

南方中证 A500 交易型开放式指数证券 投资基金 2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 30 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 2025 年 8 月 28 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 2025 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.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	10
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.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	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）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	52

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 A500ETF
场内简称	A500ETF 南方
基金主代码	159352
交易代码	159352
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 9 月 25 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	17,472,101,746.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 10 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制策略、替代策略及其他适当的策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。主要投资策略包括：完全复制策略、替代策略、金融衍生品投资策略、债券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为中证 A500 指数。
风险收益特征	本基金属股票型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	郭明
	联系电话	0755-82763888	(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(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-261,638,117.47
本期利润	100,298,877.97
加权平均基金份额本期利润	0.0051
本期加权平均净值利润率	0.52%
本期基金份额净值增长率	1.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-71,153,240.57
期末可供分配基金份额利润	-0.0041
期末基金资产净值	17,803,801,142.07
期末基金份额净值	1.0190
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	1.90%

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；

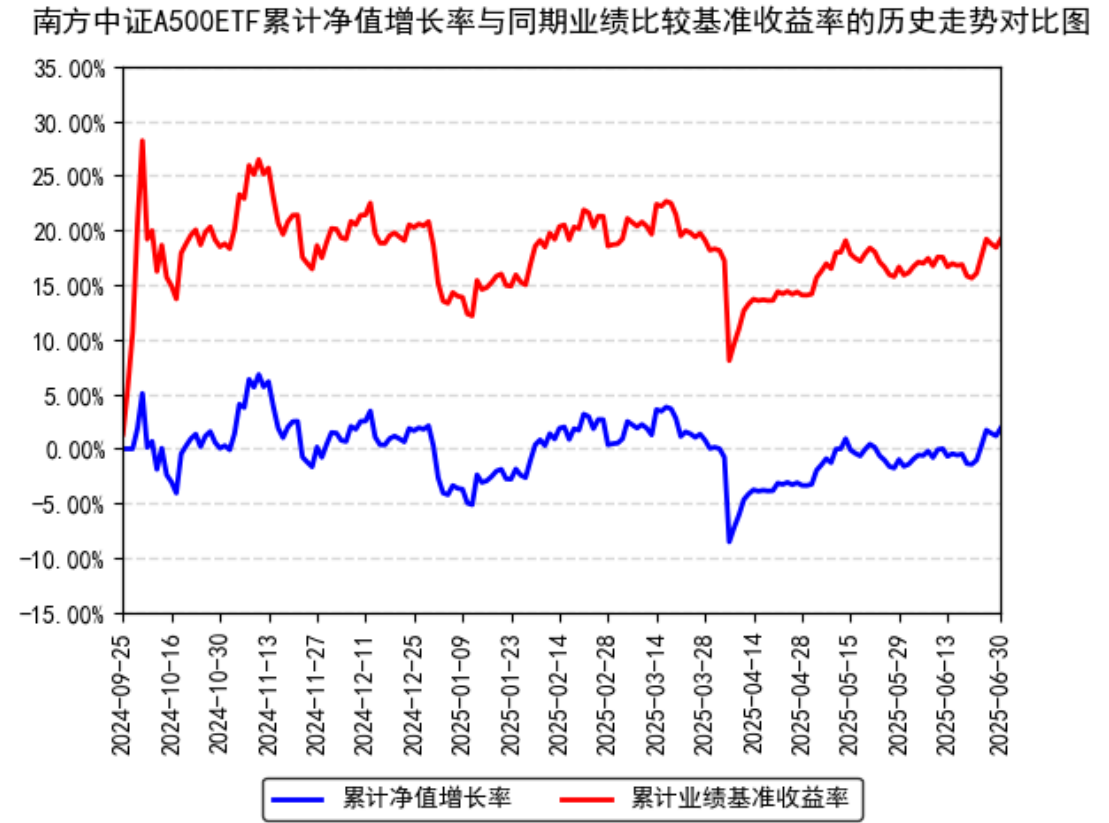
对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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
过去一个月	3.56%	0.60%	2.82%	0.60%	0.74%	0.00%
过去三个月	1.87%	1.20%	0.84%	1.20%	1.03%	0.00%
过去六个月	1.63%	1.10%	0.47%	1.10%	1.16%	0.00%
自基金合同 生效起至今	1.90%	1.23%	19.18%	1.58%	-17.28%	-0.35%

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



注：本基金合同于 2024 年 9 月 25 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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		
朱恒红	本基金基金经理	2024 年 9 月 25 日	-	8 年	北京大学经济学硕士，具有基金从业资格。2016 年 7 月加入南方基金，历任数量化投资部助理研究员、指数投资部研究员；2019 年 7 月 12 日至 2020 年 12 月 25 日，任投资经理；2023 年 4 月 13 日至 2024 年 5 月 17 日，任南方沪深 300ESG 基准 ETF 基金经理；2021 年 7 月 16 日至 2025 年 6 月 6 日，任南方中证香港科技 ETF（QDII）基金经理；2020 年 12 月 25 日至今，任南方策略优化混合基金经理；2021 年 4 月 23 日至今，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理；2021 年 11 月 2 日至今，任南方中证全指医疗保健 ETF 基金经理；2022 年 6 月 17 日至今，任南方恒生生物科技 ETF（QDII）（原：南方恒生香港上市生物科技 ETF（QDII））基金经理；2022 年 7 月 11 日至今，任南方中证上海环交所碳

					中和 ETF 基金经理；2022 年 12 月 1 日至今，任南方上证科创板 50 成份增强策略 ETF 基金经理；2023 年 5 月 30 日至今，任南方恒生生物科技 ETF 发起联接（QDII）（原：南方恒生香港上市生物科技 ETF 发起联接(QDII)）基金经理；2023 年 6 月 1 日至今，任南方中证上海环交所碳中和 ETF 联接基金经理；2023 年 10 月 24 日至今，任南方中证全指医疗保健设备与服务 ETF 发起联接基金经理；2023 年 12 月 8 日至今，任南方上证科创板 100ETF 基金经理；2024 年 4 月 16 日至今，任南方中证创新药产业 ETF 发起联接基金经理；2024 年 5 月 30 日至今，任南方深证主板 50ETF 基金经理；2024 年 6 月 24 日至今，任南方上证科创板 100ETF 联接基金经理；2024 年 9 月 25 日至今，任南方中证 A500ETF 基金经理；2024 年 10 月 18 日至今，任南方深证主板 50ETF 联接基金经理；2024 年 11 月 12 日至今，任南方中证 A500ETF 联接基金经理；2025 年 1 月 14 日至今，任南方中证港股通汽车产业主题指数发起基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券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 96 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

今年上半年市场整体波动较大，中证 A500 指数上涨 0.47%。虽然在 4 月初受关税影响市场大幅调整，但随后不断向上修复，韧性十足，目前已突破了关税冲击之前的水平，并且很多指数创出近期新高。同时，今年流动性也较好，日均成交额维持在万亿以上，体现了当前较为积极的投资情绪。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

（1）报告期内，我们根据指数定期的成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

（2）大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

（3）报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

（4）股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；

（5）新股上市初期涨幅较大的影响。

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 1.0190 元，报告期内，份额净值增长率为 1.63%，同期业绩基准增长率为 0.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年经济增速稳中有升，下半年有望维持良好态势。海外方面，中美贸易摩擦进入缓和期，虽仍有不确定性，但国内已有充分的应对手段，后续大概率是合作中竞争的模式。国内方面，中国经济发生新叙事：需求端发力两新（新消费、新质生产力），进一步打开需求空间，短期“以旧换新”与财政发力支撑内需，长期完善收入分配制度建设提升消费力。供给侧继续发力“反内卷”，进一步平衡供需，优化资源配置。货币政策方面，宽松仍是主基调，下半年有望继续降息。在弱美元周期、政策温和发力、流动性宽松的背景下，证券市场有望先稳后升。短期震荡或是底部配置、优化持仓的机会。

