

中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 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、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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 中期财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
7.6 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	58
7.7 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	58
7.8 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	59
7.9 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	59

7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	61
§9 开放式基金份额变动	61
§10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
10.2 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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	62
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	62
10.8 其他重大事件	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息	64
11.1 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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 500ETF
场内简称	500ETF；中证 500ETF 南方
基金主代码	510500
交易代码	510500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,148,568,617.00 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	2013 年 3 月 15 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	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 指数。
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	任航
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-68121816
注册地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址	深圳市福田区莲花街道 益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518017	100031
法定代表人	周易	谷澍

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告置备地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	40,397,681,612.00
本期利润	22,204,345,722.37
加权平均基金份额本期利润	2.3337
本期加权平均净值利润率	28.11%
本期基金份额净值增长率	21.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	25,166,975,030.95
期末可供分配基金份额利润	6.0664
期末基金资产净值	38,087,347,510.01
期末基金份额净值	9.1808
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	206.71%

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	19.53%	1.65%	18.56%	1.65%	0.97%	0.00%
过去六个月	21.87%	1.66%	20.97%	1.66%	0.90%	0.00%
过去一年	55.02%	1.43%	52.68%	1.42%	2.34%	0.01%
过去三年	56.90%	1.49%	50.55%	1.49%	6.35%	0.00%
过去五年	43.77%	1.36%	32.65%	1.36%	11.12%	0.00%
过去七年	105.34%	1.36%	82.43%	1.36%	22.91%	0.00%
过去十年	70.88%	1.35%	47.49%	1.35%	23.39%	0.00%
自基金合同 生效起至今	206.71%	1.56%	154.81%	1.56%	51.90%	0.00%

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



§ 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		
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日	-	21 年	中国国籍，女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月 17 日至 2015 年 6 月 16 日，任南方策略基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2019 年 4 月 18 日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 3 月 27 日，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至 2020 年 3 月 27 日，任南方 H 股联接基金经理；2014 年 10 月 30 日至 2020 年 12 月 23 日，任 500 医药基金经理；2021 年 3 月 12 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理；2021 年 10 月 22 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证全指医疗保健

					ETF 基金经理;2020 年 12 月 25 日至 2023 年 8 月 25 日,任南方策略基金经理;2021 年 7 月 2 日至 2023 年 8 月 25 日,任南方中证香港科技 ETF (QDII) 基金经理;2022 年 6 月 17 日至 2023 年 8 月 25 日,任南方恒生香港上市生物科技 ETF (QDII) 基金经理;2023 年 5 月 30 日至 2024 年 7 月 5 日,任南方恒生香港上市生物科技 ETF 发起联接 (QDII) 基金经理;2024 年 7 月 5 日至 2025 年 7 月 25 日,任南方基金南方东英沙特阿拉伯 ETF (QDII) 基金经理;2024 年 11 月 4 日至 2025 年 12 月 5 日,任南方中证沪深港黄金产业股票指数发起基金经理;2013 年 4 月 22 日至今,任南方 500、南方 500ETF 基金经理;2013 年 5 月 17 日至今,任南方 300、南方 300 联接基金经理;2015 年 2 月 16 日至今,任南方恒生 ETF 基金经理;2017 年 7 月 21 日至今,任恒生联接基金经理;2017 年 8 月 24 日至今,任南方房地产联接基金经理;2017 年 8 月 25 日至今,任南方房地产 ETF 基金经理;2018 年 4 月 3 日至今,任 MSCI 基金基金经理;2018 年 6 月 8 日至今,任 MSCI 联接基金经理;2020 年 7 月 24 日至今,兼任投资经理;2024 年 6 月 26 日至今,任南方中证国新港股通央企红利 ETF 基金经理;2024 年 9 月 12 日至今,任南方港股通央企红利 ETF 联接基金经理;2025 年 6 月 30 日至今,任南方中证港股通科技 ETF 基金经理;2025 年 9 月 18 日至今,任南方中证港股通科技 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；

3、报告截止日至批准送出日期间，自 2026 年 7 月 24 日起龚涛新任本基金的基金经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
罗文杰	公募基金	14	61,288,011,599.50	2013 年 04 月 22 日

	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	1	922,311,474.24	2026 年 03 月 12 日
	合计	15	62,210,323,073.74	-

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》及其他有关法律法规的规定及本基金基金合同的约定，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利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。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 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 24 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 500 指数涨 20.97%。中证 500 是 A 股市场核心中盘股指数，随着 A 股市场扩容与成分股市值增长，中证 500 总市值不断扩大，目前已增长至约 21 万亿元，流通市值约 10 万亿元。成分股总市值中位数从 2010 年的 60 多亿元增长至目前的 290 多亿元。随着中国经济转型发展和 A 股市场的变迁，中证 500 的行业构成不断迭代，房地产、基础化

工等传统行业权重逐渐下滑，而电子、电力设备、机械设备等新兴行业权重逐渐占据主导地位。现下指数仍被大幅低估，具有较高的安全边际。

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) 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；

(3) 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 9.1808 元，报告期内，份额净值增长率为 21.87%，同期业绩基准增长率为 20.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年还是比较乐观的，一是国内整体经济温和复苏，6 月 PPI 转正至 4.1%，工业利润 1-6 月累计同比高增 18%以上，“十五五”开局叠加“反内卷”与再通胀双轮驱动，慢牛下半场的盈利基础比 2025 年更扎实。二是流动性结构在持续优化，支撑 A 股成为全球波动中“更安全的避风港”，人民币汇率稳中偏强也有助于外资持续加配。三是产业主线极为清晰：Agent 时代到来推动 AI PCB、存储涨价、光模块、算力硬件景气持续验证。综合来看，指数在科技板块推动下有望温和上行，下半年仍具备重返高点并向上打开空间的条件。

中证 500 是 A 股市场的核心中盘股指数，在我国逐渐转向创新驱动发展的过程中，指数不仅受益于国家对科技创新领域的政策支持、新经济行业本身快速增长的红利，还能够享受各细分行业龙头公司在经济转型与集中度提升下的竞争优势。近期正处半年报业绩预披露期，目前有 157 只指数成份股公布半年报业绩预告，预喜率高达 76%，平均净利润增速高达 140%左右。这波 AI 驱动的超级大周期下，相信会有进一步盈利和估值的提升。

4.6 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、指数研究部总经理、现金及债券指数投资部总经理、国际投资部总经理、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。

4.7 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 2026 年 1 月 15 日，每 10 份基金份额分红数 0.6200。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	270,738,192.65	247,566,223.06
结算备付金		1,469,073,173.68	5,044,902,726.52
存出保证金		296,193,275.55	814,344,332.62
交易性金融资产	6.4.7.2	36,244,445,346.10	138,092,764,461.68
其中：股票投资		36,230,545,979.46	138,078,154,237.53
基金投资		-	-
债券投资		13,899,366.64	14,610,224.15
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	600,034,556.06
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		20,186,431.52	100,946,284.11
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		38,300,636,419.50	144,900,558,584.05

负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	401,521.30
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,708,313.04	17,352,119.86
应付托管费		1,569,437.67	5,784,039.98
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		543,235.49	3,598,233.76
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	206,467,923.29	182,948,001.30
负债合计		213,288,909.49	210,083,916.20
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	12,920,372,479.06	59,375,015,945.36
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	25,166,975,030.95	85,315,458,722.49
净资产合计		38,087,347,510.01	144,690,474,667.85
负债和净资产总计		38,300,636,419.50	144,900,558,584.05

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 9.1808 元，基金份额总额 4,148,568,617.00 份。

6.2 利润表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		22,288,601,955.27	6,402,618,195.75
1.利息收入		15,162,932.00	17,556,746.13
其中：存款利息收入	6.4.7.9	14,955,595.61	16,548,095.81
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产		207,336.39	1,008,650.32

收入			
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		40,199,828,955.00	4,479,628,956.70
其中：股票投资收益	6.4.7.10	38,574,635,922.34	3,559,791,105.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	19,998,834.11	6,438,277.36
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	1,389,453,078.23	-112,793,530.16
股利收益	6.4.7.14	215,741,120.32	1,026,193,103.72
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）	6.4.7.15	-18,193,335,889.63	1,905,568,397.92
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.16	266,945,957.90	-135,905.00
减：二、营业总支出		84,256,232.90	109,727,936.95
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	59,310,092.71	77,311,874.99
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	19,770,030.86	25,770,625.00
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		5,003,435.49	13.30
8.其他费用	6.4.7.18	172,673.84	6,645,423.66
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		22,204,345,722.37	6,292,890,258.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		22,204,345,722.37	6,292,890,258.80
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		22,204,345,722.37	6,292,890,258.80

