通速递	58,200	955,644.00	0.26
90	002600	领益智造	60,300	937,062.00	0.25

91	601100	恒立液压	8,500	934,235.00	0.25
92	601077	渝农商行	143,600	927,656.00	0.25
93	601998	中信银行	116,100	893,970.00	0.24
94	000708	中信特钢	54,400	890,528.00	0.24
95	601390	中国中铁	164,600	890,486.00	0.24
96	600482	中国动力	42,700	883,890.00	0.24
97	601872	招商轮船	97,800	878,244.00	0.24
98	688041	海光信息	3,882	871,159.62	0.24
99	001979	招商蛇口	98,600	851,904.00	0.23
100	600031	三一重工	39,500	834,635.00	0.23
101	601600	中国铝业	67,800	828,516.00	0.22
102	600015	华夏银行	120,500	827,835.00	0.22
103	002648	卫星化学	46,800	827,424.00	0.22
104	601066	中信建投	29,300	784,361.00	0.21
105	688981	中芯国际	6,207	762,405.81	0.21
106	600938	中国海油	25,000	754,500.00	0.20
107	600584	长电科技	20,300	746,634.00	0.20
108	601995	中金公司	20,800	728,000.00	0.20
109	601658	邮储银行	132,400	721,580.00	0.20
110	002493	荣盛石化	60,900	713,139.00	0.19
111	603986	兆易创新	3,300	707,025.00	0.19
112	601898	中煤能源	55,800	694,152.00	0.19
113	600050	中国联通	135,800	693,938.00	0.19
114	300394	天孚通信	3,400	690,302.00	0.19
115	002594	比亚迪	7,030	686,971.60	0.19
116	000977	浪潮信息	10,200	679,320.00	0.18
117	601825	沪农商行	72,500	673,525.00	0.18
118	688012	中微公司	2,369	672,203.75	0.18
119	600741	华域汽车	33,600	672,000.00	0.18
120	600406	国电南瑞	29,400	660,912.00	0.18
121	601808	中海油服	46,300	650,052.00	0.18
122	601186	中国铁建	82,400	632,008.00	0.17
123	601988	中国银行	109,600	628,008.00	0.17
124	300628	亿联网络	17,600	627,440.00	0.17
125	300124	汇川技术	8,300	625,239.00	0.17
126	300999	金龙鱼	21,200	609,288.00	0.17
127	000538	云南白药	10,610	602,223.60	0.16
128	002241	歌尔股份	20,900	600,457.00	0.16
129	600930	华电新能	94,986	592,712.64	0.16
130	601225	陕西煤业	27,800	592,696.00	0.16
131	601881	中国银河	37,100	583,212.00	0.16
132	688009	中国通号	102,725	561,905.75	0.15
133	002601	龙佰集团	28,400	556,072.00	0.15

