

# 南方中证 500 增强策略交易型开放式 指数证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 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及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 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 2024 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.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	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.....	10
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.....	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.....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	55
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.....	55
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.....	55

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	55
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12	投资组合报告附注	56
§8	基金份额持有人信息	57
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2	期末上市基金前十名持有人	57
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§9	开放式基金份额变动	58
§10	重大事件揭示	58
10.1	基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4	基金投资策略的改变	58
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8	其他重大事件	60
§11	影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
§12	备查文件目录	60
12.1	备查文件目录	61
12.2	存放地点	61
12.3	查阅方式	61

## § 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	增强 ETF；中证 500 增强 ETF
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	112,080,333.00 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	常克川
	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-52,287.50
本期利润	-1,041,272.79
加权平均基金份额本期利润	-0.0087
本期加权平均净值利润率	-1.00%
本期基金份额净值增长率	-2.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-17,227,916.49
期末可供分配基金份额利润	-0.1537
期末基金资产净值	94,852,416.51
期末基金份额净值	0.8463
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	-15.37%
-------------	---------

注：1、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；

2、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；

3、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。

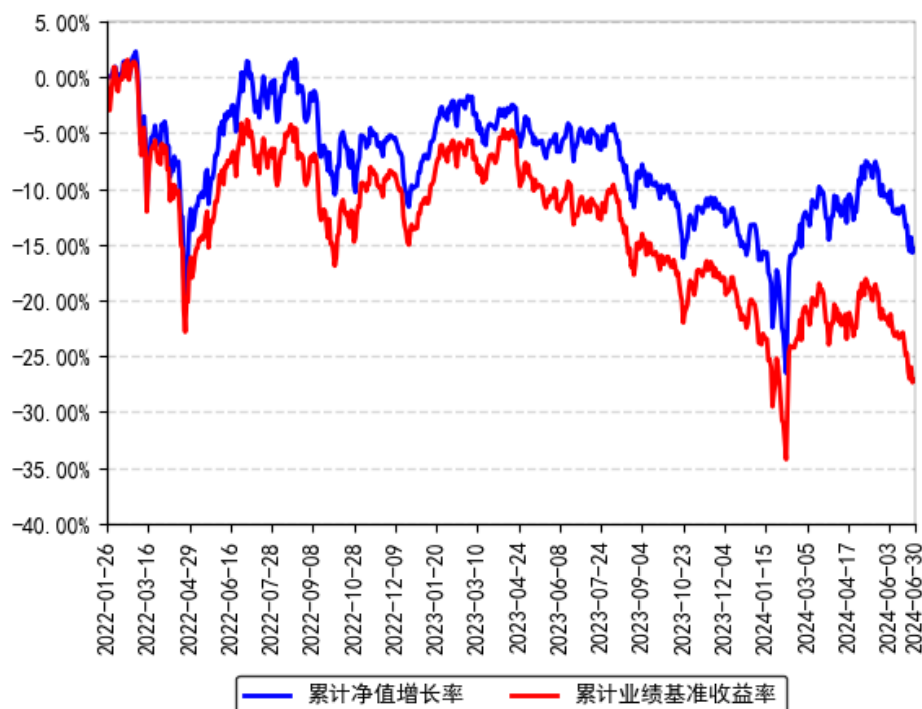
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去一个月	-5.32%	0.92%	-6.89%	0.96%	1.57%	-0.04%
过去三个月	-3.30%	1.06%	-6.50%	1.14%	3.20%	-0.08%
过去六个月	-2.44%	1.48%	-8.96%	1.61%	6.52%	-0.13%
过去一年	-10.93%	1.17%	-17.60%	1.27%	6.67%	-0.10%
自基金合同生效起至今	-15.37%	1.16%	-27.13%	1.24%	11.76%	-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	-	9年	女，康奈尔大学金融工程硕士，特许金



	基金经 理	月 26 日		融分析师（CFA），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 日至今，任南方顶峰 TOPIX ETF（QDII）基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任有色金属、南方有色金属联接、1000ETF 基金经理；2020 年 1 月 17 日至今，任红利 50 基金经理；2020 年 1 月 21 日至今，任南方大盘红利 50 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 1000 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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基

金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 69 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

2024 年上半年，中证 500 指数增强 ETF 超额收益为 6.5%。从因子角度分析，主要是传统的基本面因子表现较好，如估值、盈利、成长因子，而过去三年表现强势的量价因子、小市值风格则表现较差。

#### 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 0.8463 元，报告期内，份额净值增长率为-2.44%，同期业绩基准增长率为-8.96%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，外部不确定性较高，而国内经济仍处于弱复苏状态，股指上行弹性较弱。同时新国九条以及央企改革开启政策周期，投资范式正从过去追逐高频因子转向传统的基本面因子。我们将继续坚持以中低频因子为主的量化投资风格，严控行业及风格暴露，力争实现超越目标指数的投资收益。

### 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，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、现金及债券指数投资部总经理、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 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本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 2024 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.3.1	3,500,470.38	1,656,911.31
结算备付金		3,750,224.34	1,671,503.63
存出保证金		958,067.22	418,301.74
交易性金融资产	6.4.3.2	86,791,116.20	109,370,625.63
其中：股票投资		86,791,116.20	109,367,925.43
基金投资		-	-
债券投资		-	2,700.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
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		-	248,657.57
应收股利		-	-

应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		94,999,878.14	113,365,999.88
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.05	1,010.88
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		39,789.51	44,522.74
应付托管费		3,978.95	4,452.27
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	6.4.3.6	103,693.12	465,821.89
负债合计		147,461.63	515,807.78
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	112,080,333.00	130,080,333.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	-17,227,916.49	-17,230,140.90
净资产合计		94,852,416.51	112,850,192.10
负债和净资产总计		94,999,878.14	113,365,999.88

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8463 元，基金份额总额 112,080,333.00 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-669,537.21	7,814,218.25
1.利息收入		34,013.04	41,292.60
其中：存款利息收入	6.4.3.9	34,013.04	41,292.60

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）		12,726.65	3,549,307.22
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-1,798,314.04	2,168,733.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	4,100.69	18,749.29
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.12	238,999.30	-421,079.15
股利收益	6.4.3.13	1,567,940.70	1,782,903.49
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.14	-988,985.29	4,046,808.46
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.15	272,708.39	176,809.97
减：二、营业总支出		371,735.58	420,839.45
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	259,726.20	305,586.36
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.6.2.2	25,972.52	30,558.67
3.销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		1,305.88	213.24
8.其他费用	6.4.3.16	84,730.98	84,481.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,041,272.79	7,393,378.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,041,272.79	7,393,378.80

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,041,272.79	7,393,378.80

### 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	130,080,333.00	-	-17,230,140.90	112,850,192.10
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	130,080,333.00	-	-17,230,140.90	112,850,192.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-18,000,000.00	-	2,224.41	-17,997,775.59
（一）、综合收益总额	-	-	-1,041,272.79	-1,041,272.79
（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）	-18,000,000.00	-	1,043,497.20	-16,956,502.80
其中：1.基金申购款	109,500,000.00	-	-19,503,596.06	89,996,403.94
2.基金赎回款	-127,500,000.00	-	20,547,093.26	-106,952,906.74
（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	112,080,333.00	-	-17,227,916.49	94,852,416.51
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	137,580,333.00	-	-13,425,273.46	124,155,059.54
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	137,580,333.00	-	-13,425,273.46	124,155,059.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-25,500,000.00	-	7,834,027.26	-17,665,972.74
（一）、综合收益总额	-	-	7,393,378.80	7,393,378.80
（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）	-25,500,000.00	-	440,648.46	-25,059,351.54
其中：1.基金申购款	162,000,000.00	-	-7,520,675.01	154,479,324.99
2.基金赎回款	-187,500,000.00	-	7,961,323.47	-179,538,676.53
（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	112,080,333.00	-	-5,591,246.20	106,489,086.80

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\_\_\_\_                      \_\_\_\_常克川\_\_\_\_                      \_\_\_\_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 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。

### 6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.2.1 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。

#### 6.4.2.2 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。

#### 6.4.2.3 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。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	3,500,470.38
等于：本金	3,500,238.73
加：应计利息	231.65
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	3,500,470.38

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	90,355,802.93	-	86,791,116.20	-3,564,686.73

