

# 中证 500 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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.....	6
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.....	13
6.3 净资产变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54

7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	54
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.....	55
§8	基金份额持有人信息.....	56
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	56
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.....	57
§10	重大事件揭示.....	57
10.1	基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
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.....	58
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.....	61
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	61
§12	备查文件目录.....	61
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	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 500ETF
场内简称	500ETF; 中证 500ETF
基金主代码	510500
交易代码	510500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	19,012,168,617.00 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	2013 年 3 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	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95599
传真	0755-82763889	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518017	100031
法定代表人	周易	谷澍

## 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	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
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	4,387,321,860.88
本期利润	6,292,890,258.80
加权平均基金份额本期利润	0.3484
本期加权平均净值利润率	6.05%
本期基金份额净值增长率	4.27%
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	54,226,141,599.17
期末可供分配基金份额利润	2.8521
期末基金资产净值	113,437,962,094.11
期末基金份额净值	5.9666
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	97.86%

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。

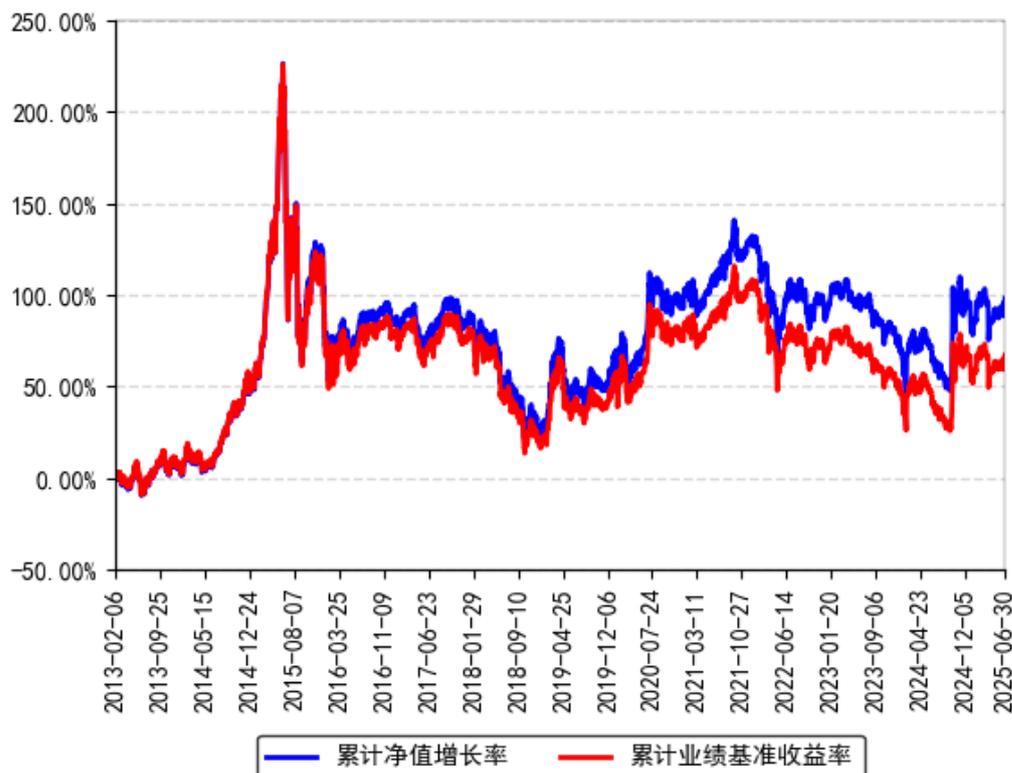
### 3.2 基金净值表现

#### 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	4.96%	0.78%	4.31%	0.79%	0.65%	-0.01%
过去三个月	1.92%	1.50%	0.98%	1.50%	0.94%	0.00%
过去六个月	4.27%	1.36%	3.31%	1.36%	0.96%	0.00%
过去一年	21.26%	1.72%	19.68%	1.72%	1.58%	0.00%
过去三年	-4.03%	1.35%	-8.35%	1.35%	4.32%	0.00%
自基金合同生效起至今	97.86%	1.57%	66.89%	1.57%	30.97%	0.00%

#### 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500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日	-	20 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月 17 日至 2015 年 6 月 16 日，任南方策略基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2019 年 4 月 18 日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 3 月 27 日，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至 2020 年 3 月 27 日，任南方 H 股联接基金经理；2014 年 10 月 30 日至 2020 年 12 月 23 日，任 500 医药基金经理；2021 年 3 月 12 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理；2021 年 10 月 22 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证全指医疗保健 ETF 基金经理；2020 年 12 月 25 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方策略基金经理；2021 年 7 月 2 日至 2023 年 8 月 25 日，任南

				<p>方中证香港科技 ETF (QDII) 基金经理 2022 年 6 月 17 日至 2023 年 8 月 25 日, 任南方恒生香港上市生物科技 ETF (QDII) 基金经理; 2023 年 5 月 30 日至 2024 年 7 月 5 日, 任南方恒生香港上市生物科技 ETF 发起联接 (QDII) 基金经理; 2013 年 4 月 22 日至今, 任南方 500、南方 500ETF 基金经理; 2013 年 5 月 17 日至今, 任南方 300、南方 300 联接基金经理; 2015 年 2 月 16 日至今, 任南方恒生 ETF 基金经理; 2017 年 7 月 21 日至今, 任恒生联接基金经理; 2017 年 8 月 24 日至今, 任南方房地产联接基金经理; 2017 年 8 月 25 日至今, 任南方房地产 ETF 基金经理; 2018 年 4 月 3 日至今, 任 MSCI 基金基金经理; 2018 年 6 月 8 日至今, 任 MSCI 联接基金经理; 2020 年 7 月 24 日至今, 兼任投资经理; 2024 年 6 月 26 日至今, 任南方中证国新港股通央企红利 ETF 基金经理; 2024 年 7 月 5 日至今, 任南方基金南方东英沙特阿拉伯 ETF (QDII) 基金经理; 2024 年 9 月 12 日至今, 任南方中证国新港股通央企红利 ETF 发起联接基金经理; 2024 年 11 月 4 日至今, 任南方中证沪深港黄金产业股票指数发起基金经理 2025 年 6 月 30 至今, 任南方中证港股通科技 ETF 基金经理。</p>
--	--	--	--	---

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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
罗文杰	公募基金	15	140,860,018,590.56	2013 年 04 月 22 日
	私募资产管理计划	6	66,838,671.82	2020 年 08 月 07 日
	其他组合	-	-	-
	合计	21	140,926,857,262.38	-

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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

报告期内，中证 500 指数涨 3.31%。中证 500 是 A 股市场核心中盘股指数，随着 A 股市场扩容与成分股市值增长，中证 500 总市值不断扩大，目前已增长至约 14 万亿元，流通市值约 7 万亿元。成分股总市值中位数从 2010 年的 60 多亿元增长至目前的 256 多亿元。随着中国经济转型发展和 A 股市场的变迁，中证 500 的行业构成不断迭代，房地产、基础化工等传统行业权重逐渐下滑，而医药生物、电子、电力设备等新兴行业权重逐渐占据主导地位。现下指数仍被大幅低估，具有较高的安全边际。

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) 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；

(2) 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；

(3) 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。

#### 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 5.9666 元，报告期内，份额净值增长率为 4.27%，同期业绩基准增长率为 3.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中证 500 是 A 股市场核心中盘股指数，随着 A 股市场扩容与成分股市值增长，中证 500 总市值不断扩大，目前已增长至约 14 万亿元，自由流通市值约 7 万亿元。2025 年上半年国内经济整体平稳回暖，经济新旧动能转换，产业结构持续分化。4 月政治局会议召开，定调经济政策方向，强调抓紧落实存量政策，研究和储备增量政策，7 月初中央财经会议释放了“反内卷”政策信号，及城市更新方案，推动经济结构优化与高质量发展。相比而言，美国多项经济数据开始出现不及市场预期的情况，且特朗普政策信号较为混乱，随着国内经济逐步复苏回暖及流动性的改善，中小盘股盈利有望见底回升。而指数仍被大幅低估，具有较高的安全边际。