134	600023	浙能电力	111,500	551,925.00	0.15
135	605117	德业股份	6,400	551,680.00	0.15
136	000568	泸州老窖	4,700	546,234.00	0.15
137	002311	海大集团	9,814	543,499.32	0.15
138	603288	海天味业	14,600	540,492.00	0.15
139	000651	格力电器	13,300	534,926.00	0.15
140	000938	紫光股份	21,200	521,520.00	0.14
141	600875	东方电气	21,400	519,592.00	0.14
142	002422	科伦药业	17,700	519,495.00	0.14
143	600377	宁沪高速	42,700	517,097.00	0.14
144	600115	中国东航	80,900	485,400.00	0.13
145	300014	亿纬锂能	7,200	473,472.00	0.13
146	601818	光大银行	125,800	439,042.00	0.12
147	000408	藏格矿业	5,200	438,880.00	0.12
148	601668	中国建筑	85,400	438,102.00	0.12
149	601111	中国国航	46,500	435,705.00	0.12
150	300413	芒果超媒	17,500	427,350.00	0.12
151	600029	南方航空	51,400	411,714.00	0.11
152	601766	中国中车	60,200	410,564.00	0.11
153	600600	青岛啤酒	6,700	410,040.00	0.11
154	300476	胜宏科技	1,400	402,612.00	0.11
155	600000	浦发银行	32,100	399,324.00	0.11
156	600547	山东黄金	10,200	394,842.00	0.11
157	688187	时代电气	7,372	378,109.88	0.10
158	600188	兖矿能源	28,200	370,830.00	0.10
159	601021	春秋航空	6,200	368,900.00	0.10
160	000768	中航西飞	14,400	365,472.00	0.10
161	601877	正泰电器	12,800	356,992.00	0.10
162	600111	北方稀土	7,700	355,124.00	0.10
163	302132	中航成飞	4,400	347,600.00	0.09
164	600346	恒力石化	15,300	344,709.00	0.09
165	688126	沪硅产业	15,672	339,142.08	0.09
166	600660	福耀玻璃	5,003	324,044.31	0.09
167	600219	南山铝业	59,300	319,034.00	0.09
168	000166	申万宏源	58,400	307,768.00	0.08
169	600489	中金黄金	13,100	306,016.00	0.08
170	688506	百利天恒	918	296,605.80	0.08
171	600809	山西汾酒	1,700	291,890.00	0.08
172	300759	康龙化成	10,200	289,986.00	0.08
173	601689	拓普集团	3,700	285,566.00	0.08
174	300316	晶盛机电	7,700	282,975.00	0.08
175	600061	国投资本	36,100	276,165.00	0.07
176	000425	徐工机械	23,800	275,604.00	0.07

177	600522	中天科技	14,800	268,176.00	0.07
178	000630	铜陵有色	44,500	267,445.00	0.07
179	002001	新和成	10,400	261,976.00	0.07
180	000301	东方盛虹	22,500	245,025.00	0.07
181	688396	华润微	4,601	243,208.86	0.07
182	301236	软通动力	5,000	237,150.00	0.06
183	688472	阿特斯	15,714	234,295.74	0.06
184	601728	中国电信	36,700	231,210.00	0.06
185	600372	中航机载	17,200	230,824.00	0.06
186	600760	中航沈飞	4,000	224,600.00	0.06
187	600026	中远海能	19,100	223,088.00	0.06
188	000807	云铝股份	6,700	220,028.00	0.06
189	601298	青岛港	25,700	214,338.00	0.06
190	601878	浙商证券	19,600	211,876.00	0.06
191	002709	天赐材料	4,400	203,852.00	0.06
192	600016	民生银行	52,600	201,458.00	0.05
193	000001	平安银行	17,600	200,816.00	0.05
194	601169	北京银行	36,500	200,020.00	0.05
195	601916	浙商银行	64,600	196,384.00	0.05
196	601838	成都银行	12,100	195,052.00	0.05
197	600426	华鲁恒升	6,100	191,723.00	0.05
198	600018	上港集团	34,200	185,364.00	0.05
199	300803	指南针	1,300	170,131.00	0.05
200	688082	盛美上海	966	170,064.30	0.05
201	000983	山西焦煤	25,000	160,500.00	0.04
202	600438	通威股份	7,100	145,692.00	0.04
203	002459	晶澳科技	12,400	141,980.00	0.04
204	688036	传音控股	1,704	112,736.64	0.03
205	300832	新产业	1,900	106,875.00	0.03
206	300979	华利集团	2,000	100,420.00	0.03
207	688169	石头科技	618	93,973.08	0.03
208	000596	古井贡酒	600	79,560.00	0.02
209	603260	合盛硅业	1,400	73,780.00	0.02
210	600585	海螺水泥	3,300	72,138.00	0.02
211	002460	赣锋锂业	1,100	69,179.00	0.02
212	600028	中国石化	9,700	59,946.00	0.02
213	600089	特变电工	2,400	53,328.00	0.01
214	601058	赛轮轮胎	3,200	51,776.00	0.01
215	000002	万科 A	10,200	47,430.00	0.01
216	600893	航发动力	900	36,027.00	0.01
217	601360	三六零	3,200	35,744.00	0.01
218	002230	科大讯飞	700	35,203.00	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	603806	福斯特	120,300	1,679,388.00	0.46
2	300953	震裕科技	6,900	1,159,338.00	0.31
3	600549	厦门钨业	27,600	1,133,256.00	0.31
4	002284	亚太股份	68,800	1,027,184.00	0.28
5	603444	吉比特	2,400	1,017,240.00	0.28
6	600578	京能电力	140,800	718,080.00	0.19
7	603486	科沃斯	8,500	685,780.00	0.19
8	688183	生益电子	7,059	675,475.71	0.18
9	300573	兴齐眼药	8,800	618,552.00	0.17
10	002039	黔源电力	34,000	617,780.00	0.17
11	600988	赤峰黄金	17,900	559,196.00	0.15
12	688072	拓荆科技	1,641	541,530.00	0.15
13	688795	摩尔线程	1,280	532,505.60	0.14
14	301345	涛涛车业	2,100	527,772.00	0.14
15	600153	建发股份	52,800	488,400.00	0.13
16	601168	西部矿业	15,600	431,184.00	0.12
17	600118	中国卫星	4,500	427,275.00	0.12
18	600867	通化东宝	51,500	420,755.00	0.11
19	601958	金钼股份	26,300	409,754.00	0.11
20	601128	常熟银行	58,100	409,024.00	0.11
21	688802	沐曦股份	965	385,421.00	0.10
22	301219	腾远钴业	5,600	382,368.00	0.10
23	002448	中原内配	28,500	368,505.00	0.10
24	603379	三美股份	6,000	364,320.00	0.10
25	002487	大金重工	7,000	363,510.00	0.10
26	301267	华夏眼科	19,200	345,216.00	0.09
27	000800	一汽解放	49,700	336,966.00	0.09
28	002913	奥士康	7,500	320,550.00	0.09
29	002558	巨人网络	7,400	320,346.00	0.09
30	601019	山东出版	35,700	308,448.00	0.08
31	601865	福莱特	19,100	299,297.00	0.08
32	600801	华新建材	12,100	296,934.00	0.08
33	600166	福田汽车	94,900	277,108.00	0.08
34	600998	九州通	53,600	274,432.00	0.07
35	603233	大参林	15,200	267,824.00	0.07
36	000543	皖能电力	33,300	264,735.00	0.07