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	90,355,802.93	-	-	86,791,116.20	-3,564,686.73

### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	8,177,000.00	-	-	-
一指期货	8,177,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,177,000.00	-	-	-

#### 6.4.3.3.2 期末基金持有的期货合约情况

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2407	IC2407	2.00	1,967,040.00	-74,120.00
IC2409	IC2409	6.00	5,850,240.00	-285,600.00
合计				-359,720.00
减：可抵销期货暂收款				-359,720.00
净额				-

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权益衍生工具为股指期货投资，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股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指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。

### 6.4.3.4 买入返售金融资产

#### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

**6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.3.5 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.3.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	19,157.76
其中：交易所市场	19,157.76
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	-
预提费用	84,535.36
应付指数使用费	-
可退替代款	-
合计	103,693.12

**6.4.3.7 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	130,080,333.00	130,080,333.00
本期申购	109,500,000.00	109,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-127,500,000.00	-127,500,000.00
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	112,080,333.00	112,080,333.00

注：红利再投及转入份额计入本期申购，转出份额计入本期赎回。

**6.4.3.8 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	-9,250,783.79	-7,979,357.11	-17,230,140.90
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	-9,250,783.79	-7,979,357.11	-17,230,140.90
本期利润	-52,287.50	-988,985.29	-1,041,272.79
本期基金份额交易产生的变动数	1,305,373.68	-261,876.48	1,043,497.20
其中：基金申购款	-11,615,565.61	-7,888,030.45	-19,503,596.06
基金赎回款	12,920,939.29	7,626,153.97	20,547,093.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,997,697.61	-9,230,218.88	-17,227,916.49

#### 6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,983.03
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	28,856.20
其他	173.81
合计	34,013.04

#### 6.4.3.10 股票投资收益

##### 6.4.3.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,560,397.56
股票投资收益——赎回差价收入	-237,916.48
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	-1,798,314.04

##### 6.4.3.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	226,019,381.13
减：卖出股票成本总额	227,393,549.17
减：交易费用	186,229.52
买卖股票差价收入	-1,560,397.56

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

##### 6.4.3.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

赎回基金份额对价总额	106,952,906.74
减：现金支付赎回款总额	44,938,144.74
减：赎回股票成本总额	62,252,678.48
减：交易费用	-
赎回差价收入	-237,916.48

#### 6.4.3.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

#### 6.4.3.11 债券投资收益

##### 6.4.3.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	1.55
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,099.14
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	4,100.69

##### 6.4.3.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	14,801.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,700.00
减：应计利息总额	1.75
减：交易费用	0.61
买卖债券差价收入	4,099.14

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

##### 6.4.3.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

##### 6.4.3.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 6.4.3.12 衍生工具收益

##### 6.4.3.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

**6.4.3.12.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	238,999.30

**6.4.3.13 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,567,940.70
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	1,567,940.70

**6.4.3.14 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-639,958.62
——股票投资	-639,958.62
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-349,026.67
——权证投资	-
——期货投资	-349,026.67
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	-988,985.29

**6.4.3.15 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	272,708.39
合计	272,708.39

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。

**6.4.3.16 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	184.00
其他	11.62
合计	84,730.98

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

#### 6.4.5 关联方关系

##### 6.4.5.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 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
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司("兴业证券")	基金管理人的股东、基金销售机构

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。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	214,089,465.77	48.03%	405,078,751.74	45.26%
兴业证券	144,371,393.94	32.39%	337,915,687.93	37.75%

###### 6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	1,887.60	12.75%	101,582.53	88.76%
兴业证券	-	-	12,867.03	11.24%

#### 6.4.6.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.6.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	21,409.08	48.03%	10,278.33	53.65%
兴业证券	14,439.51	32.39%	6,934.88	36.20%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	40,504.03	45.25%	22,792.87	47.02%
兴业证券	33,800.24	37.76%	19,040.90	39.28%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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。

#### 6.4.6.2 关联方报酬

##### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	259,726.20	305,586.36
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,658.81	8,024.35
应支付基金管理人的净管理费	253,067.39	297,562.01

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。

#### 6.4.6.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	25,972.52	30,558.67

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.05%÷当年天数。

#### 6.4.6.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.6.4 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

##### 6.4.6.4.1 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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。

##### 6.4.6.4.2 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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。

#### 6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 6.4.6.5.2 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总额	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总额

		额的比例		额的比例
华泰证券股份有限公司	1,655,000.00	1.48%	1,600,000.00	1.23%

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。

#### 6.4.6.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	3,500,470.38	4,983.03	4,293,022.59	5,001.14

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。

#### 6.4.6.7 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	-	-	-	-
兴业证券,华泰联合	-	-	-	-	-

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	113066	平煤转债	配债	850	85,000.00
华泰联合	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	1,364	44,357.28
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	1,838	38,450.96
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	1,483	28,473.60
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
兴业证券,华泰联合	688469	中芯集成	网下申购	12,695	72,234.55

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.7 利润分配情况

##### 6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 6.4.8 期末（2024 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.8.1 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

6.4.8.1.1 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
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定期	19.86	42.51	110	2,184.60	4,676.10	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁定期	9.60	16.10	274	2,630.40	4,411.40	-
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股锁定期	21.28	29.49	46	978.88	1,356.54	-
603375	盛景微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	新股锁定期	38.18	38.90	25	954.50	972.50	-
6.4.8.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金持有的上述流通受限证券，根据中国证监会、证券交易所发布的相关规定，在受限期内不得转让：

1. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2. 基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3. 基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4. 基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

## 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

## 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.9 金融工具风险及管理

#### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，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。

#### 6.4.9.2 信用风险

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

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

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

#### 6.4.9.3 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。

##### 6.4.9.3.1 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期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。

#### 6.4.9.4 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。

##### 6.4.9.4.1 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。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	3,500,470.38	-	-	-	3,500,470.38
结算备付金	3,750,224.34	-	-	-	3,750,224.34
存出保证金	19,993.62	-	-	938,073.60	958,067.22
交易性金融资产	-	-	-	86,791,116.20	86,791,116.20
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,270,688.34	-	-	87,729,189.80	94,999,878.14
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	-	-	-	0.05	0.05
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	39,789.51	39,789.51
应付托管费	-	-	-	3,978.95	3,978.95
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	-	-	-	103,693.12	103,693.12
负债总计	-	-	-	147,461.63	147,461.63
利率敏感度缺口	7,270,688.34	-	-	87,581,728.17	94,852,416.51
上年度末					
2023 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	1,656,911.31	-	-	-	1,656,911.31

结算备付金	1,671,503.63	-	-	-	1,671,503.63
存出保证金	26,852.14	-	-	391,449.60	418,301.74
交易性金融资产	-	-	2,700.20	109,367,925.43	109,370,625.63
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	-	-	-	248,657.57	248,657.57
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,355,267.08	-	2,700.20	110,008,032.60	113,365,999.88
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	-	-	-	1,010.88	1,010.88
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	44,522.74	44,522.74
应付托管费	-	-	-	4,452.27	4,452.27
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	-	-	-	465,821.89	465,821.89



负债总计	-	-	-	515,807.78	515,807.78
利率敏感度缺口	3,355,267.08	-	2,700.20	109,492,224.82	112,850,192.10

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。

#### 6.4.9.4.1.2 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（2024年6月30日）	上年度末（2023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	

#### 6.4.9.4.2 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。

#### 6.4.9.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，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。

本基金原则上采用指数复制法，跟踪中证 500 指数，根据标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产净值的 80%。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。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	86,791,116.20	91.50	109,367,925.43	96.91

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	86,791,116.20	91.50	109,367,925.43	96.91

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资。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。

#### 6.4.9.4.3.2 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	4,292,562.05	4,991,377.52
	2.组合自身基准下降 5%	-4,292,562.05	-4,991,377.52

#### 6.4.10 公允价值

##### 6.4.10.1 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。

##### 6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.10.2.1 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 2024 年 6 月 30 日
第一层次	86,779,699.66
第二层次	-
第三层次	11,416.54
合计	86,791,116.20

###### 6.4.10.2.2 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。

#### 6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.10.4 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。

#### 6.4.11 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	86,791,116.20	91.36
	其中：股票	86,791,116.20	91.36
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	7,250,694.72	7.63
8	其他各项资产	958,067.22	1.01
9	合计	94,999,878.14	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