#### 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

本报告期内本基金进行了收益分配，符合法律法规和基金合同约定。具体如下：  
权益登记日 2025 年 1 月 15 日，每 10 份基金份额分红数 0.9100。

#### 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司本报告期基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

### § 6 中期财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：中证 500 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	81,659,058.05	105,789,664.10
结算备付金		3,556,728,384.30	2,343,018,601.70
存出保证金		509,612,341.31	353,320,600.95
交易性金融资产	6.4.3.2	109,370,381,759.08	99,010,993,900.01
其中：股票投资		109,370,381,759.08	99,010,993,900.01
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
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		49,794,179.22	117,233,260.59
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		113,568,175,721.96	101,930,356,027.35
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		-	4,141,695.38
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		13,751,528.80	13,836,571.02
应付托管费		4,583,842.93	4,612,190.34
应付销售服务费		-	-

应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	3,399,904.04
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	111,878,256.12	154,619,597.68
负债合计		130,213,627.85	180,609,958.46
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	59,211,820,494.94	54,479,152,465.75
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	54,226,141,599.17	47,270,593,603.14
净资产合计		113,437,962,094.11	101,749,746,068.89
负债和净资产总计		113,568,175,721.96	101,930,356,027.35

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 5.9666 元，基金份额总额 19,012,168,617.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中证 500 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	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		6,402,618,195.75	-1,461,500,129.72
1.利息收入		17,556,746.13	52,387,903.65
其中：存款利息收入	6.4.3.9	16,548,095.81	15,154,825.71
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		1,008,650.32	-
其他利息收入		-	37,233,077.94
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,479,628,956.70	261,375,883.98
其中：股票投资收益	6.4.3.10	3,559,791,105.78	-630,956,921.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	6,438,277.36	2,996,181.63
资产支持证券投资	6.4.3.12	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.13	-112,793,530.16	-38,159,321.52
股利收益	6.4.3.14	1,026,193,103.72	927,495,944.91

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	1,905,568,397.92	-2,004,468,665.46
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-135,905.00	229,204,748.11
减：二、营业总支出		109,727,936.95	215,723,690.50
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	77,311,874.99	170,947,951.70
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.6.2.2	25,770,625.00	34,189,590.38
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		13.30	134,047.48
8.其他费用	6.4.3.17	6,645,423.66	10,452,100.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,292,890,258.80	-1,677,223,820.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,292,890,258.80	-1,677,223,820.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,292,890,258.80	-1,677,223,820.22

### 6.3 净资产变动表

会计主体：中证 500 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	54,479,152,465.75	-	47,270,593,603.14	101,749,746,068.89
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更	-	-	-	-

正				
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	54,479,152,465.75	-	47,270,593,603.14	101,749,746,068.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,732,668,029.19	-	6,955,547,996.03	11,688,216,025.22
（一）、综合收益总额	-	-	6,292,890,258.80	6,292,890,258.80
（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）	4,732,668,029.19	-	2,264,964,774.04	6,997,632,803.23
其中：1.基金申购款	31,317,331,244.01	-	25,127,201,433.27	56,444,532,677.28
2.基金赎回款	-26,584,663,214.82	-	-22,862,236,659.23	-49,446,899,874.05
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-1,602,307,036.81	-1,602,307,036.81
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	59,211,820,494.94	-	54,226,141,599.17	113,437,962,094.11
项目	上年度可比期间 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	26,355,967,254.27	-	20,392,259,204.99	46,748,226,459.26
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	26,355,967,254.27	-	20,392,259,204.99	46,748,226,459.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	19,655,708,351.90	-	7,487,888,179.80	27,143,596,531.70
（一）、综合收益	-	-	-1,677,223,820.2	-1,677,223,820.2

总额			2	2
(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)	19,655,708,351.9 0	-	10,371,503,599.3 0	30,027,211,951.2 0
其中：1.基金申购款	46,941,738,259.1 7	-	30,007,845,145.5 6	76,949,583,404.7 3
2.基金赎回款	-27,286,029,907. 27	-	-19,636,341,546. 26	-46,922,371,453. 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)	-	-	-1,206,391,599.2 8	-1,206,391,599.2 8
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	46,011,675,606.1 7	-	27,880,147,384.7 9	73,891,822,990.9 6

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	81,659,058.05
等于：本金	81,613,782.21
加：应计利息	45,275.84
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	81,659,058.05

### 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	102,869,979,311.29	-	109,370,381,759.08	6,500,402,447.79
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	102,869,979,311.29	-	109,370,381,759.08	6,500,402,447.79

### 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	3,819,825,094.43	-	-	-
-股指期货	3,819,825,094.43	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,819,825,094.43	-	-	-

#### 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
IC2507	IC2507	204.00	239,389,920.00	7,694,065.57
IC2509	IC2509	3,307.00	3,820,114,120.00	231,984,880.00
合计				239,678,945.57
减：可抵销期货暂收款				239,678,945.57
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	5,482,669.78

其中：交易所市场	5,482,669.78
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	106,296,097.88
预提费用	99,178.95
应付指数使用费	-
可退替代款	309.51
合计	111,878,256.12

### 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	17,492,568,617.00	54,479,152,465.75
本期申购	10,055,600,000.00	31,317,331,244.01
本期赎回（以“-”号填列）	-8,536,000,000.00	-26,584,663,214.82
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	19,012,168,617.00	59,211,820,494.94

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	105,323,809,135.72	-58,053,215,532.58	47,270,593,603.14
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	105,323,809,135.72	-58,053,215,532.58	47,270,593,603.14
本期利润	4,387,321,860.88	1,905,568,397.92	6,292,890,258.80
本期基金份额交易产生的变动数	9,258,569,756.62	-6,993,604,982.58	2,264,964,774.04
其中：基金申购款	60,754,027,734.79	-35,626,826,301.52	25,127,201,433.27
基金赎回款	-51,495,457,978.17	28,633,221,318.94	-22,862,236,659.23
本期已分配利润	-1,602,307,036.81	-	-1,602,307,036.81
本期末	117,367,393,716.41	-63,141,252,117.24	54,226,141,599.17

### 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	1,557,919.97
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	14,942,565.45
其他	47,610.39
合计	16,548,095.81

### 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	2,514,864,044.04
股票投资收益——赎回差价收入	1,044,927,061.74
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	3,559,791,105.78

#### 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	41,306,884,706.24
减：卖出股票成本总额	38,757,401,593.97
减：交易费用	34,619,068.23
买卖股票差价收入	2,514,864,044.04

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	49,446,899,874.05
减：现金支付赎回款总额	24,680,860,248.05
减：赎回股票成本总额	23,721,112,564.26
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,044,927,061.74

### 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	3,696.08
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券	6,434,581.28

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	6,438,277.36

#### 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	45,781,319.39
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	39,341,100.00
减：应计利息总额	3,806.93
减：交易费用	1,831.18
买卖债券差价收入	6,434,581.28

注：上述交易费用(如有)包含债券买卖产生的交易费用。

#### 6.4.3.12 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	-112,793,530.16

#### 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	1,026,193,103.72
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	1,026,193,103.72

#### 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	1,529,292,683.30

——股票投资	1,529,292,683.30
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	376,275,714.62
——权证投资	-
——期货投资	376,275,714.62
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,905,568,397.92

#### 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	-135,905.00
合计	-135,905.00

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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	6,469,823.83
银行费用	40,314.85
其他	36,106.03
合计	6,645,423.66

#### 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

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。

#### 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
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	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
南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)("南方中证 500ETF 联接基金")	本基金的基金管理人管理的其他基金
华泰联合证券有限责任公司("华泰联合")	基金管理人的股东华泰证券控制的公司

注: 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	12,369,665,194.99	14.53%	74,009,409,771.71	86.28%

###### 6.4.6.1.2 债券交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	-	1,051,393.20	7.70%

###### 6.4.6.1.3 债券回购交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华泰证券	1,100,000,000.00	68.75%	-	-

#### 6.4.6.1.4 权证交易

无。

#### 6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	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	1,236,922.39	14.53%	1,129,004.66	20.59%
关联方名称	上年度可比期间 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	7,401,850.47	86.28%	3,421,936.03	79.80%