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、现金及债券指数投资部总经理、国际业务部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 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 2025 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 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.3.1	153,205,097.15	116,123,998.17
结算备付金		879,064.43	770,469.35
存出保证金		418,483.20	420,864.00
交易性金融资产	6.4.3.2	17,769,370,041.47	22,629,587,332.72
其中：股票投资		17,769,045,620.14	22,629,587,332.72

基金投资		-	-
债券投资		324,421.33	-
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		-	-
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		17,923,872,686.25	22,746,902,664.24
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		29,616.66	226,193.80
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,019,267.28	2,430,698.40
应付托管费		673,089.10	810,232.80
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.67	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	117,349,570.47	100,390,594.15
负债合计		120,071,544.18	103,857,719.15
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	17,472,101,746.00	22,581,101,746.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	331,699,396.07	61,943,199.09
净资产合计		17,803,801,142.07	22,643,044,945.09
负债和净资产总计		17,923,872,686.25	22,746,902,664.24

注：1. 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0190 元，基金份额总额 17,472,101,746.00 份。

2. 基金合同生效日为 2024 年 09 月 25 日, 2024 年度实际报告期间为 2024 年 09 月 25 日至 2024 年 12 月 31 日。

6.2 利润表

会计主体：南方中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		119,612,802.81
1.利息收入		42,319.17
其中：存款利息收入	6.4.3.9	42,319.17
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）		-250,558,838.14
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-465,053,893.46
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.3.11	20.73
资产支持证券投资收益	6.4.3.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.3.13	-86,426.54
股利收益	6.4.3.14	214,581,461.13
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）	6.4.3.15	361,936,995.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	8,192,326.34
减：二、营业总支出		19,313,924.84
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	14,421,875.81

其中：暂估管理人报酬		-
2.托管费	6.4.6.2.2	4,807,292.00
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		0.07
8.其他费用	6.4.3.17	84,756.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		100,298,877.97
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		100,298,877.97
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		100,298,877.97

6.3 净资产变动表

会计主体：南方中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	22,581,101,746.00	-	61,943,199.09	22,643,044,945.09
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	22,581,101,746.00	-	61,943,199.09	22,643,044,945.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,109,000,000.00	-	269,756,196.98	-4,839,243,803.02
（一）、综合收益总额	-	-	100,298,877.97	100,298,877.97
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	-5,109,000,000.00	-	169,457,319.01	-4,939,542,680.99

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	8,688,000,000.00	-	-38,391,931.81	8,649,608,068.19
2.基金赎回款	-13,797,000,000.00	-	207,849,250.82	-13,589,150,749.18
(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	17,472,101,746.00	-	331,699,396.07	17,803,801,142.07

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 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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.3 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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	236,271.19
等于：本金	236,250.04
加：应计利息	21.15
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	152,968,825.96
等于：本金	152,967,977.78
加：应计利息	848.18
减：坏账准备	-
合计	153,205,097.15

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		17,745,330,438.35	-	17,769,045,620.14	23,715,181.79
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	324,400.00	21.33	324,421.33	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	324,400.00	21.33	324,421.33	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		17,745,654,838.35	21.33	17,769,370,041.47	23,715,181.79

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 2025 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	3,387,180.00	-	-	-
-股指期货	3,387,180.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,387,180.00	-	-	-

6.4.3.3.2 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
IC2509	IC2509	1.00	1,155,160.00	38,800.00
IF2509	IF2509	2.00	2,332,200.00	61,380.00
合计				100,180.00
减：可抵销期货暂收款				100,180.00
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。

6.4.3.4 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

无。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.3.5 其他资产

无。

6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-

应退退补款	114,679,706.56
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	-
可退替代款	2,090,829.71
其他	494,731.64
合计	117,349,570.47

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,581,101,746.00	22,581,101,746.00
本期申购	8,688,000,000.00	8,688,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-13,797,000,000.00	-13,797,000,000.00
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	17,472,101,746.00	17,472,101,746.00

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）。

6.4.3.8 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	182,727,631.45	-120,784,432.36	61,943,199.09
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	182,727,631.45	-120,784,432.36	61,943,199.09
本期利润	-261,638,117.47	361,936,995.44	100,298,877.97
本期基金份额交易产生的变动数	7,757,245.45	161,700,073.56	169,457,319.01
其中：基金申购款	2,797,035.61	-41,188,967.42	-38,391,931.81
基金赎回款	4,960,209.84	202,889,040.98	207,849,250.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-71,153,240.57	402,852,636.64	331,699,396.07

6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	779.43

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	36,638.92
结算备付金利息收入	4,900.82
其他	-
合计	42,319.17

注 其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-196,230,762.51
股票投资收益——赎回差价收入	-268,823,130.95
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	-465,053,893.46

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	8,892,533,749.43
减：卖出股票成本总额	9,081,832,162.27
减：交易费用	6,932,349.67
买卖股票差价收入	-196,230,762.51

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	13,589,150,749.18
减：现金支付赎回款总额	7,839,936,232.18
减：赎回股票成本总额	6,018,037,647.95
减：交易费用	-
赎回差价收入	-268,823,130.95

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	20.73

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	20.73

6.4.3.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.3.12 资产支持证券投资收益

6.4.3.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.3.13 衍生工具收益

6.4.3.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.3.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	-86,426.54

6.4.3.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	214,581,461.13
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	214,581,461.13

6.4.3.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	361,749,255.44
——股票投资	361,749,255.44
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	187,740.00
——权证投资	-
——期货投资	187,740.00

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	361,936,995.44

6.4.3.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	8,192,326.34
合计	8,192,326.34

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。

6.4.3.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	454.40
合计	84,756.96

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），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。

本基金的基金管理人于 2025 年 7 月 9 日宣告 2025 年度第 1 次分红，向截至 2025 年 7 月 11 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.1100 元。

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

无。

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
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
南方中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“南方中证 A500ETF 联接”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 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

无。

6.4.6.1.2 债券交易

无。

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 权证交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,421,875.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,406,727.96
应支付基金管理人的净管理费	13,015,147.85

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

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,807,292.00

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

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

无。

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

无。

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

无。

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

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
报告期初持有的基金份额	50,073,500.00
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	50,073,500.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.29%

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

6.4.6.5.2 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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券股份有限公司	1,450,676,102.00	8.30%	1,949,776,048.00	8.63%
兴业证券股份有限公司	153,824,278.00	0.88%	118,825,205.00	0.53%
中国工商银行股份有限公司—南方中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	3,897,888,107.00	22.31%	5,063,498,507.00	22.42%

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	236,271.19	779.43

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 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	301458	钧崴电子	网下申购	7,005	72,852.00
华泰联合	603014	威高血净	网下申购	2,045	54,192.50
华泰联合	688757	胜科纳米	网下申购	5,357	48,641.56

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

于本期末，本基金持有关联方中国工商银行发行的普通股，成本总额为人民币 178,877,644.95 元，估值总额为人民币 206,432,061.00 元，占基金净资产的比例为 1.16%（于上期末，本基金持有关联方中国工商银行发行的普通股，成本总额为人民币 220,153,295.22 元，估值总额为人民币 243,128,664.00 元，占基金净资产的比例为 1.07%）。