6.3 净资产变动表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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	59,375,015,945.36	-	85,315,458,722.49	144,690,474,667.85
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	59,375,015,945.36	-	85,315,458,722.49	144,690,474,667.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-46,454,643,466.30	-	-60,148,483,691.54	-106,603,127,157.84
（一）、综合收益总额	-	-	22,204,345,722.37	22,204,345,722.37
（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）	-46,454,643,466.30	-	-81,191,608,546.16	-127,646,252,012.46
其中：1.基金申购款	41,817,899,469.66	-	69,557,166,194.30	111,375,065,663.96
2.基金赎回款	-88,272,542,935.96	-	-150,748,774,740.46	-239,021,317,676.42
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-1,161,220,867.75	-1,161,220,867.75
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	12,920,372,479.06	-	25,166,975,030.95	38,087,347,510.01
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	54,479,152,465.75	-	47,270,593,603.14	101,749,746,068.89
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	54,479,152,465.75	-	47,270,593,603.14	101,749,746,068.89
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,732,668,029.19	-	6,955,547,996.03	11,688,216,025.22
(一)、综合收益总额	-	-	6,292,890,258.80	6,292,890,258.80
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	4,732,668,029.19	-	2,264,964,774.04	6,997,632,803.23
其中：1.基金申购款	31,317,331,244.01	-	25,127,201,433.27	56,444,532,677.28
2.基金赎回款	-26,584,663,214.82	-	-22,862,236,659.23	-49,446,899,874.05
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-1,602,307,036.81	-1,602,307,036.81
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	59,211,820,494.94	-	54,226,141,599.17	113,437,962,094.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1727 号《关于核准中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准,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《中证 500 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 1,147,543,632.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 075 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 2 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,147,553,216.00 份,其中通过基金管理人进行网下现金认购部分的认购资金利息折合 9,584.00 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债[2013]83 号审核同意,本基金 4,616,093,841.00 份基金份额于 2013 年 3 月 15 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中证 500 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 500 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以及存托凭证)、一级市场新股或增发的股票、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。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 95%,权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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 500 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,根据《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的约定,于 2013 年 2 月 22 日将管理的南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)变更为南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)(以下简称“南方中证 500ETF 联接(LOF)基金”)。南方中证 500ETF 联接(LOF)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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以

下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集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》《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策,会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、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》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前,资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为,可以选择适用简易计税方法,按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。

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

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

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	270,738,192.65
等于：本金	270,647,926.26
加：应计利息	90,266.39
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	270,738,192.65

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		32,466,408,348.92	-	36,230,545,979.46	3,764,137,630.54
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	13,899,000.00	366.64	13,899,366.64	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	13,899,000.00	366.64	13,899,366.64	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		32,480,307,348.92	366.64	36,244,445,346.10	3,764,137,630.54

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 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	1,709,037,482.85	-	-	-
-股指期货	1,709,037,482.85	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,709,037,482.85	-	-	-

6.4.7.3.2 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
IC2609	IC2609	1,040.00	1,822,371,200.0	113,333,717.15

			0	
合计				113,333,717.15
减：可抵销期货暂收款				113,333,717.15
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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 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	10,812,363.78
其中：交易所市场	10,812,363.78
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	185,682,270.05
预提费用	109,095.94
应付指数使用费	-
可退替代款	9,864,193.52
合计	206,467,923.29

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,064,568,617.00	59,375,015,945.36

本期申购	13,427,200,000.00	41,817,899,469.66
本期赎回（以“-”号填列）	-28,343,200,000.00	-88,272,542,935.96
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	4,148,568,617.00	12,920,372,479.06

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）。

6.4.7.8 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	133,263,254,983.73	-47,947,796,261.24	85,315,458,722.49
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	133,263,254,983.73	-47,947,796,261.24	85,315,458,722.49
本期利润	40,397,681,612.00	-18,193,335,889.63	22,204,345,722.37
本期基金份额交易产生的变动数	-127,273,298,689.42	46,081,690,143.26	-81,191,608,546.16
其中：基金申购款	121,882,745,855.57	-52,325,579,661.27	69,557,166,194.30
基金赎回款	-249,156,044,544.99	98,407,269,804.53	-150,748,774,740.46
本期已分配利润	-1,161,220,867.75	-	-1,161,220,867.75
本期末	45,226,417,038.56	-20,059,442,007.61	25,166,975,030.95

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,999,873.92
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	9,849,635.73
其他	106,085.96
合计	14,955,595.61

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	25,312,357,013.90
股票投资收益——赎回差价收入	13,262,278,908.44

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	38,574,635,922.34

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	150,349,891,305.07
减：卖出股票成本总额	124,922,976,393.75
减：交易费用	114,557,897.42
买卖股票差价收入	25,312,357,013.90

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	239,021,317,676.42
减：现金支付赎回款总额	126,785,580,133.42
减：赎回股票成本总额	98,973,458,634.56
减：交易费用	-
赎回差价收入	13,262,278,908.44

6.4.7.10.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	1,312.37
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	19,997,521.74
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	19,998,834.11

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	42,612,334.84
减：卖出债券（债转股及债券到期	22,611,900.00

兑付) 成本总额	
减: 应计利息总额	1,209.11
减: 交易费用	1,703.99
买卖债券差价收入	19,997,521.74

注: 上述交易费用 (如有) 包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位: 人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	1,389,453,078.23

6.4.7.14 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	215,741,120.32
其中: 证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	215,741,120.32

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-17,946,468,789.64
——股票投资	-17,946,468,789.64
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-246,867,099.99
——权证投资	-
——期货投资	-246,867,099.99
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	-18,193,335,889.63

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	266,945,957.90
合计	266,945,957.90

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。

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	42,617.87
其他	20,960.03
合计	172,673.84

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 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 7 月 14 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 1.4900 元。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

南方基金管理股份有限公司（“南方基金”）	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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
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
南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）（“南方中证 500ETF 联接（LOF）基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金
华泰金融控股(香港)有限公司（“华泰金控”）	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	59,278,421,206.77	24.69%	12,369,665,194.99	14.53%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	39,048,624.78	91.64%	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华泰证券	-	-	1,100,000,000.00	68.75%

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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	5,925,744.37	24.70%	2,126,774.97	19.67%
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	1,236,922.39	14.53%	1,129,004.66	20.59%

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	59,310,092.71	77,311,874.99
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,734,102.49	2,177,801.99
应支付基金管理人的净管理费	54,575,990.22	75,134,073.00

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026	上年度可比期间 2025 年 1
----	-------------------------	------------------

	年 6 月 30 日	月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	19,770,030.86	25,770,625.00

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：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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
华泰金融控股（香港）有限公司—自有资金	10,000.00	0.00%	10,000.00	0.00%
华泰证券股份有限公司	113,842,256.00	2.74%	244,841,519.00	1.28%
兴业证券股份有限公司	268,742.00	0.01%	33,527,727.00	0.18%
中国农业银行—南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	913,608,678.00	22.02%	1,008,628,500.00	5.29%

(LOF)				
-------	--	--	--	--

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。

6.4.10.6 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	270,738,192.65	4,999,873.92	81,659,058.05	1,557,919.97

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。

6.4.10.7 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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	113704	春风转债	配债	53,520	5,352,000.00
华泰联合	603293	埃泰克	网下申购	716	23,978.84

上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	127108	太能转债	配债	266,319	26,631,900.00
华泰联合	301458	钧崑电子	网下申购	7,005	72,852.00
华泰联合	603014	威高血净	网下申购	2,045	54,192.50
华泰联合	688757	胜科纳米	网下申购	5,357	48,641.56

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 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	2026 年	2026 年	-	0.6200	1,161,2	-	1,161,2	-

	1 月 15 日	1 月 16 日			20,867.75		20,867.75	
合计	-	-	-	0.6200	1,161,220,867.75	-	1,161,220,867.75	-

