

深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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

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

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

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

目录

§ 1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§ 4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	13
§ 5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§ 6 审计报告.....	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§ 7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 净资产变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
§ 8 投资组合报告.....	48
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	64
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	64
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	64
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	64
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
8.12 投资组合报告附注.....	64
§ 9 基金份额持有人信息.....	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	66
§ 10 开放式基金份额变动.....	66
§ 11 重大事件揭示.....	67
11.1 基金份额持有人大会决议.....	67
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
11.4 基金投资策略的改变.....	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
11.8 其他重大事件.....	70
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
§ 13 备查文件目录.....	72
13.1 备查文件目录.....	72
13.2 存放地点.....	72
13.3 查阅方式.....	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方深证成份 ETF
场内简称	深成 ETF 南方
基金主代码	159903
交易代码	159903
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 4 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	304,154,507.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 2 月 2 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	<p>本基金为完全被动式指数基金，原则上采用完全复制法，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。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> <p>存托凭证的投资策略：本基金将根据法律法规和监管机构的要求，制定存托凭证投资策略，关注发行人有关信息披露情况，关注发行人基本面情况、市场估值等因素，通过定性分析和定量分析相结合的办法，参与存托凭证的投资，谨慎决定存托凭证的权重配置和标的选择。</p>
业绩比较基准	深证成份指数
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。本基金为指数型基金，主要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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革
	联系电话	0755-82763888
		郭明
		(010) 66105799

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	95,839,705.42	6,792,331.68	-11,141,197.86
本期利润	147,065,475.03	80,685,392.01	-37,566,107.75
加权平均基金份额本期利润	0.3895	0.2115	-0.1696
本期加权平均净值利润率	28.68%	18.79%	-13.48%
本期基金份额净值增长率	31.42%	10.94%	-12.83%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	86,588,176.93	-48,446,297.01	-68,729,518.90
期末可供分配基金份额利润	0.2846	-0.1074	-0.2305
期末基金资产净值	498,798,644.42	562,988,371.92	335,349,348.61
期末基金份额净值	1.6400	1.2479	1.1248
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	21.01%	-7.92%	-17.00%

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

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

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

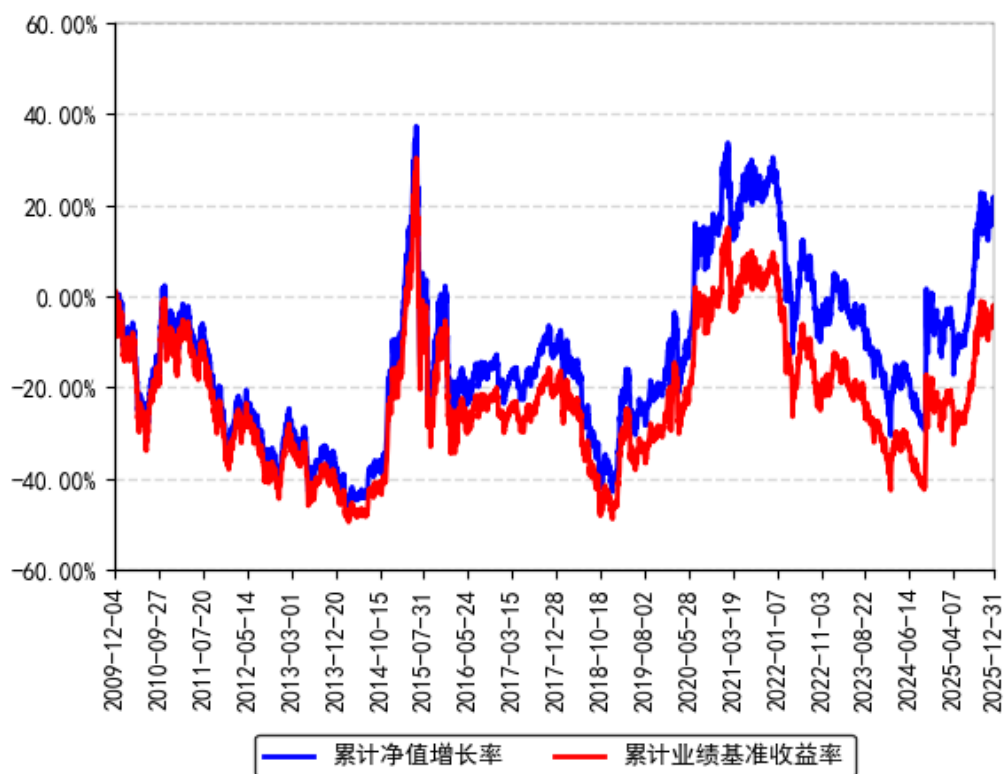
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.05%	1.32%	-0.01%	1.32%	0.06%	0.00%
过去六个月	29.72%	1.27%	29.24%	1.27%	0.48%	0.00%
过去一年	31.42%	1.33%	29.87%	1.33%	1.55%	0.00%
过去三年	27.09%	1.41%	22.78%	1.41%	4.31%	0.00%
过去五年	0.03%	1.39%	-6.54%	1.39%	6.57%	0.00%
自基金合同生效起至今	21.01%	1.54%	-2.59%	1.55%	23.60%	-0.01%

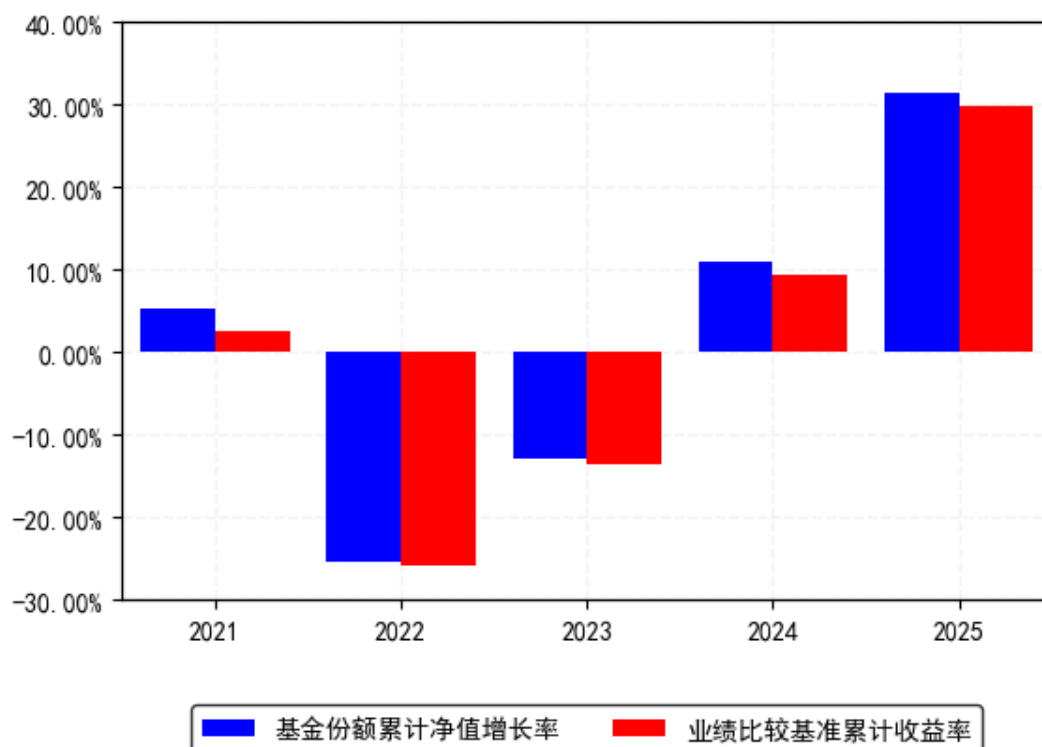
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方深证成份ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