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

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

6.4.8 期末（2025 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
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定期	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-
688411	海博思创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定期	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
603049	中策橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股锁定期	46.50	42.85	724	33,666.00	31,023.40	-
688545	兴福电子	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股锁定期	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
301458	钧崑电子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股锁定期	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股锁定期	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
688583	思看科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定期	33.46	79.68	175	5,855.50	13,944.00	-
688583	思看科技	2025 年 6 月 19 日	1 个月内（含）	锁定期转增	-	79.68	52	-	4,143.36	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
301602	超研股份	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股锁定期	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301501	恒鑫生活	2025	6 个月	新股锁	39.92	45.22	241	9,620.72	10,898.02	-

		年 3 月 11 日		定期						
301501	恒鑫生活	2025 年 6 月 6 日	1-6 个 月 (含)	锁定期 转增	-	45.22	108	-	4,883.76	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月 内 (含)	新股未 上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁 定期	41.90	77.87	130	5,447.00	10,123.10	-
301479	弘景光电	2025 年 5 月 28 日	1-6 个 月 (含)	锁定期 转增	-	77.87	52	-	4,049.24	-
688757	胜科纳米	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁 定期	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	89.60	139.4 8	73	6,540.80	10,182.04	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股锁 定期	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-

603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股锁定期	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603409	汇通控股	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新股锁定期	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股锁定期	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股锁定期	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定期	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-

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
123257	安克转债	2025 年 6 月 16 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.01	3,244	324,400.00	324,421.33	-

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

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

无。

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

本基金为被动式指数基金，紧密跟踪中证 A500 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证 A500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权

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

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

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

6.4.9.2 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资产净值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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

6.4.9.4 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 2025 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	153,205,097.15	-	-	-	153,205,097.15
结算备付金	879,064.43	-	-	-	879,064.43
存出保证金	-	-	-	418,483.20	418,483.20
交易性金融资产	-	-	324,421.33	17,769,045,620.14	17,769,370,041.47
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	154,084,161.58	-	324,421.33	17,769,464,103.34	17,923,872,686.25
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	-	-	-	29,616.66	29,616.66
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,019,267.28	2,019,267.28
应付托管费	-	-	-	673,089.10	673,089.10
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.67	0.67
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	117,349,570.47	117,349,570.47
负债总计	-	-	-	120,071,544.18	120,071,544.18
利率敏感度缺口	154,084,161.58	-	324,421.33	17,649,392,559.16	17,803,801,142.07
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	116,123,998.17	-	-	-	116,123,998.17
结算备付金	770,469.35	-	-	-	770,469.35
存出保证金	-	-	-	420,864.00	420,864.00
交易性金融资产	-	-	-	22,629,587,332.72	22,629,587,332.72
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	116,894,467.52	-	-	22,630,008,196.72	22,746,902,664.24
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	-	-	-	226,193.80	226,193.80
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,430,698.40	2,430,698.40
应付托管费	-	-	-	810,232.80	810,232.80
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	-	-	-	100,390,594.15	100,390,594.15
负债总计	-	-	-	103,857,719.15	103,857,719.15
利率敏感度缺口	116,894,467.52	-	-	22,526,150,477.57	22,643,044,945.09

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	0.00	0.00
	2.市场利率平行下降 25 个基点	0.00	0.00

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。本基金主要投资于股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	17,769,045,620.14	99.80	22,629,587,332.72	99.94
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	17,769,045,620.14	99.80	22,629,587,332.72	99.94

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（ 2025 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2024 年 12 月 31 日 ）
	1.组合自身基准上升 5%	810,533,923.60	925,493,556.63
	2.组合自身基准下降 5%	-810,533,923.60	-925,493,556.63

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	17,768,630,602.83
第二层次	339,806.87
第三层次	399,631.77
合计	17,769,370,041.47

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。

6.4.10.4 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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	17,769,045,620.14	99.14
	其中：股票	17,769,045,620.14	99.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	324,421.33	0.00
	其中：债券	324,421.33	0.00
	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	154,084,161.58	0.86
8	其他各项资产	418,483.20	0.00
9	合计	17,923,872,686.25	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	97,166,479.18	0.55
B	采矿业	896,901,505.01	5.04
C	制造业	10,325,459,640.35	58.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	547,341,249.00	3.07
E	建筑业	338,656,862.00	1.90
F	批发和零售业	125,920,730.00	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	619,569,282.00	3.48
H	住宿和餐饮业	15,685,641.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,167,970,254.74	6.56
J	金融业	2,880,718,180.25	16.18
K	房地产业	185,559,542.00	1.04
L	租赁和商务服务业	197,132,636.60	1.11
M	科学研究和技术服务业	197,202,141.50	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	39,245,101.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	11,671,146.00	0.07
Q	卫生和社会工作	66,453,288.48	0.37

R	文化、体育和娱乐业	55,967,559.82	0.31
S	综合	-	-
	合计	17,768,621,238.93	99.80

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	410,477.37	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	13,903.84	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	424,381.21	0.00

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 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	600519	贵州茅台	490,290	691,073,560.80	3.88
2	300750	宁德时代	2,052,322	517,636,654.84	2.91
3	601318	中国平安	8,341,000	462,758,680.00	2.60
4	600036	招商银行	9,626,330	442,329,863.50	2.48

5	601166	兴业银行	12,881,000	300,642,540.00	1.69
6	600900	长江电力	9,471,650	285,475,531.00	1.60
7	000333	美的集团	3,812,300	275,248,060.00	1.55
8	601899	紫金矿业	12,776,556	249,142,842.00	1.40
9	002594	比亚迪	698,200	231,739,562.00	1.30
10	300059	东方财富	9,781,154	226,238,092.02	1.27
11	600030	中信证券	7,569,165	209,060,337.30	1.17
12	601398	工商银行	27,197,900	206,432,061.00	1.16
13	600276	恒瑞医药	3,465,700	179,869,830.00	1.01
14	000858	五粮液	1,508,200	179,324,980.00	1.01
15	601328	交通银行	20,712,500	165,700,000.00	0.93
16	000651	格力电器	3,466,624	155,720,750.08	0.87
17	601288	农业银行	24,783,100	145,724,628.00	0.82
18	688981	中芯国际	1,548,984	136,573,919.28	0.77
19	600887	伊利股份	4,897,669	136,547,011.72	0.77
20	002475	立讯精密	3,934,780	136,497,518.20	0.77
21	600919	江苏银行	11,409,200	136,225,848.00	0.77
22	603259	药明康德	1,933,300	134,461,015.00	0.76
23	601816	京沪高铁	22,730,400	130,699,800.00	0.73
24	600000	浦发银行	9,124,519	126,648,323.72	0.71
25	002371	北方华创	257,950	114,068,069.50	0.64
26	000725	京东方 A	28,287,500	112,867,125.00	0.63
27	300760	迈瑞医疗	472,284	106,145,829.00	0.60
28	688041	海光信息	735,874	103,971,637.46	0.58
29	601088	中国神华	2,550,500	103,397,270.00	0.58
30	601601	中国太保	2,678,000	100,451,780.00	0.56
31	300308	中际旭创	684,030	99,772,615.80	0.56
32	300502	新易盛	761,156	96,682,035.12	0.54
33	300124	汇川技术	1,468,229	94,803,546.53	0.53
34	688256	寒武纪	156,495	94,131,742.50	0.53
35	601728	中国电信	12,057,600	93,446,400.00	0.52
36	601668	中国建筑	16,047,900	92,596,383.00	0.52
37	000001	平安银行	7,497,500	90,494,825.00	0.51
38	002352	顺丰控股	1,851,600	90,284,016.00	0.51
39	002714	牧原股份	2,131,318	89,536,669.18	0.50
40	002230	科大讯飞	1,780,900	85,269,492.00	0.48
41	601127	赛力斯	631,700	84,849,944.00	0.48
42	603501	豪威集团	658,100	84,006,465.00	0.47
43	600031	三一重工	4,605,920	82,676,264.00	0.46
44	000063	中兴通讯	2,473,782	80,373,177.18	0.45
45	603019	中科曙光	1,137,500	80,080,000.00	0.45
46	600309	万华化学	1,470,665	79,798,282.90	0.45
47	002415	海康威视	2,860,500	79,321,665.00	0.45

