

# 南方中证 1000 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：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 .....	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 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
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 .....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
4.9 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 .....	14
§ 6 审计报告 .....	14
6.1 审计报告基本信息 .....	15
6.2 审计报告的基本内容 .....	15
§ 7 年度财务报表 .....	17
7.1 资产负债表 .....	17
7.2 利润表 .....	18
7.3 净资产变动表 .....	19
7.4 报表附注 .....	21
§ 8 投资组合报告 .....	60
8.1 期末基金资产组合情况 .....	60
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	60
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 .....	61

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	108
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	110
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 .....	110
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 .....	110
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 .....	110
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 .....	111
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	111
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	111
8.12 投资组合报告附注 .....	111
§ 9 基金份额持有人信息 .....	112
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	112
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	113
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	113
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 .....	113
§ 10 开放式基金份额变动 .....	113
§ 11 重大事件揭示 .....	114
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	114
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 .....	114
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	114
11.4 基金投资策略的改变 .....	114
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	114
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	114
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	116
11.8 其他重大事件 .....	117
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	118
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 .....	119
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	119
§ 13 备查文件目录 .....	119
13.1 备查文件目录 .....	119
13.2 存放地点 .....	119
13.3 查阅方式 .....	120

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 1000ETF
场内简称	中证 1000ETF 南方
基金主代码	512100
交易代码	512100
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2016 年 9 月 29 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	25,651,217,646.00 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	2016 年 11 月 4 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	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
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

	大厦 32-42 楼	
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	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
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	11,921,270,913.35	9,718,234,129.89	-206,484,218.25
本期利润	19,483,925,401.60	12,174,500,187.63	-195,824,808.82
加权平均基金份额本期利润	0.7983	0.7860	-0.0493
本期加权平均净值利润率	29.67%	35.80%	-1.91%
本期基金份额净值增长率	29.23%	2.10%	-5.54%
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	8,825,170,715.10	-7,002,922,771.78	-1,409,579,027.13
期末可供分配基金份额利润	0.3440	-0.3147	-0.3645
期末基金资产净值	78,996,456,091.95	53,872,818,371.16	9,169,553,589.41
期末基金份额净值	3.0796	2.4209	2.3711
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	14.37%	-11.50%	-13.32%

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	0.51%	1.13%	0.27%	1.13%	0.24%	0.00%
过去六个月	20.16%	1.11%	19.49%	1.11%	0.67%	0.00%
过去一年	29.23%	1.39%	27.49%	1.39%	1.74%	0.00%
过去三年	24.64%	1.56%	20.91%	1.56%	3.73%	0.00%

过去五年	21.95%	1.50%	14.28%	1.50%	7.67%	0.00%
自基金合同生效起至今	14.37%	1.48%	-11.60%	1.49%	25.97%	-0.01%

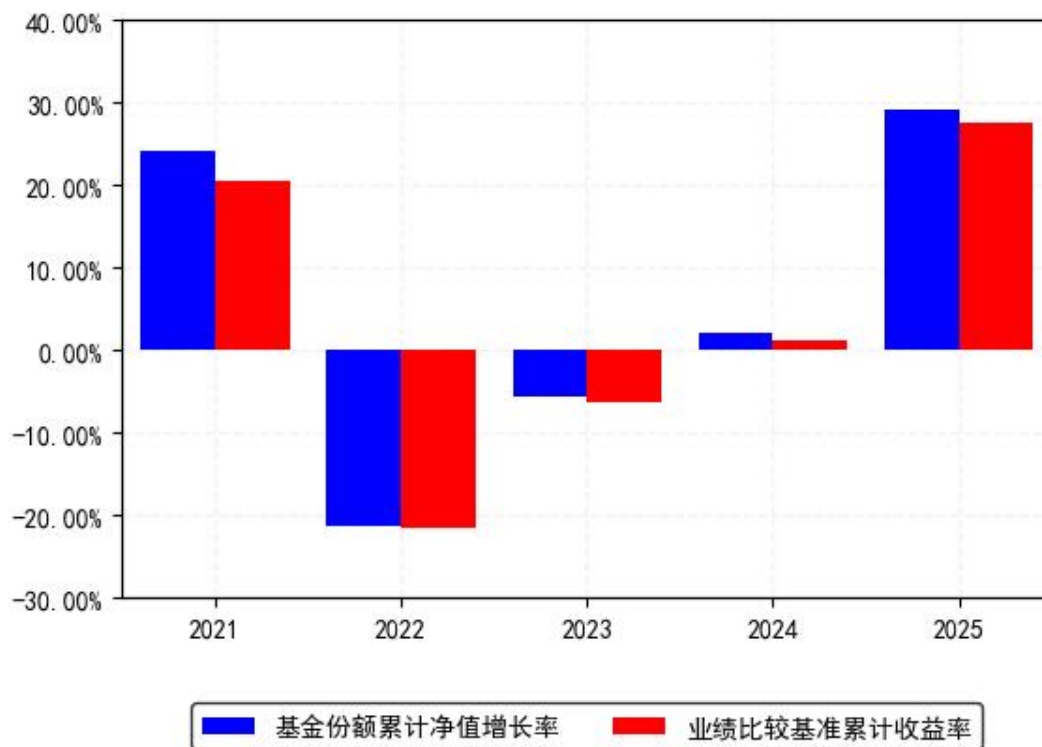
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方中证1000ETF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

南方中证1000ETF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

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2025 年	0.3700	845,347,054.72	-	845,347,054.72	-
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
合计	0.3700	845,347,054.72	-	845,347,054.72	-

## § 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	2019年7月12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

报告期内，中证 1000 指数涨 27.49%。期间我们通过自建的指数化交易系统、日内择时交易模型、跟踪误差归因分析系统、ETF 现金流精算系统等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

(1) 大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

(2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

(3) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；

(4) 报告期内，我们根据指数定期的成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

#### 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 3.0796 元，报告期内，份额净值增长率为 29.23%，同期业绩基准增长率为 27.49%。

#### 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。

中证 1000 指数去年在牛市初期大幅跑输大盘成长指数（如创业板指和科创 50），自四季度开始大市值相对小市值的超额收益开始收敛。历史上中小盘指数在牛市中具备后端发力的潜能，且目前整个经济处于复苏周期，政策支持力度较大，中证 1000 以新兴行业为主，前五大行业为电子、医药、机械、计算机和基础化工，能较好反映中国经济转型升级的大环境。因为我们对中证 1000 指数的上半年走势较为乐观。

#### 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

本报告期内本基金进行了收益分配，符合法律法规和基金合同约定。具体如下：

权益登记日 2025 年 1 月 14 日，每 10 份基金份额分红数 0.3700。

#### 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遵规守信、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_H40 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 1000 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 1000 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 1000 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 1000 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 1000 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 1000 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。在编制财务报表时，管理层负责评估南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督南方中证 1000 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，就可能对南方中证 1000 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 1000 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。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>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）</p>

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 1000 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	220,940,588.06	170,215,322.31
结算备付金		1,438,123,747.69	732,760,603.64
存出保证金		230,285,443.41	137,982,008.76
交易性金融资产	7.4.7.2	77,174,913,024.99	52,919,663,438.62
其中：股票投资		77,161,417,207.62	52,919,663,438.62
基金投资		-	-
债券投资		13,495,817.37	-
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		34,248,630.04	53,269,754.26
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		79,098,511,434.19	54,013,891,127.59
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		-	5,902,092.90
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,618,006.24	7,204,671.93
应付托管费		3,206,002.09	2,401,557.31
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		691,926.49	4,996,618.26
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	88,539,407.42	120,567,816.03
负债合计		102,055,342.24	141,072,756.43
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	70,171,285,376.85	60,875,741,142.94
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	8,825,170,715.10	-7,002,922,771.78
净资产合计		78,996,456,091.95	53,872,818,371.16
负债和净资产总计		79,098,511,434.19	54,013,891,127.59

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.0796 元，基金份额总额 25,651,217,646.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方中证 1000 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		19,620,381,873.82	12,366,269,875.54
1.利息收入		15,560,323.61	17,694,876.80
其中：存款利息收入	7.4.7.9	15,560,323.61	9,866,696.09
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		-	7,828,180.71

2.投资收益（损失以“-”填列）		11,948,355,265.24	10,105,522,736.84
其中：股票投资收益	7.4.7.10	10,749,485,250.64	9,490,944,581.50
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	22,079,868.02	1,981,330.74
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	456,570,267.92	211,117,848.00
股利收益	7.4.7.15	720,219,878.66	401,478,976.60
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	7,562,654,488.25	2,456,266,057.74
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	93,811,796.72	-213,213,795.84
减：二、营业总支出		136,456,472.22	191,769,687.91
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	98,283,007.20	149,276,144.03
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	32,761,002.43	31,143,194.21
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		1,646,017.36	789,614.19
8.其他费用	7.4.7.18	3,766,445.23	10,560,735.48
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		19,483,925,401.60	12,174,500,187.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		19,483,925,401.60	12,174,500,187.63
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		19,483,925,401.60	12,174,500,187.63

### 7.3 净资产变动表

会计主体：南方中证 1000 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	60,875,741,142.94	-	-7,002,922,771.78	53,872,818,371.16
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	60,875,741,142.94	-	-7,002,922,771.78	53,872,818,371.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	9,295,544,233.91	-	15,828,093,486.88	25,123,637,720.79
(一)、综合收益总额	-	-	19,483,925,401.60	19,483,925,401.60
(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)	9,295,544,233.91	-	-2,810,484,860.00	6,485,059,373.91
其中：1.基金申购款	119,200,719,096.62	-	-6,573,765,006.25	112,626,954,090.37
2.基金赎回款	-109,905,174,862.71	-	3,763,280,146.25	-106,141,894,716.46
(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)	-	-	-845,347,054.72	-845,347,054.72
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	70,171,285,376.85	-	8,825,170,715.10	78,996,456,091.95
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	10,579,132,616.54	-	-1,409,579,027.13	9,169,553,589.41
加：会计政策变更	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	10,579,132,616.54	-	-1,409,579,027.13	9,169,553,589.41
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	50,296,608,526.40	-	-5,593,343,744.65	44,703,264,781.75
(一)、综合收益总额	-	-	12,174,500,187.63	12,174,500,187.63
(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)	50,296,608,526.40	-	-17,767,843,932.28	32,528,764,594.12
其中：1.基金申购款	178,661,563,336.15	-	-38,441,982,800.12	140,219,580,536.03
2.基金赎回款	-128,364,954,809.75	-	20,674,138,867.84	-107,690,815,941.91
(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	60,875,741,142.94	-	-7,002,922,771.78	53,872,818,371.16

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 1000 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[2016]366 号《关于准予南方中证 1000 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(原南方基

金管理有限公司,已于 2018 年 1 月 4 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 1000 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 587,892,000.00 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(2016)第 1149 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 587,892,000.00 份,无认购资金利息折份额。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。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2016]264 号审核同意,本基金 587,892,000.00 份基金份额于 2016 年 11 月 4 日在上交所挂牌交易。

根据《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《南方基金管理股份有限公司关于南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额合并结果的公告》的有关规定,本基金的基金管理人确定 2022 年 9 月 2 日为本基金的基金份额合并日。当日合并前基金份额总额为 10,207,092,000 份,基金份额净值为 0.9910 元。根据基金份额合并公式,基金份额合并比例为 0.36555,合并后基金份额总额为 3,731,217,646 份,基金份额净值为 2.7109 元。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述合并比例,对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了合并,并于 2022 年 9 月 2 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证 1000 指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化;主要投资范围为标的指数的成份股和备选成份股;此外,本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、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)。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。基金管理人根据相关规定可参与转融通证券出借业务。本基金可投资于存托凭证。在正常市场情况下,力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为:中证 1000 指数。

本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“南方中证 1000 联接基金”)。南方中证 1000 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人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。由于基金份额合并引起的实收基金份额变动于基金份额合并日根据合并前的基金份额数及确定的合并比例计算认列。

#### 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	220,940,588.06	170,215,322.31
等于：本金	220,916,072.32	170,189,314.08
加：应计利息	24,515.74	26,008.23
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	220,940,588.06	170,215,322.31

#### 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		67,724,551,009.73	-	77,161,417,207.62	9,436,866,197.89
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	8,970,600.00	534.37	13,495,817.37	4,524,683.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,970,600.00	534.37	13,495,817.37	4,524,683.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		67,733,521,609.73	534.37	77,174,913,024.99	9,441,390,880.89
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		50,906,439,812.99	-	52,919,663,438.62	2,013,223,625.63
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		50,906,439,812.99	-	52,919,663,438.62	2,013,223,625.63

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,713,682,126.50	-	-	-
-股指期货	1,713,682,126.50	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,713,682,126.50	-	-	-
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	962,549,679.49	-	-	-
—股指期货	962,549,679.49	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	962,549,679.49	-	-	-

## 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
IM2601	IM2601	417.00	632,138,640.00	35,347,553.50
IM2603	IM2603	795.00	1,182,801,000.00	65,909,960.00
合计				101,257,513.50
减：可抵销期货暂收款				101,257,513.50
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	4,182,457.86	8,720,615.46
其中：交易所市场	4,182,457.86	8,720,615.46
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应退退补款	83,330,389.75	104,324,360.86
预提费用	220,000.00	200,000.00
应付指数使用费	-	4,536,912.37
可退替代款	806,559.81	2,785,927.34
合计	88,539,407.42	120,567,816.03

**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	22,253,217,646.00	60,875,741,142.94
本期申购	43,574,000,000.00	119,200,719,096.62
本期赎回（以“-”号填列）	-40,176,000,000.00	-109,905,174,862.71
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	25,651,217,646.00	70,171,285,376.85

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	10,595,763,772.54	-17,598,686,544.32	-7,002,922,771.78
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	10,595,763,772.54	-17,598,686,544.32	-7,002,922,771.78
本期利润	11,921,270,913.35	7,562,654,488.25	19,483,925,401.60
本期基金份额交易产生的变动数	2,090,295,380.21	-4,900,780,240.21	-2,810,484,860.00
其中：基金申购款	26,148,809,587.35	-32,722,574,593.60	-6,573,765,006.25
基金赎回款	-24,058,514,207.14	27,821,794,353.39	3,763,280,146.25
本期已分配利润	-845,347,054.72	-	-845,347,054.72
本期末	23,761,983,011.38	-14,936,812,296.28	8,825,170,715.10

