

南方中证 500 增强策略交易型开放式 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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.....	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.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
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.....	10
§5 托管人报告.....	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	49

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	52
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.....	52
10.8 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 500 增强策略 ETF
场内简称	中证 500 增强 ETF 南方
基金主代码	560100
交易代码	560100
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 1 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	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	59,580,333.00 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	2022 年 2 月 16 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强策略交易型开放式指数证券投资基金，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 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.5%。
投资策略	本基金主要通过量化投资模型，在控制组合跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。主要投资策略包括：1、以增强指数投资收益为目的的股票投资策略；2、金融衍生品投资策略；3、债券投资策略；4、转融通证券出借业务投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、存托凭证投资策略
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
风险收益特征	本基金属股票型基金，一般而言，其风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革
	联系电话	0755-82763888
		郭明
		(010) 66105799

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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	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	14,690,136.02
本期利润	15,836,893.79
加权平均基金份额本期利润	0.2697
本期加权平均净值利润率	19.47%
本期基金份额净值增长率	21.13%
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	30,549,287.84
期末可供分配基金份额利润	0.5127
期末基金资产净值	90,129,620.84
期末基金份额净值	1.5127
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	51.27%
-------------	--------

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	17.98%	1.66%	18.56%	1.65%	-0.58%	0.01%
过去六个月	21.13%	1.64%	20.97%	1.66%	0.16%	-0.02%
过去一年	51.59%	1.40%	52.68%	1.42%	-1.09%	-0.02%
过去三年	59.21%	1.41%	50.55%	1.49%	8.66%	-0.08%
自基金合同生效起至今	51.27%	1.33%	33.16%	1.41%	18.11%	-0.08%

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增强策略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		
崔蕾	本基金	2022 年 1	-	11 年	中国国籍，女，康奈尔大学金融工程硕

	基金经 理	月 26 日			士，具有基金从业资格。2015 年 2 月加入南方基金，历任数量化投资部助理研究员、研究员，指数投资部研究员；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 4 月 23 日，任南方小康 ETF、南方小康 ETF 联接基金经理；2019 年 6 月 28 日至 2022 年 2 月 18 日，任大数据 300 基金经理；2020 年 3 月 26 日至 2023 年 3 月 27 日，任南方粤港澳大湾区联接基金经理；2019 年 11 月 29 日至 2023 年 7 月 4 日，任南方粤港澳大湾区 ETF 基金经理；2018 年 11 月 8 日至 2023 年 12 月 29 日，任南方中证 500 增强基金经理；2022 年 12 月 1 日至 2023 年 12 月 29 日，任南方上证科创板 50 成份增强策略 ETF 基金经理；2019 年 6 月 12 日至 2025 年 6 月 6 日，任南方顶峰 TOPIX ETF（QDII）基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任南方中证申万有色金属 ETF、南方有色金属 ETF 联接、南方中证 1000ETF 基金经理；2020 年 1 月 17 日至今，任南方标普中国 A 股大盘红利低波 50ETF 基金经理；2020 年 1 月 21 日至今，任南方标普红利低波 50ETF 联接基金经理；2021 年 6 月 24 日至今，任南方中证科创创业 50ETF 基金经理；2021 年 8 月 19 日至今，任南方中证科创创业 50ETF 联接基金经理；2021 年 9 月 27 日至今，任南方中证 1000ETF 发起联接基金经理；2021 年 12 月 29 日至今，任南方国证在线消费 ETF 基金经理；2022 年 1 月 26 日至今，任南方中证 500 增强策略 ETF 基金经理；2022 年 11 月 23 日至今，任南方国证交通运输行业 ETF 基金经理；2023 年 11 月 24 日至今，任南方国证交通运输行业 ETF 发起联接基金经理。
--	----------	--------	--	--	--

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

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

本报告期内指数涨跌幅 20.97%，产品净值涨幅 21.13%，超额收益仅约 0.16 个百分点，增强效果不显著。主要原因是上半年市场呈现极致结构性分化，AI 科技主线一骑绝尘，传统板块普遍下跌，本基金的量化模型未能有效识别并超配这一极端风格。在科技主导的极端分化行情中，基金对科技板块配置不足、持仓分散度过高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.5127 元，报告期内，份额净值增长率为 21.13%，同期业绩基准增长率为 20.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

截至 2026 年 6 月 30 日，中证 500 估值处于历史高位，PE-TTM 超 40 倍，位于历史分位数 90% 以上，安全边际不足。并且上半年极致分化后，高估值、低估值板块的剪刀差已处于

历史较高水平，后续市场可能出现风格切换。本基金使用的量化模型更适合行业分布相对均衡的市场环境，在极致分化行情中可能持续承压，但若风格反转或有较好表现。另下半年 A 股将从前期的 beta 行情转为盈利验证驱动的结构性情行，本基金使用的基本面量化模型能较好地捕捉该类 alpha。