注：1. 上述佣金费率参考市场价格确定。

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

#### 6.4.6.2 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	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	77,311,874.99	170,947,951.70
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,177,801.99	-
应支付基金管理人的净管理费	75,134,073.00	170,947,951.70

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。

自 2024 年 11 月 20 日起本基金管理费年费率由 0.50% 调整为 0.15%。

### 6.4.6.2 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	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	25,770,625.00	34,189,590.38

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。

自 2024 年 11 月 20 日起本基金托管费年费率由 0.10% 调整为 0.05%。

### 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

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	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-

上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	20,713,927,528.00	1~4.3	1.05	9,982,043.62	489,297,506.00	124,401.89

### 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 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	11,314,215.00	0.06%	29,036,451.00	0.17%
兴业证券股份有限公司	610,785.00	0.00%	48,009,322.00	0.27%
中国农业银行—南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	1,352,154,181.00	7.11%	1,436,259,408.00	8.21%

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		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
中国农业银行	81,659,058.05	1,557,919.97	122,336,531.06	2,739,983.73

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	127108	太能转债	配债	266,319	26,631,900.00
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

上年度可比期间 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	688709	成都华微	网下申购	10,448	163,929.12

华泰联合	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
华泰联合	301587	中瑞股份	网下申购	3,056	66,406.88
兴业证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 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

单位：人民币元

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2025 年 1 月 15 日	2025 年 1 月 16 日	-	0.9100	1,602,307,036.81	-	1,602,307,036.81	-
合计	-	-	-	0.9100	1,602,307,036.81	-	1,602,307,036.81	-

#### 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
688521	芯原股份	2025 年 2 月 27 日	6 个月	大宗受限锁定	74.42	92.14	600,000	44,652,000.00	55,284,000.00	-
688521	芯原股份	2025 年 3 月 4 日	6 个月	大宗受限锁定	80.77	91.91	600,000	48,462,000.00	55,146,000.00	-
688521	芯原股份	2025 年 3 月 5 日	6 个月	大宗受限锁定	87.82	91.89	600,000	52,692,000.00	55,134,000.00	-
603228	景旺电子	2025 年 6 月 27 日	6 个月	大宗受限锁定	33.01	37.63	1,515,000	50,010,150.00	57,009,450.00	-
603228	景旺电子	2025 年 6 月	6 个月	大宗受限锁定	35.76	37.59	1,390,000	49,706,400.00	52,250,100.00	-

		30 日								
300383	光环新网	2025 年 6 月 3 日	6 个月	大宗受限锁定	11.59	12.82	4,315,000	50,010,850.00	55,318,300.00	-
300383	光环新网	2025 年 5 月 20 日	6 个月	大宗受限锁定	12.56	12.96	1,600,000	20,096,000.00	20,736,000.00	-
001696	宗申动力	2025 年 6 月 9 日	6 个月	大宗受限锁定	20.30	20.82	3,450,000	70,035,000.00	71,829,000.00	-
688234	天岳先进	2025 年 1 月 14 日	6 个月	大宗受限锁定	50.18	57.93	798,000	40,043,640.00	46,228,140.00	-
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	109	-	4,928.98	-
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	-

#### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股票 名称	停牌日期	停牌 原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌开 盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天 3	2023 年 8 月 30 日	暂停 转让	0.14	-	-	18,775,114	31,284,231.12	2,628,515.96	-

#### 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 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。本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 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之内。

#### 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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，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、流通受限限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的 15%。于本期末，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 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	81,659,058.05	-	-	-	81,659,058.05
结算备付金	3,556,728,384.30	-	-	-	3,556,728,384.30
存出保证金	22,471,856.51	-	-	487,140,484.80	509,612,341.31
交易性金融资产	-	-	-	109,370,381,759.08	109,370,381,759.08
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	-	-	-	49,794,179.22	49,794,179.22
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,660,859,29	-	-	109,907,316,	113,568,175,

	8.86			423.10	721.96
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融 负债	-	-	-	-	-
衍生金融负 债	-	-	-	-	-
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	13,751,528.8 0	13,751,528.8 0
应付托管费	-	-	-	4,583,842.93	4,583,842.93
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	-	-	-	111,878,256. 12	111,878,256. 12
负债总计	-	-	-	130,213,627. 85	130,213,627. 85
利率敏感度 缺口	3,660,859,29 8.86	-	-	109,777,102, 795.25	113,437,962, 094.11
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	105,789,664. 10	-	-	-	105,789,664. 10
结算备付金	2,343,018,60 1.70	-	-	-	2,343,018,60 1.70
存出保证金	25,653,136.9 5	-	-	327,667,464. 00	353,320,600. 95
交易性金融 资产	-	-	-	99,010,993,9 00.01	99,010,993,9 00.01
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	-	-	-	117,233,260.59	117,233,260.59
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,474,461,402.75	-	-	99,455,894,624.60	101,930,356,027.35
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	4,141,695.38	4,141,695.38
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	13,836,571.02	13,836,571.02
应付托管费	-	-	-	4,612,190.34	4,612,190.34
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3,399,904.04	3,399,904.04
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	154,619,597.68	154,619,597.68
负债总计	-	-	-	180,609,958.46	180,609,958.46
利率敏感度缺口	2,474,461,402.75	-	-	99,275,284,666.14	101,749,746,068.89

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	109,370,381,759.08	96.41	99,010,993,900.01	97.31
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	109,370,381,759.08	96.41	99,010,993,900.01	97.31

#### 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%	5,641,983,915.49	5,057,215,823.85
2.组合自身基准下降 5%	-5,641,983,915.49	-5,057,215,823.85	

#### 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	108,898,403,190.59
第二层次	15,385.54
第三层次	471,963,182.95
合计	109,370,381,759.08

###### 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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	109,370,381,759.08	96.30
	其中：股票	109,370,381,759.08	96.30
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	3,638,387,442.35	3.20
8	其他各项资产	559,406,520.53	0.49
9	合计	113,568,175,721.96	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	272,132,026.20	0.24
B	采矿业	3,907,882,410.09	3.44
C	制造业	69,284,583,547.18	61.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,524,571,630.77	3.11
E	建筑业	964,049,085.63	0.85

F	批发和零售业	2,398,626,269.81	2.11
G	交通运输、仓储和邮政业	1,815,761,159.60	1.60
H	住宿和餐饮业	292,639,510.83	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,139,808,125.52	8.94
J	金融业	10,750,682,558.69	9.48
K	房地产业	1,353,409,371.28	1.19
L	租赁和商务服务业	938,443,359.40	0.83
M	科学研究和技术服务业	742,215,309.91	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	458,532,352.42	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	225,372,586.32	0.20
Q	卫生和社会工作	504,195,293.48	0.44
R	文化、体育和娱乐业	1,534,554,267.09	1.35
S	综合	259,879,316.37	0.23
	合计	109,367,338,180.59	96.41

### 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	401,158.69	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	2,628,515.96	0.00
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	3,043,578.49	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	300476	胜宏科技	8,970,530	1,205,459,821.40	1.06
2	000988	华工科技	14,942,912	702,466,293.12	0.62
3	600988	赤峰黄金	24,730,339	615,290,834.32	0.54
4	300339	润和软件	11,802,924	599,942,626.92	0.53
5	002966	苏州银行	66,401,323	583,003,615.94	0.51
6	600839	四川长虹	54,840,320	533,047,910.40	0.47
7	601162	天风证券	105,459,770	519,916,666.10	0.46
8	601555	东吴证券	59,015,012	516,381,355.00	0.46
9	689009	九号公司	8,532,221	504,851,516.57	0.45
10	688521	芯原股份	5,256,511	499,117,311.50	0.44
11	002517	恺英网络	25,349,413	489,497,165.03	0.43
12	002340	格林美	76,089,570	483,168,769.50	0.43
13	002195	岩山科技	84,335,326	474,807,885.38	0.42
14	002558	巨人网络	20,141,800	474,339,390.00	0.42
15	603893	瑞芯微	3,099,908	470,752,028.88	0.41
16	002261	拓维信息	14,957,874	462,946,200.30	0.41
17	002156	通富微电	18,022,677	461,740,984.74	0.41
18	600487	亨通光电	29,334,784	448,822,195.20	0.40
19	600157	永泰能源	329,913,364	442,083,907.76	0.39
20	002797	第一创业	62,371,089	441,587,310.12	0.39
21	300251	光线传媒	21,766,128	441,199,414.56	0.39
22	300207	欣旺达	21,911,998	439,554,679.88	0.39
23	688608	恒玄科技	1,261,248	438,889,079.04	0.39
24	300803	指南针	5,335,185	430,336,022.10	0.38
25	000066	中国长城	28,798,986	426,224,992.80	0.38
26	688777	中控技术	9,394,094	421,888,761.54	0.37
27	688213	思特威	4,111,034	420,229,895.48	0.37
28	688120	华海清科	2,486,717	419,509,157.90	0.37
29	600096	云天化	18,959,747	416,545,641.59	0.37
30	601168	西部矿业	24,845,944	413,188,048.72	0.36
31	600536	中国软件	8,829,901	412,974,469.77	0.36
32	002273	水晶光电	20,618,043	411,742,318.71	0.36
33	002465	海格通信	29,445,798	410,474,424.12	0.36
34	600879	航天电子	39,164,061	410,047,718.67	0.36

