

南方中证 500 量化增强股票型发起式 证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	61
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	61
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	62
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	62

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
7.12 投资组合报告附注.....	62
§8 基金份额持有人信息.....	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	64
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	64
§9 开放式基金份额变动.....	65
§10 重大事件揭示.....	65
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变.....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	66
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....	66
10.8 其他重大事件.....	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
§12 备查文件目录.....	68
12.1 备查文件目录.....	68
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金	
基金简称	南方中证 500 量化增强股票发起	
基金主代码	002906	
交易代码	002906	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 23 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	300,195,070.86 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方中证 500 量化增强股票发起 A	南方中证 500 量化增强股票发起 C
下属分级基金的交易代码	002906	002907
报告期末下属分级基金的份额总额	229,371,703.91 份	70,823,366.95 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、南方中证 500 量化增强股票发起 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	59,581,219.28
本期利润	61,350,764.03
加权平均基金份额本期利润	0.2136
本期加权平均净值利润率	14.59%
本期基金份额净值增长率	16.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	125,287,039.79
期末可供分配基金份额利润	0.5462
期末基金资产净值	358,603,440.39
期末基金份额净值	1.5634

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	56.34%

2、南方中证 500 量化增强股票发起 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	46,569,510.97
本期利润	53,074,421.47
加权平均基金份额本期利润	0.2432
本期加权平均净值利润率	17.21%
本期基金份额净值增长率	16.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	35,208,961.46
期末可供分配基金份额利润	0.4971
期末基金资产净值	107,144,546.05
期末基金份额净值	1.5128
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	51.28%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方中证 500 量化增强股票发起 A

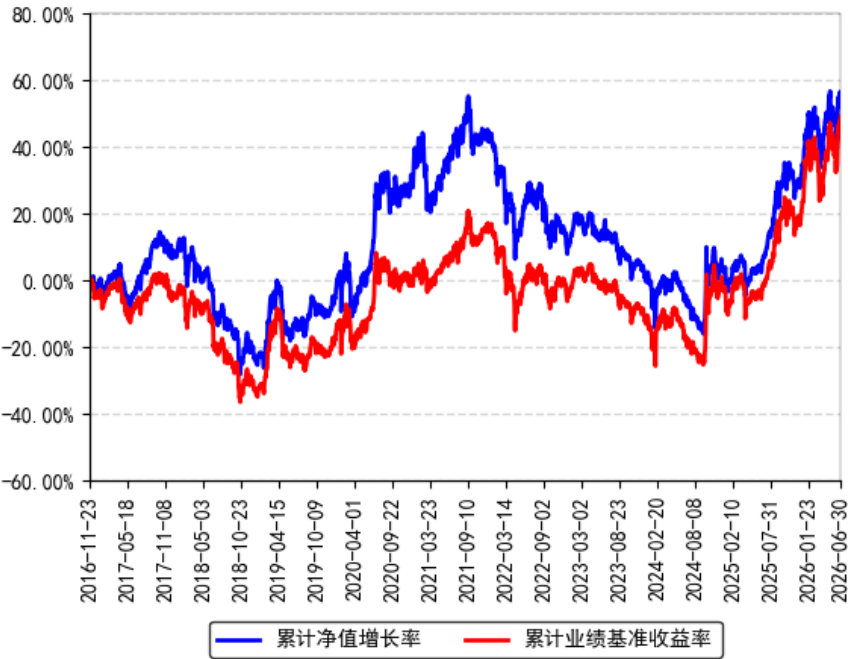
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	13.56%	1.48%	17.90%	1.57%	-4.34%	-0.09%
过去六个月	16.26%	1.46%	20.51%	1.58%	-4.25%	-0.12%
过去一年	46.62%	1.25%	51.16%	1.35%	-4.54%	-0.10%
过去三年	37.38%	1.28%	52.57%	1.41%	-15.19%	-0.13%
过去五年	11.59%	1.24%	38.24%	1.30%	-26.65%	-0.06%
过去七年	81.79%	1.30%	91.31%	1.29%	-9.52%	0.01%
自基金合同 生效起至今	56.34%	1.30%	49.16%	1.29%	7.18%	0.01%

南方中证 500 量化增强股票发起 C

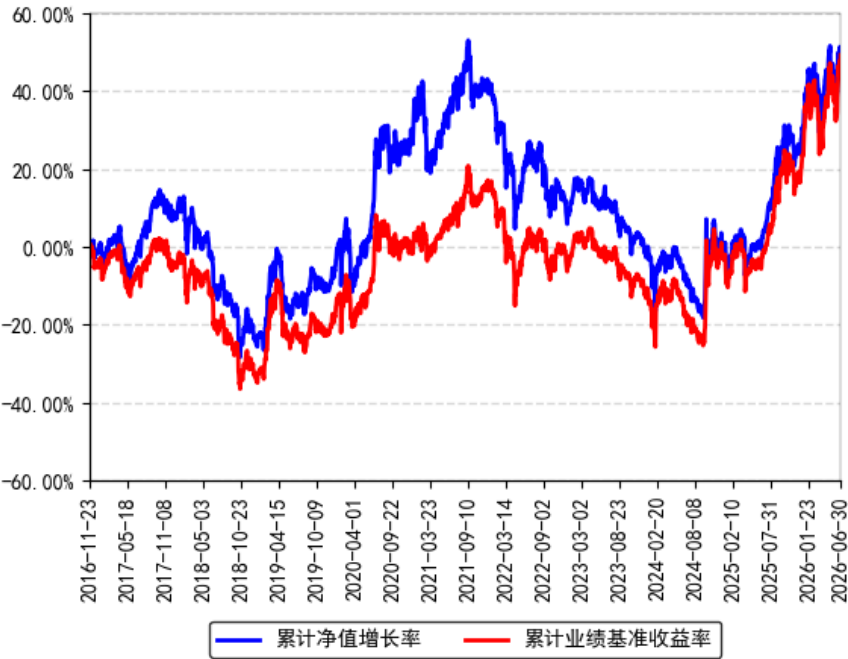
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	13.45%	1.48%	17.90%	1.57%	-4.45%	-0.09%
过去六个月	16.03%	1.46%	20.51%	1.58%	-4.48%	-0.12%
过去一年	46.05%	1.25%	51.16%	1.35%	-5.11%	-0.10%
过去三年	35.80%	1.28%	52.57%	1.41%	-16.77%	-0.13%
过去五年	9.39%	1.24%	38.24%	1.30%	-28.85%	-0.06%
过去七年	76.73%	1.30%	91.31%	1.29%	-14.58%	0.01%
自基金合同 生效起至今	51.28%	1.30%	49.16%	1.29%	2.12%	0.01%

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

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



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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
游涛	本基金基金经理	2024 年 12 月 6 日	-	9 年	中国国籍，中央财经大学统计学博士，深圳证券交易所博士后，具有基金从业

	理				资格。曾先后就职于深圳证券交易所，博时基金管理有限公司，历任博士后研究员、高级人工智能研究员、高级量化研究员。2022 年 4 月加入南方基金数量化投资部，2024 年 12 月 6 日至今，任南方中证 500 量化增强股票发起基金经理；2026 年 3 月 27 日至今，任南方中证 2000ETF 基金经理。
王翰生	本基金基金经理	2026 年 3 月 13 日	-	9 年	中国国籍，卡耐基梅隆大学计算金融专业硕士，具有基金从业资格。曾任职于美国 AQR Capital Management、美国 Citadel Securities，历任量化研究员、量化交易员。2021 年 11 月加入南方基金，2023 年 9 月 15 日至今，任南方上证 50 增强基金经理；2025 年 6 月 27 日至今，任南方睿阳稳健添利 6 个月持有债券基金经理；2026 年 3 月 13 日至今，任南方中证 500 量化增强股票发起、南方沪深 300 指数增强基金经理；2026 年 6 月 29 日至今，任南方中小盘成长股票基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 24 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年 2 季度，本基金基于公司自主研发的 AI 策略平台不断寻找市场规律力争获取稳健 alpha。策略研发层面丰富了能够适应不同市场环境的子策略，并且具有稳健的风格标签。基金整体在个股偏离、行业偏离、风格偏离上实行严格的总量控制，实现有限度的市场风格观点表达，从整体上力求实现长期稳健的超额收益，兼顾超额收益率和超额收益滚动胜率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.5634 元，报告期内，份额净值增长率为 16.26%，同期业绩基准增长率为 20.51%；本基金 C 份额净值为 1.5128 元，报告期内，份额净值增长率为 16.03%，同期业绩基准增长率为 20.51%。