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 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 增强策略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	232,966.73	4,537,676.64
结算备付金		1,987,151.48	2,388,203.95
存出保证金		893,109.34	906,798.56
交易性金融资产	6.4.7.2	82,765,675.50	75,945,313.97
其中：股票投资		82,753,675.01	75,945,313.97
基金投资		-	-
债券投资		12,000.49	-
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		4,596,121.84	344,545.59
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		90,475,024.89	84,122,538.71
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		-	93,230.70
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		34,558.31	33,842.71
应付托管费		3,455.82	3,384.27
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6,518.61	3,700.57
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	300,871.31	217,989.25
负债合计		345,404.05	352,147.50
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	59,580,333.00	67,080,333.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	30,549,287.84	16,690,058.21
净资产合计		90,129,620.84	83,770,391.21
负债和净资产总计		90,475,024.89	84,122,538.71

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5127 元，基金份额总额 59,580,333.00 份。

6.2 利润表

会计主体：南方中证 500 增强策略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		16,114,571.94	5,583,137.44
1.利息收入		20,643.00	30,578.80
其中：存款利息收入	6.4.7.9	20,643.00	30,578.80
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）		14,476,141.03	3,884,102.79
其中：股票投资收益	6.4.7.10	12,423,674.55	2,823,891.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	0.49	4,864.56
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	1,533,339.03	65,866.65
股利收益	6.4.7.14	519,126.96	989,480.16
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.15	1,146,757.77	1,582,195.01
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	471,030.14	86,260.84
减：二、营业总支出		277,678.15	329,654.56
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	202,146.51	226,339.01
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	20,214.64	22,633.89
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		5,524.43	1,133.12
8.其他费用	6.4.7.18	49,792.57	79,548.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,836,893.79	5,253,482.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,836,893.79	5,253,482.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		15,836,893.79	5,253,482.88

6.3 净资产变动表

会计主体：南方中证 500 增强策略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	67,080,333.00	-	16,690,058.21	83,770,391.21
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	67,080,333.00	-	16,690,058.21	83,770,391.21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,500,000.00	-	13,859,229.63	6,359,229.63
（一）、综合收益总额	-	-	15,836,893.79	15,836,893.79
（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）	-7,500,000.00	-	-1,977,664.16	-9,477,664.16
其中：1.基金申购款	76,500,000.00	-	31,296,855.49	107,796,855.49
2.基金赎回款	-84,000,000.00	-	-33,274,519.65	-117,274,519.65

（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	59,580,333.00	-	30,549,287.84	90,129,620.84
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	104,580,333.00	-	-4,795,394.57	99,784,938.43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	104,580,333.00	-	-4,795,394.57	99,784,938.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-24,000,000.00	-	4,628,262.98	-19,371,737.02
（一）、综合收益总额	-	-	5,253,482.88	5,253,482.88
（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）	-24,000,000.00	-	-625,219.90	-24,625,219.90
其中：1.基金申购款	58,500,000.00	-	-2,366,945.21	56,133,054.79
2.基金赎回款	-82,500,000.00	-	1,741,725.31	-80,758,274.69
（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	80,580,333.00	-	-167,131.59	80,413,201.41

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 增强策略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[2021]3580 号《关于准予南方中证 500 增强策略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 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 746,577,500.00 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(2022)第 0042 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2022 年 1 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 746,580,333.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,833.00 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2022]38 号审核同意，本基金 746,580,333.00 份基金份额于 2022 年 2 月 16 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 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，力争实现超越目标指数的投资收益；主要投资于标的指数成份股、备选成份股。此外，本基金可少量投资于非成份股(包含主板、创业板及其他经中国证监会核准/注册发行的股票)、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、政府支持债券、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、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)。本基金可投资存托凭证。基金管理人根据相关规定可参与转融通证券

出借业务。本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产净值的 80%。每个交易日日终，在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 6.5%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率。

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、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”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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

本基金的主要税项列示如下：

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 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》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（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、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、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》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，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、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金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，暂减按 25% 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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰ 调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《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[2016]127 号《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	232,966.73
等于：本金	232,815.17
加：应计利息	151.56
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	232,966.73

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		78,308,606.93	-	82,753,675.01	4,445,068.08
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	12,000.00	0.49	12,000.49	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	12,000.00	0.49	12,000.49	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		78,320,606.93	0.49	82,765,675.50	4,445,068.08

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

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		合同/名义金额	公允价值		备注
			资产	负债	
利率衍生工具		-	-	-	-
货币衍生工具		-	-	-	-
权益衍生工具		6,853,160.00	-	-	-
-股指期货		6,853,160.00	-	-	-
其他衍生工具		-	-	-	-
合计		6,853,160.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2607	IC2607	4.00	7,142,560.00	289,400.00
合计				289,400.00
减：可抵销期货暂收款				289,400.00
净额				0.00

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的利率/货币/权益/其他衍生工具为国债/外汇/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债/外汇/股指/商品期

货投资合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债/外汇/股指/商品期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

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	30,512.01
其中：交易所市场	30,512.01
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	193,312.71
预提费用	49,588.57
应付指数使用费	-
可退替代款	27,458.02
合计	300,871.31

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	67,080,333.00	67,080,333.00
本期申购	76,500,000.00	76,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-84,000,000.00	-84,000,000.00
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	59,580,333.00	59,580,333.00