35	300450	先导智能	16,269,052	404,285,942.20	0.36
36	688235	百济神州	1,725,921	403,244,182.44	0.36
37	000831	中国稀土	11,066,340	399,716,200.80	0.35
38	601099	太平洋	101,223,237	397,807,321.41	0.35
39	600352	浙江龙盛	38,601,724	392,193,515.84	0.35
40	002294	信立泰	8,261,390	391,011,588.70	0.34
41	300017	网宿科技	36,310,898	389,252,826.56	0.34
42	000933	神火股份	23,374,316	388,948,618.24	0.34
43	600885	宏发股份	17,323,436	386,485,857.16	0.34
44	002185	华天科技	38,150,466	385,319,706.60	0.34
45	601108	财通证券	48,231,455	381,510,809.05	0.34
46	688617	惠泰医疗	1,268,391	376,712,127.00	0.33
47	688002	睿创微纳	5,368,387	374,283,941.64	0.33
48	601128	常熟银行	49,226,417	362,798,693.29	0.32
49	002130	沃尔核材	14,968,606	356,552,194.92	0.31
50	601577	长沙银行	35,815,311	356,004,191.34	0.31
51	600079	人福医药	16,942,008	355,443,327.84	0.31
52	002281	光迅科技	7,163,278	353,292,870.96	0.31
53	002595	豪迈科技	5,963,453	353,155,686.66	0.31
54	300454	深信服	3,748,130	352,998,883.40	0.31
55	688099	晶晨股份	4,948,703	351,407,400.03	0.31
56	002085	万丰奥威	22,058,500	350,509,565.00	0.31
57	688469	芯联集成	73,421,623	350,221,141.71	0.31
58	000423	东阿阿胶	6,679,665	349,346,479.50	0.31
59	688122	西部超导	6,720,623	348,665,921.24	0.31
60	000997	新大陆	10,755,804	348,272,933.52	0.31
61	300223	北京君正	5,023,245	347,608,554.00	0.31
62	603129	春风动力	1,603,101	347,071,366.50	0.31
63	002738	中矿资源	10,740,643	345,419,078.88	0.30
64	002532	天山铝业	41,463,300	344,560,023.00	0.30
65	300058	蓝色光标	52,492,432	344,350,353.92	0.30
66	300002	神州泰岳	29,162,200	344,113,960.00	0.30
67	000783	长江证券	49,250,865	341,308,494.45	0.30
68	300474	景嘉微	4,656,760	339,943,480.00	0.30
69	300458	全志科技	8,563,488	339,884,838.72	0.30
70	600109	国金证券	38,587,548	338,412,795.96	0.30
71	002472	双环传动	10,086,100	337,783,489.00	0.30
72	002138	顺络电子	11,942,045	335,810,305.40	0.30
73	002078	太阳纸业	24,852,205	334,510,679.30	0.29
74	603596	伯特利	6,334,529	333,766,333.01	0.29
75	002436	兴森科技	25,046,810	331,619,764.40	0.29
76	601933	永辉超市	67,356,735	330,048,001.50	0.29
77	002410	广联达	24,519,240	328,803,008.40	0.29

78	300765	新诺威	6,286,476	324,947,944.44	0.29
79	300346	南大光电	10,267,882	324,875,786.48	0.29
80	002851	麦格米特	6,474,750	324,643,965.00	0.29
81	600862	中航高科	12,392,849	323,205,501.92	0.28
82	688072	拓荆科技	2,100,522	322,871,236.62	0.28
83	600143	金发科技	31,308,946	322,795,233.26	0.28
84	300136	信维通信	14,394,400	322,434,560.00	0.28
85	601198	东兴证券	28,857,452	321,760,589.80	0.28
86	688525	佰维存储	4,761,216	320,905,958.40	0.28
87	002065	东华软件	33,401,718	320,656,492.80	0.28
88	600580	卧龙电驱	16,205,640	320,385,502.80	0.28
89	002353	杰瑞股份	9,121,249	319,243,715.00	0.28
90	002850	科达利	2,820,413	319,186,139.21	0.28
91	300024	机器人	18,573,306	319,089,397.08	0.28
92	300395	菲利华	6,232,580	318,484,838.00	0.28
93	300054	鼎龙股份	11,100,565	318,364,204.20	0.28
94	603606	东方电缆	6,156,340	318,344,341.40	0.28
95	002223	鱼跃医疗	8,933,216	318,022,489.60	0.28
96	000034	神州数码	8,437,508	317,587,801.12	0.28
97	600298	安琪酵母	9,021,280	317,278,417.60	0.28
98	600873	梅花生物	29,647,721	316,934,137.49	0.28
99	600363	联创光电	5,402,793	315,144,915.69	0.28
100	002202	金风科技	30,728,894	314,971,163.50	0.28
101	688578	艾力斯	3,378,778	314,361,505.12	0.28
102	002673	西部证券	39,796,587	313,597,105.56	0.28
103	300496	中科创达	5,469,391	312,958,553.02	0.28
104	601615	明阳智能	26,958,275	309,750,579.75	0.27
105	000728	国元证券	38,837,352	306,426,707.28	0.27
106	002624	完美世界	20,196,897	306,386,927.49	0.27
107	300857	协创数据	3,552,000	305,685,120.00	0.27
108	300383	光环新网	21,952,755	305,394,196.50	0.27
109	002008	大族激光	12,481,786	304,181,124.82	0.27
110	000021	深科技	16,168,539	302,998,420.86	0.27
111	300115	长盈精密	14,090,021	301,526,449.40	0.27
112	603659	璞泰来	15,853,655	297,731,640.90	0.26
113	600549	厦门钨业	14,161,982	296,268,663.44	0.26
114	600895	张江高科	11,458,913	294,494,064.10	0.26
115	603087	甘李药业	5,368,708	294,097,824.24	0.26
116	688220	翱捷科技	3,755,366	294,045,157.80	0.26
117	603160	汇顶科技	4,119,841	292,632,306.23	0.26
118	300604	长川科技	6,510,144	292,370,567.04	0.26
119	603605	珀莱雅	3,523,723	291,729,027.17	0.26
120	000426	兴业银锡	18,462,300	291,704,340.00	0.26