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 年下半年，核心观点：低波动慢牛，可以从以下三个方面分析：第一：A 股上市公司正陆续从本国敞口的本土化企业转型为全球敞口的跨国公司，中国资本市场也正从新兴市场逐步转型为成熟市场，A 股不仅是中国的 A 股，也是全球的 A 股。“十五五”期间，中企在全球价值链分配中的位置有望进一步抬升，把份额优势转化为定价权，这是 A 股行情迈向低波动慢牛的基础。第二：追求稳健回报的绝对收益资金持续入市，应该是未来资本市场增量流动性格局的核心特征，一定程度上推动了 A 股整体呈现高夏普比资产的特征。第三：从大势研判来看，A 股全球营收敞口企业已不局限于少数公司，而是足以推动整个 A 股的行情，未来 A 股的基本面要放在全球市场需求去看，而不是单看本土需求。当前市场情绪处于相对中性位置，两融余额处于历史高位，短期市场春季行情预期升温，建议积极把握投资机会布局。结构上，建议大盘优于小盘，成长价值均衡，低估值优于高估值。中长期维度来看，当前 A 股估值处于合理位置，中央经济工作会议对 2026 年经济政策定调积极，中长期维度战略看多 A 股市场表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面的运作严格依据基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司以自身能够获取的数据和信息为限，根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定对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进行了复核，认为以上内容真实、准确、完整。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	28,039,791.47	46,679,964.79
结算备付金		6,315,032.26	9,989,583.73
存出保证金		326,704.80	241,067.87
交易性金融资产	6.4.7.2	436,604,229.32	718,967,037.02
其中：股票投资		436,424,687.04	717,782,499.92
基金投资		-	-
债券投资		179,542.28	1,184,537.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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		-	153,598.67
应收股利		-	-
应收申购款		438,374.62	802,331.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		471,724,132.47	776,833,584.00
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		89,264.42	-
应付赎回款		4,806,708.32	3,040,616.22
应付管理人报酬		382,523.94	646,453.38
应付托管费		76,504.81	129,290.67
应付销售服务费		34,989.42	115,128.25
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3.29	2.40
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	586,151.83	748,262.30
负债合计		5,976,146.03	4,679,753.22
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	300,195,070.86	582,290,594.72
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	165,552,915.58	189,863,236.06
净资产合计		465,747,986.44	772,153,830.78
负债和净资产总计		471,724,132.47	776,833,584.00

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，南方中证 500 量化增强股票发起 A 份额净值 1.5634 元，基金份额总额 229,371,703.91 份；南方中证 500 量化增强股票发起 C 份额净值 1.5128 元，基金份额总额 70,823,366.95 份；总份额合计 300,195,070.86 份。

6.2 利润表

会计主体：南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		119,489,739.05	36,188,894.76
1.利息收入		100,926.29	156,563.06
其中：存款利息收入	6.4.7.9	100,926.29	156,563.06
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）		110,803,523.94	12,553,307.71
其中：股票投资收益	6.4.7.10	106,276,455.77	5,686,427.75
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	814,832.16	0.59
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	3,712,236.01	6,866,879.37
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	8,274,455.25	23,417,897.43
4.汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	310,833.57	61,126.56
减：二、营业总支出		5,064,553.55	4,539,747.25
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	3,635,900.32	3,534,457.86
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	727,180.06	706,891.56
3.销售服务费	6.4.10.2.3	619,589.74	191,483.53
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-

7.税金及附加		2.06	-
8.其他费用	6.4.7.19	81,881.37	106,914.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		114,425,185.50	31,649,147.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		114,425,185.50	31,649,147.51
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		114,425,185.50	31,649,147.51

6.3 净资产变动表

会计主体：南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	582,290,594.72	-	189,863,236.06	772,153,830.78
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	582,290,594.72	-	189,863,236.06	772,153,830.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-282,095,523.86	-	-24,310,320.48	-306,405,844.34
（一）、综合收益总额	-	-	114,425,185.50	114,425,185.50
（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）	-282,095,523.86	-	-138,735,505.98	-420,831,029.84
其中：1.基金申购款	128,864,676.79	-	57,500,550.42	186,365,227.21
2.基金赎回款	-410,960,200.65	-	-196,236,056.40	-607,196,257.05

(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	300,195,070.86	-	165,552,915.58	465,747,986.44
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	716,934,740.12	-	11,549,842.52	728,484,582.64
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	716,934,740.12	-	11,549,842.52	728,484,582.64
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-36,509,405.50	-	30,738,736.13	-5,770,669.37
(一)、综合收益总额	-	-	31,649,147.51	31,649,147.51
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-36,509,405.50	-	-910,411.38	-37,419,816.88
其中：1.基金申购款	33,220,324.53	-	407,884.82	33,628,209.35
2.基金赎回款	-69,729,730.03	-	-1,318,296.20	-71,048,026.23
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减	-	-	-	-

少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	680,425,334.62	-	42,288,578.65	722,713,913.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1138 号《关于准予南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司，已于 2018 年 1 月 4 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 82,675,811.77 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1457 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 82,689,142.28 份基金份额，其中认购资金利息折合 13,330.51 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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用、从本类别基金资产中不计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票以及存托凭证)、债券(包括国债、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(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票资产(含存托凭证)投资比例不低于基金资产的 90%,投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;本基金在每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+1%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策,会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关

于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	28,039,791.47

等于：本金	28,037,367.88
加：应计利息	2,423.59
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	28,039,791.47

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		416,175,258.30	-	436,424,687.04	20,249,428.74
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	119,600.00	9.04	179,542.28	59,933.24
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	119,600.00	9.04	179,542.28	59,933.24
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		416,294,858.30	9.04	436,604,229.32	20,309,361.98

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,125.19
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	500,203.78
其中：交易所市场	500,203.78
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	81,822.86
应付指数使用费	-
合计	586,151.83

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方中证 500 量化增强股票发起 A		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	316,877,260.36	316,877,260.36
本期申购	68,598,936.28	68,598,936.28
本期赎回（以“-”号填列）	-156,104,492.73	-156,104,492.73
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	229,371,703.91	229,371,703.91

南方中证 500 量化增强股票发起 C		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	265,413,334.36	265,413,334.36
本期申购	60,265,740.51	60,265,740.51
本期赎回（以“-”号填列）	-254,855,707.92	-254,855,707.92
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	70,823,366.95	70,823,366.95

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

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

南方中证 500 量化增强股票发起 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	109,404,900.75	-176,311.63	109,228,589.12
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	109,404,900.75	-176,311.63	109,228,589.12
本期利润	59,581,219.28	1,769,544.75	61,350,764.03
本期基金份额交易产生的变动数	-43,699,080.24	2,351,463.57	-41,347,616.67
其中：基金申购款	32,477,820.14	-193,658.58	32,284,161.56
基金赎回款	-76,176,900.38	2,545,122.15	-73,631,778.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	125,287,039.79	3,944,696.69	129,231,736.48

南方中证 500 量化增强股票发起 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	81,019,977.15	-385,330.21	80,634,646.94
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	81,019,977.15	-385,330.21	80,634,646.94
本期利润	46,569,510.97	6,504,910.50	53,074,421.47
本期基金份额交易产生的变动数	-92,380,526.66	-5,007,362.65	-97,387,889.31
其中：基金申购款	25,444,656.01	-228,267.15	25,216,388.86
基金赎回款	-117,825,182.67	-4,779,095.50	-122,604,278.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,208,961.46	1,112,217.64	36,321,179.10

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	85,012.10

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	15,216.04
其他	698.15
合计	100,926.29

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	106,276,455.77
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	106,276,455.77

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,608,534,444.90
减：卖出股票成本总额	5,497,679,771.40
减：交易费用	4,578,217.73
买卖股票差价收入	106,276,455.77

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	549.05
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	814,283.11
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	814,832.16

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,852,987.62
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,021,830.00
减：应计利息总额	16,801.04
减：交易费用	73.47
买卖债券差价收入	814,283.11

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,712,236.01
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	3,712,236.01

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	8,274,455.25
——股票投资	8,563,502.11
——债券投资	-289,046.86
——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	8,274,455.25

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	263,843.92
基金转换费收入	46,989.65
合计	310,833.57

6.4.7.18 信用减值损失

无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	58.51
合计	81,881.37

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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。

6.4.9 关联方、关联关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司（“南方基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合”）	基金管理人的股东华泰证券控制的公 司
----------------------	-----------------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券	3,151,831,665.7 3	29.15%	1,924,015,497.8 5	19.49%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交 总额的比例	成交金额	占当期债券成交 总额的比例
华泰证券	8,414,886.72	53.13%	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金 余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券	314,899.57	29.15%	253,159.05	50.61%
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总	期末应付佣金	占期末应付佣

		量的比例	余额	金总额的比例
华泰证券	192,214.80	19.49%	57,606.88	12.29%

注：1. 上述佣金费率参考市场价格确定。

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,635,900.32	3,534,457.86
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,159,293.17	1,056,621.82
应支付基金管理人的净管理费	2,476,607.15	2,477,836.04

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	727,180.06	706,891.56

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方中证 500 量化增强股票发起 A	南方中证 500 量化增强股票发起 C	合计
光大银行	-	4,588.02	4,588.02

华泰证券	-	2,379.85	2,379.85
南方基金	-	15,193.52	15,193.52
兴业证券	-	87.17	87.17
合计	-	22,248.56	22,248.56
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方中证 500 量化增强股票发起 A	南方中证 500 量化增强股票发起 C	合计
光大银行	-	1,851.86	1,851.86
华泰证券	-	3,031.54	3,031.54
南方基金	-	14,232.92	14,232.92
兴业证券	-	63.22	63.22
合计	-	19,179.54	19,179.54

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

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.40% ÷ 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	南方中证 500 量化增强股票发起 A	南方中证 500 量化增强股票发起 C
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-