南方深证成份ETF每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙伟	本基金基金经理	2016 年 8 月 19 日	-	15 年	中国国籍，北京大学工商管理硕士，注册会计师（CPA），具有基金从业资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010 年 2 月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员、基金经理助理；2015 年 5 月 22 日至 2016 年 7 月 29 日，任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 7 月 2 日至 2020 年 12 月 1 日，任改革基金、高铁基金基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 7 日，任南方中证 500 工业 ETF 基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 14 日，任南方中证 500 原材料 ETF 基金经理；2020 年 12 月 1 日至 2021 年 4 月 19 日，任改革基金基金经理；2015 年 7 月 10 日至今，任 500 信息基金经理；2016 年 5 月 13 日至今，任南方创业板 ETF 基金经理 2016 年 5 月 20 日至今，任南方创业板 ETF 联接基金经

				<p>理；2016 年 8 月 17 日至今，任 500 信息联接基金经理；2016 年 8 月 19 日至今，任深成 ETF、南方深成基金经理；2017 年 3 月 8 日至今，任南方全指证券 ETF 联接基金经理；2017 年 3 月 10 日至今，任南方中证全指证券 ETF 基金经理；2017 年 6 月 28 日至今，任南方中证银行 ETF 基金经理；2017 年 6 月 29 日至今，任南方银行联接基金经理；2018 年 2 月 8 日至今，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至今，任南方 H 股联接基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任南方上证 380ETF、南方上证 380ETF 联接基金经理；2020 年 12 月 1 日至今，任高铁基金基金经理；2022 年 3 月 3 日至今，任南方上海金 ETF 基金经理；2023 年 7 月 25 日至今，任南方上海金 ETF 发起联接基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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

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

4.1.3 基金经理薪酬机制

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、

基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025年全年，深证成指累计上涨29.87%，从驱动逻辑看，指数全年受益于科技与消费板块的协同拉动：科技赛道依托AI应用落地、先进制造全球竞争力提升贡献高弹性，消费板块伴随内需复苏释放稳健增长动能，二者共同支撑指数突破关键点位。本基金作为跟踪深证成指的指数工具，全年紧密锚定标的指数，在市场结构行情中保持跟踪的精准性。

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ETF基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

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

(2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离；

(3) 根据指数成份股调整进行的基金调仓，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，将跟踪误差控制在理想范围内；

(4) 新股上市初期涨幅较大的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.6400 元，报告期内，份额净值增长率为 31.42%，同期业绩基准增长率为 29.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，深证成指覆盖的核心板块仍具备较强的增长动力：消费板块将受益于内需持续复苏，基建板块依托稳增长政策延续景气，先进制造赛道则将凭借技术优势与全球竞争力实现高成长。深证成指作为覆盖大盘蓝筹与优质成长的宽基指数，其配置价值将持续凸显。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、自律规则、监管要求和业务发展情况，严格遵守包括《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》在内的公募基金行业各项法律法规及其他规范要求，有效落实了 2025 年度发布的《推动公募基金高质量发展行动方案》《基金经营机构及其工作人员廉洁从业实施细则》和《公开募集证券投资基金管理人参与上市公司治理管理规则》等公募基金相关新法律法规。

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

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

在进一步优化制度体系的基础上，坚持“看不清管不住则不展业”原则，切实推动“合规创造价值”理念走深走实，强化新规及监管政策的内化落实，推进落实全面风险管

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2025 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(26)第 P00626 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
--------	------

审计报告收件人	深证成份交易型开放式指数证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了深证成份交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则以及中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于深证成份交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>南方基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括深证成份交易型开放式指数证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则以及中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估深证成份交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算深证成份交易型开放式指数证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选</p>

	<p>择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督深证成份交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对深证成份交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致深证成份交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	汪芳 陈思雨
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼
审计报告日期	2026 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	235,438.69	410,033.34
结算备付金		144,410.77	19,393.23
存出保证金		16,157.09	24,342.03
交易性金融资产	7.4.7.2	498,702,418.19	562,924,619.18
其中：股票投资		498,702,418.19	562,924,619.18
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		14,052.30	2,424.45
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		499,112,477.04	563,380,812.23
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		966.15	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		215,310.09	243,196.04
应付托管费		43,062.02	48,639.19
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	54,494.36	100,605.02
负债合计		313,832.62	392,440.31
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	412,210,467.49	611,434,668.93
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	86,588,176.93	-48,446,297.01
净资产合计		498,798,644.42	562,988,371.92
负债和净资产总计		499,112,477.04	563,380,812.23

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.6400 元，基金份额总额 304,154,507.00 份。

7.2 利润表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		150,354,056.97	83,589,342.85
1.利息收入		4,110.75	4,346.42
其中：存款利息收入	7.4.7.9	4,110.75	4,346.42
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		99,066,919.07	8,984,971.67
其中：股票投资收益	7.4.7.10	89,673,002.75	385,149.42
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	71,386.45	15,953.44
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	9,322,529.87	8,583,868.81
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	51,225,769.61	73,893,060.33
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	57,257.54	706,964.43
减：二、营业总支出		3,288,581.94	2,903,950.84
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	2,570,762.68	2,153,229.72
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	514,152.52	430,645.89
3.销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		0.07	0.03
8.其他费用	7.4.7.18	203,666.67	320,075.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		147,065,475.03	80,685,392.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		147,065,475.03	80,685,392.01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		147,065,475.03	80,685,392.01

7.3 净资产变动表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	611,434,668.93	-	-48,446,297.01	562,988,371.92
加：会计政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	611,434,668.93	-	-48,446,297.01	562,988,371.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-199,224,201.44	-	135,034,473.94	-64,189,727.50
（一）、综合收益总额	-	-	147,065,475.03	147,065,475.03
（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）	-199,224,201.44	-	-12,031,001.09	-211,255,202.53
其中：1.基金申购款	463,501,203.05	-	14,086,450.22	477,587,653.27
2.基金赎回款	-662,725,404.49	-	-26,117,451.31	-688,842,855.80
（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	412,210,467.49	-	86,588,176.93	498,798,644.42
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	404,078,867.51	-	-68,729,518.90	335,349,348.61
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	404,078,867.51	-	-68,729,518.90	335,349,348.61
三、本期增减变动额（减少以	207,355,801.42	-	20,283,221.89	227,639,023.31

“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	80,685,392.01	80,685,392.01
(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)	207,355,801.42	-	-60,402,170.12	146,953,631.30
其中: 1.基金申购款	573,277,803.92	-	-106,926,503.71	466,351,300.21
2.基金赎回款	-365,922,002.50	-	46,524,333.59	-319,397,668.91
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	611,434,668.93	-	-48,446,297.01	562,988,371.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

____杨小松____ ____蔡忠评____ ____徐超____
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

深证成份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[2009]1066号《关于核准深证成份交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》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《深证成份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4,127,252,482.00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(2009)第263号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2009年12月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,127,538,537.00份基金份额,其中通过代销机构网上现金及直销机构

网下现金认购部分的认购资金利息折合 286,055.00 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司确定 2010 年 1 月 13 日为本基金的基金份额折算日。当日深证成份指数收盘值为 13,016.557 点，本基金的基金资产净值为 3,964,290,323.04 元，折算前基金份额总额为 4,127,538,537.00 份，折算前基金份额净值为 0.960 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.73786718，折算后基金份额总额为 3,045,554,507.00 份，折算后基金份额净值为 1.302 元。本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司已根据上述折算比例，对所有基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2010 年 1 月 15 日完成了变更登记。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2010]38 号审核同意，本基金于 2010 年 2 月 2 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《深证成份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深证成份指数，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以及存托凭证，该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%；本基金可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为深证成份指数。

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，于 2009 年 12 月 9 日募集成立了南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“南方深成 ETF 联接基金”)。南方深成 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表的编制符合企业会计准则以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但

尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经

调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1)对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3)经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占净资产的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的金额确认，逐日确认债券利息并计入投资收益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息并计入投资收益。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息并记入投资收益。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券投资收益。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

股利收入于除权(息)日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

(3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率在回购期内逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。基金管理人对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；

(2) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

(3) 在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益分配每年最多 12 次，每次基金收益分配比例不低于基金收益分配基准日可供分配利润的 5%。基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

(4) 本基金收益分配采取现金分红方式；

(5) 《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(6) 每一基金份额享有同等分配权；

(7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13 号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13 号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 根据中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)2018年1月1日起，公开募集证券投资基金管理人运营公开募集证券投资基金过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后(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；取得的在2025年8月8日之前已发行的国债、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。

(2)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全

额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，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)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	235,438.69	410,033.34
等于：本金	235,375.57	409,998.20
加：应计利息	63.12	35.14
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	235,438.69	410,033.34

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	413,685,625.54	-	498,702,418.19	85,016,792.65
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	-	-	-	-
交易所市场	-	-	-	-

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		413,685,625.54	-	498,702,418.19	85,016,792.65
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		529,133,596.14	-	562,924,619.18	33,791,023.04
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		529,133,596.14	-	562,924,619.18	33,791,023.04

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	6,494.36	5,741.20
其中：交易所市场	6,494.36	5,741.20

银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应退退补款	-	-
预提费用	48,000.00	50,000.00
应付指数使用费	-	44,597.20
可退替代款	-	266.62
合计	54,494.36	100,605.02

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	451,154,507.00	611,434,668.93
本期申购	342,000,000.00	463,501,203.05
本期赎回（以“-”号填列）	-489,000,000.00	-662,725,404.49
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	304,154,507.00	412,210,467.49

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

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	325,745,429.20	-374,191,726.21	-48,446,297.01
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	325,745,429.20	-374,191,726.21	-48,446,297.01
本期利润	95,839,705.42	51,225,769.61	147,065,475.03
本期基金份额交易产生的变动数	-117,958,937.96	105,927,936.87	-12,031,001.09
其中：基金申购款	280,977,759.20	-266,891,308.98	14,086,450.22
基金赎回款	-398,936,697.16	372,819,245.85	-26,117,451.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	303,626,196.66	-217,038,019.73	86,588,176.93

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	3,861.03	3,343.17

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	199.27	873.32
其他	50.45	129.93
合计	4,110.75	4,346.42

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	700,848.07	-3,975,912.01
股票投资收益——赎回差价收入	88,972,154.68	4,361,061.43
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	89,673,002.75	385,149.42

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	39,621,591.25	36,453,773.58
减：卖出股票成本总额	38,877,992.88	40,391,482.21
减：交易费用	42,750.30	38,203.38
买卖股票差价收入	700,848.07	-3,975,912.01

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	688,842,855.80	319,397,668.91
减：现金支付赎回款总额	38,358.80	33,049.91
减：赎回股票成本总额	599,832,342.32	315,003,557.57
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	88,972,154.68	4,361,061.43

7.4.7.11 基金投资收益

无。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	33.67	7.32
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差 价收入	71,352.78	15,946.12
债券投资收益——赎回差价收 入	-	-
债券投资收益——申购差价收 入	-	-
合计	71,386.45	15,953.44

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出债券(债转股及债券到 期兑付)成交总额	402,703.24	92,159.80
减: 卖出债券(债转股及债 券到期兑付)成本总额	331,300.00	76,200.00
减: 应计利息总额	34.35	9.99
减: 交易费用	16.11	3.69
买卖债券差价收入	71,352.78	15,946.12

注：上述交易费用(如有)包含债券买卖产生的交易费用。

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
----	--	--

股票投资产生的股利收益	9,322,529.87	8,583,868.81
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	9,322,529.87	8,583,868.81

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	51,225,769.61	73,893,060.33
——股票投资	51,225,769.61	73,893,060.33
——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	51,225,769.61	73,893,060.33

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	57,257.54	706,964.43
合计	57,257.54	706,964.43

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

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	48,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-

指数使用费	35,264.67	149,597.20
银行费用	402.00	478.00
合计	203,666.67	320,075.20

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司(“厦门国际信托”)	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司(“深圳投资控股”)	基金管理人的股东
厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
南方资本管理有限公司(“南方资本”)	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司(“南方东英”)	基金管理人的子公司
南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“南方深证成份 ETF 联接”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	-	-	6,242,808.74	5.13%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日
-------	---------------------------	------------------------

	12 月 31 日		至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	-	-	36,290.67	39.38%

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 基金交易

无。

7.4.10.1.5 权证交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	624.38	5.13%	-	-

注：1. 上述佣金费率参考市场价格确定。

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,570,762.68	2,153,229.72
其中：应支付销售机构的客户维护费	122,534.36	28,803.18
应支付基金管理人的净管理费	2,448,228.32	2,124,426.54

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	514,152.52	430,645.89

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

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券股份有限公司	780,017.00	0.26%	814,409.00	0.18%
中国工商银行股份有限公司—南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	121,164,674.00	39.84%	167,919,674.00	37.22%

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

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	235,438.69	3,861.03	410,033.34	3,343.17

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	127108	太能转债	配债	858	85,800.00
华泰联合	127110	广核转债	配债	340	34,000.00

上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	-	-	-	-	-

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

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

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-------	-------	--------	--------	----

002049	紫 光 国 微	2025 年 12 月 30 日	重 大 事 项 停 牌	78. 81	20 26 年 1 月 15 日	86.6 9	20,978	1,516,463.6 2	1,653,276.1 8	-
400174	中 天 3	2023 年 8 月 30 日	暂 停 转 让	0.1 4	-	-	100,100	332,602.15	14,014.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，紧密跟踪深证成份指数，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，跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资

产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

7.4.13.3 流动性风险

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行期货投资，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的 15%。于本报告期末，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，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逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度；根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	235,438.69	-	-	-	235,438.69
结算备付金	144,410.77	-	-	-	144,410.77
存出保证金	16,157.09	-	-	-	16,157.09
交易性金融资产	-	-	-	498,702,418.19	498,702,418.19
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	-	-	-	14,052.30	14,052.30
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	396,006.55	-	-	498,716,470.49	499,112,477.04
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	-	-	-	966.15	966.15
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	215,310.09	215,310.09
应付托管费	-	-	-	43,062.02	43,062.02
应付销售服务费	-	-	-	-	-
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	-	-	-	54,494.36	54,494.36
负债总计	-	-	-	313,832.62	313,832.62
利率敏感度缺口	396,006.55	-	-	498,402,637.87	498,798,644.42
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	410,033.34	-	-	-	410,033.34
结算备付金	19,393.23	-	-	-	19,393.23
存出保证金	24,342.03	-	-	-	24,342.03
交易性金融资产	-	-	-	562,924,619.18	562,924,619.18
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	-	-	-	2,424.45	2,424.45
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	453,768.60	-	-	562,927,043.63	563,380,812.23
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	-	-	-	243,196.04	243,196.04
应付托管费	-	-	-	48,639.19	48,639.19
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.06	0.06
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	100,605.02	100,605.02
负债总计	-	-	-	392,440.31	392,440.31
利率敏感度缺口	453,768.60	-	-	562,534,603.32	562,988,371.92

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2025年12月31日)	上年度末(2024年12月31日)
	1.市场利率平行上升25个基点	0.00	0.00
	2.市场利率平行下降25个基点	0.00	0.00

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金采用完全复制法，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	498,702,418.19	99.98	562,924,619.18	99.99
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	498,702,418.19	99.98	562,924,619.18	99.99