121	300012	华测检测	24,944,500	291,601,205.00	0.26
122	002155	湖南黄金	16,233,080	289,760,478.00	0.26
123	603228	景旺电子	7,204,330	289,143,517.20	0.25
124	000733	振华科技	5,768,800	288,728,440.00	0.25
125	600171	上海贝岭	8,402,446	287,783,775.50	0.25
126	300627	华测导航	8,120,490	284,217,150.00	0.25
127	688361	中科飞测	3,364,752	283,278,470.88	0.25
128	605589	圣泉集团	10,056,852	279,077,643.00	0.25
129	601216	君正集团	50,086,590	276,477,976.80	0.24
130	600392	盛和资源	20,785,608	273,746,457.36	0.24
131	000750	国海证券	66,376,776	273,472,317.12	0.24
132	601665	齐鲁银行	43,230,776	273,218,504.32	0.24
133	300699	光威复材	8,620,218	273,002,304.06	0.24
134	300037	新宙邦	7,753,662	272,928,902.40	0.24
135	002444	巨星科技	10,679,244	272,427,514.44	0.24
136	601997	贵阳银行	43,391,042	270,760,102.08	0.24
137	000519	中兵红箭	12,367,576	270,726,238.64	0.24
138	000729	燕京啤酒	20,920,004	270,495,651.72	0.24
139	688180	君实生物	7,959,893	270,477,164.14	0.24
140	000932	华菱钢铁	61,466,216	270,451,350.40	0.24
141	300003	乐普医疗	19,559,240	269,526,327.20	0.24
142	600153	建发股份	25,804,204	267,589,595.48	0.24
143	600060	海信视像	11,597,803	266,981,425.06	0.24
144	601990	南京证券	32,963,195	266,342,615.60	0.23
145	601717	中创智领	16,018,183	266,222,201.46	0.23
146	300073	当升科技	6,043,549	265,130,494.63	0.23
147	601233	桐昆股份	24,987,749	264,870,139.40	0.23
148	601696	中银证券	24,751,448	264,592,979.12	0.23
149	000878	云南铜业	20,762,865	264,103,642.80	0.23
150	300001	特锐德	10,995,421	263,560,241.37	0.23
151	688052	纳芯微	1,507,312	263,010,870.88	0.23
152	300142	沃森生物	23,812,189	261,934,079.00	0.23
153	002821	凯莱英	2,958,261	261,066,533.25	0.23
154	600673	东阳光	22,345,599	259,879,316.37	0.23
155	002414	高德红外	25,295,920	259,283,180.00	0.23
156	603979	金诚信	5,572,553	258,789,361.32	0.23
157	600369	西南证券	59,197,898	257,510,856.30	0.23
158	002837	英维克	8,613,976	255,921,226.96	0.23
159	600699	均胜电子	14,658,057	255,636,514.08	0.23
160	002007	华兰生物	16,271,491	254,974,263.97	0.22
161	688027	国盾量子	926,315	254,745,888.15	0.22
162	300373	扬杰科技	4,845,759	251,494,892.10	0.22
163	688065	凯赛生物	5,327,416	250,921,293.60	0.22

164	600118	中国卫星	8,760,891	250,298,655.87	0.22
165	600177	雅戈尔	34,286,057	250,288,216.10	0.22
166	600521	华海药业	13,417,628	249,970,409.64	0.22
167	002152	广电运通	18,524,673	248,971,605.12	0.22
168	600398	海澜之家	35,617,727	247,899,379.92	0.22
169	000893	亚钾国际	8,216,476	247,644,586.64	0.22
170	600704	物产中大	46,478,505	244,941,721.35	0.22
171	603345	安井食品	3,036,987	244,234,494.54	0.22
172	600435	北方导航	15,639,114	243,813,787.26	0.21
173	300748	金力永磁	10,216,023	243,549,988.32	0.21
174	600909	华安证券	41,696,729	243,091,930.07	0.21
175	000738	航发控制	11,669,462	242,141,336.50	0.21
176	600316	洪都航空	6,420,762	242,062,727.40	0.21
177	000623	吉林敖东	14,247,890	241,501,735.50	0.21
178	688249	晶合集成	11,871,370	240,632,669.90	0.21
179	002044	美年健康	46,691,963	239,996,689.82	0.21
180	600497	驰宏锌锗	45,326,994	239,779,798.26	0.21
181	603179	新泉股份	5,071,195	238,194,029.15	0.21
182	002958	青农商行	65,938,600	238,038,346.00	0.21
183	002318	久立特材	10,174,500	237,981,555.00	0.21
184	000009	中国宝安	26,778,950	237,797,076.00	0.21
185	600038	中直股份	6,100,394	236,756,291.14	0.21
186	600765	中航重机	14,020,623	236,668,116.24	0.21
187	600141	兴发集团	11,451,453	235,098,330.09	0.21
188	688385	复旦微电	4,723,629	232,733,200.83	0.21
189	002409	雅克科技	4,228,683	231,266,673.27	0.20
190	600562	国睿科技	7,343,589	231,249,617.61	0.20
191	000400	许继电气	10,609,509	230,969,010.93	0.20
192	600155	华创云信	33,137,864	230,639,533.44	0.20
193	000528	柳工	23,977,753	230,426,206.33	0.20
194	001696	宗申动力	10,486,261	229,793,059.45	0.20
195	688188	柏楚电子	1,745,149	229,766,317.34	0.20
196	002683	广东宏大	6,755,464	229,280,448.16	0.20
197	300919	中伟股份	6,940,595	228,206,763.60	0.20
198	300757	罗博特科	1,510,203	226,485,143.91	0.20
199	002607	中公教育	73,651,172	225,372,586.32	0.20
200	000960	锡业股份	14,678,793	224,585,532.90	0.20
201	300724	捷佳伟创	4,118,351	223,626,459.30	0.20
202	600637	东方明珠	29,915,413	223,468,135.11	0.20
203	600498	烽火通信	10,562,406	222,127,398.18	0.20
204	600884	杉杉股份	23,356,755	220,954,902.30	0.19
205	300623	捷捷微电	7,381,372	219,964,885.60	0.19
206	603939	益丰药房	8,985,758	219,881,498.26	0.19

207	600529	山东药玻	9,855,214	218,194,437.96	0.19
208	300558	贝达药业	3,747,404	217,162,061.80	0.19
209	002841	视源股份	6,227,851	215,483,644.60	0.19
210	002739	万达电影	18,818,718	215,097,946.74	0.19
211	600563	法拉电子	1,971,242	215,042,789.78	0.19
212	000039	中集集团	27,336,566	214,865,408.76	0.19
213	688568	中科星图	5,960,590	214,640,845.90	0.19
214	000415	渤海租赁	64,221,000	213,855,930.00	0.19
215	002653	海思科	4,996,012	210,931,626.64	0.19
216	002926	华西证券	23,474,776	209,864,497.44	0.19
217	301358	湖南裕能	6,727,894	209,843,013.86	0.18
218	600486	扬农化工	3,603,749	209,017,442.00	0.18
219	002025	航天电器	4,056,100	208,524,101.00	0.18
220	600901	江苏金租	34,365,089	208,252,439.34	0.18
221	002385	大北农	51,069,729	206,321,705.16	0.18
222	000887	中鼎股份	11,715,129	206,069,119.11	0.18
223	688017	绿的谐波	1,649,968	206,064,503.52	0.18
224	300285	国瓷材料	11,797,531	204,687,162.85	0.18
225	688114	华大智造	3,146,703	204,000,755.49	0.18
226	688582	芯动联科	3,027,333	203,436,777.60	0.18
227	300763	锦浪科技	3,537,243	203,002,375.77	0.18
228	002939	长城证券	24,009,770	201,201,872.60	0.18
229	300144	宋城演艺	23,455,320	200,542,986.00	0.18
230	600820	隧道股份	32,810,521	200,144,178.10	0.18
231	300679	电连技术	4,398,736	199,614,639.68	0.18
232	600863	内蒙华电	48,360,724	198,762,575.64	0.18
233	002568	百润股份	7,758,724	198,700,921.64	0.18
234	600008	首创环保	65,647,937	198,256,769.74	0.17
235	603486	科沃斯	3,394,703	197,673,555.69	0.17
236	000723	美锦能源	45,750,666	197,642,877.12	0.17
237	600132	重庆啤酒	3,585,818	197,578,571.80	0.17
238	600390	五矿资本	33,479,300	195,184,319.00	0.17
239	600516	方大炭素	42,025,821	194,999,809.44	0.17
240	002064	华峰化学	29,460,676	194,735,068.36	0.17
241	000513	丽珠集团	5,390,601	194,277,260.04	0.17
242	002080	中材科技	9,960,631	194,232,304.50	0.17
243	603568	伟明环保	10,137,530	193,424,072.40	0.17
244	002312	川发龙蟒	16,826,565	193,168,966.20	0.17
245	600998	九州通	37,578,312	193,152,523.68	0.17
246	000703	恒逸石化	32,791,500	192,814,020.00	0.17
247	600763	通策医疗	4,670,830	192,811,862.40	0.17
248	688538	和辉光电	82,110,925	192,139,564.50	0.17
249	600166	福田汽车	70,540,104	191,163,681.84	0.17