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。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
300757	罗博特科	2026 年 4 月 17 日	6 个月	大宗受限锁定	466.36	560.47	220,000	102,599,200.00	123,303,400.00	-
300757	罗博特科	2026 年 5 月 11 日	6 个月	大宗受限锁定	455.95	555.34	38,300	17,462,885.00	21,269,522.00	-
600601	方正科技	2026 年 5 月 7 日	6 个月	大宗受限锁定	11.20	12.68	2,232,000	24,998,400.00	28,301,760.00	-
600601	方正科技	2026 年 4 月 29 日	6 个月	大宗受限锁定	10.98	12.71	1,870,000	20,532,600.00	23,767,700.00	-
600601	方正科技	2026 年 4 月 28 日	6 个月	大宗受限锁定	10.76	12.71	1,860,000	20,013,600.00	23,640,600.00	-
600601	方正科技	2026 年 5 月 6 日	6 个月	大宗受限锁定	11.00	12.68	1,820,000	20,020,000.00	23,077,600.00	-
600601	方正科技	2026 年 4 月 20 日	6 个月	大宗受限锁定	10.46	12.74	1,000,000	10,460,000.00	12,740,000.00	-
301377	鼎泰高科	2026 年 6 月 8 日	6 个月	询价转让	270.55	488.17	116,000	31,383,800.00	56,627,720.00	-
300383	光环新网	2026 年 5 月 6 日	6 个月	大宗受限锁定	15.66	11.19	2,554,000	39,995,640.00	28,579,260.00	-
300383	光环新网	2026 年 5 月 8 日	6 个月	大宗受限锁定	15.79	11.19	1,520,000	24,000,800.00	17,008,800.00	-

		日								
300679	电连技术	2026 年 5 月 8 日	6 个月	大宗受 限锁定	46.46	54.21	753,00 0	34,984,380.0 0	40,820,130.0 0	-
688234	天岳先进	2026 年 6 月 26 日	6 个月	大宗受 限锁定	151.7 7	151.9 4	260,00 0	39,460,200.0 0	39,504,400.0 0	-
603650	彤程新材	2026 年 5 月 20 日	6 个月	大宗受 限锁定	57.43	89.86	417,00 0	23,948,310.0 0	37,471,620.0 0	-
688295	中复神鹰	2026 年 5 月 8 日	6 个月	大宗受 限锁定	53.71	53.56	466,00 0	25,028,860.0 0	24,958,960.0 0	-
600363	联创光电	2026 年 5 月 7 日	6 个月	大宗受 限锁定	43.25	33.18	693,00 0	29,972,250.0 0	22,993,740.0 0	-
688608	恒玄科技	2026 年 4 月 27 日	6 个月	大宗受 限锁定	167.2 0	156.4 6	100,00 0	16,720,000.0 0	15,646,000.0 0	-
688608	恒玄科技	2026 年 4 月 22 日	6 个月	大宗受 限锁定	161.6 8	156.5 4	42,700	6,903,736.00	6,684,258.00	-
002271	东方雨虹	2026 年 5 月 8 日	6 个月	大宗受 限锁定	15.41	11.11	1,300,0 00	20,033,000.0 0	14,443,000.0 0	-
001248	华润新能 源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
001248	华润新能 源	2026 年 6 月 24 日	1 个月 内（含）	新股未 上市	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	46.08	463.3 3	1,220	56,217.60	565,262.60	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	19.68	141.4 9	2,391	47,054.88	338,302.59	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	81.88	1,584 .33	163	13,346.44	258,245.79	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
688818	电科蓝天	2026 年	6 个月	新股锁	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-

		2 月 3 日		定期						
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定期	22.68	47.61	1,300	29,484.00	61,893.00	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股锁定期	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定期	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁定期	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁定期	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定期	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定期	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定期	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-

001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股锁 定期	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	58.00	112.1 6	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	78.38	121.7 7	96	7,524.48	11,689.92	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
920193	吉和昌	2026 年 6 月 18 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
920189	康美特	2026 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	8.14	8.14	200	1,628.00	1,628.00	-
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27	6 个月	新股锁 定期	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

		日								
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	67,450	6,745,000.00	6,745,088.70	-
113704	春风转债	2026 年 6 月 11 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	53,520	5,352,000.00	5,352,246.34	-
118071	华峰转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	18,020	1,802,000.00	1,802,031.60	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天3	2023 年 8 月 30 日	暂停转让	0.14	-	-	18,775,114	31,284,231.12	2,628,515.96	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，紧密跟踪中证 500 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 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，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

6.4.13.3 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，由于部分成份券流动性差，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组合证券形式，流动性风险相对较低。

6.4.13.3.1 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	270,738,192.65	-	-	-	270,738,192.65
结算备付金	1,469,073,173.68	-	-	-	1,469,073,173.68
存出保证金	77,508,731.55	-	-	218,684,544.00	296,193,275.55
交易性金融资产	-	-	13,899,366.64	36,230,545,979.46	36,244,445,346.10
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	-	-	-	20,186,431.52	20,186,431.52
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,817,320,097.88	-	13,899,366.64	36,469,416,954.98	38,300,636,419.50
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	-	-	-	4,708,313.04	4,708,313.04
应付托管费	-	-	-	1,569,437.67	1,569,437.67
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	543,235.49	543,235.49
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	206,467,923.29	206,467,923.29
负债总计	-	-	-	213,288,909.49	213,288,909.49
利率敏感度缺口	1,817,320,097.88	-	13,899,366.64	36,256,128,045.49	38,087,347,510.01
上年度末 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	247,566,223.06	-	-	-	247,566,223.06
结算备付金	5,044,902,726.52	-	-	-	5,044,902,726.52
存出保证金	26,506,681.42	-	-	787,837,651.20	814,344,332.62
交易性金融资产	-	-	14,610,224.15	138,078,154,237.53	138,092,764,461.68
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	600,034,556.06	-	-	-	600,034,556.06
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工	-	-	-	-	-

具投资					
应收清算款	-	-	-	100,946,284.11	100,946,284.11
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,919,010,187.06	-	14,610,224.15	138,966,938,172.84	144,900,558,584.05
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	-	-	-	401,521.30	401,521.30
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	17,352,119.86	17,352,119.86
应付托管费	-	-	-	5,784,039.98	5,784,039.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3,598,233.76	3,598,233.76
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	182,948,001.30	182,948,001.30
负债总计	-	-	-	210,083,916.20	210,083,916.20
利率敏感度缺口	5,919,010,187.06	-	14,610,224.15	138,756,854,256.64	144,690,474,667.85

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。

6.4.13.4.1.2 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（ 2026 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 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

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	36,230,545,979.46	95.12	138,078,154,237.53	95.43
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	13,899,366.64	0.04	14,610,224.15	0.01
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	36,244,445,346.10	95.16	138,092,764,461.68	95.44

注：1、交易性金融资产-债券投资项目仅包含可转换公司债券或可交换公司债券。

2、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。

6.4.13.4.3.2 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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	1,900,215,890.17	7,215,037,925.04
	2.组合自身基准下降 5%	-1,900,215,890.17	-7,215,037,925.04

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	35,664,126,651.39
第二层次	14,753,842.08
第三层次	565,564,852.63
合计	36,244,445,346.10

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.15 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	36,230,545,979.46	94.60
	其中：股票	36,230,545,979.46	94.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,899,366.64	0.04
	其中：债券	13,899,366.64	0.04
	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	1,739,811,366.33	4.54
8	其他各项资产	316,379,707.07	0.83
9	合计	38,300,636,419.50	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。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	116,672,992.88	0.31
B	采矿业	1,107,671,143.68	2.91
C	制造业	27,288,010,440.92	71.65
D	电力、热力、燃气及水生产和	871,194,029.14	2.29

	供应业		
E	建筑业	210,198,003.06	0.55
F	批发和零售业	695,091,174.27	1.82
G	交通运输、仓储和邮政业	429,260,200.11	1.13
H	住宿和餐饮业	23,840,401.97	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,354,325,263.80	6.18
J	金融业	1,971,114,538.94	5.18
K	房地产业	142,063,061.19	0.37
L	租赁和商务服务业	365,999,719.98	0.96
M	科学研究和技术服务业	264,346,656.26	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	126,145,716.92	0.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	84,360,863.01	0.22
R	文化、体育和娱乐业	174,413,422.31	0.46
S	综合	-	-
	合计	36,224,707,628.44	95.11