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2025年12月31日)	上年度末(2024年12月31日)
	1.组合自身基准上升 5%	24,818,534.23	27,988,715.22
2.组合自身基准下降 5%	-24,818,534.23	-27,988,715.22	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	497,035,128.01	561,267,766.38
第二层次	1,653,276.18	1,642,838.80
第三层次	14,014.00	14,014.00
合计	498,702,418.19	562,924,619.18

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位:人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	交易性金融资产	合计

	债券投资	股票投资	
期初余额	-	14,014.00	14,014.00
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	14,014.00	14,014.00
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	35,227.61	35,227.61
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	17,645.57	17,645.57
当期利得或损失总额	-	-3,568.04	-3,568.04
其中：计入损益的利得或损失	-	-3,568.04	-3,568.04
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	14,014.00	14,014.00
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
停牌股票	14,014.00	经调整的净资产法	不适用	不适用	不适用
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
停牌股票	14,014.00	经调整的净资产法	不适用	不适用	不适用
限售股票	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	498,702,418.19	99.92
	其中：股票	498,702,418.19	99.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	379,849.46	0.08
8	其他各项资产	30,209.39	0.01
9	合计	499,112,477.04	100.00

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

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	8,461,921.06	1.70
B	采矿业	6,872,496.22	1.38
C	制造业	384,949,990.36	77.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,892,918.80	0.98
E	建筑业	723,632.00	0.15
F	批发和零售业	5,573,988.46	1.12
G	交通运输、仓储和邮政业	5,951,342.99	1.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,797,065.20	5.77
J	金融业	34,361,135.15	6.89
K	房地产业	2,918,691.50	0.59
L	租赁和商务服务业	6,102,238.88	1.22
M	科学研究和技术服务业	3,316,715.35	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	609,930.08	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	429,906.00	0.09
Q	卫生和社会工作	2,131,831.92	0.43
R	文化、体育和娱乐业	2,594,600.22	0.52
S	综合	-	-
	合计	498,688,404.19	99.98

8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-

J	金融业	-	-
K	房地产业	14,014.00	0.00
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	14,014.00	0.00

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	82,860	30,431,163.60	6.10
2	300308	中际旭创	27,432	16,733,520.00	3.35
3	000333	美的集团	158,591	12,393,886.65	2.48
4	300502	新易盛	28,626	12,334,370.88	2.47
5	300059	东方财富	415,381	9,628,531.58	1.93
6	002475	立讯精密	151,208	8,575,005.68	1.72
7	300274	阳光电源	47,688	8,156,555.52	1.64
8	002594	比亚迪	82,008	8,013,821.76	1.61
9	000858	五粮液	58,041	6,148,863.54	1.23
10	002371	北方华创	12,455	5,717,841.40	1.15
11	300476	胜宏科技	19,600	5,636,568.00	1.13
12	000651	格力电器	138,240	5,560,012.80	1.11
13	300124	汇川技术	63,691	4,797,843.03	0.96
14	000725	京东方 A	1,065,242	4,484,668.82	0.90
15	002714	牧原股份	80,883	4,091,062.14	0.82
16	000063	中兴通讯	102,433	3,876,064.72	0.78
17	002050	三花智控	68,666	3,797,916.46	0.76
18	300760	迈瑞医疗	19,600	3,732,820.00	0.75

19	002415	海康威视	118,881	3,547,409.04	0.71
20	002384	东山精密	40,800	3,453,720.00	0.69
21	000425	徐工机械	282,708	3,273,758.64	0.66
22	002463	沪电股份	43,920	3,209,234.40	0.64
23	002230	科大讯飞	62,370	3,136,587.30	0.63
24	000001	平安银行	272,212	3,105,938.92	0.62
25	002142	宁波银行	109,911	3,087,399.99	0.62
26	300498	温氏股份	178,809	3,018,295.92	0.61
27	002352	顺丰控股	76,883	2,946,156.56	0.59
28	000792	盐湖股份	104,400	2,939,904.00	0.59
29	300394	天孚通信	14,404	2,924,444.12	0.59
30	002028	思源电气	18,300	2,828,997.00	0.57
31	300014	亿纬锂能	42,951	2,824,457.76	0.57
32	000338	潍柴动力	163,808	2,817,497.60	0.56
33	000568	泸州老窖	24,192	2,811,594.24	0.56
34	000100	TCL 科技	583,878	2,650,806.12	0.53
35	002625	光启技术	51,090	2,491,148.40	0.50
36	002027	分众传媒	324,696	2,393,009.52	0.48
37	002241	歌尔股份	79,810	2,292,941.30	0.46
38	002460	赣锋锂业	35,860	2,255,235.40	0.45
39	000977	浪潮信息	33,086	2,203,527.60	0.44
40	000807	云铝股份	66,800	2,193,712.00	0.44
41	000988	华工科技	27,000	2,141,910.00	0.43
42	300033	同花顺	6,400	2,061,952.00	0.41
43	002837	英维克	19,034	2,034,544.26	0.41
44	000776	广发证券	90,559	1,994,109.18	0.40
45	002709	天赐材料	42,556	1,971,619.48	0.40
46	000408	藏格矿业	23,100	1,949,640.00	0.39
47	300433	蓝思科技	62,758	1,899,684.66	0.38
48	300408	三环集团	40,400	1,848,300.00	0.37
49	002466	天齐锂业	33,200	1,838,616.00	0.37
50	002916	深南电路	7,899	1,834,858.71	0.37
51	300450	先导智能	35,199	1,759,246.02	0.35
52	002558	巨人网络	39,100	1,692,639.00	0.34
53	002202	金风科技	82,413	1,681,225.20	0.34
54	000625	长安汽车	139,536	1,654,896.96	0.33
55	002049	紫光国微	20,978	1,653,276.18	0.33
56	300136	信维通信	25,760	1,597,120.00	0.32
57	002738	中矿资源	20,280	1,592,994.00	0.32
58	300803	指南针	12,060	1,578,292.20	0.32
59	002600	领益智造	100,800	1,566,432.00	0.31
60	300475	香农芯创	10,800	1,558,872.00	0.31
61	002532	天山铝业	96,200	1,556,516.00	0.31

62	300015	爱尔眼科	139,988	1,537,068.24	0.31
63	000426	兴业银锡	43,100	1,534,360.00	0.31
64	000630	铜陵有色	243,500	1,463,435.00	0.29
65	300604	长川科技	14,200	1,438,602.00	0.29
66	000938	紫光股份	58,058	1,428,226.80	0.29
67	000166	申万宏源	269,069	1,417,993.63	0.28
68	300115	长盈精密	30,388	1,413,042.00	0.28
69	002156	通富微电	37,080	1,397,916.00	0.28
70	002311	海大集团	25,240	1,397,791.20	0.28
71	000933	神火股份	50,400	1,384,488.00	0.28
72	000538	云南白药	24,220	1,374,727.20	0.28
73	002074	国轩高科	35,139	1,374,286.29	0.28
74	300395	菲利华	13,700	1,374,110.00	0.28
75	002353	杰瑞股份	19,187	1,359,015.21	0.27
76	000157	中联重科	156,827	1,353,417.01	0.27
77	000547	航天发展	41,000	1,353,410.00	0.27
78	300058	蓝色光标	116,247	1,339,165.44	0.27
79	000975	山金国际	54,904	1,335,814.32	0.27
80	300255	常山药业	21,300	1,322,730.00	0.27
81	002179	中航光电	36,886	1,307,239.84	0.26
82	002340	格林美	155,400	1,299,144.00	0.26
83	002001	新和成	49,928	1,257,686.32	0.25
84	002517	恺英网络	56,400	1,233,468.00	0.25
85	301308	江波龙	5,000	1,224,200.00	0.25
86	300339	润和软件	24,700	1,222,650.00	0.25
87	002851	麦格米特	13,400	1,206,938.00	0.24
88	300857	协创数据	7,100	1,197,628.00	0.24
89	002195	岩山科技	168,205	1,192,573.45	0.24
90	300223	北京君正	11,100	1,177,044.00	0.24
91	002304	洋河股份	19,371	1,176,594.54	0.24
92	300442	润泽科技	22,140	1,168,992.00	0.23
93	002236	大华股份	61,378	1,162,499.32	0.23
94	002736	国信证券	88,000	1,154,560.00	0.23
95	002407	多氟多	33,860	1,148,192.60	0.23
96	300207	欣旺达	43,900	1,147,985.00	0.23
97	300418	昆仑万维	27,400	1,142,580.00	0.23
98	002261	拓维信息	34,200	1,132,020.00	0.23
99	002595	豪迈科技	13,200	1,115,532.00	0.22
100	001309	德明利	4,800	1,113,072.00	0.22
101	002920	德赛西威	9,200	1,106,760.00	0.22
102	002555	三七互娱	46,800	1,104,480.00	0.22
103	002422	科伦药业	37,078	1,088,239.30	0.22
104	002281	光迅科技	15,500	1,084,225.00	0.22

