

中证 500 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	15
§ 5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§ 6 审计报告.....	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§ 7 年度财务报表.....	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 净资产变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
§ 8 投资组合报告.....	58
8.1 期末基金资产组合情况.....	58
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	59
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.....	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	84

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	86
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	86
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	86
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	86
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	86
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	86
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	87
8.12 投资组合报告附注	87
§ 9 基金份额持有人信息	88
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	88
9.2 期末上市基金前十名持有人	88
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	89
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	89
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	89
§ 10 开放式基金份额变动	89
§ 11 重大事件揭示	89
11.1 基金份额持有人大会决议	90
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	90
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	90
11.4 基金投资策略的改变	90
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	90
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	90
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	92
11.8 其他重大事件	93
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	95
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	95
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	95
§ 13 备查文件目录	95
13.1 备查文件目录	95
13.2 存放地点	96
13.3 查阅方式	96

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 500ETF
场内简称	500ETF；中证 500ETF 南方
基金主代码	510500
交易代码	510500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	19,064,568,617.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	任航
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-68121816
注册地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

	大厦 32-42 楼	
邮政编码	518017	100031
法定代表人	周易	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金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	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
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	19,560,093,138.88	7,427,178,956.18	-1,917,729,060.58
本期利润	36,796,387,380.76	15,760,952,998.71	-1,954,896,379.50
加权平均基金份额本期利润	2.0058	1.0207	-0.2329
本期加权平均净值利润率	31.38%	19.02%	-3.88%
本期基金份额净值增长率	32.63%	6.98%	-6.16%
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	85,315,458,722.49	47,270,593,603.14	20,392,259,204.99
期末可供分配基金份额利润	4.4750	2.7023	2.4097
期末基金资产净值	144,690,474,667.85	101,749,746,068.89	46,748,226,459.26
期末基金份额净值	7.5895	5.8167	5.5241
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	151.67%	89.76%	77.37%

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	1.00%	1.24%	0.72%	1.24%	0.28%	0.00%
过去六个月	27.20%	1.18%	26.21%	1.17%	0.99%	0.01%
过去一年	32.63%	1.27%	30.39%	1.26%	2.24%	0.01%
过去三年	33.16%	1.37%	27.30%	1.37%	5.86%	0.00%
过去五年	27.26%	1.30%	17.25%	1.30%	10.01%	0.00%
自基金合同	151.67%	1.56%	110.63%	1.56%	41.04%	0.00%

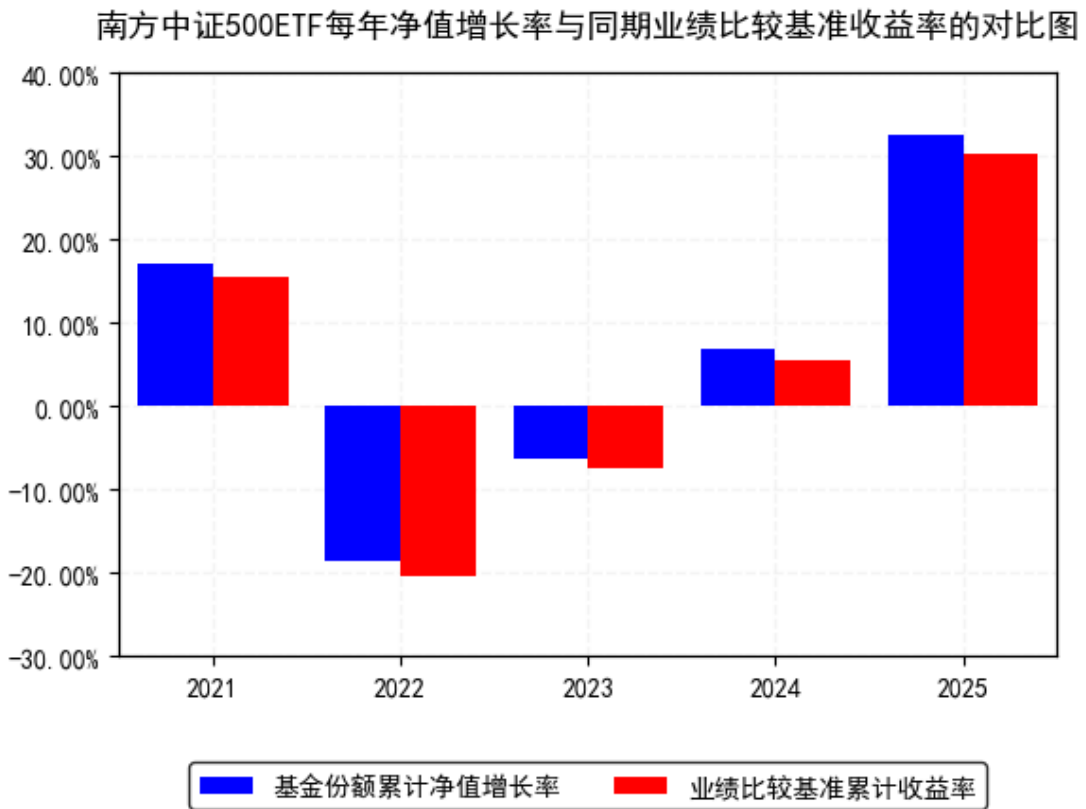
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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500ETF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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2025 年	0.9100	1,602,307,036.81	-	1,602,307,036.81	-
2024 年	0.8700	1,206,391,599.28	-	1,206,391,599.28	-
2023 年	-	-	-	-	-
合计	1.7800	2,808,698,636.09	-	2,808,698,636.09	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子

公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日	-	20 年	中国国籍，女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月 17 日至 2015 年 6 月 16 日，任南方策略基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2019 年 4 月 18 日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 3 月 27 日，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至 2020 年 3 月 27 日，任南方 H 股联接基金经理；2014 年 10 月 30 日至 2020 年 12 月 23 日，任 500 医药基金经理；2021 年 3 月 12 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理；2021 年 10 月 22 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证全指医疗保健 ETF 基金经理；2020 年 12 月 25 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方策略基金经理；2021 年 7 月 2 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方中证香港科技 ETF（QDII）基金经理；2022 年 6 月 17 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方恒生香港上市生物科技 ETF（QDII）基金经理；2023 年 5 月 30 日至 2024 年 7 月 5 日，任南方恒生香港上市生物科技 ETF 发起联接（QDII）基金经理；2024 年 7 月 5 日至 2025 年 7 月 25 日，任南方基金南方东英沙特阿拉伯 ETF（QDII）基

					金经理：2024 年 11 月 4 日至 2025 年 12 月 5 日，任南方中证沪深港黄金产业股票指数发起基金经理；2013 年 4 月 22 日至今，任南方 500、南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月 17 日至今，任南方 300、南方 300 联接基金经理；2015 年 2 月 16 日至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2017 年 7 月 21 日至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月 24 日至今，任南方房地产联接基金经理；2017 年 8 月 25 日至今，任南方房地产 ETF 基金经理；2018 年 4 月 3 日至今，任 MSCI 基金基金经理；2018 年 6 月 8 日至今，任 MSCI 联接基金经理；2020 年 7 月 24 日至今，兼任投资经理；2024 年 6 月 26 日至今，任南方中证国新港股通央企红利 ETF 基金经理；2024 年 9 月 12 日至今，任南方中证国新港股通央企红利 ETF 发起联接基金经理；2025 年 6 月 30 日至今，任南方中证港股通科技 ETF 基金经理；2025 年 9 月 18 日至今，任南方中证港股通科技 ETF 发起联接基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
罗文杰	公募基金	14	171,357,372,183.93	2013 年 04 月 22 日
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	-	-	-
	合计	14	171,357,372,183.93	-

注：报告期内，基金经理（罗文杰）不再担任 6 个私募资产管理计划的投资经理职务，离任日期为 2025 年 11 月 14 日。

4.1.4 基金经理薪酬机制

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，中证 500 指数涨 30.39%。中证 500 是 A 股市场核心中盘股指数，随着 A 股市场扩容与成分股市值增长，中证 500 总市值不断扩大，目前已增长至约 17 万亿元，流通市值约 9 万亿元。成分股总市值中位数从 2010 年的 60 多亿元增长至目前的 310 多亿元。随着中国经济转型发展和 A 股市场的变迁，中证 500 的行业构成不断迭代，房地产、基础化工等传统行业权重逐渐下滑，而电子、电力设备、医药生物等新兴行业权重逐渐占据主导地位。现下指数仍被大幅低估，具有较高的安全边际。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

- (1) 大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- (2) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；
- (3) 报告期内，我们根据指数定期的成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 7.5895 元，报告期内，份额净值增长率为 32.63%，同期业绩基准增长率为 30.39%。

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 2026 年，全球经济增长预计小幅降至 2.5% 左右，发达经济体需求疲软、债务压力和高利率滞后效应是主要拖累。美国大选后政策走向不确定，欧洲经济陷入“滞胀”，地缘冲突或将加剧能源与供应链波动。国内而言，2026 年是关键的五十五开局之年，经济结构将在保增长的前提下，依据传统动能托底+新动能主导，继续调整结构和提升增长质量。

中证 500 是 A 股市场的核心中盘股指数，26 年开年以来，指数表现强势。成分股覆盖了 110 多个细分行业，且近 80% 的都是细分行业龙头（营业收入和总市值都居行业前 10%）。在我国逐渐转向创新驱动发展的过程中，指数不仅受益于国家对科技创新领域的政策支持、新经济行业本身快速增长的红利，还能够享受各细分行业龙头公司在经济转型与集中度提升

下的竞争优势。行业角度，现在的中证 500 指数兼具周期和以新一代信息技术产业、航空航天产业等为代表的科技制造这两大属性，在这波 AI 驱动的超级大周期下，相信会有进一步盈利和估值的提升。估值角度，目前中证 500 指数整体处历史中枢区域，未至高位区间，拥挤度指标在近 10 年均值+1 倍标准差附近，距离极值区域仍有较大距离。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