7.2.2 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	36,149.82	0.00
C	制造业	2,050,685.14	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	850,291.44	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,628,515.96	0.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,567,225.82	0.01

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688498	源杰科技	321,323	606,015,178.00	1.59
2	300604	长川科技	1,416,179	483,511,834.18	1.27
3	001309	德明利	506,000	477,107,400.00	1.25
4	688347	华虹宏力	1,293,928	435,147,986.40	1.14
5	688120	华海清科	1,243,732	400,705,575.76	1.05
6	002281	光迅科技	1,538,968	395,422,437.92	1.04
7	002008	大族激光	2,626,878	394,320,656.58	1.04
8	300857	协创数据	1,094,072	371,875,072.80	0.98
9	300136	信维通信	3,085,405	367,934,546.25	0.97
10	688361	中科飞测	809,362	348,025,660.00	0.91
11	300475	香农芯创	1,056,896	317,068,800.00	0.83
12	300223	北京君正	1,254,630	312,277,407.00	0.82
13	002436	兴森科技	5,430,410	276,679,389.50	0.73
14	300285	国瓷材料	2,545,131	262,606,616.58	0.69
15	300054	鼎龙股份	2,428,445	257,342,316.65	0.68
16	600105	永鼎股份	3,723,084	251,233,708.32	0.66
17	300666	江丰电子	671,200	247,404,320.00	0.65
18	688200	华峰测控	463,457	243,361,270.70	0.64
19	300757	罗博特科	412,098	239,773,884.00	0.63
20	688777	中控技术	2,038,844	239,564,170.00	0.63
21	688037	芯源微	532,614	233,844,176.70	0.61
22	000021	深科技	3,500,439	224,973,214.53	0.59
23	002851	麦格米特	1,327,357	221,907,543.26	0.58
24	601869	长飞光纤	402,400	219,670,160.00	0.58
25	688019	安集科技	613,900	208,394,494.00	0.55
26	300548	长芯博创	748,764	208,156,392.00	0.55
27	300346	南大光电	2,234,521	207,028,370.65	0.54
28	002409	雅克科技	908,787	204,022,681.50	0.54
29	300567	精测电子	609,928	193,713,132.80	0.51
30	600498	烽火通信	2,601,119	191,442,358.40	0.50
31	002185	华天科技	8,488,866	189,386,600.46	0.50
32	002407	多氟多	3,727,530	187,233,831.90	0.49

33	002138	顺络电子	2,560,245	187,153,909.50	0.49
34	300395	菲利华	1,364,319	182,450,379.87	0.48
35	688313	仕佳光子	982,914	181,495,070.10	0.48
36	688002	睿创微纳	1,165,486	180,289,029.34	0.47
37	600879	航天电子	8,439,505	179,677,061.45	0.47
38	300620	光库科技	471,540	178,336,428.00	0.47
39	688017	绿的谐波	423,746	177,066,503.56	0.46
40	300390	天华新能	1,860,454	173,971,053.54	0.46
41	688469	芯联集成	16,172,462	171,589,821.82	0.45
42	301526	国际复材	3,617,141	168,811,970.47	0.44
43	300373	扬杰科技	1,063,668	167,240,519.64	0.44
44	688702	盛科通信	406,142	158,391,318.58	0.42
45	300058	蓝色光标	11,505,031	158,309,226.56	0.42
46	002273	水晶光电	4,399,843	156,106,429.64	0.41
47	300037	新宙邦	1,679,125	155,906,756.25	0.41
48	301377	鼎泰高科	290,099	152,538,859.10	0.40
49	688172	燕东微	1,803,288	150,863,074.08	0.40
50	603256	宏和科技	564,378	149,746,414.74	0.39
51	300751	迈为股份	523,998	148,008,475.08	0.39
52	605358	立昂微	1,893,714	146,952,206.40	0.39
53	605589	圣泉集团	2,210,056	140,493,259.92	0.37
54	600988	赤峰黄金	5,295,006	139,364,557.92	0.37
55	002738	中矿资源	2,329,936	137,442,924.64	0.36
56	600885	宏发股份	3,966,053	136,789,167.97	0.36
57	000960	锡业股份	3,202,745	136,725,184.05	0.36
58	688099	晶晨股份	1,325,994	136,444,782.60	0.36
59	600601	方正科技	10,511,742	135,467,289.28	0.36
60	000831	中国稀土	2,436,340	135,192,506.60	0.35
61	002126	银轮股份	2,705,086	134,713,282.80	0.35
62	600392	盛和资源	4,474,255	133,198,571.35	0.35
63	600141	兴发集团	2,687,099	126,213,040.03	0.33
64	002812	恩捷股份	1,879,161	125,734,662.51	0.33
65	001389	广合科技	524,861	124,523,272.25	0.33
66	688234	天岳先进	745,709	123,779,768.59	0.32
67	601179	中国西电	8,276,146	123,480,098.32	0.32
68	300570	太辰光	495,379	122,214,953.09	0.32
69	600378	昊华科技	1,605,807	121,045,731.66	0.32
70	301358	湖南裕能	1,579,857	119,863,750.59	0.31
71	002195	岩山科技	18,068,126	118,165,544.04	0.31
72	600497	驰宏锌锗	9,683,512	117,267,330.32	0.31
73	002850	科达利	603,020	114,151,686.00	0.30
74	688629	华丰科技	608,403	114,081,646.53	0.30
75	002261	拓维信息	4,032,763	112,957,691.63	0.30

76	600157	永泰能源	69,806,934	112,389,163.74	0.30
77	002340	格林美	16,443,070	108,688,692.70	0.29
78	688052	纳芯微	376,500	108,548,715.00	0.28
79	600711	盛屯矿业	9,885,800	108,447,226.00	0.28
80	600143	金发科技	6,853,803	105,891,256.35	0.28
81	600909	华安证券	9,523,950	105,811,084.50	0.28
82	688411	海博思创	361,477	105,262,102.40	0.28
83	301200	大族数控	290,431	104,743,940.15	0.28
84	300017	网宿科技	8,015,298	104,279,026.98	0.27
85	688027	国盾量子	203,828	102,731,350.28	0.27
86	600352	浙江龙盛	8,443,136	102,246,376.96	0.27
87	000783	长江证券	10,469,965	102,082,158.75	0.27
88	002203	海亮股份	4,453,317	101,758,293.45	0.27
89	002821	凯莱英	622,686	100,875,132.00	0.26
90	002131	利欧股份	21,231,698	100,850,565.50	0.26
91	002966	苏州银行	14,456,673	100,618,444.08	0.26
92	003031	中瓷电子	557,948	100,598,024.40	0.26
93	601555	东吴证券	12,657,921	100,250,734.32	0.26
94	601233	桐昆股份	4,521,882	97,898,745.30	0.26
95	300339	润和软件	2,535,024	97,623,774.24	0.26
96	603659	璞泰来	3,371,851	97,547,649.43	0.26
97	301611	珂玛科技	537,524	96,791,946.68	0.25
98	688235	百济神州	379,909	96,728,630.49	0.25
99	300759	康龙化成	3,336,416	96,522,514.88	0.25
100	688220	翱捷科技	755,743	93,953,969.76	0.25
101	002472	双环传动	2,207,200	91,620,872.00	0.24
102	300001	特锐德	2,418,221	91,481,300.43	0.24
103	603308	应流股份	1,509,040	91,146,016.00	0.24
104	603129	春风动力	354,801	90,758,095.80	0.24
105	688213	思特威	846,920	90,679,724.40	0.24
106	300207	欣旺达	4,733,598	89,891,026.02	0.24
107	601108	财通证券	10,376,353	89,755,453.45	0.24
108	688122	西部超导	1,428,621	89,731,685.01	0.24
109	300458	全志科技	2,249,642	88,770,873.32	0.23
110	601958	金钼股份	3,152,953	88,629,508.83	0.23
111	002797	第一创业	13,469,889	88,497,170.73	0.23
112	688387	信科移动	4,458,913	88,464,833.92	0.23
113	688578	艾力斯	807,874	88,219,840.80	0.23
114	002601	龙佰集团	5,299,241	87,331,491.68	0.23
115	688301	奕瑞科技	698,889	86,662,236.00	0.23
116	300115	长盈精密	3,087,021	86,251,366.74	0.23
117	002517	恺英网络	5,302,909	86,172,271.25	0.23
118	688322	奥比中光	656,781	85,742,759.55	0.23