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	19,192,056.89	-2,501,998.68	16,690,058.21
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	19,192,056.89	-2,501,998.68	16,690,058.21
本期利润	14,690,136.02	1,146,757.77	15,836,893.79
本期基金份额交易产生的变动数	-2,285,203.02	307,538.86	-1,977,664.16
其中：基金申购款	32,902,947.80	-1,606,092.31	31,296,855.49
基金赎回款	-35,188,150.82	1,913,631.17	-33,274,519.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,596,989.89	-1,047,702.05	30,549,287.84

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	4,196.57
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	16,388.76
其他	57.67
合计	20,643.00

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	10,036,735.76
股票投资收益——赎回差价收入	2,386,938.79
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	12,423,674.55

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	237,054,421.07
减：卖出股票成本总额	226,821,467.66
减：交易费用	196,217.65
买卖股票差价收入	10,036,735.76

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	117,274,519.65
减：现金支付赎回款总额	60,665,941.65
减：赎回股票成本总额	54,221,639.21
减：交易费用	-
赎回差价收入	2,386,938.79

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

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	0.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	0.49

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	1,533,339.03

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	519,126.96
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	519,126.96

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	1,218,597.77
——股票投资	1,218,597.77
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-71,840.00
——权证投资	-
——期货投资	-71,840.00
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	1,146,757.77

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	471,030.14
合计	471,030.14

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	9,916.99
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	204.00
合计	49,792.57

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
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人
华泰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
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

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	182,263,290.88	38.48%	150,646,152.28	42.35%

兴业证券	113,767,247.68	24.02%	-	-
------	----------------	--------	---	---

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	-	-	2,554.64	9.88%

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	18,204.25	38.48%	12,424.15	40.72%
兴业证券	11,366.84	24.02%	6,010.98	19.70%
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
华泰证券	15,042.72	42.33%	9,175.62	47.69%
兴业证券	-	-	-	-

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	上年度可比期间 2025 年 1
----	--------------------	------------------

	2026 年 6 月 30 日	月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	202,146.51	226,339.01
其中：应支付销售机构的客户维护费	15,274.31	10,345.63
应支付基金管理人的净管理费	186,872.20	215,993.38

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% \div \text{当年天数}。$$

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	20,214.64	22,633.89

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% \div \text{当年天数}。$$

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

无。

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	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券股份有限公司	1,467,500.00	2.46%	1,104,500.00	1.65%

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

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
中国工商银行	232,966.73	4,196.57	5,062,507.50	5,760.87

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	113704	春风转债	配债	70	7,000.00

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	-	-	-	-	-

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
001248	华润新能源	2026 年 6 月 25 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	1,000	10,110.00	10,110.00	-
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
113704	春风转债	2026 年 6 月 11 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	70	7,000.00	7,000.32	-
118071	华峰转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	40	4,000.00	4,000.07	-
113703	翔 26 转债	2026 年 6 月 11 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	10	1,000.00	1,000.10	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601369	陕鼓动力	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	9.05	2026 年 7 月 13 日	9.96	4,200	39,879.94	38,010.00	-

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

本基金是指数型基金，其风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。紧密跟踪中证 500 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金在力求对中证 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。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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变

动以确保质押品按公允价值计算足额，并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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	232,966.73	-	-	-	232,966.73
结算备付金	1,987,151.48	-	-	-	1,987,151.48
存出保证金	36,002.14	-	-	857,107.20	893,109.34
交易性金融资产	-	-	12,000.49	82,753,675.01	82,765,675.50
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	-	-	-	4,596,121.84	4,596,121.84
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,256,120.35	-	12,000.49	88,206,904.05	90,475,024.89
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	-	-	-	34,558.31	34,558.31
应付托管费	-	-	-	3,455.82	3,455.82
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	6,518.61	6,518.61
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	300,871.31	300,871.31
负债总计	-	-	-	345,404.05	345,404.05
利率敏感度缺口	2,256,120.35	-	12,000.49	87,861,500.00	90,129,620.84
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	4,537,676.64	-	-	-	4,537,676.64
结算备付金	2,388,203.95	-	-	-	2,388,203.95
存出保证金	22,806.56	-	-	883,992.00	906,798.56
交易性金融资产	-	-	-	75,945,313.97	75,945,313.97
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	-	-	-	344,545.59	344,545.59
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,948,687.15	-	-	77,173,851.56	84,122,538.71
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	-	-	-	93,230.70	93,230.70
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	33,842.71	33,842.71
应付托管费	-	-	-	3,384.27	3,384.27
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3,700.57	3,700.57
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	217,989.25	217,989.25
负债总计	-	-	-	352,147.50	352,147.50
利率敏感度缺口	6,948,687.15	-	-	76,821,704.06	83,770,391.21

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	82,753,675.01	91.82	75,945,313.97	90.66
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	12,000.49	0.01	-	-
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	82,765,675.50	91.83	75,945,313.97	90.66

注：1、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。

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

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%	4,380,051.37	3,974,042.34
	2.组合自身基准下降 5%	-4,380,051.37	-3,974,042.34

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	82,705,555.01
第二层次	60,120.49
第三层次	-
合计	82,765,675.50

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

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	82,753,675.01	91.47
	其中：股票	82,753,675.01	91.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,000.49	0.01
	其中：债券	12,000.49	0.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	2,220,118.21	2.45
8	其他各项资产	5,489,231.18	6.07
9	合计	90,475,024.89	100.00