#### 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	1,055,401.55	784,132.94
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	14,424,769.71	8,896,272.97
其他	80,152.35	186,290.18
合计	15,560,323.61	9,866,696.09

#### 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	6,961,047,759.16	7,037,171,370.84
股票投资收益——赎回差价收入	3,788,437,491.48	2,453,773,210.66
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	10,749,485,250.64	9,490,944,581.50

##### 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	78,893,599,093.95	80,456,839,255.13
减：卖出股票成本总额	71,866,263,361.88	73,349,903,648.67
减：交易费用	66,287,972.91	69,764,235.62
买卖股票差价收入	6,961,047,759.16	7,037,171,370.84

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	106,141,894,716.46	107,690,815,941.91
减：现金支付赎回款总额	58,777,444,849.46	60,687,083,738.91
减：赎回股票成本总额	43,576,012,375.52	44,549,958,992.34
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	3,788,437,491.48	2,453,773,210.66

#### 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	4,885.42	3,413.50
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付）差 价收入	22,074,982.60	1,977,917.24
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	22,079,868.02	1,981,330.74

##### 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	75,907,817.04	33,529,908.04

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	53,825,300.00	31,547,000.00
减：应计利息总额	4,498.00	3,650.45
减：交易费用	3,036.44	1,340.35
买卖债券差价收入	22,074,982.60	1,977,917.24

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	456,570,267.92	211,117,848.00

#### 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	720,219,878.66	401,478,976.60
其中：证券出借权益补偿收入	-	8,959,988.87
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	720,219,878.66	401,478,976.60

#### 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	7,428,167,255.26	2,487,908,022.94
——股票投资	7,423,642,572.26	2,487,908,022.94
——债券投资	4,524,683.00	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	134,487,232.99	-31,641,965.20
——权证投资	-	-

——期货投资	134,487,232.99	-31,641,965.20
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	7,562,654,488.25	2,456,266,057.74

#### 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	93,811,796.72	-213,213,795.84
合计	93,811,796.72	-213,213,795.84

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	100,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	3,493,612.96	10,308,932.17
银行费用	52,832.27	51,803.31
合计	3,766,445.23	10,560,735.48

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

无。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本基金的基金管理人已发布的本基金分红公告，向截至 2026 年 1 月 16 日止登记在册的全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.4100 元。

### 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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	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
南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(南方中证 1000ETF 发起联接)	本基金的基金管理人管理的其他基金
华泰长城资本管理有限公司	基金管理人的股东华泰证券控制的公司

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	74,893,794,150.27	45.77%	34,610,161,745.69	19.23%

#### 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	25,277,998.49	33.30%	1,352,312.39	4.03%

#### 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	7,482,616.60	45.75%	1,396,216.81	33.38%
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	3,459,615.68	19.23%	2,922,886.02	33.52%

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	98,283,007.20	149,276,144.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,806,879.81	2,205,342.42
应支付基金管理人的净管理费	93,476,127.39	147,070,801.61

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 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% ÷ 当年天数。

自 2024 年 11 月 20 日起本基金管理费年费率由 0.50% 调整为 0.15%。

#### 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	32,761,002.43	31,143,194.21

管费		
----	--	--

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：

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

自 2024 年 11 月 20 日起本基金托管费年费率由 0.10% 调整为 0.05%。

#### 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

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	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-

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	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	3,250,466,027.00	1.1~3.5	1.28	1,639,252.76	-	-

#### 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
华泰长城资本管理有限 公司	-	-	848,500.00	0.00%
华泰证券股份有限公司	16,306,667.00	0.06%	120,982,787.0 0	0.54%
兴业证券股份有限公司	779,343.00	0.00%	38,483,643.00	0.17%
招商银行股份有限公司 —南方中证 1000 交易型 开放式指数证券投资基 金发起式联接基金	248,877,585.0 0	0.97%	424,678,785.0 0	1.91%

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
招商银行	220,940,588.06	1,055,401.55	170,215,322.31	784,132.94

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	113697	应流转债	配债	94,550	9,455,000.00
华泰联合	118062	天准转债	配债	39,700	3,970,000.00
华泰联合	600930	华电新能	网下申购	363,650	1,156,407.00
华泰联合	301458	钧威电子	网下申购	7,005	72,852.00
华泰联合	688802	沐曦股份	网下申购	675	70,645.50
华泰联合	603092	德力佳	网下申购	1,454	67,872.72
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	603370	华新精科	网下申购	811	15,084.60
兴业证券	123263	鼎捷转债	配债	50,006	5,000,600.00
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	688709	成都华微	网下申购	10,448	163,929.12
华泰联合	301606	绿联科技	网下申购	3,959	83,970.39
华泰联合	688605	先锋精科	网下申购	7,433	83,918.57
华泰联合	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
华泰联合	301622	英思特	网下申购	3,056	68,332.16
华泰联合	301587	中瑞股份	网下申购	3,056	66,406.88
华泰联合	603312	西典新能	网下申购	1,296	37,609.92
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

单位：人民币元

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2025 年 1 月 14 日	2025 年 1 月 15 日	-	0.3700	845,347,054.72	-	845,347,054.72	-
合计	-	-	-	0.3700	845,347,054.72	-	845,347,054.72	-

注：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
603119	浙江荣泰	2025 年 12 月 9 日	6 个月	大宗受限锁定	87.24	103.85	600,000	52,344,000.00	62,310,000.00	-

		日								
600577	精达股份	2025年12月3日	6个月	大宗受限锁定	9.34	11.45	2,000,000	18,680,000.00	22,900,000.00	-
600577	精达股份	2025年12月4日	6个月	大宗受限锁定	9.04	11.45	1,600,000	14,464,000.00	18,320,000.00	-
600577	精达股份	2025年11月28日	6个月	大宗受限锁定	9.50	11.45	1,000,000	9,500,000.00	11,450,000.00	-
603667	五洲新春	2025年12月8日	6个月	大宗受限锁定	44.64	63.41	400,000	17,856,000.00	25,364,000.00	-
603667	五洲新春	2025年12月5日	6个月	大宗受限锁定	42.69	63.44	300,000	12,807,000.00	19,032,000.00	-
300045	华力创通	2025年11月7日	6个月	大宗受限锁定	21.92	26.88	1,000,000	21,920,000.00	26,880,000.00	-
300045	华力创通	2025年11月25日	6个月	大宗受限锁定	21.02	26.74	500,000	10,510,000.00	13,370,000.00	-
688205	德科立	2025年12月9日	6个月	大宗受限锁定	140.00	116.38	300,000	42,000,000.00	34,914,000.00	-
300850	新强联	2025年12月8日	6个月	大宗受限锁定	43.45	38.23	600,000	26,070,000.00	22,938,000.00	-
300850	新强联	2025年11月11日	6个月	大宗受限锁定	44.17	38.40	200,000	8,834,000.00	7,680,000.00	-
603360	百傲化学	2025年11月28日	6个月	大宗受限锁定	30.32	29.66	600,000	18,192,000.00	17,796,000.00	-

		日								
603360	百傲化学	2025年12月2日	6个月	大宗受限锁定	28.68	29.63	400,000	11,472,000.00	11,852,000.00	-
600641	先导基电	2025年12月8日	6个月	大宗受限锁定	15.00	16.53	1,750,000	26,250,000.00	28,927,500.00	-
301029	怡合达	2025年12月3日	6个月	大宗受限锁定	23.70	24.97	1,000,000	23,700,000.00	24,970,000.00	-
301510	固高科技	2025年12月3日	6个月	大宗受限锁定	29.34	34.46	650,000	19,071,000.00	22,399,000.00	-
600105	永鼎股份	2025年12月5日	6个月	大宗受限锁定	14.78	22.39	1,000,000	14,780,000.00	22,390,000.00	-
688321	微芯生物	2025年11月19日	6个月	大宗受限锁定	25.11	27.64	500,000	12,555,000.00	13,820,000.00	-
688321	微芯生物	2025年11月25日	6个月	大宗受限锁定	24.20	27.36	300,000	7,260,000.00	8,208,000.00	-
002378	章源钨业	2025年11月7日	6个月	大宗受限锁定	12.15	13.10	1,000,000	12,150,000.00	13,100,000.00	-
002378	章源钨业	2025年12月8日	6个月	大宗受限锁定	11.93	12.95	500,000	5,965,000.00	6,475,000.00	-
300337	银邦股份	2025年11月11日	6个月	大宗受限锁定	9.06	14.24	800,000	7,248,000.00	11,392,000.00	-
300337	银邦股份	2025年11月20日	6个月	大宗受限锁定	8.83	14.23	500,000	4,415,000.00	7,115,000.00	-

		日								
688206	概伦电子	2025年11月18日	6个月	大宗受限锁定	30.00	31.78	300,000	9,000,000.00	9,534,000.00	-
688206	概伦电子	2025年11月6日	6个月	大宗受限锁定	31.62	32.00	200,000	6,324,000.00	6,400,000.00	-
603698	航天工程	2025年12月10日	6个月	大宗受限锁定	20.80	35.49	430,000	8,944,000.00	15,260,700.00	-
301487	盟固利	2025年11月28日	6个月	大宗受限锁定	21.20	20.36	600,000	12,720,000.00	12,216,000.00	-
301487	盟固利	2025年12月4日	6个月	大宗受限锁定	20.00	20.35	140,000	2,800,000.00	2,849,000.00	-
002892	科力尔	2025年11月3日	6个月	大宗受限锁定	12.47	12.86	300,000	3,741,000.00	3,858,000.00	-
002892	科力尔	2025年11月5日	6个月	大宗受限锁定	12.34	12.85	300,000	3,702,000.00	3,855,000.00	-
002892	科力尔	2025年11月20日	6个月	大宗受限锁定	11.62	12.84	300,000	3,486,000.00	3,852,000.00	-
002892	科力尔	2025年11月25日	6个月	大宗受限锁定	11.62	12.84	180,000	2,091,600.00	2,311,200.00	-
000935	四川双马	2025年11月19日	6个月	大宗受限锁定	18.81	23.48	500,000	9,405,000.00	11,740,000.00	-
002755	奥赛康	2025年12月4日	6个月	大宗受限锁定	15.35	15.41	750,000	11,512,500.00	11,557,500.00	-

		日								
001339	智微智能	2025年12月11日	6个月	大宗受限锁定	45.90	47.64	220,000	10,098,000.00	10,480,800.00	-
301551	无线传媒	2025年12月5日	6个月	大宗受限锁定	28.71	29.80	300,000	8,613,000.00	8,940,000.00	-
603327	福蓉科技	2025年12月8日	6个月	大宗受限锁定	11.54	10.11	800,000	9,232,000.00	8,088,000.00	-
688165	埃夫特	2025年12月12日	6个月	大宗受限锁定	18.87	22.11	300,000	5,661,000.00	6,633,000.00	-
001236	弘业期货	2025年11月11日	6个月	大宗受限锁定	10.09	10.17	600,000	6,054,000.00	6,102,000.00	-
600930	华电新能	2025年7月9日	6个月	新锁定期	3.18	6.24	254,555	809,484.90	1,588,423.20	-
688783	西安奕材	2025年10月20日	6个月	新锁定期	8.62	18.36	14,790	127,489.80	271,544.40	-
301656	联合动力	2025年9月17日	6个月	新锁定期	12.48	25.46	7,395	92,289.60	188,276.70	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	6个月	新锁定期	114.28	416.18	344	39,312.32	143,165.92	-
001280	中国铀业	2025年11月25日	6个月	新锁定期	17.89	45.36	2,277	40,735.53	103,284.72	-
688729	屹唐股份	2025年7月1日	6个月	新锁定期	8.45	24.28	3,505	29,617.25	85,101.40	-

		日								
688759	必贝特	2025年10月21日	6个月	新锁定期	17.78	25.11	2,789	49,588.42	70,031.79	-
688809	强一股份	2025年12月23日	6个月	新锁定期	85.09	203.31	259	22,038.31	52,657.29	-
688802	沐曦股份	2025年12月9日	6个月	新锁定期	104.66	399.31	102	10,675.32	40,729.62	-
301638	南网数字	2025年11月11日	6个月	新锁定期	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	-
001386	马可波罗	2025年10月15日	6个月	新锁定期	13.75	18.53	1,626	22,357.50	30,129.78	-
688727	恒坤新材	2025年11月11日	6个月	新锁定期	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-
001233	海安集团	2025年11月18日	6个月	新锁定期	48.00	51.88	370	17,760.00	19,195.60	-
688796	百奥赛图	2025年12月2日	6个月	新锁定期	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
688807	优迅股份	2025年12月10日	6个月	新锁定期	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-
301632	广东建科	2025年8月5日	6个月	新锁定期	6.56	23.68	656	4,303.36	15,534.08	-
301563	云汉芯城	2025年9月23日	6个月	新锁定期	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-

		日								
688765	禾元生物	2025年10月16日	6个月	新锁定期	29.06	52.62	262	7,613.72	13,786.44	-
301491	汉桑科技	2025年7月29日	6个月	新锁定期	28.91	55.11	245	7,082.95	13,501.95	-
301584	建发致新	2025年9月18日	6个月	新锁定期	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
001369	双欣环保	2025年12月23日	6个月	新锁定期	6.85	12.89	897	6,144.45	11,562.33	-
301609	山大电力	2025年7月16日	6个月	新锁定期	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新锁定期	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
688790	昂瑞微	2025年12月9日	6个月	新锁定期	83.06	117.19	86	7,143.16	10,078.34	-
001221	悍高集团	2025年7月23日	6个月	新锁定期	15.43	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-
301667	纳百川	2025年12月10日	6个月	新锁定期	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	新锁定期	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
603418	友升股份	2025年9月16日	6个月	新锁定期	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	-

		日									
603175	超颖电子	2025年10月17日	6个月	新锁定期	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-	
603092	德力佳	2025年10月30日	6个月	新锁定期	46.68	55.66	146	6,815.28	8,126.36	-	
001285	瑞立科密	2025年9月23日	6个月	新锁定期	42.28	56.08	137	5,792.36	7,682.96	-	
301668	昊创瑞通	2025年9月15日	6个月	新锁定期	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-	
301449	天溯计量	2025年12月16日	6个月	新锁定期	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-	
601026	道生天合	2025年10月9日	6个月	新锁定期	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-	
301575	艾芬达	2025年9月3日	6个月	新锁定期	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-	
603406	天富龙	2025年7月30日	6个月	新锁定期	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-	
603262	技源集团	2025年7月16日	6个月	新锁定期	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	新锁定期	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	新锁定期	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-	

