

# 南方中证国新港股通央企红利交易型 开放式指数证券投资基金 2026 年中期 报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

## 目录

|                                              |    |
|----------------------------------------------|----|
| §1 重要提示及目录.....                              | 1  |
| 1.1 重要提示.....                                | 1  |
| 1.2 目录.....                                  | 2  |
| §2 基金简介.....                                 | 4  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 4  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 4  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 4  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 5  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 5  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现.....                        | 5  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 5  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 6  |
| §4 管理人报告.....                                | 7  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 7  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 12 |
| 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.....       | 12 |
| §5 托管人报告.....                                | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 13 |
| 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..... | 13 |
| 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.....       | 13 |
| §6 中期财务会计报告（未经审计）.....                       | 13 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 13 |
| 6.2 利润表.....                                 | 15 |
| 6.3 净资产变动表.....                              | 16 |
| 6.4 报表附注.....                                | 18 |
| §7 投资组合报告.....                               | 38 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 39 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 39 |
| 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.....       | 40 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 41 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 43 |
| 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.....      | 43 |
| 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.....   | 43 |
| 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.....   | 43 |
| 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.....      | 43 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                     | 44 |

|                                          |    |
|------------------------------------------|----|
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....           | 44 |
| 7.12 投资组合报告附注.....                       | 44 |
| §8 基金份额持有人信息.....                        | 45 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....               | 45 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....            | 45 |
| 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.....    | 45 |
| §9 开放式基金份额变动.....                        | 45 |
| §10 重大事件揭示.....                          | 46 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                    | 46 |
| 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.....    | 46 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....         | 46 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                      | 46 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....               | 46 |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....        | 46 |
| 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.....    | 47 |
| 10.8 其他重大事件.....                         | 48 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息.....                  | 49 |
| 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 ..... | 49 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 49 |
| §12 备查文件目录.....                          | 49 |
| 12.1 备查文件目录.....                         | 49 |
| 12.2 存放地点.....                           | 49 |
| 12.3 查阅方式.....                           | 49 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|              |                             |
|--------------|-----------------------------|
| 基金名称         | 南方中证国新港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称         | 南方中证国新港股通央企红利 ETF           |
| 场内简称         | 港股通央企红利 ETF 南方              |
| 基金主代码        | 520660                      |
| 交易代码         | 520660                      |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                      |
| 基金合同生效日      | 2024 年 6 月 26 日             |
| 基金管理人        | 南方基金管理股份有限公司                |
| 基金托管人        | 中信建投证券股份有限公司                |
| 报告期末基金份额总额   | 2,307,485,486.00 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         | 2024 年 7 月 10 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   | 本基金主要采用完全复制策略、替代策略及其他适当的策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。主要投资策略包括：完全复制策略、替代策略、金融衍生品投资策略、债券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略等以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。         |
| 业绩比较基准 | 中证国新港股通央企红利指数（人民币中间价）收益率。                                                                                                                                                                                   |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。<br>本基金投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |

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 | 中信建投证券股份有限公司 |

|         |      |                                  |                                                             |
|---------|------|----------------------------------|-------------------------------------------------------------|
| 信息披露负责人 | 姓名   | 鲍文革                              | 邱珂磊                                                         |
|         | 联系电话 | 0755-82763888                    | 4008-888-108                                                |
|         | 电子邮箱 | manager@southernfund.com         | service@csc.com.cn                                          |
| 客户服务电话  |      | 400-889-8899                     | 95587                                                       |
| 传真      |      | 0755-82763889                    | 010-56162085                                                |
| 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 | 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼                                         |
| 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 | 北京市朝阳区景辉街 16 号院 1 号楼泰康集团大厦 8 层/18 层，北京市朝阳区光华路 10 号中信大厦 82 层 |
| 邮政编码    |      | 518017                           | 100020                                                      |
| 法定代表人   |      | 周易                               | 刘成                                                          |

## 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 | <a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a> |
| 基金中期报告置备地点        | 基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）                         |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址             |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

|               |                                       |
|---------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | 64,106,700.70                         |
| 本期利润          | -183,024,038.35                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0723                               |
| 本期加权平均净值利润率   | -6.76%                                |
| 本期基金份额净值增长率   | -8.93%                                |
| 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      | -187,944,144.09                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0814                               |

|              |                       |
|--------------|-----------------------|
| 期末基金资产净值     | 2,119,541,341.91      |
| 期末基金份额净值     | 0.9186                |
| 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  | -2.88%                |

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。

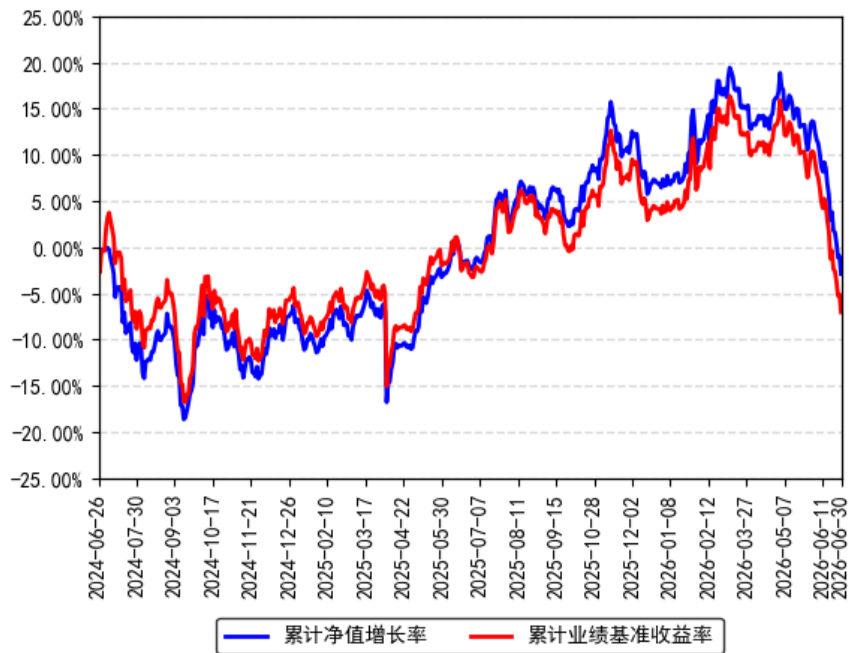
### 3.2 基金净值表现

#### 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<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③   | ②-④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|-------|--------|
| 过去三个月          | -14.01%      | 0.93%               | -15.54%            | 0.96%                     | 1.53% | -0.03% |
| 过去六个月          | -8.93%       | 1.09%               | -10.44%            | 1.11%                     | 1.51% | -0.02% |
| 过去一年           | -0.52%       | 0.96%               | -3.92%             | 0.98%                     | 3.40% | -0.02% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -2.88%       | 1.16%               | -7.02%             | 1.19%                     | 4.14% | -0.03% |