48	600941	中国移动	696,300	78,368,565.00	0.44
49	300274	阳光电源	1,126,443	76,339,042.11	0.43
50	601857	中国石油	8,769,000	74,974,950.00	0.42
51	688008	澜起科技	897,112	73,563,184.00	0.41
52	601919	中远海控	4,858,950	73,078,608.00	0.41
53	600690	海尔智家	2,904,700	71,978,466.00	0.40
54	601012	隆基绿能	4,693,027	70,489,265.54	0.40
55	600660	福耀玻璃	1,233,700	70,333,237.00	0.40
56	600406	国电南瑞	3,091,550	69,281,635.50	0.39
57	601766	中国中车	9,413,800	66,273,152.00	0.37
58	603986	兆易创新	521,200	65,947,436.00	0.37
59	600050	中国联通	12,106,800	64,650,312.00	0.36
60	000568	泸州老窖	568,741	64,495,229.40	0.36
61	000338	潍柴动力	4,174,119	64,197,950.22	0.36
62	600028	中国石化	11,279,200	63,614,688.00	0.36
63	300476	胜宏科技	470,200	63,185,476.00	0.35
64	000100	TCL 科技	14,490,100	62,742,133.00	0.35
65	601988	中国银行	11,077,460	62,255,325.20	0.35
66	601006	大秦铁路	9,359,800	61,774,680.00	0.35
67	688012	中微公司	328,016	59,797,316.80	0.34
68	601985	中国核电	6,375,200	59,416,864.00	0.33
69	601225	陕西煤业	2,991,429	57,555,093.96	0.32
70	600104	上汽集团	3,572,700	57,341,835.00	0.32
71	002027	分众传媒	7,823,634	57,112,528.20	0.32
72	600150	中国船舶	1,733,300	56,401,582.00	0.32
73	600418	江淮汽车	1,338,800	53,672,492.00	0.30
74	601628	中国人寿	1,279,800	52,714,962.00	0.30
75	600760	中航沈飞	865,200	50,718,024.00	0.28
76	603288	海天味业	1,281,464	49,861,764.24	0.28
77	000425	徐工机械	6,355,700	49,383,789.00	0.28
78	000625	长安汽车	3,842,600	49,031,576.00	0.28
79	605499	东鹏饮料	155,958	48,978,609.90	0.28
80	000792	盐湖股份	2,862,500	48,891,500.00	0.27
81	688111	金山办公	173,636	48,626,761.80	0.27
82	600111	北方稀土	1,942,700	48,373,230.00	0.27
83	600938	中国海油	1,842,200	48,099,842.00	0.27
84	688271	联影医疗	370,750	47,359,605.00	0.27
85	600905	三峡能源	11,057,700	47,105,802.00	0.26
86	601658	邮储银行	8,588,900	46,981,283.00	0.26
87	600089	特变电工	3,926,348	46,841,331.64	0.26
88	002625	光启技术	1,162,350	46,470,753.00	0.26
89	601888	中国中免	751,300	45,806,761.00	0.26
90	603993	洛阳钼业	5,417,900	45,618,718.00	0.26

91	002050	三花智控	1,726,000	45,531,880.00	0.26
92	600436	片仔癀	226,193	45,240,861.93	0.25
93	600048	保利发展	5,583,300	45,224,730.00	0.25
94	600019	宝钢股份	6,803,400	44,834,406.00	0.25
95	002463	沪电股份	1,051,640	44,778,831.20	0.25
96	300015	爱尔眼科	3,581,945	44,702,673.60	0.25
97	601390	中国中铁	7,967,900	44,699,919.00	0.25
98	300014	亿纬锂能	968,844	44,382,743.64	0.25
99	600415	小商品城	2,136,500	44,182,820.00	0.25
100	600547	山东黄金	1,382,320	44,137,477.60	0.25
101	300033	同花顺	161,251	44,023,135.51	0.25
102	002241	歌尔股份	1,874,700	43,718,004.00	0.25
103	601600	中国铝业	6,160,600	43,370,624.00	0.24
104	601989	中国重工	8,805,300	40,856,592.00	0.23
105	000977	浪潮信息	790,900	40,240,992.00	0.23
106	002179	中航光电	995,300	40,170,308.00	0.23
107	600893	航发动力	1,040,900	40,116,286.00	0.23
108	600585	海螺水泥	1,847,800	39,672,266.00	0.22
109	603799	华友钴业	1,061,300	39,289,326.00	0.22
110	600570	恒生电子	1,169,200	39,214,968.00	0.22
111	000538	云南白药	681,680	38,030,927.20	0.21
112	002384	东山精密	1,000,700	37,796,439.00	0.21
113	600584	长电科技	1,112,000	37,463,280.00	0.21
114	000938	紫光股份	1,559,900	37,422,001.00	0.21
115	601727	上海电气	4,875,400	36,029,206.00	0.20
116	000988	华工科技	763,100	35,873,331.00	0.20
117	002028	思源电气	488,136	35,589,995.76	0.20
118	600438	通威股份	2,110,600	35,352,550.00	0.20
119	300408	三环集团	1,045,000	34,903,000.00	0.20
120	002049	紫光国微	529,100	34,846,526.00	0.20
121	300433	蓝思科技	1,554,600	34,667,580.00	0.19
122	000002	万科 A	5,242,600	33,657,492.00	0.19
123	600795	国电电力	6,897,000	33,381,480.00	0.19
124	600489	中金黄金	2,252,400	32,952,612.00	0.19
125	601669	中国电建	6,676,000	32,512,120.00	0.18
126	002422	科伦药业	886,756	31,852,275.52	0.18
127	600988	赤峰黄金	1,278,300	31,804,104.00	0.18
128	601689	拓普集团	666,000	31,468,500.00	0.18
129	600010	宝钢股份	17,550,400	31,415,216.00	0.18
130	600009	上海机场	979,490	31,118,397.30	0.17
131	300339	润和软件	611,600	31,087,628.00	0.17
132	601100	恒立液压	431,300	31,053,600.00	0.17
133	002456	欧菲光	2,593,900	30,737,715.00	0.17