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

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

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	41,192.00	0.05
B	采矿业	2,698,080.40	2.99
C	制造业	66,597,943.00	73.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	597,495.00	0.66
E	建筑业	729,151.00	0.81

F	批发和零售业	4,184,751.31	4.64
G	交通运输、仓储和邮政业	858,090.00	0.95
H	住宿和餐饮业	244,664.00	0.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,587,708.46	2.87
J	金融业	1,681,699.00	1.87
K	房地产业	357,826.00	0.40
L	租赁和商务服务业	1,104,374.00	1.23
M	科学研究和技术服务业	34,339.84	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	632,544.00	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	393,707.00	0.44
S	综合	-	-
	合计	82,743,565.01	91.81

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,110.00	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,110.00	0.01

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	688498	源杰科技	812	1,531,432.00	1.70
2	300604	长川科技	3,700	1,263,254.00	1.40
3	688361	中科飞测	2,600	1,118,000.00	1.24
4	300136	信维通信	9,200	1,097,100.00	1.22
5	300857	协创数据	3,160	1,074,084.00	1.19
6	300223	北京君正	4,100	1,020,490.00	1.13
7	002008	大族激光	6,700	1,005,737.00	1.12
8	300475	香农芯创	3,300	990,000.00	1.10
9	002436	兴森科技	18,700	952,765.00	1.06
10	000021	深科技	13,600	874,072.00	0.97
11	688037	芯源微	1,806	792,924.30	0.88
12	300757	罗博特科	1,200	742,800.00	0.82
13	688777	中控技术	6,223	731,202.50	0.81
14	300567	精测电子	2,300	730,480.00	0.81
15	002851	麦格米特	4,200	702,156.00	0.78
16	300346	南大光电	7,400	685,610.00	0.76
17	300548	长芯博创	2,400	667,200.00	0.74
18	600498	烽火通信	8,900	655,040.00	0.73
19	002185	华天科技	29,200	651,452.00	0.72
20	002407	多氟多	12,600	632,898.00	0.70
21	301526	国际复材	13,500	630,045.00	0.70
22	300395	菲利华	4,700	628,531.00	0.70
23	688002	睿创微纳	4,051	626,649.19	0.70
24	300620	光库科技	1,600	605,120.00	0.67
25	600141	兴发集团	12,800	601,216.00	0.67
26	601869	长飞光纤	1,100	600,490.00	0.67
27	300390	天华新能	6,400	598,464.00	0.66
28	688313	仕佳光子	3,174	586,079.10	0.65
29	000960	锡业股份	13,600	580,584.00	0.64
30	300373	扬杰科技	3,600	566,028.00	0.63
31	688234	天岳先进	3,220	558,702.20	0.62
32	300058	蓝色光标	40,100	551,776.00	0.61
33	600497	驰宏锌锗	45,000	544,950.00	0.60
34	301377	鼎泰高科	900	495,810.00	0.55

35	002738	中矿资源	8,400	495,516.00	0.55
36	600601	方正科技	35,700	494,088.00	0.55
37	600143	金发科技	31,400	485,130.00	0.54
38	600352	浙江龙盛	39,400	477,134.00	0.53
39	300458	全志科技	11,876	468,626.96	0.52
40	002812	恩捷股份	7,000	468,370.00	0.52
41	601233	桐昆股份	21,200	458,980.00	0.51
42	603650	彤程新材	4,500	440,910.00	0.49
43	000034	神州数码	15,880	440,670.00	0.49
44	002465	海格通信	34,400	439,288.00	0.49
45	002335	科华数据	10,320	438,084.00	0.49
46	002056	横店东磁	14,300	435,864.00	0.48
47	002850	科达利	2,300	435,390.00	0.48
48	002402	和而泰	16,800	433,944.00	0.48
49	688411	海博思创	1,482	431,558.40	0.48
50	600105	永鼎股份	6,300	425,124.00	0.47
51	000060	中金岭南	56,000	423,920.00	0.47
52	688728	格科微	20,148	423,913.92	0.47
53	600060	海信视像	15,201	423,651.87	0.47
54	000703	恒逸石化	31,200	423,384.00	0.47
55	688235	百济神州	1,658	422,143.38	0.47
56	002414	高德红外	31,200	413,712.00	0.46
57	688331	荣昌生物	3,169	412,793.94	0.46
58	300623	捷捷微电	9,100	409,409.00	0.45
59	002203	海亮股份	17,900	409,015.00	0.45
60	301200	大族数控	1,100	396,715.00	0.44
61	000878	云南铜业	24,500	389,060.00	0.43
62	300339	润和软件	10,000	385,100.00	0.43
63	603129	春风动力	1,500	383,700.00	0.43
64	603444	吉比特	1,070	383,509.40	0.43
65	600298	安琪酵母	10,528	381,113.60	0.42
66	300207	欣旺达	20,000	379,800.00	0.42
67	002155	湖南黄金	15,500	369,985.00	0.41
68	002266	浙富控股	73,100	369,886.00	0.41
69	300115	长盈精密	13,200	368,808.00	0.41
70	002432	九安医疗	5,200	367,536.00	0.41
71	000623	吉林敖东	20,400	361,692.00	0.40
72	603225	新凤鸣	18,100	355,665.00	0.39
73	600392	盛和资源	11,900	354,263.00	0.39
74	688169	石头科技	3,726	353,858.22	0.39
75	000967	盈峰环境	33,600	353,808.00	0.39
76	002841	视源股份	10,200	352,206.00	0.39
77	000039	中集集团	42,800	347,108.00	0.39