在进一步优化制度体系的基础上，坚持“看不清管不住则不展业”原则，切实推动“合规创造价值”理念走深走实，强化新规及监管政策的内化落实，推进落实全面风险管理与全员合规管理要求，提升公司业务发展内在稳定性。持续夯实投研交易长效管控基础，着力加强日常风险监测预警与应对处置，切实防范各环节业务风险；紧跟监管动态，精准强化产品运作及市场营销各环节关键机制，系统性强化风险防范及排查，确保监管要求及政策精神的贯彻落实；对投研交易、市场销售、运营管理及人员管理等业务和相关部门通过专项稽核和合规检查工作，促进公司业务合规运作、稳健经营；厚植公司廉洁从业合规文化根基，强化智能高效的人员检查机制，丰富文化建设和宣导形式，有效规范人员从业行为；持续完善信息披露工作机制，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；落

实提升投资者获得感，持续加强投资者教育及保护力度，监督和落实客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金进行了收益分配，符合法律法规和基金合同约定。具体如下：

权益登记日 2025 年 1 月 15 日，每 10 份基金份额分红数 0.9100。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司本报告期基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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	容诚审字[2026]200Z0712 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	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“南方中证 500ETF 基金”）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和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了南方中证 500ETF 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职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于南方中证 500ETF 基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。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	南方中证 500ETF 基金的基金管理人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。其他信息包括南方中证 500ETF 基金 2025 年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。 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。 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。 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。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估南方中证 500ETF 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南方中证 500ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督南方中证 500ETF 基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错

责任	误导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。 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： （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。 （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。 （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。 （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，就可能导致对南方中证 500ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致南方中证 500ETF 基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与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。	
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈熹	成磊
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26	
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：中证 500 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	247,566,223.06	105,789,664.10
结算备付金		5,044,902,726.52	2,343,018,601.70
存出保证金		814,344,332.62	353,320,600.95
交易性金融资产	7.4.7.2	138,092,764,461.68	99,010,993,900.01
其中：股票投资		138,078,154,237.53	99,010,993,900.01
基金投资		-	-
债券投资		14,610,224.15	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	600,034,556.06	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		100,946,284.11	117,233,260.59
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		144,900,558,584.05	101,930,356,027.35
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		401,521.30	4,141,695.38
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		17,352,119.86	13,836,571.02
应付托管费		5,784,039.98	4,612,190.34
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-

应交税费		3,598,233.76	3,399,904.04
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	182,948,001.30	154,619,597.68
负债合计		210,083,916.20	180,609,958.46
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	59,375,015,945.36	54,479,152,465.75
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	85,315,458,722.49	47,270,593,603.14
净资产合计		144,690,474,667.85	101,749,746,068.89
负债和净资产总计		144,900,558,584.05	101,930,356,027.35

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 7.5895 元，基金份额总额 19,064,568,617.00 份。

7.2 利润表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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		37,041,729,081.20	16,237,806,137.87
1.利息收入		47,190,024.59	72,072,905.24
其中：存款利息收入	7.4.7.9	46,146,818.21	31,026,570.20
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		1,043,206.38	-
其他利息收入		-	41,046,335.04
2.投资收益（损失以“-”填列）		19,713,250,515.17	7,659,030,083.37
其中：股票投资收益	7.4.7.10	16,819,843,355.48	5,877,316,983.36
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	41,155,126.27	4,249,839.45
资产支持证券投资	7.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	1,158,287,167.58	281,192,404.07
股利收益	7.4.7.15	1,693,964,865.84	1,496,270,856.49
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	17,236,294,241.88	8,333,774,042.53
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	44,994,299.56	172,929,106.73
减：二、营业总支出		245,341,700.44	476,853,139.16
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	175,738,646.97	373,232,316.45
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	58,579,549.04	77,125,479.20
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		4,173,600.34	1,161,694.67
8.其他费用	7.4.7.18	6,849,904.09	25,333,648.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		36,796,387,380.76	15,760,952,998.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		36,796,387,380.76	15,760,952,998.71
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		36,796,387,380.76	15,760,952,998.71

7.3 净资产变动表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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	54,479,152,465.75	-	47,270,593,603.14	101,749,746,068.89
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	54,479,152,465.75	-	47,270,593,603.14	101,749,746,068.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,895,863,479.61	-	38,044,865,119.35	42,940,728,598.96
（一）、综合收益总额	-	-	36,796,387,380.76	36,796,387,380.76
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	4,895,863,479.61	-	2,850,784,775.40	7,746,648,255.01
其中：1.基金申购款	57,478,433,760.50	-	58,393,550,631.43	115,871,984,391.93
2.基金赎回款	-52,582,570,280.89	-	-55,542,765,856.03	-108,125,336,136.92
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-1,602,307,036.81	-1,602,307,036.81
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	59,375,015,945.36	-	85,315,458,722.49	144,690,474,667.85
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	26,355,967,254.27	-	20,392,259,204.99	46,748,226,459.26
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	26,355,967,254.27	-	20,392,259,204.99	46,748,226,459.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	28,123,185,211.48	-	26,878,334,398.15	55,001,519,609.63
（一）、综合收益总额	-	-	15,760,952,998.71	15,760,952,998.71

(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)	28,123,185,211.48	-	12,323,772,998.72	40,446,958,210.20
其中: 1.基金申购款	88,520,450,523.48	-	59,983,835,468.31	148,504,285,991.79
2.基金赎回款	-60,397,265,312.00	-	-47,660,062,469.59	-108,057,327,781.59
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-1,206,391,599.28	-1,206,391,599.28
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	54,479,152,465.75	-	47,270,593,603.14	101,749,746,068.89

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

中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1727 号《关于核准中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准,由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司,已于 2018 年 1 月 4 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,147,543,632.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 075 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 2 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,147,553,216.00 份,其中通过基金管理人进行网下现金认购部分的认购资金利息折合 9,584.00 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证 500 指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；主要投资范围为标的指数的成份股和备选成份股；此外，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票以及存托凭证）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。

本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司以本基金为目标 ETF，根据《南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》的约定，于 2013 年 2 月 22 日将管理的南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）变更为南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）（以下简称“南方中证 500ETF 联接基金”）。南方中证 500ETF 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

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 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等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于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。本基金现无金融资产分类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。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为货币资金、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项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。

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损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本 and 努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该

工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 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约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。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。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。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。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可

转换债券、可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1

个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

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	247,566,223.06	105,789,664.10
等于：本金	247,273,363.57	105,716,306.14
加：应计利息	292,859.49	73,357.96
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	247,566,223.06	105,789,664.10

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	116,367,547,817.35	-	138,078,154,237.53	21,710,606,420.18
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券 交易所	14,610,000.00	224.15	14,610,224.15	-

	市场				
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	14,610,000.00	224.15	14,610,224.15	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		116,382,157,817.35	224.15	138,092,764,461.68	21,710,606,420.18
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		94,039,884,135.52	-	99,010,993,900.01	4,971,109,764.49
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		94,039,884,135.52	-	99,010,993,900.01	4,971,109,764.49

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	6,205,112,942.86	-	-	-
-股指期货	6,205,112,942.86	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,205,112,942.86	-	-	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,867,158,969.05	-	-	-
—股指期货	2,867,158,969.05	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,867,158,969.05	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2601	IC2601	427.00	636,674,080.00	38,305,977.14
IC2603	IC2603	4,024.00	5,928,639,680.00	321,894,840.00
合计				360,200,817.14
减：可抵销期货暂收款				360,200,817.14
净额				0.00

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的利率/货币/权益/其他衍生工具为国债/外汇/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债/外汇/股指/商品期货投资合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债/外汇/股指/商品期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	600,034,556.06	-
银行间市场	-	-
合计	600,034,556.06	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

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	6,574,985.65	7,303,757.32
其中：交易所市场	6,574,985.65	7,303,757.32
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应退退补款	171,504,967.61	138,403,444.53
预提费用	220,000.00	200,000.00
应付指数使用费	-	8,505,967.86
可退替代款	4,648,048.04	206,427.97
合计	182,948,001.30	154,619,597.68

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	17,492,568,617.00	54,479,152,465.75
本期申购	18,455,600,000.00	57,478,433,760.50
本期赎回（以“-”号填列）	-16,883,600,000.00	-52,582,570,280.89
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	19,064,568,617.00	59,375,015,945.36

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	105,323,809,135.72	-58,053,215,532.58	47,270,593,603.14
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	105,323,809,135.72	-58,053,215,532.58	47,270,593,603.14
本期利润	19,560,093,138.88	17,236,294,241.88	36,796,387,380.76
本期基金份额交易产生的变动数	9,981,659,745.94	-7,130,874,970.54	2,850,784,775.40
其中：基金申购款	115,735,533,560.86	-57,341,982,929.43	58,393,550,631.43

基金赎回款	-105,753,873,814.92	50,211,107,958.89	-55,542,765,856.03
本期已分配利润	-1,602,307,036.81	-	-1,602,307,036.81
本期末	133,263,254,983.73	-47,947,796,261.24	85,315,458,722.49

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	4,171,901.54	6,368,406.27
定期存款利息收入	-	6,549,722.14
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	41,887,968.91	17,742,268.44
其他	86,947.76	366,173.35
合计	46,146,818.21	31,026,570.20

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	12,028,141,108.74	3,900,243,534.36
股票投资收益——赎回差价收入	4,791,702,246.74	1,977,073,449.00
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	16,819,843,355.48	5,877,316,983.36

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	89,340,607,664.54	82,926,099,671.03
减：卖出股票成本总额	77,237,882,902.89	78,953,774,157.84
减：交易费用	74,583,652.91	72,081,978.83
买卖股票差价收入	12,028,141,108.74	3,900,243,534.36

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	108,125,336,136.92	108,057,327,781.59
减：现金支付赎回款总额	54,904,162,440.92	54,683,201,212.59
减：赎回股票成本总额	48,429,471,449.26	51,397,053,120.00
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	4,791,702,246.74	1,977,073,449.00

7.4.7.11 基金投资收益

无。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	10,078.02	11,913.98
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付）差 价收入	41,145,048.25	4,237,925.47
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	41,155,126.27	4,249,839.45

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	163,718,252.21	83,420,533.19
减：卖出债券（债转股及债 券到期兑付）成本总额	122,556,500.00	79,167,000.00
减：应计利息总额	10,156.15	12,271.30
减：交易费用	6,547.81	3,336.42
买卖债券差价收入	41,145,048.25	4,237,925.47