金额单位：人民币元

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	460,130.00	0.49
B	采矿业	4,040,281.00	4.26
C	制造业	55,591,059.59	58.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,427,864.00	2.56
E	建筑业	1,423,244.70	1.50
F	批发和零售业	2,531,222.44	2.67
G	交通运输、仓储和邮政业	2,051,666.00	2.16
H	住宿和餐饮业	205,707.00	0.22
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,313,924.12	5.60
J	金融业	6,612,776.90	6.97
K	房地产业	1,594,177.00	1.68
L	租赁和商务服务业	938,594.00	0.99
M	科学研究和技术服务业	208,651.19	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	930,998.72	0.98
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	24,480.00	0.03
Q	卫生和社会工作	262,939.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	1,891,648.00	1.99
S	综合	270,336.00	0.29
	合计	86,779,699.66	91.49

## 7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	6,740.44	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,676.10	0.00
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	11,416.54	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

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300502	新易盛	8,900	939,395.00	0.99
2	600066	宇通客车	29,800	768,840.00	0.81
3	002028	思源电气	9,400	628,860.00	0.66
4	601168	西部矿业	33,400	599,530.00	0.63
5	688169	石头科技	1,469	576,729.40	0.61
6	600642	申能股份	64,900	573,067.00	0.60
7	002532	天山铝业	67,300	545,803.00	0.58
8	002128	电投能源	25,800	544,380.00	0.57
9	601233	桐昆股份	33,800	539,448.00	0.57
10	600177	雅戈尔	75,700	538,984.00	0.57
11	000423	东阿阿胶	8,600	538,360.00	0.57
12	601108	财通证券	81,400	538,054.00	0.57
13	603228	景旺电子	16,408	521,774.40	0.55
14	600398	海澜之家	55,200	510,048.00	0.54
15	002422	科伦药业	16,800	509,544.00	0.54
16	002463	沪电股份	13,700	500,050.00	0.53
17	601717	郑煤机	33,400	494,320.00	0.52
18	601666	平煤股份	42,900	480,480.00	0.51
19	600352	浙江龙盛	55,800	479,322.00	0.51
20	603606	东方电缆	9,600	468,576.00	0.49
21	601231	环旭电子	28,900	463,845.00	0.49
22	600566	济川药业	14,600	462,966.00	0.49

23	600096	云天化	23,400	454,428.00	0.48
24	002966	苏州银行	60,200	451,500.00	0.48
25	603589	口子窖	11,400	446,766.00	0.47
26	600820	隧道股份	68,400	446,652.00	0.47
27	600801	华新水泥	31,800	437,250.00	0.46
28	603816	顾家家居	13,300	429,457.00	0.45
29	601216	君正集团	114,800	423,612.00	0.45
30	600988	赤峰黄金	25,400	415,036.00	0.44
31	600373	中文传媒	27,900	414,036.00	0.44
32	600170	上海建工	192,100	413,015.00	0.44
33	600704	物产中大	94,500	410,130.00	0.43
34	603160	汇顶科技	5,900	405,625.00	0.43
35	688188	柏楚电子	2,195	405,087.25	0.43
36	600582	天地科技	58,000	399,620.00	0.42
37	600282	南钢股份	79,900	397,902.00	0.42
38	000513	丽珠集团	10,600	394,426.00	0.42
39	000738	航发控制	19,600	393,372.00	0.41
40	600998	九州通	80,059	390,687.92	0.41
41	601098	中南传媒	31,200	387,504.00	0.41
42	600038	中直股份	9,400	386,434.00	0.41
43	601198	东兴证券	48,300	384,468.00	0.41
44	688099	晶晨股份	6,443	382,198.76	0.40
45	601636	旗滨集团	58,900	379,905.00	0.40
46	000997	新大陆	27,300	379,743.00	0.40
47	000975	山金国际	23,100	376,299.00	0.40
48	002517	恺英网络	39,200	374,360.00	0.39
49	601058	赛轮轮胎	26,400	369,600.00	0.39
50	603444	吉比特	2,070	368,480.70	0.39
51	600499	科达制造	43,400	365,862.00	0.39
52	601665	齐鲁银行	74,300	364,813.00	0.38
53	002064	华峰化学	50,500	362,085.00	0.38
54	603156	养元饮品	16,900	359,463.00	0.38
55	000933	神火股份	17,600	356,048.00	0.38
56	601990	南京证券	46,200	354,816.00	0.37
57	002138	顺络电子	12,900	354,234.00	0.37
58	603658	安图生物	7,500	345,525.00	0.36
59	600873	梅花生物	34,099	341,671.98	0.36
60	600325	华发股份	52,400	340,600.00	0.36
61	601000	唐山港	71,800	337,460.00	0.36
62	002557	洽洽食品	11,900	335,461.00	0.35
63	601928	凤凰传媒	30,500	334,280.00	0.35
64	300207	欣旺达	21,900	332,223.00	0.35
65	601598	中国外运	58,700	330,481.00	0.35

66	600583	海油工程	55,500	328,005.00	0.35
67	600062	华润双鹤	16,600	325,028.00	0.34
68	300677	英科医疗	12,000	321,720.00	0.34
69	600516	方大炭素	74,600	321,526.00	0.34
70	000563	陕国投 A	116,200	319,550.00	0.34
71	600511	国药股份	10,300	317,137.00	0.33
72	600885	宏发股份	11,400	315,552.00	0.33
73	688002	睿创微纳	11,116	310,914.52	0.33
74	002558	巨人网络	32,800	309,632.00	0.33
75	600901	江苏金租	60,180	303,909.00	0.32
76	600598	北大荒	24,300	303,507.00	0.32
77	600637	东方明珠	49,500	300,960.00	0.32
78	600529	山东药玻	11,500	291,410.00	0.31
79	603568	伟明环保	14,100	290,178.00	0.31
80	000709	河钢股份	149,300	289,642.00	0.31
81	600737	中粮糖业	29,600	283,864.00	0.30
82	300394	天孚通信	3,180	281,175.60	0.30
83	600161	天坛生物	11,500	280,600.00	0.30
84	600535	天士力	22,100	278,018.00	0.29
85	601077	渝农商行	55,200	277,104.00	0.29
86	000728	国元证券	45,500	275,730.00	0.29
87	688516	奥特维	6,548	273,771.88	0.29
88	002244	滨江集团	37,500	272,250.00	0.29
89	300529	健帆生物	10,000	272,100.00	0.29
90	600673	东阳光	38,400	270,336.00	0.29
91	000636	风华高科	20,500	267,730.00	0.28
92	601866	中远海发	103,200	266,256.00	0.28
93	000598	兴蓉环境	35,100	263,952.00	0.28
94	600663	陆家嘴	29,900	263,718.00	0.28
95	002262	恩华药业	11,100	263,514.00	0.28
96	300558	贝达药业	8,000	260,400.00	0.27
97	000930	中粮科技	51,600	259,548.00	0.27
98	688029	南微医学	4,175	257,013.00	0.27
99	000825	太钢不锈	75,900	256,542.00	0.27
100	688425	铁建重工	69,672	256,392.96	0.27
101	603225	新凤鸣	16,400	255,676.00	0.27
102	300251	光线传媒	30,300	254,823.00	0.27
103	601187	厦门银行	47,800	254,774.00	0.27
104	000887	中鼎股份	20,800	254,592.00	0.27
105	603897	长城科技	14,500	254,475.00	0.27
106	603517	绝味食品	16,500	254,100.00	0.27
107	002409	雅克科技	4,000	251,640.00	0.27
108	002508	老板电器	11,300	249,730.00	0.26

