

南方中证 500 量化增强股票型发起式 证券投资基金 2025 年中期报告

2025 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：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 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 2025 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.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	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.....	11
§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.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
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.....	58
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.....	58

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
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	61
§9 开放式基金份额变动.....	62
§10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
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	南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金	
基金简称	南方中证 500 量化增强股票发起	
基金主代码	002906	
交易代码	002906	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 23 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	680,425,334.62 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方中证 500 量化增强股票发起 A	南方中证 500 量化增强股票发起 C
下属分级基金的交易代码	002906	002907
报告期末下属分级基金的份额总额	588,666,650.18 份	91,758,684.44 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金利用量化投资模型，在控制组合跟踪误差的基础上，力求投资收益能够超越目标指数。
业绩比较基准	比较基准的标的指数：中证 500 指数 本基金的业绩比较基准：中证 500 指数收益率×95%+1%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人		基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司		中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	王茵
	联系电话	0755-82763888	010-63639180
	电子邮箱	manager@southernfund.com	wangyin@cebbank.com

客户服务电话	400-889-8899	95595
传真	0755-82763889	010-63639132
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码	518017	100033
法定代表人	周易	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、南方中证 500 量化增强股票发起 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	7,332,248.30
本期利润	27,462,506.35
加权平均基金份额本期利润	0.0456
本期加权平均净值利润率	4.45%
本期基金份额净值增长率	4.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	31,733,747.31
期末可供分配基金份额利润	0.0539
期末基金资产净值	627,669,588.83
期末基金份额净值	1.0663
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	6.63%
-------------	-------

2、南方中证 500 量化增强股票发起 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	899,001.78
本期利润	4,186,641.16
加权平均基金份额本期利润	0.0432
本期加权平均净值利润率	4.34%
本期基金份额净值增长率	4.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,269,157.88
期末可供分配基金份额利润	0.0247
期末基金资产净值	95,044,324.44
期末基金份额净值	1.0358
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	3.58%

注：基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方中证 500 量化增强股票发起 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	3.97%	0.66%	4.18%	0.76%	-0.21%	-0.10%
过去三个月	2.22%	1.31%	1.22%	1.43%	1.00%	-0.12%
过去六个月	4.55%	1.15%	3.71%	1.29%	0.84%	-0.14%
过去一年	13.36%	1.44%	20.01%	1.64%	-6.65%	-0.20%
过去三年	-16.30%	1.21%	-4.84%	1.29%	-11.46%	-0.08%
自基金合同 生效起至今	6.63%	1.30%	-1.32%	1.29%	7.95%	0.01%

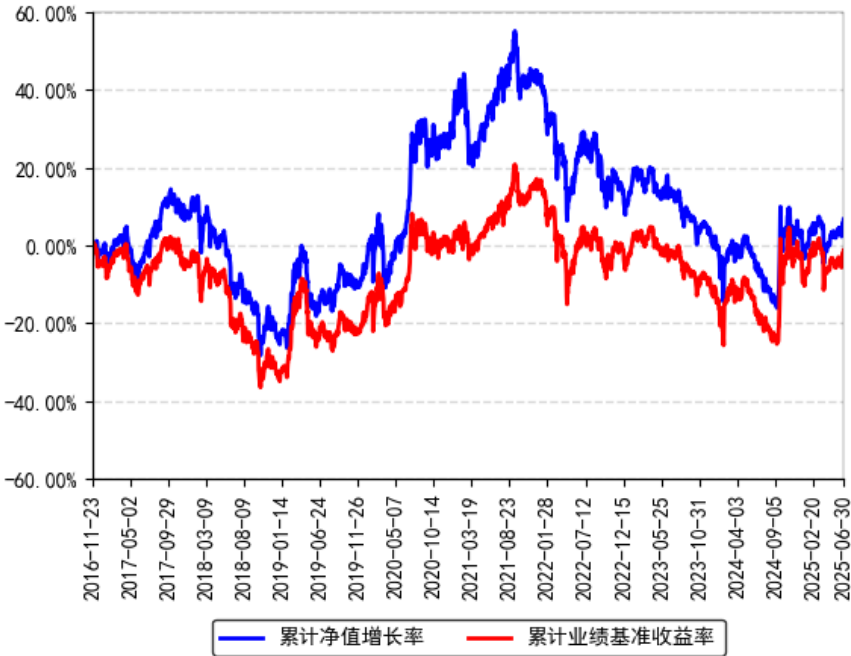
南方中证 500 量化增强股票发起 C

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

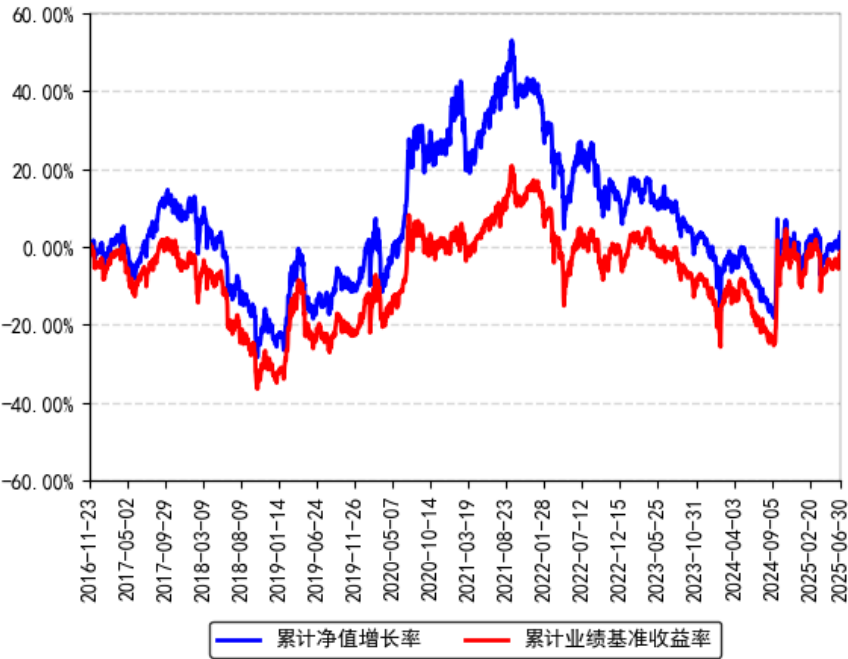
	增长率①	增长率标准 差②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去一个月	3.93%	0.66%	4.18%	0.76%	-0.25%	-0.10%
过去三个月	2.11%	1.31%	1.22%	1.43%	0.89%	-0.12%
过去六个月	4.33%	1.15%	3.71%	1.29%	0.62%	-0.14%
过去一年	12.91%	1.44%	20.01%	1.64%	-7.10%	-0.20%
过去三年	-17.33%	1.21%	-4.84%	1.29%	-12.49%	-0.08%
自基金合同 生效起至今	3.58%	1.30%	-1.32%	1.29%	4.90%	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500量化增强股票发起A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方中证500量化增强股票发起C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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		
游涛	本基金基金经理	2024 年 12 月 6 日	-	8 年	中央财经大学统计学博士，深圳证券交易所博士后，具有基金从业资格。曾先

	理				后就职于深圳证券交易所，博时基金管理有限公司，历任博士后研究员、高级人工智能研究员、高级量化研究员。2022 年 4 月加入南方基金数量化投资部，2024 年 12 月 6 日至今，任南方中证 500 量化增强股票发起基金经理。
--	---	--	--	--	--

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，并且交易占优比也没有明显异常，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 96 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

2025 年上半年，本基金以指数增强选股模型股票投资为主，通过严谨的数量化的方法挖掘市场 alpha，力求提升超额收益。本基金基于公司自主研发量化投资研发平台进行策略研发，目前有基本面策略，多因子策略，AI 深度学习策略，由核心模型和卫星模型构成。在追求超额收益的同时，为了控制超额回撤风险，在组合优化的过程中，严格控制了行业偏离以及个股偏离，综合考虑预期收益，风险以及交易成本来确定投资组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.0663 元，报告期内，份额净值增长率为 4.55%，同期业绩基准增长率为 3.71%；本基金 C 份额净值为 1.0358 元，报告期内，份额净值增长率为 4.33%，同期业绩基准增长率为 3.71%。

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 2025 年下半年，短期保持耐心，中长期依然乐观。短期来看，对增量政策保持耐心。今年 3-4 月关税冲击下，国内政策迅速转向宽松，但目前观察之下，二阶段的财政货币政策节奏均相对平缓。政策节奏变化的核心原因在于中美关税事件的边际缓和且关税暂缓期或有延期，在事件悬而未决之前国内政策工具或不会使用完毕。中长期来看，自 4 月政治局会议以来已经明确走向了财政货币双宽来推动金融企稳、经济复苏的路径。1-2 个月战术视角耐心等待，6-12 个月战略视角维持再通胀牛市观点配置以红利+小盘科技成长为主。

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、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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金 2025 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、