78	000062	深圳华强	10,900	346,838.00	0.38
79	300142	沃森生物	26,700	346,833.00	0.38
80	000661	长春高新	5,200	346,320.00	0.38
81	002487	大金重工	5,900	342,023.00	0.38
82	000050	深天马 A	34,400	340,904.00	0.38
83	000830	鲁西化工	28,400	340,800.00	0.38
84	600704	物产中大	72,100	340,312.00	0.38
85	600332	白云山	16,800	336,672.00	0.37
86	002756	永兴材料	5,900	334,176.00	0.37
87	601216	君正集团	74,900	334,054.00	0.37
88	300558	贝达药业	5,100	331,857.00	0.37
89	600985	淮北矿业	23,600	331,580.00	0.37
90	300073	当升科技	6,900	331,476.00	0.37
91	600699	均胜电子	15,300	330,633.00	0.37
92	300972	万辰集团	1,900	329,479.00	0.37
93	000737	北方铜业	24,900	329,178.00	0.37
94	688295	中复神鹰	5,412	327,642.48	0.36
95	600329	达仁堂	8,700	323,814.00	0.36
96	300919	中伟新材	7,400	323,750.00	0.36
97	600998	九州通	68,859	322,948.71	0.36
98	300383	光环新网	25,900	322,196.00	0.36
99	300953	震裕科技	2,400	320,880.00	0.36
100	603816	顾家家居	14,300	319,748.00	0.35
101	300054	鼎龙股份	3,000	317,910.00	0.35
102	600170	上海建工	143,200	317,904.00	0.35
103	000629	钒钛股份	94,800	316,632.00	0.35
104	000951	中国重汽	16,200	316,062.00	0.35
105	002500	山西证券	61,100	315,276.00	0.35
106	000519	中兵红箭	14,800	311,836.00	0.35
107	000959	首钢股份	88,200	309,582.00	0.34
108	600100	同方股份	45,000	308,250.00	0.34
109	600380	健康元	32,700	308,034.00	0.34
110	603345	安井食品	3,800	304,722.00	0.34
111	600390	五矿资本	66,800	304,608.00	0.34
112	600595	中孚实业	54,100	304,042.00	0.34
113	601611	中国核建	27,100	302,165.00	0.34
114	000800	一汽解放	50,400	299,880.00	0.33
115	301606	绿联科技	4,900	298,998.00	0.33
116	600546	山煤国际	27,300	298,389.00	0.33
117	688525	佰维存储	602	297,827.46	0.33
118	600737	中粮糖业	24,100	297,153.00	0.33
119	002312	川发龙蟒	32,300	296,191.00	0.33
120	600521	华海药业	20,500	295,200.00	0.33

121	002683	广东宏大	10,000	292,900.00	0.32
122	603728	鸣志电器	4,800	292,416.00	0.32
123	002138	顺络电子	4,000	292,400.00	0.32
124	601866	中远海发	131,800	291,278.00	0.32
125	603899	晨光股份	14,100	290,883.00	0.32
126	000415	渤海租赁	71,400	290,598.00	0.32
127	603858	步长制药	19,800	289,080.00	0.32
128	000825	太钢不锈	84,200	287,122.00	0.32
129	600126	杭钢股份	46,800	286,884.00	0.32
130	000983	山西焦煤	49,400	286,520.00	0.32
131	600801	华新建材	18,302	285,511.20	0.32
132	601666	平煤股份	39,800	284,570.00	0.32
133	600688	上海石化	96,600	283,038.00	0.31
134	600062	华润双鹤	17,600	282,304.00	0.31
135	002032	苏泊尔	7,100	281,160.00	0.31
136	600166	福田汽车	96,500	280,815.00	0.31
137	688409	富创精密	914	279,912.50	0.31
138	603233	大参林	18,600	279,558.00	0.31
139	688349	三一重能	18,235	276,807.30	0.31
140	600208	衢州发展	96,000	271,680.00	0.30
141	688778	厦钨新能	4,952	269,388.80	0.30
142	600486	扬农化工	5,310	269,217.00	0.30
143	002120	韵达股份	41,900	266,484.00	0.30
144	000987	越秀资本	34,000	265,880.00	0.29
145	601399	国机重装	75,800	265,300.00	0.29
146	603939	益丰药房	14,720	264,665.60	0.29
147	600685	中船防务	10,400	264,576.00	0.29
148	000785	居然智家	131,000	262,000.00	0.29
149	003022	联泓新科	10,100	261,590.00	0.29
150	600132	重庆啤酒	6,300	260,190.00	0.29
151	002299	圣农发展	17,008	257,841.28	0.29
152	688200	华峰测控	487	255,723.70	0.28
153	300308	中际旭创	200	254,000.00	0.28
154	601608	中信重工	52,400	249,948.00	0.28
155	600816	建元信托	100,800	245,952.00	0.27
156	600754	锦江酒店	13,600	244,664.00	0.27
157	603986	兆易创新	300	244,500.00	0.27
158	300592	华凯易佰	13,700	242,490.00	0.27
159	600977	中国电影	18,100	233,852.00	0.26
160	600098	广州发展	39,200	231,672.00	0.26
161	301150	中一科技	3,600	227,196.00	0.25
162	600339	中油工程	72,600	222,882.00	0.25
163	000750	国海证券	60,500	222,640.00	0.25