37	300604	长川科技	2,600	263,406.00	0.07
38	002414	高德红外	17,200	252,324.00	0.07
39	600873	梅花生物	23,400	237,042.00	0.06
40	688466	金科环境	14,354	233,539.58	0.06
41	601665	齐鲁银行	40,100	230,174.00	0.06
42	002182	宝武镁业	14,900	227,970.00	0.06
43	600236	桂冠电力	28,500	223,155.00	0.06
44	600995	南网储能	17,700	222,489.00	0.06
45	002080	中材科技	6,000	218,040.00	0.06
46	300644	南京聚隆	5,700	210,387.00	0.06
47	002008	大族激光	5,100	210,069.00	0.06
48	603156	养元饮品	7,200	207,000.00	0.06
49	688525	佰维存储	1,786	205,014.94	0.06
50	000582	北部湾港	21,800	204,484.00	0.06
51	603699	纽威股份	3,900	202,683.00	0.06
52	300083	创世纪	21,900	201,699.00	0.05
53	300972	万辰集团	1,000	201,070.00	0.05
54	688671	碧兴物联	7,952	196,971.04	0.05
55	301308	江波龙	800	195,872.00	0.05
56	002677	浙江美大	23,200	193,720.00	0.05
57	601577	长沙银行	19,900	193,030.00	0.05
58	688553	汇宇制药	10,840	192,843.60	0.05
59	688610	埃科光电	3,077	190,189.37	0.05
60	601963	重庆银行	17,400	188,442.00	0.05
61	301295	美硕科技	6,300	187,740.00	0.05
62	300743	天地数码	8,400	187,488.00	0.05
63	688156	路德科技	11,638	186,324.38	0.05
64	002849	威星智能	11,700	186,030.00	0.05
65	603081	大丰实业	13,200	185,196.00	0.05
66	688296	和达科技	13,920	184,440.00	0.05
67	300550	和仁科技	12,700	184,277.00	0.05
68	002811	郑中设计	12,400	184,016.00	0.05
69	300835	龙磁科技	2,800	183,624.00	0.05
70	603590	康辰药业	4,600	182,850.00	0.05
71	603950	长源东谷	6,300	182,385.00	0.05
72	688116	天奈科技	3,853	181,668.95	0.05
73	603629	利通电子	6,800	181,220.00	0.05
74	002839	张家港行	39,500	180,515.00	0.05
75	605058	澳弘电子	5,900	180,068.00	0.05
76	300566	激智科技	9,700	177,995.00	0.05
77	002612	朗姿股份	8,700	177,828.00	0.05
78	601528	瑞丰银行	31,000	176,700.00	0.05
79	600332	白云山	6,700	172,458.00	0.05