250	600170	上海建工	79,484,899	189,968,908.61	0.17
251	300487	蓝晓科技	3,763,284	189,293,185.20	0.17
252	688183	生益电子	3,686,939	188,771,276.80	0.17
253	600208	衢州发展	63,576,909	188,187,650.64	0.17
254	002262	恩华药业	9,051,672	188,093,744.16	0.17
255	002500	山西证券	32,155,417	187,787,635.28	0.17
256	601179	中国西电	30,440,117	186,902,318.38	0.16
257	603816	顾家家居	7,308,938	186,524,097.76	0.16
258	603589	口子窖	5,356,869	186,419,041.20	0.16
259	300676	华大基因	3,727,400	185,512,698.00	0.16
260	600312	平高电气	12,047,084	185,404,622.76	0.16
261	000683	博源化工	38,671,900	185,238,401.00	0.16
262	605358	立昂微	7,946,080	185,143,664.00	0.16
263	601155	新城控股	13,500,523	184,687,154.64	0.16
264	002203	海亮股份	17,803,980	183,737,073.60	0.16
265	600021	上海电力	20,902,766	183,735,313.14	0.16
266	600985	淮北矿业	15,983,313	181,250,769.42	0.16
267	002244	滨江集团	18,564,895	181,007,726.25	0.16
268	600126	杭钢股份	20,041,590	180,374,310.00	0.16
269	600583	海油工程	32,946,756	179,889,287.76	0.16
270	002432	九安医疗	4,935,976	179,817,605.68	0.16
271	000591	太阳能	40,933,200	179,696,748.00	0.16
272	600380	健康元	16,274,684	179,509,764.52	0.16
273	000403	派林生物	9,883,213	179,182,651.69	0.16
274	601000	唐山港	43,934,388	178,373,615.28	0.16
275	600348	华阳股份	26,754,512	178,185,049.92	0.16
276	688728	格科微	11,543,000	177,762,200.00	0.16
277	000629	钒钛股份	69,425,237	177,728,606.72	0.16
278	000060	中金岭南	38,775,817	177,593,241.86	0.16
279	688278	特宝生物	2,460,228	177,407,041.08	0.16
280	603338	浙江鼎力	3,741,650	177,354,210.00	0.16
281	601991	大唐发电	55,498,329	175,929,702.93	0.16
282	603885	吉祥航空	13,059,001	175,904,743.47	0.16
283	600872	中炬高新	9,241,685	175,592,015.00	0.15
284	000921	海信家电	6,830,833	175,552,408.10	0.15
285	000830	鲁西化工	16,980,398	174,898,099.40	0.15
286	002603	以岭药业	12,396,459	174,790,071.90	0.15
287	300567	精测电子	2,881,349	174,638,562.89	0.15
288	600816	建元信托	58,859,478	173,635,460.10	0.15
289	603379	三美股份	3,606,596	173,549,399.52	0.15
290	600535	天士力	11,074,232	173,311,730.80	0.15
291	002984	森麒麟	9,218,180	172,840,875.00	0.15
292	002439	启明星辰	10,806,669	172,798,637.31	0.15

293	300146	汤臣倍健	15,171,967	170,532,909.08	0.15
294	002056	横店东磁	12,034,094	170,282,430.10	0.15
295	600095	湘财股份	16,974,823	170,257,474.69	0.15
296	600970	中材国际	19,625,460	168,386,446.80	0.15
297	000062	深圳华强	6,240,875	167,629,902.50	0.15
298	301308	江波龙	1,911,600	167,245,884.00	0.15
299	002423	中粮资本	13,663,127	167,100,043.21	0.15
300	600499	科达制造	17,043,173	167,023,095.40	0.15
301	601880	辽港股份	111,323,038	166,984,557.00	0.15
302	603927	中科软	8,621,830	166,746,192.20	0.15
303	600685	中船防务	6,124,484	166,524,719.96	0.15
304	601016	节能风电	57,602,624	166,471,583.36	0.15
305	601611	中国核建	18,010,055	165,512,405.45	0.15
306	603000	人民网	8,182,972	165,377,864.12	0.15
307	000636	风华高科	11,981,932	164,631,745.68	0.15
308	300390	天华新能	8,632,860	164,628,640.20	0.15
309	000958	电投产融	24,039,700	164,431,548.00	0.14
310	688297	中无人机	3,078,839	164,410,002.60	0.14
311	600511	国药股份	5,617,703	163,812,219.48	0.14
312	000563	陕国投 A	45,818,986	163,573,780.02	0.14
313	601666	平煤股份	22,021,738	163,181,078.58	0.14
314	300212	易华录	7,470,491	162,557,884.16	0.14
315	603298	杭叉集团	7,747,871	162,317,897.45	0.14
316	688520	神州细胞	2,702,484	161,743,667.40	0.14
317	600859	王府井	11,634,561	161,604,052.29	0.14
318	603077	和邦生物	92,274,315	161,480,051.25	0.14
319	000155	川能动力	16,436,870	161,410,063.40	0.14
320	601456	国联民生	15,587,539	161,331,028.65	0.14
321	603737	三棵树	4,373,044	161,146,671.40	0.14
322	600655	豫园股份	28,953,447	160,691,630.85	0.14
323	600325	华发股份	32,823,203	159,848,998.61	0.14
324	601966	玲珑轮胎	10,891,477	159,777,967.59	0.14
325	600004	白云机场	17,545,883	159,667,535.30	0.14
326	000598	兴蓉环境	22,129,559	159,554,120.39	0.14
327	600483	福能股份	16,502,489	159,083,993.96	0.14
328	603899	晨光股份	5,485,785	159,032,907.15	0.14
329	688301	奕瑞科技	1,815,135	159,023,977.35	0.14
330	002773	康弘药业	5,484,351	158,881,648.47	0.14
331	300677	英科医疗	6,697,963	158,607,763.84	0.14
332	603156	养元饮品	7,473,400	158,137,144.00	0.14
333	600131	国网信通	8,902,124	157,567,594.80	0.14
334	601958	金钼股份	14,354,983	157,043,514.02	0.14
335	000050	深天马 A	18,337,348	156,234,204.96	0.14

336	600378	昊华科技	5,766,203	156,091,115.21	0.14
337	600663	陆家嘴	17,491,723	154,976,665.78	0.14
338	600282	南钢股份	36,818,585	154,638,057.00	0.14
339	000987	越秀资本	22,507,112	154,398,788.32	0.14
340	002507	涪陵榨菜	11,982,483	153,255,957.57	0.14
341	000951	中国重汽	8,707,904	153,084,952.32	0.13
342	688234	天岳先进	2,619,615	152,883,698.25	0.13
343	002756	永兴材料	4,810,482	152,732,803.50	0.13
344	300529	健帆生物	7,073,800	152,581,866.00	0.13
345	600598	北大荒	10,571,226	152,437,078.92	0.13
346	600271	航天信息	16,459,222	152,083,211.28	0.13
347	600754	锦江酒店	6,768,058	151,875,221.52	0.13
348	601001	晋控煤业	12,390,740	151,414,842.80	0.13
349	300601	康泰生物	9,955,900	151,230,121.00	0.13
350	600739	辽宁成大	13,710,503	150,815,533.00	0.13
351	000559	万向钱潮	19,629,748	150,167,572.20	0.13
352	688363	华熙生物	2,922,828	150,087,217.80	0.13
353	600737	中粮糖业	15,863,393	149,909,063.85	0.13
354	601918	新集能源	23,191,377	149,816,295.42	0.13
355	301536	星辰科技	2,469,675	148,921,402.50	0.13
356	603290	斯达半导	1,814,940	147,500,173.80	0.13
357	002429	兆驰股份	33,659,620	147,429,135.60	0.13
358	600582	天地科技	24,578,002	147,222,231.98	0.13
359	300070	碧水源	32,441,707	145,987,681.50	0.13
360	601333	广深铁路	50,335,900	145,470,751.00	0.13
361	688772	珠海冠宇	10,102,285	144,361,652.65	0.13
362	600566	济川药业	5,481,833	144,336,662.89	0.13
363	601866	中远海发	58,317,012	144,043,019.64	0.13
364	002120	韵达股份	21,483,006	143,936,140.20	0.13
365	300735	光弘科技	5,707,700	143,263,270.00	0.13
366	600764	中国海防	4,209,488	143,122,592.00	0.13
367	601231	环旭电子	9,776,502	143,030,224.26	0.13
368	600867	通化东宝	17,406,834	142,736,038.80	0.13
369	688778	厦钨新能	2,543,078	142,208,921.76	0.13
370	603728	鸣志电器	2,469,392	141,915,958.24	0.13
371	300751	迈为股份	2,039,897	141,895,235.32	0.13
372	003031	中瓷电子	2,665,258	141,818,378.18	0.13
373	002430	杭氧股份	7,291,582	141,602,522.44	0.12
374	300888	稳健医疗	3,436,800	141,252,480.00	0.12
375	603688	石英股份	4,007,564	141,146,404.08	0.12
376	600329	达仁堂	4,222,756	140,871,140.16	0.12
377	600258	首旅酒店	9,962,087	140,764,289.31	0.12
378	601098	中南传媒	10,674,164	140,045,031.68	0.12