#### 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

南方中证国新港股通央企红利ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 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 | 2024 年 6 月 26 日 | -    | 21 年   | 中国国籍，女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士， |

|  |   |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--|---|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 理 |  |  | 具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月 17 日至 2015 年 6 月 16 日，任南方策略基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2019 年 4 月 18 日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 3 月 27 日，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至 2020 年 3 月 27 日，任南方 H 股联接基金经理；2014 年 10 月 30 日至 2020 年 12 月 23 日，任 500 医药基金经理；2021 年 3 月 12 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理；2021 年 10 月 22 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证全指医疗保健 ETF 基金经理；2020 年 12 月 25 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方策略基金经理；2021 年 7 月 2 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方中证香港科技 ETF（QDII）基金经理；2022 年 6 月 17 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方恒生香港上市生物科技 ETF（QDII）基金经理；2023 年 5 月 30 日至 2024 年 7 月 5 日，任南方恒生香港上市生物科技 ETF 发起联接（QDII）基金经理；2024 年 7 月 5 日至 2025 年 7 月 25 日，任南方基金南方东英沙特阿拉伯 ETF（QDII）基金经理；2024 年 11 月 4 日至 2025 年 12 月 5 日，任南方中证沪深港黄金产业股票指数发起基金经理；2013 年 4 月 22 日至今，任南方 500、南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月 17 日至今，任南方 300、南方 300 联接基金经理；2015 年 2 月 16 日至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2017 年 7 月 21 日至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月 24 日至今，任南方房地产联接基金经理；2017 年 8 月 25 日至今，任南方房地产 ETF 基金经理；2018 年 4 月 3 日至今，任 MSCI 基金基金经理；2018 年 6 月 8 日至今，任 MSCI 联接基金经理；2020 年 7 月 24 |
|--|---|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|     |         |                 |   |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|-----|---------|-----------------|---|-----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |         |                 |   |     | 日至今，兼任投资经理；2024 年 6 月 26 日至今，任南方中证国新港股通央企红利 ETF 基金经理；2024 年 9 月 12 日至今，任南方港股通央企红利 ETF 联接基金经理；2025 年 6 月 30 日至今，任南方中证港股通科技 ETF 基金经理；2025 年 9 月 18 日至今，任南方中证港股通科技 ETF 发起联接基金经理。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 潘水洋 | 本基金基金经理 | 2024 年 6 月 26 日 | - | 8 年 | 中国国籍，北京大学金融学专业博士，具有基金从业资格。2011 年 7 月至 2013 年 7 月，就职于深圳迈瑞生物医疗电子股份有限公司，任系统研究员。2017 年 7 月加入南方基金，历任数量化投资部量化研究员、宏观策略部策略研究员、指数投资部研究员；2021 年 6 月 4 日至 2024 年 3 月 7 日，任投资经理；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 12 月 30 日至 2026 年 1 月 23 日，任南方上证 180ETF 基金经理；2025 年 1 月 20 日至 2026 年 3 月 27 日，任南方上证 180ETF 发起联接（原：南方上证 180 指数发起）基金经理；2025 年 2 月 26 日至 2026 年 3 月 27 日，任南方上证科创板综合 ETF 基金经理；2025 年 4 月 8 日至 2026 年 5 月 8 日，任南方上证科创板综合 ETF 联接基金经理；2024 年 3 月 7 日至今，任南方中证全指计算机 ETF 基金经理；2024 年 3 月 13 日至今，任南方中证机器人 ETF 发起联接（原：南方中证机器人指数发起）基金经理；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 7 月 23 日至今，任南方中证全指计算机 ETF 发起联接基金经理；2024 年 9 月 3 日至今，任南方中证全指汽车指数发起基金经理；2024 年 9 月 12 日至今，任南方港股通央企红利 ETF 联接基金经理；2025 年 4 月 23 日至今，任南方创业板人工智能 ETF、南方中证全指自由现金流 ETF 基金经理；2025 年 7 月 24 日至今，任南方中证机器人 ETF 基金经理；2025 年 10 月 30 日至今，任南方创业板人工智能 ETF 联接基金经理；2025 年 12 月 2 日至 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                      |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 今，任南方中证全指自由现金流 ETF 联接基金经理；2026 年 3 月 27 日至今，任南方中证新能源 ETF、南方中证新能源 ETF 联接基金经理；2026 年 4 月 30 日至今，任南方中证全指汽车 ETF 基金经理；2026 年 5 月 21 日至今，任南方上证综合 ETF 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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

4.1.3 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<br>(只) | 资产净值(元)           | 任职时间             |
|-----|----------|-------------|-------------------|------------------|
| 罗文杰 | 公募基金     | 14          | 61,288,011,599.50 | 2013 年 04 月 22 日 |
|     | 私募资产管理计划 | -           | -                 | -                |
|     | 其他组合     | 1           | 922,311,474.24    | 2026 年 03 月 12 日 |
|     | 合计       | 15          | 62,210,323,073.74 | -                |

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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

报告期内，国新港股通央企红利指数下跌 6.86%。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）接受申购赎回所带来的仓位偏离，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

（2）根据指数成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

#### 4.4.2 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 0.9186 元，报告期内，份额净值增长率为-8.93%，同期业绩基准增长率为-10.44%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 上半年，对于港股市场而言，全球宏观和资金流向的影响贯穿始终，港股整体震荡调整、港股通央企红利指数优于大市。美伊冲突前，港股内部显著分化，流动性预期扰动、HALO 叙事下的资金转向以及企业盈利下修等因素使得港股科技尤其是互联网巨头承压，而另一侧的港股红利资产则凭借稳健经营和股息性价比持续获得资金流入、期间创下历史新高。随后中东冲突爆发，全球资金风险偏好迅速承压，油价、美元大幅攀升，对港股整体形成压制，而高股息板块表现稳健，尤其是汇聚能源等行业龙头的港股通央企红利受益于资源品战略安全溢价、一度续创新高。此后，地缘缓和、全球市场逐步脱敏，但此前高油价对于宏观经济的传导逐步体现，市场定价加息预期，港股再度承压；而与此同时，以算力链为代表的硬科技逆势上行，资金共识高度凝结、极致演绎形成虹吸，偏紧流动性下的抽水效应也蔓延