80	603506	南都物业	12,800	167,168.00	0.05
81	002863	今飞凯达	28,400	166,708.00	0.05
82	605033	美邦股份	8,300	166,664.00	0.05
83	000893	亚钾国际	3,400	163,098.00	0.04
84	301358	湖南裕能	2,500	161,650.00	0.04
85	688618	三旺通信	5,673	151,242.18	0.04
86	600780	通宝能源	26,300	149,384.00	0.04
87	301038	深水规院	6,300	147,735.00	0.04
88	001389	广合科技	1,800	146,934.00	0.04
89	002101	广东鸿图	11,600	142,912.00	0.04
90	300183	东软载波	8,800	130,504.00	0.04
91	000988	华工科技	1,600	126,928.00	0.03
92	605198	安德利	3,200	120,384.00	0.03
93	600848	上海临港	10,100	118,170.00	0.03
94	688677	海泰新光	2,733	117,956.28	0.03
95	300602	飞荣达	3,500	116,060.00	0.03
96	002421	达实智能	38,500	109,725.00	0.03
97	688681	科汇股份	6,223	109,400.34	0.03
98	600378	昊华科技	3,400	108,664.00	0.03
99	300232	洲明科技	15,200	107,768.00	0.03
100	605580	恒盛能源	4,700	106,032.00	0.03
101	300451	创业慧康	21,400	103,576.00	0.03
102	688778	厦钨新能	1,305	100,967.85	0.03
103	300474	景嘉微	1,400	100,618.00	0.03
104	688599	天合光能	6,076	100,557.80	0.03
105	688159	有方科技	2,078	100,450.52	0.03
106	301095	广立微	1,400	100,394.00	0.03
107	000729	燕京啤酒	8,500	95,455.00	0.03
108	002850	科达利	600	94,716.00	0.03
109	002859	洁美科技	3,400	93,840.00	0.03
110	002624	完美世界	5,600	91,784.00	0.02
111	601991	大唐发电	24,500	85,505.00	0.02
112	300303	聚飞光电	12,400	84,816.00	0.02
113	688069	德林海	3,781	84,807.83	0.02
114	603529	爱玛科技	2,700	80,190.00	0.02
115	688188	柏楚电子	573	77,864.97	0.02
116	000597	东北制药	14,900	77,778.00	0.02
117	301656	联合动力	3,051	77,678.46	0.02
118	300689	澄天伟业	1,700	76,415.00	0.02
119	002727	一心堂	5,900	75,874.00	0.02
120	002396	星网锐捷	2,500	75,750.00	0.02
121	688113	联测科技	1,886	74,553.58	0.02
122	601799	星宇股份	600	74,022.00	0.02