财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金
报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.3.1	41,892,344.93	50,171,712.07
结算备付金		5,738,869.67	1,828,331.03
存出保证金		321,811.65	82,010.58
交易性金融资产	6.4.3.2	678,677,639.09	678,504,194.11
其中：股票投资		678,668,638.50	678,504,194.11
基金投资		-	-
债券投资		9,000.59	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
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		13,129,814.78	-
应收股利		-	-
应收申购款		103,119.71	258,356.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		739,863,599.83	730,844,603.82
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		14,499,692.86	21,799.64
应付赎回款		1,368,623.45	1,257,358.09
应付管理人报酬		582,725.85	629,641.64
应付托管费		116,545.16	125,928.32
应付销售服务费		30,985.42	34,827.47
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	1.55
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	551,113.82	290,464.47
负债合计		17,149,686.56	2,360,021.18
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	680,425,334.62	716,934,740.12
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	42,288,578.65	11,549,842.52
净资产合计		722,713,913.27	728,484,582.64
负债和净资产总计		739,863,599.83	730,844,603.82

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，南方中证 500 量化增强股票发起 A 份额净值 1.0663 元，基金份额总额 588,666,650.18 份；南方中证 500 量化增强股票发起 C 份额净值 1.0358 元，基金份额总额 91,758,684.44 份；总份额合计 680,425,334.62 份。

6.2 利润表

会计主体：南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		36,188,894.76	-41,876,207.23
1.利息收入		156,563.06	147,346.66
其中：存款利息收入	6.4.3.9	156,563.06	147,346.66
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”		12,553,307.71	-51,284,933.16

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.3.10	5,686,427.75	-59,756,259.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	0.59	49,591.12
资产支持证券投资 收益	6.4.3.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.13	-	-
股利收益	6.4.3.14	6,866,879.37	8,421,735.16
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）	6.4.3.15	23,417,897.43	9,228,992.65
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.3.16	61,126.56	32,386.62
减：二、营业总支出		4,539,747.25	3,606,070.16
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	3,534,457.86	2,733,155.96
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.6.2.2	706,891.56	546,631.23
3.销售服务费	6.4.6.2.3	191,483.53	198,017.08
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		-	0.13
8.其他费用	6.4.3.17	106,914.30	128,265.76
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		31,649,147.51	-45,482,277.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		31,649,147.51	-45,482,277.39
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		31,649,147.51	-45,482,277.39

6.3 净资产变动表

会计主体：南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	716,934,740.12	-	11,549,842.52	728,484,582.64
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	716,934,740.12	-	11,549,842.52	728,484,582.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-36,509,405.50	-	30,738,736.13	-5,770,669.37
（一）、综合收益总额	-	-	31,649,147.51	31,649,147.51
（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）	-36,509,405.50	-	-910,411.38	-37,419,816.88
其中：1.基金申购款	33,220,324.53	-	407,884.82	33,628,209.35
2.基金赎回款	-69,729,730.03	-	-1,318,296.20	-71,048,026.23
（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	680,425,334.62	-	42,288,578.65	722,713,913.27
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	567,949,836.17	-	9,537,691.61	577,487,527.78
加：会计政策变更	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	567,949,836.17	-	9,537,691.61	577,487,527.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-11,548,424.75	-	-44,912,591.68	-56,461,016.43
（一）、综合收益总额	-	-	-45,482,277.39	-45,482,277.39
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-11,548,424.75	-	569,685.71	-10,978,739.04
其中：1.基金申购款	31,575,029.66	-	-1,069,750.91	30,505,278.75
2.基金赎回款	-43,123,454.41	-	1,639,436.62	-41,484,017.79
（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	556,401,411.42	-	-35,374,900.07	521,026,511.35

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 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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 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。

6.4.2.2 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。

6.4.2.3 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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 货币资金

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款		41,892,344.93
等于：本金		41,888,504.83
加：应计利息		3,840.10
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		41,892,344.93

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		660,201,845.27	-	678,668,638.50	18,466,793.23
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	9,000.00	0.59	9,000.59	-
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	9,000.00	0.59	9,000.59	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		660,210,845.27	0.59	678,677,639.09	18,466,793.23

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.3.5 其他资产

无。

6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	730.20
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	468,560.76
其中：交易所市场	468,560.76
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	81,822.86
应付指数使用费	-
合计	551,113.82

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方中证 500 量化增强股票发起 A		
项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	615,913,249.69	615,913,249.69
本期申购	22,144,460.70	22,144,460.70

本期赎回（以“-”号填列）	-49,391,060.21	-49,391,060.21
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	588,666,650.18	588,666,650.18

南方中证 500 量化增强股票发起 C		
项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	101,021,490.43	101,021,490.43
本期申购	11,075,863.83	11,075,863.83
本期赎回（以“-”号填列）	-20,338,669.82	-20,338,669.82
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	91,758,684.44	91,758,684.44

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）。

6.4.3.8 未分配利润

单位：人民币元

南方中证 500 量化增强股票发起 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	25,551,369.65	-13,272,228.82	12,279,140.83
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	25,551,369.65	-13,272,228.82	12,279,140.83
本期利润	7,332,248.30	20,130,258.05	27,462,506.35
本期基金份额交易产生的变动数	-1,149,870.64	411,162.11	-738,708.53
其中：基金申购款	766,031.29	-248,973.83	517,057.46
基金赎回款	-1,915,901.93	660,135.94	-1,255,765.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,733,747.31	7,269,191.34	39,002,938.65

南方中证 500 量化增强股票发起 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,479,718.75	-2,209,017.06	-729,298.31
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,479,718.75	-2,209,017.06	-729,298.31
本期利润	899,001.78	3,287,639.38	4,186,641.16
本期基金份额交易产生的变动数	-109,562.65	-62,140.20	-171,702.85
其中：基金申购款	158,939.50	-268,112.14	-109,172.64
基金赎回款	-268,502.15	205,971.94	-62,530.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,269,157.88	1,016,482.12	3,285,640.00

6.4.3.9 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 6 月 30 日
活期存款利息收入	142,027.82
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	14,083.63
其他	451.61
合计	156,563.06

6.4.3.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,953,371,672.73
减：卖出股票成本总额	4,943,589,204.68
减：交易费用	4,096,040.30
买卖股票差价收入	5,686,427.75

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.3.11 债券投资收益

6.4.3.11.1 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 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	0.59
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	0.59

6.4.3.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.3.12 资产支持证券投资收益

6.4.3.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.3.13 衍生工具收益

6.4.3.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.3.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.3.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,866,879.37
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	6,866,879.37

6.4.3.15 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 6 月 30 日
1.交易性金融资产	23,417,897.43
——股票投资	23,417,897.43
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	23,417,897.43

6.4.3.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	48,697.81
基金转换费收入	12,428.75

合计	61,126.56
----	-----------

6.4.3.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	25,049.03
其他	42.41
合计	106,914.30

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），规定自 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。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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、登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司("中国光大银行")	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司("兴业证券")	基金管理人的股东、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

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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 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 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	1,924,015,497.85	19.49%	86,229,512.07	11.47%

6.4.6.1.2 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 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	-	285,184.04	81.08%

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 权证交易

无。

6.4.6.1.5 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 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	192,214.80	19.49%	57,606.88	12.29%
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	63,456.77	48.80%	-	-

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。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025	上年度可比期间 2024 年 1 月
----	-------------------------	--------------------

	年 6 月 30 日	1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,534,457.86	2,733,155.96
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,056,621.82	725,331.54
应支付基金管理人的净管理费	2,477,836.04	2,007,824.42

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 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	706,891.56	546,631.23

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方中证 500 量化增强股票发起 A	南方中证 500 量化增强股票发起 C	合计
光大银行	-	1,851.86	1,851.86
华泰证券	-	3,031.54	3,031.54
南方基金	-	14,232.92	14,232.92
兴业证券	-	63.22	63.22
合计	-	19,179.54	19,179.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方中证 500 量化增强股票发起 A	南方中证 500 量化增强股票发起 C	合计
光大银行	-	2,283.84	2,283.84
华泰证券	-	2,960.19	2,960.19
南方基金	-	16,550.04	16,550.04
兴业证券	-	97.76	97.76
合计	-	21,891.83	21,891.83

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

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

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.6.4 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

6.4.6.4.1 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。

6.4.6.4.2 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。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	南方中证 500 量化增强股票 发起 A	南方中证 500 量化增强股票 发起 C
报告期初持有的基金份额	7,745,925.64	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	7,745,925.64	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占 基金总份额比例	-	-

项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	南方中证 500 量化增强股票 发起 A	南方中证 500 量化增强股票 发起 C
报告期初持有的基金份额	7,745,925.64	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	7,745,925.64	-

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.39%	-
---------------------	-------	---

注：基金管理人南方基金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。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.6 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 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
中国光大银行	41,892,344.93	142,027.82	46,909,250.39	139,238.16

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。

6.4.6.7 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 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	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

上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	688709	成都华微	网下申购	10,448	163,929.12
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

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

6.4.8 期末（2025 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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

6.4.8.1.1 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
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定期	47.27	124.16	564	26,660.28	70,026.24	-
688411	海博思创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定期	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股锁定期	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
688583	思看科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定期	33.46	79.68	175	5,855.50	13,944.00	-
688583	思看科技	2025 年 6 月 19 日	1 个月内(含)	锁定期转增	-	79.68	52	-	4,143.36	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股锁定期	39.92	45.22	241	9,620.72	10,898.02	-
301501	恒鑫生活	2025 年 6 月 6 日	1-6 个月(含)	锁定期转增	-	45.22	109	-	4,928.98	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内(含)	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定期	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁定期	41.90	77.87	130	5,447.00	10,123.10	-
301479	弘景光电	2025 年 5 月 28 日	1-6 个月(含)	锁定期转增	-	77.87	52	-	4,049.24	-
688757	胜科纳米	2025	6 个月	新股锁	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-