119	601198	东兴证券	6,257,911	85,045,010.49	0.22
120	688385	复旦微电	1,171,590	83,522,651.10	0.22
121	002155	湖南黄金	3,493,867	83,398,605.29	0.22
122	601991	大唐发电	11,769,600	83,328,768.00	0.22
123	000703	恒逸石化	6,115,374	82,985,625.18	0.22
124	002465	海格通信	6,439,698	82,234,943.46	0.22
125	300024	机器人	4,142,406	80,072,707.98	0.21
126	603179	新泉股份	1,605,461	79,711,138.65	0.21
127	601665	齐鲁银行	13,803,250	79,644,752.50	0.21
128	600563	法拉电子	415,341	79,247,062.80	0.21
129	300454	深信服	822,730	79,146,626.00	0.21
130	603156	养元饮品	1,602,544	78,636,834.08	0.21
131	688331	荣昌生物	600,228	78,185,699.28	0.21
132	603650	彤程新材	829,505	77,888,859.90	0.20
133	002056	横店东磁	2,551,394	77,766,489.12	0.20
134	002429	兆驰股份	7,459,140	77,500,464.60	0.20
135	002130	沃尔核材	4,051,206	76,810,865.76	0.20
136	600707	彩虹股份	4,511,884	76,205,720.76	0.20
137	601162	天风证券	22,580,906	76,097,653.22	0.20
138	300012	华测检测	5,483,000	75,994,380.00	0.20
139	600884	杉杉股份	5,561,464	75,357,837.20	0.20
140	688266	泽璟制药	645,541	75,308,813.06	0.20
141	002432	九安医疗	1,063,676	75,180,619.68	0.20
142	000060	中金岭南	9,911,407	75,029,350.99	0.20
143	300496	中科创达	1,204,891	74,450,214.89	0.20
144	603379	三美股份	973,898	73,909,119.22	0.19
145	600109	国金证券	8,417,620	73,906,703.60	0.19
146	002402	和而泰	2,860,935	73,897,951.05	0.19
147	601099	太平洋	21,606,692	72,814,552.04	0.19
148	002444	巨星科技	2,332,744	72,548,338.40	0.19
149	002271	东方雨虹	6,194,565	72,541,486.55	0.19
150	000733	振华科技	1,280,200	72,510,528.00	0.19
151	002414	高德红外	5,459,920	72,398,539.20	0.19
152	603979	金诚信	1,225,879	72,363,637.37	0.19
153	300474	景嘉微	1,195,144	72,282,309.12	0.19
154	000034	神州数码	2,592,051	71,929,415.25	0.19
155	689009	九号公司	1,870,590	71,363,008.50	0.19
156	002335	科华数据	1,680,530	71,338,498.50	0.19
157	000878	云南铜业	4,490,301	71,305,979.88	0.19
158	300623	捷捷微电	1,583,236	71,229,787.64	0.19
159	002756	永兴材料	1,249,632	70,779,156.48	0.19
160	300748	金力永磁	2,287,623	70,573,169.55	0.19
161	601696	中银证券	5,573,306	70,502,320.90	0.19

162	600298	安琪酵母	1,944,549	70,392,673.80	0.18
163	002487	大金重工	1,214,200	70,387,174.00	0.18
164	688728	格科微	3,334,081	70,149,064.24	0.18
165	688676	金盘科技	828,277	70,105,365.28	0.18
166	000893	亚钾国际	1,709,145	69,886,939.05	0.18
167	000661	长春高新	1,048,804	69,850,346.40	0.18
168	600699	均胜电子	3,216,313	69,504,523.93	0.18
169	603920	世运电路	1,439,711	69,163,716.44	0.18
170	688608	恒玄科技	422,125	69,047,323.75	0.18
171	600256	广汇能源	13,932,150	68,824,821.00	0.18
172	300432	富临精工	3,419,371	68,695,163.39	0.18
173	300142	沃森生物	5,280,189	68,589,655.11	0.18
174	002078	太阳纸业	5,486,305	68,523,949.45	0.18
175	603688	石英股份	827,560	68,364,731.60	0.18
176	688169	石头科技	715,111	67,914,091.67	0.18
177	601128	常熟银行	11,665,253	67,891,772.46	0.18
178	300073	当升科技	1,411,128	67,790,589.12	0.18
179	603087	甘李药业	1,193,207	67,726,429.32	0.18
180	601577	长沙银行	7,726,837	67,300,750.27	0.18
181	301536	星宸科技	518,666	66,757,500.86	0.18
182	600060	海信视像	2,375,125	66,194,733.75	0.17
183	300763	锦浪科技	727,443	65,724,475.05	0.17
184	600021	上海电力	4,343,238	65,452,596.66	0.17
185	603606	东方电缆	1,572,362	65,268,746.62	0.17
186	300919	中伟新材	1,489,537	65,167,243.75	0.17
187	688375	国博电子	622,403	64,916,632.90	0.17
188	002157	正邦科技	23,080,392	64,855,901.52	0.17
189	688343	云天励飞	790,380	64,542,430.80	0.17
190	000423	东阿阿胶	1,419,665	64,396,004.40	0.17
191	601615	明阳智能	5,563,227	64,366,536.39	0.17
192	002252	上海莱士	14,768,200	64,093,988.00	0.17
193	000728	国元证券	8,542,852	63,985,961.48	0.17
194	002025	航天电器	836,600	63,765,652.00	0.17
195	688018	乐鑫科技	488,916	62,542,134.72	0.16
196	002064	华峰化学	6,530,276	61,972,319.24	0.16
197	300724	捷佳伟创	859,527	60,682,606.20	0.16
198	688599	天合光能	4,282,987	60,475,776.44	0.16
199	603290	斯达半导	395,260	60,451,064.40	0.16
200	688188	柏楚电子	563,123	60,085,224.10	0.16
201	000786	北新建材	3,292,388	59,559,298.92	0.16
202	002831	裕同科技	1,669,817	59,378,692.52	0.16
203	603806	福斯特	3,504,315	58,837,448.85	0.15
204	603119	浙江荣泰	879,370	58,337,405.80	0.15

205	600177	雅戈尔	7,718,561	58,120,764.33	0.15
206	300972	万辰集团	334,909	58,076,569.69	0.15
207	300383	光环新网	5,043,628	57,650,232.32	0.15
208	300953	震裕科技	430,940	57,616,678.00	0.15
209	001203	大中矿业	1,915,600	57,372,220.00	0.15
210	600642	申能股份	6,524,961	56,962,909.53	0.15
211	000559	万向钱潮	4,382,048	56,659,880.64	0.15
212	300679	电连技术	1,016,943	56,654,070.57	0.15
213	600516	方大炭素	9,169,538	56,576,049.46	0.15
214	000519	中兵红箭	2,667,176	56,197,398.32	0.15
215	002624	完美世界	4,497,987	55,864,998.54	0.15
216	002673	西部证券	8,591,487	55,758,750.63	0.15
217	688180	君实生物	1,638,120	55,401,218.40	0.15
218	600171	上海贝岭	1,733,221	55,359,078.74	0.15
219	000623	吉林敖东	3,120,140	55,320,082.20	0.15
220	603444	吉比特	153,594	55,051,161.48	0.14
221	603160	汇顶科技	891,515	55,015,390.65	0.14
222	688187	时代电气	800,223	54,943,311.18	0.14
223	002318	久立特材	2,289,300	54,714,270.00	0.14
224	688617	惠泰医疗	300,085	54,483,432.60	0.14
225	300677	英科医疗	1,387,004	54,328,946.68	0.14
226	002065	东华软件	7,585,318	54,159,170.52	0.14
227	600637	东方明珠	6,444,593	53,554,567.83	0.14
228	300699	光威复材	1,862,218	53,352,545.70	0.14
229	688065	凯赛生物	1,113,793	53,294,995.05	0.14
230	000750	国海证券	14,481,976	53,293,671.68	0.14
231	688568	中科星图	1,273,029	52,792,512.63	0.14
232	000983	山西焦煤	9,100,799	52,784,634.20	0.14
233	601699	潞安环能	3,661,603	52,287,690.84	0.14
234	000400	许继电气	2,388,709	51,834,985.30	0.14
235	002739	儒意电影	5,370,318	51,555,052.80	0.14
236	001696	宗申动力	2,474,288	51,489,933.28	0.14
237	603345	安井食品	641,036	51,404,676.84	0.13
238	300002	神州泰岳	6,565,800	51,278,898.00	0.13
239	603596	伯特利	2,064,250	51,275,970.00	0.13
240	600499	科达制造	3,674,810	50,712,378.00	0.13
241	002266	浙富控股	10,007,219	50,636,528.14	0.13
242	300627	华测导航	1,770,390	50,279,076.00	0.13
243	000155	川能动力	4,194,070	50,244,958.60	0.13
244	002085	万丰奥威	4,526,400	50,197,776.00	0.13
245	300003	乐普医疗	4,227,776	50,099,145.60	0.13
246	603225	新凤鸣	2,546,529	50,039,294.85	0.13
247	600100	同方股份	7,285,955	49,908,791.75	0.13