134	600160	巨化股份	1,054,800	30,251,664.00	0.17
135	002460	赣锋锂业	894,940	30,222,123.80	0.17
136	000768	中航西飞	1,076,900	29,442,446.00	0.17
137	300394	天孚通信	367,587	29,348,146.08	0.16
138	600183	生益科技	958,400	28,895,760.00	0.16
139	601186	中国铁建	3,551,800	28,449,918.00	0.16
140	002252	上海莱士	4,088,549	28,088,331.63	0.16
141	002074	国轩高科	861,362	27,959,810.52	0.16
142	600839	四川长虹	2,857,200	27,771,984.00	0.16
143	000157	中联重科	3,840,000	27,763,200.00	0.16
144	601360	三六零	2,717,100	27,714,420.00	0.16
145	600989	宝丰能源	1,702,900	27,484,806.00	0.15
146	688036	传音控股	341,994	27,256,921.80	0.15
147	600886	国投电力	1,848,900	27,252,786.00	0.15
148	000963	华东医药	670,100	27,045,236.00	0.15
149	601058	赛轮轮胎	2,057,393	26,992,996.16	0.15
150	600115	中国东航	6,590,100	26,558,103.00	0.15
151	300442	润泽科技	533,109	26,404,888.77	0.15
152	600066	宇通客车	1,038,100	25,807,166.00	0.14
153	000408	藏格矿业	603,700	25,759,879.00	0.14
154	000807	云铝股份	1,611,350	25,749,373.00	0.14
155	002001	新和成	1,182,284	25,147,180.68	0.14
156	002466	天齐锂业	784,300	25,128,972.00	0.14
157	002340	格林美	3,954,100	25,108,535.00	0.14
158	600196	复星医药	998,469	25,051,587.21	0.14
159	600426	华鲁恒升	1,149,500	24,909,665.00	0.14
160	300661	圣邦股份	341,648	24,861,724.96	0.14
161	301236	软通动力	452,250	24,710,940.00	0.14
162	002195	岩山科技	4,386,700	24,697,121.00	0.14
163	600029	南方航空	4,160,100	24,544,590.00	0.14
164	601800	中国交建	2,759,400	24,531,066.00	0.14
165	600674	川投能源	1,528,600	24,518,744.00	0.14
166	001979	招商蛇口	2,794,400	24,506,888.00	0.14
167	002236	大华股份	1,542,400	24,493,312.00	0.14
168	002156	通富微电	954,500	24,454,290.00	0.14
169	600011	华能国际	3,405,100	24,312,414.00	0.14
170	688169	石头科技	155,206	24,297,499.30	0.14
171	000661	长春高新	244,700	24,269,346.00	0.14
172	000975	山金国际	1,275,500	24,157,970.00	0.14
173	688126	沪硅产业	1,267,015	23,718,520.80	0.13
174	600487	亨通光电	1,543,400	23,614,020.00	0.13
175	600346	恒力石化	1,638,900	23,370,714.00	0.13
176	002517	恺英网络	1,202,144	23,213,400.64	0.13

177	300251	光线传媒	1,132,200	22,949,694.00	0.13
178	600460	士兰微	922,500	22,896,450.00	0.13
179	601111	中国国航	2,897,000	22,857,330.00	0.13
180	300207	欣旺达	1,139,300	22,854,358.00	0.13
181	002558	巨人网络	958,500	22,572,675.00	0.13
182	300418	昆仑万维	670,900	22,562,367.00	0.13
183	600372	中航机载	1,862,100	22,456,926.00	0.13
184	600745	闻泰科技	667,600	22,384,628.00	0.13
185	000066	中国长城	1,511,500	22,370,200.00	0.13
186	002648	卫星化学	1,289,723	22,350,899.59	0.13
187	601868	中国能建	10,013,200	22,329,436.00	0.13
188	003816	中国广核	6,090,500	22,169,420.00	0.12
189	300347	泰格医药	412,700	22,005,164.00	0.12
190	600096	云天化	1,000,700	21,985,379.00	0.12
191	601021	春秋航空	395,000	21,981,750.00	0.12
192	688608	恒玄科技	63,003	21,923,783.94	0.12
193	601117	中国化学	2,837,100	21,760,557.00	0.12
194	300450	先导智能	871,161	21,648,350.85	0.12
195	688213	思特威	210,898	21,557,993.56	0.12
196	002916	深南电路	199,928	21,554,237.68	0.12
197	600879	航天电子	2,057,300	21,539,931.00	0.12
198	002273	水晶光电	1,076,957	21,506,831.29	0.12
199	002465	海格通信	1,542,200	21,498,268.00	0.12
200	600741	华域汽车	1,214,800	21,441,220.00	0.12
201	601319	中国人保	2,460,200	21,428,342.00	0.12
202	600588	用友网络	1,594,200	21,314,454.00	0.12
203	601168	西部矿业	1,281,400	21,309,682.00	0.12
204	688777	中控技术	474,200	21,296,322.00	0.12
205	300782	卓胜微	298,216	21,283,675.92	0.12
206	002920	德赛西威	208,088	21,252,027.44	0.12
207	600256	广汇能源	3,512,550	21,145,551.00	0.12
208	600176	中国巨石	1,849,300	21,082,020.00	0.12
209	601633	长城汽车	980,600	21,063,288.00	0.12
210	002294	信立泰	444,500	21,038,185.00	0.12
211	688120	华海清科	124,240	20,959,288.00	0.12
212	002601	龙佰集团	1,279,700	20,743,937.00	0.12
213	000831	中国稀土	572,800	20,689,536.00	0.12
214	600482	中国动力	895,000	20,647,650.00	0.12
215	600352	浙江龙盛	2,030,700	20,631,912.00	0.12
216	600885	宏发股份	924,620	20,628,272.20	0.12
217	002555	三七互娱	1,191,300	20,597,577.00	0.12
218	600219	南山铝业	5,375,800	20,589,314.00	0.12
219	000786	北新建材	769,800	20,384,304.00	0.11

220	600039	四川路桥	2,038,200	20,178,180.00	0.11
221	688235	百济神州	86,263	20,154,487.32	0.11
222	000933	神火股份	1,209,917	20,133,018.88	0.11
223	300017	网宿科技	1,876,300	20,113,936.00	0.11
224	300896	爱美客	113,400	19,823,454.00	0.11
225	002185	华天科技	1,961,800	19,814,180.00	0.11
226	000630	铜陵有色	5,902,200	19,713,348.00	0.11
227	601877	正泰电器	869,200	19,704,764.00	0.11
228	302132	中航成飞	220,800	19,417,152.00	0.11
229	002493	荣盛石化	2,340,800	19,381,824.00	0.11
230	000423	东阿阿胶	369,400	19,319,620.00	0.11
231	600085	同仁堂	533,100	19,223,586.00	0.11
232	002281	光迅科技	389,300	19,200,276.00	0.11
233	688002	睿创微纳	273,494	19,068,001.68	0.11
234	002129	TCL 中环	2,479,600	19,043,328.00	0.11
235	001965	招商公路	1,586,200	19,034,400.00	0.11
236	002709	天赐材料	1,040,300	18,850,236.00	0.11
237	688617	惠泰医疗	63,436	18,840,492.00	0.11
238	002595	豪迈科技	317,700	18,814,194.00	0.11
239	688396	华润微	398,129	18,775,763.64	0.11
240	300223	北京君正	270,900	18,746,280.00	0.11
241	603596	伯特利	352,700	18,583,763.00	0.10
242	603392	万泰生物	303,914	18,538,754.00	0.10
243	600362	江西铜业	788,400	18,472,212.00	0.10
244	300122	智飞生物	942,251	18,458,697.09	0.10
245	002131	利欧股份	5,218,000	18,263,000.00	0.10
246	002130	沃尔核材	765,099	18,224,658.18	0.10
247	002085	万丰奥威	1,145,900	18,208,351.00	0.10
248	300866	安克创新	159,390	18,106,704.00	0.10
249	300002	神州泰岳	1,525,900	18,005,620.00	0.10
250	600161	天坛生物	937,900	17,998,301.00	0.10
251	002532	天山铝业	2,161,000	17,957,910.00	0.10
252	300058	蓝色光标	2,734,940	17,941,206.40	0.10
253	688099	晶晨股份	252,578	17,935,563.78	0.10
254	002738	中矿资源	557,686	17,935,181.76	0.10
255	300454	深信服	189,760	17,871,596.80	0.10
256	688506	百利天恒	60,130	17,805,695.60	0.10
257	603606	东方电缆	344,300	17,803,753.00	0.10
258	300832	新产业	312,304	17,713,882.88	0.10
259	300395	菲利华	346,287	17,695,265.70	0.10
260	688122	西部超导	340,963	17,689,160.44	0.10
261	002472	双环传动	525,600	17,602,344.00	0.10
262	002128	电投能源	889,800	17,600,244.00	0.10