109	002384	东山精密	12,000	248,400.00	0.26
110	002563	森马服饰	42,600	247,506.00	0.26
111	600399	抚顺特钢	43,900	247,157.00	0.26
112	002653	海思科	7,800	239,460.00	0.25
113	002019	亿帆医药	19,100	236,076.00	0.25
114	002266	浙富控股	83,100	231,849.00	0.24
115	300866	安克创新	3,251	231,503.71	0.24
116	002010	传化智联	60,000	230,400.00	0.24
117	002340	格林美	35,800	228,046.00	0.24
118	600348	华阳股份	22,850	227,586.00	0.24
119	002025	航天电器	4,900	227,262.00	0.24
120	603866	桃李面包	44,640	226,324.80	0.24
121	002203	海亮股份	28,000	223,440.00	0.24
122	600126	杭钢股份	54,000	221,940.00	0.23
123	002152	广电运通	21,200	221,752.00	0.23
124	002595	豪迈科技	5,800	221,386.00	0.23
125	600985	淮北矿业	13,100	219,294.00	0.23
126	002444	巨星科技	8,800	217,360.00	0.23
127	002156	通富微电	9,600	214,944.00	0.23
128	000581	威孚高科	13,100	213,268.00	0.22
129	600008	首创环保	78,500	210,380.00	0.22
130	000400	许继电气	6,000	206,460.00	0.22
131	300390	天华新能	12,000	206,160.00	0.22
132	600970	中材国际	16,900	203,814.00	0.21
133	601577	长沙银行	24,900	203,682.00	0.21
134	601019	山东出版	17,200	203,304.00	0.21
135	600755	厦门国贸	28,300	202,911.00	0.21
136	000967	盈峰环境	47,800	202,194.00	0.21
137	688778	厦钨新能	6,462	201,872.88	0.21
138	002465	海格通信	19,200	198,912.00	0.21
139	002429	兆驰股份	41,200	198,172.00	0.21
140	600563	法拉电子	2,600	198,068.00	0.21
141	600380	健康元	17,300	193,241.00	0.20
142	002223	鱼跃医疗	5,100	191,760.00	0.20
143	600208	新湖中宝	121,300	191,654.00	0.20
144	000932	华菱钢铁	43,200	191,376.00	0.20
145	603826	坤彩科技	6,580	190,622.60	0.20
146	600418	江淮汽车	11,900	188,496.00	0.20
147	603939	益丰药房	7,620	187,071.00	0.20
148	600699	均胜电子	12,600	186,732.00	0.20
149	600390	五矿资本	46,000	186,300.00	0.20
150	600153	建发股份	20,200	180,386.00	0.19
151	002056	横店东磁	14,300	178,321.00	0.19



152	603355	莱克电气	8,200	177,120.00	0.19
153	603885	吉祥航空	16,000	175,840.00	0.19
154	603927	中科软	9,680	175,111.20	0.18
155	688120	华海清科	914	173,276.12	0.18
156	688312	燕麦科技	7,068	171,399.00	0.18
157	603681	永冠新材	13,400	170,850.00	0.18
158	002032	苏泊尔	3,400	170,340.00	0.18
159	603338	浙江鼎力	2,800	169,176.00	0.18
160	688132	邦彦技术	9,573	166,091.55	0.18
161	688018	乐鑫科技	1,649	162,723.32	0.17
162	603171	税友股份	6,000	162,240.00	0.17
163	600160	巨化股份	6,600	159,258.00	0.17
164	300001	特锐德	7,900	158,948.00	0.17
165	300146	汤臣倍健	11,700	158,535.00	0.17
166	000630	铜陵有色	43,500	157,035.00	0.17
167	600867	通化东宝	18,700	156,519.00	0.17
168	600308	华泰股份	49,400	155,116.00	0.16
169	601139	深圳燃气	22,900	152,972.00	0.16
170	600655	豫园股份	29,700	152,955.00	0.16
171	000988	华工科技	5,100	152,643.00	0.16
172	300872	天阳科技	11,400	151,050.00	0.16
173	600707	彩虹股份	21,800	148,458.00	0.16
174	600350	山东高速	16,600	146,910.00	0.15
175	002430	杭氧股份	6,600	146,850.00	0.15
176	600060	海信视像	5,901	145,990.74	0.15
177	600155	华创云信	24,600	145,386.00	0.15
178	600285	羚锐制药	6,000	145,260.00	0.15
179	000544	中原环保	18,400	144,808.00	0.15
180	300088	长信科技	30,800	144,760.00	0.15
181	601126	四方股份	7,500	144,150.00	0.15
182	688578	艾力斯	2,258	143,924.92	0.15
183	600183	生益科技	6,800	143,208.00	0.15
184	002500	山西证券	30,400	142,880.00	0.15
185	688689	银河微电	6,702	142,283.46	0.15
186	600258	首旅酒店	11,500	142,025.00	0.15
187	600764	中国海防	7,200	141,336.00	0.15
188	688616	西力科技	12,398	140,593.32	0.15
189	688307	中润光学	6,781	140,298.89	0.15
190	300017	网宿科技	17,700	139,830.00	0.15
191	601568	北元集团	37,400	138,754.00	0.15
192	600765	中航重机	6,800	138,720.00	0.15
193	688408	中信博	1,504	138,488.32	0.15
194	688819	天能股份	5,795	138,268.70	0.15

195	000155	川能动力	12,800	137,856.00	0.15
196	300885	海昌新材	15,500	137,795.00	0.15
197	002600	领益智造	19,300	137,416.00	0.14
198	688480	赛恩斯	4,928	137,294.08	0.14
199	002511	中顺洁柔	19,800	137,016.00	0.14
200	000878	云南铜业	10,800	134,568.00	0.14
201	600549	厦门钨业	7,800	134,550.00	0.14
202	000987	越秀资本	27,000	133,920.00	0.14
203	002078	太阳纸业	9,600	133,920.00	0.14
204	300296	利亚德	29,700	133,650.00	0.14
205	601991	大唐发电	44,300	133,343.00	0.14
206	600879	航天电子	17,100	132,867.00	0.14
207	603712	七一二	7,300	132,787.00	0.14
208	002756	永兴材料	3,700	132,386.00	0.14
209	601318	中国平安	3,200	132,352.00	0.14
210	002738	中矿资源	4,900	131,320.00	0.14
211	601997	贵阳银行	24,800	130,696.00	0.14
212	688129	东来技术	10,457	130,607.93	0.14
213	600486	扬农化工	2,310	130,399.50	0.14
214	002625	光启技术	7,500	130,125.00	0.14
215	002850	科达利	1,700	129,846.00	0.14
216	601162	天风证券	59,300	129,274.00	0.14
217	601138	工业富联	4,700	128,780.00	0.14
218	002106	莱宝高科	11,800	128,620.00	0.14
219	300976	达瑞电子	2,800	128,380.00	0.14
220	605377	华旺科技	9,680	128,260.00	0.14
221	002487	大金重工	5,600	128,128.00	0.14
222	000778	新兴铸管	36,700	127,716.00	0.13
223	688101	三达膜	11,187	127,308.06	0.13
224	000960	锡业股份	8,200	127,018.00	0.13
225	603258	电魂网络	7,800	125,970.00	0.13
226	688375	国博电子	1,761	124,397.04	0.13
227	688678	福立旺	11,466	124,176.78	0.13
228	688019	安集科技	987	124,164.60	0.13
229	600887	伊利股份	4,800	124,032.00	0.13
230	688478	晶升股份	4,241	123,497.92	0.13
231	605128	上海沿浦	4,400	122,716.00	0.13
232	600109	国金证券	16,100	121,555.00	0.13
233	601555	东吴证券	20,600	121,540.00	0.13
234	601156	东航物流	5,900	120,065.00	0.13
235	002080	中材科技	9,200	118,680.00	0.13
236	688586	江航装备	12,736	118,444.80	0.12
237	002408	齐翔腾达	21,000	117,600.00	0.12