		日								
603370	华新精科	2025年8月27日	6个月	新股锁定期	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025年10月28日	6个月	新股锁定期	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	新股锁定期	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-

#### 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
603508	思维列控	2025年12月29日	重大事项停牌	27.82	2026年1月7日	27.83	1,735,072	49,486,772.61	48,269,703.04	-
600058	五矿发展	2025年12月30日	重大事项停牌	11.52	2026年1月15日	12.67	3,931,401	31,728,362.26	45,289,739.52	-

#### 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

本基金是被动式指数基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。紧密跟踪中证 1000 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。本基金采用完全复制法，跟踪中证 1000 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约

定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人就借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，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 0.02%（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	220,940,588.06	-	-	-	220,940,588.06
结算备付金	1,438,123,747.69	-	-	-	1,438,123,747.69
存出保证金	12,492,686.61	-	-	217,792,756.80	230,285,443.41
交易性金融资产	-	-	13,495,817.37	77,161,417,207.62	77,174,913,024.99
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	-	-	-	34,248,630.04	34,248,630.04
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,671,557,022.36	-	13,495,817.37	77,413,458,594.46	79,098,511,434.19
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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	9,618,006.24	9,618,006.24
应付托管费	-	-	-	3,206,002.09	3,206,002.09
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	691,926.49	691,926.49
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	88,539,407.42	88,539,407.42
负债总计	-	-	-	102,055,342.24	102,055,342.24
利率敏感度	1,671,557,02	-	13,495,817.3	77,311,403,2	78,996,456,0

缺口	2.36		7	52.22	91.95
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	170,215,322. 31	-	-	-	170,215,322. 31
结算备付金	732,760,603. 64	-	-	-	732,760,603. 64
存出保证金	26,463,613.5 6	-	-	111,518,395. 20	137,982,008. 76
交易性金融资产	-	-	-	52,919,663,4 38.62	52,919,663,4 38.62
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	-	-	-	53,269,754.2 6	53,269,754.2 6
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	929,439,539. 51	-	-	53,084,451,5 88.08	54,013,891,1 27.59
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	-	-	-	5,902,092.90	5,902,092.90
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	7,204,671.93	7,204,671.93

应付托管费	-	-	-	2,401,557.31	2,401,557.31
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	4,996,618.26	4,996,618.26
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	120,567,816.03	120,567,816.03
负债总计	-	-	-	141,072,756.43	141,072,756.43
利率敏感度缺口	929,439,539.51	-	-	52,943,378.831.65	53,872,818,371.16

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。

本基金采用完全复制法，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，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	77,161,417,207.62	97.68	52,919,663,438.62	98.23
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	77,161,417,207.62	97.68	52,919,663,438.62	98.23

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%	3,929,663,912.10	2,677,551,208.26
	2.组合自身基准下降 5%	-3,929,663,912.10	-2,677,551,208.26

## 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	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
--------------	----------------------	-----------------------

次		
第一层次	76,501,165,681.44	52,571,528,025.78
第二层次	93,559,442.56	36,147,794.10
第三层次	580,187,900.99	311,987,618.74
合计	77,174,913,024.99	52,919,663,438.62

#### 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	-	311,987,618.74	311,987,618.74
当期购买	-	646,997,300.00	646,997,300.00
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,583,535.68	1,583,535.68
转出第三层次	-	530,130,879.27	530,130,879.27
当期利得或损失总额	-	149,750,325.84	149,750,325.84
其中：计入损益的利得或损失	-	149,750,325.84	149,750,325.84
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	580,187,900.99	580,187,900.99
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	-	67,351,940.83	67,351,940.83
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	-	1,082,636.05	1,082,636.05
当期购买	-	340,464,220.00	340,464,220.00
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	479,106.59	479,106.59
转出第三层次	-	13,832,294.44	13,832,294.44
当期利得或损失总额	-	-16,206,049.46	-16,206,049.46
其中：计入损益的利得或损失	-	-16,206,049.46	-16,206,049.46
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	311,987,618.74	311,987,618.74
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	-	-18,961,420.46	-18,961,420.46

#### 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	580,187,900.99	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1628-3.0791	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	311,987,618.74	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	77,161,417,207.62	97.55
	其中：股票	77,161,417,207.62	97.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,495,817.37	0.02
	其中：债券	13,495,817.37	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,659,064,335.75	2.10
8	其他各项资产	264,534,073.45	0.33
9	合计	79,098,511,434.19	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	382,989,915.64	0.48
B	采矿业	1,968,140,013.27	2.49
C	制造业	51,702,047,654.26	65.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,910,349,315.20	2.42
E	建筑业	897,817,754.59	1.14
F	批发和零售业	2,575,231,570.34	3.26
G	交通运输、仓储和邮政业	1,706,687,269.67	2.16
H	住宿和餐饮业	102,743,763.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,955,773,978.41	11.34
J	金融业	2,051,815,846.30	2.60
K	房地产业	969,463,006.70	1.23

L	租赁和商务服务业	1,260,247,137.76	1.60
M	科学研究和技术服务业	869,327,070.05	1.10
N	水利、环境和公共设施管理业	728,985,407.20	0.92
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	54,329,646.00	0.07
Q	卫生和社会工作	244,843,099.21	0.31
R	文化、体育和娱乐业	706,110,043.60	0.89
S	综合	71,571,058.30	0.09
	合计	77,158,473,549.50	97.67

### 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	-	-
B	采矿业	103,284.72	0.00
C	制造业	1,111,735.92	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,588,423.20	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,694.44	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,995.62	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	40,711.59	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,903,845.49	0.00

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 8.3.1 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	300475	香农芯创	2,976,400	429,613,576.00	0.54
2	688110	东芯股份	2,835,717	372,471,427.95	0.47
3	688498	源杰科技	551,504	354,060,052.96	0.45
4	603083	剑桥科技	2,528,810	339,821,487.80	0.43
5	002456	欧菲光	30,827,155	327,384,386.10	0.41
6	300548	长芯博创	2,148,500	305,087,000.00	0.39
7	603516	淳中科技	1,304,700	291,600,450.00	0.37
8	001309	德明利	1,248,559	289,528,346.51	0.37
9	600105	永鼎股份	10,803,886	268,467,538.60	0.34
10	300456	赛微电子	4,706,939	263,400,306.44	0.33
11	002497	雅化集团	10,565,569	261,497,832.75	0.33
12	688313	仕佳光子	2,930,287	260,150,879.86	0.33
13	000766	通化金马	8,874,000	243,946,260.00	0.31
14	300762	上海瀚讯	5,784,124	241,082,288.32	0.31
15	603119	浙江荣泰	2,065,900	231,870,653.00	0.29
16	688333	铂力特	2,027,233	226,056,751.83	0.29
17	688037	芯源微	1,488,188	221,010,799.88	0.28
18	601208	东材科技	7,476,311	202,533,264.99	0.26
19	600595	中孚实业	25,777,856	202,356,169.60	0.26
20	300620	光库科技	1,369,000	201,311,450.00	0.25

21	002405	四维图新	21,767,350	196,123,823. 50	0.25
22	600577	精达股份	16,131,216	196,003,014. 88	0.25
23	002222	福晶科技	3,454,717	194,638,755. 78	0.25
24	688270	臻镭科技	1,579,829	192,849,726. 03	0.24
25	600100	同方股份	21,519,010	191,949,569. 20	0.24
26	300568	星源材质	12,379,809	188,792,087. 25	0.24
27	002245	蔚蓝锂芯	10,544,600	187,693,880. 00	0.24
28	600331	宏达股份	14,557,700	186,192,983. 00	0.24
29	603308	应流股份	4,378,541	182,804,086. 75	0.23
30	002487	大金重工	3,514,400	182,502,792. 00	0.23
31	300666	江丰电子	1,964,924	180,773,008. 00	0.23
32	002151	北斗星通	3,974,300	180,552,449. 00	0.23
33	603236	移远通信	1,875,074	178,900,810. 34	0.23
34	300170	汉得信息	9,371,300	177,304,996. 00	0.22
35	601777	千里科技	16,614,651	176,613,740. 13	0.22
36	688343	云天励飞	2,306,678	175,492,062. 24	0.22
37	300438	鹏辉能源	3,242,307	172,555,578. 54	0.22
38	300049	福瑞医科	2,436,000	171,518,760. 00	0.22
39	002249	大洋电机	15,721,600	171,365,440. 00	0.22
40	601677	明泰铝业	11,409,862	168,751,858. 98	0.21
41	603005	晶方科技	5,993,836	165,789,503. 76	0.21
42	300779	惠城环保	1,266,228	164,748,925. 08	0.21

43	688200	华峰测控	865,322	164,584,244. 40	0.21
44	603667	五洲新春	2,405,400	163,739,892. 00	0.21
45	300102	乾照光电	5,930,000	163,430,800. 00	0.21
46	688005	容百科技	4,602,118	162,914,977. 20	0.21
47	601020	华钰矿业	6,036,093	162,129,457. 98	0.21
48	600151	航天机电	9,203,200	161,516,160. 00	0.20
49	300409	道氏技术	7,180,852	161,497,361. 48	0.20
50	300953	震裕科技	958,100	160,979,962. 00	0.20
51	601606	长城军工	3,337,317	160,591,694. 04	0.20
52	300655	晶瑞电材	9,855,751	158,973,263. 63	0.20
53	002171	楚江新材	11,930,796	158,202,354. 96	0.20
54	688208	道通科技	4,298,690	158,191,792. 00	0.20
55	002139	拓邦股份	11,430,200	157,508,156. 00	0.20
56	300085	银之杰	3,894,861	156,144,977. 49	0.20
57	600201	生物股份	10,213,897	153,923,427. 79	0.19
58	002176	江特电机	15,673,600	152,660,864. 00	0.19
59	300131	英唐智控	10,402,686	152,503,376. 76	0.19
60	603306	华懋科技	2,419,200	152,433,792. 00	0.19
61	002428	云南锗业	4,798,300	152,346,025. 00	0.19
62	600388	龙净环保	9,312,254	151,882,862. 74	0.19
63	002389	航天彩虹	6,320,900	151,575,182. 00	0.19
64	300468	四方精创	3,891,248	151,097,159. 84	0.19

65	002611	东方精工	7,816,520	150,233,514. 40	0.19
66	300672	国科微	1,393,875	150,008,827. 50	0.19
67	600246	万通发展	12,135,836	149,270,782. 80	0.19
68	600330	天通股份	11,319,338	148,622,907. 94	0.19
69	002326	永太科技	5,957,800	148,468,376. 00	0.19
70	300459	汤姆猫	32,313,400	148,318,506. 00	0.19
71	301550	斯菱智驱	1,062,265	147,336,155. 50	0.19
72	688123	聚辰股份	1,171,082	147,064,477. 56	0.19
73	688048	长光华芯	1,163,404	145,832,691. 40	0.18
74	000901	航天科技	5,118,283	145,717,517. 01	0.18
75	002149	西部材料	3,153,900	143,533,989. 00	0.18
76	300253	卫宁健康	16,261,030	143,422,284. 60	0.18
77	002617	露笑科技	17,655,470	143,009,307. 00	0.18
78	600114	东睦股份	4,653,519	142,165,005. 45	0.18
79	002400	省广集团	16,006,700	141,979,429. 00	0.18
80	300773	拉卡拉	4,978,600	141,790,528. 00	0.18
81	000969	安泰科技	6,739,400	141,594,794. 00	0.18
82	002048	宁波华翔	4,500,585	141,588,404. 10	0.18
83	603127	昭衍新药	4,043,681	141,569,271. 81	0.18
84	601519	大智慧	10,961,100	141,069,357. 00	0.18
85	300045	华力创通	4,984,800	140,995,568. 00	0.18
86	300083	创世纪	15,298,300	140,897,343. 00	0.18

87	688536	思瑞浦	876,094	140,069,908. 72	0.18
88	002104	恒宝股份	6,478,159	139,993,015. 99	0.18
89	002484	江海股份	4,699,554	139,576,753. 80	0.18
90	688205	德科立	1,056,689	138,943,603. 72	0.18
91	603063	禾望电气	4,198,100	138,831,167. 00	0.18
92	300088	长信科技	22,905,217	138,805,615. 02	0.18
93	601126	四方股份	4,593,300	138,166,464. 00	0.17
94	605090	九丰能源	3,204,040	138,094,124. 00	0.17
95	688327	云从科技	9,546,262	137,179,784. 94	0.17
96	300182	捷成股份	24,483,540	135,149,140. 80	0.17
97	000737	北方铜业	8,753,500	134,716,365. 00	0.17
98	600155	华创云信	20,271,000	134,194,020. 00	0.17
99	300738	奥飞数据	7,248,333	134,021,677. 17	0.17
100	300035	中科电气	6,286,400	133,837,456. 00	0.17
101	000917	电广传媒	13,001,600	133,656,448. 00	0.17
102	300777	中简科技	3,240,714	132,221,131. 20	0.17
103	000875	吉电股份	23,258,900	131,180,196. 00	0.17
104	600728	佳都科技	19,614,900	131,027,532. 00	0.17
105	601869	长飞光纤	1,119,833	130,303,767. 88	0.16
106	603613	国联股份	4,644,550	130,047,400. 00	0.16
107	002396	星网锐捷	4,285,532	129,851,619. 60	0.16
108	300236	上海新阳	2,030,025	129,434,394. 00	0.16

109	002544	普天科技	3,747,800	129,261,622. 00	0.16
110	002163	海南发展	5,417,844	129,161,400. 96	0.16
111	688331	荣昌生物	1,655,141	128,753,418. 39	0.16
112	600323	瀚蓝环境	4,497,100	128,617,060. 00	0.16
113	300007	汉威科技	2,398,100	128,538,160. 00	0.16
114	600416	湘电股份	8,145,190	128,531,098. 20	0.16
115	600179	安通控股	23,265,036	128,422,998. 72	0.16
116	300068	南都电源	8,252,175	128,238,799. 50	0.16
117	300229	拓尔思	6,411,000	127,578,900. 00	0.16
118	688116	天奈科技	2,689,971	126,832,132. 65	0.16
119	001203	大中矿业	4,134,200	126,713,230. 00	0.16
120	600338	西藏珠峰	8,392,799	126,227,696. 96	0.16
121	002716	湖南白银	18,190,725	125,879,817. 00	0.16
122	300296	利亚德	19,915,273	125,864,525. 36	0.16
123	300674	宇信科技	5,174,240	125,527,062. 40	0.16
124	002276	万马股份	7,422,274	125,510,653. 34	0.16
125	300638	广和通	4,201,193	124,523,360. 52	0.16
126	002270	华明装备	4,936,800	123,617,472. 00	0.16
127	002895	川恒股份	3,355,291	123,004,968. 06	0.16
128	001301	尚太科技	1,432,492	122,922,138. 52	0.16
129	300315	掌趣科技	24,834,100	122,680,454. 00	0.16
130	600113	浙江东日	1,937,696	122,404,256. 32	0.15