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股指期货-投资收益	1,158,287,167.58	281,192,404.07

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	1,693,964,865.84	1,496,270,856.49
其中：证券出借权益补偿收入	-	72,685,790.56
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,693,964,865.84	1,496,270,856.49

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	16,739,496,655.69	8,442,118,559.25
——股票投资	16,739,496,655.69	8,442,118,559.25
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	496,797,586.19	-108,344,516.72
——权证投资	-	-
——期货投资	496,797,586.19	-108,344,516.72
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	17,236,294,241.88	8,333,774,042.53

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	44,994,299.56	172,929,106.73
合计	44,994,299.56	172,929,106.73

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

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	6,469,823.83	24,996,905.53
银行费用	81,943.49	77,174.04
其他	78,136.77	59,569.27
合计	6,849,904.09	25,333,648.84

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本基金的基金管理人已发布的本基金分红公告，向截至 2026 年 1 月 15 日止登记在册的全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.6200 元。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司（“南方基金”）	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
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
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
南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）（“南方中证 500ETF 联接（LOF）基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

华泰金融控股（香港）有限公司（“华泰香港”）	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
------------------------	-------------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	30,523,299,072.72	16.74%	93,871,819,861.13	50.30%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	-	-	70,814,885.83	84.89%

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华泰证券	1,100,000,000.00	50.00%	-	-

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	3,050,517.37	16.73%	1,685,899.92	25.64%

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	9,387,795.03	50.31%	1,181,875.02	16.18%

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	175,738,646.97	373,232,316.45
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,853,592.85	2,957,805.24
应支付基金管理人的净管理费	165,885,054.12	370,274,511.21

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% ÷ 当年天数。

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	58,579,549.04	77,125,479.20

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% ÷ 当年天数。

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

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

单位：人民币元

本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间（%）	加权平均费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-

上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间（%）	加权平均费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	21,611,343,851.00	1~4.3	1.07	10,381,431.10	-	-

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
华泰金融控股（香港）有限公司—自有资金	10,000.00	0.00%	-	-
华泰证券股份有限公司	244,841,519.00	1.28%	29,036,451.00	0.17%
兴业证券股份有限公司	33,527,727.00	0.18%	48,009,322.00	0.27%
中国农业银行—南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	1,008,628,500.00	5.29%	1,436,259,408.00	8.21%

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
中国农业银行	247,566,223.06	4,171,901.54	105,789,664.10	6,368,406.27

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	266,319	26,631,900.00
华泰联合	688802	沐曦股份	网下申购	2,034	212,878.44
华泰联合	301458	钧崑电子	网下申购	7,005	72,852.00
华泰联合	603092	德力佳	网下申购	1,454	67,872.72
华泰联合	603014	威高血净	网下申购	2,045	54,192.50
华泰联合	688757	胜科纳米	网下申购	5,357	48,641.56
华泰联合	603370	华新精科	网下申购	811	15,084.60
兴业证券	110099	福能转债	配债	221,560	22,156,000.00
兴业证券	301609	山大电力	网下申购	2,762	40,490.92

上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	688709	成都华微	网下申购	10,448	163,929.12
华泰联合	301606	绿联科技	网下申购	3,959	83,970.39
华泰联合	688605	先锋精科	网下申购	7,433	83,918.57
华泰联合	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
华泰联合	301622	英思特	网下申购	3,056	68,332.16
华泰联合	301587	中瑞股份	网下申购	3,056	66,406.88
兴业证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

单位：人民币元

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2025 年 1 月 15 日	2025 年 1 月 16 日	-	0.9100	1,602,307,036.81	-	1,602,307,036.81	-
合计	-	-	-	0.9100	1,602,307,036.81	-	1,602,307,036.81	-

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

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300724	捷佳伟创	2025 年 8 月 12 日	6 个月	大宗受限锁定	59.10	91.92	1,150,000	67,965,000.00	105,708,000.00	-
300724	捷佳伟创	2025 年 8 月 8 日	6 个月	大宗受限锁定	59.50	92.47	840,000	49,980,000.00	77,674,800.00	-
688220	翱捷科技	2025 年 10 月 9 日	6 个月	大宗受限锁定	99.46	77.64	780,000	77,578,800.00	60,559,200.00	-
688220	翱捷科技	2025 年 11 月 6 日	6 个月	大宗受限锁定	79.38	76.42	630,000	50,009,400.00	48,144,600.00	-
688220	翱捷科技	2025 年 10 月 24 日	6 个月	大宗受限锁定	85.10	77.06	503,307	42,831,425.70	38,784,837.42	-
30060	长川科	2025	6 个月	大宗	80.	95.	875,	70,000,00	83,615,00	-

4	技	年 9 月 24 日	月	受 限 锁 定	00	56	000	0.00	0.00	
688525	佰维存储	2025 年 10 月 9 日	6 个 月	大 宗 受 限 锁 定	93.87	104.38	450,000	42,241,500.00	46,971,000.00	-
688525	佰维存储	2025 年 11 月 13 日	6 个 月	大 宗 受 限 锁 定	126.34	103.03	316,600	39,999,244.00	32,619,298.00	-
688234	天岳先进	2025 年 11 月 20 日	6 个 月	大 宗 受 限 锁 定	70.00	81.13	800,000	56,000,000.00	64,904,000.00	-
300718	长盛轴承	2025 年 12 月 5 日	6 个 月	大 宗 受 限 锁 定	71.12	79.58	703,000	49,997,360.00	55,944,740.00	-
300748	金力永磁	2025 年 10 月 13 日	6 个 月	大 宗 受 限 锁 定	41.27	31.57	1,700,000	70,159,000.00	53,669,000.00	-
300957	贝泰妮	2025 年 9 月 8 日	6 个 月	大 宗 受 限 锁 定	44.58	38.82	900,000	40,122,000.00	34,938,000.00	-
603179	新泉股份	2025 年 10 月 9 日	6 个 月	大 宗 受 限 锁 定	75.57	68.33	390,000	29,472,300.00	26,648,700.00	-
300676	华大基因	2025 年 9 月 15 日	6 个 月	大 宗 受 限 锁 定	47.88	44.43	522,140	25,000,063.20	23,198,680.20	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	104.66	399.31	814	85,193.24	325,038.34	-
301656	联合动力	2025 年 9 月 17 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	12.48	25.46	7,395	92,289.60	188,276.70	-
68879	摩尔线	2025	6 个 月	新 股	114	416	344	39,312.32	143,165.9	-

5	程	年 11 月 26 日	月	锁 定 期	.28	.18			2	
001280	中国铀业	2025 年 11 月 25 日	6 个月	新 股 定 锁 期	17.89	45.36	2,277	40,735.53	103,284.72	-
688729	屹唐股份	2025 年 7 月 1 日	6 个月	新 股 定 锁 期	8.45	24.28	3,505	29,617.25	85,101.40	-
688809	强一股份	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新 股 定 锁 期	85.09	203.31	259	22,038.31	52,657.29	-
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	6 个月	新 股 定 锁 期	8.62	18.36	2,054	17,705.48	37,711.44	-
301638	南网数字	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新 股 定 锁 期	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	-
001386	马可波罗	2025 年 10 月 15 日	6 个月	新 股 定 锁 期	13.75	18.53	1,626	22,357.50	30,129.78	-
688727	恒坤新材	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新 股 定 锁 期	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-
001233	海安集团	2025 年 11 月 18 日	6 个月	新 股 定 锁 期	48.00	51.88	370	17,760.00	19,195.60	-
688796	百奥赛图	2025 年 12 月 2 日	6 个月	新 股 定 锁 期	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
688807	优迅股份	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新 股 定 锁 期	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-
30163	广东建	2025	6 个月	新 股	6.5	23.	656	4,303.36	15,534.08	-

2	科	年 8 月 5 日	月	锁 定 期	6	68				
301563	云汉芯城	2025 年 9 月 23 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	27. 00	133 .69	110	2,970.00	14,705.90	-
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	29. 06	52. 62	262	7,613.72	13,786.44	-
301491	汉桑科技	2025 年 7 月 29 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	28. 91	55. 11	245	7,082.95	13,501.95	-
301584	建发致新	2025 年 9 月 18 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	7.0 5	26. 82	447	3,151.35	11,988.54	-
688759	必贝特	2025 年 10 月 21 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	17. 78	25. 11	465	8,267.70	11,676.15	-
001369	双欣环保	2025 年 12 月 23 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	6.8 5	12. 89	897	6,144.45	11,562.33	-
301609	山大电力	2025 年 7 月 16 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	14. 66	40. 99	277	4,060.82	11,354.23	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	21. 93	54. 39	195	4,276.35	10,606.05	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	83. 06	117 .19	86	7,143.16	10,078.34	-
001221	悍高集团	2025 年 7 月 23 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	15. 43	56. 94	160	2,468.80	9,110.40	-
30166	纳百川	2025	6 个	新 股	22.	57.	151	3,417.13	8,617.57	-

7		年 12 月 10 日	月	锁 定 期	63	07				
688805	健信超导	2025 年 12 月 17 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
603418	友升股份	2025 年 9 月 16 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	-
603175	超颖电子	2025 年 10 月 17 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603092	德力佳	2025 年 10 月 30 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	46.68	55.66	146	6,815.28	8,126.36	-
001285	瑞立科密	2025 年 9 月 23 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	42.28	56.08	137	5,792.36	7,682.96	-
301668	昊创瑞通	2025 年 9 月 15 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
301449	天溯计量	2025 年 12 月 16 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
601026	道生天合	2025 年 10 月 9 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
301575	艾芬达	2025 年 9 月 3 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
603406	天富龙	2025 年 7 月 30 日	6 个 月	新 股 锁 定 期	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
60326	技源集	2025	6 个 月	新 股	10.	28.	155	1,686.40	4,355.50	-

2	团	年 7 月 16 日	月	锁 定 期	88	10				
603248	锡华科技	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新 股 锁 定 期	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新 股 锁 定 期	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
603370	华新精科	2025 年 8 月 27 日	6 个月	新 股 锁 定 期	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025 年 10 月 28 日	6 个月	新 股 锁 定 期	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603334	丰倍生物	2025 年 10 月 29 日	6 个月	新 股 锁 定 期	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-