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

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

注：基金管理人南方基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.5.2 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

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	28,039,791.47	85,012.10	41,892,344.93	142,027.82

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	603293	埃泰克	网下申购	716	23,978.84
华泰联合	113704	春风转债	配债	100	10,000.00

上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	603014	威高血净	网下申购	2,045	54,192.50

华泰联合	688757	胜科纳米	网下申购	5,357	48,641.56
------	--------	------	------	-------	-----------

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

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。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定期	46.08	463.33	1,202	55,388.16	556,922.66	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定期	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定期	10.11	10.11	16,014	161,901.54	161,901.54	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	6,862	69,374.82	69,374.82	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定期	19.68	141.49	1,110	21,844.80	157,053.90	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定期	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期	44.56	468.67	176	7,842.56	82,485.92	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期	10.12	27.73	2,381	24,095.72	66,025.13	-

688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁 定期	22.68	47.61	1,300	29,484.00	61,893.00	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	92.18	463.1 5	116	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	26.28	172.0 9	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	40.98	308.1 9	128	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026	6 个月	新股锁	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-

		年 4 月 22 日		定期						
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	58.00	112.1 6	117	6,786.00	13,122.72	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	11.18	17.59	742	8,295.56	13,051.78	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	78.38	121.7 7	96	7,524.48	11,689.92	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代 码	证券名称	成功认 购日	受限期	流通受 限类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 （单 位： 张）	期末成本总 额	期末估值总 额	备 注
111025	圣泉转债	2026 年 6 月 26 日	1 个月 内 （含）	新债未 上市	100.0 0	100.0 0	470	47,000.00	47,000.62	-
113704	春风转债	2026 年 6 月 11 日	1 个月 内 （含）	新债未 上市	100.0 0	100.0 0	100	10,000.00	10,000.46	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.3 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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行期货投资，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用期货的杠杆作用，达到降低投资组合的整体风险的目的。

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

6.4.13.3.1 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。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	28,039,791.4	-	-	-	28,039,791.4

	7				7
结算备付金	6,315,032.26	-	-	-	6,315,032.26
存出保证金	326,704.80	-	-	-	326,704.80
交易性金融资产	-	-	179,542.28	436,424,687.04	436,604,229.32
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	438,374.62	438,374.62
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	34,681,528.53	-	179,542.28	436,863,061.66	471,724,132.47
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	-	-	-	89,264.42	89,264.42
应付赎回款	-	-	-	4,806,708.32	4,806,708.32
应付管理人报酬	-	-	-	382,523.94	382,523.94
应付托管费	-	-	-	76,504.81	76,504.81
应付销售服务费	-	-	-	34,989.42	34,989.42
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3.29	3.29
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	586,151.83	586,151.83
负债总计	-	-	-	5,976,146.03	5,976,146.03
利率敏感度缺口	34,681,528.53	-	179,542.28	430,886,915.63	465,747,986.44
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	46,679,964.79	-	-	-	46,679,964.79
结算备付金	9,989,583.73	-	-	-	9,989,583.73
存出保证金	241,067.87	-	-	-	241,067.87
交易性金融资产	-	-	1,184,537.10	717,782,499.92	718,967,037.02
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	-	-	-	153,598.67	153,598.67
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	802,331.92	802,331.92
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	56,910,616.39	-	1,184,537.10	718,738,430.51	776,833,584.00
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	-	-	-	3,040,616.22	3,040,616.22
应付管理人报酬	-	-	-	646,453.38	646,453.38

应付托管费	-	-	-	129,290.67	129,290.67
应付销售服务费	-	-	-	115,128.25	115,128.25
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2.40	2.40
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	748,262.30	748,262.30
负债总计	-	-	-	4,679,753.22	4,679,753.22
利率敏感度缺口	56,910,616.39	-	1,184,537.10	714,058,677.29	772,153,830.78

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	0.00	0.00
	2.市场利率平行下降 25 个基点	0.00	0.00

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产- 股票投资	436,424,687.04	93.70	717,782,499.92	92.96
交易性金融资产- 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产- 债券投资	179,542.28	0.04	1,184,537.10	0.15
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	436,604,229.32	93.74	718,967,037.02	93.11

注：交易性金融资产-债券投资项目仅包含可转换公司债券或可交换公司债券。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2026 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）
	1.组合自身基准上升 5%	21,069,356.42	33,823,300.56
	2.组合自身基准下降 5%	-21,069,356.42	-33,823,300.56

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	434,569,288.78

第二层次	288,277.44
第三层次	1,746,663.10
合计	436,604,229.32

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	436,424,687.04	92.52
	其中：股票	436,424,687.04	92.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	179,542.28	0.04
	其中：债券	179,542.28	0.04
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	34,354,823.73	7.28
8	其他各项资产	765,079.42	0.16
9	合计	471,724,132.47	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	196,035.00	0.04
B	采矿业	7,068,805.80	1.52
C	制造业	255,965,052.91	54.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,736,719.48	3.38
E	建筑业	4,798,992.00	1.03
F	批发和零售业	8,266,073.18	1.77
G	交通运输、仓储和邮政业	6,812,486.00	1.46
H	住宿和餐饮业	226,674.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,038,859.71	4.73
J	金融业	19,757,743.40	4.24
K	房地产业	459,471.00	0.10
L	租赁和商务服务业	3,849,701.68	0.83
M	科学研究和技术服务业	938,949.12	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	5,365,827.00	1.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	767,150.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	1,458,538.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	353,707,078.28	75.94

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,796,413.56	0.60
C	制造业	68,313,191.82	14.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,369,780.36	0.29
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	671,632.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	118,618.46	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服	5,235,093.80	1.12

	务业		
J	金融业	657,846.00	0.14
K	房地产业	7,592.00	0.00
L	租赁和商务服务业	625,320.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	1,312,666.20	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	1,399,023.56	0.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	23,760.00	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,697.00	0.00
S	综合	177,974.00	0.04
	合计	82,717,608.76	17.76

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300857	协创数据	30,760	10,455,324.00	2.24
2	002281	光迅科技	40,000	10,277,600.00	2.21
3	300604	长川科技	19,400	6,623,548.00	1.42
4	688301	奕瑞科技	47,711	5,916,164.00	1.27
5	300054	鼎龙股份	52,900	5,605,813.00	1.20
6	300475	香农芯创	18,365	5,509,500.00	1.18
7	601991	大唐发电	764,800	5,414,784.00	1.16
8	301536	星宸科技	40,900	5,264,239.00	1.13
9	688017	绿的谐波	12,437	5,196,924.82	1.12
10	301358	湖南裕能	68,000	5,159,160.00	1.11
11	688002	睿创微纳	32,846	5,080,947.74	1.09
12	301200	大族数控	12,200	4,399,930.00	0.94
13	002185	华天科技	185,300	4,134,043.00	0.89
14	600498	烽火通信	52,900	3,893,440.00	0.84
15	300757	罗博特科	6,100	3,775,900.00	0.81
16	000032	深桑达 A	142,900	3,565,355.00	0.77
17	300373	扬杰科技	22,000	3,459,060.00	0.74
18	002266	浙富控股	666,700	3,373,502.00	0.72
19	688361	中科飞测	7,788	3,348,840.00	0.72
20	000783	长江证券	341,816	3,332,706.00	0.72

21	603345	安井食品	39,600	3,175,524.00	0.68
22	002008	大族激光	20,800	3,122,288.00	0.67
23	600392	盛和资源	102,900	3,063,333.00	0.66
24	600499	科达制造	218,500	3,015,300.00	0.65
25	000951	中国重汽	152,800	2,981,128.00	0.64
26	601000	唐山港	696,400	2,890,060.00	0.62
27	001286	陕西能源	283,700	2,876,718.00	0.62
28	603816	顾家家居	126,207	2,821,988.52	0.61
29	300623	捷捷微电	60,500	2,721,895.00	0.58
30	002138	顺络电子	34,900	2,551,190.00	0.55
31	600909	华安证券	225,900	2,509,749.00	0.54
32	002851	麦格米特	15,000	2,507,700.00	0.54
33	688469	芯联集成	231,455	2,455,737.55	0.53
34	301526	国际复材	52,400	2,445,508.00	0.53
35	001389	广合科技	10,200	2,419,950.00	0.52
36	300548	长芯博创	8,700	2,418,600.00	0.52
37	688498	源杰科技	1,274	2,402,764.00	0.52
38	002273	水晶光电	67,000	2,377,160.00	0.51
39	600295	鄂尔多斯	219,400	2,351,968.00	0.50
40	300432	富临精工	116,800	2,346,512.00	0.50
41	688052	纳芯微	8,123	2,341,942.13	0.50
42	002410	广联达	285,800	2,332,128.00	0.50
43	001309	德明利	2,400	2,262,960.00	0.49
44	603920	世运电路	45,600	2,190,624.00	0.47
45	688778	厦钨新能	40,008	2,176,435.20	0.47
46	000060	中金岭南	278,111	2,105,300.27	0.45
47	000415	渤海租赁	506,400	2,061,048.00	0.44
48	002409	雅克科技	9,000	2,020,500.00	0.43
49	601156	东航物流	122,300	1,971,476.00	0.42
50	300140	节能环境	395,300	1,964,641.00	0.42
51	600901	江苏金租	338,000	1,943,500.00	0.42
52	688336	三生国健	35,119	1,864,818.90	0.40
53	002025	航天电器	24,400	1,859,768.00	0.40
54	600546	山煤国际	169,900	1,857,007.00	0.40
55	688615	合合信息	16,341	1,848,167.10	0.40
56	603833	欧派家居	60,700	1,827,677.00	0.39
57	300223	北京君正	7,300	1,816,970.00	0.39
58	300666	江丰电子	4,900	1,806,140.00	0.39
59	002966	苏州银行	256,900	1,788,024.00	0.38
60	688578	艾力斯	16,327	1,782,908.40	0.38
61	603156	养元饮品	34,900	1,712,543.00	0.37
62	688213	思特威	15,874	1,699,629.18	0.36
63	000423	东阿阿胶	37,200	1,687,392.00	0.36