131	301171	易点天下	3,019,676	122,296,878. 00	0.15
132	600259	中稀有色	2,172,272	122,212,022. 72	0.15
133	600529	山东药玻	6,077,203	121,118,655. 79	0.15
134	000970	中科三环	8,916,997	120,914,479. 32	0.15
135	000636	风华高科	7,418,600	120,774,808. 00	0.15
136	002506	协鑫集成	43,045,216	120,526,604. 80	0.15
137	603881	数据港	3,955,705	120,372,103. 15	0.15
138	000686	东北证券	12,885,059	120,088,749. 88	0.15
139	002145	钛能化学	24,504,909	120,074,054. 10	0.15
140	300065	海兰信	6,604,759	120,008,471. 03	0.15
141	600761	安徽合力	5,728,700	119,672,543. 00	0.15
142	002373	千方科技	10,115,195	119,055,845. 15	0.15
143	600759	洲际油气	38,061,900	118,753,128. 00	0.15
144	002317	众生药业	6,242,673	118,485,933. 54	0.15
145	300593	新雷能	3,971,100	118,179,936. 00	0.15
146	000811	冰轮环境	6,379,570	118,149,636. 40	0.15
147	300101	振芯科技	4,153,400	118,081,162. 00	0.15
148	000603	盛达资源	3,807,200	117,870,912. 00	0.15
149	600635	大众公用	17,769,630	116,213,380. 20	0.15
150	600120	浙江东方	18,807,351	116,041,355. 67	0.15
151	300199	翰宇药业	6,467,938	115,776,090. 20	0.15
152	603300	海南华铁	14,699,500	115,391,075. 00	0.15

153	688382	益方生物	4,229,421	115,209,428. 04	0.15
154	300348	长亮科技	7,430,950	115,031,106. 00	0.15
155	600877	电科芯片	6,530,263	114,606,115. 65	0.15
156	002747	埃斯顿	4,807,600	113,940,120. 00	0.14
157	000422	湖北宜化	7,976,900	113,351,749. 00	0.14
158	300811	铂科新材	1,586,973	113,167,044. 63	0.14
159	688630	芯碁微装	837,080	112,612,372. 40	0.14
160	601636	旗滨集团	18,954,517	112,400,285. 81	0.14
161	600859	王府井	7,207,273	111,928,949. 69	0.14
162	688484	南芯科技	2,747,081	111,696,313. 46	0.14
163	002268	电科网安	5,419,928	111,325,321. 12	0.14
164	600850	电科数字	3,748,540	111,106,725. 60	0.14
165	300827	上能电气	3,246,214	111,085,443. 08	0.14
166	300573	兴齐眼药	1,574,696	110,685,381. 84	0.14
167	002174	游族网络	9,020,888	110,415,669. 12	0.14
168	600206	有研新材	5,430,304	110,398,080. 32	0.14
169	300870	欧陆通	498,903	110,257,563. 00	0.14
170	300850	新强联	2,716,640	109,909,396. 80	0.14
171	600490	鹏欣资源	14,206,900	109,819,337. 00	0.14
172	605376	博迁新材	1,677,950	109,737,930. 00	0.14
173	002536	飞龙股份	3,692,400	109,664,280. 00	0.14
174	688088	虹软科技	2,213,460	109,566,270. 00	0.14

175	002681	奋达科技	16,446,600	109,369,890.00	0.14
176	603358	华达科技	2,161,562	109,158,881.00	0.14
177	605111	新洁能	3,050,407	108,991,042.11	0.14
178	601375	中原证券	25,338,327	108,954,806.10	0.14
179	300077	国民技术	5,350,144	108,179,911.68	0.14
180	601975	招商南油	35,659,334	107,691,188.68	0.14
181	688141	杰华特	2,479,613	107,689,592.59	0.14
182	600559	老白干酒	6,706,134	107,566,389.36	0.14
183	000681	视觉中国	4,510,800	107,402,148.00	0.14
184	600667	太极实业	13,465,875	107,323,023.75	0.14
185	300775	三角防务	3,529,820	107,306,528.00	0.14
186	002036	联创电子	9,717,635	107,088,337.70	0.14
187	300260	新莱应材	1,880,625	106,988,756.25	0.14
188	600986	浙文互联	13,652,340	106,761,298.80	0.14
189	600619	海立股份	5,059,004	106,744,984.40	0.14
190	002046	国机精工	2,458,700	106,166,666.00	0.13
191	300184	力源信息	10,606,900	105,962,931.00	0.13
192	002545	东方铁塔	5,734,600	105,803,370.00	0.13
193	688548	广钢气体	7,271,301	105,724,716.54	0.13
194	600641	先导基电	6,100,680	105,673,495.20	0.13
195	002237	恒邦股份	7,866,355	105,566,484.10	0.13
196	688567	孚能科技	6,711,072	105,028,276.80	0.13

197	603360	百傲化学	3,339,470	105,025,723. 40	0.13
198	301377	鼎泰高科	753,933	104,872,080. 30	0.13
199	002020	京新药业	5,519,900	104,767,702. 00	0.13
200	603009	北特科技	2,171,601	104,584,304. 16	0.13
201	002518	科士达	2,149,100	104,274,332. 00	0.13
202	300181	佐力药业	6,433,339	103,962,758. 24	0.13
203	600456	宝钛股份	2,635,100	103,954,695. 00	0.13
204	002807	江阴银行	22,642,200	103,474,854. 00	0.13
205	000099	中信海直	4,982,010	103,376,707. 50	0.13
206	301511	德福科技	2,883,212	103,190,157. 48	0.13
207	300009	安科生物	10,772,199	103,089,944. 43	0.13
208	688766	普冉股份	809,493	102,975,604. 53	0.13
209	603305	旭升集团	6,361,957	102,936,464. 26	0.13
210	600258	首旅酒店	6,133,956	102,743,763. 00	0.13
211	301205	联特科技	609,143	102,646,686. 93	0.13
212	601528	瑞丰银行	18,001,070	102,606,099. 00	0.13
213	688372	伟测科技	939,481	102,487,982. 29	0.13
214	300133	华策影视	12,156,100	101,138,752. 00	0.13
215	300130	新国都	3,639,111	100,912,548. 03	0.13
216	300607	拓斯达	3,050,872	100,495,723. 68	0.13
217	300008	天海防务	12,699,200	100,196,688. 00	0.13
218	600872	中炬高新	5,706,224	100,144,231. 20	0.13

219	000762	西藏矿业	3,812,100	100,143,867.00	0.13
220	300624	万兴科技	1,416,293	100,061,100.45	0.13
221	301316	慧博云通	2,229,496	99,613,881.28	0.13
222	600596	新安股份	8,682,840	99,592,174.80	0.13
223	300455	航天智装	3,311,900	99,489,476.00	0.13
224	300457	赢合科技	3,566,304	99,321,566.40	0.13
225	000680	山推股份	8,292,250	99,258,232.50	0.13
226	002192	融捷股份	1,916,911	99,200,144.25	0.13
227	688131	皓元医药	1,371,605	98,865,288.40	0.13
228	600186	莲花控股	16,485,899	98,585,676.02	0.12
229	002212	天融信	10,826,845	98,199,484.15	0.12
230	002368	太极股份	4,008,683	98,172,646.67	0.12
231	300657	弘信电子	3,542,927	97,997,360.82	0.12
232	002324	普利特	6,128,540	97,995,354.60	0.12
233	002701	奥瑞金	16,426,100	97,735,295.00	0.12
234	002182	宝武镁业	6,381,480	97,636,644.00	0.12
235	601778	晶科科技	26,221,500	97,543,980.00	0.12
236	603997	继峰股份	7,011,315	97,457,278.50	0.12
237	600366	宁波韵升	7,065,200	97,429,108.00	0.12
238	300098	高新兴	15,944,200	97,259,620.00	0.12
239	688390	固德威	1,565,162	97,243,515.06	0.12
240	002896	中大力德	1,087,891	97,213,939.76	0.12

241	600629	华建集团	4,470,600	97,012,020.0 0	0.12
242	002779	中坚科技	853,996	96,979,785.7 6	0.12
243	601137	博威合金	4,535,135	96,915,834.9 5	0.12
244	002354	天娱数科	15,182,200	96,710,614.0 0	0.12
245	688409	富创精密	1,432,551	96,553,937.4 0	0.12
246	600064	南京高科	11,117,008	96,495,629.4 4	0.12
247	000612	焦作万方	8,750,100	96,426,102.0 0	0.12
248	600446	金证股份	6,052,142	96,350,100.6 4	0.12
249	600072	中船科技	8,285,119	96,273,082.7 8	0.12
250	603026	石大胜华	1,280,758	95,813,505.9 8	0.12
251	688068	热景生物	590,527	95,665,374.0 0	0.12
252	002507	涪陵榨菜	7,395,260	95,472,806.6 0	0.12
253	600933	爱柯迪	4,745,282	95,380,168.2 0	0.12
254	688503	聚和材料	1,562,482	95,311,402.0 0	0.12
255	000801	四川九洲	5,610,898	95,160,830.0 8	0.12
256	002698	博实股份	5,645,300	94,897,493.0 0	0.12
257	688158	优刻得	3,365,265	94,530,293.8 5	0.12
258	688698	伟创电气	955,488	94,478,653.4 4	0.12
259	600320	振华重工	18,306,100	94,276,415.0 0	0.12
260	603323	苏农银行	18,494,179	93,395,603.9 5	0.12
261	603662	柯力传感	1,292,384	93,051,648.0 0	0.12
262	301029	怡合达	3,566,226	93,026,313.5 2	0.12

263	002075	沙钢股份	16,155,600	92,894,700.0 0	0.12
264	300398	飞凯材料	4,143,660	92,859,420.6 0	0.12
265	603678	火炬电子	2,616,300	92,407,716.0 0	0.12
266	002539	云图控股	7,769,100	91,830,762.0 0	0.12
267	002815	崇达技术	6,708,865	91,643,095.9 0	0.12
268	002251	步步高	17,229,400	91,488,114.0 0	0.12
269	002745	木林森	9,543,245	91,328,854.6 5	0.12
270	688063	派能科技	1,604,468	91,165,871.7 6	0.12
271	600459	贵研铂业	4,895,422	91,103,803.4 2	0.12
272	000778	新兴铸管	21,775,500	91,021,590.0 0	0.12
273	600531	豫光金铅	7,729,100	90,816,925.0 0	0.11
274	000581	威孚高科	4,400,695	90,742,330.9 0	0.11
275	688800	瑞可达	1,091,243	90,573,169.0 0	0.11
276	000688	国城矿业	3,257,093	90,547,185.4 0	0.11
277	688652	京仪装备	920,347	90,479,313.5 7	0.11
278	300378	鼎捷数智	1,999,101	90,479,311.2 6	0.11
279	300618	寒锐钴业	1,999,924	90,416,564.0 4	0.11
280	300682	朗新集团	5,934,595	90,265,189.9 5	0.11
281	000902	新洋丰	5,777,600	90,246,112.0 0	0.11
282	688403	汇成股份	5,500,702	90,101,498.7 6	0.11
283	002123	梦网科技	7,401,700	90,004,672.0 0	0.11
284	600633	浙数文化	6,997,900	89,992,994.0 0	0.11

285	688400	凌云光	2,120,689	89,874,799.8 2	0.11
286	300660	江苏雷利	1,636,300	89,701,966.0 0	0.11
287	600428	中远海特	12,620,400	89,604,840.0 0	0.11
288	600550	保变电气	8,457,200	89,223,460.0 0	0.11
289	002706	良信股份	8,271,340	89,165,045.2 0	0.11
290	600301	华锡有色	2,321,499	89,052,701.6 4	0.11
291	002015	协鑫能科	8,949,400	89,046,530.0 0	0.11
292	000555	神州信息	5,380,300	89,043,965.0 0	0.11
293	300113	顺网科技	4,397,620	89,007,828.8 0	0.11
294	600133	东湖高新	9,795,040	88,938,963.2 0	0.11
295	300303	聚飞光电	12,998,800	88,911,792.0 0	0.11
296	601187	厦门银行	12,109,935	88,886,922.9 0	0.11
297	600057	厦门象屿	10,402,279	88,627,417.0 8	0.11
298	000923	河钢资源	4,184,600	88,587,982.0 0	0.11
299	002006	精工科技	3,820,722	88,487,921.5 2	0.11
300	600835	上海机电	2,943,800	88,343,438.0 0	0.11
301	600718	东软集团	8,771,410	88,328,098.7 0	0.11
302	603690	至纯科技	2,807,564	88,297,887.8 0	0.11
303	300602	飞荣达	2,659,812	88,199,365.9 2	0.11
304	688559	海目星	1,832,689	88,079,033.3 4	0.11
305	300693	盛弘股份	2,298,987	88,005,222.3 6	0.11
306	002936	郑州银行	45,569,480	87,949,096.4 0	0.11