7.4.12.1.2 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
118063	金 05 转债	2025 年 12 月 26 日	1 个月 内 (含)	配 债 未 上 市	100.00	100.00	146,100	14,610,000.00	14,610,224.15	-

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 单 价	数 量 (股)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
400174	中天	2023 年 8 月	暂停	0.14	-	-	18,775,114	31,284,231.12	2,628,515.96	-

	3	30 日	转 让							
--	---	------	--------	--	--	--	--	--	--	--

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，紧密跟踪中证 500 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约可能性很小，在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。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。

于本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占净资产的比例为 0.01%（上期末：本基金无债券投资）。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用组合证券形式，流动性风险相对较低。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	247,566,223.06	-	-	-	247,566,223.06
结算备付金	5,044,902,726.52	-	-	-	5,044,902,726.52
存出保证金	26,506,681.42	-	-	787,837,651.20	814,344,332.62
交易性金融	-	-	14,610,224.1	138,078,154,	138,092,764,

资产			5	237.53	461.68
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	600,034,556.06	-	-	-	600,034,556.06
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	100,946,284.11	100,946,284.11
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,919,010,187.06	-	14,610,224.15	138,966,938,172.84	144,900,558,584.05
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	401,521.30	401,521.30
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	17,352,119.86	17,352,119.86
应付托管费	-	-	-	5,784,039.98	5,784,039.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3,598,233.76	3,598,233.76
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	182,948,001.30	182,948,001.30
负债总计	-	-	-	210,083,916.	210,083,916.

				20	20
利率敏感度缺口	5,919,010,187.06	-	14,610,224.15	138,756,854,256.64	144,690,474,667.85
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	105,789,664.10	-	-	-	105,789,664.10
结算备付金	2,343,018,601.70	-	-	-	2,343,018,601.70
存出保证金	25,653,136.95	-	-	327,667,464.00	353,320,600.95
交易性金融资产	-	-	-	99,010,993,900.01	99,010,993,900.01
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	-	-	-	117,233,260.59	117,233,260.59
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,474,461,402.75	-	-	99,455,894,624.60	101,930,356,027.35
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	-	-	-	4,141,695.38	4,141,695.38
应付赎回款	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	13,836,571.02	13,836,571.02
应付托管费	-	-	-	4,612,190.34	4,612,190.34
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3,399,904.04	3,399,904.04
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	154,619,597.68	154,619,597.68
负债总计	-	-	-	180,609,958.46	180,609,958.46
利率敏感度缺口	2,474,461,402.75	-	-	99,275,284,666.14	101,749,746,068.89

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	138,078,154,237.53	95.43	99,010,993,900.01	97.31
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	138,078,154,237.53	95.43	99,010,993,900.01	97.31

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注“衍生金融资产/负债”）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2025 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2024 年 12 月 31 日 ）
	1.组合自身基准上升 5%	7,215,037,925.04	5,057,215,823.85
	2.组合自身基准下降 5%	-7,215,037,925.04	-5,057,215,823.85

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	137,320,833,968.04	98,446,310,875.37
第二层次	14,610,224.15	27,736.50
第三层次	757,320,269.49	564,655,288.14
合计	138,092,764,461.68	99,010,993,900.01

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	-	564,655,288.14	564,655,288.14
当期购买	-	1,137,064,132.90	1,137,064,132.90
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	701,872.26	701,872.26
转出第三层次	-	1,264,633,093.48	1,264,633,093.48
当期利得或损失总额	-	319,532,069.67	319,532,069.67
其中：计入损益的利得或损失	-	319,532,069.67	319,532,069.67
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	757,320,269.49	757,320,269.49
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	-	42,812,872.49	42,812,872.49
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	-	40,857,495.76	40,857,495.76
当期购买	-	670,941,700.00	670,941,700.00
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	449,081.99	449,081.99
转出第三层次	-	123,888,309.56	123,888,309.56
当期利得或损失总额	-	-23,704,680.05	-23,704,680.05
其中：计入损益的利得或损失	-	-23,704,680.05	-23,704,680.05
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	564,655,288.14	564,655,288.14
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	-	-21,716,840.56	-21,716,840.56

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	754,691,753.53	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.18~3.0791	负相关
停牌股票	2,628,515.96	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
限售股票	562,026,772.18	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2665~4.9648	负相关
停牌股票	2,628,515.96	经调整的净资产法	不适用	不适用	不适用

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	138,078,154,237.53	95.29
	其中：股票	138,078,154,237.53	95.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,610,224.15	0.01
	其中：债券	14,610,224.15	0.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	600,034,556.06	0.41
	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	5,292,468,949.58	3.65
8	其他各项资产	915,290,616.73	0.63
9	合计	144,900,558,584.05	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	658,311,827.78	0.45
B	采矿业	5,778,987,671.33	3.99
C	制造业	94,156,964,441.10	65.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,984,374,836.21	2.75
E	建筑业	1,126,488,624.04	0.78
F	批发和零售业	2,082,187,797.07	1.44
G	交通运输、仓储和邮政业	2,055,136,024.19	1.42
H	住宿和餐饮业	172,131,734.81	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,540,415,846.78	7.98
J	金融业	10,212,727,210.10	7.06
K	房地产业	976,001,772.88	0.67

L	租赁和商务服务业	1,719,481,436.14	1.19
M	科学研究和技术服务业	912,640,104.30	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	601,962,904.20	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	199,746,197.28	0.14
Q	卫生和社会工作	429,778,052.74	0.30
R	文化、体育和娱乐业	968,937,904.28	0.67
S	综合	497,931,599.94	0.34
	合计	138,074,205,985.17	95.43

8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	103,284.72	0.00
C	制造业	1,099,101.14	0.00
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	26,694.44	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,995.62	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,628,515.96	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	40,711.59	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,931,303.47	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	002837	英维克	8,515,596	910,232,056. 44	0.63
2	300136	信维通信	14,119,228	875,392,136. 00	0.61
3	002558	巨人网络	19,769,700	855,830,313. 00	0.59
4	002738	中矿资源	10,575,043	830,669,627. 65	0.57
5	600879	航天电子	38,545,761	821,795,624. 52	0.57
6	600118	中国卫星	8,609,065	817,430,721. 75	0.56
7	300450	先导智能	16,199,776	809,664,804. 48	0.56
8	600580	卧龙电驱	16,155,332	793,226,801. 20	0.55
9	600988	赤峰黄金	24,312,413	759,519,782. 12	0.52
10	000426	兴业银锡	20,894,138	743,831,312. 80	0.51
11	600487	亨通光电	29,015,195	717,545,772. 35	0.50
12	002202	金风科技	35,172,067	717,510,166. 80	0.50
13	601168	西部矿业	24,508,627	677,418,450. 28	0.47
14	002156	通富微电	17,915,620	675,418,874. 00	0.47
15	300604	长川科技	6,673,169	671,027,501. 39	0.46
16	600549	厦门钨业	16,254,982	667,429,560. 92	0.46
17	002532	天山铝业	41,161,600	665,994,688. 00	0.46
18	688347	华虹公司	6,077,517	655,581,758. 79	0.45
19	300115	长盈精密	13,986,421	650,368,576. 50	0.45
20	002353	杰瑞股份	9,054,849	641,354,954. 67	0.44
21	000933	神火股份	23,211,916	637,631,332. 52	0.44

22	002340	格林美	75,348,770	629,915,717. 20	0.44
23	600096	云天化	18,805,623	628,295,864. 43	0.43
24	301308	江波龙	2,519,784	616,943,914. 56	0.43
25	002261	拓维信息	18,434,963	610,197,275. 30	0.42
26	600143	金发科技	31,126,376	608,209,387. 04	0.42
27	300395	菲利华	6,054,616	607,277,984. 80	0.42
28	300857	协创数据	3,576,900	603,351,492. 00	0.42
29	300058	蓝色光标	51,964,932	598,636,016. 64	0.41
30	002195	岩山科技	83,429,626	591,516,048. 34	0.41
31	002851	麦格米特	6,526,757	587,865,002. 99	0.41
32	300339	润和软件	11,787,324	583,472,538. 00	0.40
33	300207	欣旺达	21,828,298	570,809,992. 70	0.39
34	688525	佰维存储	4,993,522	564,798,674. 38	0.39
35	002131	利欧股份	99,211,500	559,552,860. 00	0.39
36	688002	睿创微纳	5,511,034	555,512,227. 20	0.38
37	002517	恺英网络	25,292,513	553,147,259. 31	0.38
38	600885	宏发股份	18,013,181	547,600,702. 40	0.38
39	002966	苏州银行	65,998,523	547,127,755. 67	0.38
40	603228	景旺电子	7,333,862	536,031,973. 58	0.37
41	002402	和而泰	13,626,435	533,066,137. 20	0.37
42	601555	东吴证券	58,600,038	530,916,344. 28	0.37
43	688120	华海清科	3,532,504	530,158,200. 32	0.37

44	002436	兴森科技	25,022,210	529,720,185. 70	0.37
45	300223	北京君正	4,968,345	526,843,303. 80	0.36
46	300751	迈为股份	2,520,197	519,135,380. 03	0.36
47	600601	方正科技	44,132,400	517,231,728. 00	0.36
48	002273	水晶光电	20,525,943	515,611,688. 16	0.36
49	000831	中国稀土	10,878,640	505,204,041. 60	0.35
50	688122	西部超导	6,771,234	504,998,631. 72	0.35
51	002281	光迅科技	7,187,917	502,794,794. 15	0.35
52	002008	大族激光	12,177,186	501,578,291. 34	0.35
53	600157	永泰能源	317,551,588	498,555,993. 16	0.34
54	600673	东阳光	22,199,358	497,931,599. 94	0.34
55	688469	芯联集成	74,142,242	496,011,598. 98	0.34
56	002595	豪迈科技	5,851,953	494,548,548. 03	0.34
57	002130	沃尔核材	18,560,606	488,515,149. 92	0.34
58	002472	双环传动	9,981,500	473,222,915. 00	0.33
59	689009	九号公司	8,480,450	471,428,215. 50	0.33
60	002126	银轮股份	12,449,486	470,590,570. 80	0.33
61	300390	天华新能	8,572,860	468,163,884. 60	0.32
62	002128	电投能源	16,571,221	462,502,778. 11	0.32
63	002465	海格通信	29,328,998	461,931,718. 50	0.32
64	688361	中科飞测	3,009,772	460,465,018. 28	0.32
65	688777	中控技术	9,325,526	460,121,452. 84	0.32