		年 3 月 18 日		定期						
603049	中策橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	46.50	42.85	317	14,740.50	13,583.45	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	89.60	139.4 8	73	6,540.80	10,182.04	-
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股锁 定期	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
603409	汇通控股	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新股锁 定期	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
6.4.8.1.2 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
123257	安克转债	2025 年 6 月	1 个月 内(含)	配债未 上市	100.0 0	100.0 1	90	9,000.00	9,000.59	-

		16 日								
--	--	------	--	--	--	--	--	--	--	--

6.4.8.2 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
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大事项停牌	38.05	2025 年 7 月 11 日	39.98	15,641	446,924.78	595,140.05	-

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数增强基金，本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资和衍生工具(主要为股指期货投资)等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.9.2 信用风险

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

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

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

6.4.9.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

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,达到降低投资组合的整体风险的目的。

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

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	41,892,344.93	-	-	-	41,892,344.93
结算备付金	5,738,869.67	-	-	-	5,738,869.67
存出保证金	321,811.65	-	-	-	321,811.65
交易性金融资产	-	-	9,000.59	678,668,638.50	678,677,639.09
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	-	-	-	13,129,814.78	13,129,814.78
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	103,119.71	103,119.71
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	47,953,026.25	-	9,000.59	691,901,572.99	739,863,599.83
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	-	-	-	14,499,692.86	14,499,692.86
应付赎回款	-	-	-	1,368,623.45	1,368,623.45
应付管理人报酬	-	-	-	582,725.85	582,725.85
应付托管费	-	-	-	116,545.16	116,545.16
应付销售服务费	-	-	-	30,985.42	30,985.42
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	551,113.82	551,113.82
负债总计	-	-	-	17,149,686.56	17,149,686.56
利率敏感度缺口	47,953,026.25	-	9,000.59	674,751,886.43	722,713,913.27
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	50,171,712.07	-	-	-	50,171,712.07
结算备付金	1,828,331.03	-	-	-	1,828,331.03
存出保证金	82,010.58	-	-	-	82,010.58
交易性金融资产	-	-	-	678,504,194.11	678,504,194.11
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	258,356.03	258,356.03

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	52,082,053.68	-	-	678,762,550.14	730,844,603.82
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	-	-	-	21,799.64	21,799.64
应付赎回款	-	-	-	1,257,358.09	1,257,358.09
应付管理人报酬	-	-	-	629,641.64	629,641.64
应付托管费	-	-	-	125,928.32	125,928.32
应付销售服务费	-	-	-	34,827.47	34,827.47
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.55	1.55
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	290,464.47	290,464.47
负债总计	-	-	-	2,360,021.18	2,360,021.18
利率敏感度缺口	52,082,053.68	-	-	676,402,528.96	728,484,582.64

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。

6.4.9.4.1.2 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 6 月 30 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

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 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	678,668,638.50	93.91	678,504,194.11	93.14
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	678,668,638.50	93.91	678,504,194.11	93.14

6.4.9.4.3.2 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 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2024 年 12 月 31 日 ）
	1.组合自身基准上升 5%	31,293,870.83	31,679,259.05
	2.组合自身基准下降 5%	-31,293,870.83	-31,679,259.05

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 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。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日
第一层次	677,752,749.60
第二层次	619,526.18
第三层次	305,363.31
合计	678,677,639.09

6.4.10.2.2 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。

6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.10.4 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。

6.4.11 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	678,668,638.50	91.73
	其中：股票	678,668,638.50	91.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,000.59	0.00
	其中：债券	9,000.59	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	47,631,214.60	6.44
8	其他各项资产	13,554,746.14	1.83
9	合计	739,863,599.83	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	38,213.00	0.01
B	采矿业	17,913,492.98	2.48
C	制造业	334,902,386.33	46.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,679,118.48	3.28
E	建筑业	2,443,040.98	0.34
F	批发和零售业	28,311,852.26	3.92
G	交通运输、仓储和邮政业	2,794,852.45	0.39
H	住宿和餐饮业	2,944,581.30	0.41
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,071,846.58	7.21
J	金融业	59,482,180.61	8.23
K	房地产业	6,629,131.43	0.92
L	租赁和商务服务业	5,482,508.01	0.76
M	科学研究和技术服务业	879,124.11	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	2,997,598.60	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	106,663.50	0.01
R	文化、体育和娱乐业	9,448,101.65	1.31
S	综合	2,390,465.09	0.33
	合计	552,515,157.36	76.45

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	20,685.00	0.00
B	采矿业	3,513,204.13	0.49
C	制造业	77,728,164.36	10.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	271,260.00	0.04
E	建筑业	3,571,326.00	0.49
F	批发和零售业	3,320,190.50	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	3,871,699.41	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,304,382.74	2.26
J	金融业	7,266,832.06	1.01
K	房地产业	3,247,216.00	0.45
L	租赁和商务服务业	3,912,194.00	0.54
M	科学研究和技术服务业	2,626,340.94	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	467,142.00	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	32,844.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	126,153,481.14	17.46

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 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	300207	欣旺达	464,055	9,308,943.30	1.29
2	300017	网宿科技	836,215	8,964,224.80	1.24
3	000783	长江证券	1,220,838	8,460,407.34	1.17
4	000893	亚钾国际	276,872	8,344,922.08	1.15
5	000988	华工科技	174,700	8,212,647.00	1.14
6	688122	西部超导	154,156	7,997,613.28	1.11
7	603087	甘李药业	140,950	7,721,241.00	1.07

8	600998	九州通	1,461,970	7,514,525.80	1.04
9	603379	三美股份	153,622	7,392,290.64	1.02
10	000039	中集集团	865,494	6,802,782.84	0.94
11	600166	福田汽车	2,496,600	6,765,786.00	0.94
12	603233	大参林	408,550	6,659,365.00	0.92
13	600578	京能电力	1,403,692	6,302,577.08	0.87
14	000009	中国宝安	694,702	6,168,953.76	0.85
15	601128	常熟银行	833,396	6,142,128.52	0.85
16	600685	中船防务	221,822	6,031,340.18	0.83
17	688099	晶晨股份	83,424	5,923,938.24	0.82
18	002821	凯莱英	66,759	5,891,481.75	0.82
19	600704	物产中大	1,103,999	5,818,074.73	0.81
20	002025	航天电器	108,639	5,585,130.99	0.77
21	300496	中科创达	96,682	5,532,144.04	0.77
22	000636	风华高科	388,652	5,340,078.48	0.74
23	600038	中直股份	135,379	5,254,058.99	0.73
24	002500	山西证券	864,804	5,050,455.36	0.70
25	688249	晶合集成	245,977	4,985,953.79	0.69
26	003022	联泓新科	308,900	4,889,887.00	0.68
27	002939	长城证券	580,800	4,867,104.00	0.67
28	601991	大唐发电	1,528,650	4,845,820.50	0.67
29	002080	中材科技	248,084	4,837,638.00	0.67
30	603816	顾家家居	186,228	4,752,538.56	0.66
31	688188	柏楚电子	34,891	4,593,749.06	0.64
32	000960	锡业股份	297,100	4,545,630.00	0.63
33	600959	江苏有线	1,313,577	4,518,704.88	0.63
34	002673	西部证券	557,400	4,392,312.00	0.61
35	600739	辽宁成大	398,470	4,383,170.00	0.61
36	300604	长川科技	96,300	4,324,833.00	0.60
37	000728	国元证券	548,100	4,324,509.00	0.60
38	600316	洪都航空	114,550	4,318,535.00	0.60
39	300001	特锐德	178,213	4,271,765.61	0.59
40	600582	天地科技	702,800	4,209,772.00	0.58
41	601717	中创智领	250,593	4,164,855.66	0.58
42	002202	金风科技	404,964	4,150,881.00	0.57
43	600062	华润双鹤	220,396	4,112,589.36	0.57
44	300623	捷捷微电	136,900	4,079,620.00	0.56
45	000050	深天马 A	474,643	4,043,958.36	0.56
46	600497	驰宏锌锗	762,800	4,035,212.00	0.56
47	000060	中金岭南	879,411	4,027,702.38	0.56
48	000415	渤海租赁	1,209,500	4,027,635.00	0.56
49	600008	首创环保	1,316,100	3,974,622.00	0.55
50	600867	通化东宝	478,650	3,924,930.00	0.54