248	603699	纽威股份	990,376	49,815,912.80	0.13
249	300558	贝达药业	759,742	49,436,411.94	0.13
250	600595	中孚实业	8,768,200	49,277,284.00	0.13
251	000629	钒钛股份	14,744,837	49,247,755.58	0.13
252	002044	美年健康	9,785,063	49,218,866.89	0.13
253	000683	博源化工	8,527,500	49,118,400.00	0.13
254	688692	达梦数据	200,652	49,017,277.08	0.13
255	002841	视源股份	1,419,551	49,017,096.03	0.13
256	688772	珠海冠宇	2,494,129	48,959,752.27	0.13
257	600369	西南证券	12,136,459	48,788,565.18	0.13
258	600521	华海药业	3,369,093	48,514,939.20	0.13
259	600536	中国软件	1,724,231	48,485,375.72	0.13
260	601990	南京证券	7,372,675	48,438,474.75	0.13
261	601997	贵阳银行	9,415,596	48,302,007.48	0.13
262	601016	节能风电	12,433,685	48,242,697.80	0.13
263	600863	华能蒙电	10,254,707	48,197,122.90	0.13
264	002430	杭氧股份	1,556,274	48,182,243.04	0.13
265	600332	白云山	2,393,110	47,957,924.40	0.13
266	600873	梅花生物	6,464,751	47,515,919.85	0.12
267	601212	白银有色	9,263,250	47,057,310.00	0.12
268	000032	深桑达 A	1,885,437	47,041,653.15	0.12
269	002223	鱼跃医疗	1,822,116	46,755,496.56	0.12
270	600704	物产中大	9,899,395	46,725,144.40	0.12
271	000415	渤海租赁	11,475,500	46,705,285.00	0.12
272	600862	中航高科	2,587,387	46,650,587.61	0.12
273	000039	中集集团	5,751,816	46,647,227.76	0.12
274	601001	晋控煤业	2,669,122	46,416,031.58	0.12
275	600985	淮北矿业	3,278,900	46,068,545.00	0.12
276	600166	福田汽车	15,788,358	45,944,121.78	0.12
277	601717	中创智领	3,299,816	45,900,440.56	0.12
278	601216	君正集团	10,286,176	45,876,344.96	0.12
279	603766	隆鑫通用	3,822,714	45,604,978.02	0.12
280	300487	蓝晓科技	764,784	45,007,538.40	0.12
281	000887	中鼎股份	2,513,429	44,965,244.81	0.12
282	688615	合合信息	396,673	44,863,716.30	0.12
283	000050	深天马 A	4,518,348	44,776,828.68	0.12
284	002939	长城证券	5,366,570	44,757,193.80	0.12
285	000062	深圳华强	1,397,356	44,463,867.92	0.12
286	600153	建发股份	5,555,844	44,057,842.92	0.12
287	002410	广联达	5,391,340	43,993,334.40	0.12
288	688538	和辉光电	16,871,034	43,864,688.40	0.12
289	000830	鲁西化工	3,651,899	43,822,788.00	0.12
290	603077	和邦生物	18,860,472	43,756,295.04	0.11

291	000729	燕京啤酒	4,318,704	43,748,471.52	0.11
292	002926	华西证券	5,324,676	43,502,602.92	0.11
293	600363	联创光电	1,265,293	43,470,383.54	0.11
294	600312	平高电气	2,449,632	43,260,501.12	0.11
295	000967	盈峰环境	4,106,714	43,243,698.42	0.11
296	688582	芯动联科	663,267	43,112,355.00	0.11
297	688297	中无人机	1,036,207	43,054,400.85	0.11
298	603568	伟明环保	2,775,147	42,681,760.86	0.11
299	600765	中航重机	3,298,128	42,611,813.76	0.11
300	603605	珀莱雅	708,203	42,435,523.76	0.11
301	002683	广东宏大	1,436,879	42,086,185.91	0.11
302	600348	华阳股份	5,457,559	41,750,326.35	0.11
303	688248	南网科技	603,101	41,722,527.18	0.11
304	600578	京能电力	6,407,667	41,329,452.15	0.11
305	000528	柳工	5,420,953	40,928,195.15	0.11
306	600901	江苏金租	7,026,632	40,403,134.00	0.11
307	000737	北方铜业	3,054,900	40,385,778.00	0.11
308	688114	华大智造	789,454	40,325,310.32	0.11
309	600316	洪都航空	1,442,707	40,309,233.58	0.11
310	600435	北方导航	3,593,416	40,246,259.20	0.11
311	600008	首创环保	14,775,349	40,188,949.28	0.11
312	000738	航发控制	2,192,650	40,103,568.50	0.11
313	000932	华菱钢铁	11,550,516	40,080,290.52	0.11
314	002603	以岭药业	2,666,590	39,998,850.00	0.11
315	600998	九州通	8,521,039	39,963,672.91	0.10
316	603728	鸣志电器	655,835	39,953,468.20	0.10
317	600737	中粮糖业	3,235,884	39,898,449.72	0.10
318	000921	海信家电	1,459,533	39,874,441.56	0.10
319	002007	华兰生物	3,257,791	39,712,472.29	0.10
320	600995	南网储能	3,227,133	39,693,735.90	0.10
321	601611	中国核建	3,551,009	39,593,750.35	0.10
322	601799	星宇股份	430,950	39,052,689.00	0.10
323	688778	厦钨新能	716,507	38,977,980.80	0.10
324	688295	中复神鹰	697,259	38,959,379.86	0.10
325	000997	新大陆	2,377,104	38,746,795.20	0.10
326	000591	太阳能	8,367,400	38,490,040.00	0.10
327	600820	隧道股份	7,384,567	38,473,594.07	0.10
328	600170	上海建工	17,328,111	38,468,406.42	0.10
329	603341	龙旗科技	900,860	38,277,541.40	0.10
330	600583	海油工程	7,561,585	38,034,772.55	0.10
331	600398	海澜之家	7,245,922	37,896,172.06	0.10
332	002152	广电运通	3,977,373	37,307,758.74	0.10
333	603486	科沃斯	729,711	37,032,833.25	0.10