105	002938	鹏鼎控股	21,100	1,067,238.00	0.21
106	002812	恩捷股份	18,780	1,063,699.20	0.21
107	000768	中航西飞	41,790	1,060,630.20	0.21
108	002008	大族激光	25,500	1,050,345.00	0.21
109	002131	利欧股份	185,743	1,047,590.52	0.21
110	300751	迈为股份	5,018	1,033,657.82	0.21
111	002472	双环传动	21,800	1,033,538.00	0.21
112	002436	兴森科技	48,600	1,028,862.00	0.21
113	002966	苏州银行	124,080	1,028,623.20	0.21
114	000831	中国稀土	22,000	1,021,680.00	0.20
115	002456	欧菲光	95,602	1,015,293.24	0.20
116	300390	天华新能	18,500	1,010,285.00	0.20
117	002402	和而泰	25,800	1,009,296.00	0.20
118	000002	万科 A	216,058	1,004,669.70	0.20
119	002493	荣盛石化	85,025	995,642.75	0.20
120	300548	长芯博创	7,000	994,000.00	0.20
121	002252	上海莱士	155,240	984,221.60	0.20
122	002648	卫星化学	55,501	981,257.68	0.20
123	002273	水晶光电	38,754	973,500.48	0.20
124	000963	华东医药	24,595	970,272.75	0.19
125	002601	龙佰集团	49,200	963,336.00	0.19
126	300347	泰格医药	16,900	958,230.00	0.19
127	002126	银轮股份	25,100	948,780.00	0.19
128	002465	海格通信	60,000	945,000.00	0.19
129	001979	招商蛇口	108,727	939,401.28	0.19
130	301236	软通动力	19,728	935,699.04	0.19
131	000066	中国长城	64,538	929,992.58	0.19
132	300456	赛微电子	16,600	928,936.00	0.19
133	002185	华天科技	83,474	915,709.78	0.18
134	000895	双汇发展	34,424	911,203.28	0.18
135	000878	云南铜业	44,396	910,561.96	0.18
136	300782	卓胜微	11,086	903,287.28	0.18
137	000661	长春高新	9,700	897,735.00	0.18
138	002128	电投能源	32,000	893,120.00	0.18
139	300661	圣邦股份	13,007	892,800.48	0.18
140	300454	深信服	7,600	875,216.00	0.18
141	000021	深科技	34,500	872,160.00	0.17
142	002130	沃尔核材	33,100	871,192.00	0.17
143	002850	科达利	5,500	868,230.00	0.17
144	300759	康龙化成	30,325	862,139.75	0.17
145	000960	锡业股份	30,872	860,711.36	0.17
146	002797	第一创业	124,840	857,650.80	0.17
147	000893	亚钾国际	17,800	853,866.00	0.17

148	003816	中国广核	224,600	844,496.00	0.17
149	301358	湖南裕能	13,000	840,580.00	0.17
150	300054	鼎龙股份	22,300	838,480.00	0.17
151	300724	捷佳伟创	8,700	831,720.00	0.17
152	002271	东方雨虹	61,163	831,205.17	0.17
153	000657	中钨高新	29,500	817,445.00	0.16
154	300346	南大光电	19,048	817,159.20	0.16
155	002497	雅化集团	33,000	816,750.00	0.16
156	002080	中材科技	22,310	810,745.40	0.16
157	002129	TCL 中环	94,600	810,722.00	0.16
158	000617	中油资本	84,400	810,240.00	0.16
159	000301	东方盛虹	74,200	808,038.00	0.16
160	002078	太阳纸业	51,000	803,250.00	0.16
161	300458	全志科技	19,110	803,193.30	0.16
162	002138	顺络电子	22,600	802,978.00	0.16
163	300037	新宙邦	15,260	799,624.00	0.16
164	000783	长江证券	97,819	797,224.85	0.16
165	300474	景嘉微	11,050	794,163.50	0.16
166	300757	罗博特科	3,400	793,220.00	0.16
167	002240	盛新锂能	23,000	791,890.00	0.16
168	000786	北新建材	31,300	781,561.00	0.16
169	002157	正邦科技	240,800	780,192.00	0.16
170	300866	安克创新	6,810	778,995.90	0.16
171	300496	中科创达	11,354	766,395.00	0.15
172	002444	巨星科技	22,400	762,048.00	0.15
173	002414	高德红外	51,920	761,666.40	0.15
174	002294	信立泰	15,300	758,115.00	0.15
175	300073	当升科技	13,100	757,180.00	0.15
176	300748	金力永磁	21,960	749,055.60	0.15
177	300251	光线传媒	45,520	745,617.60	0.15
178	300285	国瓷材料	26,650	730,476.50	0.15
179	000034	神州数码	18,747	729,445.77	0.15
180	002223	鱼跃医疗	19,000	725,990.00	0.15
181	300316	晶盛机电	19,710	724,342.50	0.15
182	002624	完美世界	43,850	718,701.50	0.14
183	002155	湖南黄金	33,950	716,005.50	0.14
184	000728	国元证券	85,605	714,801.75	0.14
185	000423	东阿阿胶	14,405	706,997.40	0.14
186	000766	通化金马	25,700	706,493.00	0.14
187	002222	福晶科技	12,500	704,250.00	0.14
188	302132	中航成飞	8,900	703,100.00	0.14
189	300002	神州泰岳	60,500	696,960.00	0.14
190	300017	网宿科技	67,645	693,361.25	0.14