164	002064	华峰化学	23,400	222,066.00	0.25
165	688326	经纬恒润	3,047	215,971.36	0.24
166	300438	鹏辉能源	2,600	215,410.00	0.24
167	688388	嘉元科技	4,846	213,224.00	0.24
168	600292	电投水电	17,600	211,904.00	0.24
169	002384	东山精密	800	209,880.00	0.23
170	688025	杰普特	442	207,740.00	0.23
171	001298	好上好	9,900	205,425.00	0.23
172	000301	东方盛虹	17,400	199,230.00	0.22
173	301217	铜冠铜箔	1,200	198,084.00	0.22
174	600988	赤峰黄金	7,500	197,400.00	0.22
175	600739	辽宁成大	19,500	197,145.00	0.22
176	600487	亨通光电	1,800	196,812.00	0.22
177	688390	固德威	1,811	196,511.61	0.22
178	603681	永冠新材	8,600	196,510.00	0.22
179	600150	中国船舶	5,800	195,982.00	0.22
180	600419	天润乳业	25,700	194,549.00	0.22
181	601061	中信金属	18,000	193,860.00	0.22
182	000990	诚志股份	23,500	192,230.00	0.21
183	002273	水晶光电	5,403	191,698.44	0.21
184	603618	杭电股份	3,800	189,544.00	0.21
185	601069	西部黄金	8,600	189,200.00	0.21
186	002493	荣盛石化	17,600	189,200.00	0.21
187	688059	华锐精密	936	186,928.56	0.21
188	688063	派能科技	3,509	186,924.43	0.21
189	600955	维远股份	12,600	185,472.00	0.21
190	600230	沧州大化	13,900	180,978.00	0.20
191	603629	利通电子	1,000	178,810.00	0.20
192	603026	石大胜华	2,000	178,740.00	0.20
193	603045	福达合金	2,400	171,336.00	0.19
194	688017	绿的谐波	401	167,561.86	0.19
195	600879	航天电子	7,800	166,062.00	0.18
196	688766	普冉股份	210	160,986.00	0.18
197	688019	安集科技	468	158,867.28	0.18
198	300570	太辰光	600	148,026.00	0.16
199	688099	晶晨股份	1,315	135,313.50	0.15
200	002409	雅克科技	600	134,700.00	0.15
201	601179	中国西电	9,000	134,280.00	0.15
202	300037	新宙邦	1,200	111,420.00	0.12
203	000831	中国稀土	2,000	110,980.00	0.12
204	001389	广合科技	400	94,900.00	0.11
205	001314	亿道信息	1,400	86,520.00	0.10
206	300454	深信服	800	76,960.00	0.09

207	600563	法拉电子	400	76,320.00	0.08
208	600885	宏发股份	2,200	75,878.00	0.08
209	688213	思特威	698	74,734.86	0.08
210	002126	银轮股份	1,400	69,720.00	0.08
211	688322	奥比中光	528	68,930.40	0.08
212	603156	养元饮品	1,400	68,698.00	0.08
213	601198	东兴证券	4,800	65,232.00	0.07
214	301536	星宸科技	500	64,355.00	0.07
215	601139	深圳燃气	11,100	62,826.00	0.07
216	002130	沃尔核材	3,300	62,568.00	0.07
217	601665	齐鲁银行	10,700	61,739.00	0.07
218	600256	广汇能源	12,000	59,280.00	0.07
219	000423	东阿阿胶	1,300	58,968.00	0.07
220	603920	世运电路	1,200	57,648.00	0.06
221	600171	上海贝岭	1,800	57,492.00	0.06
222	688582	芯动联科	874	56,810.00	0.06
223	000786	北新建材	3,100	56,079.00	0.06
224	002430	杭氧股份	1,800	55,728.00	0.06
225	300677	英科医疗	1,420	55,621.40	0.06
226	600177	雅戈尔	7,300	54,969.00	0.06
227	600516	方大炭素	8,900	54,913.00	0.06
228	001696	宗申动力	2,600	54,106.00	0.06
229	600637	东方明珠	6,500	54,015.00	0.06
230	300679	电连技术	900	53,991.00	0.06
231	300627	华测导航	1,900	53,960.00	0.06
232	002673	西部证券	8,300	53,867.00	0.06
233	002065	东华软件	7,400	52,836.00	0.06
234	603766	隆鑫通用	4,400	52,492.00	0.06
235	000921	海信家电	1,900	51,908.00	0.06
236	002195	岩山科技	7,900	51,666.00	0.06
237	601990	南京证券	7,800	51,246.00	0.06
238	002085	万丰奥威	4,600	51,014.00	0.06
239	603341	龙旗科技	1,200	50,988.00	0.06
240	002568	百润股份	3,000	50,760.00	0.06
241	603568	伟明环保	3,300	50,754.00	0.06
242	601001	晋控煤业	2,900	50,431.00	0.06
243	603699	纽威股份	1,000	50,300.00	0.06
244	601000	唐山港	12,100	50,215.00	0.06
245	002318	久立特材	2,100	50,190.00	0.06
246	601717	中创智领	3,600	50,076.00	0.06
247	600873	梅花生物	6,800	49,980.00	0.06
248	002603	以岭药业	3,300	49,500.00	0.05
249	600901	江苏金租	8,580	49,335.00	0.05