238	002432	九安医疗	2,900	117,566.00	0.12
239	002273	水晶光电	6,900	117,162.00	0.12
240	688258	卓易信息	3,507	117,133.80	0.12
241	605358	立昂微	5,000	115,700.00	0.12
242	603786	科博达	1,800	115,470.00	0.12
243	002997	瑞鹄模具	3,600	115,092.00	0.12
244	600299	安迪苏	11,800	114,460.00	0.12
245	300383	光环新网	13,400	113,230.00	0.12
246	002290	禾盛新材	8,500	113,220.00	0.12
247	600967	内蒙一机	15,700	113,040.00	0.12
248	301061	匠心家居	2,400	112,704.00	0.12
249	002939	长城证券	16,800	112,560.00	0.12
250	000783	长江证券	22,800	110,124.00	0.12
251	000050	深天马 A	15,000	109,200.00	0.12
252	300037	新宙邦	3,800	108,528.00	0.11
253	601958	金钼股份	10,400	108,264.00	0.11
254	688772	珠海冠宇	7,222	107,607.80	0.11
255	002534	西子洁能	10,700	107,107.00	0.11
256	600141	兴发集团	5,600	106,848.00	0.11
257	600021	上海电力	10,800	106,812.00	0.11
258	002294	信立泰	4,000	106,520.00	0.11
259	300073	当升科技	3,100	106,361.00	0.11
260	000039	中集集团	11,400	105,564.00	0.11
261	601298	青岛港	11,000	105,160.00	0.11
262	603883	老百姓	5,707	104,780.52	0.11
263	600143	金发科技	15,800	104,438.00	0.11
264	600219	南山铝业	27,400	104,394.00	0.11
265	600859	王府井	8,800	103,312.00	0.11
266	000999	华润三九	2,410	102,617.80	0.11
267	002423	中粮资本	13,600	101,864.00	0.11
268	601567	三星医疗	2,900	101,500.00	0.11
269	600482	中国动力	5,200	101,296.00	0.11
270	600839	四川长虹	22,300	100,127.00	0.11
271	600528	中铁工业	13,600	99,552.00	0.10
272	000156	华数传媒	15,800	99,224.00	0.10
273	002353	杰瑞股份	2,800	98,224.00	0.10
274	000703	恒逸石化	13,800	97,842.00	0.10
275	600166	福田汽车	43,400	97,650.00	0.10
276	002372	伟星新材	6,300	97,146.00	0.10
277	688777	中控技术	2,553	96,248.10	0.10
278	002865	钧达股份	2,500	95,950.00	0.10
279	688510	航亚科技	5,210	95,916.10	0.10
280	000030	富奥股份	19,500	95,745.00	0.10

281	603267	鸿远电子	2,800	95,480.00	0.10
282	002034	旺能环境	7,300	94,973.00	0.10
283	002831	裕同科技	3,700	94,683.00	0.10
284	002683	广东宏大	4,700	94,611.00	0.10
285	300070	碧水源	22,400	93,856.00	0.10
286	603882	金城医学	3,400	92,446.00	0.10
287	300724	捷佳伟创	1,700	91,817.00	0.10
288	002468	申通快递	10,900	91,560.00	0.10
289	301236	软通动力	2,600	91,546.00	0.10
290	688617	惠泰医疗	200	91,220.00	0.10
291	601128	常熟银行	12,050	91,218.50	0.10
292	688005	容百科技	3,901	90,815.28	0.10
293	688301	奕瑞科技	784	90,340.32	0.10
294	002531	天顺风能	10,100	90,294.00	0.10
295	002497	雅化集团	10,100	90,092.00	0.09
296	601696	中银证券	9,900	89,892.00	0.09
297	001872	招商港口	4,600	88,550.00	0.09
298	603868	飞科电器	2,300	88,320.00	0.09
299	002958	青农商行	32,900	88,172.00	0.09
300	600316	洪都航空	5,300	88,139.00	0.09
301	002797	第一创业	17,200	87,548.00	0.09
302	603737	三棵树	2,400	87,048.00	0.09
303	002088	鲁阳节能	7,200	87,048.00	0.09
304	601158	重庆水务	18,100	86,880.00	0.09
305	000021	深科技	5,700	86,184.00	0.09
306	688063	派能科技	2,166	86,011.86	0.09
307	002185	华天科技	10,400	84,760.00	0.09
308	600928	西安银行	25,600	83,712.00	0.09
309	600906	财达证券	14,400	82,512.00	0.09
310	000559	万向钱潮	18,500	82,510.00	0.09
311	688006	杭可科技	4,726	82,468.70	0.09
312	002120	韵达股份	10,600	82,044.00	0.09
313	600497	驰宏锌锗	15,300	81,702.00	0.09
314	688122	西部超导	2,125	81,430.00	0.09
315	000517	荣安地产	30,300	81,204.00	0.09
316	600498	烽火通信	5,100	81,090.00	0.09
317	603979	金诚信	1,600	80,848.00	0.09
318	002788	鹭燕医药	10,200	80,376.00	0.08
319	002690	美亚光电	4,870	80,355.00	0.08
320	002507	涪陵榨菜	6,500	79,625.00	0.08
321	300888	稳健医疗	3,120	78,936.00	0.08
322	600741	华域汽车	4,800	78,624.00	0.08
323	300244	迪安诊断	6,500	78,000.00	0.08

324	300024	机器人	8,000	77,920.00	0.08
325	300009	安科生物	9,100	77,714.00	0.08
326	688200	华峰测控	844	77,437.00	0.08
327	002925	盈趣科技	6,100	77,287.00	0.08
328	603686	福龙马	10,100	76,962.00	0.08
329	002155	湖南黄金	4,200	76,020.00	0.08
330	601016	节能风电	25,000	74,750.00	0.08
331	002533	金杯电工	7,500	74,625.00	0.08
332	603456	九洲药业	5,400	74,088.00	0.08
333	002202	金风科技	11,000	73,920.00	0.08
334	300373	扬杰科技	1,900	73,910.00	0.08
335	600056	中国医药	7,300	73,876.00	0.08
336	600079	人福医药	4,300	73,831.00	0.08
337	601615	明阳智能	7,800	73,632.00	0.08
338	688056	莱伯泰科	3,304	73,216.64	0.08
339	002416	爱施德	8,200	72,570.00	0.08
340	688281	华秦科技	870	72,488.40	0.08
341	689009	九号公司	1,967	72,405.27	0.08
342	300114	中航电测	1,600	72,400.00	0.08
343	603596	伯特利	1,860	72,354.00	0.08
344	600502	安徽建工	16,800	72,240.00	0.08
345	000758	中色股份	14,200	72,136.00	0.08
346	600536	中国软件	2,400	71,808.00	0.08
347	600757	长江传媒	8,900	71,734.00	0.08
348	300861	美畅股份	3,700	71,595.00	0.08
349	600848	上海临港	7,800	71,058.00	0.07
350	600298	安琪酵母	2,528	70,607.04	0.07
351	000009	中国宝安	8,100	69,660.00	0.07
352	603317	天味食品	6,100	69,601.00	0.07
353	300699	光威复材	2,800	69,524.00	0.07
354	600369	西南证券	19,200	68,736.00	0.07
355	603056	德邦股份	5,200	68,120.00	0.07
356	002020	京新药业	6,500	68,055.00	0.07
357	600329	达仁堂	2,100	68,019.00	0.07
358	601966	玲珑轮胎	3,700	67,969.00	0.07
359	000591	太阳能	14,400	67,824.00	0.07
360	600057	厦门象屿	9,900	67,320.00	0.07
361	600909	华安证券	15,900	66,939.00	0.07
362	603345	安井食品	900	66,879.00	0.07
363	002008	大族激光	3,200	66,560.00	0.07
364	002739	万达电影	5,500	66,495.00	0.07
365	688032	禾迈股份	578	66,342.84	0.07
366	300349	金卡智能	5,500	65,560.00	0.07

367	300012	华测检测	6,500	65,390.00	0.07
368	300003	乐普医疗	4,400	65,296.00	0.07
369	300532	今天国际	5,300	65,137.00	0.07
370	000739	普洛药业	4,800	65,136.00	0.07
371	002048	宁波华翔	5,000	64,700.00	0.07
372	002462	嘉事堂	5,900	64,546.00	0.07
373	600862	中航高科	3,400	63,852.00	0.07
374	688525	佰维存储	994	63,765.10	0.07
375	603688	石英股份	2,147	63,572.67	0.07
376	688180	君实生物	2,174	63,154.70	0.07
377	603179	新泉股份	1,600	62,784.00	0.07
378	300136	信维通信	3,200	62,656.00	0.07
379	600064	南京高科	10,300	62,521.00	0.07
380	300604	长川科技	2,300	62,491.00	0.07
381	000683	远兴能源	9,000	62,190.00	0.07
382	600927	永安期货	5,500	61,325.00	0.06
383	600392	盛和资源	7,100	61,202.00	0.06
384	603096	新经典	3,600	60,840.00	0.06
385	603726	朗迪集团	4,500	60,300.00	0.06
386	603379	三美股份	1,540	60,275.60	0.06
387	002436	兴森科技	5,800	59,856.00	0.06
388	002281	光迅科技	1,600	59,792.00	0.06
389	300595	欧普康视	3,800	59,584.00	0.06
390	601179	中国西电	7,400	59,496.00	0.06
391	600377	宁沪高速	4,700	59,220.00	0.06
392	600872	中炬高新	2,600	58,994.00	0.06
393	688601	力芯微	1,350	58,981.50	0.06
394	300054	鼎龙股份	2,600	58,968.00	0.06
395	600546	山煤国际	4,000	58,480.00	0.06
396	000831	中国稀土	2,300	58,305.00	0.06
397	600521	华海药业	3,400	57,970.00	0.06
398	600710	苏美达	7,100	57,865.00	0.06
399	603360	百傲化学	4,880	57,340.00	0.06
400	600643	爱建集团	15,200	57,304.00	0.06
401	600284	浦东建设	10,700	57,138.00	0.06
402	002065	东华软件	12,600	56,952.00	0.06
403	300474	景嘉微	900	56,907.00	0.06
404	000066	中国长城	6,500	56,875.00	0.06
405	300002	神州泰岳	7,000	56,840.00	0.06
406	301307	美利信	2,900	56,782.00	0.06
407	688065	凯赛生物	1,241	56,328.99	0.06
408	002673	西部证券	9,000	55,710.00	0.06
409	600895	张江高科	3,000	55,440.00	0.06