307	600867	通化东宝	10,755,410	87,871,699.7 0	0.11
308	688050	爱博医疗	1,448,565	87,869,952.9 0	0.11
309	603456	九洲药业	4,894,700	87,615,130.0 0	0.11
310	000682	东方电子	7,386,100	87,599,146.0 0	0.11
311	603871	嘉友国际	6,277,405	87,569,799.7 5	0.11
312	002654	万润科技	6,213,808	87,428,278.5 6	0.11
313	300276	三丰智能	9,010,300	87,399,910.0 0	0.11
314	002948	青岛银行	19,483,900	87,287,872.0 0	0.11
315	002170	芭田股份	7,119,000	86,709,420.0 0	0.11
316	600645	中源协和	3,439,001	86,662,825.2 0	0.11
317	603588	高能环境	11,186,218	86,357,602.9 6	0.11
318	600285	羚锐制药	4,158,205	86,116,425.5 5	0.11
319	600552	凯盛科技	6,941,300	86,072,120.0 0	0.11
320	300034	钢研高纳	4,388,720	85,931,137.6 0	0.11
321	601609	金田股份	7,949,149	85,850,809.2 0	0.11
322	300166	东方国信	8,394,300	85,789,746.0 0	0.11
323	002097	山河智能	6,895,357	85,571,380.3 7	0.11
324	002416	爱施德	6,800,400	85,549,032.0 0	0.11
325	600216	浙江医药	6,170,077	85,517,267.2 2	0.11
326	002987	京北方	3,964,700	85,359,991.0 0	0.11
327	688279	峰昭科技	419,020	85,266,379.8 0	0.11
328	688362	甬矽电子	2,630,047	85,239,823.2 7	0.11

329	688062	迈威生物	2,213,139	85,139,457.3 3	0.11
330	002063	远光软件	14,013,728	85,063,328.9 6	0.11
331	603809	豪能股份	5,926,543	85,045,892.0 5	0.11
332	002947	恒铭达	1,634,014	85,001,408.2 8	0.11
333	000758	中色股份	12,794,900	84,958,136.0 0	0.11
334	600325	华发股份	20,131,475	84,954,824.5 0	0.11
335	001227	兰州银行	36,499,900	84,679,768.0 0	0.11
336	000035	中国天楹	15,335,000	84,649,200.0 0	0.11
337	600478	科力远	12,257,700	84,455,553.0 0	0.11
338	300747	锐科激光	3,114,462	84,183,907.8 6	0.11
339	000690	宝新能源	19,971,827	83,681,955.1 3	0.11
340	301078	孩子王	8,069,157	83,677,158.0 9	0.11
341	002675	东诚药业	6,074,635	83,465,484.9 0	0.11
342	688660	电气风电	4,902,017	83,383,309.1 7	0.11
343	000403	派林生物	6,090,697	83,381,641.9 3	0.11
344	600908	无锡银行	14,056,800	83,356,824.0 0	0.11
345	300772	运达股份	4,346,608	82,846,348.4 8	0.10
346	300725	药石科技	2,146,711	82,777,176.1 6	0.10
347	688029	南微医学	1,014,429	82,736,829.2 4	0.10
348	301510	固高科技	2,256,375	82,557,743.7 5	0.10
349	600480	凌云股份	6,717,004	82,551,979.1 6	0.10
350	301050	雷电微力	1,579,532	82,451,570.4 0	0.10

351	000543	皖能电力	10,362,900	82,385,055.0 0	0.10
352	300036	超图软件	4,533,700	82,331,992.0 0	0.10
353	002364	中恒电气	3,111,700	82,273,348.0 0	0.10
354	600210	紫江企业	11,164,400	82,058,340.0 0	0.10
355	000420	吉林化纤	18,106,300	82,021,539.0 0	0.10
356	002839	张家港行	17,937,960	81,976,477.2 0	0.10
357	000829	天音控股	7,508,614	81,918,978.7 4	0.10
358	600869	远东股份	10,167,000	81,844,350.0 0	0.10
359	688147	微导纳米	1,301,678	81,732,361.6 2	0.10
360	300185	通裕重工	28,671,200	81,426,208.0 0	0.10
361	300357	我武生物	2,871,123	81,396,337.0 5	0.10
362	600750	江中药业	3,512,023	81,373,572.9 1	0.10
363	300352	北信源	13,267,900	81,332,227.0 0	0.10
364	600771	广誉远	4,506,990	81,035,680.2 0	0.10
365	688789	宏华数科	989,117	80,682,273.6 9	0.10
366	002091	江苏国泰	8,926,930	80,610,177.9 0	0.10
367	603267	鸿远电子	1,479,340	80,520,476.2 0	0.10
368	000676	智度股份	9,288,039	80,155,776.5 7	0.10
369	600389	江山股份	3,165,580	80,025,862.4 0	0.10
370	002019	亿帆医药	6,687,200	79,978,912.0 0	0.10
371	601678	滨化股份	18,839,751	79,880,544.2 4	0.10
372	688779	五矿新能	10,656,784	79,819,312.1 6	0.10

373	002183	怡亚通	16,716,100	79,568,636.0 0	0.10
374	300761	立华股份	3,828,388	79,439,051.0 0	0.10
375	002315	焦点科技	1,735,900	79,434,784.0 0	0.10
376	688516	奥特维	1,753,628	79,369,203.2 8	0.10
377	600452	涪陵电力	8,459,550	79,265,983.5 0	0.10
378	600961	株冶集团	4,919,392	79,202,211.2 0	0.10
379	300224	正海磁材	5,122,600	79,195,396.0 0	0.10
380	300446	航天智造	3,123,000	79,136,820.0 0	0.10
381	001287	中电港	3,485,286	78,976,580.7 6	0.10
382	000685	中山公用	6,766,300	78,827,395.0 0	0.10
383	301217	铜冠铜箔	2,294,321	78,649,323.8 8	0.10
384	603619	中曼石油	3,408,619	78,568,667.9 5	0.10
385	300576	容大感光	2,033,722	78,399,983.1 0	0.10
386	600063	皖维高新	13,299,664	78,335,020.9 6	0.10
387	300776	帝尔激光	1,259,853	78,287,265.4 2	0.10
388	300180	华峰超纤	11,283,211	78,192,652.2 3	0.10
389	300415	伊之密	2,999,642	78,170,670.5 2	0.10
390	002378	章源钨业	5,630,794	78,149,658.9 2	0.10
391	002537	海联金汇	8,623,440	78,128,366.4 0	0.10
392	301293	三博脑科	1,321,727	77,955,458.4 6	0.10
393	002928	华夏航空	7,049,825	77,900,566.2 5	0.10
394	300663	科蓝软件	4,405,209	77,707,886.7 6	0.10

395	600993	马应龙	2,772,632	77,633,696.0 0	0.10
396	002338	奥普光电	1,323,300	77,267,487.0 0	0.10
397	688502	茂莱光学	192,834	76,950,407.7 0	0.10
398	603876	鼎胜新材	5,125,220	76,929,552.2 0	0.10
399	688321	微芯生物	2,678,114	76,906,491.0 8	0.10
400	300726	宏达电子	1,510,452	76,897,111.3 2	0.10
401	300910	瑞丰新材	1,357,440	76,763,232.0 0	0.10
402	002073	软控股份	9,386,200	76,497,530.0 0	0.10
403	600273	嘉化能源	8,748,613	76,462,877.6 2	0.10
404	688612	威迈斯	2,309,944	76,158,853.6 8	0.10
405	600267	海正药业	7,697,442	76,127,701.3 8	0.10
406	002643	万润股份	5,078,450	76,125,965.5 0	0.10
407	688433	华曙高科	1,148,686	76,008,552.6 2	0.10
408	600864	哈投股份	11,448,900	75,906,207.0 0	0.10
409	601963	重庆银行	6,990,946	75,711,945.1 8	0.10
410	002468	申通快递	5,635,200	75,624,384.0 0	0.10
411	300493	润欣科技	3,763,400	75,606,706.0 0	0.10
412	603337	杰克科技	1,742,176	75,488,486.0 8	0.10
413	300319	麦捷科技	6,450,300	75,404,007.0 0	0.10
414	605020	永和股份	2,801,760	75,339,326.4 0	0.10
415	000061	农产品	7,320,627	75,329,251.8 3	0.10
416	603612	索通发展	3,203,247	75,276,304.5 0	0.10

417	600507	方大特钢	12,733,399	74,999,720.1 1	0.09
418	688262	国芯科技	2,467,768	74,896,758.8 0	0.09
419	600821	金开新能	14,669,400	74,813,940.0 0	0.09
420	301345	涛涛车业	297,422	74,748,097.0 4	0.09
421	002320	海峡股份	6,139,937	74,723,033.2 9	0.09
422	002011	盾安环境	5,879,500	74,552,060.0 0	0.09
423	603887	城地香江	5,497,618	74,327,795.3 6	0.09
424	601860	紫金银行	26,896,552	74,234,483.5 2	0.09
425	600621	华鑫股份	4,870,811	74,231,159.6 4	0.09
426	301219	腾远钴业	1,084,639	74,059,150.9 2	0.09
427	002100	天康生物	10,041,800	74,008,066.0 0	0.09
428	600399	抚顺特钢	12,666,624	73,973,084.1 6	0.09
429	600022	山东钢铁	48,987,758	73,971,514.5 8	0.09
430	002010	传化智联	12,728,400	73,952,004.0 0	0.09
431	002906	华阳集团	2,407,579	73,623,765.8 2	0.09
432	600353	旭光电子	4,563,100	73,557,172.0 0	0.09
433	002023	海特高新	5,420,000	73,386,800.0 0	0.09
434	300047	天源迪科	5,839,572	73,286,628.6 0	0.09
435	688543	国科军工	1,178,305	73,137,391.3 5	0.09
436	300598	诚迈科技	1,588,076	73,003,853.7 2	0.09
437	300244	迪安诊断	4,596,915	72,861,102.7 5	0.09
438	000837	秦川机床	5,648,500	72,752,680.0 0	0.09

439	600509	天富能源	8,805,575	72,734,049.5 0	0.09
440	688127	蓝特光学	1,883,829	72,508,578.2 1	0.09
441	301526	国际复材	10,351,723	72,462,061.0 0	0.09
442	601222	林洋能源	13,246,878	72,460,422.6 6	0.09
443	002239	奥特佳	24,304,980	72,428,840.4 0	0.09
444	600572	康恩贝	16,223,020	72,354,669.2 0	0.09
445	600776	东方通信	4,382,700	72,314,550.0 0	0.09
446	002292	奥飞娱乐	8,169,500	72,300,075.0 0	0.09
447	603505	金石资源	3,866,504	72,226,294.7 2	0.09
448	300595	欧普康视	4,911,893	72,155,708.1 7	0.09
449	000620	盈新发展	26,896,396	72,082,341.2 8	0.09
450	002979	雷赛智能	1,713,005	72,066,120.3 5	0.09
451	002891	中宠股份	1,388,783	71,883,408.0 8	0.09
452	002572	索菲亚	5,275,393	71,798,098.7 3	0.09
453	000628	高新发展	1,606,400	71,629,376.0 0	0.09
454	000833	粤桂股份	3,677,855	71,571,058.3 0	0.09
455	002345	潮宏基	5,702,240	71,278,000.0 0	0.09
456	002017	东信和平	3,192,815	71,199,774.5 0	0.09
457	301291	明阳电气	1,709,646	71,138,370.0 6	0.09
458	600056	中国医药	6,863,902	70,904,107.6 6	0.09
459	300087	荃银高科	6,068,790	70,883,467.2 0	0.09
460	002649	博彦科技	5,373,354	70,874,539.2 6	0.09

461	002226	江南化工	12,189,400	70,820,414.0 0	0.09
462	300855	图南股份	2,188,960	70,703,408.0 0	0.09
463	600185	珠免集团	10,347,828	70,468,708.6 8	0.09
464	600556	天下秀	11,604,500	70,439,315.0 0	0.09
465	600409	三友化工	11,365,800	70,354,302.0 0	0.09
466	300079	数码视讯	13,050,800	70,343,812.0 0	0.09
467	301035	润丰股份	1,032,328	70,208,627.2 8	0.09
468	300337	银邦股份	4,633,400	70,208,034.0 0	0.09
469	300075	数字政通	4,574,300	70,169,762.0 0	0.09
470	688206	概伦电子	2,056,212	70,136,863.9 6	0.09
471	002221	东华能源	8,657,744	70,127,726.4 0	0.09
472	300327	中颖电子	2,500,110	70,078,083.3 0	0.09
473	000860	顺鑫农业	4,783,210	70,074,026.5 0	0.09
474	600315	上海家化	3,110,152	70,040,623.0 4	0.09
475	300031	宝通科技	3,080,400	70,017,492.0 0	0.09
476	600686	金龙汽车	3,937,400	69,849,476.0 0	0.09
477	002004	华邦健康	14,586,234	69,722,198.5 2	0.09
478	000935	四川双马	2,819,434	69,354,740.5 6	0.09
479	688519	南亚新材	857,403	69,329,606.5 8	0.09
480	002003	伟星股份	6,537,400	69,296,440.0 0	0.09
481	300188	国投智能	4,740,480	69,258,412.8 0	0.09
482	000712	锦龙股份	5,758,863	69,221,533.2 6	0.09

483	300363	博腾股份	2,976,080	69,164,099.2 0	0.09
484	002233	塔牌集团	7,672,707	69,131,090.0 7	0.09
485	600996	贵广网络	6,883,600	69,111,344.0 0	0.09
486	601311	骆驼股份	7,532,800	69,075,776.0 0	0.09
487	603663	三祥新材	1,953,261	69,047,776.3 5	0.09
488	002965	祥鑫科技	1,691,560	68,812,660.8 0	0.09
489	300525	博思软件	4,874,305	68,727,700.5 0	0.09
490	002847	盐津铺子	1,004,963	68,649,022.5 3	0.09
491	688596	正帆科技	2,167,454	68,556,570.0 2	0.09
492	002215	诺普信	6,439,800	68,197,482.0 0	0.09
493	603220	中贝通信	3,198,870	68,135,931.0 0	0.09
494	301263	泰恩康	2,348,241	68,075,506.5 9	0.09
495	600782	新钢股份	17,523,000	67,989,240.0 0	0.09
496	300026	红日药业	19,247,996	67,752,945.9 2	0.09
497	002204	大连重工	8,833,700	67,577,805.0 0	0.09
498	601718	际华集团	20,149,005	67,499,166.7 5	0.09
499	600787	中储股份	12,003,202	67,457,995.2 4	0.09
500	603583	捷昌驱动	1,763,763	67,146,457.4 1	0.08
501	300925	法本信息	3,160,467	67,128,319.0 8	0.08
502	600651	飞乐音响	9,194,902	67,030,835.5 8	0.08
503	601069	西部黄金	2,510,700	66,985,476.0 0	0.08
504	600328	中盐化工	8,096,940	66,718,785.6 0	0.08