66	600699	均胜电子	14,430,740	452,548,006. 40	0.31
67	002850	科达利	2,865,164	452,294,789. 04	0.31
68	600392	盛和资源	20,746,754	446,677,613. 62	0.31
69	688027	国盾量子	877,306	441,977,989. 74	0.31
70	688099	晶晨股份	5,062,194	441,575,182. 62	0.31
71	688235	百济神州	1,635,946	439,415,095. 60	0.30
72	301358	湖南裕能	6,765,294	437,443,910. 04	0.30
73	603659	璞泰来	15,850,190	433,344,194. 60	0.30
74	601162	天风证券	103,917,828	432,298,164. 48	0.30
75	300346	南大光电	10,062,882	431,697,637. 80	0.30
76	300454	深信服	3,742,930	431,035,818. 80	0.30
77	603129	春风动力	1,529,701	426,297,074. 68	0.29
78	002797	第一创业	61,977,489	425,785,349. 43	0.29
79	000878	云南铜业	20,735,165	425,278,234. 15	0.29
80	002138	顺络电子	11,914,645	423,327,336. 85	0.29
81	688578	艾力斯	4,054,348	422,260,344. 20	0.29
82	603979	金诚信	5,512,613	419,785,479. 95	0.29
83	601108	财通证券	47,947,092	418,098,642. 24	0.29
84	600021	上海电力	20,842,025	417,257,340. 50	0.29
85	300054	鼎龙股份	11,043,165	415,223,004. 00	0.29
86	688385	复旦微电	5,629,415	414,887,885. 50	0.29
87	002185	华天科技	37,761,666	414,245,476. 02	0.29

88	601099	太平洋	100,424,108	412,743,083. 88	0.29
89	000021	深科技	16,192,839	409,354,969. 92	0.28
90	600352	浙江龙盛	38,394,850	409,289,101. 00	0.28
91	002294	信立泰	8,248,390	408,707,724. 50	0.28
92	300037	新宙邦	7,775,005	407,410,262. 00	0.28
93	688213	思特威	4,266,330	405,685,319. 70	0.28
94	000960	锡业股份	14,531,493	405,138,024. 84	0.28
95	000783	长江证券	48,930,365	398,782,474. 75	0.28
96	300724	捷佳伟创	4,207,151	395,342,435. 60	0.27
97	600141	兴发集团	11,431,653	395,306,560. 74	0.27
98	000893	亚钾国际	8,196,976	393,208,938. 72	0.27
99	601717	中创智领	16,012,883	393,116,277. 65	0.27
100	600298	安琪酵母	8,956,499	391,757,266. 26	0.27
101	601198	东兴证券	28,190,852	391,289,025. 76	0.27
102	002078	太阳纸业	24,706,705	389,130,603. 75	0.27
103	601615	明阳智能	26,653,775	385,946,662. 00	0.27
104	600498	烽火通信	11,990,617	384,658,993. 36	0.27
105	300474	景嘉微	5,341,160	383,869,169. 20	0.27
106	002271	东方雨虹	28,231,065	383,660,173. 35	0.27
107	600536	中国软件	8,274,991	383,132,083. 30	0.26
108	603179	新泉股份	5,209,226	382,693,116. 88	0.26
109	688608	恒玄科技	1,671,877	379,415,766. 38	0.26

110	688676	金盘科技	4,143,295	374,305,270. 30	0.26
111	002414	高德红外	25,266,620	370,661,315. 40	0.26
112	300017	网宿科技	36,117,298	370,202,304. 50	0.26
113	688019	安集科技	1,694,597	369,286,578. 24	0.26
114	601696	中银证券	24,564,232	368,217,837. 68	0.25
115	300073	当升科技	6,359,528	367,580,718. 40	0.25
116	000657	中钨高新	13,253,200	367,246,172. 00	0.25
117	601233	桐昆股份	21,314,018	366,814,249. 78	0.25
118	300496	中科创达	5,414,091	365,451,142. 50	0.25
119	601665	齐鲁银行	63,495,146	364,462,138. 04	0.25
120	603606	东方电缆	6,038,140	360,778,865. 00	0.25
121	002444	巨星科技	10,562,644	359,341,148. 88	0.25
122	002080	中材科技	9,882,831	359,142,078. 54	0.25
123	300458	全志科技	8,534,788	358,717,139. 64	0.25
124	603087	甘李药业	5,261,159	358,127,093. 13	0.25
125	600884	杉杉股份	26,375,921	356,338,692. 71	0.25
126	688568	中科星图	6,036,256	356,139,104. 00	0.25
127	600109	国金证券	38,217,748	355,425,056. 40	0.25
128	002157	正邦科技	109,425,592	354,538,918. 08	0.25
129	688017	绿的谐波	1,843,149	354,068,922. 90	0.24
130	002085	万丰奥威	21,915,900	350,873,559. 00	0.24
131	601577	长沙银行	35,564,666	344,977,260. 20	0.24

132	601128	常熟银行	48,932,569	344,485,285. 76	0.24
133	300748	金力永磁	10,221,723	344,344,971. 53	0.24
134	688183	生益电子	3,573,825	341,979,314. 25	0.24
135	002155	湖南黄金	16,193,380	341,518,384. 20	0.24
136	002223	鱼跃医疗	8,868,816	338,877,459. 36	0.23
137	300699	光威复材	8,581,118	338,610,916. 28	0.23
138	601179	中国西电	37,045,319	337,112,402. 90	0.23
139	300012	华测检测	24,872,500	337,022,375. 00	0.23
140	300024	机器人	18,466,006	335,896,649. 14	0.23
141	000559	万向钱潮	19,420,048	334,024,825. 60	0.23
142	300757	罗博特科	1,431,723	334,020,975. 90	0.23
143	300002	神州泰岳	28,904,200	332,976,384. 00	0.23
144	600363	联创光电	5,273,093	332,521,244. 58	0.23
145	000423	东阿阿胶	6,702,165	328,942,258. 20	0.23
146	002624	完美世界	20,056,497	328,725,985. 83	0.23
147	000034	神州数码	8,415,608	327,451,307. 28	0.23
148	300373	扬杰科技	4,798,059	326,268,012. 00	0.23
149	600497	驰宏锌锗	44,598,440	326,014,596. 40	0.23
150	300919	中伟股份	7,000,095	324,314,401. 35	0.22
151	300285	国瓷材料	11,826,831	324,173,437. 71	0.22
152	002683	广东宏大	6,776,064	323,895,859. 20	0.22
153	603160	汇顶科技	4,099,938	323,895,102. 00	0.22

154	000728	国元证券	38,669,552	322,890,759. 20	0.22
155	688599	天合光能	19,303,411	319,471,452. 05	0.22
156	603596	伯特利	6,227,469	319,282,335. 63	0.22
157	002064	华峰化学	28,623,676	314,860,436. 00	0.22
158	002409	雅克科技	4,218,683	312,604,410. 30	0.22
159	002673	西部证券	39,581,687	312,299,510. 43	0.22
160	603920	世运电路	6,328,674	306,371,108. 34	0.21
161	600765	中航重机	15,970,238	305,989,760. 08	0.21
162	002410	广联达	24,317,740	305,917,169. 20	0.21
163	600079	ST 人福	16,767,894	303,666,560. 34	0.21
164	002065	东华软件	33,053,618	302,440,604. 70	0.21
165	300003	乐普医疗	19,076,540	301,600,097. 40	0.21
166	688220	翱捷科技	3,753,049	299,469,724. 04	0.21
167	000733	振华科技	5,709,400	299,229,654. 00	0.21
168	600637	东方明珠	29,863,796	294,158,390. 60	0.20
169	002335	科华数据	5,296,700	294,125,751. 00	0.20
170	002756	永兴材料	5,417,682	293,909,248. 50	0.20
171	688617	惠泰医疗	1,206,894	293,601,103. 38	0.20
172	000997	新大陆	10,366,604	293,582,225. 28	0.20
173	603766	隆鑫通用	18,216,764	293,472,068. 04	0.20
174	600873	梅花生物	28,930,116	293,062,075. 08	0.20
175	600862	中航高科	12,341,949	291,640,254. 87	0.20

176	002318	久立特材	10,063,900	291,349,905. 00	0.20
177	601231	环旭电子	9,667,686	290,030,580. 00	0.20
178	000932	华菱钢铁	50,962,716	286,410,463. 92	0.20
179	000703	恒逸石化	26,588,600	286,359,222. 00	0.20
180	000683	博源化工	38,444,400	286,026,336. 00	0.20
181	600060	海信视像	11,620,332	282,141,660. 96	0.19
182	300627	华测导航	8,080,890	282,103,869. 90	0.19
183	000528	柳工	23,763,153	282,068,626. 11	0.19
184	605589	圣泉集团	9,964,682	282,000,500. 60	0.19
185	000830	鲁西化工	16,929,398	280,520,124. 86	0.19
186	600909	华安证券	41,336,679	280,262,683. 62	0.19
187	000750	国海证券	65,913,476	279,473,138. 24	0.19
188	300001	特锐德	10,874,621	279,260,267. 28	0.19
189	300570	太辰光	2,411,100	278,602,605. 00	0.19
190	603486	科沃斯	3,437,512	277,338,468. 16	0.19
191	002821	凯莱英	2,981,523	277,072,932. 39	0.19
192	605358	立昂微	7,955,233	277,001,213. 06	0.19
193	000623	吉林敖东	14,099,390	275,361,086. 70	0.19
194	688234	天岳先进	3,153,202	274,056,593. 76	0.19
195	000039	中集集团	27,123,966	273,680,816. 94	0.19
196	000887	中鼎股份	11,711,229	271,817,625. 09	0.19
197	688180	君实生物	7,939,799	271,223,533. 84	0.19