123	688329	艾隆科技	3,431	73,045.99	0.02
124	688067	爱威科技	2,920	71,715.20	0.02
125	000761	本钢板材	21,300	71,355.00	0.02
126	000030	富奥股份	12,100	69,454.00	0.02
127	688798	艾为电子	912	69,412.32	0.02
128	600487	亨通光电	2,800	69,244.00	0.02
129	600392	盛和资源	3,200	68,896.00	0.02
130	603659	璞泰来	2,500	68,350.00	0.02
131	002273	水晶光电	2,700	67,824.00	0.02
132	603920	世运电路	1,400	67,774.00	0.02
133	600131	国网信通	4,100	66,174.00	0.02
134	688123	聚辰股份	524	65,803.92	0.02
135	000811	冰轮环境	3,500	64,820.00	0.02
136	600502	安徽建工	13,800	64,722.00	0.02
137	300552	万集科技	2,100	63,756.00	0.02
138	300970	华绿生物	3,100	63,581.00	0.02
139	600737	中粮糖业	3,500	60,235.00	0.02
140	300450	先导智能	1,200	59,976.00	0.02
141	300184	力源信息	6,000	59,940.00	0.02
142	001280	中国铀业	1,321	59,920.56	0.02
143	600517	国网英大	9,800	58,898.00	0.02
144	301316	慧博云通	1,300	58,084.00	0.02
145	002815	崇达技术	4,100	56,006.00	0.02
146	000826	启迪环境	24,600	54,612.00	0.01
147	688729	屹唐股份	2,197	53,343.16	0.01
148	600223	福瑞达	7,200	52,992.00	0.01
149	003012	东鹏控股	8,000	52,400.00	0.01
150	688021	奥福科技	2,791	51,214.85	0.01
151	688609	九联科技	4,983	50,876.43	0.01
152	688636	智明达	1,149	49,223.16	0.01
153	300428	立中集团	2,000	46,700.00	0.01
154	600746	江苏索普	6,600	45,408.00	0.01
155	002636	金安国纪	2,700	45,117.00	0.01
156	301002	崧盛股份	1,200	43,692.00	0.01
157	002842	翔鹭钨业	3,000	43,380.00	0.01
158	603283	赛腾股份	1,000	43,320.00	0.01
159	600736	苏州高新	6,300	42,588.00	0.01
160	000612	焦作万方	3,800	41,876.00	0.01
161	688595	芯海科技	1,271	41,688.80	0.01
162	601801	皖新传媒	5,900	38,822.00	0.01
163	603299	苏盐井神	3,600	37,512.00	0.01
164	600288	大恒科技	2,500	37,450.00	0.01
165	688138	清溢光电	1,319	37,143.04	0.01

166	002778	中晟高科	1,700	35,938.00	0.01
167	688316	青云科技	589	35,440.13	0.01
168	000589	贵州轮胎	6,800	35,224.00	0.01
169	603186	华正新材	700	34,720.00	0.01
170	688790	昂瑞微	232	27,188.08	0.01
171	688809	强一股份	107	21,754.17	0.01
172	301638	南网数字	1,445	20,533.45	0.01
173	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.01
174	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
175	001386	马可波罗	941	17,436.73	0.00
176	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
177	688796	百奥赛图	338	14,280.50	0.00
178	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
179	688783	西安奕材	677	12,429.72	0.00
180	001233	海安集团	232	12,036.16	0.00
181	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
182	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
183	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
184	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
185	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
186	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
187	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
188	001369	双欣环保	597	7,695.33	0.00
189	603418	友升股份	127	7,500.62	0.00
190	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
191	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
192	001285	瑞立科密	122	6,841.76	0.00
193	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
194	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
195	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
196	688765	禾元生物	100	5,262.00	0.00
197	603092	德力佳	85	4,731.10	0.00
198	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
199	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
200	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
201	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
202	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
203	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	601899	紫金矿业	22,884,022.00	5.41
2	300750	宁德时代	21,730,060.40	5.14
3	601318	中国平安	18,964,297.13	4.48
4	601328	交通银行	17,707,176.00	4.19
5	000333	美的集团	17,616,291.00	4.17
6	000725	京东方 A	16,893,334.80	3.99
7	000651	格力电器	15,902,733.00	3.76
8	600519	贵州茅台	15,881,848.00	3.76
9	601601	中国太保	15,382,093.00	3.64
10	600919	江苏银行	15,235,057.00	3.60
11	000776	广发证券	15,073,779.00	3.56
12	603259	药明康德	14,855,133.00	3.51
13	601766	中国中车	14,698,982.00	3.48
14	300502	新易盛	14,406,875.60	3.41
15	000100	TCL 科技	14,350,265.00	3.39
16	600926	杭州银行	14,168,710.00	3.35
17	601628	中国人寿	14,148,536.00	3.35
18	002594	比亚迪	13,982,310.92	3.31
19	601166	兴业银行	13,913,948.00	3.29
20	601138	工业富联	13,841,217.41	3.27
21	600660	福耀玻璃	13,814,393.45	3.27
22	600066	宇通客车	13,462,908.30	3.18
23	002142	宁波银行	13,459,339.50	3.18
24	601229	上海银行	13,092,610.28	3.10
25	601600	中国铝业	13,089,486.00	3.10
26	002028	思源电气	12,986,238.00	3.07
27	002475	立讯精密	12,853,580.00	3.04
28	300033	同花顺	12,733,651.00	3.01
29	600887	伊利股份	12,496,118.00	2.95
30	600030	中信证券	12,186,952.95	2.88
31	600406	国电南瑞	12,087,136.00	2.86
32	600031	三一重工	12,086,130.00	2.86
33	600547	山东黄金	11,916,925.20	2.82
34	600415	小商品城	11,798,328.54	2.79
35	601211	国泰海通	11,791,382.76	2.79
36	600690	海尔智家	11,759,987.00	2.78
37	603993	洛阳钼业	11,705,130.00	2.77
38	601398	工商银行	11,578,120.00	2.74
39	600011	华能国际	11,557,251.00	2.73
40	601336	新华保险	11,448,570.00	2.71
41	000807	云铝股份	11,422,488.00	2.70