191	002683	广东宏大	14,500	693,100.00	0.14
192	300024	机器人	38,090	692,857.10	0.14
193	301269	华大九天	6,500	691,145.00	0.14
194	000559	万向钱潮	40,040	688,688.00	0.14
195	002085	万丰奥威	42,928	687,277.28	0.14
196	300122	智飞生物	36,150	682,150.50	0.14
197	000733	振华科技	12,900	676,089.00	0.14
198	300699	光威复材	16,992	670,504.32	0.13
199	002487	大金重工	12,800	664,704.00	0.13
200	000997	新大陆	23,380	662,121.60	0.13
201	002459	晶澳科技	57,776	661,535.20	0.13
202	002409	雅克科技	8,800	652,080.00	0.13
203	300896	爱美客	4,580	649,077.60	0.13
204	002405	四维图新	70,996	639,673.96	0.13
205	002335	科华数据	11,500	638,595.00	0.13
206	000703	恒逸石化	59,078	636,270.06	0.13
207	300919	中伟股份	13,660	632,867.80	0.13
208	002180	纳思达	31,200	630,864.00	0.13
209	300373	扬杰科技	9,260	629,680.00	0.13
210	000596	古井贡酒	4,739	628,391.40	0.13
211	002065	东华软件	68,500	626,775.00	0.13
212	000876	新希望	67,952	626,517.44	0.13
213	300832	新产业	11,100	624,375.00	0.13
214	002151	北斗星通	13,700	622,391.00	0.12
215	002673	西部证券	78,854	622,158.06	0.12
216	000683	博源化工	83,400	620,496.00	0.12
217	000932	华菱钢铁	110,340	620,110.80	0.12
218	300012	华测检测	45,300	613,815.00	0.12
219	002756	永兴材料	11,310	613,567.50	0.12
220	300438	鹏辉能源	11,500	612,030.00	0.12
221	000060	中金岭南	103,745	606,908.25	0.12
222	001965	招商公路	60,113	605,939.04	0.12
223	002064	华峰化学	54,900	603,900.00	0.12
224	002821	凯莱英	6,480	602,186.40	0.12
225	000887	中鼎股份	25,900	601,139.00	0.12
226	300003	乐普医疗	38,000	600,780.00	0.12
227	300001	特锐德	23,300	598,344.00	0.12
228	300568	星源材质	39,227	598,211.75	0.12
229	300666	江丰电子	6,500	598,000.00	0.12
230	000039	中集集团	59,190	597,227.10	0.12
231	300779	惠城环保	4,500	585,495.00	0.12
232	300972	万辰集团	2,900	583,103.00	0.12
233	002249	大洋电机	53,334	581,340.60	0.12

234	300570	太辰光	5,000	577,750.00	0.12
235	000999	华润三九	20,183	574,408.18	0.12
236	002318	久立特材	19,800	573,210.00	0.11
237	002152	广电运通	41,400	571,734.00	0.11
238	000528	柳工	48,160	571,659.20	0.11
239	300383	光环新网	45,600	570,456.00	0.11
240	000750	国海证券	134,025	568,266.00	0.11
241	300142	沃森生物	52,000	567,320.00	0.11
242	002203	海亮股份	44,400	562,104.00	0.11
243	002410	广联达	44,647	561,659.26	0.11
244	000623	吉林敖东	28,718	560,862.54	0.11
245	300432	富临精工	33,440	558,448.00	0.11
246	002245	蔚蓝锂芯	31,300	557,140.00	0.11
247	300468	四方精创	14,300	555,269.00	0.11
248	300627	华测导航	15,900	555,069.00	0.11
249	002739	万达电影	49,000	554,680.00	0.11
250	300567	精测电子	6,050	551,760.00	0.11
251	000830	鲁西化工	32,500	538,525.00	0.11
252	300628	亿联网络	15,100	538,315.00	0.11
253	300953	震裕科技	3,200	537,664.00	0.11
254	000400	许继电气	20,900	537,339.00	0.11
255	300677	英科医疗	13,720	533,708.00	0.11
256	000009	中国宝安	53,417	526,157.45	0.11
257	000983	山西焦煤	80,920	519,506.40	0.10
258	300999	金龙鱼	18,058	518,986.92	0.10
259	002056	横店东磁	26,600	518,700.00	0.10
260	300672	国科微	4,800	516,576.00	0.10
261	002429	兆驰股份	69,500	515,690.00	0.10
262	001696	宗申动力	23,600	511,884.00	0.10
263	300773	拉卡拉	17,800	506,944.00	0.10
264	300253	卫宁健康	57,123	503,824.86	0.10
265	002484	江海股份	16,800	498,960.00	0.10
266	002044	美年健康	94,256	497,671.68	0.10
267	300763	锦浪科技	6,965	497,370.65	0.10
268	002007	华兰生物	32,730	495,204.90	0.10
269	000519	中兵红箭	27,100	493,491.00	0.10
270	300459	汤姆猫	106,889	490,620.51	0.10
271	300487	蓝晓科技	7,900	487,825.00	0.10
272	300413	芒果超媒	19,900	485,958.00	0.10
273	002389	航天彩虹	20,200	484,396.00	0.10
274	002841	视源股份	12,200	483,486.00	0.10
275	000737	北方铜业	31,200	480,168.00	0.10
276	300364	中文在线	19,100	479,792.00	0.10

277	000415	渤海租赁	117,700	476,685.00	0.10
278	002139	拓邦股份	34,100	469,898.00	0.09
279	000738	航发控制	22,050	469,885.50	0.09
280	002048	宁波华翔	14,900	468,754.00	0.09
281	002544	普天科技	13,500	465,615.00	0.09
282	300777	中简科技	11,300	461,040.00	0.09
283	002176	江特电机	47,100	458,754.00	0.09
284	002617	露笑科技	55,700	451,170.00	0.09
285	300296	利亚德	71,050	449,036.00	0.09
286	300229	拓尔思	22,400	445,760.00	0.09
287	002025	航天电器	8,890	445,655.70	0.09
288	000875	吉电股份	78,500	442,740.00	0.09
289	000708	中信特钢	27,030	442,481.10	0.09
290	002385	大北农	110,350	441,400.00	0.09
291	300638	广和通	14,760	437,486.40	0.09
292	000155	川能动力	37,200	433,380.00	0.09
293	300679	电连技术	8,900	433,252.00	0.09
294	002926	华西证券	46,600	432,448.00	0.09
295	002432	九安医疗	10,800	432,432.00	0.09
296	002603	以岭药业	25,320	432,212.40	0.09
297	000723	美锦能源	91,800	431,460.00	0.09
298	002939	长城证券	42,300	431,460.00	0.09
299	002653	海思科	8,400	431,088.00	0.09
300	002607	中公教育	156,900	429,906.00	0.09
301	300674	宇信科技	17,700	429,402.00	0.09
302	300765	新诺威	11,900	429,233.00	0.09
303	000729	燕京啤酒	38,200	428,986.00	0.09
304	300623	捷捷微电	15,754	428,036.18	0.09
305	000629	钒钛股份	137,900	427,490.00	0.09
306	002958	青农商行	137,600	426,560.00	0.09
307	300144	宋城演艺	51,626	422,816.94	0.08
308	000686	东北证券	45,000	419,400.00	0.08
309	002270	华明装备	16,700	418,168.00	0.08
310	002262	恩华药业	17,300	417,449.00	0.08
311	001203	大中矿业	13,600	416,840.00	0.08
312	000050	深天马 A	46,100	416,283.00	0.08
313	000970	中科三环	30,570	414,529.20	0.08
314	300088	长信科技	68,004	412,104.24	0.08
315	301611	珂玛科技	4,800	411,504.00	0.08
316	002583	海能达	36,100	408,652.00	0.08
317	000636	风华高科	24,900	405,372.00	0.08
318	000799	酒鬼酒	7,400	403,892.00	0.08
319	000513	丽珠集团	11,620	400,425.20	0.08