198	688065	凯赛生物	5,430,532	270,440,493. 60	0.19
199	000400	许继电气	10,497,409	269,888,385. 39	0.19
200	600737	中粮糖业	15,611,289	268,670,283. 69	0.19
201	300972	万辰集团	1,331,209	267,666,193. 63	0.18
202	300567	精测电子	2,927,949	267,028,948. 80	0.18
203	601799	星宇股份	2,164,426	267,025,235. 62	0.18
204	000060	中金岭南	45,616,017	266,853,699. 45	0.18
205	600332	白云山	10,356,400	266,573,736. 00	0.18
206	300383	光环新网	21,225,928	265,536,359. 28	0.18
207	688629	华丰科技	2,646,278	264,786,576. 68	0.18
208	600369	西南证券	58,751,870	263,208,377. 60	0.18
209	603444	吉比特	620,800	263,126,080. 00	0.18
210	000009	中国宝安	26,610,750	262,115,887. 50	0.18
211	300677	英科医疗	6,735,563	262,013,400. 70	0.18
212	600171	上海贝岭	8,381,121	261,910,031. 25	0.18
213	688322	奥比中光	2,906,064	260,586,758. 88	0.18
214	688052	纳芯微	1,637,646	259,042,844. 28	0.18
215	600177	雅戈尔	34,076,177	258,978,945. 20	0.18
216	600521	华海药业	15,229,681	258,447,686. 57	0.18
217	601990	南京证券	32,614,995	258,310,760. 40	0.18
218	688387	信科移动	20,015,918	258,205,342. 20	0.18
219	300142	沃森生物	23,564,089	257,084,210. 99	0.18

220	002203	海亮股份	20,297,080	256,961,032. 80	0.18
221	601212	白银有色	43,887,291	256,740,652. 35	0.18
222	600704	物产中大	45,984,816	256,135,425. 12	0.18
223	001696	宗申动力	11,794,561	255,824,028. 09	0.18
224	603568	伟明环保	10,027,694	254,502,873. 72	0.18
225	002152	广电运通	18,333,473	253,185,262. 13	0.17
226	300763	锦浪科技	3,545,443	253,180,084. 63	0.17
227	601997	贵阳银行	43,115,960	253,090,685. 20	0.17
228	600486	扬农化工	3,626,649	251,653,174. 11	0.17
229	688702	盛科通信	1,764,007	249,942,151. 83	0.17
230	000738	航发控制	11,664,562	248,571,816. 22	0.17
231	300432	富临精工	14,803,271	247,214,625. 70	0.17
232	002429	兆驰股份	33,302,020	247,100,988. 40	0.17
233	688266	泽璟制药	2,658,387	246,432,474. 90	0.17
234	002007	华兰生物	16,190,991	244,969,693. 83	0.17
235	688018	乐鑫科技	1,435,362	244,011,540. 00	0.17
236	002841	视源股份	6,156,951	243,999,968. 13	0.17
237	002044	美年健康	46,208,963	243,983,324. 64	0.17
238	600208	衢州发展	62,791,830	243,004,382. 10	0.17
239	600801	华新建材	9,889,737	242,694,145. 98	0.17
240	603605	珀莱雅	3,543,548	242,662,167. 04	0.17
241	603345	安井食品	3,060,151	242,608,771. 28	0.17

242	600378	昊华科技	7,581,880	242,316,884. 80	0.17
243	002939	长城证券	23,754,770	242,298,654. 00	0.17
244	002739	万达电影	21,385,718	242,086,327. 76	0.17
245	601611	中国核建	17,806,457	240,031,040. 36	0.17
246	600435	北方导航	15,565,443	240,019,131. 06	0.17
247	601216	君正集团	49,686,040	239,486,712. 80	0.17
248	603699	纽威股份	4,585,756	238,321,739. 32	0.16
249	601567	三星医疗	10,352,170	238,306,953. 40	0.16
250	600153	建发股份	25,692,242	237,653,238. 50	0.16
251	600516	方大炭素	41,361,373	235,346,212. 37	0.16
252	600499	科达制造	16,964,095	235,291,997. 65	0.16
253	002056	横店东磁	12,042,194	234,822,783. 00	0.16
254	688375	国博电子	2,521,134	234,742,786. 74	0.16
255	000729	燕京啤酒	20,792,404	233,498,696. 92	0.16
256	300487	蓝晓科技	3,763,184	232,376,612. 00	0.16
257	688615	合合信息	993,141	226,019,028. 78	0.16
258	603816	顾家家居	7,320,764	225,040,285. 36	0.16
259	000519	中兵红箭	12,334,176	224,605,344. 96	0.16
260	688188	柏楚电子	1,648,086	223,958,406. 54	0.15
261	688778	厦钨新能	2,876,671	222,568,035. 27	0.15
262	601958	金钼股份	14,244,183	221,924,371. 14	0.15
263	600316	洪都航空	6,347,730	221,599,254. 30	0.15

264	301611	珂玛科技	2,580,600	221,234,838.00	0.15
265	688166	博瑞医药	4,508,275	221,175,971.50	0.15
266	603379	三美股份	3,631,017	220,475,352.24	0.15
267	600348	华阳股份	26,564,603	219,423,620.78	0.15
268	603728	鸣志电器	3,031,692	219,342,916.20	0.15
269	600642	申能股份	28,173,483	219,189,697.74	0.15
270	002430	杭氧股份	7,314,082	218,471,629.34	0.15
271	600038	中直股份	6,030,894	217,896,200.22	0.15
272	000155	川能动力	18,665,670	217,455,055.50	0.15
273	002262	恩华药业	8,991,172	216,956,980.36	0.15
274	600563	法拉电子	2,066,938	216,925,143.10	0.15
275	688538	和辉光电	81,516,583	216,834,110.78	0.15
276	000415	渤海租赁	53,523,300	216,769,365.00	0.15
277	600863	内蒙华电	48,147,354	215,700,145.92	0.15
278	002926	华西证券	23,229,476	215,569,537.28	0.15
279	688772	珠海冠宇	9,995,657	215,206,495.21	0.15
280	603806	福斯特	15,377,931	214,675,916.76	0.15
281	600398	海澜之家	35,378,127	214,037,668.35	0.15
282	603156	养元饮品	7,430,631	213,630,641.25	0.15
283	000723	美锦能源	45,403,666	213,397,230.20	0.15
284	688114	华大智造	3,510,688	213,309,402.88	0.15
285	300679	电连技术	4,377,136	213,078,980.48	0.15

286	000629	钒钛股份	68,709,837	213,000,494. 70	0.15
287	603338	浙江鼎力	3,757,625	212,831,880. 00	0.15
288	600967	内蒙一机	12,612,927	211,897,173. 60	0.15
289	600820	隧道股份	32,460,521	210,668,781. 29	0.15
290	002603	以岭药业	12,327,559	210,431,432. 13	0.15
291	600901	江苏金租	34,203,009	209,322,415. 08	0.14
292	600312	平高电气	12,053,832	209,133,985. 20	0.14
293	601699	潞安环能	17,707,795	208,951,981. 00	0.14
294	600562	国睿科技	7,380,421	208,570,697. 46	0.14
295	688692	达梦数据	797,484	208,358,644. 68	0.14
296	600170	上海建工	78,462,740	207,926,261. 00	0.14
297	603077	和邦生物	91,263,628	206,255,799. 28	0.14
298	603298	杭叉集团	7,758,168	206,134,523. 76	0.14
299	600166	福田汽车	69,860,138	203,991,602. 96	0.14
300	001389	广合科技	2,491,461	203,377,961. 43	0.14
301	002025	航天电器	4,046,200	202,836,006. 00	0.14
302	601399	国机重装	42,377,705	202,565,429. 90	0.14
303	002958	青农商行	65,340,100	202,554,310. 00	0.14
304	002385	大北农	50,614,529	202,458,116. 00	0.14
305	600970	中材国际	19,423,812	201,813,406. 68	0.14
306	601106	中国一重	50,549,827	201,693,809. 73	0.14
307	300623	捷捷微电	7,412,372	201,394,147. 24	0.14

308	603737	三棵树	4,346,326	201,104,504. 02	0.14
309	002607	中公教育	72,900,072	199,746,197. 28	0.14
310	003031	中瓷电子	2,706,448	198,003,735. 68	0.14
311	300676	华大基因	4,330,240	195,934,096. 20	0.14
312	600008	首创环保	64,960,901	194,882,703. 00	0.13
313	688297	中无人机	4,054,182	194,681,819. 64	0.13
314	603939	益丰药房	8,931,676	193,996,002. 72	0.13
315	002984	森麒麟	9,145,900	193,618,703. 00	0.13
316	688278	特宝生物	2,313,684	193,609,077. 12	0.13
317	002432	九安医疗	4,832,276	193,484,331. 04	0.13
318	603885	吉祥航空	12,979,225	193,130,868. 00	0.13
319	300100	双林股份	4,858,051	192,475,980. 62	0.13
320	000050	深天马 A	21,265,148	192,024,286. 44	0.13
321	600329	达仁堂	4,202,055	191,697,749. 10	0.13
322	600282	南钢股份	36,435,285	191,649,599. 10	0.13
323	601991	大唐发电	54,908,135	191,629,391. 15	0.13
324	688582	芯动联科	2,893,967	191,320,158. 37	0.13
325	002500	山西证券	31,822,517	190,616,876. 83	0.13
326	600998	九州通	37,181,012	190,366,781. 44	0.13
327	300144	宋城演艺	23,211,620	190,103,167. 80	0.13
328	600132	重庆啤酒	3,598,773	187,999,901. 52	0.13
329	600380	健康元	16,196,554	187,070,198. 70	0.13