64	002487	大金重工	29,000	1,681,130.00	0.36
65	601108	财通证券	185,900	1,608,035.00	0.35
66	688322	奥比中光	12,269	1,601,717.95	0.34
67	300957	贝泰妮	50,400	1,588,104.00	0.34
68	600378	昊华科技	20,600	1,552,828.00	0.33
69	002738	中矿资源	26,320	1,552,616.80	0.33
70	300919	中伟新材	35,300	1,544,375.00	0.33
71	600737	中粮糖业	124,600	1,536,318.00	0.33
72	600995	南网储能	124,200	1,527,660.00	0.33
73	300073	当升科技	31,600	1,518,064.00	0.33
74	300953	震裕科技	11,300	1,510,810.00	0.32
75	300972	万辰集团	8,700	1,508,667.00	0.32
76	603290	斯达半导	9,700	1,483,518.00	0.32
77	300017	网宿科技	112,100	1,458,421.00	0.31
78	300748	金力永磁	46,000	1,419,100.00	0.30
79	600685	中船防务	55,100	1,401,744.00	0.30
80	300570	太辰光	5,500	1,356,905.00	0.29
81	688027	国盾量子	2,688	1,354,778.88	0.29
82	600801	华新建材	86,100	1,343,160.00	0.29
83	000528	柳工	176,300	1,331,065.00	0.29
84	601615	明阳智能	113,000	1,307,410.00	0.28
85	688266	泽璟制药	10,583	1,234,612.78	0.27
86	600363	联创光电	34,000	1,216,520.00	0.26
87	002472	双环传动	29,300	1,216,243.00	0.26
88	605589	圣泉集团	18,900	1,201,473.00	0.26
89	300454	深信服	12,200	1,173,640.00	0.25
90	688220	翱捷科技	9,434	1,172,834.88	0.25
91	300699	光威复材	40,800	1,168,920.00	0.25
92	002402	和而泰	44,800	1,157,184.00	0.25
93	688563	航材股份	22,562	1,155,851.26	0.25
94	300458	全志科技	29,280	1,155,388.80	0.25
95	600299	安迪苏	146,900	1,153,165.00	0.25
96	300058	蓝色光标	83,618	1,150,583.68	0.25
97	603699	纽威股份	22,850	1,149,355.00	0.25
98	000960	锡业股份	26,800	1,144,092.00	0.25
99	002414	高德红外	85,882	1,138,795.32	0.24
100	600348	华阳股份	148,300	1,134,495.00	0.24
101	300002	神州泰岳	145,100	1,133,231.00	0.24
102	688166	博瑞医药	32,286	1,130,332.86	0.24
103	600008	首创环保	407,900	1,109,488.00	0.24
104	688709	成都华微	29,069	1,107,238.21	0.24
105	300115	长盈精密	39,600	1,106,424.00	0.24
106	688122	西部超导	17,609	1,106,021.29	0.24

107	002130	沃尔核材	56,900	1,078,824.00	0.23
108	002340	格林美	163,000	1,077,430.00	0.23
109	601611	中国核建	96,100	1,071,515.00	0.23
110	600032	浙江新能	151,800	1,070,190.00	0.23
111	600332	白云山	53,300	1,068,132.00	0.23
112	600105	永鼎股份	15,800	1,066,184.00	0.23
113	300724	捷佳伟创	14,900	1,051,940.00	0.23
114	600312	平高电气	59,300	1,047,238.00	0.22
115	600699	均胜电子	47,600	1,028,636.00	0.22
116	600808	马钢股份	410,100	1,025,250.00	0.22
117	000629	钒钛股份	306,600	1,024,044.00	0.22
118	688099	晶晨股份	9,937	1,022,517.30	0.22
119	603650	彤程新材	10,300	1,009,194.00	0.22
120	601001	晋控煤业	57,400	998,186.00	0.21
121	002624	完美世界	80,200	996,084.00	0.21
122	300567	精测电子	3,100	984,560.00	0.21
123	601179	中国西电	65,900	983,228.00	0.21
124	002153	石基信息	135,400	978,942.00	0.21
125	601598	中国外运	195,600	970,176.00	0.21
126	000997	新大陆	59,200	964,960.00	0.21
127	002299	圣农发展	62,300	944,468.00	0.20
128	000155	川能动力	78,576	941,340.48	0.20
129	002432	九安医疗	13,300	940,044.00	0.20
130	000878	云南铜业	58,200	924,216.00	0.20
131	000623	吉林敖东	52,060	923,023.80	0.20
132	000987	越秀资本	116,900	914,158.00	0.20
133	002517	恺英网络	56,200	913,250.00	0.20
134	600988	赤峰黄金	34,500	908,040.00	0.19
135	002429	兆驰股份	87,100	904,969.00	0.19
136	002850	科达利	4,750	899,175.00	0.19
137	002683	广东宏大	30,600	896,274.00	0.19
138	002673	西部证券	137,700	893,673.00	0.19
139	601990	南京证券	135,200	888,264.00	0.19
140	000039	中集集团	108,100	876,691.00	0.19
141	601696	中银证券	68,500	866,525.00	0.19
142	300012	华测检测	62,300	863,478.00	0.19
143	688281	华秦科技	17,165	862,197.95	0.19
144	601966	玲珑轮胎	84,200	857,998.00	0.18
145	600483	福能股份	84,100	856,979.00	0.18
146	688318	财富趋势	11,869	846,378.39	0.18
147	688347	华虹宏力	2,515	845,794.50	0.18
148	603308	应流股份	13,900	839,560.00	0.18
149	600352	浙江龙盛	68,600	830,746.00	0.18

150	300735	光弘科技	35,900	816,366.00	0.18
151	688692	达梦数据	3,332	813,974.28	0.17
152	601233	桐昆股份	37,300	807,545.00	0.17
153	300383	光环新网	64,700	804,868.00	0.17
154	300487	蓝晓科技	13,400	788,590.00	0.17
155	688772	珠海冠宇	40,109	787,339.67	0.17
156	000559	万向钱潮	60,800	786,144.00	0.17
157	002430	杭氧股份	25,300	783,288.00	0.17
158	002821	凯莱英	4,800	777,600.00	0.17
159	300037	新宙邦	8,300	770,655.00	0.17
160	000703	恒逸石化	55,800	757,206.00	0.16
161	002335	科华数据	17,780	754,761.00	0.16
162	000750	国海证券	202,500	745,200.00	0.16
163	002044	美年健康	147,800	743,434.00	0.16
164	300136	信维通信	6,178	736,726.50	0.16
165	600126	杭钢股份	115,900	710,467.00	0.15
166	600764	中国海防	40,600	707,658.00	0.15
167	603659	璞泰来	24,000	694,320.00	0.15
168	600906	财达证券	88,700	661,702.00	0.14
169	300395	菲利华	4,910	656,614.30	0.14
170	002926	华西证券	78,200	638,894.00	0.14
171	300144	宋城演艺	108,700	631,547.00	0.14
172	600153	建发股份	79,000	626,470.00	0.13
173	600109	国金证券	70,100	615,478.00	0.13
174	600497	驰宏锌锗	50,600	612,766.00	0.13
175	603233	大参林	40,206	604,296.18	0.13
176	600927	永安期货	46,400	577,680.00	0.12
177	603444	吉比特	1,611	577,414.62	0.12
178	002271	东方雨虹	47,500	563,825.00	0.12
179	688037	芯源微	1,281	562,423.05	0.12
180	000893	亚钾国际	13,400	547,926.00	0.12
181	600601	方正科技	39,300	543,912.00	0.12
182	300001	特锐德	13,400	506,922.00	0.11
183	000598	兴蓉环境	78,600	504,612.00	0.11
184	002152	广电运通	52,926	496,445.88	0.11
185	002078	太阳纸业	38,500	480,865.00	0.10
186	601577	长沙银行	54,600	475,566.00	0.10
187	600595	中孚实业	84,400	474,328.00	0.10
188	600885	宏发股份	13,651	470,822.99	0.10
189	600642	申能股份	52,100	454,833.00	0.10
190	601019	山东出版	70,400	450,560.00	0.10
191	688629	华丰科技	2,320	435,023.20	0.09
192	000786	北新建材	23,800	430,542.00	0.09