250	603298	杭叉集团	2,060	49,151.60	0.05
251	002410	广联达	6,000	48,960.00	0.05
252	000528	柳工	6,400	48,320.00	0.05
253	600398	海澜之家	9,200	48,116.00	0.05
254	600038	中直股份	1,900	48,051.00	0.05
255	000932	华菱钢铁	13,800	47,886.00	0.05
256	002152	广电运通	5,100	47,838.00	0.05
257	601567	三星电气	3,200	47,808.00	0.05
258	300735	光弘科技	2,100	47,754.00	0.05
259	688709	成都华微	1,247	47,498.23	0.05
260	600820	隧道股份	9,100	47,411.00	0.05
261	000591	太阳能	10,300	47,380.00	0.05
262	600282	南钢股份	10,300	47,277.00	0.05
263	000725	京东方 A	5,400	46,872.00	0.05
264	600350	山东高速	4,200	46,746.00	0.05
265	002340	格林美	7,000	46,270.00	0.05
266	600008	首创环保	17,000	46,240.00	0.05
267	000513	丽珠集团	1,600	46,224.00	0.05
268	000997	新大陆	2,800	45,640.00	0.05
269	000598	兴蓉环境	7,100	45,582.00	0.05
270	600602	云赛智联	2,800	45,024.00	0.05
271	600535	天士力	3,400	44,982.00	0.05
272	603726	朗迪集团	1,300	44,525.00	0.05
273	600970	中材国际	6,200	44,206.00	0.05
274	000883	湖北能源	10,200	44,064.00	0.05
275	600871	石化油服	21,600	43,848.00	0.05
276	600131	国网信通	3,000	43,800.00	0.05
277	000429	粤高速 A	3,200	43,680.00	0.05
278	002068	黑猫股份	2,900	43,587.00	0.05
279	600848	上海临港	5,800	43,442.00	0.05
280	300146	汤臣倍健	4,800	43,392.00	0.05
281	601098	中南传媒	4,400	43,296.00	0.05
282	601928	凤凰传媒	4,900	43,071.00	0.05
283	603589	口子窖	2,300	42,964.00	0.05
284	600483	福能股份	4,200	42,798.00	0.05
285	000027	深圳能源	6,900	42,780.00	0.05
286	600663	陆家嘴	6,800	42,704.00	0.05
287	300718	长盛轴承	700	42,679.00	0.05
288	600517	国网英大	9,100	42,588.00	0.05
289	000100	TCL 科技	7,300	42,486.00	0.05
290	600582	天地科技	9,500	42,275.00	0.05
291	688475	萤石网络	1,543	42,201.05	0.05
292	002367	康力电梯	6,100	42,151.00	0.05

293	688425	铁建重工	10,465	42,069.30	0.05
294	601598	中国外运	8,400	41,664.00	0.05
295	600377	宁沪高速	3,600	41,652.00	0.05
296	603658	安图生物	1,430	41,498.60	0.05
297	600598	北大荒	3,800	41,192.00	0.05
298	601298	青岛港	5,100	41,055.00	0.05
299	600764	中国海防	2,300	40,089.00	0.04
300	002265	建设工业	2,300	40,020.00	0.04
301	605277	新亚电子	2,040	38,882.40	0.04
302	601019	山东出版	6,000	38,400.00	0.04
303	002774	快意电梯	2,700	38,367.00	0.04
304	000937	冀中能源	9,580	38,128.40	0.04
305	002658	雪迪龙	4,500	38,025.00	0.04
306	601369	陕鼓动力	4,200	38,010.00	0.04
307	688819	天能股份	1,712	38,006.40	0.04
308	600566	济川药业	1,700	37,723.00	0.04
309	002728	特一药业	4,100	37,515.00	0.04
310	002461	珠江啤酒	4,900	37,093.00	0.04
311	002884	凌霄泵业	2,400	36,576.00	0.04
312	601138	工业富联	500	36,075.00	0.04
313	002315	焦点科技	1,540	35,851.20	0.04
314	603886	元祖股份	2,800	35,784.00	0.04
315	600078	澄星股份	2,500	35,525.00	0.04
316	603565	中谷物流	3,600	35,316.00	0.04
317	002533	金杯电工	3,300	35,211.00	0.04
318	600757	长江传媒	4,800	35,088.00	0.04
319	600261	阳光照明	11,356	34,976.48	0.04
320	600183	生益科技	200	34,680.00	0.04
321	002206	海利得	6,700	34,639.00	0.04
322	600479	千金药业	3,720	34,596.00	0.04
323	603357	设计总院	5,648	34,339.84	0.04
324	601728	中国电信	6,600	34,254.00	0.04
325	000544	中原环保	4,900	34,153.00	0.04
326	300017	网宿科技	2,600	33,826.00	0.04
327	600299	安迪苏	4,300	33,755.00	0.04
328	000523	红棉股份	13,000	33,540.00	0.04
329	002274	华昌化工	7,200	33,336.00	0.04
330	300230	永利股份	7,900	33,180.00	0.04
331	002900	哈三联	3,600	33,048.00	0.04
332	600968	海油发展	9,900	32,967.00	0.04
333	300349	金卡智能	3,000	32,820.00	0.04
334	603897	长城科技	1,000	32,460.00	0.04
335	300410	正业科技	2,900	32,103.00	0.04