至港股红利资产，同时在原油、煤炭价格承压之下港股能源板块有所回摆，指数在二季度后期随市同步回调。分行业来看，石油方面，油价在报告期内中枢抬升、宽幅波动，尽管在霍尔木兹海峡通航后迅速回落，但中东产油炼油能力需要时间恢复，在夏季燃料需求高峰逐步到来及全球石油库存持续减少背景下，油价具备反弹动能。煤炭方面，今年以来国内煤炭产量缺乏弹性，同时安监趋于严格、抑制煤炭产量释放；需求端，煤化工耗煤维持高位，同时考虑到 26Q3 大部分为夏季旺季，在供给收缩背景下，行业供需格局会继续改善。整体而言，在国内宏观整体平稳运行情况下，后续随着海外市场对港股的资金虹吸效应趋缓，港股整体面临的压制或将有所缓和、当前位置具备一定性价比，而在总量与微观基本面出现确定性逆转前，港股内部的红利资产配置价值将持续凸显。对于港股通央企红利指数来说，一方面在全球地缘复杂背景下，关键领域央企内在安全支撑价值有望长期显现，另一方面指数相比同类显著超配能源、电力及通信，亦能够分享产业浪潮中的演绎红利，投资价值可关注。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金进行了收益分配，符合法律法规和基金合同约定。具体如下：

权益登记日 2026 年 1 月 19 日，每 10 份基金份额分红数 0.1000。

权益登记日 2026 年 4 月 14 日，每 10 份基金份额分红数 0.1000。

#### 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

在本报告期内，本基金托管人在托管南方中证国新港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方中证国新港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产    | 附注号     | 本期末 2026 年 6 月 30 日 | 上年度末 2025 年 12 月 31 日 |
|-------|---------|---------------------|-----------------------|
| 资产：   |         |                     |                       |
| 货币资金  | 6.4.7.1 | 23,236,059.42       | 2,500,596.20          |
| 结算备付金 |         | 4,660,494.93        | 4,710,868.62          |
| 存出保证金 |         | 26,596.61           | 14,673.91             |

|           |         |                     |                       |
|-----------|---------|---------------------|-----------------------|
| 交易性金融资产   | 6.4.7.2 | 2,080,601,217.94    | 2,792,170,992.29      |
| 其中：股票投资   |         | 2,080,601,217.94    | 2,792,170,992.29      |
| 基金投资      |         | -                   | -                     |
| 债券投资      |         | -                   | -                     |
| 资产支持证券投资  |         | -                   | -                     |
| 贵金属投资     |         | -                   | -                     |
| 其他投资      |         | -                   | -                     |
| 衍生金融资产    | 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     |         | 28,529,627.16       | -                     |
| 应收股利      |         | 28,642,414.17       | 815,934.88            |
| 应收申购款     |         | -                   | -                     |
| 递延所得税资产   |         | -                   | -                     |
| 其他资产      | 6.4.7.5 | -                   | -                     |
| 资产总计      |         | 2,165,696,410.23    | 2,800,213,065.90      |
| 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     |         | -                   | 4,119,271.70          |
| 应付赎回款     |         | -                   | -                     |
| 应付管理人报酬   |         | 985,511.94          | 1,201,688.59          |
| 应付托管费     |         | 197,102.38          | 240,337.72            |
| 应付销售服务费   |         | -                   | -                     |
| 应付投资顾问费   |         | -                   | -                     |
| 应交税费      |         | -                   | -                     |
| 应付利润      |         | -                   | -                     |
| 递延所得税负债   |         | -                   | -                     |
| 其他负债      | 6.4.7.6 | 44,972,454.00       | 126,923.47            |
| 负债合计      |         | 46,155,068.32       | 5,688,221.48          |
| 净资产：      |         |                     |                       |
| 实收基金      | 6.4.7.7 | 2,307,485,486.00    | 2,718,485,486.00      |
| 其他综合收益    |         | -                   | -                     |
| 未分配利润     | 6.4.7.8 | -187,944,144.09     | 76,039,358.42         |

|          |  |                  |                  |
|----------|--|------------------|------------------|
| 净资产合计    |  | 2,119,541,341.91 | 2,794,524,844.42 |
| 负债和净资产总计 |  | 2,165,696,410.23 | 2,800,213,065.90 |

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9186 元，基金份额总额 2,307,485,486.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方中证国新港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|------------------------------------|-----------------------------------------|
| 一、营业总收入               |          | -174,754,323.12                    | 45,059,097.92                           |
| 1.利息收入                |          | 37,221.90                          | 31,076.30                               |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.9  | 37,221.90                          | 31,076.30                               |
| 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）      |          | 70,308,939.50                      | 21,252,174.28                           |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.10 | 25,810,714.57                      | -12,320,937.22                          |
| 基金投资收益                |          | -                                  | -                                       |
| 债券投资收益                | 6.4.7.11 | -                                  | -                                       |
| 资产支持证券投资              | 6.4.7.12 | -                                  | -                                       |
| 收益                    |          | -                                  | -                                       |
| 贵金属投资收益               |          | -                                  | -                                       |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.13 | -                                  | -                                       |
| 股利收益                  | 6.4.7.14 | 44,498,224.93                      | 33,573,111.50                           |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 |          | -                                  | -                                       |
| 其他投资收益                |          | -                                  | -                                       |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.15 | -247,130,739.05                    | 24,673,279.84                           |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -                                  | -                                       |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.16 | 2,030,254.53                       | -897,432.50                             |