505	301095	广立微	930,081	66,696,108.5 1	0.08
506	600783	鲁信创投	2,695,475	66,659,096.7 5	0.08
507	002690	美亚光电	3,240,527	66,657,640.3 9	0.08
508	688591	泰凌微	1,560,619	66,419,944.6 4	0.08
509	603108	润达医疗	4,436,115	66,319,919.2 5	0.08
510	600827	百联股份	7,366,328	66,223,288.7 2	0.08
511	002043	兔宝宝	4,586,300	66,088,583.0 0	0.08
512	000089	深圳机场	9,424,800	65,879,352.0 0	0.08
513	688306	均普智能	5,662,655	65,686,798.0 0	0.08
514	301155	海力风电	811,586	65,681,654.9 8	0.08
515	600461	洪城环境	7,078,790	65,620,383.3 0	0.08
516	002597	金禾实业	3,149,177	65,376,914.5 2	0.08
517	002332	仙琚制药	7,251,200	65,333,312.0 0	0.08
518	600037	歌华有线	8,936,911	65,239,450.3 0	0.08
519	601969	海南矿业	5,488,700	65,205,756.0 0	0.08
520	688006	杭可科技	2,222,443	65,095,355.4 7	0.08
521	600773	西藏城投	5,252,200	65,074,758.0 0	0.08
522	002099	海翔药业	10,391,000	64,839,840.0 0	0.08
523	002550	千红制药	8,239,400	64,761,684.0 0	0.08
524	603556	海兴电力	1,772,500	64,519,000.0 0	0.08
525	603283	赛腾股份	1,487,820	64,452,362.4 0	0.08
526	600587	新华医疗	4,454,331	64,142,366.4 0	0.08

527	603039	泛微网络	1,197,967	64,139,153.18	0.08
528	000156	华数传媒	8,468,996	64,110,299.72	0.08
529	600129	太极集团	3,545,550	63,997,177.50	0.08
530	300821	东岳硅材	5,486,800	63,976,088.00	0.08
531	002488	金固股份	7,276,700	63,962,193.00	0.08
532	603169	兰石重装	5,989,350	63,846,471.00	0.08
533	600866	星湖科技	9,173,330	63,754,643.50	0.08
534	000503	国新健康	7,176,700	63,729,096.00	0.08
535	600475	华光环能	3,504,653	63,679,545.01	0.08
536	002408	齐翔腾达	13,046,800	63,668,384.00	0.08
537	601890	亚星锚链	6,179,201	63,583,978.29	0.08
538	605507	国邦医药	2,561,200	63,517,760.00	0.08
539	688326	经纬恒润	539,529	63,394,657.50	0.08
540	688798	艾为电子	832,541	63,364,695.51	0.08
541	002941	新疆交建	3,997,700	63,363,545.00	0.08
542	000727	冠捷科技	24,891,200	63,223,648.00	0.08
543	600888	新疆众和	7,717,005	63,202,270.95	0.08
544	688083	中望软件	927,052	63,141,511.72	0.08
545	601369	陕鼓动力	6,302,212	63,085,142.12	0.08
546	600916	中国黄金	7,739,900	63,080,185.00	0.08
547	300634	彩讯股份	2,494,000	62,923,620.00	0.08
548	603218	日月股份	4,743,232	62,847,824.00	0.08

549	688097	博众精工	1,662,160	62,746,540.0 0	0.08
550	300294	博雅生物	2,773,050	62,670,930.0 0	0.08
551	600211	西藏药业	1,471,572	62,615,388.6 0	0.08
552	301018	申菱环境	985,046	62,570,121.9 2	0.08
553	002541	鸿路钢构	3,794,400	62,379,936.0 0	0.08
554	000795	英洛华	6,251,500	62,327,455.0 0	0.08
555	603393	新天然气	2,338,302	62,175,450.1 8	0.08
556	600420	国药现代	6,149,505	62,110,000.5 0	0.08
557	688717	艾罗能源	1,008,170	62,103,272.0 0	0.08
558	000810	创维数字	5,244,200	61,776,676.0 0	0.08
559	603883	老百姓	4,170,111	61,717,642.8 0	0.08
560	600158	中体产业	7,058,300	61,618,959.0 0	0.08
561	603171	税友股份	1,117,000	61,580,210.0 0	0.08
562	300841	康华生物	849,303	61,370,634.7 8	0.08
563	000065	北方国际	4,914,597	61,235,878.6 2	0.08
564	688523	航天环宇	1,092,466	61,134,397.3 6	0.08
565	600422	昆药集团	4,863,892	61,090,483.5 2	0.08
566	301039	中集车辆	6,666,364	60,997,230.6 0	0.08
567	688016	心脉医疗	665,404	60,990,930.6 4	0.08
568	002096	易普力	4,564,216	60,795,357.1 2	0.08
569	688289	圣湘生物	3,210,811	60,716,436.0 1	0.08
570	600055	万东医疗	3,868,640	60,273,411.2 0	0.08

571	300580	贝斯特	2,289,649	60,194,872.2 1	0.08
572	002557	洽洽食品	2,782,392	60,155,315.0 4	0.08
573	603027	千禾味业	6,116,851	60,128,645.3 3	0.08
574	688153	唯捷创芯	1,596,490	60,091,883.6 0	0.08
575	300687	赛意信息	2,609,000	59,928,730.0 0	0.08
576	600654	中安科	15,857,500	59,782,775.0 0	0.08
577	688146	中船特气	1,476,313	59,643,045.2 0	0.08
578	600717	天津港	13,326,328	59,568,686.1 6	0.08
579	300323	华灿光电	7,457,200	59,508,456.0 0	0.08
580	000589	贵州轮胎	11,466,601	59,396,993.1 8	0.08
581	601619	嘉泽新能	13,375,700	59,388,108.0 0	0.08
582	600789	鲁抗医药	6,563,728	59,336,101.1 2	0.08
583	300678	中科信息	1,925,150	59,217,614.0 0	0.07
584	300613	富瀚微	1,284,930	59,183,875.8 0	0.07
585	600882	妙可蓝多	2,353,400	59,164,476.0 0	0.07
586	301031	中熔电气	527,224	59,149,260.5 6	0.07
587	603256	宏和科技	1,605,918	59,113,841.5 8	0.07
588	002967	广电计量	2,682,831	59,049,110.3 1	0.07
589	300685	艾德生物	2,875,844	58,839,768.2 4	0.07
590	002985	北摩高科	1,853,612	58,815,108.7 6	0.07
591	300226	上海钢联	2,340,128	58,784,015.3 6	0.07
592	300428	立中集团	2,516,718	58,765,365.3 0	0.07

593	600373	中文传媒	6,258,578	58,455,118.5 2	0.07
594	688700	东威科技	1,656,303	58,434,369.8 4	0.07
595	000880	潍柴重机	2,138,022	58,410,761.0 4	0.07
596	300416	苏试试验	3,273,450	58,398,348.0 0	0.07
597	600361	创新新材	13,749,000	58,295,760.0 0	0.07
598	301061	匠心家居	614,649	58,268,725.2 0	0.07
599	002045	国光电器	4,110,900	58,251,453.0 0	0.07
600	301626	苏州天脉	311,900	58,106,970.0 0	0.07
601	300443	金雷股份	2,063,903	58,057,591.3 9	0.07
602	000650	仁和药业	10,260,700	57,972,955.0 0	0.07
603	000672	上峰水泥	4,461,300	57,952,287.0 0	0.07
604	000927	中国铁物	22,202,700	57,949,047.0 0	0.07
605	002897	意华股份	1,070,300	57,871,121.0 0	0.07
606	301392	汇成真空	448,336	57,853,277.4 4	0.07
607	000791	甘肃能源	8,967,240	57,838,698.0 0	0.07
608	688439	振华风光	894,656	57,794,777.6 0	0.07
609	600266	城建发展	11,387,000	57,732,090.0 0	0.07
610	002258	利尔化学	4,421,446	57,699,870.3 0	0.07
611	300360	炬华科技	3,317,100	57,684,369.0 0	0.07
612	002434	万里扬	6,027,600	57,443,028.0 0	0.07
613	603599	广信股份	5,000,041	57,400,470.6 8	0.07
614	301571	国科天成	994,403	57,357,165.0 4	0.07

615	688690	纳微科技	2,221,831	57,345,458.1 1	0.07
616	300470	中密控股	1,523,100	57,268,560.0 0	0.07
617	600116	三峡水利	8,749,300	57,220,422.0 0	0.07
618	605123	派克新材	550,418	57,188,430.2 0	0.07
619	002079	苏州固锔	5,982,400	57,131,920.0 0	0.07
620	688165	埃夫特	2,420,778	57,022,685.2 8	0.07
621	688332	中科蓝讯	434,055	56,995,762.0 5	0.07
622	600094	大名城	13,690,322	56,951,739.5 2	0.07
623	000049	德赛电池	2,117,148	56,908,938.2 4	0.07
624	300232	洲明科技	7,995,875	56,690,753.7 5	0.07
625	688139	海尔生物	1,779,740	56,560,137.2 0	0.07
626	002531	天顺风能	8,230,400	56,460,544.0 0	0.07
627	603698	航天工程	1,492,670	56,439,162.5 0	0.07
628	301127	武汉天源	3,714,271	56,419,776.4 9	0.07
629	603496	恒为科技	2,067,364	56,397,689.9 2	0.07
630	600458	时代新材	4,247,710	56,367,111.7 0	0.07
631	600252	中恒集团	20,531,900	56,257,406.0 0	0.07
632	000600	建投能源	6,592,000	56,229,760.0 0	0.07
633	601702	华峰铝业	2,743,800	56,165,586.0 0	0.07
634	688658	悦康药业	2,472,694	55,907,611.3 4	0.07
635	000012	南玻 A	12,615,449	55,886,439.0 7	0.07
636	688696	极米科技	499,257	55,657,170.3 6	0.07

637	600269	赣粤高速	10,706,722	55,567,887.18	0.07
638	300171	东富龙	3,536,133	55,517,288.10	0.07
639	002421	达实智能	19,439,000	55,401,150.00	0.07
640	300027	华谊兄弟	25,520,100	55,378,617.00	0.07
641	300723	一品红	1,650,336	55,368,772.80	0.07
642	301487	盟固利	2,577,700	55,365,761.00	0.07
643	002626	金达威	2,803,200	55,251,072.00	0.07
644	688091	上海谊众	1,174,222	55,188,434.00	0.07
645	688352	颀中科技	4,374,581	55,163,466.41	0.07
646	002243	力合科创	5,542,434	55,147,218.30	0.07
647	002892	科力尔	4,154,508	55,136,097.36	0.07
648	002993	奥海科技	1,259,549	55,054,886.79	0.07
649	300451	创业慧康	11,371,425	55,037,697.00	0.07
650	301589	诺瓦星云	334,150	54,984,382.50	0.07
651	002254	泰和新材	5,486,905	54,978,788.10	0.07
652	300284	苏交科	6,970,756	54,929,557.28	0.07
653	688007	光峰科技	2,957,688	54,924,266.16	0.07
654	002859	洁美科技	1,979,800	54,642,480.00	0.07
655	600751	海航科技	14,231,000	54,504,730.00	0.07
656	000966	长源电力	12,756,300	54,469,401.00	0.07
657	600744	华银电力	9,263,500	54,469,380.00	0.07
658	300492	华图山鼎	731,220	54,329,646.00	0.07

659	603100	川仪股份	2,358,341	54,241,843.0 0	0.07
660	600059	古越龙山	5,856,112	54,227,597.1 2	0.07
661	600125	铁龙物流	8,395,400	54,066,376.0 0	0.07
662	600682	南京新百	6,172,180	53,944,853.2 0	0.07
663	000029	深深房 A	2,445,996	53,860,831.9 2	0.07
664	603279	景津装备	3,185,276	53,735,606.1 2	0.07
665	002881	美格智能	1,205,100	53,699,256.0 0	0.07
666	688300	联瑞新材	863,095	53,589,568.5 5	0.07
667	600623	华谊集团	6,932,200	53,447,262.0 0	0.07
668	603533	掌阅科技	2,411,400	53,340,168.0 0	0.07
669	300770	新媒股份	1,254,636	53,209,112.7 6	0.07
670	002127	南极电商	15,788,600	53,207,582.0 0	0.07
671	002093	国脉科技	4,613,927	53,060,160.5 0	0.07
672	600729	重庆百货	2,039,900	53,037,400.0 0	0.07
673	600006	东风股份	7,375,469	52,955,867.4 2	0.07
674	000990	诚志股份	6,677,960	52,889,443.2 0	0.07
675	688639	华恒生物	1,621,453	52,826,938.7 4	0.07
676	300633	开立医疗	1,998,099	52,789,775.5 8	0.07
677	300401	花园生物	3,490,800	52,780,896.0 0	0.07
678	300298	三诺生物	3,082,280	52,737,810.8 0	0.07
679	002588	史丹利	5,279,800	52,692,404.0 0	0.07
680	002219	新里程	24,734,800	52,685,124.0 0	0.07

681	688408	中信博	1,240,576	52,240,655.36	0.07
682	600033	福建高速	12,615,202	52,100,784.26	0.07
683	002929	润建股份	1,308,700	52,099,347.00	0.07
684	601908	京运通	13,318,800	52,076,508.00	0.07
685	600710	苏美达	4,809,300	51,988,533.00	0.07
686	000928	中钢国际	7,862,600	51,971,786.00	0.07
687	688106	金宏气体	2,652,201	51,956,617.59	0.07
688	301091	深城交	1,942,940	51,954,215.60	0.07
689	002668	TCL 智家	4,975,800	51,648,804.00	0.07
690	600612	老凤祥	1,160,712	51,616,862.64	0.07
691	002534	西子洁能	3,077,703	51,613,079.31	0.07
692	600502	安徽建工	10,979,200	51,492,448.00	0.07
693	600597	光明乳业	6,340,858	51,297,541.22	0.06
694	300257	开山股份	3,650,334	51,287,192.70	0.06
695	600586	金晶科技	9,098,140	51,222,528.20	0.06
696	301071	力量钻石	1,429,140	51,220,377.60	0.06
697	688003	天准科技	869,400	51,207,660.00	0.06
698	002761	浙江建投	5,973,800	51,195,466.00	0.06
699	002458	益生股份	6,106,500	51,172,470.00	0.06
700	600649	城投控股	11,488,132	51,122,187.40	0.06
701	300783	三只松鼠	2,202,680	50,992,042.00	0.06
702	300482	万孚生物	2,578,700	50,929,325.00	0.06