334	600486	扬农化工	729,399	36,980,529.30	0.10
335	600161	天坛生物	3,175,444	36,771,641.52	0.10
336	603298	杭叉集团	1,540,131	36,747,525.66	0.10
337	600546	山煤国际	3,358,585	36,709,334.05	0.10
338	601567	三星电气	2,453,250	36,651,555.00	0.10
339	600208	衢州发展	12,882,251	36,456,770.33	0.10
340	601000	唐山港	8,778,858	36,432,260.70	0.10
341	601106	中国一重	11,000,813	36,302,682.90	0.10
342	000513	丽珠集团	1,256,201	36,291,646.89	0.10
343	003022	联泓新科	1,400,504	36,273,053.60	0.10
344	000987	越秀资本	4,625,212	36,169,157.84	0.09
345	600483	福能股份	3,540,940	36,082,178.60	0.09
346	600038	中直股份	1,421,391	35,946,978.39	0.09
347	600685	中船防务	1,408,484	35,831,832.96	0.09
348	688336	三生国健	670,853	35,622,294.30	0.09
349	603885	吉祥航空	3,452,741	35,528,704.89	0.09
350	601156	东航物流	2,193,343	35,356,689.16	0.09
351	600282	南钢股份	7,664,335	35,179,297.65	0.09
352	600763	通策医疗	1,037,249	35,141,996.12	0.09
353	000582	北部湾港	3,254,360	34,919,282.80	0.09
354	600390	五矿资本	7,656,030	34,911,496.80	0.09
355	603939	益丰药房	1,940,656	34,892,994.88	0.09
356	601399	国机重装	9,895,386	34,633,851.00	0.09
357	688318	财富趋势	483,836	34,502,345.16	0.09
358	000951	中国重汽	1,761,704	34,370,845.04	0.09
359	002500	山西证券	6,659,817	34,364,655.72	0.09
360	000009	中国宝安	5,500,750	34,269,672.50	0.09
361	002262	恩华药业	1,808,872	33,916,350.00	0.09
362	601666	平煤股份	4,742,137	33,906,279.55	0.09
363	600906	财达证券	4,541,798	33,881,813.08	0.09
364	600329	达仁堂	909,846	33,864,468.12	0.09
365	603565	中谷物流	3,434,013	33,687,667.53	0.09
366	600511	国药股份	1,290,281	33,598,917.24	0.09
367	600535	天士力	2,505,875	33,152,726.25	0.09
368	600380	健康元	3,496,467	32,936,719.14	0.09
369	600977	中国电影	2,537,088	32,779,176.96	0.09
370	688166	博瑞医药	926,873	32,449,823.73	0.09
371	300735	光弘科技	1,426,867	32,446,955.58	0.09
372	300100	双林股份	1,166,051	32,392,896.78	0.09
373	603338	浙江鼎力	761,505	32,363,962.50	0.08
374	603816	顾家家居	1,446,721	32,348,681.56	0.08
375	000723	美锦能源	9,590,566	32,128,396.10	0.08
376	300146	汤臣倍健	3,551,667	32,107,069.68	0.08

377	600970	中材国际	4,464,642	31,832,897.46	0.08
378	601865	福莱特	3,026,928	31,813,013.28	0.08
379	688281	华秦科技	630,015	31,645,653.45	0.08
380	600132	重庆啤酒	765,114	31,599,208.20	0.08
381	688278	特宝生物	580,636	31,586,598.40	0.08
382	600562	国睿科技	1,487,569	31,566,214.18	0.08
383	002312	川发龙蟒	3,440,465	31,549,064.05	0.08
384	600602	云赛智联	1,955,157	31,438,924.56	0.08
385	300676	华大基因	892,140	31,278,428.40	0.08
386	601880	辽港股份	22,450,844	30,982,164.72	0.08
387	300144	宋城演艺	5,321,820	30,919,774.20	0.08
388	002244	滨江集团	4,019,795	30,550,442.00	0.08
389	002299	圣农发展	1,997,652	30,284,404.32	0.08
390	003021	兆威机电	342,060	29,878,941.00	0.08
391	600967	内蒙一机	2,714,874	29,456,382.90	0.08
392	688363	华熙生物	816,715	29,213,895.55	0.08
393	000739	普洛药业	1,753,030	29,205,479.80	0.08
394	600655	豫园股份	7,097,387	29,170,260.57	0.08
395	000598	兴蓉环境	4,541,159	29,154,240.78	0.08
396	300718	长盛轴承	475,400	28,985,138.00	0.08
397	601236	红塔证券	4,226,300	28,823,366.00	0.08
398	600816	建元信托	11,604,930	28,316,029.20	0.07
399	600126	杭钢股份	4,619,055	28,314,807.15	0.07
400	600566	济川药业	1,274,590	28,283,152.10	0.07
401	000800	一汽解放	4,708,300	28,014,385.00	0.07
402	002568	百润股份	1,653,824	27,982,702.08	0.07
403	000709	河钢股份	14,368,800	27,875,472.00	0.07
404	603589	口子窖	1,485,369	27,746,692.92	0.07
405	601155	新城控股	2,689,517	27,594,444.42	0.07
406	600095	湘财股份	3,651,923	27,498,980.19	0.07
407	002773	康弘药业	1,343,251	27,469,482.95	0.07
408	688709	成都华微	715,636	27,258,575.24	0.07
409	600598	北大荒	2,507,828	27,184,855.52	0.07
410	002120	韵达股份	4,240,706	26,970,890.16	0.07
411	000883	湖北能源	6,241,294	26,962,390.08	0.07
412	002583	海能达	3,478,319	26,748,273.11	0.07
413	600131	国网信通	1,830,763	26,729,139.80	0.07
414	600801	华新建材	1,711,443	26,698,510.80	0.07
415	601966	玲珑轮胎	2,599,786	26,491,819.34	0.07
416	600871	石化油服	12,982,602	26,354,682.06	0.07
417	001286	陕西能源	2,591,768	26,280,527.52	0.07
418	600004	白云机场	3,619,064	26,274,404.64	0.07
419	002984	森麒麟	2,003,100	26,180,517.00	0.07

420	603000	人民网	1,762,134	26,061,961.86	0.07
421	688563	航材股份	505,710	25,907,523.30	0.07
422	000027	深圳能源	4,171,362	25,862,444.40	0.07
423	601608	中信重工	5,381,582	25,670,146.14	0.07
424	000825	太钢不锈	7,527,748	25,669,620.68	0.07
425	603899	晨光股份	1,243,911	25,661,883.93	0.07
426	600848	上海临港	3,396,896	25,442,751.04	0.07
427	000088	盐田港	6,206,283	25,383,697.47	0.07
428	603737	三棵树	1,053,206	25,382,264.60	0.07
429	600582	天地科技	5,643,016	25,111,421.20	0.07
430	688192	迪哲医药	627,746	25,065,897.78	0.07
431	601866	中远海发	11,256,196	24,876,193.16	0.07
432	601098	中南传媒	2,505,872	24,657,780.48	0.06
433	601118	海南橡胶	5,006,552	24,632,235.84	0.06
434	601598	中国外运	4,914,257	24,374,714.72	0.06
435	600350	山东高速	2,179,700	24,260,061.00	0.06
436	600062	华润双鹤	1,498,380	24,034,015.20	0.06
437	600754	锦江酒店	1,325,203	23,840,401.97	0.06
438	002423	中粮资本	2,829,927	23,290,299.21	0.06
439	301606	绿联科技	378,400	23,089,968.00	0.06
440	600517	国网英大	4,915,174	23,003,014.32	0.06
441	603858	步长制药	1,571,320	22,941,272.00	0.06
442	688425	铁建重工	5,697,806	22,905,180.12	0.06
443	000429	粤高速 A	1,661,665	22,681,727.25	0.06
444	688349	三一重能	1,478,449	22,442,855.82	0.06
445	600098	广州发展	3,765,730	22,255,464.30	0.06
446	600663	陆家嘴	3,506,155	22,018,653.40	0.06
447	002508	老板电器	1,492,953	21,826,972.86	0.06
448	600688	上海石化	7,357,971	21,558,855.03	0.06
449	601928	凤凰传媒	2,421,093	21,281,407.47	0.06
450	688561	奇安信	840,689	20,159,722.22	0.05
451	688708	佳驰科技	388,345	19,727,926.00	0.05
452	301498	乖宝宠物	482,102	19,568,520.18	0.05
453	600968	海油发展	5,871,562	19,552,301.46	0.05
454	603786	科博达	472,393	19,325,597.63	0.05
455	601808	中海油服	1,777,429	19,214,007.49	0.05
456	603233	大参林	1,277,547	19,201,531.41	0.05
457	600295	鄂尔多斯	1,769,385	18,967,807.20	0.05
458	003035	南网能源	3,235,190	18,828,805.80	0.05
459	600339	中油工程	6,025,779	18,499,141.53	0.05
460	300957	贝泰妮	585,700	18,455,407.00	0.05
461	002670	国盛证券	1,668,592	18,354,512.00	0.05
462	300888	稳健医疗	651,410	18,232,965.90	0.05