42	002463	沪电股份	11,391,821.60	2.69
43	601838	成都银行	11,342,113.00	2.68
44	601668	中国建筑	11,176,802.00	2.64
45	000338	潍柴动力	11,054,361.00	2.61
46	002648	卫星化学	11,021,623.00	2.61
47	601857	中国石油	10,936,519.00	2.59
48	600276	恒瑞医药	10,855,053.00	2.57
49	600050	中国联通	10,622,987.00	2.51
50	601009	南京银行	10,615,893.00	2.51
51	300308	中际旭创	10,582,647.00	2.50
52	601319	中国人保	10,549,470.00	2.49
53	002714	牧原股份	10,476,638.72	2.48
54	600941	中国移动	10,446,333.00	2.47
55	600989	宝丰能源	10,414,613.00	2.46
56	600176	中国巨石	10,354,203.00	2.45
57	000975	山金国际	10,301,529.00	2.44
58	002415	海康威视	10,240,639.00	2.42
59	000858	五粮液	10,184,689.00	2.41
60	688256	寒武纪	10,024,470.85	2.37
61	300274	阳光电源	9,946,867.00	2.35
62	600219	南山铝业	9,801,798.00	2.32
63	600183	生益科技	9,766,478.62	2.31
64	601728	中国电信	9,734,072.00	2.30
65	600019	宝钢股份	9,703,615.00	2.29
66	300059	东方财富	9,696,719.00	2.29
67	000538	云南白药	9,647,840.00	2.28
68	000425	徐工机械	9,388,306.00	2.22
69	688111	金山办公	9,303,747.48	2.20
70	600938	中国海油	9,274,523.00	2.19
71	600900	长江电力	9,151,940.00	2.16
72	002236	大华股份	9,138,971.93	2.16
73	300408	三环集团	9,053,280.00	2.14
74	601658	邮储银行	9,020,770.00	2.13
75	002001	新和成	8,943,727.12	2.11
76	600016	民生银行	8,870,502.00	2.10
77	603288	海天味业	8,856,195.25	2.09
78	300124	汇川技术	8,796,248.00	2.08
79	000938	紫光股份	8,693,796.00	2.06
80	601901	方正证券	8,629,066.00	2.04
81	300760	迈瑞医疗	8,501,863.00	2.01