193	000519	中兵红箭	18,700	394,009.00	0.08
194	601665	齐鲁银行	66,800	385,436.00	0.08
195	603885	吉祥航空	34,800	358,092.00	0.08
196	601717	中创智领	24,900	346,359.00	0.07
197	300390	天华新能	3,600	336,636.00	0.07
198	300677	英科医疗	8,500	332,945.00	0.07
199	600562	国睿科技	15,560	330,183.20	0.07
200	600637	东方明珠	39,538	328,560.78	0.07
201	002841	视源股份	9,200	317,676.00	0.07
202	002007	华兰生物	25,500	310,845.00	0.07
203	002756	永兴材料	5,400	305,856.00	0.07
204	300207	欣旺达	16,000	303,840.00	0.07
205	002739	儒意电影	31,400	301,440.00	0.06
206	603529	爱玛科技	15,400	300,454.00	0.06
207	688235	百济神州	1,177	299,675.97	0.06
208	688120	华海清科	928	298,983.04	0.06
209	601155	新城控股	28,500	292,410.00	0.06
210	600004	白云机场	39,800	288,948.00	0.06
211	603379	三美股份	3,778	286,712.42	0.06
212	688475	萤石网络	10,402	284,494.70	0.06
213	688728	格科微	13,346	280,799.84	0.06
214	601869	长飞光纤	500	272,950.00	0.06
215	600177	雅戈尔	35,800	269,574.00	0.06
216	002831	裕同科技	7,493	266,451.08	0.06
217	600316	洪都航空	9,200	257,048.00	0.06
218	002812	恩捷股份	3,800	254,258.00	0.05
219	300751	迈为股份	900	254,214.00	0.05
220	600704	物产中大	53,500	252,520.00	0.05
221	002064	华峰化学	26,600	252,434.00	0.05
222	600863	华能蒙电	53,700	252,390.00	0.05
223	600873	梅花生物	34,252	251,752.20	0.05
224	000733	振华科技	4,300	243,552.00	0.05
225	688568	中科星图	5,801	240,567.47	0.05
226	603806	福斯特	14,300	240,097.00	0.05
227	002126	银轮股份	4,800	239,040.00	0.05
228	000400	许继电气	11,000	238,700.00	0.05
229	601699	潞安环能	16,600	237,048.00	0.05
230	000009	中国宝安	37,600	234,248.00	0.05
231	002195	岩山科技	35,700	233,478.00	0.05
232	600879	航天电子	10,900	232,061.00	0.05
233	600754	锦江酒店	12,600	226,674.00	0.05
234	300339	润和软件	5,800	223,358.00	0.05
235	601567	三星电气	14,700	219,618.00	0.05

236	300142	沃森生物	16,600	215,634.00	0.05
237	600535	天士力	15,800	209,034.00	0.04
238	603737	三棵树	8,626	207,886.60	0.04
239	600329	达仁堂	5,500	204,710.00	0.04
240	600583	海油工程	40,400	203,212.00	0.04
241	688599	天合光能	14,221	200,800.52	0.04
242	600765	中航重机	14,900	192,508.00	0.04
243	002065	东华软件	26,600	189,924.00	0.04
244	002120	韵达股份	29,800	189,528.00	0.04
245	603000	人民网	12,800	189,312.00	0.04
246	600871	石化油服	90,700	184,121.00	0.04
247	000034	神州数码	6,400	177,600.00	0.04
248	600369	西南证券	43,500	174,870.00	0.04
249	600578	京能电力	26,900	173,505.00	0.04
250	002318	久立特材	7,200	172,080.00	0.04
251	301606	绿联科技	2,800	170,856.00	0.04
252	000021	深科技	2,600	167,102.00	0.04
253	688777	中控技术	1,412	165,910.00	0.04
254	603766	隆鑫通用	13,900	165,827.00	0.04
255	600566	济川药业	7,400	164,206.00	0.04
256	000932	华菱钢铁	47,000	163,090.00	0.04
257	000883	湖北能源	37,500	162,000.00	0.03
258	300346	南大光电	1,700	157,505.00	0.03
259	300285	国瓷材料	1,500	154,770.00	0.03
260	601608	中信重工	32,400	154,548.00	0.03
261	603129	春风动力	600	153,480.00	0.03
262	002261	拓维信息	5,400	151,254.00	0.03
263	601865	福莱特	14,300	150,293.00	0.03
264	603160	汇顶科技	2,400	148,104.00	0.03
265	601128	常熟银行	25,170	146,489.40	0.03
266	003031	中瓷电子	800	144,240.00	0.03
267	000739	普洛药业	8,600	143,276.00	0.03
268	002444	巨星科技	4,500	139,950.00	0.03
269	605358	立昂微	1,800	139,680.00	0.03
270	000729	燕京啤酒	13,100	132,703.00	0.03
271	600598	北大荒	12,200	132,248.00	0.03
272	600143	金发科技	8,500	131,325.00	0.03
273	688617	惠泰医疗	721	130,904.76	0.03
274	601399	国机重装	36,800	128,800.00	0.03
275	603338	浙江鼎力	3,000	127,500.00	0.03
276	603298	杭叉集团	5,300	126,458.00	0.03
277	603606	东方电缆	2,980	123,699.80	0.03
278	688385	复旦微电	1,730	123,331.70	0.03

279	000831	中国稀土	2,200	122,078.00	0.03
280	003022	联泓新科	4,697	121,652.30	0.03
281	688387	信科移动	6,082	120,666.88	0.03
282	688019	安集科技	355	120,508.30	0.03
283	301301	川宁生物	14,900	118,306.00	0.03
284	002155	湖南黄金	4,700	112,189.00	0.02
285	002244	滨江集团	14,500	110,200.00	0.02
286	688234	天岳先进	606	105,147.06	0.02
287	603179	新泉股份	2,100	104,265.00	0.02
288	600170	上海建工	46,100	102,342.00	0.02
289	688349	三一重能	6,622	100,521.96	0.02
290	300496	中科创达	1,614	99,729.06	0.02
291	300763	锦浪科技	1,100	99,385.00	0.02
292	600095	湘财股份	13,000	97,890.00	0.02
293	002608	江苏国信	13,800	95,220.00	0.02
294	600141	兴发集团	2,000	93,940.00	0.02
295	002203	海亮股份	4,100	93,685.00	0.02
296	601958	金钼股份	3,300	92,763.00	0.02
297	603225	新凤鸣	4,700	92,355.00	0.02
298	002603	以岭药业	6,100	91,500.00	0.02
299	001203	大中矿业	3,000	89,850.00	0.02
300	603979	金诚信	1,500	88,545.00	0.02
301	000737	北方铜业	6,600	87,252.00	0.02
302	002465	海格通信	6,800	86,836.00	0.02
303	600166	福田汽车	29,189	84,939.99	0.02
304	601666	平煤股份	11,800	84,370.00	0.02
305	601808	中海油服	7,600	82,156.00	0.02
306	300627	华测导航	2,800	79,520.00	0.02
307	600563	法拉电子	400	76,320.00	0.02
308	603939	益丰药房	4,200	75,516.00	0.02
309	688180	君实生物	2,138	72,307.16	0.02
310	688188	柏楚电子	669	71,382.30	0.02
311	600602	云赛智联	4,200	67,536.00	0.01
312	600021	上海电力	4,400	66,308.00	0.01
313	688608	恒玄科技	386	64,535.34	0.01
314	600655	豫园股份	15,600	64,116.00	0.01
315	600060	海信视像	2,300	64,101.00	0.01
316	002056	横店东磁	2,100	64,008.00	0.01
317	002157	正邦科技	22,700	63,787.00	0.01
318	601216	君正集团	14,100	62,886.00	0.01
319	600536	中国软件	2,200	61,864.00	0.01
320	000582	北部湾港	5,600	60,088.00	0.01
321	002797	第一创业	9,100	59,787.00	0.01

322	603688	石英股份	700	57,827.00	0.01
323	603077	和邦生物	24,500	56,840.00	0.01
324	603486	科沃斯	1,100	55,825.00	0.01
325	688018	乐鑫科技	436	55,773.12	0.01
326	688065	凯赛生物	1,162	55,601.70	0.01
327	603596	伯特利	2,200	54,648.00	0.01
328	301611	珂玛科技	300	54,021.00	0.01
329	603605	珀莱雅	900	53,928.00	0.01
330	688375	国博电子	514	53,610.20	0.01
331	000830	鲁西化工	4,400	52,800.00	0.01
332	600707	彩虹股份	3,100	52,359.00	0.01
333	600171	上海贝岭	1,600	51,104.00	0.01
334	601106	中国一重	15,400	50,820.00	0.01
335	600486	扬农化工	1,000	50,700.00	0.01
336	603728	鸣志电器	800	48,736.00	0.01
337	688297	中无人机	1,149	47,740.95	0.01
338	601139	深圳燃气	8,300	46,978.00	0.01
339	002085	万丰奥威	4,100	45,469.00	0.01
340	601799	星宇股份	500	45,310.00	0.01
341	600985	淮北矿业	3,200	44,960.00	0.01
342	003021	兆威机电	500	43,675.00	0.01
343	600398	海澜之家	8,300	43,409.00	0.01
344	000887	中鼎股份	2,400	42,936.00	0.01
345	000539	粤电力 A	6,300	42,903.00	0.01
346	000738	航发控制	2,300	42,067.00	0.01
347	300679	电连技术	700	41,993.00	0.01
348	601016	节能风电	10,800	41,904.00	0.01
349	001696	宗申动力	2,000	41,620.00	0.01
350	600862	中航高科	2,300	41,469.00	0.01
351	688538	和辉光电	15,809	41,103.40	0.01
352	600516	方大炭素	6,500	40,105.00	0.01
353	600298	安琪酵母	1,100	39,820.00	0.01
354	603087	甘李药业	700	39,732.00	0.01
355	000723	美锦能源	11,800	39,530.00	0.01
356	000591	太阳能	8,100	37,260.00	0.01
357	000967	盈峰环境	3,500	36,855.00	0.01
358	300718	长盛轴承	600	36,582.00	0.01
359	002312	川发龙蟒	3,900	35,763.00	0.01
360	601099	太平洋	10,600	35,722.00	0.01
361	600977	中国电影	2,700	34,884.00	0.01
362	600282	南钢股份	7,600	34,884.00	0.01
363	600582	天地科技	7,800	34,710.00	0.01
364	689009	九号公司	906	34,563.90	0.01