330	600095	湘财股份	16,855,823	186,425,402. 38	0.13
331	601155	新城控股	13,360,617	186,380,607. 15	0.13
332	600763	通策医疗	4,620,610	185,794,728. 10	0.13
333	002244	滨江集团	18,372,895	184,647,594. 75	0.13
334	000513	丽珠集团	5,335,201	183,851,026. 46	0.13
335	600390	五矿资本	33,125,610	183,847,135. 50	0.13
336	002583	海能达	16,195,400	183,331,928. 00	0.13
337	002312	川发龙蟒	16,709,765	182,637,731. 45	0.13
338	688301	奕瑞科技	1,799,379	181,935,210. 69	0.13
339	000987	越秀资本	22,276,712	181,332,435. 68	0.13
340	300146	汤臣倍健	15,009,867	180,268,502. 67	0.12
341	000591	太阳能	40,511,900	179,872,836. 00	0.12
342	603589	口子窖	5,981,869	179,755,163. 45	0.12
343	600583	海油工程	32,599,830	178,973,066. 70	0.12
344	601608	中信重工	26,923,582	177,426,405. 38	0.12
345	600995	南网储能	14,106,247	177,315,524. 79	0.12
346	601865	福莱特	11,313,905	177,288,891. 35	0.12
347	600985	淮北矿业	15,910,465	176,765,266. 15	0.12
348	300558	贝达药业	3,768,504	175,951,451. 76	0.12
349	601880	辽港股份	108,698,791	173,918,065. 60	0.12
350	600977	中国电影	11,045,239	173,631,157. 08	0.12
351	688728	格科微	11,581,266	173,024,114. 04	0.12

352	600685	中船防务	6,053,184	172,213,084. 80	0.12
353	601666	平煤股份	21,876,078	172,164,733. 86	0.12
354	600754	锦江酒店	6,811,703	172,131,734. 81	0.12
355	601156	东航物流	9,331,938	171,800,978. 58	0.12
356	003021	兆威机电	1,379,860	171,351,014. 80	0.12
357	000921	海信家电	6,903,633	171,279,134. 73	0.12
358	600602	云赛智联	9,085,700	169,811,733. 00	0.12
359	300735	光弘科技	6,801,700	169,090,262. 00	0.12
360	002568	百润股份	7,752,724	169,086,910. 44	0.12
361	601016	节能风电	57,233,114	168,837,686. 30	0.12
362	603225	新凤鸣	8,629,831	167,936,511. 26	0.12
363	601000	唐山港	43,640,312	167,578,798. 08	0.12
364	600535	天士力	11,058,549	166,652,333. 43	0.12
365	603290	斯达半导	1,720,840	165,355,515. 60	0.11
366	600848	上海临港	14,099,170	164,960,289. 00	0.11
367	600004	白云机场	17,423,847	164,829,592. 62	0.11
368	600816	建元信托	58,239,413	164,817,538. 79	0.11
369	603927	中科软	8,564,407	163,494,529. 63	0.11
370	002773	康弘药业	5,425,651	162,606,760. 47	0.11
371	000032	深桑达 A	8,396,737	162,476,860. 95	0.11
372	601001	晋控煤业	12,339,340	162,262,321. 00	0.11
373	600126	杭钢股份	19,848,504	161,963,792. 64	0.11

374	002266	浙富控股	38,441,319	159,915,887. 04	0.11
375	600511	国药股份	5,555,518	159,721,142. 50	0.11
376	000825	太钢不锈	32,510,748	158,977,557. 72	0.11
377	002423	中粮资本	13,572,027	158,792,715. 90	0.11
378	000598	兴蓉环境	21,945,059	157,346,073. 03	0.11
379	603650	彤程新材	3,559,829	157,130,852. 06	0.11
380	601966	玲珑轮胎	10,772,177	156,519,731. 81	0.11
381	000563	陕国投 A	45,347,786	156,449,861. 70	0.11
382	600598	北大荒	10,461,476	156,399,066. 20	0.11
383	600483	福能股份	16,393,990	155,251,085. 30	0.11
384	603000	人民网	8,148,737	155,233,439. 85	0.11
385	002831	裕同科技	5,410,786	154,261,508. 86	0.11
386	000958	电投产融	23,785,900	153,894,773. 00	0.11
387	301536	星宸科技	2,565,175	153,679,634. 25	0.11
388	000062	深圳华强	6,169,775	151,899,860. 50	0.10
389	600517	国网英大	25,267,173	151,855,709. 73	0.10
390	002299	圣农发展	9,177,952	151,803,326. 08	0.10
391	601918	新集能源	22,949,613	151,696,941. 93	0.10
392	600739	辽宁成大	13,567,013	151,679,205. 34	0.10
393	601333	广深铁路	49,865,900	151,592,336. 00	0.10
394	002439	启明星辰	10,688,269	150,918,358. 28	0.10
395	600578	京能电力	29,583,415	150,875,416. 50	0.10

396	600808	马钢股份	35,211,194	148,591,238. 68	0.10
397	688561	奇安信	4,172,756	148,466,658. 48	0.10
398	601118	海南橡胶	25,192,110	147,373,843. 50	0.10
399	600546	山煤国际	14,583,246	147,144,952. 14	0.10
400	600655	豫园股份	28,641,648	146,931,654. 24	0.10
401	603899	晨光股份	5,425,985	146,827,154. 10	0.10
402	688318	财富趋势	1,108,903	146,730,044. 96	0.10
403	603688	石英股份	4,001,614	146,379,040. 12	0.10
404	000951	中国重汽	8,658,004	146,320,267. 60	0.10
405	603341	龙旗科技	3,457,518	146,114,710. 68	0.10
406	601866	中远海发	57,956,091	146,049,349. 32	0.10
407	300601	康泰生物	9,848,100	145,456,437. 00	0.10
408	300718	长盛轴承	1,737,200	144,224,052. 00	0.10
409	002120	韵达股份	21,368,206	144,021,708. 44	0.10
410	002670	国盛证券	8,550,292	143,986,917. 28	0.10
411	600131	国网信通	8,850,938	142,854,139. 32	0.10
412	600566	济川药业	5,424,743	142,670,740. 90	0.10
413	600582	天地科技	24,347,902	141,948,268. 66	0.10
414	000739	普洛药业	8,671,360	141,083,027. 20	0.10
415	000883	湖北能源	30,993,594	140,710,916. 76	0.10
416	000709	河钢股份	60,741,800	140,313,558. 00	0.10
417	603833	欧派家居	2,690,829	140,165,282. 61	0.10

418	688281	华秦科技	1,897,019	140,000,002. 20	0.10
419	300529	健帆生物	7,096,600	139,590,122. 00	0.10
420	601598	中国外运	22,867,264	138,575,619. 84	0.10
421	600663	陆家嘴	17,384,418	137,510,746. 38	0.10
422	600707	彩虹股份	21,157,124	137,309,734. 76	0.09
423	000027	深圳能源	21,027,562	137,099,704. 24	0.09
424	002508	老板电器	7,079,953	136,997,090. 55	0.09
425	000967	盈峰环境	18,623,714	136,698,060. 76	0.09
426	000088	盐田港	30,398,383	135,272,804. 35	0.09
427	600528	中铁工业	16,467,424	134,703,528. 32	0.09
428	603786	科博达	1,697,593	132,582,013. 30	0.09
429	300888	稳健医疗	3,467,300	131,202,632. 00	0.09
430	002153	石基信息	12,066,303	130,678,061. 49	0.09
431	600871	石化油服	59,975,569	129,547,229. 04	0.09
432	000582	北部湾港	13,666,560	128,192,332. 80	0.09
433	688709	成都华微	2,782,338	127,959,724. 62	0.09
434	600906	财达证券	19,098,056	127,384,033. 52	0.09
435	600959	江苏有线	36,897,449	126,927,224. 56	0.09
436	300070	碧水源	32,105,407	125,853,195. 44	0.09
437	603565	中谷物流	12,375,637	124,251,395. 48	0.09
438	688172	燕东微	4,281,486	123,906,204. 84	0.09
439	603858	步长制药	7,906,026	123,650,246. 64	0.09

440	002265	建设工业	4,581,981	122,888,730. 42	0.08
441	688363	华熙生物	2,782,397	121,535,100. 96	0.08
442	603233	大参林	6,842,015	120,556,304. 30	0.08
443	688425	铁建重工	23,528,721	119,290,615. 47	0.08
444	300957	贝泰妮	3,021,200	118,958,732. 00	0.08
445	601098	中南传媒	10,556,064	118,861,280. 64	0.08
446	003022	联泓新科	5,952,284	117,914,746. 04	0.08
447	601061	中信金属	8,040,550	115,783,920. 00	0.08
448	600968	海油发展	29,875,079	114,720,303. 36	0.08
449	688192	迪哲医药	1,987,137	114,459,091. 20	0.08
450	600764	中国海防	4,185,619	114,434,823. 46	0.08
451	603529	爱玛科技	3,815,069	113,307,549. 30	0.08
452	688563	航材股份	1,936,367	113,180,651. 15	0.08
453	601928	凤凰传媒	11,267,948	113,130,197. 92	0.08
454	000959	首钢股份	22,913,752	112,277,384. 80	0.08
455	600062	华润双鹤	6,116,480	111,870,419. 20	0.08
456	688248	南网科技	2,451,817	109,694,292. 58	0.08
457	600295	鄂尔多斯	8,780,805	108,530,749. 80	0.08
458	301498	乖宝宠物	1,664,102	108,416,245. 30	0.07
459	002032	苏泊尔	2,432,518	107,225,393. 44	0.07
460	000785	居然智家	36,599,300	106,869,956. 00	0.07
461	688336	三生国健	1,771,711	105,540,824. 27	0.07

462	301200	大族数控	874,133	103,820,776.41	0.07
463	600606	绿地控股	62,392,936	103,572,273.76	0.07
464	001286	陕西能源	11,093,168	103,277,394.08	0.07
465	600098	广州发展	15,469,519	101,170,654.26	0.07
466	000537	绿发电力	12,177,605	99,978,137.05	0.07
467	301301	川宁生物	9,839,900	99,776,586.00	0.07
468	601965	中国汽研	5,913,160	98,158,456.00	0.07
469	002372	伟星新材	9,384,431	97,879,615.33	0.07
470	600720	中交设计	13,080,956	94,444,502.32	0.07
471	603658	安图生物	2,560,977	90,709,805.34	0.06
472	000429	粤高速 A	7,699,386	90,698,767.08	0.06
473	600688	上海石化	32,434,357	90,167,512.46	0.06
474	000898	鞍钢股份	35,416,048	89,602,601.44	0.06
475	688349	三一重能	3,524,101	89,089,273.28	0.06
476	601139	深圳燃气	12,818,274	84,600,608.40	0.06
477	688100	威胜信息	2,135,882	83,940,162.60	0.06
478	600339	中油工程	24,941,859	83,555,227.65	0.06
479	000937	冀中能源	15,499,184	83,385,609.92	0.06
480	002608	江苏国信	11,162,735	82,492,611.65	0.06
481	688520	神州细胞	1,877,255	81,303,914.05	0.06
482	688295	中复神鹰	2,433,233	79,834,374.73	0.06
483	601019	山东出版	9,236,361	79,802,159.04	0.06