|                     |            |                 |               |
|---------------------|------------|-----------------|---------------|
| 减：二、营业总支出           |            | 8,269,715.23    | 3,428,982.95  |
| 1.管理人报酬             | 6.4.10.2.1 | 6,727,823.90    | 2,749,977.75  |
| 其中：暂估管理人报酬          |            | -               | -             |
| 2.托管费               | 6.4.10.2.2 | 1,345,564.68    | 549,995.58    |
| 3.销售服务费             | 6.4.10.2.3 | -               | -             |
| 4.投资顾问费             |            | -               | -             |
| 5.利息支出              |            | -               | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | -               | -             |
| 6.信用减值损失            | 6.4.7.17   | -               | -             |
| 7.税金及附加             |            | -               | -             |
| 8.其他费用              | 6.4.7.18   | 196,326.65      | 129,009.62    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | -183,024,038.35 | 41,630,114.97 |
| 减：所得税费用             |            | -               | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | -183,024,038.35 | 41,630,114.97 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |            | -               | -             |
| 六、综合收益总额            |            | -183,024,038.35 | 41,630,114.97 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：南方中证国新港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                   | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |        |                 |                  |
|----------------------|------------------------------------|--------|-----------------|------------------|
|                      | 实收基金                               | 其他综合收益 | 未分配利润           | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产            | 2,718,485,486.00                   | -      | 76,039,358.42   | 2,794,524,844.42 |
| 加：会计政策变更             | -                                  | -      | -               | -                |
| 前期差错更正               | -                                  | -      | -               | -                |
| 其他                   | -                                  | -      | -               | -                |
| 二、本期期初净资产            | 2,718,485,486.00                   | -      | 76,039,358.42   | 2,794,524,844.42 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -411,000,000.00                    | -      | -263,983,502.51 | -674,983,502.51  |
| （一）、综合收益总额           | -                                  | -      | -183,024,038.35 | -183,024,038.35  |

|                                          |                                         |        |                 |                  |
|------------------------------------------|-----------------------------------------|--------|-----------------|------------------|
| (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)      | -411,000,000.00                         | -      | -29,499,754.44  | -440,499,754.44  |
| 其中: 1.基金申购款                              | 89,000,000.00                           | -      | 5,206,534.83    | 94,206,534.83    |
| 2.基金赎回款                                  | -500,000,000.00                         | -      | -34,706,289.27  | -534,706,289.27  |
| (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) | -                                       | -      | -51,459,709.72  | -51,459,709.72   |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                                       | -      | -               | -                |
| 四、本期期末净资产                                | 2,307,485,486.00                        | -      | -187,944,144.09 | 2,119,541,341.91 |
| 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                                | 1,302,485,486.00                        | -      | -81,202,807.73  | 1,221,282,678.27 |
| 加: 会计政策变更                                | -                                       | -      | -               | -                |
| 前期差错更正                                   | -                                       | -      | -               | -                |
| 其他                                       | -                                       | -      | -               | -                |
| 二、本期期初净资产                                | 1,302,485,486.00                        | -      | -81,202,807.73  | 1,221,282,678.27 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -183,000,000.00                         | -      | 36,263,635.63   | -146,736,364.37  |
| (一)、综合收益总额                               | -                                       | -      | 41,630,114.97   | 41,630,114.97    |
| (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)      | -183,000,000.00                         | -      | 13,990,802.97   | -169,009,197.03  |

|                                          |                  |   |                |                  |
|------------------------------------------|------------------|---|----------------|------------------|
| 填列)                                      |                  |   |                |                  |
| 其中：1.基金申购款                               | 126,000,000.00   | - | -12,606,880.16 | 113,393,119.84   |
| 2.基金赎回款                                  | -309,000,000.00  | - | 26,597,683.13  | -282,402,316.87  |
| (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） | -                | - | -19,357,282.31 | -19,357,282.31   |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                | - | -              | -                |
| 四、本期期末净资产                                | 1,119,485,486.00 | - | -44,939,172.10 | 1,074,546,313.90 |

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

南方中证国新港股通央企红利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[2024]820号《关于准予南方中证国新港股通央企红利交易型开放式指数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依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证国新港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,110,481,000.00元,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(2024)第0266号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中证国新港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2024年6月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,110,485,486.00份,其中认购资金利息折合4,486.00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,基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2024]83号核准,本基金1,110,485,486.00份基金份额于2024年7月10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《南方中证国新港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股(包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(简称“港股通股票”)、存托凭证，下同)。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股(包含主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册发行的股票、港股通股票)、金融衍生品(股指期货、股票期权等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、政府机构债券、地方政府债券、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、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)、同业存单、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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金根据相关规定可参与融资、转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：在建仓完成后，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 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的业绩比较基准为：中证国新港股通央企红利指数(人民币中间价)收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表的编制符合企业会计准则以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日的经营成果和净资产变动情况。

#### 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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，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。对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税；取得的在2025年8月8日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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

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

额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

## 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           | 23,236,059.42       |
| 等于：本金          | 23,234,026.97       |
| 加：应计利息         | 2,032.45            |
| 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             | 23,236,059.42       |

### 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            | 2,310,440,586.05    | -    | 2,080,601,217.94 | -<br>229,839,368.11 |
| 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            | 2,310,440,586.05    | -    | 2,080,601,217.94 | -<br>229,839,368.11 |

#### 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       | -                   |
| 应付证券出借违约金   | -                   |
| 应付交易费用      | 19,568.21           |
| 其中：交易所市场    | 19,568.21           |
| 银行间市场       | -                   |
| 应付利息        | -                   |

|         |               |
|---------|---------------|
| 应退退补款   | 44,863,625.64 |
| 预提费用    | 89,260.15     |
| 应付指数使用费 | -             |
| 可退替代款   | -             |
| 合计      | 44,972,454.00 |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                  |
|---------------|------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                            | 账面金额             |
| 上年度末          | 2,718,485,486.00                   | 2,718,485,486.00 |
| 本期申购          | 89,000,000.00                      | 89,000,000.00    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -500,000,000.00                    | -500,000,000.00  |
| 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           | 2,307,485,486.00                   | 2,307,485,486.00 |

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

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
|----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末           | -6,272,126.85  | 82,311,485.27   | 76,039,358.42   |
| 加：会计政策变更       | -              | -               | -               |
| 前期差错更正         | -              | -               | -               |
| 其他             | -              | -               | -               |
| 本期期初           | -6,272,126.85  | 82,311,485.27   | 76,039,358.42   |
| 本期利润           | 64,106,700.70  | -247,130,739.05 | -183,024,038.35 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,798,848.20   | -31,298,602.64  | -29,499,754.44  |
| 其中：基金申购款       | -751,903.23    | 5,958,438.06    | 5,206,534.83    |
| 基金赎回款          | 2,550,751.43   | -37,257,040.70  | -34,706,289.27  |
| 本期已分配利润        | -51,459,709.72 | -               | -51,459,709.72  |
| 本期末            | 8,173,712.33   | -196,117,856.42 | -187,944,144.09 |

#### 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 | 29,616.07                          |
| 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 | 7,435.65  |
| 其他        | 170.18    |
| 合计        | 37,221.90 |