365	600521	华海药业	2,400	34,560.00	0.01
366	300003	乐普医疗	2,879	34,116.15	0.01
367	002984	森麒麟	2,600	33,982.00	0.01
368	000050	深天马 A	3,400	33,694.00	0.01
369	600435	北方导航	3,000	33,600.00	0.01
370	688248	南网科技	484	33,483.12	0.01
371	000921	海信家电	1,200	32,784.00	0.01
372	600517	国网英大	7,000	32,760.00	0.01
373	688295	中复神鹰	529	32,025.66	0.01
374	600820	隧道股份	6,000	31,260.00	0.01
375	688582	芯动联科	474	30,810.00	0.01
376	002223	鱼跃医疗	1,200	30,792.00	0.01
377	600131	国网信通	2,100	30,660.00	0.01
378	600038	中直股份	1,200	30,348.00	0.01
379	601997	贵阳银行	5,800	29,754.00	0.01
380	600967	内蒙一机	2,700	29,295.00	0.01
381	688114	华大智造	562	28,706.96	0.01
382	000062	深圳华强	900	28,638.00	0.01
383	600970	中材国际	4,000	28,520.00	0.01
384	000728	国元证券	3,800	28,462.00	0.01
385	300100	双林股份	1,000	27,780.00	0.01
386	603568	伟明环保	1,800	27,684.00	0.01
387	000709	河钢股份	14,000	27,160.00	0.01
388	688425	铁建重工	6,740	27,094.80	0.01
389	000825	太钢不锈	7,800	26,598.00	0.01
390	300558	贝达药业	400	26,028.00	0.01
391	603341	龙旗科技	600	25,494.00	0.01
392	603899	晨光股份	1,200	24,756.00	0.01
393	600998	九州通	5,200	24,388.00	0.01
394	002262	恩华药业	1,300	24,375.00	0.01
395	000027	深圳能源	3,900	24,180.00	0.01
396	600208	衢州发展	8,500	24,055.00	0.01
397	688561	奇安信	1,001	24,003.98	0.01
398	002032	苏泊尔	600	23,760.00	0.01
399	600763	通策医疗	700	23,716.00	0.01
400	002508	老板电器	1,600	23,392.00	0.01
401	000513	丽珠集团	800	23,112.00	0.00
402	600380	健康元	2,400	22,608.00	0.00
403	300888	稳健医疗	800	22,392.00	0.00
404	688278	特宝生物	400	21,760.00	0.00
405	002939	长城证券	2,600	21,684.00	0.00
406	601098	中南传媒	2,200	21,648.00	0.00
407	300676	华大基因	600	21,036.00	0.00

408	003035	南网能源	3,600	20,952.00	0.00
409	600511	国药股份	800	20,832.00	0.00
410	600132	重庆啤酒	500	20,650.00	0.00
411	601866	中远海发	9,300	20,553.00	0.00
412	000088	盐田港	4,900	20,041.00	0.00
413	000537	绿发电力	2,700	19,737.00	0.00
414	000937	冀中能源	4,710	18,745.80	0.00
415	603565	中谷物流	1,900	18,639.00	0.00
416	002568	百润股份	1,100	18,612.00	0.00
417	000959	首钢股份	5,300	18,603.00	0.00
418	601928	凤凰传媒	2,100	18,459.00	0.00
419	688192	迪哲医药	447	17,848.71	0.00
420	600098	广州发展	3,000	17,730.00	0.00
421	002500	山西证券	3,400	17,544.00	0.00
422	002265	建设工业	1,000	17,400.00	0.00
423	600390	五矿资本	3,800	17,328.00	0.00
424	603589	口子窖	900	16,812.00	0.00
425	600848	上海临港	2,200	16,478.00	0.00
426	603786	科博达	400	16,364.00	0.00
427	002773	康弘药业	800	16,360.00	0.00
428	600663	陆家嘴	2,600	16,328.00	0.00
429	300146	汤臣倍健	1,800	16,272.00	0.00
430	301498	乖宝宠物	400	16,236.00	0.00
431	688363	华熙生物	453	16,203.81	0.00
432	603858	步长制药	1,100	16,060.00	0.00
433	600968	海油发展	4,600	15,318.00	0.00
434	000429	粤高速 A	1,100	15,015.00	0.00
435	688819	天能股份	659	14,629.80	0.00
436	600062	华润双鹤	900	14,436.00	0.00
437	688520	神州细胞	400	13,684.00	0.00
438	601112	振石股份	742	13,051.78	0.00
439	600688	上海石化	4,100	12,013.00	0.00
440	600339	中油工程	3,800	11,666.00	0.00
441	603658	安图生物	400	11,608.00	0.00
442	000785	居然智家	5,800	11,600.00	0.00
443	002670	国盛证券	900	9,900.00	0.00
444	601228	广州港	3,500	9,870.00	0.00
445	000983	山西焦煤	1,700	9,860.00	0.00
446	603049	中策橡胶	200	8,962.00	0.00
447	002461	珠江啤酒	1,000	7,570.00	0.00
448	002945	华林证券	500	6,715.00	0.00
449	001221	悍高集团	100	4,022.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601231	环旭电子	123,100	3,988,440.00	0.86
2	301308	江波龙	5,479	3,856,120.20	0.83
3	002972	科安达	134,000	2,621,040.00	0.56
4	688609	九联科技	206,681	2,275,557.81	0.49
5	002079	苏州固锟	145,400	2,185,362.00	0.47
6	002595	豪迈科技	46,435	2,163,871.00	0.46
7	688045	必易微	24,126	1,948,898.28	0.42
8	600487	亨通光电	17,820	1,948,438.80	0.42
9	002763	汇洁股份	265,500	1,802,745.00	0.39
10	301666	大普微	3,005	1,744,558.76	0.37
11	600096	云天化	55,400	1,684,160.00	0.36
12	301072	中捷精工	40,900	1,677,309.00	0.36
13	688309	恒誉环保	23,241	1,414,912.08	0.30
14	688059	华锐精密	6,491	1,296,317.61	0.28
15	688677	海泰新光	12,689	1,283,238.57	0.28
16	301086	鸿富瀚	5,560	1,163,596.80	0.25
17	001359	平安电工	9,110	1,141,027.50	0.24
18	688218	江苏北人	19,956	1,096,781.76	0.24
19	688525	佰维存储	2,159	1,068,122.07	0.23
20	603020	爱普股份	75,300	1,061,730.00	0.23
21	301189	奥尼电子	17,800	1,048,954.00	0.23
22	301280	珠城科技	20,700	1,046,799.00	0.22
23	605186	健麾信息	33,100	1,038,016.00	0.22
24	002532	天山铝业	96,200	1,032,226.00	0.22
25	000922	佳电股份	73,100	1,020,476.00	0.22
26	301122	采纳股份	33,600	988,176.00	0.21
27	300450	先导智能	20,000	814,400.00	0.17
28	688628	优利德	7,990	790,530.60	0.17
29	603283	赛腾股份	9,400	761,212.00	0.16
30	002837	英维克	9,400	747,864.00	0.16
31	600549	厦门钨业	8,200	698,640.00	0.15
32	600875	东方电气	24,100	693,357.00	0.15
33	603067	振华股份	14,600	675,834.00	0.15
34	000426	兴业银锡	20,400	672,384.00	0.14
35	000933	神火股份	31,400	665,680.00	0.14
36	300476	胜宏科技	1,900	658,217.00	0.14
37	002353	杰瑞股份	4,200	640,500.00	0.14