484	600032	浙江新能	10,616,468	78,668,027.88	0.05
485	003035	南网能源	16,896,590	77,386,382.20	0.05
486	601228	广州港	22,322,575	72,325,143.00	0.05
487	688475	萤石网络	2,306,309	69,442,963.99	0.05
488	600927	永安期货	4,319,711	69,417,755.77	0.05
489	603049	中策橡胶	1,191,424	66,660,172.80	0.05
490	688819	天能股份	1,988,529	66,058,933.38	0.05
491	603707	健友股份	7,158,069	64,637,363.07	0.04
492	002945	华林证券	4,031,030	61,795,689.90	0.04
493	300140	节能环境	9,112,400	61,690,948.00	0.04
494	002461	珠江啤酒	6,514,300	60,517,847.00	0.04
495	600007	中国国贸	3,001,925	59,498,153.50	0.04
496	000539	粤电力 A	13,193,000	58,313,060.00	0.04
497	600299	安迪苏	5,920,661	53,108,329.17	0.04
498	001213	中铁特货	13,061,300	52,898,265.00	0.04
499	601921	浙版传媒	6,563,122	51,323,614.04	0.04
500	001221	悍高集团	445,861	25,819,655.31	0.02

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	18,775,114	2,628,515.96	0.00
2	688802	沐曦股份	814	325,038.34	0.00
3	301656	联合动力	7,395	188,276.70	0.00

4	688795	摩尔线程	344	143,165.92	0.00
5	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.00
6	688729	屹唐股份	3,505	85,101.40	0.00
7	688809	强一股份	259	52,657.29	0.00
8	688783	西安奕材	2,054	37,711.44	0.00
9	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.00
10	001386	马可波罗	1,626	30,129.78	0.00
11	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
12	001233	海安集团	370	19,195.60	0.00
13	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
14	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
15	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
16	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
17	688765	禾元生物	262	13,786.44	0.00
18	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
19	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
20	688759	必贝特	465	11,676.15	0.00
21	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
22	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
23	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
24	688790	昂瑞微	86	10,078.34	0.00
25	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
26	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
27	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
28	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
29	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
30	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
31	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
32	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
33	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
34	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
35	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
36	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
37	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
38	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
39	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
40	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
41	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产
----	------	------	----------	---------

				净值比例 (%)
1	300476	胜宏科技	1,263,086,061.54	1.24
2	300450	先导智能	758,646,907.46	0.75
3	300339	润和软件	757,183,491.49	0.74
4	000988	华工科技	664,236,610.99	0.65
5	000933	神火股份	649,467,985.01	0.64
6	002850	科达利	646,620,697.79	0.64
7	002128	电投能源	641,154,046.24	0.63
8	002851	麦格米特	638,806,562.17	0.63
9	688347	华虹公司	635,433,143.34	0.62
10	002130	沃尔核材	633,409,062.35	0.62
11	002402	和而泰	633,030,698.23	0.62
12	002966	苏州银行	618,094,797.33	0.61
13	002156	通富微电	606,661,154.31	0.60
14	300454	深信服	601,557,536.36	0.59
15	300751	迈为股份	595,176,618.85	0.58
16	300857	协创数据	586,962,657.43	0.58
17	002837	英维克	576,925,336.51	0.57
18	300604	长川科技	555,309,525.56	0.55
19	600601	方正科技	542,097,378.35	0.53
20	300207	欣旺达	540,975,665.54	0.53

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	300476	胜宏科技	3,904,242,343.01	3.84
2	000988	华工科技	1,802,712,740.02	1.77
3	002625	光启技术	1,312,606,903.62	1.29
4	600418	江淮汽车	1,136,564,692.65	1.12
5	300803	指南针	1,090,401,760.26	1.07
6	688521	芯原股份	971,994,323.49	0.96
7	002384	东山精密	951,596,346.94	0.94
8	688072	拓荆科技	790,621,905.53	0.78
9	000066	中国长城	790,037,599.24	0.78
10	300339	润和软件	753,399,160.34	0.74
11	300251	光线传媒	748,759,989.74	0.74
12	301236	软通动力	722,881,369.93	0.71
13	002850	科达利	627,409,448.09	0.62
14	603893	瑞芯微	615,956,758.68	0.61
15	300866	安克创新	571,379,370.93	0.56

16	002156	通富微电	558,523,955.95	0.55
17	300604	长川科技	537,605,613.64	0.53
18	300207	欣旺达	535,009,400.00	0.53
19	002340	格林美	526,289,972.93	0.52
20	002202	金风科技	517,284,707.36	0.51

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	93,031,198,005.09
卖出股票收入（成交）总额	89,340,607,664.54

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	14,610,224.15	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,610,224.15	0.01

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	118063	金 05 转债	146,100	14,610,224.15	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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	814,344,332.62
2	应收清算款	100,946,284.11
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	915,290,616.73
---	----	----------------

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	2,628,515.96	0.00	暂停转让
2	688802	沐曦股份	325,038.34	0.00	新股锁定期
3	301656	联合动力	188,276.70	0.00	新股锁定期
4	688795	摩尔线程	143,165.92	0.00	新股锁定期
5	001280	中国铀业	103,284.72	0.00	新股锁定期

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持 有的基 金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		南方中证 500 交易 型开放式指数证券 投资基金联接基金 (LOF)	
		持有份 额	占总份 额比例	持有份 额	占总份 额比例	持有份 额	占总份 额比例
176,268	108,156.72	16,576,993,251.00	86.95%	1,478,946,866.00	7.76%	1,008,628,500.00	5.29%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	中央汇金投资有限责任公司	8,235,101,633.00	43.20%
2	中央汇金资产管理有限责任公司	5,981,977,518.00	31.38%
3	华泰证券股份有限公司	244,841,519.00	1.28%
4	易方达基金—中央汇金资产管理有 限责任公司—易方达基金—汇金资 管单一资产管理计划	190,080,598.00	1.00%

5	国泰海通证券股份有限公司	154,003,392.00	0.81%
6	中国人寿保险股份有限公司	138,711,710.00	0.73%
7	北京诚旻投资有限公司－诚旻灵活配置私募证券投资基金	62,946,490.00	0.33%
8	财通证券股份有限公司	47,057,141.00	0.25%
9	申万宏源证券有限公司	46,287,326.00	0.24%
10	兴业证券股份有限公司	33,527,727.00	0.18%
11	中国农业银行－南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	1,008,628,500.00	5.29%

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。

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
罗文杰	公募基金	50~100
	私募资产管理计划	0
	合计	50~100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013 年 2 月 6 日)基金份额总额	1,147,553,216.00
本报告期期初基金份额总额	17,492,568,617.00
本报告期基金总申购份额	18,455,600,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	16,883,600,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	19,064,568,617.00

§ 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。

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

2025 年 9 月，中国农业银行总行决定蔡崎峰任托管业务部总裁。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内无涉及基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

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，目前容诚会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 2 年，本报告期应支付给容诚会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 100,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2025-10-17; 2025-11-18
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局; 国家外汇管理局深圳市分局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施; 行政处罚
受到的具体措施类型	责令改正; 警告、罚款
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作、人员管理、其他问题(销售管理); 其他问题(外汇登记)
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务

	管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》； 《中华人民共和国外汇管理条例》
管理人采取整改措施的情况	截至报告期末公司已通过完善制度、优化流程等整改措施完成整改，整改成果已经中国证监会深圳监管局验收通过； 截至报告期末公司已完成整改，整改成果已向国家外汇管理局深圳市分局报告并通过
其他	-

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

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

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
中信证券	2	64,925,563,639.40	35.60%	6,486,731.29	35.57%	-
方正证券	2	41,466,690,872.37	22.74%	4,145,659.81	22.74%	-
华泰证券	3	30,523,299,072.72	16.74%	3,050,517.37	16.73%	-
国信证券	2	21,091,898,809.47	11.57%	2,111,439.87	11.58%	-
招商证券	2	16,250,555,536.56	8.91%	1,625,403.25	8.91%	-
国泰海通	3	2,911,549,465.64	1.60%	292,929.57	1.61%	-
中泰证券	1	1,866,219,678.29	1.02%	186,445.40	1.02%	-
广发证券	2	1,287,786,758.98	0.71%	128,669.80	0.71%	-
申万宏源	2	771,751,673.97	0.42%	77,106.93	0.42%	-
中金公司	1	647,816,474.95	0.36%	66,904.32	0.37%	-
银河证券	1	623,863,199.57	0.34%	62,325.35	0.34%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	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：中泰证券；减少交易单元：无。

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	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期权证成

		交总额的 比例		购成交 总额的 比例		交总额的 比例
中信证 券	40,640,038.59	24.82%	500,000,000.00	22.73%	-	-
方正证 券	4,106,654.86	2.51%	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	1,100,000,000.00	50.00%	-	-
国信证 券	27,052,219.00	16.52%	600,000,000.00	27.27%	-	-
招商证 券	12,440,037.01	7.60%	-	-	-	-
国泰海 通	58,410,580.14	35.68%	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
中金公 司	21,068,722.61	12.87%	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于直销平台相关业务费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-01
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-04

3	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加华金证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-08
4	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金分红公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-09
5	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加瑞银证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-02-20
6	关于南方基金管理股份有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-19
7	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-20
8	南方基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-04-01
10	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-05-14
11	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-07-18
12	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-08-29
13	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-10-16
14	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-11-01
15	南方基金管理股份有限公司关于旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-11-24
16	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-12-11

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20250408-20251231	2,615,889,755.00	3,366,087,763.00	-	5,981,977,518.00	31.38%
机构	2	20250101-20251231	8,235,101,633.00	-	-	8,235,101,633.00	43.20%
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中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 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>