703	603197	保隆科技	1,374,819	50,854,554.8 1	0.06
704	002511	中顺洁柔	5,938,357	50,832,335.9 2	0.06
705	600017	日照港	16,886,700	50,660,100.0 0	0.06
706	688150	莱特光电	1,865,059	50,412,544.7 7	0.06
707	603328	依顿电子	4,599,200	50,407,232.0 0	0.06
708	002960	青鸟消防	4,792,213	50,366,158.6 3	0.06
709	002081	金螳螂	14,713,900	50,321,538.0 0	0.06
710	002913	奥士康	1,170,700	50,035,718.0 0	0.06
711	603118	共进股份	4,323,900	49,724,850.0 0	0.06
712	601200	上海环境	6,166,071	49,636,871.5 5	0.06
713	688739	成大生物	1,925,287	49,595,393.1 2	0.06
714	300463	迈克生物	4,423,800	49,502,322.0 0	0.06
715	600757	长江传媒	5,566,800	49,433,184.0 0	0.06
716	688549	中巨芯	5,413,963	49,375,342.5 6	0.06
717	002158	汉钟精机	1,968,170	49,263,295.1 0	0.06
718	603227	雪峰科技	5,911,700	49,185,344.0 0	0.06
719	000930	中粮科技	8,507,700	49,089,429.0 0	0.06
720	002125	湘潭电化	3,459,900	48,992,184.0 0	0.06
721	002194	武汉凡谷	3,753,352	48,981,243.6 0	0.06
722	002351	漫步者	4,058,981	48,951,310.8 6	0.06
723	603713	密尔克卫	876,300	48,871,251.0 0	0.06
724	002110	三钢闽光	11,127,750	48,850,822.5 0	0.06

725	301600	慧翰股份	375,765	48,778,054.6 5	0.06
726	688776	国光电气	482,933	48,650,670.4 2	0.06
727	002061	浙江交科	12,220,980	48,639,500.4 0	0.06
728	600248	陕建股份	13,754,373	48,552,936.6 9	0.06
729	301297	富乐德	1,354,089	48,476,386.2 0	0.06
730	002867	周大生	3,979,825	48,474,268.5 0	0.06
731	002038	双鹭药业	6,570,700	48,426,059.0 0	0.06
732	688380	中微半导	1,504,695	48,375,944.2 5	0.06
733	603477	巨星农牧	2,808,438	48,333,217.9 8	0.06
734	603508	思维列控	1,735,072	48,269,703.0 4	0.06
735	002925	盈趣科技	2,846,219	48,214,949.8 6	0.06
736	600305	恒顺醋业	6,085,941	48,200,652.7 2	0.06
737	300119	瑞普生物	2,566,569	48,174,500.1 3	0.06
738	603888	新华网	2,477,735	48,142,391.0 5	0.06
739	000848	承德露露	5,656,800	48,082,800.0 0	0.06
740	600123	兰花科创	8,122,634	48,004,766.9 4	0.06
741	600664	哈药股份	13,860,806	47,819,780.7 0	0.06
742	600012	皖通高速	3,224,402	47,785,637.6 4	0.06
743	002077	大港股份	3,194,830	47,507,122.1 0	0.06
744	600292	远达环保	3,636,745	47,459,522.2 5	0.06
745	000767	晋控电力	16,895,600	47,307,680.0 0	0.06
746	603733	仙鹤股份	1,950,600	47,146,002.0 0	0.06

747	002777	久远银海	2,623,748	47,070,039.1 2	0.06
748	000059	华锦股份	8,790,200	47,027,570.0 0	0.06
749	002832	比音勒芬	3,139,333	46,964,421.6 8	0.06
750	002498	汉缆股份	12,248,800	46,912,904.0 0	0.06
751	601595	上海电影	1,629,180	46,643,423.4 0	0.06
752	605599	菜百股份	2,845,600	46,582,472.0 0	0.06
753	600075	新疆天业	9,385,673	46,459,081.3 5	0.06
754	000950	重药控股	7,940,400	46,213,128.0 0	0.06
755	600395	盘江股份	9,903,300	46,149,378.0 0	0.06
756	601952	苏垦农发	5,047,770	46,035,662.4 0	0.06
757	300913	兆龙互连	873,500	45,972,305.0 0	0.06
758	601326	秦港股份	13,170,500	45,965,045.0 0	0.06
759	603099	长白山	1,003,500	45,308,025.0 0	0.06
760	600058	五矿发展	3,931,401	45,289,739.5 2	0.06
761	600675	中华企业	16,701,863	45,262,048.7 3	0.06
762	000552	甘肃能化	19,549,700	45,159,807.0 0	0.06
763	600963	岳阳林纸	9,652,050	45,075,073.5 0	0.06
764	688575	亚辉龙	3,168,755	44,996,321.0 0	0.06
765	600928	西安银行	12,156,700	44,979,790.0 0	0.06
766	002605	姚记科技	1,923,600	44,819,880.0 0	0.06
767	600575	淮河能源	13,174,500	44,793,300.0 0	0.06
768	603915	国茂股份	2,421,820	44,585,706.2 0	0.06

769	688032	禾迈股份	442,246	44,573,974.34	0.06
770	002516	旷达科技	6,759,472	44,544,920.48	0.06
771	000913	钱江摩托	2,888,600	44,542,212.00	0.06
772	000813	德展健康	11,573,200	44,441,088.00	0.06
773	300134	大富科技	3,545,302	44,316,275.00	0.06
774	688515	裕太微	431,180	44,217,509.00	0.06
775	600740	山西焦化	11,743,028	44,153,785.28	0.06
776	002946	新乳业	2,380,900	44,118,077.00	0.06
777	300809	华辰装备	1,157,220	44,055,365.40	0.06
778	600557	康缘药业	3,120,793	44,034,389.23	0.06
779	300768	迪普科技	2,370,671	43,928,533.63	0.06
780	603128	华贸物流	7,201,360	43,928,296.00	0.06
781	300151	昌红科技	2,907,700	43,848,116.00	0.06
782	600167	联美控股	6,237,200	43,847,516.00	0.06
783	688522	纳睿雷达	1,097,344	43,816,945.92	0.06
784	600812	华北制药	7,907,385	43,727,839.05	0.06
785	000028	国药一致	1,778,761	43,686,370.16	0.06
786	601900	南方传媒	3,253,200	43,625,412.00	0.06
787	603638	艾迪精密	2,296,865	43,479,654.45	0.06
788	600217	中再资环	10,639,600	43,409,568.00	0.05
789	301087	可孚医疗	970,045	43,331,910.15	0.05
790	300641	正丹股份	2,432,704	42,937,225.60	0.05

791	000048	京基智农	2,435,100	42,857,760.0 0	0.05
792	002978	安宁股份	1,294,884	42,795,916.2 0	0.05
793	001337	四川黄金	1,535,900	42,790,174.0 0	0.05
794	688432	有研硅	3,439,103	42,679,268.2 3	0.05
795	688190	云路股份	433,556	42,228,354.4 0	0.05
796	002705	新宝股份	2,955,300	42,142,578.0 0	0.05
797	601500	通用股份	8,716,872	42,015,323.0 4	0.05
798	002755	奥赛康	2,609,697	41,926,352.0 1	0.05
799	601163	三角轮胎	2,932,667	41,907,811.4 3	0.05
800	603297	永新光学	397,448	41,851,274.4 0	0.05
801	300579	数字认证	1,244,290	41,820,586.9 0	0.05
802	000756	新华制药	2,713,600	41,816,576.0 0	0.05
803	002635	安洁科技	3,016,890	41,814,095.4 0	0.05
804	301238	瑞泰新材	2,041,888	41,654,515.2 0	0.05
805	002612	朗姿股份	2,037,400	41,644,456.0 0	0.05
806	002727	一心堂	3,234,182	41,591,580.5 2	0.05
807	300080	易成新能	8,540,900	41,508,774.0 0	0.05
808	001914	招商积余	3,873,500	41,368,980.0 0	0.05
809	301267	华夏眼科	2,299,300	41,341,414.0 0	0.05
810	002051	中工国际	4,520,500	41,000,935.0 0	0.05
811	603383	顶点软件	1,134,360	40,961,739.6 0	0.05
812	300705	九典制药	2,731,632	40,919,847.3 6	0.05

813	000828	东莞控股	3,798,300	40,869,708.0 0	0.05
814	603033	三维股份	3,767,340	40,724,945.4 0	0.05
815	688107	安路科技	1,497,821	40,710,774.7 8	0.05
816	600975	新五丰	6,904,300	40,666,327.0 0	0.05
817	688584	上海合晶	1,852,808	40,650,607.5 2	0.05
818	601096	宏盛华源	9,785,218	40,608,654.7 0	0.05
819	688686	奥普特	326,225	40,494,309.2 5	0.05
820	600643	爱建集团	7,316,987	40,462,938.1 1	0.05
821	301522	上大股份	1,031,375	40,398,958.7 5	0.05
822	002399	海普瑞	3,423,400	40,361,886.0 0	0.05
823	000557	西部创业	8,071,600	40,196,568.0 0	0.05
824	002563	森马服饰	7,398,700	40,100,954.0 0	0.05
825	688631	莱斯信息	588,481	40,063,786.4 8	0.05
826	301175	中科环保	6,722,200	39,728,202.0 0	0.05
827	300820	英杰电气	824,164	39,518,663.8 0	0.05
828	603202	天有为	429,796	39,459,570.7 6	0.05
829	300926	博俊科技	1,203,284	39,443,649.5 2	0.05
830	002737	葵花药业	2,669,300	39,425,561.0 0	0.05
831	300341	麦克奥迪	2,388,000	39,019,920.0 0	0.05
832	603056	德邦股份	2,819,772	38,546,283.2 4	0.05
833	603919	金徽酒	1,887,043	38,533,418.0 6	0.05
834	002489	浙江永强	9,992,200	38,270,126.0 0	0.05

835	600861	北京人力	2,076,901	38,090,364.3 4	0.05
836	600163	中闽能源	7,015,500	38,024,010.0 0	0.05
837	601101	昊华能源	5,298,140	37,934,682.4 0	0.05
838	605333	沪光股份	1,267,158	37,799,323.1 4	0.05
839	688586	江航装备	2,896,084	37,764,935.3 6	0.05
840	601033	永兴股份	2,490,211	37,676,892.4 3	0.05
841	603229	奥翔药业	3,793,012	37,626,679.0 4	0.05
842	002101	广东鸿图	3,044,100	37,503,312.0 0	0.05
843	301363	美好医疗	1,559,260	37,500,203.0 0	0.05
844	688443	智翔金泰	1,369,394	37,302,292.5 6	0.05
845	002060	广东建工	10,330,100	37,188,360.0 0	0.05
846	603025	大豪科技	2,070,420	37,184,743.2 0	0.05
847	002697	红旗连锁	6,226,600	36,986,004.0 0	0.05
848	603043	广州酒家	2,081,120	36,690,145.6 0	0.05
849	002216	三全食品	3,243,798	36,622,479.4 2	0.05
850	300861	美畅股份	2,450,408	36,584,591.4 4	0.05
851	600640	国脉文化	2,911,700	36,570,952.0 0	0.05
852	603317	天味食品	2,907,524	36,402,200.4 8	0.05
853	002901	大博医疗	764,870	36,231,891.9 0	0.05
854	601107	四川成渝	5,947,200	36,158,976.0 0	0.05
855	001339	智微智能	721,800	36,127,798.0 0	0.05
856	600894	广日股份	3,904,885	36,120,186.2 5	0.05

857	600197	伊力特	2,603,526	36,032,799.84	0.05
858	002068	黑猫股份	4,072,300	35,917,686.00	0.05
859	300127	银河磁体	1,181,800	35,843,994.00	0.05
860	002882	金龙羽	1,186,300	35,778,808.00	0.05
861	000550	江铃汽车	1,916,630	35,649,318.00	0.05
862	301000	肇民科技	902,840	35,544,810.80	0.04
863	600335	国机汽车	5,458,950	35,537,764.50	0.04
864	601801	皖新传媒	5,379,815	35,399,182.70	0.04
865	600020	中原高速	8,304,900	35,378,874.00	0.04
866	301551	无线传媒	1,115,986	34,684,358.30	0.04
867	003006	百亚股份	1,578,000	34,463,520.00	0.04
868	003012	东鹏控股	5,260,100	34,453,655.00	0.04
869	000498	山东路桥	5,712,067	34,443,764.01	0.04
870	002390	信邦制药	10,689,200	34,419,224.00	0.04
871	000567	海德股份	5,361,107	34,418,306.94	0.04
872	301325	曼恩斯特	680,629	34,405,795.95	0.04
873	603013	亚普股份	1,394,266	34,396,542.22	0.04
874	000597	东北制药	6,587,558	34,387,052.76	0.04
875	603730	岱美股份	3,922,913	34,364,717.88	0.04
876	600223	福瑞达	4,663,401	34,322,631.36	0.04
877	002791	坚朗五金	1,618,214	34,322,318.94	0.04
878	600971	恒源煤电	5,491,950	34,269,768.00	0.04

879	301015	百洋医药	1,442,528	34,043,660.8 0	0.04
880	600810	神马股份	3,759,731	33,799,981.6 9	0.04
881	600929	雪天盐业	5,975,200	33,759,880.0 0	0.04
882	601949	中国出版	5,227,400	33,716,730.0 0	0.04
883	603355	莱克电气	1,057,120	33,542,417.6 0	0.04
884	600997	开滦股份	5,810,700	33,411,525.0 0	0.04
885	688552	航天南湖	915,013	33,233,272.1 6	0.04
886	002651	利君股份	2,827,700	33,055,813.0 0	0.04
887	000719	中原传媒	2,805,800	32,996,208.0 0	0.04
888	603530	神马电力	800,700	32,892,756.0 0	0.04
889	301109	军信股份	2,186,450	32,796,750.0 0	0.04
890	688252	天德钰	1,534,616	32,487,820.7 2	0.04
891	688185	康希诺	516,046	32,433,491.1 0	0.04
892	688209	英集芯	1,625,830	32,419,050.2 0	0.04
893	603093	南华期货	1,661,600	32,384,584.0 0	0.04
894	605555	德昌股份	1,765,010	32,299,683.0 0	0.04
895	301153	中科江南	1,305,856	32,280,760.3 2	0.04
896	600639	浦东金桥	3,124,523	32,088,851.2 1	0.04
897	300183	东软载波	2,146,300	31,829,629.0 0	0.04
898	601089	福元医药	1,316,100	31,586,400.0 0	0.04
899	688128	中国电研	1,084,304	31,531,560.3 2	0.04
900	600662	外服控股	6,262,801	31,439,261.0 2	0.04