38	002922	伊戈尔	19,400	636,320.00	0.14
39	300004	南风股份	62,700	633,270.00	0.14
40	300792	壹网壹创	24,200	627,748.00	0.13
41	300254	仟源医药	78,200	626,382.00	0.13
42	300409	道氏技术	31,200	621,816.00	0.13
43	002324	普利特	51,100	616,777.00	0.13
44	300986	志特新材	35,800	613,970.00	0.13
45	000534	万泽股份	22,400	612,864.00	0.13
46	300170	汉得信息	40,100	611,124.00	0.13
47	601778	晶科科技	142,000	610,600.00	0.13
48	603259	药明康德	4,900	610,099.00	0.13
49	603186	华正新材	2,700	608,310.00	0.13
50	300774	倍杰特	56,200	604,150.00	0.13
51	002128	电投能源	25,200	582,624.00	0.13
52	601126	四方股份	9,100	575,120.00	0.12
53	002558	巨人网络	19,800	545,688.00	0.12
54	300681	英搏尔	18,500	529,470.00	0.11
55	000958	电投产融	93,600	527,904.00	0.11
56	688813	泰金新能	2,337	481,899.06	0.10
57	601318	中国平安	9,800	467,852.00	0.10
58	300959	线上线下	3,100	458,211.00	0.10
59	601168	西部矿业	16,500	447,810.00	0.10
60	688256	寒武纪	280	446,754.00	0.10
61	601899	紫金矿业	17,100	429,894.00	0.09
62	002716	湖南白银	53,100	429,579.00	0.09
63	688480	赛恩斯	4,784	419,030.56	0.09
64	002156	通富微电	5,300	402,111.00	0.09
65	601061	中信金属	35,800	385,566.00	0.08
66	688183	生益电子	2,848	377,075.20	0.08
67	000657	中钨高新	3,800	363,736.00	0.08
68	002202	金风科技	15,200	363,280.00	0.08
69	688802	沐曦股份	421	348,714.30	0.07
70	300502	新易盛	540	327,780.00	0.07
71	601918	新集能源	37,276	320,200.84	0.07
72	601965	中国汽研	25,200	301,392.00	0.06
73	301371	敷尔佳	11,300	293,800.00	0.06
74	000792	盐湖股份	9,700	292,843.00	0.06
75	002460	赣锋锂业	4,400	287,760.00	0.06
76	603556	海兴电力	13,000	286,000.00	0.06
77	300606	金太阳	6,700	285,152.00	0.06
78	688127	蓝特光学	2,892	282,259.20	0.06
79	600323	瀚蓝环境	10,200	280,092.00	0.06
80	605599	菜百股份	19,700	269,890.00	0.06

81	002440	闰土股份	26,000	266,500.00	0.06
82	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.06
83	600720	中交设计	53,500	257,870.00	0.06
84	300308	中际旭创	200	254,000.00	0.05
85	603061	金海通	500	251,110.00	0.05
86	688653	康希通信	13,600	236,368.00	0.05
87	001248	华润新能源	22,876	231,276.36	0.05
88	600893	航发动力	6,000	230,040.00	0.05
89	002283	天润工业	22,800	220,020.00	0.05
90	301669	高特电子	5,455	217,413.57	0.05
91	301172	君逸数码	8,200	212,790.00	0.05
92	301169	零点有数	3,000	211,980.00	0.05
93	605168	三人行	4,100	207,624.00	0.04
94	300767	震安科技	9,300	207,297.00	0.04
95	600113	浙江东日	6,200	205,716.00	0.04
96	001399	惠科股份	5,952	202,365.91	0.04
97	300750	宁德时代	500	196,505.00	0.04
98	002545	东方铁塔	11,600	188,152.00	0.04
99	600961	株冶集团	5,500	178,145.00	0.04
100	600673	东阳光	5,300	177,974.00	0.04
101	603538	美诺华	5,200	169,260.00	0.04
102	603790	雅运股份	7,800	166,452.00	0.04
103	688258	卓易信息	1,388	164,533.52	0.04
104	600580	卧龙电驱	4,960	164,176.00	0.04
105	603986	兆易创新	200	163,000.00	0.03
106	688820	盛合晶微	1,110	157,053.90	0.03
107	002294	信立泰	4,900	156,261.00	0.03
108	600183	生益科技	900	156,060.00	0.03
109	600150	中国船舶	4,600	155,434.00	0.03
110	002396	星网锐捷	8,000	153,360.00	0.03
111	001280	中国铀业	2,277	151,875.90	0.03
112	605196	华通线缆	5,800	151,380.00	0.03
113	600887	伊利股份	6,300	150,948.00	0.03
114	002080	中材科技	1,600	144,000.00	0.03
115	688809	强一股份	227	141,421.00	0.03
116	603228	景旺电子	1,900	137,579.00	0.03
117	600118	中国卫星	1,600	131,280.00	0.03
118	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.03
119	600519	贵州茅台	100	118,549.00	0.03
120	603707	健友股份	16,600	117,362.00	0.03
121	688710	益诺思	1,691	113,635.20	0.02
122	002439	启明星辰	8,800	111,320.00	0.02
123	002328	新朋股份	13,300	97,622.00	0.02

124	000408	藏格矿业	1,400	97,048.00	0.02
125	688008	澜起科技	294	91,110.60	0.02
126	603150	万朗磁塑	1,200	84,960.00	0.02
127	605117	德业股份	800	84,944.00	0.02
128	300408	三环集团	500	83,450.00	0.02
129	688981	中芯国际	522	82,904.04	0.02
130	688797	臻宝科技	176	82,485.92	0.02
131	300991	创益通	2,300	80,983.00	0.02
132	688388	嘉元科技	1,829	80,476.00	0.02
133	001314	亿道信息	1,300	80,340.00	0.02
134	002049	紫光国微	900	79,875.00	0.02
135	605222	起帆电缆	3,400	79,288.00	0.02
136	603993	洛阳钼业	4,500	78,975.00	0.02
137	002384	东山精密	300	78,705.00	0.02
138	002887	绿茵生态	7,500	78,525.00	0.02
139	002792	通宇通讯	2,200	78,254.00	0.02
140	688717	艾罗能源	946	78,111.22	0.02
141	001208	华菱线缆	5,500	78,045.00	0.02
142	002104	恒宝股份	7,500	77,325.00	0.02
143	600989	宝丰能源	3,800	77,254.00	0.02
144	601601	中国太保	2,700	77,004.00	0.02
145	301190	善水科技	4,800	76,944.00	0.02
146	002379	宏桥控股	5,200	76,804.00	0.02
147	000975	山金国际	4,500	76,500.00	0.02
148	000617	中油资本	11,600	76,444.00	0.02
149	601333	广深铁路	27,400	75,350.00	0.02
150	000807	云铝股份	3,400	75,276.00	0.02
151	603897	长城科技	2,300	74,658.00	0.02
152	603826	坤彩科技	2,900	74,124.00	0.02
153	601600	中国铝业	8,900	73,158.00	0.02
154	688790	昂瑞微	502	67,182.66	0.01
155	002111	威海广泰	7,200	64,800.00	0.01
156	688781	视涯科技	1,300	61,893.00	0.01
157	603095	越剑智能	4,200	60,144.00	0.01
158	002544	普天科技	3,100	56,482.00	0.01
159	601127	赛力斯	900	55,125.00	0.01
160	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
161	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
162	600482	中国动力	1,600	52,480.00	0.01
163	688577	浙海德曼	910	41,705.30	0.01
164	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
165	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
166	600233	圆通速递	2,200	34,650.00	0.01

167	300529	健帆生物	2,100	32,340.00	0.01
168	002385	大北农	11,700	32,292.00	0.01
169	600528	中铁工业	4,800	31,632.00	0.01
170	002949	华阳国际	3,000	29,670.00	0.01
171	603293	埃泰克	716	28,924.24	0.01
172	603459	红板科技	330	27,825.60	0.01
173	603927	中科软	2,100	26,691.00	0.01
174	002154	报喜鸟	7,100	25,276.00	0.01
175	600959	江苏有线	8,600	24,854.00	0.01
176	002607	中公教育	13,200	23,760.00	0.01
177	002958	青农商行	8,100	22,194.00	0.00
178	002372	伟星新材	2,600	21,294.00	0.00
179	001393	维通利	487	20,455.13	0.00
180	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
181	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
182	300601	康泰生物	1,600	18,144.00	0.00
183	688100	威胜信息	591	18,078.69	0.00
184	300070	碧水源	5,400	17,226.00	0.00
185	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
186	001233	海安集团	370	16,539.00	0.00
187	600739	辽宁成大	1,600	16,176.00	0.00
188	300049	福瑞医科	400	15,552.00	0.00
189	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
190	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
191	300638	广和通	800	14,808.00	0.00
192	000563	陕国投 A	5,200	14,352.00	0.00
193	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
194	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
195	300014	亿纬锂能	200	13,006.00	0.00
196	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
197	688765	禾元生物	232	11,832.00	0.00
198	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
199	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
200	601921	浙版传媒	1,300	8,697.00	0.00
201	600007	中国国贸	400	7,592.00	0.00
202	001213	中铁特货	2,100	7,035.00	0.00
203	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
204	000425	徐工机械	400	3,236.00	0.00
205	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
206	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
207	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688002	睿创微纳	28,066,259.01	3.63
2	300604	长川科技	26,988,254.76	3.50
3	002738	中矿资源	26,226,023.40	3.40
4	000426	兴业银锡	25,412,378.00	3.29
5	002532	天山铝业	25,059,589.00	3.25
6	002008	大族激光	24,567,362.00	3.18
7	688120	华海清科	23,924,416.58	3.10
8	002558	巨人网络	23,731,866.35	3.07
9	600352	浙江龙盛	22,469,168.99	2.91
10	688301	奕瑞科技	22,259,408.68	2.88
11	300136	信维通信	21,240,576.58	2.75
12	002517	恺英网络	21,232,580.00	2.75
13	002064	华峰化学	20,882,471.00	2.70
14	002595	豪迈科技	20,738,383.13	2.69
15	603699	纽威股份	20,632,033.50	2.67
16	600363	联创光电	20,141,263.00	2.61
17	688385	复旦微电	19,961,624.87	2.59
18	000933	神火股份	19,804,816.00	2.56
19	688017	绿的谐波	19,616,843.81	2.54
20	002851	麦格米特	19,285,696.00	2.50
21	600988	赤峰黄金	19,219,086.49	2.49
22	300012	华测检测	19,064,190.00	2.47
23	600879	航天电子	18,994,177.11	2.46
24	301358	湖南裕能	18,702,068.00	2.42
25	300919	中伟新材	18,565,061.00	2.40
26	600801	华新建材	18,458,892.80	2.39
27	300373	扬杰科技	18,194,012.00	2.36
28	300432	富临精工	18,121,216.40	2.35
29	002409	雅克科技	17,999,082.00	2.33
30	002273	水晶光电	17,959,519.50	2.33
31	600885	宏发股份	17,945,066.68	2.32
32	002294	信立泰	17,466,656.00	2.26
33	000060	中金岭南	17,388,167.95	2.25
34	688778	厦钨新能	17,386,672.62	2.25
35	002281	光迅科技	17,316,206.00	2.24
36	002410	广联达	17,303,711.00	2.24
37	300395	菲利华	17,173,747.20	2.22
38	000415	渤海租赁	17,145,448.00	2.22