51	002532	天山铝业	470,499	3,909,846.69	0.54
52	300140	节能环境	633,200	3,906,844.00	0.54
53	688728	格科微	253,667	3,906,471.80	0.54
54	601958	金钼股份	349,493	3,823,453.42	0.53
55	000709	河钢股份	1,763,509	3,809,179.44	0.53
56	600021	上海电力	431,200	3,790,248.00	0.52
57	600968	海油发展	924,890	3,773,551.20	0.52
58	688213	思特威	36,745	3,756,073.90	0.52
59	600435	北方导航	238,410	3,716,811.90	0.51
60	688425	铁建重工	901,653	3,678,744.24	0.51
61	601921	浙版传媒	442,000	3,562,520.00	0.49
62	600637	东方明珠	471,385	3,521,245.95	0.49
63	688120	华海清科	20,800	3,508,960.00	0.49
64	300054	鼎龙股份	120,300	3,450,204.00	0.48
65	601568	北元集团	830,134	3,445,056.10	0.48
66	600352	浙江龙盛	332,447	3,377,661.52	0.47
67	002244	滨江集团	344,015	3,354,146.25	0.46
68	600298	安琪酵母	93,100	3,274,327.00	0.45
69	603529	爱玛科技	94,338	3,245,227.20	0.45
70	600299	安迪苏	330,927	3,193,445.55	0.44
71	300373	扬杰科技	61,518	3,192,784.20	0.44
72	600517	国网英大	616,400	3,143,640.00	0.43
73	600348	华阳股份	463,456	3,086,616.96	0.43
74	688778	厦钨新能	54,916	3,070,902.72	0.42
75	688561	奇安信	88,944	3,022,317.12	0.42
76	600143	金发科技	291,775	3,008,200.25	0.42
77	600707	彩虹股份	464,822	3,002,750.12	0.42
78	002444	巨星科技	116,026	2,959,823.26	0.41
79	600258	首旅酒店	206,010	2,910,921.30	0.40
80	000959	首钢股份	855,966	2,910,284.40	0.40
81	601168	西部矿业	173,187	2,880,099.81	0.40
82	300677	英科医疗	121,214	2,870,347.52	0.40
83	300573	兴齐眼药	54,515	2,823,331.85	0.39
84	600487	亨通光电	184,350	2,820,555.00	0.39
85	003031	中瓷电子	52,670	2,802,570.70	0.39
86	300251	光线传媒	136,100	2,758,747.00	0.38
87	002266	浙富控股	869,378	2,677,684.24	0.37
88	300888	稳健医疗	65,055	2,673,760.50	0.37
89	002409	雅克科技	48,600	2,657,934.00	0.37
90	601456	国联民生	253,858	2,627,430.30	0.36
91	600380	健康元	237,867	2,623,673.01	0.36
92	000723	美锦能源	605,126	2,614,144.32	0.36
93	002299	圣农发展	181,980	2,600,494.20	0.36

94	603858	步长制药	158,411	2,572,594.64	0.36
95	002318	久立特材	107,602	2,516,810.78	0.35
96	000729	燕京啤酒	190,025	2,457,023.25	0.34
97	600499	科达制造	244,656	2,397,628.80	0.33
98	600673	东阳光	205,543	2,390,465.09	0.33
99	300346	南大光电	73,740	2,333,133.60	0.32
100	002138	顺络电子	82,836	2,329,348.32	0.32
101	601665	齐鲁银行	365,698	2,311,211.36	0.32
102	300383	光环新网	159,400	2,279,420.00	0.32
103	002595	豪迈科技	37,890	2,243,845.80	0.31
104	688777	中控技术	48,616	2,183,344.56	0.30
105	603486	科沃斯	37,291	2,171,454.93	0.30
106	600895	张江高科	84,000	2,158,800.00	0.30
107	002850	科达利	18,935	2,142,873.95	0.30
108	002958	青农商行	593,400	2,142,174.00	0.30
109	300476	胜宏科技	15,470	2,078,858.60	0.29
110	301165	锐捷网络	33,320	2,047,847.20	0.28
111	000951	中国重汽	116,100	2,041,038.00	0.28
112	603927	中科软	105,100	2,032,634.00	0.28
113	600862	中航高科	76,635	1,998,640.80	0.28
114	601156	东航物流	150,900	1,975,281.00	0.27
115	600906	财达证券	286,800	1,955,976.00	0.27
116	603225	新凤鸣	181,700	1,935,105.00	0.27
117	000513	丽珠集团	51,612	1,860,096.48	0.26
118	002624	完美世界	121,831	1,848,176.27	0.26
119	603893	瑞芯微	11,819	1,794,833.34	0.25
120	000623	吉林敖东	99,996	1,694,932.20	0.23
121	600901	江苏金租	277,700	1,682,862.00	0.23
122	603979	金诚信	34,823	1,617,180.12	0.22
123	601098	中南传媒	115,363	1,513,562.56	0.21
124	600970	中材国际	173,056	1,484,820.48	0.21
125	002841	视源股份	42,623	1,474,755.80	0.20
126	601162	天风证券	292,950	1,444,243.50	0.20
127	600511	国药股份	49,105	1,431,901.80	0.20
128	000987	越秀资本	208,459	1,430,028.74	0.20
129	000598	兴蓉环境	196,900	1,419,649.00	0.20
130	300395	菲利华	26,410	1,349,551.00	0.19
131	301358	湖南裕能	43,051	1,342,760.69	0.19
132	002432	九安医疗	35,451	1,291,479.93	0.18
133	603589	口子窖	36,190	1,259,412.00	0.17
134	603298	杭叉集团	58,595	1,227,565.25	0.17
135	002572	索菲亚	86,000	1,204,860.00	0.17
136	300024	机器人	69,900	1,200,882.00	0.17

137	601577	长沙银行	117,307	1,166,031.58	0.16
138	601928	凤凰传媒	103,377	1,154,721.09	0.16
139	688235	百济神州	4,931	1,152,078.84	0.16
140	300454	深信服	12,000	1,130,160.00	0.16
141	002517	恺英网络	56,800	1,096,808.00	0.15
142	002156	通富微电	42,600	1,091,412.00	0.15
143	688297	中无人机	20,398	1,089,253.20	0.15
144	688220	翱捷科技	13,867	1,085,786.10	0.15
145	603737	三棵树	29,381	1,082,689.85	0.15
146	600132	重庆啤酒	19,640	1,082,164.00	0.15
147	002155	湖南黄金	60,459	1,079,193.15	0.15
148	601216	君正集团	192,370	1,061,882.40	0.15
149	688114	华大智造	16,303	1,056,923.49	0.15
150	600392	盛和资源	76,300	1,004,871.00	0.14
151	000591	太阳能	225,800	991,262.00	0.14
152	000785	居然智家	321,152	979,513.60	0.14
153	688525	佰维存储	14,507	977,771.80	0.14
154	688017	绿的谐波	7,728	965,149.92	0.13
155	301308	江波龙	10,823	946,904.27	0.13
156	000032	深桑达 A	45,850	927,545.50	0.13
157	600498	烽火通信	44,050	926,371.50	0.13
158	603728	鸣志电器	15,950	916,646.50	0.13
159	300919	中伟股份	27,812	914,458.56	0.13
160	002223	鱼跃医疗	25,500	907,800.00	0.13
161	603939	益丰药房	36,400	890,708.00	0.12
162	601155	新城控股	63,916	874,370.88	0.12
163	300763	锦浪科技	15,195	872,041.05	0.12
164	000703	恒逸石化	143,400	843,192.00	0.12
165	600563	法拉电子	7,612	830,393.08	0.11
166	688819	天能股份	29,679	823,889.04	0.11
167	600056	中国医药	78,300	809,622.00	0.11
168	688475	萤石网络	25,409	800,891.68	0.11
169	601997	贵阳银行	128,000	798,720.00	0.11
170	600988	赤峰黄金	31,626	786,854.88	0.11
171	600873	梅花生物	73,517	785,896.73	0.11
172	603341	龙旗科技	19,266	782,777.58	0.11
173	601061	中信金属	98,473	778,921.43	0.11
174	601158	重庆水务	162,844	755,596.16	0.10
175	600956	新天绿能	95,528	737,476.16	0.10
176	603565	中谷物流	73,759	704,398.45	0.10
177	000423	东阿阿胶	12,009	628,070.70	0.09
178	002439	启明星辰	35,824	572,825.76	0.08
179	300567	精测电子	9,350	566,703.50	0.08

180	600483	福能股份	58,347	562,465.08	0.08
181	603868	飞科电器	14,750	529,082.50	0.07
182	002185	华天科技	49,610	501,061.00	0.07
183	000825	太钢不锈	138,635	497,699.65	0.07
184	002414	高德红外	48,194	493,988.50	0.07
185	688248	南网科技	15,471	486,717.66	0.07
186	002410	广联达	34,400	461,304.00	0.06
187	600096	云天化	20,727	455,372.19	0.06
188	601696	中银证券	42,100	450,049.00	0.06
189	600153	建发股份	42,873	444,593.01	0.06
190	603129	春风动力	1,951	422,391.50	0.06
191	000898	鞍钢股份	181,800	421,776.00	0.06
192	600909	华安证券	71,069	414,332.27	0.06
193	600398	海澜之家	58,783	409,129.68	0.06
194	002739	万达电影	34,400	393,192.00	0.05
195	600928	西安银行	100,239	392,936.88	0.05
196	000733	振华科技	7,768	388,788.40	0.05
197	600583	海油工程	71,002	387,670.92	0.05
198	601918	新集能源	59,862	386,708.52	0.05
199	002756	永兴材料	11,771	373,729.25	0.05
200	002340	格林美	58,700	372,745.00	0.05
201	300037	新宙邦	10,570	372,064.00	0.05
202	002056	横店东磁	25,875	366,131.25	0.05
203	300012	华测检测	30,455	356,018.95	0.05
204	600131	国网信通	20,100	355,770.00	0.05
205	603596	伯特利	6,398	337,110.62	0.05
206	600295	鄂尔多斯	37,750	328,802.50	0.05
207	600060	海信视像	13,900	319,978.00	0.04
208	603568	伟明环保	16,767	319,914.36	0.04
209	603606	东方电缆	5,841	302,038.11	0.04
210	601233	桐昆股份	25,448	269,748.80	0.04
211	600486	扬农化工	4,546	263,668.00	0.04
212	600612	老凤祥	5,251	261,237.25	0.04
213	002738	中矿资源	6,894	221,711.04	0.03
214	688563	航材股份	3,847	217,855.61	0.03
215	300699	光威复材	6,600	209,022.00	0.03
216	301498	乖宝宠物	1,834	200,584.58	0.03
217	688278	特宝生物	2,718	195,994.98	0.03
218	603290	斯达半导	2,263	183,914.01	0.03
219	689009	九号公司	2,835	167,746.95	0.02
220	600663	陆家嘴	18,530	164,175.80	0.02
221	603338	浙江鼎力	3,263	154,666.20	0.02
222	688538	和辉光电	64,325	150,520.50	0.02