379	603341	龙旗科技	3,434,921	139,560,840.23	0.12
380	600995	南网储能	14,235,947	139,227,561.66	0.12
381	601212	白银有色	44,353,791	138,827,365.83	0.12
382	600707	彩虹股份	21,267,176	137,385,956.96	0.12
383	000032	深桑达 A	6,784,637	137,253,206.51	0.12
384	688561	奇安信	3,992,296	135,658,218.08	0.12
385	000027	深圳能源	21,134,762	134,839,781.56	0.12
386	688676	金盘科技	4,016,909	134,365,606.05	0.12
387	002508	老板电器	7,038,953	133,810,496.53	0.12
388	600578	京能电力	29,745,867	133,558,942.83	0.12
389	688318	财富趋势	1,160,961	133,417,638.12	0.12
390	603858	步长制药	8,186,412	132,947,330.88	0.12
391	000709	河钢股份	61,366,500	132,551,640.00	0.12
392	002299	圣农发展	9,274,152	132,527,632.08	0.12
393	301498	乖宝宠物	1,208,922	132,219,799.14	0.12
394	600906	财达证券	19,306,956	131,673,439.92	0.12
395	603529	爱玛科技	3,821,973	131,475,871.20	0.12
396	000883	湖北能源	28,991,494	130,751,637.94	0.12
397	000967	盈峰环境	18,798,214	130,647,587.30	0.12
398	300573	兴齐眼药	2,516,328	130,320,627.12	0.11
399	002831	裕同科技	5,545,286	129,870,598.12	0.11
400	600517	国网英大	25,406,013	129,570,666.30	0.11
401	002670	国盛金控	8,594,592	129,348,609.60	0.11
402	600848	上海临港	14,246,268	129,213,650.76	0.11
403	600546	山煤国际	14,735,144	128,637,807.12	0.11
404	601399	国机重装	42,810,271	128,430,813.00	0.11
405	600959	江苏有线	37,292,145	128,284,978.80	0.11
406	601928	凤凰传媒	11,319,448	126,438,234.16	0.11
407	601156	东航物流	9,430,438	123,444,433.42	0.11
408	600968	海油发展	30,117,054	122,877,580.32	0.11
409	000739	普洛药业	8,761,160	122,656,240.00	0.11
410	600808	马钢股份	35,505,426	122,493,719.70	0.11
411	000825	太钢不锈	33,858,548	121,552,187.32	0.11
412	300595	欧普康视	7,954,023	121,457,931.21	0.11
413	600528	中铁工业	16,444,366	121,359,421.08	0.11
414	603225	新凤鸣	11,275,859	120,087,898.35	0.11
415	601636	旗滨集团	23,963,672	120,057,996.72	0.11
416	002572	索菲亚	8,558,158	119,899,793.58	0.11
417	301301	川宁生物	9,947,100	119,763,084.00	0.11
418	601118	海南橡胶	25,359,099	119,694,947.28	0.11
419	002266	浙富控股	38,675,519	119,120,598.52	0.11
420	603565	中谷物流	12,443,177	118,832,340.35	0.10
421	600977	中国电影	11,061,686	118,581,273.92	0.10

422	601608	中信重工	27,125,082	118,536,608.34	0.10
423	600871	石化油服	60,707,168	118,378,977.60	0.10
424	600801	华新水泥	9,994,952	118,340,231.68	0.10
425	000543	皖能电力	16,792,312	117,546,184.00	0.10
426	601598	中国外运	23,502,434	115,866,999.62	0.10
427	600062	华润双鹤	6,186,580	115,441,582.80	0.10
428	688563	航材股份	2,030,651	114,995,766.13	0.10
429	601106	中国一重	40,968,839	114,712,749.20	0.10
430	600056	中国医药	11,084,477	114,613,492.18	0.10
431	688387	信科移动	20,194,868	114,101,004.20	0.10
432	000582	北部湾港	13,789,860	113,766,345.00	0.10
433	603650	彤程新材	3,537,270	113,723,230.50	0.10
434	688702	盛科通信	1,858,485	113,516,263.80	0.10
435	000785	居然智家	36,933,600	112,647,480.00	0.10
436	300957	贝泰妮	2,481,599	109,736,307.78	0.10
437	603233	大参林	6,718,522	109,511,908.60	0.10
438	600925	苏能股份	20,392,216	106,651,289.68	0.09
439	600373	中文传媒	10,364,181	106,440,138.87	0.09
440	601965	中国汽研	5,980,777	106,158,791.75	0.09
441	002153	石基信息	12,116,003	104,924,585.98	0.09
442	000429	粤高速 A	7,732,786	103,078,037.38	0.09
443	600606	绿地控股	63,057,632	102,783,940.16	0.09
444	000537	中绿电	12,249,005	102,401,681.80	0.09
445	688281	华秦科技	1,640,469	99,264,779.19	0.09
446	002372	伟星新材	9,483,531	98,249,381.16	0.09
447	601568	北元集团	23,605,571	97,963,119.65	0.09
448	001286	陕西能源	11,233,468	97,731,171.60	0.09
449	600098	广州发展	15,627,327	97,670,793.75	0.09
450	600361	创新新材	24,419,217	97,432,675.83	0.09
451	688425	铁建重工	23,823,361	97,199,312.88	0.09
452	600612	老凤祥	1,924,181	95,728,004.75	0.08
453	003022	联泓新科	6,019,884	95,294,763.72	0.08
454	603658	安图生物	2,529,022	94,838,325.00	0.08
455	600688	上海石化	32,780,148	93,423,421.80	0.08
456	688349	三一重能	3,713,057	92,603,641.58	0.08
457	000937	冀中能源	15,678,884	90,153,583.00	0.08
458	601019	山东出版	9,335,918	88,411,143.46	0.08
459	301165	锐捷网络	1,432,820	88,061,117.20	0.08
460	000898	鞍钢股份	35,781,048	83,012,031.36	0.07
461	688100	威胜信息	2,228,754	82,575,335.70	0.07
462	600339	中油工程	25,195,359	82,388,823.93	0.07
463	601139	深圳燃气	12,951,911	82,374,153.96	0.07
464	002608	江苏国信	11,165,635	81,844,104.55	0.07