39	600096	云天化	17,145,432.00	2.22
40	603979	金诚信	17,087,468.00	2.21
41	300450	先导智能	17,047,649.87	2.21
42	000039	中集集团	16,561,566.00	2.14
43	603606	东方电缆	16,547,569.00	2.14
44	688099	晶晨股份	16,470,370.57	2.13
45	688281	华秦科技	16,429,473.83	2.13
46	603345	安井食品	16,406,296.00	2.12
47	601168	西部矿业	16,339,622.00	2.12
48	688188	柏楚电子	16,048,352.21	2.08
49	300058	蓝色光标	15,715,993.52	2.04
50	300054	鼎龙股份	15,542,635.00	2.01
51	603766	隆鑫通用	15,477,330.50	2.00

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002008	大族激光	31,244,973.28	4.05
2	300604	长川科技	29,066,663.94	3.76
3	000426	兴业银锡	26,411,412.00	3.42
4	002273	水晶光电	26,362,125.00	3.41
5	002517	恺英网络	26,269,478.60	3.40
6	002738	中矿资源	25,521,939.00	3.31
7	688120	华海清科	25,247,460.13	3.27
8	688002	睿创微纳	25,076,887.15	3.25
9	600487	亨通光电	24,734,101.60	3.20
10	000933	神火股份	23,054,940.80	2.99
11	002532	天山铝业	22,815,334.30	2.95
12	600549	厦门钨业	22,468,076.00	2.91
13	300136	信维通信	22,217,160.43	2.88
14	603659	璞泰来	21,971,377.00	2.85
15	688385	复旦微电	21,728,809.50	2.81
16	001389	广合科技	21,336,985.00	2.76
17	002851	麦格米特	21,134,205.00	2.74
18	002558	巨人网络	20,847,708.28	2.70
19	300450	先导智能	20,681,930.58	2.68
20	002595	豪迈科技	20,600,725.25	2.67
21	600352	浙江龙盛	20,559,094.32	2.66
22	002064	华峰化学	20,531,223.00	2.66

23	603699	纽威股份	20,356,345.00	2.64
24	600141	兴发集团	20,270,433.61	2.63
25	600901	江苏金租	20,077,953.00	2.60
26	688301	奕瑞科技	19,736,301.86	2.56
27	601233	桐昆股份	19,625,642.00	2.54
28	300919	中伟新材	19,477,577.20	2.52
29	002185	华天科技	19,234,499.00	2.49
30	600879	航天电子	19,203,881.00	2.49
31	000060	中金岭南	19,166,327.00	2.48
32	002156	通富微电	18,311,280.00	2.37
33	603345	安井食品	18,295,116.01	2.37
34	300012	华测检测	18,144,822.14	2.35
35	688777	中控技术	18,091,872.63	2.34
36	300496	中科创达	18,072,880.00	2.34
37	002409	雅克科技	18,047,711.91	2.34
38	688281	华秦科技	17,853,849.96	2.31
39	300373	扬杰科技	17,837,164.00	2.31
40	600363	联创光电	17,812,491.00	2.31
41	300395	菲利华	17,679,566.82	2.29
42	600497	驰宏锌锗	17,678,078.00	2.29
43	002444	巨星科技	17,579,948.18	2.28
44	000733	振华科技	17,579,048.00	2.28
45	600988	赤峰黄金	17,484,611.00	2.26
46	600885	宏发股份	17,260,145.00	2.24
47	000415	渤海租赁	17,188,046.00	2.23
48	002318	久立特材	17,085,884.75	2.21
49	300207	欣旺达	17,085,567.00	2.21
50	603606	东方电缆	16,901,907.99	2.19
51	000997	新大陆	16,832,299.48	2.18
52	603129	春风动力	16,788,976.00	2.17
53	603766	隆鑫通用	16,738,209.00	2.17
54	688017	绿的谐波	16,657,517.18	2.16
55	688347	华虹宏力	16,586,286.19	2.15
56	002294	信立泰	16,573,966.00	2.15
57	301358	湖南裕能	16,492,810.00	2.14
58	600801	华新建材	16,484,513.00	2.13
59	603979	金诚信	16,454,478.16	2.13
60	600970	中材国际	16,408,538.00	2.13
61	000039	中集集团	16,335,563.51	2.12
62	603379	三美股份	16,317,988.48	2.11
63	300432	富临精工	16,312,004.00	2.11
64	002414	高德红外	16,082,325.00	2.08
65	601168	西部矿业	15,964,399.00	2.07

66	600096	云天化	15,937,151.00	2.06
67	601108	财通证券	15,865,841.00	2.05
68	603568	伟明环保	15,821,552.99	2.05
69	688188	柏楚电子	15,732,988.65	2.04
70	688525	佰维存储	15,620,827.53	2.02
71	300017	网宿科技	15,568,727.80	2.02
72	688166	博瑞医药	15,476,354.05	2.00

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,207,758,456.41
卖出股票收入（成交）总额	5,608,534,444.90

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	179,542.28	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	179,542.28	0.04

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123271	通合转债	626	122,541.20	0.03
2	111025	圣泉转债	470	47,000.62	0.01
3	113704	春风转债	100	10,000.46	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

多头套期保值策略

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

相关证券的投资决策程序做出说明

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

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	326,704.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	438,374.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	765,079.42

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比	持有份额	占总份额比

				例		例
南方中证 500 量化增强股票发起 A	21,383	10,726.83	714,861.03	0.31%	228,656,842.88	99.69%
南方中证 500 量化增强股票发起 C	6,014	11,776.42	182,885.71	0.26%	70,640,481.24	99.74%
合计	27,397	10,957.22	897,746.74	0.30%	299,297,324.12	99.70%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方中证 500 量化增强股票发起 A	565,539.20	0.2466%
	南方中证 500 量化增强股票发起 C	2,363.90	0.0033%
	合计	567,903.10	0.1892%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	9,900,000.00	3.30	自合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	435,847.29	0.15	-	-	-
基金经理等人员	-	-	100,000.00	0.03	自合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	435,847.29	0.15	10,000,000.00	3.33	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方中证 500 量化增强股票发起 A	南方中证 500 量化增强股票发起 C
基金合同生效日(2016 年 11 月 23 日)基金份额总额	25,994,568.76	56,694,573.52
本报告期期初基金份额总额	316,877,260.36	265,413,334.36
本报告期基金总申购份额	68,598,936.28	60,265,740.51
减：本报告期基金总赎回份额	156,104,492.73	254,855,707.92
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	229,371,703.91	70,823,366.95

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内无涉及基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	2	5,093,814,472.02	47.10%	508,897.92	47.10%	-
华泰证券	2	3,151,831,665.73	29.15%	314,899.57	29.15%	-
招商证券	1	2,568,456,854.18	23.75%	256,609.26	23.75%	-
国联民生	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

国盛证券	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：华泰证券；减少交易单元：无。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	1,157,670.49	7.31%	-	-	-	-
华泰证券	8,414,886.72	53.13%	-	-	-	-
招商证券	6,265,852.46	39.56%	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金变更基金经理的公告	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	2026-03-14
2	关于南方基金管理股份有限公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	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	2026-03-21
3	南方基金管理股份有限公司旗下公募基金通过	上海证券报、基金管	2026-03-31

	证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-11
5	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	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	2026-04-24
6	南方基金管理股份有限公司成都分公司工商注册信息变更公告	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	2026-04-28
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	2026-06-12

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 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	20260101-20260513	191,187,169.22	-	191,187,169.22	-	-
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金基金合同》；

- 3、《南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金 2026 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>