223	002078	太阳纸业	11,069	148,988.74	0.02
224	688617	惠泰医疗	489	145,233.00	0.02
225	601179	中国西电	15,952	97,945.28	0.01
226	000997	新大陆	1,850	59,903.00	0.01
227	688002	睿创微纳	800	55,776.00	0.01
228	002294	信立泰	1,150	54,429.50	0.01
229	002558	巨人网络	2,250	52,987.50	0.01
230	000519	中兵红箭	2,400	52,536.00	0.01
231	002683	广东宏大	1,350	45,819.00	0.01
232	000831	中国稀土	1,250	45,150.00	0.01
233	002436	兴森科技	3,400	45,016.00	0.01
234	688375	国博电子	750	45,007.50	0.01
235	603688	石英股份	1,250	44,025.00	0.01
236	688052	纳芯微	250	43,622.50	0.01
237	688180	君实生物	1,250	42,475.00	0.01
238	002044	美年健康	7,800	40,092.00	0.01
239	688065	凯赛生物	850	40,035.00	0.01
240	600329	达仁堂	1,200	40,032.00	0.01
241	601212	白银有色	12,500	39,125.00	0.01
242	000958	电投产融	5,650	38,646.00	0.01
243	600118	中国卫星	1,350	38,569.50	0.01
244	600598	北大荒	2,650	38,213.00	0.01
245	600361	创新新材	9,450	37,705.50	0.01
246	603179	新泉股份	800	37,576.00	0.01
247	002568	百润股份	1,450	37,134.50	0.01
248	000539	粤电力 A	8,150	37,001.00	0.01
249	600995	南网储能	3,750	36,675.00	0.01
250	600098	广州发展	5,850	36,562.50	0.01
251	601965	中国汽研	2,050	36,387.50	0.01
252	603345	安井食品	450	36,189.00	0.01
253	601228	广州港	11,050	35,691.50	0.00
254	603650	彤程新材	1,100	35,365.00	0.00
255	600378	昊华科技	1,300	35,191.00	0.00
256	601990	南京证券	4,350	35,148.00	0.00
257	000537	中绿电	4,200	35,112.00	0.00
258	300144	宋城演艺	4,100	35,055.00	0.00
259	002385	大北农	8,550	34,542.00	0.00
260	603786	科博达	620	34,354.20	0.00
261	600871	石化油服	17,500	34,125.00	0.00
262	600848	上海临港	3,750	34,012.50	0.00
263	002507	涪陵榨菜	2,650	33,893.50	0.00
264	600754	锦江酒店	1,500	33,660.00	0.00
265	301267	华夏眼科	1,750	33,547.50	0.00

266	688172	燕东微	1,700	33,422.00	0.00
267	603826	坤彩科技	1,700	33,269.00	0.00
268	600763	通策医疗	800	33,024.00	0.00
269	603885	吉祥航空	2,450	33,001.50	0.00
270	002120	韵达股份	4,900	32,830.00	0.00
271	600536	中国软件	700	32,739.00	0.00
272	601099	太平洋	8,200	32,226.00	0.00
273	300212	易华录	1,450	31,552.00	0.00
274	002262	恩华药业	1,500	31,170.00	0.00
275	300601	康泰生物	2,050	31,139.50	0.00
276	300058	蓝色光标	4,690	30,766.40	0.00
277	601019	山东出版	3,200	30,304.00	0.00
278	688032	禾迈股份	300	29,958.00	0.00
279	600177	雅戈尔	4,050	29,565.00	0.00
280	600325	华发股份	6,000	29,220.00	0.00
281	688349	三一重能	1,150	28,681.00	0.00
282	300390	天华新能	1,450	27,651.50	0.00
283	000155	川能动力	2,700	26,514.00	0.00
284	600606	绿地控股	16,000	26,080.00	0.00
285	688578	艾力斯	250	23,260.00	0.00
286	000403	派林生物	1,235	22,390.55	0.00
287	688295	中复神鹰	1,000	20,800.00	0.00
288	000034	神州数码	550	20,702.00	0.00
289	601615	明阳智能	1,800	20,682.00	0.00
290	300339	润和软件	400	20,332.00	0.00
291	300487	蓝晓科技	400	20,120.00	0.00
292	002085	万丰奥威	1,250	19,862.50	0.00
293	688521	芯原股份	200	19,300.00	0.00
294	600032	浙江新能	2,550	19,278.00	0.00
295	301301	川宁生物	1,600	19,264.00	0.00
296	600516	方大炭素	4,100	19,024.00	0.00
297	002261	拓维信息	600	18,570.00	0.00
298	002472	双环传动	550	18,419.50	0.00
299	688301	奕瑞科技	210	18,398.10	0.00
300	600872	中炬高新	950	18,050.00	0.00
301	001286	陕西能源	2,050	17,835.00	0.00
302	600155	华创云信	2,550	17,748.00	0.00
303	002608	江苏国信	2,400	17,592.00	0.00
304	601139	深圳燃气	2,750	17,490.00	0.00
305	002563	森马服饰	3,250	17,095.00	0.00
306	688281	华秦科技	280	16,942.80	0.00
307	600764	中国海防	450	15,300.00	0.00
308	000027	深圳能源	2,300	14,674.00	0.00

309	600007	中国国贸	700	14,406.00	0.00
310	600004	白云机场	1,500	13,650.00	0.00
311	000750	国海证券	3,150	12,978.00	0.00
312	688361	中科飞测	150	12,628.50	0.00
313	603605	珀莱雅	150	12,418.50	0.00
314	600688	上海石化	4,350	12,397.50	0.00
315	601001	晋控煤业	1,000	12,220.00	0.00
316	688469	芯联集成	2,550	12,163.50	0.00
317	000967	盈峰环境	1,750	12,162.50	0.00
318	000739	普洛药业	850	11,900.00	0.00
319	600720	中交设计	1,500	11,595.00	0.00
320	600369	西南证券	2,650	11,527.50	0.00
321	002372	伟星新材	1,100	11,396.00	0.00
322	601106	中国一重	3,750	10,500.00	0.00
323	603556	海兴电力	350	8,914.50	0.00
324	002064	华峰化学	1,300	8,593.00	0.00
325	300285	国瓷材料	450	7,807.50	0.00
326	002203	海亮股份	750	7,740.00	0.00
327	002430	杭氧股份	350	6,797.00	0.00
328	000021	深科技	350	6,559.00	0.00
329	002831	裕同科技	250	5,855.00	0.00
330	601608	中信重工	1,250	5,462.50	0.00
331	688387	信科移动	918	5,186.70	0.00
332	300146	汤臣倍健	450	5,058.00	0.00
333	688385	复旦微电	100	4,927.00	0.00
334	002423	中粮资本	400	4,892.00	0.00
335	600859	王府井	350	4,861.50	0.00
336	600737	中粮糖业	500	4,725.00	0.00
337	601611	中国核建	500	4,595.00	0.00
338	000887	中鼎股份	250	4,397.50	0.00
339	000738	航发控制	150	3,112.50	0.00
340	688153	唯捷创芯	100	3,101.00	0.00
341	000921	海信家电	100	2,570.00	0.00
342	002945	华林证券	150	2,155.50	0.00
343	601016	节能风电	700	2,023.00	0.00
344	002508	老板电器	100	1,901.00	0.00
345	000629	钒钛股份	350	896.00	0.00