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------------|------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 25,810,714.57                      |
| 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               | 25,810,714.57                      |

##### 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   | 621,810,183.86                     |
| 减：卖出股票成本总额 | 595,099,622.61                     |
| 减：交易费用     | 899,846.68                         |
| 买卖股票差价收入   | 25,810,714.57                      |

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目          | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额  | 534,706,289.27                     |
| 减：现金支付赎回款总额 | 534,706,289.27                     |
| 减：赎回股票成本总额  | -                                  |
| 减：交易费用      | -                                  |
| 赎回差价收入      | -                                  |

##### 6.4.7.10.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益****6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

无。

**6.4.7.13 衍生工具收益****6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**6.4.7.14 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 44,498,224.93                      |
| 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            | 44,498,224.93                      |

**6.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------------------------------|
| 1.交易性金融资产              | -247,130,739.05                    |
| ——股票投资                 | -247,130,739.05                    |
| ——债券投资                 | -                                  |
| ——资产支持证券投资             | -                                  |
| ——贵金属投资                | -                                  |
| ——其他                   | -                                  |
| 2.衍生工具                 | -                                  |
| ——权证投资                 | -                                  |
| ——期货投资                 | -                                  |
| 3.其他                   | -                                  |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                                  |
| 合计                     | -247,130,739.05                    |

**6.4.7.16 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                                  |
| 替代损益    | 2,030,254.53                       |

|    |              |
|----|--------------|
| 合计 | 2,030,254.53 |
|----|--------------|

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

#### 6.4.7.17 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|------------------------------------|
| 审计费用    | 29,752.78                          |
| 信息披露费   | 59,507.37                          |
| 证券出借违约金 | -                                  |
| 其他      | 107,066.50                         |
| 合计      | 196,326.65                         |

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

无。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本基金的基金管理人已发布的本基金分红公告，向截至 2026 年 7 月 14 日止登记在册的全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.1000 元。

### 6.4.9 关联方、关联关系

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

无。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                                                        | 与本基金的关系          |
|--------------------------------------------------------------|------------------|
| 南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)                                         | 基金管理人            |
| 中信建投证券股份有限公司(“中信建投证券”)                                       | 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  |
| 南方中证国新港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(“南方中证国新港股通央企红利 ETF 发起联接”) | 本基金的基金管理人管理的其他基金 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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 |
| 中信建投  | 146,751,212.81                     | 19.50%       | 60,480,600.61                           | 14.80%       |

6.4.10.1.2 债券交易

无。

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 |
| 中信建投  | 8,659.44                                | 19.50%     | 5,837.46 | 29.83%       |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |            |          |              |
|       | 当期佣金                                    | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 中信建投  | 2,684.08                                | 11.75%     | 1,995.77 | 19.61%       |

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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2025 年 1<br>月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 6,727,823.90                          | 2,749,977.75                               |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 107,952.11                            | 226,201.09                                 |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 6,619,871.79                          | 2,523,776.66                               |

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

#### 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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2025 年 1<br>月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,345,564.68                          | 549,995.58                                 |

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                      | 本期 2026 年 1 月 1 日至<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2025 年 1<br>月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 报告期初持有的基金份额             | -                                     | 10,000,000.00                              |
| 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<br>份额      | -                                     | -                                          |
| 报告期末持有的基金份额             | -                                     | 10,000,000.00                              |
| 报告期末持有的基金份额占<br>基金总份额比例 | -                                     | 0.89%                                      |

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

份额单位：份

| 关联方名称                                                           | 本期末 2026 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末 2025 年 12 月 31 日 |                          |
|-----------------------------------------------------------------|---------------------|--------------------------|-----------------------|--------------------------|
|                                                                 | 持有的基金份<br>额         | 持有的基金份<br>额占基金总份<br>额的比例 | 持有的基金份<br>额           | 持有的基金份<br>额占基金总份<br>额的比例 |
| 华泰证券股份有限公司                                                      | 940,630.00          | 0.04%                    | 890,630.00            | 0.03%                    |
| 中信建投证券股份有限<br>公司                                                | 900,284.00          | 0.04%                    | 2,440,300.00          | 0.09%                    |
| 中信建投证券股份有限<br>公司—南方中证国新港<br>股通央企红利交易型开<br>放式指数证券投资基金<br>发起式联接基金 | 252,808,200.0<br>0  | 10.96%                   | 139,712,400.0<br>0    | 5.14%                    |

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

无。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日           | 场内除息日           | 场外除息日 | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额      | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计      | 备注 |
|----|-----------------|-----------------|-------|---------------|---------------|-----------|---------------|----|
| 1  | 2026 年 1 月 19 日 | 2026 年 1 月 20 日 | -     | 0.1000        | 27,114,854.86 | -         | 27,114,854.86 | -  |
| 2  | 2026 年 4 月 14 日 | 2026 年 4 月 15 日 | -     | 0.1000        | 24,344,854.86 | -         | 24,344,854.86 | -  |
| 合计 | -               | -               | -     | 0.2000        | 51,459,709.72 | -         | 51,459,709.72 | -  |

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

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

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 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

本基金为被动式指数基金，紧密跟踪中证国新港股通央企红利指数，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。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险、市场制度以及交易规则不同等境外证券市场投资所面临的特有风险。本基金采用完全复制法，跟踪中证国新港

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

#### 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、流通受限限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

#### 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<br>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                   | 23,236,059.42 | -     | -     | -                | 23,236,059.42    |
| 结算备付金                  | 4,660,494.93  | -     | -     | -                | 4,660,494.93     |
| 存出保证金                  | 26,596.61     | -     | -     | -                | 26,596.61        |
| 交易性金融资产                | -             | -     | -     | 2,080,601,217.94 | 2,080,601,217.94 |
| 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                  | -             | -     | -     | 28,529,627.16    | 28,529,627.16    |
| 应收股利                   | -             | -     | -     | 28,642,414.17    | 28,642,414.17    |
| 应收申购款                  | -             | -     | -     | -                | -                |
| 递延所得税资产                | -             | -     | -     | -                | -                |
| 其他资产                   | -             | -     | -     | -                | -                |
| 资产总计                   | 27,923,150.96 | -     | -     | 2,137,773,259.27 | 2,165,696,410.23 |
| 负债                     |               |       |       |                  |                  |
| 短期借款                   | -             | -     | -     | -                | -                |
| 交易性金融                  | -             | -     | -     | -                | -                |