336	002416	爱施德	3,500	31,360.00	0.03
337	300834	星辉环材	700	29,260.00	0.03
338	300751	迈为股份	100	28,246.00	0.03
339	600378	昊华科技	300	22,614.00	0.03
340	003031	中瓷电子	100	18,030.00	0.02
341	000032	深桑达 A	700	17,465.00	0.02
342	688708	佳驰科技	281	14,274.80	0.02
343	002939	长城证券	400	3,336.00	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	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.01

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	600498	烽火通信	1,932,436.00	2.31
2	002008	大族激光	1,871,308.00	2.23
3	300604	长川科技	1,868,714.17	2.23
4	300857	协创数据	1,864,039.00	2.23
5	000657	中钨高新	1,854,995.00	2.21
6	300475	香农芯创	1,733,867.00	2.07
7	002202	金风科技	1,733,210.00	2.07
8	002558	巨人网络	1,641,897.00	1.96
9	300450	先导智能	1,622,489.00	1.94
10	002532	天山铝业	1,604,312.00	1.92
11	300919	中伟新材	1,582,372.00	1.89
12	002340	格林美	1,572,829.00	1.88
13	300073	当升科技	1,507,562.00	1.80
14	002738	中矿资源	1,501,944.00	1.79
15	002850	科达利	1,486,140.00	1.77
16	300136	信维通信	1,410,560.00	1.68
17	301308	江波龙	1,403,367.00	1.68
18	300972	万辰集团	1,396,214.00	1.67
19	002156	通富微电	1,379,145.25	1.65
20	300058	蓝色光标	1,360,149.00	1.62

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	000657	中钨高新	3,123,900.90	3.73
2	600487	亨通光电	2,392,048.00	2.86
3	002202	金风科技	2,297,086.00	2.74
4	002156	通富微电	2,199,221.00	2.63
5	300450	先导智能	2,173,877.00	2.60
6	301308	江波龙	2,162,436.00	2.58
7	002008	大族激光	2,142,717.00	2.56
8	002532	天山铝业	2,093,118.00	2.50
9	300604	长川科技	2,087,703.00	2.49
10	002558	巨人网络	1,988,557.00	2.37
11	688525	佰维存储	1,986,588.63	2.37
12	300857	协创数据	1,882,024.00	2.25
13	002340	格林美	1,539,910.00	1.84
14	600498	烽火通信	1,538,867.18	1.84
15	002126	银轮股份	1,530,110.00	1.83
16	300454	深信服	1,521,923.00	1.82
17	002080	中材科技	1,505,288.00	1.80
18	000960	锡业股份	1,488,539.00	1.78
19	301200	大族数控	1,457,456.00	1.74
20	000426	兴业银锡	1,375,138.00	1.64

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	236,611,212.82
卖出股票收入（成交）总额	237,054,421.07

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）	12,000.49	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,000.49	0.01

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	113704	春风转债	70	7,000.32	0.01
2	118071	华峰转债	40	4,000.07	0.00
3	113703	翔 26 转债	10	1,000.10	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。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。

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	893,109.34
2	应收清算款	4,596,121.84
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,489,231.18

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	001248	华润新能源	10,110.00	0.01	新股未上市

§ 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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,350	44,133.58	20,166,933.00	33.85 %	39,413,400.00	66.15 %

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(2022 年 1 月 26 日)基金份额总额	746,580,333.00
本报告期期初基金份额总额	67,080,333.00
本报告期基金总申购份额	76,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	84,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	59,580,333.00

§ 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。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

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重大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重大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	
华泰证券	2	182,263,290.88	38.48%	18,204.25	38.48%	-
招商证券	2	173,521,134.85	36.64%	17,335.28	36.64%	-
兴业证券	1	113,767,247.68	24.02%	11,366.84	24.02%	-
中信证券	2	2,948,879.00	0.62%	294.54	0.62%	-
国泰海通	2	1,134,318.48	0.24%	113.28	0.24%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	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：招商证券；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
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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	证券日报、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	证券日报、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）	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
4	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加民生证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-22
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	证券日报、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	证券日报、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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-12
8	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	证券日报、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

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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		达到或者超过 20% 的时间区间					
机构	1	20260101-20260119, 20260212-20260212, 20260224-20260304, 20260507-20260510, 20260514-20260514	17,971,900.00	123,279,800.00	135,111,100.00	6,140,600.00	10.31%
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 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方中证 500 增强策略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 500 增强策略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>