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	601899	紫金矿业	24,118,235.99	5.70
2	601318	中国平安	22,955,619.50	5.43
3	300750	宁德时代	22,515,062.80	5.32
4	002594	比亚迪	21,879,372.00	5.17
5	000725	京东方 A	19,528,139.60	4.62
6	600519	贵州茅台	19,454,199.00	4.60
7	000333	美的集团	18,929,878.53	4.48
8	300502	新易盛	18,219,157.00	4.31
9	000776	广发证券	17,847,467.00	4.22
10	000651	格力电器	17,638,544.00	4.17
11	002001	新和成	17,442,657.00	4.12
12	601601	中国太保	16,690,755.00	3.95
13	600660	福耀玻璃	16,351,292.16	3.87
14	601328	交通银行	16,291,700.00	3.85
15	601766	中国中车	16,062,610.21	3.80
16	002714	牧原股份	15,686,192.36	3.71
17	603259	药明康德	15,646,164.15	3.70
18	000807	云铝股份	15,294,387.00	3.62
19	601319	中国人保	15,196,391.00	3.59
20	600000	浦发银行	15,174,779.00	3.59
21	601166	兴业银行	14,815,914.00	3.50
22	600219	南山铝业	14,667,053.00	3.47
23	601919	中远海控	13,842,350.80	3.27
24	601628	中国人寿	13,781,748.00	3.26
25	002028	思源电气	13,456,362.00	3.18
26	600031	三一重工	13,292,520.00	3.14
27	601211	国泰海通	13,266,312.98	3.14
28	600547	山东黄金	13,182,964.18	3.12
29	601138	工业富联	12,971,246.00	3.07
30	300274	阳光电源	12,954,815.00	3.06
31	688256	寒武纪	12,947,904.08	3.06
32	601398	工商银行	12,923,183.00	3.06
33	600887	伊利股份	12,891,201.00	3.05
34	600900	长江电力	12,830,320.00	3.03
35	601600	中国铝业	12,707,891.00	3.00
36	000858	五粮液	12,686,930.00	3.00
37	601229	上海银行	12,594,321.62	2.98
38	601857	中国石油	12,592,140.00	2.98

39	600406	国电南瑞	12,567,115.92	2.97
40	000100	TCL 科技	12,491,034.00	2.95
41	002475	立讯精密	12,411,035.00	2.93
42	600919	江苏银行	12,381,191.00	2.93
43	601336	新华保险	12,092,726.00	2.86
44	601728	中国电信	12,033,048.18	2.85
45	600276	恒瑞医药	12,005,197.48	2.84
46	601288	农业银行	11,968,237.00	2.83
47	601668	中国建筑	11,966,345.00	2.83
48	688041	海光信息	11,827,406.39	2.80
49	601838	成都银行	11,798,851.00	2.79
50	605499	东鹏饮料	11,675,663.00	2.76
51	603993	洛阳钼业	11,675,519.00	2.76
52	300033	同花顺	11,574,752.00	2.74
53	600926	杭州银行	11,507,304.67	2.72
54	000338	潍柴动力	11,160,444.00	2.64
55	600938	中国海油	11,083,967.00	2.62
56	600050	中国联通	10,939,434.00	2.59
57	600176	中国巨石	10,831,873.77	2.56
58	002463	沪电股份	10,752,720.00	2.54
59	601009	南京银行	10,744,755.00	2.54
60	002142	宁波银行	10,733,736.96	2.54
61	600941	中国移动	10,674,835.00	2.52
62	600030	中信证券	10,615,927.70	2.51
63	601658	邮储银行	10,535,849.00	2.49
64	000975	山金国际	10,514,269.00	2.49
65	002352	顺丰控股	10,488,766.00	2.48
66	601988	中国银行	10,438,469.00	2.47
67	600066	宇通客车	10,400,525.00	2.46
68	603799	华友钴业	10,354,815.00	2.45
69	002371	北方华创	10,260,478.22	2.43
70	000425	徐工机械	10,176,977.00	2.41
71	000001	平安银行	10,088,587.00	2.39
72	300433	蓝思科技	10,005,105.00	2.37
73	300059	东方财富	9,836,459.24	2.33
74	600690	海尔智家	9,782,062.00	2.31
75	000538	云南白药	9,764,142.98	2.31
76	002648	卫星化学	9,714,258.00	2.30
77	603288	海天味业	9,712,868.42	2.30
78	601169	北京银行	9,671,374.06	2.29
79	601225	陕西煤业	9,364,118.00	2.21
80	688981	中芯国际	9,317,156.71	2.20
81	300628	亿联网络	9,265,877.00	2.19