|                       |               |       |       |                  |                  |
|-----------------------|---------------|-------|-------|------------------|------------------|
| 负债                    |               |       |       |                  |                  |
| 衍生金融负债                | -             | -     | -     | -                | -                |
| 卖出回购金融资产款             | -             | -     | -     | -                | -                |
| 应付清算款                 | -             | -     | -     | -                | -                |
| 应付赎回款                 | -             | -     | -     | -                | -                |
| 应付管理人报酬               | -             | -     | -     | 985,511.94       | 985,511.94       |
| 应付托管费                 | -             | -     | -     | 197,102.38       | 197,102.38       |
| 应付销售服务费               | -             | -     | -     | -                | -                |
| 应付投资顾问费               | -             | -     | -     | -                | -                |
| 应交税费                  | -             | -     | -     | -                | -                |
| 应付利润                  | -             | -     | -     | -                | -                |
| 递延所得税负债               | -             | -     | -     | -                | -                |
| 其他负债                  | -             | -     | -     | 44,972,454.00    | 44,972,454.00    |
| 负债总计                  | -             | -     | -     | 46,155,068.32    | 46,155,068.32    |
| 利率敏感度缺口               | 27,923,150.96 | -     | -     | 2,091,618,190.95 | 2,119,541,341.91 |
| 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                  | 2,500,596.20  | -     | -     | -                | 2,500,596.20     |
| 结算备付金                 | 4,710,868.62  | -     | -     | -                | 4,710,868.62     |
| 存出保证金                 | 14,673.91     | -     | -     | -                | 14,673.91        |
| 交易性金融资产               | -             | -     | -     | 2,792,170,992.29 | 2,792,170,992.29 |
| 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      | -            | - | - | 815,934.88       | 815,934.88       |
| 应收申购款     | -            | - | - | -                | -                |
| 递延所得税资产   | -            | - | - | -                | -                |
| 其他资产      | -            | - | - | -                | -                |
| 资产总计      | 7,226,138.73 | - | - | 2,792,986,927.17 | 2,800,213,065.90 |
| 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     | -            | - | - | 4,119,271.70     | 4,119,271.70     |
| 应付赎回款     | -            | - | - | -                | -                |
| 应付管理人报酬   | -            | - | - | 1,201,688.59     | 1,201,688.59     |
| 应付托管费     | -            | - | - | 240,337.72       | 240,337.72       |
| 应付销售服务费   | -            | - | - | -                | -                |
| 应付投资顾问费   | -            | - | - | -                | -                |
| 应交税费      | -            | - | - | -                | -                |
| 应付利润      | -            | - | - | -                | -                |
| 递延所得税负债   | -            | - | - | -                | -                |
| 其他负债      | -            | - | - | 126,923.47       | 126,923.47       |
| 负债总计      | -            | - | - | 5,688,221.48     | 5,688,221.48     |
| 利率敏感度缺口   | 7,226,138.73 | - | - | 2,787,298,705.69 | 2,794,524,844.42 |

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产或负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目            | 本期末 2026 年 6 月 30 日 |                  |         |         |           |                  |
|---------------|---------------------|------------------|---------|---------|-----------|------------------|
|               | 美元折合人民币             | 港币折合人民币          | 欧元折合人民币 | 日元折合人民币 | 其他币种折合人民币 | 合计               |
| 以外币计价的资产      |                     |                  |         |         |           |                  |
| 交易性金融资产       | -                   | 2,080,601,217.94 | -       | -       | -         | 2,080,601,217.94 |
| 资产合计          | -                   | 2,080,601,217.94 | -       | -       | -         | 2,080,601,217.94 |
| 以外币计价的负债      |                     |                  |         |         |           |                  |
| 负债合计          | -                   | -                | -       | -       | -         | -                |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                   | 2,080,601,217.94 | -       | -       | -         | 2,080,601,217.94 |

| 项目            | 上年度末 2025 年 12 月 31 日 |                  |         |         |           |                  |
|---------------|-----------------------|------------------|---------|---------|-----------|------------------|
|               | 美元折合人民币               | 港币折合人民币          | 欧元折合人民币 | 日元折合人民币 | 其他币种折合人民币 | 合计               |
| 以外币计价的资产      |                       |                  |         |         |           |                  |
| 交易性金融资产       | -                     | 2,792,170,992.29 | -       | -       | -         | 2,792,170,992.29 |
| 资产合计          | -                     | 2,792,170,992.29 | -       | -       | -         | 2,792,170,992.29 |
| 以外币计价的负债      |                       |                  |         |         |           |                  |
| 负债合计          | -                     | -                | -       | -       | -         | -                |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                     | 2,792,170,992.29 | -       | -       | -         | 2,792,170,992.29 |

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

|    |                   |                             |                          |
|----|-------------------|-----------------------------|--------------------------|
| 假设 | 除汇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. 所有外币相对人民币升值 5% | 104,030,060.90              | 139,608,549.61           |
|    | 2. 所有外币相对人民币贬值 5% | -104,030,060.90             | -139,608,549.61          |

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

| 项目            | 本期末 2026 年 6 月 30 日 |              | 上年度末 2025 年 12 月 31 日 |              |
|---------------|---------------------|--------------|-----------------------|--------------|
|               | 公允价值                | 占基金资产净值比例（%） | 公允价值                  | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产-股票投资  | 2,080,601,217.94    | 98.16        | 2,792,170,992.29      | 99.92        |
| 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            | 2,080,601,217.94    | 98.16        | 2,792,170,992.29      | 99.92        |

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% | 100,680,238.15  | 133,379,381.74  |
| 2.组合自身基准下降 5% | -100,680,238.15 | -133,379,381.74 |

#### 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          | 2,080,601,217.94    |
| 第二层次          | -                   |
| 第三层次          | -                   |
| 合计            | 2,080,601,217.94    |

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|-------------------|------------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 2,080,601,217.94 | 96.07            |
|    | 其中：股票             | 2,080,601,217.94 | 96.07            |
| 2  | 基金投资              | -                | -                |
| 3  | 固定收益投资            | -                | -                |
|    | 其中：债券             | -                | -                |
|    | 资产支持证券            | -                | -                |
| 4  | 贵金属投资             | -                | -                |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                | -                |
| 6  | 买入返售金融资产          | -                | -                |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -                |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 27,896,554.35    | 1.29             |
| 8  | 其他各项资产            | 57,198,637.94    | 2.64             |
| 9  | 合计                | 2,165,696,410.23 | 100.00           |