320	002430	杭氧股份	13,400	400,258.00	0.08
321	002145	钛能化学	81,185	397,806.50	0.08
322	002373	千方科技	33,500	394,295.00	0.08
323	001389	广合科技	4,800	391,824.00	0.08
324	300182	捷成股份	70,959	391,693.68	0.08
325	300573	兴齐眼药	5,568	391,374.72	0.08
326	002747	埃斯顿	16,500	391,050.00	0.08
327	002984	森麒麟	18,360	388,681.20	0.08
328	002506	协鑫集成	137,800	385,840.00	0.08
329	300676	华大基因	8,500	385,560.00	0.08
330	300100	双林股份	9,700	384,314.00	0.08
331	300775	三角防务	12,600	383,040.00	0.08
332	002312	川发龙蟒	34,800	380,364.00	0.08
333	000591	太阳能	85,600	380,064.00	0.08
334	300146	汤臣倍健	31,500	378,315.00	0.08
335	300558	贝达药业	8,100	378,189.00	0.08
336	002500	山西证券	62,880	376,651.20	0.08
337	002518	科士达	7,600	368,752.00	0.07
338	002268	电科网安	17,800	365,612.00	0.07
339	002568	百润股份	16,700	364,227.00	0.07
340	003021	兆威机电	2,900	360,122.00	0.07
341	300718	长盛轴承	4,200	358,512.00	0.07
342	003031	中瓷电子	4,900	358,484.00	0.07
343	002237	恒邦股份	26,700	358,314.00	0.07
344	002244	滨江集团	35,300	354,765.00	0.07
345	000032	深桑达 A	18,300	354,105.00	0.07
346	000987	越秀资本	42,686	347,464.04	0.07
347	000422	湖北宜化	24,400	346,724.00	0.07
348	300009	安科生物	35,967	344,204.19	0.07
349	002831	裕同科技	11,980	341,549.80	0.07
350	000825	太钢不锈	69,700	340,833.00	0.07
351	000998	隆平高科	36,100	337,896.00	0.07
352	002701	奥瑞金	56,500	336,175.00	0.07
353	002266	浙富控股	80,530	335,004.80	0.07
354	002698	博实股份	19,900	334,519.00	0.07
355	002423	中粮资本	28,500	333,450.00	0.07
356	000563	陕国投 A	96,130	331,648.50	0.07
357	300457	赢合科技	11,900	331,415.00	0.07
358	301536	星辰科技	5,500	329,505.00	0.07
359	000958	电投产融	50,500	326,735.00	0.07
360	000099	中信海直	15,700	325,775.00	0.07
361	000778	新兴铸管	77,432	323,665.76	0.06
362	002507	涪陵榨菜	24,940	321,975.40	0.06

363	000555	神州信息	19,400	321,070.00	0.06
364	300735	光弘科技	12,900	320,694.00	0.06
365	000951	中国重汽	18,940	320,086.00	0.06
366	002299	圣农发展	19,300	319,222.00	0.06
367	000581	威孚高科	15,351	316,537.62	0.06
368	300682	朗新集团	20,650	314,086.50	0.06
369	000921	海信家电	12,600	312,606.00	0.06
370	002368	太极股份	12,759	312,467.91	0.06
371	002439	启明星辰	22,100	312,052.00	0.06
372	002773	康弘药业	10,334	309,709.98	0.06
373	000682	东方电子	26,000	308,360.00	0.06
374	300601	康泰生物	20,800	307,216.00	0.06
375	000739	普洛药业	18,800	305,876.00	0.06
376	000598	兴蓉环境	42,600	305,442.00	0.06
377	000818	航锦科技	15,800	304,940.00	0.06
378	002670	国盛证券	17,860	300,762.40	0.06
379	002936	郑州银行	155,740	300,578.20	0.06
380	300979	华利集团	5,900	296,239.00	0.06
381	301029	怡合达	11,072	293,629.44	0.06
382	300034	钢研高纳	14,980	293,308.40	0.06
383	301078	孩子王	28,200	292,434.00	0.06
384	301377	鼎泰高科	2,100	292,110.00	0.06
385	000801	四川九洲	17,200	291,712.00	0.06
386	301165	锐捷网络	3,280	291,264.00	0.06
387	300660	江苏雷利	5,300	290,546.00	0.06
388	001227	兰州银行	125,100	290,232.00	0.06
389	002508	老板电器	14,960	289,476.00	0.06
390	000902	新洋丰	18,502	289,001.24	0.06
391	000069	华侨城 A	115,849	287,305.52	0.06
392	002745	木林森	29,900	286,143.00	0.06
393	301050	雷电微力	5,460	285,012.00	0.06
394	300910	瑞丰新材	5,000	282,750.00	0.06
395	300747	锐科激光	10,410	281,382.30	0.06
396	300776	帝尔激光	4,523	281,059.22	0.06
397	000709	河钢股份	121,400	280,434.00	0.06
398	002120	韵达股份	41,561	280,121.14	0.06
399	002015	协鑫能科	28,100	279,595.00	0.06
400	002948	青岛银行	62,190	278,611.20	0.06
401	002019	亿帆医药	23,200	277,472.00	0.06
402	002153	石基信息	25,582	277,053.06	0.06
403	300070	碧水源	70,134	274,925.28	0.06
404	002183	怡亚通	57,640	274,366.40	0.06
405	002675	东诚药业	19,800	272,052.00	0.05

406	002091	江苏国泰	30,100	271,803.00	0.05
407	300529	健帆生物	13,800	271,446.00	0.05
408	000403	派林生物	19,470	266,544.30	0.05
409	301219	腾远钴业	3,900	266,292.00	0.05
410	000688	国城矿业	9,500	264,100.00	0.05
411	002416	爱施德	20,900	262,922.00	0.05
412	301200	大族数控	2,200	261,294.00	0.05
413	000062	深圳华强	10,612	261,267.44	0.05
414	300212	易华录	14,900	260,005.00	0.05
415	000027	深圳能源	39,640	258,452.80	0.05
416	002468	申通快递	19,100	256,322.00	0.05
417	000543	皖能电力	32,100	255,195.00	0.05
418	000883	湖北能源	55,500	251,970.00	0.05
419	300357	我武生物	8,840	250,614.00	0.05
420	000967	盈峰环境	34,100	250,294.00	0.05
421	000582	北部湾港	26,600	249,508.00	0.05
422	002572	索菲亚	18,164	247,212.04	0.05
423	000088	盐田港	55,000	244,750.00	0.05
424	002221	东华能源	30,100	243,810.00	0.05
425	002320	海峡股份	20,025	243,704.25	0.05
426	301155	海力风电	3,000	242,790.00	0.05
427	002003	伟星股份	22,900	242,740.00	0.05
428	000800	一汽解放	35,700	242,046.00	0.05
429	301526	国际复材	34,400	240,800.00	0.05
430	001287	中电港	10,600	240,196.00	0.05
431	300595	欧普康视	16,320	239,740.80	0.05
432	002847	盐津铺子	3,500	239,085.00	0.05
433	000877	天山股份	44,900	238,868.00	0.05
434	300957	贝泰妮	6,000	237,660.00	0.05
435	301095	广立微	3,300	236,643.00	0.05
436	000628	高新发展	5,300	236,327.00	0.05
437	300761	立华股份	11,300	234,475.00	0.05
438	003022	联泓新科	11,600	229,796.00	0.05
439	000156	华数传媒	29,700	224,829.00	0.05
440	300726	宏达电子	4,400	224,004.00	0.04
441	002906	华阳集团	7,300	223,234.00	0.04
442	301039	中集车辆	24,300	222,345.00	0.04
443	000935	四川双马	8,900	221,076.00	0.04
444	300294	博雅生物	9,750	220,350.00	0.04
445	002010	传化智联	37,700	219,037.00	0.04
446	002597	金禾实业	10,500	217,980.00	0.04
447	300888	稳健医疗	5,680	214,931.20	0.04
448	000959	首钢股份	43,700	214,130.00	0.04