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	603259	药明康德	37,562	2,612,437.10	0.36
2	002209	达意隆	208,000	2,610,400.00	0.36
3	601567	三星医疗	104,100	2,333,922.00	0.32
4	688256	寒武纪	3,769	2,267,053.50	0.31
5	002268	电科网安	106,509	1,948,049.61	0.27
6	601218	吉鑫科技	465,500	1,913,205.00	0.26
7	601318	中国平安	34,436	1,910,509.28	0.26
8	002373	千方科技	204,069	1,897,841.70	0.26
9	601919	中远海控	124,537	1,873,036.48	0.26
10	002407	多氟多	150,925	1,839,775.75	0.25
11	002769	普路通	189,200	1,831,456.00	0.25
12	600755	厦门国贸	291,760	1,765,148.00	0.24
13	688508	芯朋微	30,923	1,726,121.86	0.24
14	002648	卫星化学	96,773	1,677,076.09	0.23
15	300279	和晶科技	241,671	1,674,780.03	0.23
16	301270	汉仪股份	35,000	1,668,100.00	0.23
17	300236	上海新阳	42,700	1,656,760.00	0.23
18	002054	德美化工	240,600	1,655,328.00	0.23
19	000333	美的集团	22,800	1,646,160.00	0.23
20	300519	新光药业	110,700	1,642,788.00	0.23
21	300018	中元股份	206,100	1,638,495.00	0.23
22	301170	锡南科技	61,100	1,635,647.00	0.23
23	600941	中国移动	14,500	1,631,975.00	0.23
24	002999	天禾股份	233,800	1,631,924.00	0.23
25	000551	创元科技	126,900	1,630,665.00	0.23
26	300666	江丰电子	22,000	1,630,200.00	0.23
27	603073	彩蝶实业	96,700	1,629,395.00	0.23
28	301337	亚华电子	55,700	1,626,997.00	0.23
29	000725	京东方 A	407,500	1,625,925.00	0.22
30	000514	渝开发	358,800	1,625,364.00	0.22
31	688981	中芯国际	18,395	1,621,887.15	0.22
32	002188	中天服务	291,700	1,621,852.00	0.22
33	688388	嘉元科技	80,702	1,620,496.16	0.22
34	002947	恒铭达	48,800	1,619,672.00	0.22
35	301503	智迪科技	42,500	1,617,125.00	0.22
36	601668	中国建筑	280,100	1,616,177.00	0.22
37	000001	平安银行	133,700	1,613,759.00	0.22
38	000651	格力电器	35,900	1,612,628.00	0.22
39	000751	锌业股份	513,300	1,611,762.00	0.22
40	601857	中国石油	188,300	1,609,965.00	0.22
41	600219	南山铝业	420,254	1,609,572.82	0.22
42	002578	闽发铝业	477,000	1,597,950.00	0.22
43	002487	大金重工	47,937	1,577,127.30	0.22

44	601003	柳钢股份	440,100	1,549,152.00	0.21
45	000401	冀东水泥	337,900	1,480,002.00	0.20
46	601398	工商银行	186,777	1,417,637.43	0.20
47	600491	龙元建设	373,700	1,375,216.00	0.19
48	600179	安通控股	493,900	1,363,164.00	0.19
49	002686	亿利达	207,800	1,352,778.00	0.19
50	002368	太极股份	54,800	1,283,416.00	0.18
51	601766	中国中车	165,815	1,167,337.60	0.16
52	601988	中国银行	179,600	1,009,352.00	0.14
53	600519	贵州茅台	708	997,940.16	0.14
54	688328	深科达	44,029	997,256.85	0.14
55	603444	吉比特	3,205	967,749.75	0.13
56	000757	浩物股份	200,100	906,453.00	0.13
57	002546	新联电子	164,400	902,556.00	0.12
58	000425	徐工机械	110,700	860,139.00	0.12
59	688768	容知日新	17,617	782,018.63	0.11
60	002933	新兴装备	21,500	767,980.00	0.11
61	300274	阳光电源	10,739	727,782.03	0.10
62	000977	浪潮信息	14,200	722,496.00	0.10
63	000157	中联重科	96,400	696,972.00	0.10
64	300100	双林股份	14,273	671,972.84	0.09
65	300990	同飞股份	13,127	655,037.30	0.09
66	300014	亿纬锂能	14,100	645,921.00	0.09
67	300749	顶固集创	76,400	642,524.00	0.09
68	688012	中微公司	3,456	630,028.80	0.09
69	301061	匠心家居	8,065	625,360.10	0.09
70	300234	开尔新材	125,800	625,226.00	0.09
71	001203	大中矿业	66,140	625,023.00	0.09
72	301031	中熔电气	7,805	621,668.25	0.09
73	688272	富吉瑞	22,842	617,876.10	0.09
74	688343	云天励飞	12,407	613,153.94	0.08
75	603799	华友钴业	16,555	612,866.10	0.08
76	603173	福斯达	17,026	605,274.30	0.08
77	603811	诚意药业	65,500	604,565.00	0.08
78	605016	百龙创园	29,248	603,386.24	0.08
79	300972	万辰集团	3,325	599,298.00	0.08
80	600660	福耀玻璃	10,500	598,605.00	0.08
81	601211	国泰海通	31,140	596,642.40	0.08
82	688313	仕佳光子	15,641	595,140.05	0.08
83	003006	百亚股份	21,640	592,503.20	0.08
84	603166	福达股份	37,972	587,426.84	0.08
85	688314	康拓医疗	19,019	587,306.72	0.08
86	300850	新强联	16,310	584,224.20	0.08

87	002963	豪尔赛	45,700	579,933.00	0.08
88	600186	莲花控股	96,456	578,736.00	0.08
89	603766	隆鑫通用	44,949	573,549.24	0.08
90	600389	江山股份	30,760	572,136.00	0.08
91	601083	锦江航运	50,565	561,777.15	0.08
92	002597	金禾实业	23,836	561,337.80	0.08
93	688668	鼎通科技	8,976	560,640.96	0.08
94	688696	极米科技	4,888	558,991.68	0.08
95	300824	北鼎股份	46,754	557,775.22	0.08
96	000975	山金国际	28,281	535,642.14	0.07
97	688536	思瑞浦	3,582	496,895.04	0.07
98	002661	克明食品	48,600	486,486.00	0.07
99	002734	利民股份	26,096	477,556.80	0.07
100	300912	凯龙高科	31,800	467,142.00	0.06
101	000100	TCL 科技	96,200	416,546.00	0.06
102	000637	茂化实华	96,200	411,736.00	0.06
103	300866	安克创新	3,318	376,924.80	0.05
104	002128	电投能源	18,909	374,020.02	0.05
105	600338	西藏珠峰	33,233	368,553.97	0.05
106	601319	中国人保	41,400	360,594.00	0.05
107	000538	云南白药	6,200	345,898.00	0.05
108	300612	宣亚国际	20,900	315,590.00	0.04
109	002690	美亚光电	18,159	306,342.33	0.04
110	603236	移远通信	3,500	300,300.00	0.04
111	601011	宝泰隆	108,500	291,865.00	0.04
112	600036	招商银行	6,041	277,583.95	0.04
113	600900	长江电力	9,000	271,260.00	0.04
114	301018	申菱环境	6,900	261,786.00	0.04
115	688545	兴福电子	7,897	214,756.99	0.03
116	600983	惠而浦	19,383	201,195.54	0.03
117	600981	汇鸿集团	51,800	147,112.00	0.02
118	300750	宁德时代	469	118,291.18	0.02
119	688041	海光信息	836	118,118.44	0.02
120	301626	苏州天脉	957	100,867.80	0.01
121	688231	隆达股份	4,668	84,257.40	0.01
122	688775	影石创新	564	70,026.24	0.01
123	688615	合合信息	405	63,953.55	0.01
124	601288	农业银行	10,800	63,504.00	0.01
125	688449	联芸科技	1,406	58,236.52	0.01
126	302132	中航成飞	550	48,367.00	0.01
127	688411	海博思创	560	46,754.40	0.01
128	688605	先锋精科	744	46,611.60	0.01
129	600104	上汽集团	2,900	46,545.00	0.01

130	600315	上海家化	2,200	46,354.00	0.01
131	000818	航锦科技	2,050	46,125.00	0.01
132	603072	天和磁材	826	45,227.70	0.01
133	301611	珂玛科技	804	44,228.04	0.01
134	600418	江淮汽车	1,100	44,099.00	0.01
135	688708	佳驰科技	780	43,126.20	0.01
136	600377	宁沪高速	2,750	42,185.00	0.01
137	600066	宇通客车	1,600	39,776.00	0.01
138	300394	天孚通信	490	39,121.60	0.01
139	002019	亿帆医药	2,950	38,320.50	0.01
140	688567	孚能科技	2,600	37,700.00	0.01
141	000630	铜陵有色	11,200	37,408.00	0.01
142	688005	容百科技	1,639	36,582.48	0.01
143	603456	九洲药业	2,400	36,504.00	0.01
144	002028	思源电气	500	36,455.00	0.01
145	688750	金天钛业	1,685	36,193.80	0.01
146	603882	金域医学	1,150	32,844.00	0.00
147	002240	盛新锂能	2,500	32,200.00	0.00
148	600129	太极集团	1,500	31,965.00	0.00
149	301551	无线传媒	652	31,778.48	0.00
150	002408	齐翔腾达	7,050	31,584.00	0.00
151	001391	国货航	4,686	31,536.78	0.00
152	603185	弘元绿能	2,100	31,185.00	0.00
153	301522	上大股份	816	29,057.76	0.00
154	601992	金隅集团	18,950	28,804.00	0.00
155	301622	英思特	306	26,695.44	0.00
156	688516	奥特维	800	26,592.00	0.00
157	300118	东方日升	2,750	26,345.00	0.00
158	688276	百克生物	1,250	26,250.00	0.00
159	600416	湘电股份	1,750	23,520.00	0.00
160	301556	托普云农	267	23,060.79	0.00
161	301613	新铝时代	414	22,066.20	0.00
162	002867	周大生	1,650	21,747.00	0.00
163	000998	隆平高科	2,100	20,685.00	0.00
164	301606	绿联科技	396	20,366.28	0.00
165	603937	丽岛新材	1,900	18,582.00	0.00
166	301571	国科天成	350	18,161.50	0.00
167	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
168	301631	壹连科技	214	17,676.40	0.00
169	001227	兰州银行	6,900	17,250.00	0.00
170	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
171	301608	博实结	184	16,390.72	0.00
172	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00