82	600016	民生银行	9,259,646.00	2.19
83	601881	中国银河	9,229,768.00	2.18
84	600415	小商品城	9,223,751.00	2.18
85	300124	汇川技术	9,184,707.00	2.17
86	300308	中际旭创	8,998,883.80	2.13
87	002236	大华股份	8,923,832.00	2.11
88	300408	三环集团	8,844,006.00	2.09
89	601901	方正证券	8,754,112.00	2.07
90	601633	长城汽车	8,726,815.94	2.06
91	300760	迈瑞医疗	8,722,708.00	2.06
92	600958	东方证券	8,720,356.28	2.06
93	002415	海康威视	8,690,275.00	2.05
94	601877	正泰电器	8,627,397.00	2.04
95	600183	生益科技	8,587,689.00	2.03
96	688111	金山办公	8,572,402.17	2.03

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	2,400,134,712.18
卖出股票收入（成交）总额	2,546,733,772.04

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	45,004.14	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	45,004.14	0.01

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产净值 比例 (%)
1	111024	澳弘转债	450	45,004.14	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，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。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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中,宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行宁波市分行的处罚。除上述证券的发行主体外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

对上述证券的投资决策程序的说明:本基金为指数型基金,因复制指数被动持有,上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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	62,392.26
2	应收清算款	119,201.83
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,488,980.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,670,574.83

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

份额级别	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
南方沪深 300 指数增强 A	4,465	28,141.40	34,151,291.44	27.18%	91,500,049.15	72.82%
南方沪深 300 指数增强 C	3,346	38,769.65	86,452,231.54	66.64%	43,271,002.78	33.36%
合计	7,811	32,694.22	120,603,522.98	47.23%	134,771,051.93	52.77%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方沪深 300 指数增强 A	275,531.98	0.2193%
	南方沪深 300 指数增强 C	477,572.78	0.3681%
	合计	753,104.76	0.2949%

注：分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	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	南方沪深 300 指数增强 A	0
	南方沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	南方沪深 300 指数增强 A	0~10
	南方沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方沪深 300 指数增强 A	南方沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日(2020 年 4 月 23 日)基金份额总额	207,317,769.06	32,901,558.76
本报告期期初基金份额总额	230,725,603.12	126,717,513.46
本报告期基金总申购份额	58,637,818.33	204,126,496.23
减：本报告期基金总赎回份额	163,712,080.86	201,120,775.37
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	125,651,340.59	129,723,234.32

§ 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。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

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。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内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 40,000.00 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，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	3	2,119,692,063.14	42.88%	211,723.79	42.89%	-
中信建投	2	1,488,219,713.46	30.11%	148,653.79	30.11%	-
招商证券	1	562,679,910.80	11.38%	56,199.75	11.38%	-
华泰证券	3	282,770,344.68	5.72%	28,243.30	5.72%	-
中金公司	1	248,944,021.21	5.04%	24,862.39	5.04%	-
银河证券	1	174,767,249.56	3.54%	17,448.45	3.53%	-
广发证券	1	65,744,794.08	1.33%	6,569.39	1.33%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	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
方正证券	27,610.50	85.78%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
银河证券	4,578.09	14.22%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会	2025-01-04

		基金电子披露网站	
3	关于南方基金管理股份有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-19
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-20
5	关于南方基金管理股份有限公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-26
6	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
7	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-05-14
8	关于南方基金管理股份有限公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-06-06
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-07-11
10	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-07-11
11	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-07-18
12	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-08-29
13	关于南方基金管理股份有限公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-09-04
14	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-11-01
15	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-12-11
16	关于南方基金管理股份有限公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-12-23

§ 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	20250114-20250915	62,419,212.33	67,006,163.64	129,425,375.97	-	-
机构	2	20250101-20250507,20250611-20251231	81,988,530.95	83,754,323.39	81,988,530.95	83,754,323.39	32.80%
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沪深 300 指数增强型证券投资基金的文件；
- 2、《南方沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方沪深 300 指数增强型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、《南方沪深 300 指数增强型证券投资基金 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>