263	002138	顺络电子	619,000	17,406,280.00	0.10
264	002180	纳思达	756,435	17,352,618.90	0.10
265	603129	春风动力	80,100	17,341,650.00	0.10
266	002078	太阳纸业	1,284,200	17,285,332.00	0.10
267	002938	鹏鼎控股	538,500	17,248,155.00	0.10
268	300474	景嘉微	235,100	17,162,300.00	0.10
269	002436	兴森科技	1,293,600	17,127,264.00	0.10
270	000301	东方盛虹	2,052,300	17,095,659.00	0.10
271	600233	圆通速递	1,321,500	17,034,135.00	0.10
272	002410	广联达	1,265,820	16,974,646.20	0.10
273	300346	南大光电	535,456	16,941,827.84	0.10
274	000034	神州数码	450,100	16,941,764.00	0.10
275	600143	金发科技	1,637,100	16,878,501.00	0.09
276	002223	鱼跃医疗	472,400	16,817,440.00	0.09
277	300024	机器人	976,700	16,779,706.00	0.09
278	300496	中科创达	293,100	16,771,182.00	0.09
279	002353	杰瑞股份	478,800	16,758,000.00	0.09
280	600862	中航高科	641,975	16,742,708.00	0.09
281	600188	兖矿能源	1,368,800	16,658,296.00	0.09
282	002065	东华软件	1,731,400	16,621,440.00	0.09
283	300759	康龙化成	676,675	16,605,604.50	0.09
284	300054	鼎龙股份	578,400	16,588,512.00	0.09
285	601618	中国中冶	5,536,800	16,499,664.00	0.09
286	300136	信维通信	735,900	16,484,160.00	0.09
287	002202	金风科技	1,602,900	16,429,725.00	0.09
288	000999	华润三九	518,423	16,216,271.44	0.09
289	688072	拓荆科技	104,864	16,118,645.44	0.09
290	300604	长川科技	358,800	16,113,708.00	0.09
291	605117	德业股份	305,226	16,073,201.16	0.09
292	688047	龙芯中科	120,261	16,041,614.79	0.09
293	688223	晶科能源	3,081,448	15,992,715.12	0.09
294	002271	东方雨虹	1,488,760	15,974,394.80	0.09
295	002624	完美世界	1,052,631	15,968,412.27	0.09
296	601615	明阳智能	1,389,500	15,965,355.00	0.09
297	300383	光环新网	1,110,700	15,883,010.00	0.09
298	603087	甘李药业	289,800	15,875,244.00	0.09
299	002008	大族激光	644,500	15,706,465.00	0.09
300	688578	艾力斯	168,695	15,695,382.80	0.09
301	600515	海南机场	4,429,300	15,679,722.00	0.09
302	600845	宝信软件	662,400	15,645,888.00	0.09
303	002405	四维图新	1,823,638	15,573,868.52	0.09
304	601872	招商轮船	2,485,600	15,559,856.00	0.09
305	002155	湖南黄金	867,077	15,477,324.45	0.09

306	000733	振华科技	308,650	15,447,932.50	0.09
307	002459	晶澳科技	1,543,380	15,402,932.40	0.09
308	600895	张江高科	597,400	15,353,180.00	0.09
309	000426	兴业银锡	969,800	15,322,840.00	0.09
310	603659	璞泰来	810,300	15,217,434.00	0.09
311	300459	汤姆猫	2,716,700	15,213,520.00	0.09
312	600549	厦门钨业	726,600	15,200,472.00	0.09
313	300627	华测导航	433,026	15,155,910.00	0.09
314	300012	华测检测	1,288,900	15,067,241.00	0.08
315	688266	泽璟制药	138,927	14,936,041.77	0.08
316	688599	天合光能	1,019,894	14,819,059.82	0.08
317	603605	珀莱雅	178,210	14,754,005.90	0.08
318	300037	新宙邦	417,540	14,697,408.00	0.08
319	300073	当升科技	333,500	14,630,645.00	0.08
320	605589	圣泉集团	526,900	14,621,475.00	0.08
321	601216	君正集团	2,626,700	14,499,384.00	0.08
322	300699	光威复材	456,842	14,468,186.14	0.08
323	600332	白云山	545,600	14,382,016.00	0.08
324	300253	卫宁健康	1,353,014	14,341,948.40	0.08
325	600392	盛和资源	1,088,500	14,335,545.00	0.08
326	000617	中油资本	1,935,400	14,128,420.00	0.08
327	002444	巨星科技	553,800	14,127,438.00	0.08
328	000932	华菱钢铁	3,208,900	14,119,160.00	0.08
329	300003	乐普医疗	1,022,780	14,093,908.40	0.08
330	300628	亿联网络	404,700	14,067,372.00	0.08
331	603979	金诚信	300,000	13,932,000.00	0.08
332	300316	晶盛机电	510,090	13,848,943.50	0.08
333	000878	云南铜业	1,087,700	13,835,544.00	0.08
334	600153	建发股份	1,333,300	13,826,321.00	0.08
335	002389	航天彩虹	538,600	13,788,160.00	0.08
336	601233	桐昆股份	1,292,400	13,699,440.00	0.08
337	300001	特锐德	569,600	13,653,312.00	0.08
338	002007	华兰生物	867,437	13,592,737.79	0.08
339	603260	合盛硅业	285,274	13,521,987.60	0.08
340	300142	沃森生物	1,226,700	13,493,700.00	0.08
341	600803	新奥股份	709,700	13,413,330.00	0.08
342	002414	高德红外	1,306,738	13,394,064.50	0.08
343	002812	恩捷股份	456,180	13,361,512.20	0.08
344	600316	洪都航空	353,000	13,308,100.00	0.07
345	600118	中国卫星	464,660	13,275,336.20	0.07
346	688180	君实生物	389,138	13,222,909.24	0.07
347	300568	星源材质	1,042,458	13,218,367.44	0.07
348	600038	中直股份	338,500	13,137,185.00	0.07