463	301301	川宁生物	2,290,200	18,184,188.00	0.05
464	600292	电投水电	1,505,248	18,123,185.92	0.05
465	600377	宁沪高速	1,554,301	17,983,262.57	0.05
466	600032	浙江新能	2,530,511	17,840,102.55	0.05
467	601298	青岛港	2,169,700	17,466,085.00	0.05
468	000959	首钢股份	4,948,552	17,369,417.52	0.05
469	688475	萤石网络	629,611	17,219,860.85	0.05
470	002265	建设工业	987,081	17,175,209.40	0.05
471	002032	苏泊尔	431,292	17,079,163.20	0.04
472	000539	粤电力 A	2,481,840	16,901,330.40	0.04
473	000537	绿发电力	2,307,005	16,864,206.55	0.04
474	600808	马钢股份	6,697,881	16,744,702.50	0.04
475	002153	石基信息	2,265,765	16,381,480.95	0.04
476	000785	居然智家	8,038,400	16,076,800.00	0.04
477	688520	神州细胞	465,759	15,933,615.39	0.04
478	603049	中策橡胶	353,914	15,858,886.34	0.04
479	000937	冀中能源	3,921,265	15,606,634.70	0.04
480	603658	安图生物	529,393	15,362,984.86	0.04
481	600606	绿地控股	12,221,241	14,787,701.61	0.04
482	603175	超颖电子	165,800	14,771,122.00	0.04
483	300140	节能环境	2,958,600	14,704,242.00	0.04
484	002608	江苏国信	2,124,635	14,659,981.50	0.04
485	603529	爱玛科技	748,300	14,599,333.00	0.04
486	603833	欧派家居	478,414	14,405,045.54	0.04
487	601139	深圳燃气	2,440,065	13,810,767.90	0.04
488	600764	中国海防	764,944	13,332,973.92	0.04
489	601019	山东出版	2,065,661	13,220,230.40	0.03
490	688819	天能股份	560,171	12,435,796.20	0.03
491	000898	鞍钢股份	6,462,848	12,085,525.76	0.03
492	601228	广州港	4,284,537	12,082,394.34	0.03
493	600927	永安期货	930,011	11,578,636.95	0.03
494	600299	安迪苏	1,400,704	10,995,526.40	0.03
495	601112	振石股份	546,975	9,970,858.25	0.03
496	002461	珠江啤酒	1,278,400	9,677,488.00	0.03
497	002945	华林证券	685,330	9,203,981.90	0.02
498	001221	悍高集团	187,952	7,559,429.44	0.02
499	603092	德力佳	117,089	6,319,293.33	0.02
500	001386	马可波罗	350,426	4,962,032.16	0.01

7.3.2 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	400174	中天 3	18,775,114	2,628,515.96	0.01
2	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.00
3	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.00
4	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.00
5	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
6	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
7	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
8	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
9	688781	视涯科技	1,300	61,893.00	0.00
10	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
11	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
12	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
13	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
14	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
15	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
16	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
17	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
18	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
19	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
20	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
21	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
22	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
23	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
24	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
25	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
26	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
27	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
28	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
29	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
30	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
31	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
32	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
33	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
34	920189	康美特	200	1,628.00	0.00
35	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	301308	江波龙	1,897,895,227.61	1.31
2	300751	迈为股份	1,412,853,145.58	0.98
3	002281	光迅科技	1,025,452,934.99	0.71
4	002008	大族激光	973,894,940.13	0.67
5	300857	协创数据	949,079,472.36	0.66
6	300604	长川科技	932,256,600.62	0.64
7	688525	佰维存储	897,732,918.61	0.62
8	300136	信维通信	881,134,905.09	0.61
9	002850	科达利	864,552,100.65	0.60
10	000426	兴业银锡	857,705,715.15	0.59
11	300450	先导智能	810,647,223.82	0.56
12	300058	蓝色光标	789,765,892.45	0.55
13	002202	金风科技	740,658,927.08	0.51
14	002353	杰瑞股份	738,796,874.52	0.51
15	300570	太辰光	720,878,751.02	0.50
16	002837	英维克	715,708,489.70	0.49
17	300567	精测电子	714,599,029.90	0.49
18	002156	通富微电	693,109,935.81	0.48
19	001389	广合科技	677,694,322.17	0.47
20	002436	兴森科技	633,198,284.00	0.44

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。

7.4.2 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	301308	江波龙	2,928,463,321.16	2.02
2	300751	迈为股份	1,949,630,607.37	1.35
3	000426	兴业银锡	1,883,492,799.55	1.30
4	300136	信维通信	1,849,207,195.04	1.28
5	002353	杰瑞股份	1,809,448,257.90	1.25
6	300604	长川科技	1,752,343,200.21	1.21
7	300857	协创数据	1,733,169,356.92	1.20
8	002008	大族激光	1,709,687,770.90	1.18
9	300450	先导智能	1,686,125,073.92	1.17
10	002281	光迅科技	1,654,614,373.65	1.14
11	002156	通富微电	1,651,999,968.54	1.14
12	002202	金风科技	1,644,937,049.88	1.14
13	300058	蓝色光标	1,575,957,060.10	1.09
14	002837	英维克	1,568,527,797.38	1.08
15	000657	中钨高新	1,325,483,913.46	0.92

16	002738	中矿资源	1,268,130,224.02	0.88
17	002850	科达利	1,263,765,175.72	0.87
18	000933	神火股份	1,261,404,949.31	0.87
19	002131	利欧股份	1,245,057,100.57	0.86
20	002532	天山铝业	1,232,377,501.43	0.85

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。

7.4.3 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	89,770,258,447.30
卖出股票收入（成交）总额	150,349,891,305.07

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。

7.5 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）	13,899,366.64	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,899,366.64	0.04

7.6 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	111025	圣泉转债	67,450	6,745,088.70	0.02
2	113704	春风转债	53,520	5,352,246.34	0.01
3	118071	华峰转债	18,020	1,802,031.60	0.00

7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库。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）没有超出基金合同约定的备选股票库，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。

7.12.3 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	296,193,275.55
2	应收清算款	20,186,431.52
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	316,379,707.07

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 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	400174	中天 3	2,628,515.96	0.01	暂停转让
2	001248	华润新能源	595,206.03	0.00	新股锁定期
3	001248	华润新能源	255,085.41	0.00	新股未上市
4	301666	大普微	565,262.60	0.00	新股锁定期
5	688820	盛合晶微	338,302.59	0.00	新股锁定期
6	688808	联讯仪器	258,245.79	0.00	新股锁定期

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	
		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
193,399	21,450.83	1,824,187,	43.97%	1,410,772,	34.01%	913,608,6	22.02%

		872.00		067.00		78.00	
--	--	--------	--	--------	--	-------	--

8.2 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。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013 年 2 月 6 日)基金份额总额	1,147,553,216.00
本报告期期初基金份额总额	19,064,568,617.00
本报告期基金总申购份额	13,427,200,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	28,343,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,148,568,617.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 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事项。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
招商证券	2	62,106,253,526.95	25.87%	6,206,590.05	25.87%	-
华泰证券	3	59,278,421,206.77	24.69%	5,925,744.37	24.70%	-
中信证券	2	46,716,161,818.58	19.46%	4,667,254.11	19.45%	-
方正证券	2	39,032,837,339.85	16.26%	3,900,247.34	16.26%	-
银河证券	1	19,815,186,066.85	8.25%	1,979,713.81	8.25%	-
中泰证券	1	5,781,741,394.42	2.41%	577,609.17	2.41%	-
国信证券	2	5,243,739,654.79	2.18%	523,880.03	2.18%	-

国泰海通	4	1,265,145,427.96	0.53%	126,435.35	0.53%	-
中金公司	1	845,750,595.88	0.35%	84,492.16	0.35%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

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：国泰海通；减少交易单元：国投证券。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	3,563,710.06	8.36%	-	-	-	-
华泰证券	39,048,624.78	91.64%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

国金证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

10.8 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	中证 500 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	2026-01-09
2	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加世纪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	2026-01-13
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更扩位证券简称的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-20
4	南方基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 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	2026-03-31
5	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加华源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	2026-04-07
6	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	2026-04-11
7	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-24
8	南方基金管理股份有限公司成都分公司工商注册信息变更公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-28
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	2026-06-12

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		达到或者超过 20% 的时间区间					
联接基金	1	20260520-20260521, 20260525-20260601, 20260604-20260614, 20260616-20260630	1,008,628,500.00	103,044,374.00	198,064,196.00	913,608,678.00	22.02%
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证 500 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、《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年中期报告》原文。

12.2 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。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>