410	300395	菲利华	1,800	55,350.00	0.06
411	601101	昊华能源	6,000	55,140.00	0.06
412	301197	工大科雅	4,200	55,104.00	0.06
413	688138	清溢光电	2,549	54,803.50	0.06
414	601106	中国一重	23,700	54,747.00	0.06
415	600118	中国卫星	2,453	54,530.19	0.06
416	601211	国泰君安	4,000	54,200.00	0.06
417	600977	中国电影	5,000	53,800.00	0.06
418	002884	凌霄泵业	2,800	53,760.00	0.06
419	002870	香山股份	1,800	53,694.00	0.06
420	301358	湖南裕能	1,700	53,482.00	0.06
421	600846	同济科技	7,800	53,274.00	0.06
422	002984	森麒麟	2,200	52,998.00	0.06
423	601601	中国太保	1,900	52,934.00	0.06
424	002472	双环传动	2,400	52,848.00	0.06
425	002926	华西证券	8,000	52,720.00	0.06
426	002195	岩山科技	20,900	52,459.00	0.06
427	300285	国瓷材料	2,900	51,765.00	0.05
428	600032	浙江新能	7,100	51,688.00	0.05
429	300418	昆仑万维	1,600	51,584.00	0.05
430	000921	海信家电	1,600	51,584.00	0.05
431	300857	协创数据	900	51,300.00	0.05
432	603185	弘元绿能	3,000	51,270.00	0.05
433	600995	南网储能	5,300	51,198.00	0.05
434	600004	白云机场	5,400	51,192.00	0.05
435	603087	甘李药业	1,100	50,952.00	0.05
436	000582	北部湾港	6,800	50,592.00	0.05
437	600694	大商股份	3,000	50,430.00	0.05
438	688213	思特威	1,035	50,197.50	0.05
439	002439	启明星辰	2,900	50,054.00	0.05
440	300058	蓝色光标	9,200	50,048.00	0.05
441	000795	英洛华	9,000	49,860.00	0.05
442	688669	聚石化学	4,384	49,626.88	0.05
443	002368	太极股份	2,200	49,610.00	0.05
444	000723	美锦能源	10,400	49,504.00	0.05
445	000750	国海证券	16,900	49,179.00	0.05
446	603077	和邦生物	29,800	49,170.00	0.05
447	603822	嘉澳环保	2,600	49,166.00	0.05
448	002407	多氟多	4,000	48,920.00	0.05
449	000785	居然之家	20,100	48,843.00	0.05
450	600763	通策医疗	900	48,645.00	0.05
451	688114	华大智造	1,026	48,642.66	0.05
452	600686	金龙汽车	6,600	48,576.00	0.05

453	688538	和辉光电	24,427	48,365.46	0.05
454	600697	欧亚集团	4,800	48,240.00	0.05
455	600816	建元信托	17,800	48,238.00	0.05
456	603926	铁流股份	5,800	48,140.00	0.05
457	002192	融捷股份	1,600	48,032.00	0.05
458	688052	纳芯微	465	47,792.70	0.05
459	603173	福斯达	2,200	47,762.00	0.05
460	002385	大北农	12,400	47,740.00	0.05
461	601369	陕鼓动力	5,900	47,318.00	0.05
462	000539	粤电力 A	9,300	47,244.00	0.05
463	605033	美邦股份	3,800	47,196.00	0.05
464	603307	扬州金泉	1,500	47,160.00	0.05
465	603298	杭叉集团	2,400	47,136.00	0.05
466	688606	奥泰生物	1,000	47,130.00	0.05
467	603080	新疆火炬	3,500	47,110.00	0.05
468	000623	吉林敖东	3,500	46,900.00	0.05
469	603706	东方环宇	3,200	46,880.00	0.05
470	601933	永辉超市	18,900	46,872.00	0.05
471	000959	首钢股份	17,100	46,512.00	0.05
472	605288	凯迪股份	1,500	46,440.00	0.05
473	603855	华荣股份	2,100	46,431.00	0.05
474	000629	钒钛股份	18,500	46,250.00	0.05
475	600315	上海家化	2,600	46,228.00	0.05
476	600665	天地源	20,800	46,176.00	0.05
477	603629	利通电子	2,500	46,150.00	0.05
478	603000	人民网	2,300	45,977.00	0.05
479	603700	宁水集团	4,900	45,962.00	0.05
480	603013	亚普股份	3,400	45,798.00	0.05
481	603115	海星股份	4,400	45,760.00	0.05
482	601512	中新集团	6,000	45,720.00	0.05
483	600785	新华百货	3,400	45,628.00	0.05
484	603929	亚翔集成	1,900	45,410.00	0.05
485	688390	固德威	802	45,008.24	0.05
486	603881	数据港	3,540	44,993.40	0.05
487	605123	派克新材	800	44,944.00	0.05
488	688211	中科微至	1,772	44,920.20	0.05
489	603599	广信股份	3,700	44,881.00	0.05
490	601811	新华文轩	3,200	44,832.00	0.05
491	001278	一彬科技	2,800	44,268.00	0.05
492	000818	航锦科技	2,000	44,160.00	0.05
493	000729	燕京啤酒	5,000	44,150.00	0.05
494	001914	招商积余	4,400	44,088.00	0.05
495	000519	中兵红箭	3,000	44,010.00	0.05



496	603858	步长制药	2,900	43,935.00	0.05
497	600750	江中药业	1,900	43,909.00	0.05
498	002044	美年健康	11,600	43,848.00	0.05
499	688561	奇安信	1,854	43,791.48	0.05
500	600580	卧龙电驱	3,600	43,740.00	0.05
501	300601	康泰生物	2,800	43,708.00	0.05
502	600754	锦江酒店	1,900	43,662.00	0.05
503	002299	圣农发展	3,200	43,648.00	0.05
504	300951	博硕科技	1,400	43,610.00	0.05
505	600129	太极集团	1,500	43,380.00	0.05
506	301050	雷电微力	900	43,344.00	0.05
507	600968	海油发展	10,500	43,260.00	0.05
508	002774	快意电梯	6,800	43,180.00	0.05
509	603290	斯达半导	500	43,055.00	0.05
510	600416	湘电股份	4,300	42,742.00	0.05
511	603486	科沃斯	900	42,462.00	0.04
512	300193	佳士科技	5,700	42,294.00	0.04
513	300972	万辰集团	2,000	42,260.00	0.04
514	000553	安道麦 A	9,300	42,222.00	0.04
515	688348	昱能科技	712	42,008.00	0.04
516	301191	菲菱科思	600	41,982.00	0.04
517	605166	聚合顺	4,000	41,960.00	0.04
518	688017	绿的谐波	509	41,788.90	0.04
519	001225	和泰机电	1,500	41,565.00	0.04
520	688385	复旦微电	1,321	41,452.98	0.04
521	603893	瑞芯微	700	41,419.00	0.04
522	688372	伟测科技	1,043	41,021.19	0.04
523	002845	同兴达	3,100	40,982.00	0.04
524	600827	百联股份	5,500	40,590.00	0.04
525	002677	浙江美大	5,000	40,550.00	0.04
526	002658	雪迪龙	7,900	40,527.00	0.04
527	688338	赛科希德	1,871	40,507.15	0.04
528	001332	锡装股份	1,700	40,494.00	0.04
529	600131	国网信通	2,400	40,488.00	0.04
530	601456	国联证券	4,200	40,488.00	0.04
531	002852	道道全	5,600	40,320.00	0.04
532	000060	中金岭南	9,500	40,280.00	0.04
533	002624	完美世界	5,300	40,280.00	0.04
534	002004	华邦健康	10,600	40,280.00	0.04
535	002913	奥士康	1,500	40,215.00	0.04
536	300568	星源材质	4,900	40,180.00	0.04
537	300947	德必集团	2,800	40,040.00	0.04
538	300118	东方日升	3,300	39,930.00	0.04