173	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
174	301607	富特科技	360	14,371.20	0.00
175	603051	鹿山新材	500	14,240.00	0.00
176	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
177	000778	新兴铸管	3,760	13,987.20	0.00
178	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
179	603883	老百姓	650	13,656.50	0.00
180	603049	中策橡胶	317	13,583.45	0.00
181	301617	博苑股份	329	13,505.45	0.00
182	002557	洽洽食品	600	12,972.00	0.00
183	688721	龙图光罩	279	12,582.90	0.00
184	301586	佳力奇	215	12,255.00	0.00
185	603113	金能科技	1,760	12,196.80	0.00
186	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
187	301580	爱迪特	283	11,724.69	0.00
188	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
189	301585	蓝宇股份	273	9,363.90	0.00
190	301552	科力装备	200	7,752.00	0.00
191	603395	红四方	200	6,746.00	0.00
192	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
193	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
194	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
195	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
196	603205	健尔康	128	4,944.64	0.00
197	603310	巍华新材	254	4,861.56	0.00
198	603381	永臻股份	178	3,985.42	0.00
199	603391	力聚热能	100	3,906.00	0.00
200	603350	安乃达	106	3,713.18	0.00
201	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
202	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
203	603285	键邦股份	129	3,044.40	0.00
204	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
205	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
206	600500	中化国际	500	1,915.00	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	300207	欣旺达	42,463,714.95	5.83
2	002532	天山铝业	33,873,345.00	4.65

3	600096	云天化	30,212,698.00	4.15
4	000060	中金岭南	29,924,293.00	4.11
5	000039	中集集团	27,737,613.20	3.81
6	600959	江苏有线	26,339,591.00	3.62
7	601168	西部矿业	26,194,639.55	3.60
8	300001	特锐德	26,147,293.15	3.59
9	688777	中控技术	25,809,164.19	3.54
10	002244	滨江集团	25,470,133.00	3.50
11	603379	三美股份	24,600,901.00	3.38
12	600685	中船防务	24,524,617.00	3.37
13	002821	凯莱英	24,442,334.79	3.36
14	002128	电投能源	24,267,659.69	3.33
15	603129	春风动力	23,098,138.59	3.17
16	600582	天地科技	23,080,598.00	3.17
17	002138	顺络电子	23,000,652.00	3.16
18	600704	物产中大	22,643,506.00	3.11
19	600352	浙江龙盛	22,555,373.00	3.10
20	600487	亨通光电	22,521,237.77	3.09
21	301358	湖南裕能	22,093,398.00	3.03
22	002056	横店东磁	22,084,675.00	3.03
23	002683	广东宏大	21,975,268.94	3.02
24	000893	亚钾国际	21,947,014.00	3.01
25	600998	九州通	21,937,416.79	3.01
26	000987	越秀资本	21,745,763.92	2.99
27	003022	联泓新科	21,661,714.50	2.97
28	000738	航发控制	21,632,309.00	2.97
29	601717	郑煤机	21,390,662.00	2.94
30	600535	天士力	21,283,718.99	2.92
31	600663	陆家嘴	20,926,817.44	2.87
32	002185	华天科技	20,837,176.00	2.86
33	603444	吉比特	20,654,264.00	2.84
34	002299	圣农发展	20,573,677.00	2.82
35	600295	鄂尔多斯	20,453,041.12	2.81
36	600299	安迪苏	20,418,337.00	2.80
37	002625	光启技术	20,403,177.00	2.80
38	601997	贵阳银行	20,319,608.00	2.79
39	600867	通化东宝	20,304,294.25	2.79
40	600583	海油工程	20,266,497.00	2.78
41	600655	豫园股份	20,101,350.00	2.76
42	000623	吉林敖东	20,009,176.98	2.75
43	600873	梅花生物	19,915,654.00	2.73
44	000709	河钢股份	19,620,187.00	2.69
45	000021	深科技	19,562,608.00	2.69

46	600177	雅戈尔	19,489,260.72	2.68
47	300136	信维通信	19,447,650.97	2.67
48	002432	九安医疗	19,373,699.85	2.66
49	688122	西部超导	19,262,690.16	2.64
50	002926	华西证券	19,178,574.00	2.63
51	600699	均胜电子	19,108,559.00	2.62
52	601966	玲珑轮胎	19,104,879.00	2.62
53	300866	安克创新	18,965,676.40	2.60
54	000728	国元证券	18,859,528.30	2.59
55	603927	中科软	18,844,025.00	2.59
56	600062	华润双鹤	18,795,858.67	2.58
57	000733	振华科技	18,787,286.00	2.58
58	600637	东方明珠	18,769,449.74	2.58
59	002373	千方科技	18,653,450.00	2.56
60	600988	赤峰黄金	18,554,618.00	2.55
61	300699	光威复材	18,550,904.80	2.55
62	600517	国网英大	18,471,258.00	2.54
63	000050	深天马 A	18,369,028.00	2.52
64	688772	珠海冠宇	18,356,915.03	2.52
65	002268	电科网安	18,181,480.00	2.50
66	000598	兴蓉环境	18,136,991.20	2.49
67	600765	中航重机	17,981,628.00	2.47
68	601965	中国汽研	17,909,612.00	2.46
69	600546	山煤国际	17,816,170.00	2.45
70	600739	辽宁成大	17,790,070.00	2.44
71	002152	广电运通	17,737,800.00	2.43
72	000636	风华高科	17,650,563.00	2.42
73	600499	科达制造	17,643,309.00	2.42
74	300373	扬杰科技	17,540,169.00	2.41
75	600578	京能电力	17,532,318.00	2.41
76	600329	达仁堂	17,516,121.98	2.40
77	001203	大中矿业	17,481,868.00	2.40
78	002120	韵达股份	17,436,894.68	2.39
79	002831	裕同科技	17,374,669.17	2.39
80	002429	兆驰股份	17,293,521.00	2.37
81	002410	广联达	17,270,317.00	2.37
82	000513	丽珠集团	17,264,793.00	2.37
83	600380	健康元	17,128,944.00	2.35
84	601568	北元集团	17,114,915.00	2.35
85	600038	中直股份	17,080,897.00	2.34
86	601958	金铂股份	17,008,906.00	2.33
87	600312	平高电气	16,949,733.61	2.33
88	300751	迈为股份	16,917,299.41	2.32

89	002409	雅克科技	16,767,666.00	2.30
90	300140	节能环保	16,513,609.45	2.27
91	002939	长城证券	16,376,412.00	2.25
92	000423	东阿阿胶	16,329,881.00	2.24
93	002080	中材科技	16,286,204.00	2.24
94	603233	大参林	16,168,093.49	2.22
95	601179	中国西电	16,136,983.00	2.22
96	002368	太极股份	16,103,017.73	2.21
97	002517	恺英网络	15,885,718.50	2.18
98	600153	建发股份	15,874,809.00	2.18
99	002273	水晶光电	15,842,126.60	2.17
100	601918	新集能源	15,825,624.00	2.17
101	000878	云南铜业	15,812,158.00	2.17
102	688188	柏楚电子	15,754,636.95	2.16
103	002500	山西证券	15,696,539.35	2.15
104	301236	软通动力	15,634,142.10	2.15
105	002673	西部证券	15,607,844.00	2.14
106	002572	索菲亚	15,554,499.00	2.14
107	002850	科达利	15,535,675.00	2.13
108	601598	中国外运	15,495,011.53	2.13
109	600298	安琪酵母	15,271,292.00	2.10
110	000988	华工科技	15,257,879.00	2.09
111	600060	海信视像	15,147,154.00	2.08
112	600143	金发科技	14,928,106.00	2.05
113	600879	航天电子	14,914,553.00	2.05
114	603596	伯特利	14,892,907.00	2.04
115	002202	金风科技	14,862,303.00	2.04
116	688099	晶晨股份	14,804,463.62	2.03
117	000750	国海证券	14,536,523.00	2.00

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	002532	天山铝业	42,203,158.30	5.79
2	300207	欣旺达	36,786,976.34	5.05
3	002128	电投能源	34,891,345.92	4.79
4	600873	梅花生物	30,081,396.16	4.13
5	600096	云天化	29,837,380.17	4.10
6	600352	浙江龙盛	29,776,297.85	4.09