465	600032	浙江新能	10,728,068	81,104,194.08	0.07
466	688248	南网科技	2,561,811	80,594,574.06	0.07
467	603707	健友股份	7,157,668	79,807,998.20	0.07
468	600720	中交设计	10,240,857	79,161,824.61	0.07
469	000959	首钢股份	23,154,152	78,724,116.80	0.07
470	003035	南网能源	17,069,290	78,348,041.10	0.07
471	600928	西安银行	19,896,678	77,994,977.76	0.07
472	600295	鄂尔多斯	8,873,187	77,285,458.77	0.07
473	688475	萤石网络	2,379,767	75,010,255.84	0.07
474	688032	禾迈股份	750,494	74,944,330.84	0.07
475	002461	珠江啤酒	6,530,300	73,727,087.00	0.06
476	601228	广州港	22,562,278	72,876,157.94	0.06
477	603556	海兴电力	2,858,945	72,817,329.15	0.06
478	688172	燕东微	3,638,024	71,523,551.84	0.06
479	301267	华夏眼科	3,723,878	71,386,741.26	0.06
480	688375	国博电子	1,170,723	70,255,087.23	0.06
481	603786	科博达	1,223,493	67,793,747.13	0.06
482	600927	永安期货	4,366,211	64,663,584.91	0.06
483	601061	中信金属	8,133,500	64,335,985.00	0.06
484	002563	森马服饰	12,194,775	64,144,516.50	0.06
485	600007	中国国贸	2,963,725	60,993,460.50	0.05
486	000539	粤电力 A	13,328,900	60,513,206.00	0.05
487	002945	华林证券	4,072,930	58,528,004.10	0.05
488	600299	安迪苏	5,987,761	57,781,893.65	0.05
489	688819	天能股份	2,047,105	56,827,634.80	0.05
490	300140	节能环境	9,199,000	56,757,830.00	0.05
491	603826	坤彩科技	2,889,832	56,554,012.24	0.05
492	001213	中铁特货	13,181,400	53,516,484.00	0.05
493	601921	浙版传媒	6,557,000	52,849,420.00	0.05
494	601858	中国科传	2,310,986	44,948,677.70	0.04
495	688153	唯捷创芯	1,294,539	40,143,654.39	0.04
496	601158	重庆水务	8,646,100	40,117,904.00	0.04
497	600956	新天绿能	4,595,076	35,473,986.72	0.03
498	001389	广合科技	575,661	33,831,596.97	0.03
499	688295	中复神鹰	1,489,145	30,974,216.00	0.03
500	603868	飞科电器	720,697	25,851,401.39	0.02

### 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	400174	中天 3	18,775,114	2,628,515.96	0.00

2	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
3	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
4	603049	中策橡胶	724	31,023.40	0.00
5	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
6	301458	钧崑电子	701	23,911.11	0.00
7	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
8	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
9	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
10	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
11	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
12	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
13	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
14	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
15	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
16	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
17	301590	优优绿能	73	10,182.04	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	688608	恒玄科技	497,617,048.46	0.49
2	002625	光启技术	463,067,887.71	0.46
3	688235	百济神州	443,587,283.75	0.44
4	000933	神火股份	414,618,872.88	0.41
5	300339	润和软件	388,057,520.10	0.38
6	300450	先导智能	376,631,381.23	0.37
7	300454	深信服	358,493,329.46	0.35
8	002966	苏州银行	351,740,579.75	0.35
9	300458	全志科技	349,449,187.34	0.34
10	300476	胜宏科技	343,688,155.64	0.34

11	002130	沃尔核材	343,637,494.48	0.34
12	600363	联创光电	330,925,796.73	0.33
13	300346	南大光电	327,724,777.33	0.32
14	002384	东山精密	322,814,839.11	0.32
15	002851	麦格米特	317,431,515.46	0.31
16	000423	东阿阿胶	314,832,268.10	0.31
17	002156	通富微电	312,702,932.98	0.31
18	300115	长盈精密	309,570,092.42	0.30
19	002850	科达利	306,842,852.42	0.30
20	300857	协创数据	305,179,565.00	0.30

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	002625	光启技术	1,312,606,903.62	1.29
2	600418	江淮汽车	1,136,564,692.65	1.12
3	002384	东山精密	951,596,346.94	0.94
4	301236	软通动力	722,881,369.93	0.71
5	300866	安克创新	571,379,370.93	0.56
6	302132	中航成飞	512,829,349.45	0.50
7	002128	电投能源	481,607,045.91	0.47
8	300339	润和软件	381,457,138.11	0.37
9	600126	杭钢股份	375,027,443.71	0.37
10	688047	龙芯中科	352,124,405.31	0.35
11	300476	胜宏科技	324,491,616.26	0.32
12	002407	多氟多	310,005,090.35	0.30
13	002850	科达利	294,568,030.56	0.29
14	000988	华工科技	292,194,244.66	0.29
15	000818	航锦科技	288,918,371.69	0.28
16	002202	金风科技	288,044,271.18	0.28
17	000423	东阿阿胶	281,331,971.19	0.28
18	600642	申能股份	265,516,962.07	0.26
19	300395	菲利华	261,289,232.94	0.26
20	002156	通富微电	260,707,734.01	0.26

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	43,836,434,477.48
卖出股票收入（成交）总额	41,306,884,706.24

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。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，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、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，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。

#### 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，东吴证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会的处罚；苏州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江苏监管局的处罚。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	509,612,341.31
2	应收清算款	49,794,179.22
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	559,406,520.53

### 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
----	------	------	------------	--------------	----------

			值 (元)		
1	688521	芯原股份	165,564,000.00	0.15	大宗交易锁定期

### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	400174	中天 3	2,628,515.96	0.00	暂停转让
2	688775	影石创新	71,143.68	0.00	新股锁定期
3	688411	海博思创	46,754.40	0.00	新股锁定期
4	603049	中策橡胶	31,023.40	0.00	新股锁定期
5	688545	兴福电子	26,788.30	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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	
		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
207,516	91,617.84	15,819,100,180.00	83.21%	1,840,914,256.00	9.68%	1,352,154,181.00	7.11%

### 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	中央汇金投资有限责任公司	8,235,101,633.00	43.31%
2	中央汇金资产管理有限责任公司	5,981,977,518.00	31.46%
3	易方达基金—中央汇金资产管理有限责任公司—易方达基金—汇金资管单一资产管理计划	190,080,598.00	1.00%
4	中国人寿保险股份有限公司	177,588,596.00	0.93%
5	中美联泰大都会人寿保险有限公司	58,623,400.00	0.31%
6	中美联泰大都会人寿保险有限公司—分红险权益	47,799,870.00	0.25%
7	大家人寿保险股份有限公司—万能产品	43,169,711.00	0.23%
8	财通证券股份有限公司	43,008,578.00	0.23%

9	幸福人寿保险股份有限公司一分红	32,976,800.00	0.17%
10	PRAKOSO BUDI SANTOSO	32,934,315.00	0.17%
11	中国农业银行—南方中证 500 交易型 开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	1,352,154,181.00	7.11%

### 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(2013 年 2 月 6 日)基金份额总额	1,147,553,216.00
本报告期期初基金份额总额	17,492,568,617.00
本报告期基金总申购份额	10,055,600,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	8,536,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	19,012,168,617.00

## § 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。

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内无涉及基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及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，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	
中信证券	2	36,181,609,349.10	42.50%	3,614,870.48	42.47%	-
国信证券	2	17,861,769,512.94	20.98%	1,786,626.73	20.99%	-
华泰证券	3	12,369,665,194.99	14.53%	1,236,922.39	14.53%	-
招商证券	2	10,314,885,912.77	12.11%	1,032,366.45	12.13%	-
方正证券	2	5,135,231,896.03	6.03%	513,624.57	6.03%	-
广发证券	2	1,287,786,758.98	1.51%	128,669.80	1.51%	-
国泰海通	3	1,218,842,713.59	1.43%	121,910.78	1.43%	-
申万宏源	2	771,751,673.97	0.91%	77,106.93	0.91%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-

国投证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

注：根据 2024 年 7 月 1 日起施行的《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告（2024）3 号），基金管理人制定了证券公司交易单元的选择标准和程序：

1、选择标准

基金管理人建立了选择机制，选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易，并制定了定性与定量相结合的具体标准。

2、选择程序

（1）基金管理人根据上述标准对证券公司进行评估，与符合标准的证券公司签订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
中信证券	29,234,627.52	63.86%	500,000,000.00	31.25%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	1,100,000,000.00	68.75%	-	-
招商证券	12,440,037.01	27.17%	-	-	-	-
方正证券	4,106,654.86	8.97%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金分红公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-09
5	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
6	关于南方基金管理股份有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-19
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	2025-03-20
8	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
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-04-01
10	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		间					
机构	1	20250408- 20250630	2,615,889,755.00	3,366,087,763.00	-	5,981,977,518.00	31.46%
机构	2	20250101- 20250630	8,235,101,633.00	-	-	8,235,101,633.00	43.31%

**产品特有风险**

本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。

**11.2 影响投资者决策的其他重要信息**

无。

**§ 12 备查文件目录**

**12.1 备查文件目录**

- 1、中国证监会批准设立中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证 500 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、《中证 500 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>