539	688521	芯原股份	1,492	39,911.00	0.04
540	002506	协鑫集成	20,500	39,770.00	0.04
541	002275	桂林三金	3,200	39,712.00	0.04
542	600098	广州发展	6,200	39,680.00	0.04
543	300487	蓝晓科技	950	39,672.00	0.04
544	300567	精测电子	700	39,557.00	0.04
545	000998	隆平高科	4,000	39,320.00	0.04
546	000848	承德露露	5,000	39,300.00	0.04
547	000915	华特达因	1,300	39,208.00	0.04
548	688220	翱捷科技	1,044	39,108.24	0.04
549	301278	快可电子	1,200	39,024.00	0.04
550	600884	杉杉股份	4,800	38,976.00	0.04
551	600435	北方导航	4,500	38,790.00	0.04
552	002261	拓维信息	3,500	38,745.00	0.04
553	002932	明德生物	2,300	38,663.00	0.04
554	300676	华大基因	1,100	38,511.00	0.04
555	002414	高德红外	6,500	38,285.00	0.04
556	688767	博拓生物	1,524	38,206.68	0.04
557	601828	美凯龙	14,800	37,740.00	0.04
558	600378	昊华科技	1,300	37,570.00	0.04
559	300763	锦浪科技	900	37,476.00	0.04
560	300890	翔丰华	1,500	37,425.00	0.04
561	002268	电科网安	2,600	36,998.00	0.04
562	600481	双良节能	7,900	36,893.00	0.04
563	002373	千方科技	4,000	36,280.00	0.04
564	688297	中无人机	1,098	36,266.94	0.04
565	002936	郑州银行	20,780	35,949.40	0.04
566	003019	宸展光电	1,415	35,841.95	0.04
567	001286	陕西能源	3,100	35,743.00	0.04
568	600597	光明乳业	4,600	35,742.00	0.04
569	601965	中国汽研	2,100	35,469.00	0.04
570	300765	新诺威	1,400	35,322.00	0.04
571	688567	孚能科技	3,668	35,212.80	0.04
572	000042	中洲控股	8,900	35,155.00	0.04
573	600612	老凤祥	600	34,914.00	0.04
574	002240	盛新锂能	2,600	34,892.00	0.04
575	605398	新炬网络	1,700	34,833.00	0.04
576	300748	金力永磁	2,660	34,473.60	0.04
577	300259	新天科技	13,600	34,408.00	0.04
578	688349	三一重能	1,376	34,179.84	0.04
579	688234	天岳先进	720	33,782.40	0.04
580	603233	大参林	2,320	33,176.00	0.03
581	603529	爱玛科技	1,200	32,796.00	0.03

582	300803	指南针	900	32,769.00	0.03
583	603758	秦安股份	4,300	32,680.00	0.03
584	002572	索菲亚	2,100	32,193.00	0.03
585	002568	百润股份	1,900	31,977.00	0.03
586	688331	荣昌生物	736	31,795.20	0.03
587	300428	立中集团	1,700	31,603.00	0.03
588	601118	海南橡胶	6,900	31,395.00	0.03
589	688267	中触媒	1,571	31,200.06	0.03
590	688536	思瑞浦	318	31,103.58	0.03
591	002752	昇兴股份	6,100	30,866.00	0.03
592	000402	金融街	13,100	30,785.00	0.03
593	000906	浙商中拓	4,500	30,330.00	0.03
594	300357	我武生物	1,500	30,330.00	0.03
595	603967	中创物流	3,200	29,760.00	0.03
596	600332	白云山	1,000	29,330.00	0.03
597	600346	恒力石化	2,100	29,295.00	0.03
598	600987	航民股份	4,100	28,946.00	0.03
599	002761	浙江建投	3,700	28,897.00	0.03
600	601319	中国人保	5,600	28,840.00	0.03
601	300212	易华录	1,700	28,611.00	0.03
602	000032	深桑达 A	1,900	28,462.00	0.03
603	002518	科士达	1,600	28,320.00	0.03
604	300492	华图山鼎	300	28,260.00	0.03
605	603728	鸣志电器	700	28,161.00	0.03
606	603987	康德莱	4,600	28,106.00	0.03
607	603368	柳药集团	1,600	28,000.00	0.03
608	600475	华光环能	3,200	27,872.00	0.03
609	600623	华谊集团	4,800	27,744.00	0.03
610	600089	特变电工	2,000	27,740.00	0.03
611	688690	纳微科技	1,594	27,687.78	0.03
612	000736	中交地产	3,100	27,528.00	0.03
613	600713	南京医药	6,500	27,430.00	0.03
614	600966	博汇纸业	5,700	27,246.00	0.03
615	600729	重庆百货	1,200	26,832.00	0.03
616	600667	太极实业	4,670	26,665.70	0.03
617	603650	彤程新材	900	26,595.00	0.03
618	688779	五矿新能	5,707	26,423.41	0.03
619	600048	保利发展	3,000	26,280.00	0.03
620	300781	因赛集团	500	26,090.00	0.03
621	003022	联泓新科	1,900	26,049.00	0.03
622	603100	川仪股份	1,100	25,861.00	0.03
623	000725	京东方 A	6,300	25,767.00	0.03
624	300438	鹏辉能源	1,400	25,676.00	0.03

625	688239	航宇科技	733	25,508.40	0.03
626	000100	TCL 科技	5,900	25,488.00	0.03
627	002649	博彦科技	3,200	25,472.00	0.03
628	002083	孚日股份	6,000	25,380.00	0.03
629	002637	赞宇科技	3,000	25,380.00	0.03
630	002375	亚厦股份	7,700	25,025.00	0.03
631	002745	木林森	3,100	24,986.00	0.03
632	002392	北京利尔	7,900	24,885.00	0.03
633	000537	中绿电	2,600	24,778.00	0.03
634	300389	艾比森	2,000	24,560.00	0.03
635	603269	海鸥股份	2,500	24,550.00	0.03
636	600415	小商品城	3,300	24,486.00	0.03
637	002607	中公教育	16,000	24,480.00	0.03
638	002206	海利得	6,400	24,448.00	0.03
639	300815	玉禾田	2,100	24,444.00	0.03
640	002573	清新环境	6,300	24,381.00	0.03
641	000951	中国重汽	1,700	24,344.00	0.03
642	002441	众业达	3,200	24,256.00	0.03
643	002381	双箭股份	3,600	24,156.00	0.03
644	002727	一心堂	1,600	24,144.00	0.03
645	300772	运达股份	2,500	24,000.00	0.03
646	605365	立达信	1,500	23,805.00	0.03
647	002274	华昌化工	3,200	23,744.00	0.03
648	300773	拉卡拉	1,900	23,617.00	0.02
649	688517	金冠电气	1,688	23,598.24	0.02
650	002539	云图控股	3,300	23,529.00	0.02
651	002326	永太科技	3,000	23,460.00	0.02
652	000404	长虹华意	4,400	23,452.00	0.02
653	000950	重药控股	4,800	23,376.00	0.02
654	605266	健之佳	900	23,355.00	0.02
655	605507	国邦医药	1,400	23,310.00	0.02
656	300682	朗新集团	2,700	22,977.00	0.02
657	000034	神州数码	1,000	22,890.00	0.02
658	688556	高测股份	1,916	22,781.24	0.02
659	000521	长虹美菱	3,000	22,740.00	0.02
660	601611	中国核建	2,800	22,652.00	0.02
661	000028	国药一致	700	22,561.00	0.02
662	600617	国新能源	8,960	22,400.00	0.02
663	301012	扬电科技	900	22,284.00	0.02
664	603399	永杉锂业	3,600	22,284.00	0.02
665	300624	万兴科技	419	22,236.33	0.02
666	603039	泛微网络	700	22,232.00	0.02
667	002782	可立克	1,900	21,052.00	0.02