7	600582	天地科技	29,066,977.92	3.99
8	601717	郑煤机	28,797,581.51	3.95
9	000623	吉林敖东	28,739,559.94	3.95
10	600704	物产中大	27,910,237.21	3.83
11	600583	海油工程	27,525,229.15	3.78
12	601598	中国外运	26,121,597.67	3.59
13	601168	西部矿业	25,799,928.51	3.54
14	002683	广东宏大	25,762,407.50	3.54
15	000060	中金岭南	25,247,035.34	3.47
16	002203	海亮股份	25,006,266.94	3.43
17	002368	太极股份	24,714,054.00	3.39
18	000598	兴蓉环境	24,706,917.00	3.39
19	000738	航发控制	24,597,651.76	3.38
20	600563	法拉电子	24,179,210.70	3.32
21	002138	顺络电子	23,805,415.40	3.27
22	002517	恺英网络	23,787,585.02	3.27
23	600098	广州发展	23,722,625.16	3.26
24	600487	亨通光电	23,586,441.04	3.24
25	600663	陆家嘴	23,430,439.85	3.22
26	600153	建发股份	23,162,118.87	3.18
27	600295	鄂尔多斯	22,849,752.71	3.14
28	002244	滨江集团	22,438,191.05	3.08
29	603129	春风动力	22,432,278.31	3.08
30	688777	中控技术	22,318,553.37	3.06
31	601577	长沙银行	22,085,831.17	3.03
32	600642	申能股份	22,063,071.63	3.03
33	600959	江苏有线	21,932,594.96	3.01
34	002926	华西证券	21,926,790.38	3.01
35	601666	平煤股份	21,762,526.89	2.99
36	600535	天士力	21,640,272.27	2.97
37	300001	特锐德	21,555,917.82	2.96
38	002966	苏州银行	21,507,266.50	2.95
39	300866	安克创新	21,495,732.72	2.95
40	000039	中集集团	21,121,176.02	2.90
41	000021	深科技	20,910,078.37	2.87
42	603379	三美股份	20,881,583.84	2.87
43	000987	越秀资本	20,866,954.21	2.86
44	301358	湖南裕能	20,848,857.58	2.86
45	002625	光启技术	20,665,344.87	2.84
46	601966	玲珑轮胎	20,571,592.84	2.82
47	002500	山西证券	20,544,614.19	2.82
48	603444	吉比特	20,543,946.85	2.82
49	000729	燕京啤酒	20,433,548.91	2.80

50	600655	豫园股份	20,324,506.27	2.79
51	002056	横店东磁	20,289,344.59	2.79
52	603338	浙江鼎力	20,204,987.66	2.77
53	000967	盈峰环境	20,013,160.32	2.75
54	300136	信维通信	19,871,075.00	2.73
55	603568	伟明环保	19,622,495.01	2.69
56	601997	贵阳银行	19,533,857.20	2.68
57	000423	东阿阿胶	19,533,491.13	2.68
58	002185	华天科技	19,428,442.50	2.67
59	600685	中船防务	19,376,607.15	2.66
60	600177	雅戈尔	19,359,318.00	2.66
61	000733	振华科技	19,126,999.76	2.63
62	600820	隧道股份	19,106,863.38	2.62
63	600282	南钢股份	19,038,153.18	2.61
64	002831	裕同科技	18,986,640.10	2.61
65	600879	航天电子	18,935,424.90	2.60
66	000513	丽珠集团	18,790,164.28	2.58
67	300002	神州泰岳	18,738,786.48	2.57
68	600988	赤峰黄金	18,714,917.64	2.57
69	600637	东方明珠	18,676,275.59	2.56
70	002299	圣农发展	18,493,511.78	2.54
71	600699	均胜电子	18,483,091.41	2.54
72	002821	凯莱英	18,353,154.93	2.52
73	300699	光威复材	18,335,886.40	2.52
74	002152	广电运通	18,310,450.00	2.51
75	600517	国网英大	18,117,399.80	2.49
76	002432	九安医疗	18,065,946.90	2.48
77	600998	九州通	17,813,699.01	2.45
78	601965	中国汽研	17,762,282.91	2.44
79	000728	国元证券	17,644,970.12	2.42
80	600131	国网信通	17,617,187.02	2.42
81	002410	广联达	17,525,547.27	2.41
82	600765	中航重机	17,439,909.19	2.39
83	003022	联泓新科	17,435,893.50	2.39
84	002608	江苏国信	17,432,904.79	2.39
85	002429	兆驰股份	17,366,330.22	2.38
86	600546	山煤国际	17,293,003.37	2.37
87	002273	水晶光电	17,257,272.58	2.37
88	600380	健康元	17,219,553.05	2.36
89	600329	达仁堂	17,179,107.76	2.36
90	300751	迈为股份	17,163,730.20	2.36
91	600299	安迪苏	17,155,962.27	2.36
92	002120	韵达股份	17,140,915.58	2.35

93	001203	大中矿业	17,049,293.42	2.34
94	600312	平高电气	16,851,198.31	2.31
95	600208	衢州发展	16,827,530.35	2.31
96	002078	太阳纸业	16,814,404.45	2.31
97	002508	老板电器	16,684,504.52	2.29
98	601568	北元集团	16,631,703.96	2.28
99	600867	通化东宝	16,554,340.00	2.27
100	600499	科达制造	16,432,869.83	2.26
101	603927	中科软	16,335,512.45	2.24
102	000878	云南铜业	16,044,685.69	2.20
103	002373	千方科技	15,871,610.04	2.18
104	688772	珠海冠宇	15,849,324.05	2.18
105	000709	河钢股份	15,806,696.47	2.17
106	002268	电科网安	15,751,105.01	2.16
107	601958	金钼股份	15,744,789.65	2.16
108	688122	西部超导	15,610,952.31	2.14
109	601179	中国西电	15,549,167.67	2.13
110	300373	扬杰科技	15,463,974.58	2.12
111	301236	软通动力	15,242,988.00	2.09
112	603596	伯特利	15,135,481.68	2.08
113	601918	新集能源	14,938,687.38	2.05
114	002572	索菲亚	14,832,739.68	2.04
115	002202	金风科技	14,832,103.12	2.04
116	601098	中南传媒	14,820,483.82	2.03
117	600901	江苏金租	14,804,146.80	2.03
118	600060	海信视像	14,778,173.06	2.03
119	000750	国海证券	14,728,016.24	2.02
120	000050	深天马 A	14,704,285.84	2.02
121	600578	京能电力	14,657,600.82	2.01
122	603298	杭叉集团	14,625,481.54	2.01
123	600062	华润双鹤	14,547,131.63	2.00

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	4,920,335,751.64
卖出股票收入（成交）总额	4,953,371,672.73

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）	9,000.59	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,000.59	0.00

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	123257	安克转债	90	9,000.59	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

无。

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

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

多头套期保值策略

本基金为指数增强基金，当指数期货大幅贴水时，可采用多头套期保值策略，即卖出部分股票持仓并买入指数期货的期货替代现货策略。持有至基差收敛，赚取期货与现货指数的价差，增强指数。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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。

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	321,811.65
2	应收清算款	13,129,814.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	103,119.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,554,746.14

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 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 报告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

无。

§ 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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
南方中证 500 量化增强股票发起 A	25,278	23,287.71	224,536,473.02	38.14%	364,130,177.16	61.86%
南方中证 500 量化增强股票发起 C	6,798	13,497.89	59,195.38	0.06%	91,699,489.06	99.94%
合计	32,076	21,212.91	224,595,668.40	33.01%	455,829,666.22	66.99%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方中证 500 量化增强股票发起 A	437,627.20	0.0743%
	南方中证 500 量化增强股票发起 C	23,252.94	0.0253%

	合计	460,880.14	0.0677%
--	----	------------	---------

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

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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	南方中证 500 量化增强股票发起 A	10~50
	南方中证 500 量化增强股票发起 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	南方中证 500 量化增强股票发起 A	0
	南方中证 500 量化增强股票发起 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	9,900,000.00	1.45	自合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	435,847.29	0.06	-	-	-
基金经理等人员	-	-	100,000.00	0.01	自合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	435,847.29	0.06	10,000,000.00	1.47	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方中证 500 量 化增强股票发起 A	南方中证 500 量 化增强股票发 起 C
基金合同生效日(2016 年 11 月 23 日)基金份额总额	25,994,568.76	56,694,573.52
本报告期期初基金份额总额	615,913,249.69	101,021,490.43
本报告期基金总申购份额	22,144,460.70	11,075,863.83
减：本报告期基金总赎回份额	49,391,060.21	20,338,669.82
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	588,666,650.18	91,758,684.44

§ 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。

2025 年 1 月，中国光大银行股份有限公司聘任贾光华先生担任资产托管部总经理职务。

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。

本报告期内无涉及本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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
招商证券	1	3,409,612,406.33	34.54%	340,627.37	34.54%	-
中信建投	2	2,932,676,471.09	29.71%	292,956.09	29.70%	-
华泰证券	1	1,924,015,497.85	19.49%	192,214.80	19.49%	-
国盛证券	1	1,043,475,810.98	10.57%	104,251.46	10.57%	-
长江证券	1	562,636,993.67	5.70%	56,194.89	5.70%	-
国联证券	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交易单元租用协议后将其入库，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：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

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	南方基金关于直销平台相关业务费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-01
2	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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-19
3	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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-20
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(2024 年度)	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-05-14

§ 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	20250101-20250630	185,612,480.92	-	-	185,612,480.92	27.28%
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南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金 2025 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>