注：1、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；

2、本基金本报告期末通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币 2,080,601,217.94 元，占基金资产净值比例 98.16%。

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

无。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别   | 公允价值（人民币）      | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|----------------|--------------|
| 能源     | 596,233,761.69 | 28.13        |
| 材料     | 338,632,514.86 | 15.98        |
| 工业     | 439,088,934.91 | 20.72        |
| 非必需消费品 | -              | -            |
| 必需消费品  | 3,134,701.18   | 0.15         |
| 医疗保健   | 33,947,551.22  | 1.60         |
| 金融     | 46,697,330.18  | 2.20         |

|      |                  |       |
|------|------------------|-------|
| 科技   | 94,276,759.75    | 4.45  |
| 通讯   | 339,619,435.20   | 16.02 |
| 公用事业 | 142,355,150.45   | 6.72  |
| 房地产  | 46,615,078.50    | 2.20  |
| 政府   | -                | -     |
| 合计   | 2,080,601,217.94 | 98.16 |

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

### 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  | 01088 | 中国神华     | 6,608,500  | 230,281,284.52 | 10.86        |
| 2  | 00857 | 中国石油股份   | 30,088,000 | 221,607,266.75 | 10.46        |
| 3  | 00883 | 中国海洋石油   | 12,102,000 | 213,587,423.47 | 10.08        |
| 4  | 00941 | 中国移动     | 3,031,500  | 200,503,660.10 | 9.46         |
| 5  | 00386 | 中国石油化工股份 | 44,826,000 | 155,734,489.20 | 7.35         |
| 6  | 01919 | 中远海控     | 10,720,500 | 121,139,886.48 | 5.72         |
| 7  | 06869 | 长飞光纤光缆   | 425,000    | 94,276,759.75  | 4.45         |
| 8  | 00728 | 中国电信     | 22,672,000 | 84,083,839.11  | 3.97         |
| 9  | 00762 | 中国联通     | 10,370,000 | 55,031,935.99  | 2.60         |
| 10 | 00788 | 中国铁塔     | 6,284,700  | 48,090,056.19  | 2.27         |
| 11 | 01109 | 华润置地     | 1,789,000  | 46,615,078.50  | 2.20         |
| 12 | 00836 | 华润电力     | 3,032,000  | 44,557,865.71  | 2.10         |
| 13 | 03968 | 招商银行     | 1,008,500  | 39,346,895.76  | 1.86         |
| 14 | 00135 | 昆仑能源     | 6,738,000  | 37,630,224.06  | 1.78         |
| 15 | 01898 | 中煤能源     | 4,396,000  | 37,608,736.13  | 1.77         |
| 16 | 00316 | 东方海外国际   | 257,000    | 27,232,516.70  | 1.28         |
| 17 | 01800 | 中国交通建设   | 8,009,000  | 25,529,316.21  | 1.20         |
| 18 | 01766 | 中国中车     | 6,338,000  | 24,716,865.85  | 1.17         |
| 19 | 03323 | 中国建材     | 5,214,000  | 24,182,829.20  | 1.14         |
| 20 | 02600 | 中国铝业     | 3,554,000  | 23,027,727.18  | 1.09         |
| 21 | 01816 | 中广核电力    | 9,740,000  | 22,671,934.36  | 1.07         |
| 22 | 00144 | 招商局港口    | 2,112,000  | 22,636,219.58  | 1.07         |

|    |       |         |           |               |      |
|----|-------|---------|-----------|---------------|------|
| 23 | 01138 | 中远海能    | 1,754,000 | 21,069,129.56 | 0.99 |
| 24 | 03311 | 中国建筑国际  | 3,328,000 | 20,147,024.77 | 0.95 |
| 25 | 01099 | 国药控股    | 1,445,600 | 19,976,212.25 | 0.94 |
| 26 | 01258 | 中国有色矿业  | 1,912,000 | 18,682,510.50 | 0.88 |
| 27 | 00390 | 中国中铁    | 5,674,000 | 16,312,185.44 | 0.77 |
| 28 | 00598 | 中国外运    | 4,839,000 | 16,055,129.38 | 0.76 |
| 29 | 02386 | 中石化炼化工程 | 3,619,000 | 15,496,382.48 | 0.73 |
| 30 | 01186 | 中国铁建    | 3,654,000 | 14,503,725.37 | 0.68 |
| 31 | 03898 | 时代电气    | 412,900   | 14,366,489.26 | 0.68 |
| 32 | 01193 | 华润燃气    | 1,050,600 | 13,377,229.92 | 0.63 |
| 33 | 00552 | 中国通信服务  | 3,748,000 | 12,760,875.57 | 0.60 |
| 34 | 02380 | 中国电力    | 4,580,000 | 10,899,607.66 | 0.51 |
| 35 | 00916 | 龙源电力    | 2,342,000 | 10,170,720.50 | 0.48 |
| 36 | 01072 | 东方电气    | 461,000   | 8,536,561.05  | 0.40 |
| 37 | 03969 | 中国通号    | 3,044,000 | 8,460,371.84  | 0.40 |
| 38 | 03877 | 中国船舶租赁  | 3,918,000 | 7,350,434.42  | 0.35 |
| 39 | 02666 | 环球医疗    | 1,872,500 | 7,221,037.85  | 0.34 |
| 40 | 03320 | 华润医药    | 1,833,000 | 6,750,301.12  | 0.32 |
| 41 | 01199 | 中远海运港口  | 1,702,000 | 6,622,659.01  | 0.31 |
| 42 | 00934 | 中石化冠德   | 1,740,000 | 5,304,582.27  | 0.25 |
| 43 | 00297 | 中化化肥    | 4,362,000 | 4,849,427.33  | 0.23 |
| 44 | 03996 | 中国能源建设  | 4,788,000 | 4,616,065.31  | 0.22 |
| 45 | 00038 | 第一拖拉机股份 | 658,000   | 3,823,374.47  | 0.18 |
| 46 | 02866 | 中远海发    | 4,617,000 | 3,488,782.95  | 0.16 |
| 47 | 01618 | 中国中冶    | 3,040,000 | 3,485,317.44  | 0.16 |
| 48 | 00506 | 中国食品    | 1,168,000 | 3,134,701.18  | 0.15 |
| 49 | 01811 | 中广核新能源  | 1,632,000 | 3,047,568.24  | 0.14 |