349	600699	均胜电子	751,000	13,097,440.00	0.07
350	600177	雅戈尔	1,783,900	13,022,470.00	0.07
351	002152	广电运通	968,895	13,021,948.80	0.07
352	601799	星宇股份	103,600	12,950,000.00	0.07
353	600521	华海药业	692,000	12,891,960.00	0.07
354	600398	海澜之家	1,849,000	12,869,040.00	0.07
355	000519	中兵红箭	587,286	12,855,690.54	0.07
356	601238	广汽集团	1,713,900	12,837,111.00	0.07
357	300315	掌趣科技	2,109,500	12,804,665.00	0.07
358	002821	凯莱英	144,930	12,790,072.50	0.07
359	600704	物产中大	2,402,700	12,662,229.00	0.07
360	000738	航发控制	606,345	12,581,658.75	0.07
361	300413	芒果超媒	576,400	12,577,048.00	0.07
362	600497	驰宏锌锗	2,358,600	12,476,994.00	0.07
363	300919	中伟股份	378,420	12,442,449.60	0.07
364	002318	久立特材	530,300	12,403,717.00	0.07
365	600018	上港集团	2,169,300	12,386,703.00	0.07
366	002044	美年健康	2,407,800	12,376,092.00	0.07
367	601567	三星医疗	547,444	12,273,694.48	0.07
368	600141	兴发集团	595,900	12,233,827.00	0.07
369	000009	中国宝安	1,376,200	12,220,656.00	0.07
370	600765	中航重机	721,400	12,177,232.00	0.07
371	601677	明泰铝业	973,500	12,090,870.00	0.07
372	000623	吉林敖东	708,960	12,016,872.00	0.07
373	000400	许继电气	551,300	12,001,801.00	0.07
374	002841	视源股份	342,295	11,843,407.00	0.07
375	600637	东方明珠	1,570,300	11,730,141.00	0.07
376	002607	中公教育	3,814,100	11,671,146.00	0.07
377	603939	益丰药房	475,400	11,633,038.00	0.07
378	600498	烽火通信	551,200	11,591,736.00	0.07
379	002245	蔚蓝锂芯	903,400	11,590,622.00	0.07
380	601607	上海医药	642,500	11,487,900.00	0.06
381	000960	锡业股份	750,400	11,481,120.00	0.06
382	301358	湖南裕能	368,100	11,481,039.00	0.06
383	600529	山东药玻	517,100	11,448,594.00	0.06
384	300088	长信科技	1,912,261	11,397,075.56	0.06
385	300182	捷成股份	2,068,100	11,395,231.00	0.06
386	002407	多氟多	931,120	11,350,352.80	0.06
387	002409	雅克科技	207,100	11,326,299.00	0.06
388	000039	中集集团	1,438,500	11,306,610.00	0.06
389	002739	万达电影	986,899	11,280,255.57	0.06
390	600026	中远海能	1,079,600	11,152,268.00	0.06
391	688188	柏楚电子	83,675	11,016,650.50	0.06

392	601018	宁波港	3,000,800	10,982,928.00	0.06
393	300724	捷佳伟创	201,800	10,957,740.00	0.06
394	300757	罗博特科	73,000	10,947,810.00	0.06
395	300068	南都电源	685,500	10,913,160.00	0.06
396	600563	法拉电子	97,900	10,679,911.00	0.06
397	000887	中鼎股份	607,000	10,677,130.00	0.06
398	300285	国瓷材料	613,000	10,635,550.00	0.06
399	300558	贝达药业	183,100	10,610,645.00	0.06
400	600820	隧道股份	1,703,500	10,391,350.00	0.06
401	688009	中国通号	2,018,801	10,376,637.14	0.06
402	300144	宋城演艺	1,209,635	10,342,379.25	0.06
403	002497	雅化集团	904,244	10,308,381.60	0.06
404	600008	首创环保	3,408,900	10,294,878.00	0.06
405	688303	大全能源	482,514	10,287,198.48	0.06
406	603806	福斯特	792,580	10,271,836.80	0.06
407	600486	扬农化工	177,016	10,266,928.00	0.06
408	002432	九安医疗	281,300	10,247,759.00	0.06
409	002312	川发龙蟒	890,500	10,222,940.00	0.06
410	300296	利亚德	1,675,731	10,221,959.10	0.06
411	002025	航天电器	198,790	10,219,793.90	0.06
412	002064	华峰化学	1,541,900	10,191,959.00	0.06
413	600516	方大炭素	2,187,000	10,147,680.00	0.06
414	603816	顾家家居	396,500	10,118,680.00	0.06
415	603568	伟明环保	530,300	10,118,124.00	0.06
416	300763	锦浪科技	173,750	9,971,512.50	0.06
417	600998	九州通	1,935,900	9,950,526.00	0.06
418	600166	福田汽车	3,660,000	9,918,600.00	0.06
419	605358	立昂微	425,200	9,907,160.00	0.06
420	600170	上海建工	4,117,200	9,840,108.00	0.06
421	601179	中国西电	1,594,300	9,789,002.00	0.05
422	600208	衢州发展	3,300,200	9,768,592.00	0.05
423	603486	科沃斯	166,900	9,718,587.00	0.05
424	000683	博源化工	2,022,180	9,686,242.20	0.05
425	600312	平高电气	626,300	9,638,757.00	0.05
426	600323	瀚蓝环境	393,600	9,584,160.00	0.05
427	002176	江特电机	1,304,300	9,469,218.00	0.05
428	002244	滨江集团	970,400	9,461,400.00	0.05
429	601155	新城控股	691,600	9,461,088.00	0.05
430	000818	航锦科技	416,890	9,380,025.00	0.05
431	600763	通策医疗	227,096	9,374,522.88	0.05
432	601000	唐山港	2,292,000	9,305,520.00	0.05
433	000830	鲁西化工	897,500	9,244,250.00	0.05
434	600511	国药股份	314,600	9,173,736.00	0.05

435	000629	钒钛股份	3,574,500	9,150,720.00	0.05
436	603885	吉祥航空	673,700	9,074,739.00	0.05
437	300676	华大基因	182,100	9,063,117.00	0.05
438	600535	天士力	577,500	9,037,875.00	0.05
439	002603	以岭药业	639,900	9,022,590.00	0.05
440	002439	启明星辰	561,355	8,976,066.45	0.05
441	603899	晨光股份	308,900	8,955,011.00	0.05
442	000708	中信特钢	761,000	8,949,360.00	0.05
443	600499	科达制造	906,100	8,879,780.00	0.05
444	603000	人民网	436,700	8,825,707.00	0.05
445	300390	天华新能	455,940	8,694,775.80	0.05
446	601880	辽港股份	5,796,300	8,694,450.00	0.05
447	300567	精测电子	142,079	8,611,408.19	0.05
448	002145	中核钛白	2,069,195	8,587,159.25	0.05
449	600004	白云机场	929,800	8,461,180.00	0.05
450	600655	豫园股份	1,520,400	8,438,220.00	0.05
451	000563	陕国投 A	2,360,500	8,426,985.00	0.05
452	600859	王府井	606,400	8,422,896.00	0.05
453	000547	航天发展	995,600	8,363,040.00	0.05
454	600131	国网信通	471,400	8,343,780.00	0.05
455	603077	和邦生物	4,763,600	8,336,300.00	0.05
456	600754	锦江酒店	370,500	8,314,020.00	0.05
457	601966	玲珑轮胎	566,500	8,310,555.00	0.05
458	600325	华发股份	1,704,100	8,298,967.00	0.05
459	300529	健帆生物	384,576	8,295,304.32	0.05
460	002756	永兴材料	260,360	8,266,430.00	0.05
461	603613	国联股份	346,045	8,197,806.05	0.05
462	300438	鹏辉能源	294,900	8,142,189.00	0.05
463	688005	容百科技	362,903	8,099,994.96	0.05
464	300601	康泰生物	520,000	7,898,800.00	0.04
465	002544	普天科技	335,100	7,858,095.00	0.04
466	000998	隆平高科	774,600	7,629,810.00	0.04
467	600867	通化东宝	923,800	7,575,160.00	0.04
468	300070	碧水源	1,678,702	7,554,159.00	0.04
469	600667	太极实业	1,140,800	7,506,464.00	0.04
470	002120	韵达股份	1,119,661	7,501,728.70	0.04
471	601866	中远海发	3,030,000	7,484,100.00	0.04
472	603833	欧派家居	132,560	7,483,012.00	0.04
473	300457	赢合科技	321,700	7,399,100.00	0.04
474	600258	首旅酒店	521,700	7,371,621.00	0.04
475	000032	深桑达 A	363,900	7,361,697.00	0.04
476	002831	裕同科技	309,400	7,246,148.00	0.04
477	002508	老板电器	376,300	7,153,463.00	0.04