668	301299	卓创资讯	500	21,000.00	0.02
669	300900	广联航空	1,120	20,977.60	0.02
670	000788	北大医药	4,200	20,958.00	0.02
671	300194	福安药业	5,500	20,570.00	0.02
672	000153	丰原药业	3,800	20,444.00	0.02
673	300660	江苏雷利	800	20,416.00	0.02
674	600959	江苏有线	7,700	20,328.00	0.02
675	003021	兆威机电	440	20,306.00	0.02
676	301073	君亭酒店	1,100	20,020.00	0.02
677	301157	华塑科技	600	19,560.00	0.02
678	301003	江苏博云	900	19,359.00	0.02
679	300444	双杰电气	3,000	19,050.00	0.02
680	001367	海森药业	800	18,672.00	0.02
681	000555	神州信息	2,000	18,640.00	0.02
682	301121	紫建电子	500	18,465.00	0.02
683	600711	ST 盛屯	5,000	18,350.00	0.02
684	600829	人民同泰	3,200	17,952.00	0.02
685	000089	深圳机场	2,800	17,892.00	0.02
686	600095	湘财股份	3,000	17,880.00	0.02
687	301221	光庭信息	500	17,840.00	0.02
688	688399	硕世生物	257	17,378.34	0.02
689	001301	尚太科技	400	17,288.00	0.02
690	688109	品茗科技	620	16,957.00	0.02
691	605222	起帆电缆	1,100	16,874.00	0.02
692	688513	苑东生物	325	16,344.25	0.02
693	605050	福然德	1,800	15,858.00	0.02
694	688367	工大高科	1,298	15,835.60	0.02
695	603150	万朗磁塑	600	15,024.00	0.02
696	688528	秦川物联	1,875	14,981.25	0.02
697	600235	民丰特纸	3,200	14,720.00	0.02
698	603167	渤海轮渡	1,800	14,706.00	0.02
699	603201	常润股份	600	14,520.00	0.02
700	603408	建霖家居	1,100	14,509.00	0.02
701	603727	博迈科	1,100	14,476.00	0.02
702	603351	威尔药业	700	14,182.00	0.01
703	603320	迪贝电气	1,000	14,140.00	0.01
704	603819	神力股份	1,300	13,650.00	0.01
705	688087	英科再生	515	13,328.20	0.01
706	688336	三生国健	651	13,247.85	0.01
707	603337	杰克股份	500	13,160.00	0.01
708	002879	长缆科技	1,000	13,130.00	0.01
709	605305	中际联合	500	12,895.00	0.01
710	002267	陕天然气	1,700	12,852.00	0.01

711	301309	万得凯	500	12,780.00	0.01
712	002093	国脉科技	2,100	12,747.00	0.01
713	688625	呈和科技	348	12,653.28	0.01
714	002393	力生制药	800	12,648.00	0.01
715	688069	德林海	931	12,512.64	0.01
716	300453	三鑫医疗	1,900	12,141.00	0.01
717	300679	电连技术	300	12,069.00	0.01
718	300048	合康新能	2,600	12,038.00	0.01
719	002543	万和电气	1,200	11,952.00	0.01
720	003006	百亚股份	500	11,850.00	0.01
721	300708	聚灿光电	1,300	11,700.00	0.01
722	300816	艾可蓝	500	11,650.00	0.01
723	301285	鸿日达	400	10,436.00	0.01
724	605599	莱百股份	800	10,184.00	0.01
725	688016	心脉医疗	98	9,608.90	0.01
726	603365	水星家纺	600	9,390.00	0.01
727	002345	潮宏基	1,800	8,496.00	0.01
728	601001	晋控煤业	500	8,260.00	0.01
729	300396	迪瑞医疗	400	8,124.00	0.01
730	688072	拓荆科技	49	5,885.39	0.01
731	600681	百川能源	200	674.00	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	688691	灿芯股份	110	4,676.10	0.00
2	688530	欧莱新材	274	4,411.40	0.00
3	603082	北自科技	46	1,356.54	0.00
4	603375	盛景微	25	972.50	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300502	新易盛	1,205,684.00	1.07
2	002028	思源电气	1,090,456.00	0.97
3	000932	华菱钢铁	1,018,643.00	0.90
4	002517	恺英网络	1,011,713.00	0.90
5	601168	西部矿业	965,557.00	0.86

6	002463	沪电股份	920,524.00	0.82
7	002532	天山铝业	907,767.00	0.80
8	002064	华峰化学	882,458.00	0.78
9	000933	神火股份	879,474.00	0.78
10	688169	石头科技	839,274.75	0.74
11	601108	财通证券	834,180.00	0.74
12	002244	滨江集团	828,416.00	0.73
13	002422	科伦药业	827,387.00	0.73
14	000423	东阿阿胶	819,310.00	0.73
15	000975	山金国际	800,576.00	0.71
16	300866	安克创新	794,284.00	0.70
17	000709	河钢股份	783,210.00	0.69
18	600988	赤峰黄金	772,248.00	0.68
19	300394	天孚通信	751,502.00	0.67
20	002156	通富微电	741,643.00	0.66

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	000933	神火股份	1,236,318.00	1.10
2	300866	安克创新	1,197,140.00	1.06
3	000783	长江证券	1,175,849.00	1.04
4	000932	华菱钢铁	1,120,876.00	0.99
5	601168	西部矿业	1,050,891.00	0.93
6	002867	周大生	983,618.00	0.87
7	300009	安科生物	941,215.00	0.83
8	600563	法拉电子	939,025.00	0.83
9	002078	太阳纸业	936,966.00	0.83
10	002422	科伦药业	883,230.00	0.78
11	600060	海信视像	872,575.00	0.77
12	002128	电投能源	866,659.00	0.77
13	002532	天山铝业	854,014.00	0.76
14	000887	中鼎股份	853,970.00	0.76
15	002028	思源电气	847,911.00	0.75
16	300502	新易盛	844,815.00	0.75
17	000559	万向钱潮	841,284.00	0.75
18	002463	沪电股份	835,732.00	0.74
19	600873	梅花生物	832,059.00	0.74
20	000830	鲁西化工	829,709.79	0.74

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	219,754,287.99
卖出股票收入（成交）总额	226,019,381.13

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 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规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明**

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

### 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	958,067.22
2	应收清算款	-
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	958,067.22

### 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 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

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	688691	灿芯股份	4,676.10	0.00	新股锁定期
2	688530	欧莱新材	4,411.40	0.00	新股锁定期
3	603082	北自科技	1,356.54	0.00	新股锁定期
4	603375	盛景微	972.50	0.00	新股锁定期

## § 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
1,787	62,719.83	27,802,423.00	24.81%	84,277,910.00	75.19%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	东方证券股份有限公司	6,975,990.00	6.22%
2	方正证券股份有限公司	6,114,700.00	5.46%
3	广发证券股份有限公司	3,599,600.00	3.21%
4	广东华兴玻璃股份有限公司	3,100,000.00	2.77%
5	杜爱明	3,061,700.00	2.73%
6	马晓霞	2,740,900.00	2.45%
7	中信建投证券股份有限公司	2,643,600.00	2.36%
8	高璇	1,825,000.00	1.63%
9	华泰证券股份有限公司	1,655,000.00	1.48%
10	黄时博	1,550,000.00	1.38%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 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	130,080,333.00
本报告期基金总申购份额	109,500,000.00
减：报告期基金总赎回份额	127,500,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	112,080,333.00

## § 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。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	214,089,465.77	48.03%	21,409.08	48.03%	-
兴业证券	1	144,371,393.94	32.39%	14,439.51	32.39%	-
海通证券	1	82,990,197.90	18.62%	8,301.88	18.62%	-
中信建投	1	4,255,524.79	0.95%	425.53	0.95%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

#### A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

#### C：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	1,887.60	12.75%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	3,056.66	20.65%	-	-	-	-
中信建投	9,857.24	66.60%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

### 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旗下部分ETF增加财达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	2024-01-25
2	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加西南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	2024-02-26
3	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加联储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	2024-03-13
4	南方基金管理股份有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-20

## § 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。

## § 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 2024 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>