### 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

无。

## 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  | 06869 | 长飞光纤光缆   | 34,289,925.95 | 1.23           |
| 2  | 00883 | 中国海洋石油   | 10,079,890.53 | 0.36           |
| 3  | 01088 | 中国神华     | 9,729,374.16  | 0.35           |
| 4  | 00857 | 中国石油股份   | 9,693,080.59  | 0.35           |
| 5  | 00941 | 中国移动     | 8,327,814.32  | 0.30           |
| 6  | 00386 | 中国石油化工股份 | 7,363,217.32  | 0.26           |
| 7  | 01919 | 中远海控     | 5,097,360.28  | 0.18           |
| 8  | 02386 | 中石化炼化工程  | 4,712,054.47  | 0.17           |
| 9  | 00728 | 中国电信     | 3,947,120.03  | 0.14           |
| 10 | 03877 | 中国船舶租赁   | 3,021,234.40  | 0.11           |
| 11 | 00762 | 中国联通     | 2,673,329.75  | 0.10           |
| 12 | 00788 | 中国铁塔     | 2,351,118.50  | 0.08           |
| 13 | 00836 | 华润电力     | 1,987,475.12  | 0.07           |
| 14 | 01109 | 华润置地     | 1,884,671.04  | 0.07           |
| 15 | 01898 | 中煤能源     | 1,814,556.05  | 0.06           |
| 16 | 00135 | 昆仑能源     | 1,804,741.78  | 0.06           |
| 17 | 03968 | 招商银行     | 1,691,552.20  | 0.06           |
| 18 | 02600 | 中国铝业     | 1,442,598.82  | 0.05           |
| 19 | 01800 | 中国交通建设   | 1,315,849.18  | 0.05           |
| 20 | 01816 | 中广核电力    | 1,312,704.34  | 0.05           |

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  | 00883 | 中国海洋石油   | 68,910,586.56 | 2.47           |
| 2  | 00857 | 中国石油股份   | 67,011,444.52 | 2.40           |
| 3  | 01088 | 中国神华     | 65,449,136.48 | 2.34           |
| 4  | 00941 | 中国移动     | 54,079,361.38 | 1.94           |
| 5  | 00386 | 中国石油化工股份 | 48,678,847.06 | 1.74           |
| 6  | 01919 | 中远海控     | 35,005,341.52 | 1.25           |
| 7  | 00728 | 中国电信     | 25,120,697.07 | 0.90           |
| 8  | 00762 | 中国联通     | 17,185,237.65 | 0.61           |
| 9  | 01816 | 中广核电力    | 14,960,184.96 | 0.54           |
| 10 | 00788 | 中国铁塔     | 14,858,877.72 | 0.53           |

|    |       |        |               |      |
|----|-------|--------|---------------|------|
| 11 | 00836 | 华润电力   | 12,842,274.78 | 0.46 |
| 12 | 01109 | 华润置地   | 12,390,079.75 | 0.44 |
| 13 | 01898 | 中煤能源   | 12,303,369.14 | 0.44 |
| 14 | 00135 | 昆仑能源   | 11,580,323.91 | 0.41 |
| 15 | 03968 | 招商银行   | 10,802,301.86 | 0.39 |
| 16 | 02600 | 中国铝业   | 9,579,322.77  | 0.34 |
| 17 | 06869 | 长飞光纤光缆 | 9,388,218.71  | 0.34 |
| 18 | 01800 | 中国交通建设 | 8,299,579.87  | 0.30 |
| 19 | 00316 | 东方海外国际 | 8,035,016.26  | 0.29 |
| 20 | 01766 | 中国中车   | 7,632,212.33  | 0.27 |

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 | 130,660,587.31 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 621,810,183.86 |

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

无。

#### 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

无。

#### 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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

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

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额（元）         |
|----|-------|---------------|
| 1  | 存出保证金 | 26,596.61     |
| 2  | 应收清算款 | 28,529,627.16 |
| 3  | 应收股利  | 28,642,414.17 |
| 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    | 57,198,637.94 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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

| 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          |        | 南方中证国新港股通<br>央企红利交易型开放<br>式指数证券投资基金<br>发起式联接基金 |        |
|          |            | 持有份额             | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例 | 持有份额                                           | 占总份额比例 |
| 4,126    | 559,254.84 | 1,874,594,085.00 | 81.24% | 180,083,201.00 | 7.80%  | 252,808,200.00                                 | 10.96% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2024 年 6 月 26 日)基金份<br>额总额 | 1,110,485,486.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 2,718,485,486.00 |

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 本报告期基金总申购份额   | 89,000,000.00    |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 500,000,000.00   |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额  | 2,307,485,486.00 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

自 2026 年 1 月起，中信建投证券股份有限公司托管部行政负责人由朱志明变更为孙祥磊。

### 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，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

#### 10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

#### 10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内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<br>单元<br>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 |    |
| 国泰海通 | 2              | 605,719,558.36 | 80.50%       | 35,739.75 | 80.50%     | -  |
| 中信建投 | 2              | 146,751,212.81 | 19.50%       | 8,659.44  | 19.50%     | -  |
| 国信证券 | 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：无；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 |
| 国泰海通 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | - | - | - | - | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                             | 法定披露方式                      | 法定披露日期     |
|----|--------------------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 1  | 南方基金管理股份有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更场内简称的公告              | 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 | 2026-01-08 |
| 2  | 南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加世纪证券为一级交易商的公告             | 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 | 2026-01-13 |
| 3  | 南方中证国新港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金分红公告                  | 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 | 2026-01-15 |
| 4  | 南方基金管理股份有限公司关于旗下部分指数基金 2026 年非港股通交易日申购赎回等业务安排的公告 | 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 | 2026-01-22 |
| 5  | 南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加万联证券为一级交易商的公告             | 上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-02-13 |
| 6  | 南方基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）     | 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 | 2026-03-31 |
| 7  | 南方中证国新港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金分红公告                  | 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 | 2026-04-10 |
| 8  | 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 |
| 9  | 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 |
| 10 | 南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加东北证券为一级交易商的公告             | 上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-06-23 |
| 11 | 南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加华源证券为一级交易商的公告             | 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 | 2026-06-30 |

## § 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

### 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国新港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金的文件；

2、《南方中证国新港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《南方中证国新港股通央企红利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、《南方中证国新港股通央企红利交易型开放式指数证券投资基金 2026 年中期报告》原文。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

### 12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>