478	300751	迈为股份	101,300	7,046,428.00	0.04
479	000069	华侨城 A	3,076,700	6,922,575.00	0.04
480	600129	太极集团	323,600	6,895,916.00	0.04
481	000967	盈峰环境	986,500	6,856,175.00	0.04
482	300118	东方日升	694,400	6,652,352.00	0.04
483	002292	奥飞娱乐	677,700	6,587,244.00	0.04
484	300573	兴齐眼药	124,600	6,453,034.00	0.04
485	002572	索菲亚	453,000	6,346,530.00	0.04
486	002266	浙富控股	2,028,500	6,247,780.00	0.04
487	601636	旗滨集团	1,239,300	6,208,893.00	0.03
488	600315	上海家化	285,200	6,009,164.00	0.03
489	600864	哈投股份	976,900	5,832,093.00	0.03
490	000035	中国天楹	1,338,200	5,740,878.00	0.03
491	688063	派能科技	124,582	5,616,156.56	0.03
492	603650	彤程新材	173,800	5,587,670.00	0.03
493	002091	江苏国泰	742,500	5,397,975.00	0.03
494	300769	德方纳米	162,600	5,369,052.00	0.03
495	688390	固德威	123,174	5,351,910.30	0.03
496	002372	伟星新材	495,800	5,136,488.00	0.03
497	001914	招商积余	341,000	4,218,170.00	0.02
498	600335	国机汽车	469,700	3,029,565.00	0.02
499	600007	中国国贸	146,100	3,006,738.00	0.02
500	301381	赛维时代	87,100	1,737,645.00	0.01

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	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
2	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
3	603049	中策橡胶	724	31,023.40	0.00
4	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
5	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
6	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
7	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
8	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
9	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
10	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
11	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
12	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
13	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
14	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00

15	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
16	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
17	301585	蓝宇股份	273	9,363.90	0.00
18	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
19	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
20	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
21	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
22	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
23	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
24	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
25	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
26	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
27	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	600519	贵州茅台	513,294,465.34	2.27
2	600036	招商银行	221,525,998.29	0.98
3	601318	中国平安	215,234,167.63	0.95
4	601166	兴业银行	160,346,223.61	0.71
5	600900	长江电力	135,296,339.65	0.60
6	688041	海光信息	115,898,736.33	0.51
7	601899	紫金矿业	114,254,359.48	0.50
8	600030	中信证券	103,049,816.58	0.46
9	601398	工商银行	97,747,610.00	0.43
10	601328	交通银行	90,882,617.68	0.40
11	688981	中芯国际	87,512,388.97	0.39
12	600276	恒瑞医药	86,494,169.03	0.38
13	600887	伊利股份	76,812,553.44	0.34
14	601288	农业银行	68,091,281.00	0.30
15	601816	京沪高铁	65,591,083.48	0.29
16	600309	万华化学	61,456,250.94	0.27
17	600919	江苏银行	60,623,530.29	0.27
18	603259	药明康德	55,691,580.16	0.25
19	600000	浦发银行	53,648,197.58	0.24
20	688008	澜起科技	52,899,941.68	0.23

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	600519	贵州茅台	734,967,225.53	3.25
2	600036	招商银行	337,428,456.06	1.49
3	601318	中国平安	336,721,531.72	1.49
4	600900	长江电力	215,356,299.49	0.95
5	601166	兴业银行	189,778,936.04	0.84
6	601899	紫金矿业	175,475,096.90	0.77
7	600030	中信证券	159,632,577.64	0.70
8	601398	工商银行	151,988,140.00	0.67
9	688041	海光信息	147,948,505.35	0.65
10	600276	恒瑞医药	135,279,438.40	0.60
11	688981	中芯国际	128,761,492.95	0.57
12	600887	伊利股份	120,471,496.48	0.53
13	601328	交通银行	109,299,566.48	0.48
14	601288	农业银行	106,013,604.00	0.47
15	601816	京沪高铁	104,541,714.92	0.46
16	601988	中国银行	102,646,469.00	0.45
17	600919	江苏银行	92,671,918.90	0.41
18	600309	万华化学	87,699,799.43	0.39
19	603259	药明康德	86,504,191.52	0.38
20	600000	浦发银行	80,597,433.67	0.36

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	6,265,249,960.63
卖出股票收入（成交）总额	8,892,533,749.43

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）	324,421.33	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	324,421.33	0.00

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	123257	安克转债	3,244	324,421.33	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

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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（如有）没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

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	418,483.20
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	418,483.20

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	占基金资产净值	流通受限情况说
----	------	------	---------	---------	---------

			公允价值（元）	比例（%）	明
1	688775	影石创新	71,143.68	0.00	新股锁定期
2	688411	海博思创	46,754.40	0.00	新股锁定期
3	603049	中策橡胶	31,023.40	0.00	新股锁定期
4	688545	兴福电子	26,788.30	0.00	新股锁定期
5	301458	钧崴电子	23,911.11	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		南方中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
21,296	820,440.54	12,359,668,995.00	70.74%	1,214,544,644.00	6.95%	3,897,888,107.00	22.31%

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	中国人寿保险股份有限公司	2,154,148,132.00	12.33%
2	华泰证券股份有限公司	1,450,676,102.00	8.30%
3	国泰海通证券股份有限公司	523,183,041.00	2.99%
4	方正证券股份有限公司	423,815,090.00	2.43%
5	东方证券股份有限公司	405,073,441.00	2.32%
6	中国平安人寿保险股份有限公司－自有资金	307,376,300.00	1.76%
7	中信证券股份有限公司	243,509,531.00	1.39%
8	申万宏源证券有限公司	241,081,342.00	1.38%
9	中国平安人寿保险股份有限公司－传统－普通保险产品	188,323,713.00	1.08%
10	兴业证券股份有限公司	153,824,278.00	0.88%
11	中国工商银行股份有限公司－南方中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	3,897,888,107.00	22.31%

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(2024 年 9 月 25 日)基金份额总额	2,000,101,746.00
本报告期期初基金份额总额	22,581,101,746.00
本报告期基金总申购份额	8,688,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	13,797,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	17,472,101,746.00

§ 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，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及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。

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
银河证券	5	15,156,007,538.71	100.00%	1,514,150.32	100.00%	-

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交易单元租用协议后将其入库，并对入库的证券公司开展动态管理，定期检视其是否持续符合选择标准；

（2）基金管理人根据其建立的服务评价及交易量分配机制，定期对证券公司开展评价后，根据评价结果进行交易量的分配。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：新增交易单元：无；减少交易单元：无。

10.7.2 基金租用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

				比例		
银河证券	-	-	-	-	-	-

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	南方基金关于直销平台相关业务费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-01
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-04
3	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加华金证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-08
4	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加瑞银证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-02-20
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-20
6	南方基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2024 年度)	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31
7	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-05-14

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20250101-20250330, 20250401-	5,063,498,507.00	357,229,400.00	1,522,839,800.00	3,897,888,107.00	22.31%

		20250401, 20250407- 20250630					
--	--	------------------------------------	--	--	--	--	--

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 A500 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方中证 A500 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 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 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>