901	600508	上海能源	2,649,843	31,188,652.1 1	0.04
902	688182	灿勤科技	1,053,121	31,088,131.9 2	0.04
903	603866	桃李面包	5,904,277	31,056,497.0 2	0.04
904	002041	登海种业	3,242,599	30,934,394.4 6	0.04
905	002267	陕天然气	4,104,600	30,907,638.0 0	0.04
906	603162	海通发展	2,565,102	30,883,828.0 8	0.04
907	301207	华兰疫苗	1,645,791	30,661,086.3 3	0.04
908	301606	绿联科技	521,618	30,639,841.3 2	0.04
909	603567	珍宝岛	3,429,000	30,620,970.0 0	0.04
910	600403	大有能源	4,364,500	30,464,210.0 0	0.04
911	300917	特发服务	779,087	30,462,301.7 0	0.04
912	688351	微电生理	1,313,162	30,399,700.3 0	0.04
913	603826	坤彩科技	1,784,600	30,338,200.0 0	0.04
914	688232	新点软件	1,221,261	30,311,698.0 2	0.04
915	603072	天和磁材	743,210	30,241,214.9 0	0.04
916	300702	天宇股份	1,271,980	30,018,728.0 0	0.04
917	603327	福蓉科技	2,812,315	29,941,740.9 0	0.04
918	001236	弘业期货	2,820,943	29,643,995.8 0	0.04
919	603299	苏盐井神	2,841,700	29,610,514.0 0	0.04
920	301047	义翘神州	436,405	29,500,978.0 0	0.04
921	002053	云南能投	2,549,600	29,371,392.0 0	0.04
922	002242	九阳股份	2,794,437	29,173,922.2 8	0.04

923	688276	百克生物	1,533,872	28,928,825.9 2	0.04
924	601038	一拖股份	2,025,793	28,705,486.8 1	0.04
925	002302	西部建设	4,678,300	28,631,196.0 0	0.04
926	300406	九强生物	2,178,100	28,467,767.0 0	0.04
927	002840	华统股份	2,954,800	28,425,176.0 0	0.04
928	605116	奥锐特	1,125,500	28,193,775.0 0	0.04
929	600903	贵州燃气	4,248,296	28,081,236.5 6	0.04
930	601882	海天精工	1,441,400	28,049,644.0 0	0.04
931	688348	昱能科技	555,498	27,991,544.2 2	0.04
932	002543	万和电气	2,712,399	27,693,593.7 9	0.04
933	301678	新恒汇	427,832	27,475,371.0 4	0.03
934	301327	华宝新能	475,858	27,442,730.8 6	0.03
935	600657	信达地产	7,844,100	27,062,145.0 0	0.03
936	603193	润本股份	1,115,200	27,021,296.0 0	0.03
937	301565	中仑新材	1,114,611	26,906,709.5 4	0.03
938	301268	铭利达	1,475,781	26,903,487.6 3	0.03
939	601083	锦江航运	2,378,373	26,542,642.6 8	0.03
940	000899	赣能股份	2,680,437	26,536,326.3 0	0.03
941	688177	百奥泰	1,142,915	26,447,053.1 0	0.03
942	000030	富奥股份	4,600,900	26,409,166.0 0	0.03
943	301376	致欧科技	1,461,221	26,404,263.4 7	0.03
944	601858	中国科传	1,442,800	26,186,820.0 0	0.03

945	688337	普源精电	696,695	25,701,078.5 5	0.03
946	000058	深赛格	2,732,900	25,689,260.0 0	0.03
947	301631	壹连科技	243,776	25,243,004.8 0	0.03
948	002287	奇正藏药	1,060,700	25,096,162.0 0	0.03
949	603983	丸美生物	754,300	25,005,045.0 0	0.03
950	605009	豪悦护理	798,471	24,672,753.9 0	0.03
951	301215	中汽股份	3,601,800	24,672,330.0 0	0.03
952	600726	华电能源	10,242,200	24,478,858.0 0	0.03
953	600618	氯碱化工	2,055,500	24,419,340.0 0	0.03
954	301500	飞南资源	1,542,060	24,194,921.4 0	0.03
955	000885	城发环境	1,759,240	24,136,772.8 0	0.03
956	601003	柳钢股份	4,762,300	23,954,369.0 0	0.03
957	301458	钧崴电子	745,396	23,919,757.6 4	0.03
958	688001	华兴源创	791,688	23,893,143.8 4	0.03
959	300856	科思股份	1,720,795	23,196,316.6 0	0.03
960	301339	通行宝	1,592,280	23,151,751.2 0	0.03
961	603055	台华新材	2,440,600	23,039,264.0 0	0.03
962	000761	本钢板材	6,860,387	22,982,296.4 5	0.03
963	301592	六九一二	187,600	22,924,720.0 0	0.03
964	301381	赛维时代	1,110,700	22,869,313.0 0	0.03
965	002275	桂林三金	1,609,500	22,693,950.0 0	0.03
966	600746	江苏索普	3,254,300	22,389,584.0 0	0.03

967	301556	托普云农	227,009	22,255,962.3 6	0.03
968	601022	宁波远洋	2,404,300	22,047,431.0 0	0.03
969	002911	佛燃能源	1,776,071	21,525,980.5 2	0.03
970	603395	红四方	726,193	21,226,621.3 9	0.03
971	000019	深粮控股	3,050,400	21,200,280.0 0	0.03
972	001356	富岭股份	1,600,200	20,674,584.0 0	0.03
973	301004	嘉益股份	391,320	20,368,206.0 0	0.03
974	301622	英思特	314,102	20,228,168.8 0	0.03
975	300755	华致酒行	1,136,580	20,026,539.6 0	0.03
976	301508	中机认检	628,100	19,634,406.0 0	0.02
977	603693	江苏新能	1,617,620	19,184,973.2 0	0.02
978	001308	康冠科技	912,232	19,029,159.5 2	0.02
979	605296	神农集团	637,900	18,703,228.0 0	0.02
980	603194	中力股份	472,691	18,581,483.2 1	0.02
981	003039	顺控发展	1,136,600	18,106,038.0 0	0.02
982	603219	富佳股份	1,042,400	17,554,016.0 0	0.02
983	301371	敷尔佳	717,340	16,993,784.6 0	0.02
984	301275	汉朔科技	300,915	16,074,879.3 0	0.02
985	603057	紫燕食品	770,230	15,666,478.2 0	0.02
986	605011	杭州热电	751,453	15,359,699.3 2	0.02
987	601068	中铝国际	2,884,800	15,260,592.0 0	0.02
988	601811	新华文轩	1,105,200	14,831,784.0 0	0.02

989	603014	威高血净	369,177	14,630,484.51	0.02
990	605118	力鼎光电	484,700	14,594,317.00	0.02
991	605099	共创草坪	400,805	14,304,730.45	0.02
992	605198	安德利	369,400	13,896,828.00	0.02
993	688726	拉普拉斯	322,834	11,622,024.00	0.01
994	603103	横店影视	695,821	11,536,712.18	0.01
995	301602	超研股份	524,104	11,289,200.16	0.01
996	301658	首航新能	369,869	10,563,458.64	0.01
997	301262	海看股份	423,482	10,540,466.98	0.01
998	301177	迪阿股份	359,167	10,369,151.29	0.01
999	603262	技源集团	363,037	10,342,863.68	0.01
1,000	301665	泰禾股份	319,372	9,019,065.28	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	600930	华电新能	254,555	1,588,423.20	0.00
2	688783	西安奕材	14,790	271,544.40	0.00
3	301656	联合动力	7,395	188,276.70	0.00
4	688795	摩尔线程	344	143,165.92	0.00
5	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.00
6	688729	屹唐股份	3,505	85,101.40	0.00
7	688759	必贝特	2,789	70,031.79	0.00
8	688809	强一股份	259	52,657.29	0.00
9	688802	沐曦股份	102	40,729.62	0.00
10	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.00
11	001386	马可波罗	1,626	30,129.78	0.00
12	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
13	001233	海安集团	370	19,195.60	0.00

14	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
15	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
16	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
17	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
18	688765	禾元生物	262	13,786.44	0.00
19	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
20	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
21	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
22	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
23	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
24	688790	昂瑞微	86	10,078.34	0.00
25	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
26	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
27	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
28	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
29	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
30	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
31	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
32	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
33	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
34	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
35	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
36	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
37	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
38	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
39	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
40	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
41	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	002456	欧菲光	644,894,836.08	1.20
2	002402	和而泰	386,806,576.08	0.72
3	002126	银轮股份	350,907,358.85	0.65
4	002405	四维图新	342,720,260.78	0.64
5	300548	长芯博创	338,864,128.53	0.63
6	001309	德明利	333,655,930.22	0.62
7	300779	惠城环保	320,354,346.90	0.59
8	000766	通化金马	315,115,155.83	0.58

9	300459	汤姆猫	308,180,679.86	0.57
10	300972	万辰集团	306,285,455.01	0.57
11	003021	兆威机电	286,492,489.56	0.53
12	002245	蔚蓝锂芯	282,633,673.11	0.52
13	688313	仕佳光子	280,042,227.51	0.52
14	002139	拓邦股份	276,329,379.87	0.51
15	300170	汉得信息	270,398,438.27	0.50
16	300666	江丰电子	269,034,664.57	0.50
17	002497	雅化集团	267,468,028.34	0.50
18	300253	卫宁健康	265,350,998.41	0.49
19	300085	银之杰	264,237,770.09	0.49
20	002335	科华数据	262,372,618.61	0.49

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	002402	和而泰	746,509,573.55	1.39
2	002456	欧菲光	607,774,643.24	1.13
3	002126	银轮股份	605,268,171.24	1.12
4	002335	科华数据	428,852,341.14	0.80
5	002130	沃尔核材	410,521,363.25	0.76
6	300570	太辰光	409,416,990.64	0.76
7	688347	华虹公司	407,721,637.17	0.76
8	000657	中钨高新	382,414,987.29	0.71
9	002851	麦格米特	381,263,007.28	0.71
10	300432	富临精工	373,648,094.36	0.69
11	300458	全志科技	371,784,732.98	0.69
12	300346	南大光电	363,466,508.97	0.67
13	003021	兆威机电	356,499,704.48	0.66
14	688235	百济神州	340,892,286.91	0.63
15	002405	四维图新	332,567,276.27	0.62
16	300757	罗博特科	331,887,228.89	0.62
17	600601	方正科技	320,650,990.43	0.60
18	688608	恒玄科技	320,440,779.29	0.59
19	002583	海能达	309,880,204.81	0.58
20	300779	惠城环保	304,586,234.66	0.57

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	84,737,273,768.36
卖出股票收入（成交）总额	78,893,599,093.95

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）	13,495,817.37	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,495,817.37	0.02

## 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	123263	鼎捷转债	50,006	7,251,056.32	0.01
2	118062	天准转债	39,700	6,244,761.05	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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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	230,285,443.41
2	应收清算款	34,248,630.04
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	264,534,073.45

#### 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600105	永鼎股份	22,390,000.00	0.03	大宗交易锁定期

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600930	华电新能	1,588,423.20	0.00	新股锁定期
2	688783	西安奕材	271,544.40	0.00	新股锁定期
3	301656	联合动力	188,276.70	0.00	新股锁定期
4	688795	摩尔线程	143,165.92	0.00	新股锁定期
5	001280	中国铀业	103,284.72	0.00	新股锁定期

## § 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		南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
47,119	544,392.23	24,374,872,339.00	95.02%	1,027,467,722.00	4.01%	248,877,585.00	0.97%

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中央汇金资产管理有限责任公司	13,212,186,794.00	51.51%
2	中央汇金投资有限责任公司	8,956,692,256.00	34.92%
3	国泰海通证券股份有限公司	87,427,333.00	0.34%
4	中国人寿保险股份有限公司	85,058,493.00	0.33%
5	陕西省国际信托股份有限公司—陕国投·鑫和 18 号证券投资集合资金信托计划	71,180,000.00	0.28%
6	大家人寿保险股份有限公司—传统产品	68,928,169.00	0.27%
7	财通证券股份有限公司	67,461,706.00	0.26%
8	申万宏源证券有限公司	67,050,199.00	0.26%
9	滕伟	67,000,000.00	0.26%
10	长城证券股份有限公司	62,575,543.00	0.24%
11	招商银行股份有限公司—南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	248,877,585.00	0.97%

## 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(2016 年 9 月 29 日)基金份额总额	587,892,000.00
本报告期期初基金份额总额	22,253,217,646.00
本报告期基金总申购份额	43,574,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	40,176,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	25,651,217,646.00

## § 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 100,000.00 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	
华泰证券	4	74,893,794,150.27	45.77%	7,482,616.60	45.75%	-
国泰海通	2	41,172,020,269.83	25.16%	4,116,644.05	25.17%	-
广发证券	2	15,343,772,158.85	9.38%	1,532,965.48	9.37%	-
中金公司	1	11,014,907,325.22	6.73%	1,101,315.05	6.73%	-
招商证券	2	10,097,345,212.35	6.17%	1,011,980.87	6.19%	-
国信证券	1	9,054,857,412.01	5.53%	904,788.69	5.53%	-
长江证券	1	2,048,100,633.57	1.25%	204,626.98	1.25%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	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：国投证券。

## 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	25,277,998.49	33.30%	-	-	-	-
国泰海 通	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
招商证 券	34,902,286.61	45.98%	-	-	-	-
国信证 券	8,223,722.67	10.83%	-	-	-	-
长江证 券	7,503,809.27	9.89%	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 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、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-04
3	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
4	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金分红公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-10
5	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	2025-02-20

		基金电子披露网站	
6	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
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	2025-03-20
8	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
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	2025-05-14
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
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	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	2025-09-24
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
16	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
17	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	2025-12-16
18	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	2025-12-17

## § 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	202501-01-20251231	8,956,692,256.00	-	-	8,956,692,256.00	34.92%
机构	2	202501-01-20251231	7,557,031,966.00	5,655,154,828.00	-	13,212,186,794.00	51.51%
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 1000 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方中证 1000 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 1000 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>