449	001286	陕西能源	22,900	213,199.00	0.04
450	301301	川宁生物	20,600	208,884.00	0.04
451	002372	伟星新材	20,020	208,808.60	0.04
452	002690	美亚光电	9,977	205,226.89	0.04
453	000089	深圳机场	29,100	203,409.00	0.04
454	002032	苏泊尔	4,600	202,768.00	0.04
455	002408	齐翔腾达	41,420	202,129.60	0.04
456	301498	乖宝宠物	3,100	201,965.00	0.04
457	002265	建设工业	7,500	201,150.00	0.04
458	002096	易普力	15,100	201,132.00	0.04
459	002531	天顺风能	29,300	200,998.00	0.04
460	000810	创维数字	16,800	197,904.00	0.04
461	000429	粤高速 A	16,500	194,370.00	0.04
462	000966	长源电力	45,300	193,431.00	0.04
463	000029	深深房 A	8,700	191,574.00	0.04
464	002541	鸿路钢构	11,600	190,704.00	0.04
465	300633	开立医疗	7,200	190,224.00	0.04
466	000785	居然智家	64,100	187,172.00	0.04
467	301589	诺瓦星云	1,100	181,005.00	0.04
468	000537	绿发电力	21,700	178,157.00	0.04
469	002608	江苏国信	23,900	176,621.00	0.04
470	301297	富乐德	4,900	175,420.00	0.04
471	000937	冀中能源	32,500	174,850.00	0.04
472	000898	鞍钢股份	68,469	173,226.57	0.03
473	301091	深城交	6,390	170,868.60	0.03
474	001391	国货航	28,600	169,312.00	0.03
475	000927	中国铁物	63,300	165,213.00	0.03
476	000791	甘肃能源	25,500	164,475.00	0.03
477	000552	甘肃能化	70,500	162,855.00	0.03
478	002978	安宁股份	4,900	161,945.00	0.03
479	300428	立中集团	6,900	161,115.00	0.03
480	002867	周大生	13,125	159,862.50	0.03
481	003035	南网能源	32,900	150,682.00	0.03
482	002755	奥赛康	8,900	145,337.00	0.03
483	301238	瑞泰新材	7,000	142,800.00	0.03
484	002925	盈趣科技	8,330	141,110.20	0.03
485	001914	招商积余	13,200	140,976.00	0.03
486	000401	金隅冀东	31,764	140,079.24	0.03
487	002945	华林证券	9,000	137,970.00	0.03
488	002060	广东建工	37,000	133,200.00	0.03
489	001872	招商港口	6,700	129,511.00	0.03
490	002563	森马服饰	23,700	128,454.00	0.03
491	301551	无线传媒	3,900	123,045.00	0.02

492	000539	粤电力 A	27,100	119,782.00	0.02
493	301606	绿联科技	1,900	111,606.00	0.02
494	002461	珠江啤酒	11,800	109,622.00	0.02
495	002901	大博医疗	2,300	108,951.00	0.02
496	001213	中铁特货	25,300	102,465.00	0.02
497	301267	华夏眼科	5,400	97,092.00	0.02
498	001289	龙源电力	4,600	69,184.00	0.01
499	001308	康冠科技	3,160	65,917.60	0.01
500	301275	汉朔科技	1,200	64,104.00	0.01

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	400174	中天 3	100,100	14,014.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	2,056,906.00	0.37
2	300059	东方财富	1,550,413.00	0.28
3	300255	常山药业	1,516,076.00	0.27
4	002594	比亚迪	1,422,128.00	0.25
5	300760	迈瑞医疗	1,238,743.00	0.22
6	002261	拓维信息	1,092,676.00	0.19
7	300548	长芯博创	1,076,700.00	0.19
8	300033	同花顺	1,071,437.00	0.19
9	001309	德明利	1,070,032.00	0.19
10	300779	惠城环保	1,050,379.00	0.19
11	000725	京东方 A	986,782.00	0.18
12	000333	美的集团	974,284.00	0.17
13	002130	沃尔核材	972,511.00	0.17
14	300274	阳光电源	936,672.00	0.17
15	000651	格力电器	904,140.00	0.16
16	300308	中际旭创	896,232.00	0.16
17	300570	太辰光	893,530.00	0.16
18	000858	五粮液	802,167.00	0.14
19	300502	新易盛	788,372.00	0.14
20	002625	光启技术	705,456.00	0.13

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	1,832,647.00	0.33
2	300308	中际旭创	640,507.00	0.11
3	000792	盐湖股份	625,206.00	0.11
4	300896	爱美客	618,235.00	0.11
5	002594	比亚迪	595,142.00	0.11
6	000596	古井贡酒	548,182.00	0.10
7	002371	北方华创	528,806.00	0.09
8	000568	泸州老窖	492,959.00	0.09
9	300757	罗博特科	468,527.00	0.08
10	002317	众生药业	468,508.00	0.08
11	000333	美的集团	440,264.00	0.08
12	000762	西藏矿业	416,572.00	0.07
13	000651	格力电器	392,656.00	0.07
14	002865	钧达股份	354,591.29	0.06
15	000858	五粮液	350,816.00	0.06
16	300033	同花顺	349,983.00	0.06
17	000690	宝新能源	344,110.00	0.06
18	002475	立讯精密	343,228.00	0.06
19	300118	东方日升	333,955.00	0.06
20	000035	中国天楹	329,432.00	0.06

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	100,236,983.39
卖出股票收入（成交）总额	39,621,591.25

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

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

8.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	16,157.09
2	应收清算款	14,052.30
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	30,209.39

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	14,014.00	0.00	暂停转让

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
10,806	28,146.82	23,717,994.00	7.80%	159,271,839.00	52.37%	121,164,674.00	39.84%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	上海青泓私募基金管理有限公司—青泓周期与成长一号私募证券投资基金	9,098,864.00	2.99%
2	朱泽平	4,784,300.00	1.57%
3	章斌	2,526,375.00	0.83%
4	广发证券股份有限公司	2,337,213.00	0.77%
5	高建崇	1,879,818.00	0.62%
6	张雯晴	1,627,900.00	0.54%
7	浙商证券股份有限公司	1,588,595.00	0.52%

8	刘伟	1,565,900.00	0.51%
9	中国建设银行股份有限公司—广发均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）	1,543,000.00	0.51%
10	东方证券股份有限公司	1,468,862.00	0.48%
11	中国工商银行股份有限公司—南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	121,164,674.00	39.84%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年12月4日)基金份额总额	4,127,538,537.00
本报告期初基金份额总额	451,154,507.00
本报告期基金总申购份额	342,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	489,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	304,154,507.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内无涉及基金财产的诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 2 年，本报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 48,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2025-10-17; 2025-11-18
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局; 国家外汇管理局深圳市分局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施; 行政处罚
受到的具体措施类型	责令改正; 警告、罚款
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作、人员管理、其他问题(销售管理); 其他问题(外汇登记)
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》; 《中华人民共和国外汇管理条例》
管理人采取整改措施的情况	截至报告期末公司已通过完善制度、优化流程等整改措施完成整改，整改成果已经中国证监会深圳监管局验收通过; 截至报告期末公司已完成整改，整改成果已向国家外汇管理局深圳市分局报告并通过
其他	-

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
--------------------	----

受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到调查或处罚等措施的时间	2025-10-17
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理、其他问题(销售管理)
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	截至报告期末公司已通过完善制度、优化流程等整改措施完成整改，整改成果已经中国证监会深圳监管局验收通过
其他	-

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	1	74,878,314.22	53.54%	7,481.60	53.54%	-
申万宏源	1	44,484,898.42	31.81%	4,443.80	31.80%	-
国信证券	1	20,495,362.00	14.65%	2,047.19	14.65%	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-

招商证券	1	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

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

1、选择标准

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

2、选择程序

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

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

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：新增交易单元：无；减少交易单元：东北证券、方正证券、中信证券。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	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
中泰证券	121,677.70	30.22%	-	-	-	-
申万宏源	281,025.54	69.78%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证	-	-	-	-	-	-

券						
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于直销平台相关业务费率优惠的公告	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	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加华金证券为一级交易商的公告	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	2025-01-08
3	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加瑞银证券为一级交易商的公告	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	2025-02-20
4	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
5	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
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可转换公司债券的关联交易公告	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	2025-04-01
7	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加东莞证券为一级交易商的公告	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	2025-07-04

8	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	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	2025-07-11
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分基金新增流动性服务商的公告	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	2025-11-19

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	202501-01-202512-31	167,919,674.00	3,000,000.00	49,755,000.00	121,164,674.00	39.84%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立深证成份交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《深证成份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、《深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告》原文。

13.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>