

南方中证 A500 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	10
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 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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	12
§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	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
§8 基金份额持有人信息.....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	57
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	南方中证 A500 指数增强	
基金主代码	024375	
交易代码	024375	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 9 月 9 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	424,070,331.93 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方中证 A500 指数增强 A	南方中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	024375	024376
报告期末下属分级基金的份 额总额	266,689,907.43 份	157,380,424.50 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在对中证 A500 指数进行有效跟踪的基础上，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金利用量化投资模型，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。本基金主要通过量化选股模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在控制组合跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。主要投资策略包括：大类资产配置策略、股票投资策略、港股投资策略、债券投资策略、金融衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、信用衍生品投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，一般而言，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。 本基金投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动 风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险和港股通机制下因投资环境、 投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	南方基金管理股份有限公司	中国银行股份有限公司
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	95566
传真	0755-82763889	010-66594942
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 1 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 1 号
邮政编码	518017	100818
法定代表人	周易	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人的住所、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	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

§ 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

1、南方中证 A500 指数增强 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	63,735,147.29
本期利润	65,839,471.58
加权平均基金份额本期利润	0.1876
本期加权平均净值利润率	16.91%
本期基金份额净值增长率	15.46%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	47,473,376.82
期末可供分配基金份额利润	0.1780
期末基金资产净值	318,578,352.14
期末基金份额净值	1.1946
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	19.46%

2、南方中证 A500 指数增强 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	26,298,906.14
本期利润	27,981,453.26
加权平均基金份额本期利润	0.1723
本期加权平均净值利润率	15.60%
本期基金份额净值增长率	15.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	27,415,937.58
期末可供分配基金份额利润	0.1742
期末基金资产净值	187,393,886.32
期末基金份额净值	1.1907
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	19.07%

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

南方中证 A500 指数增强 A

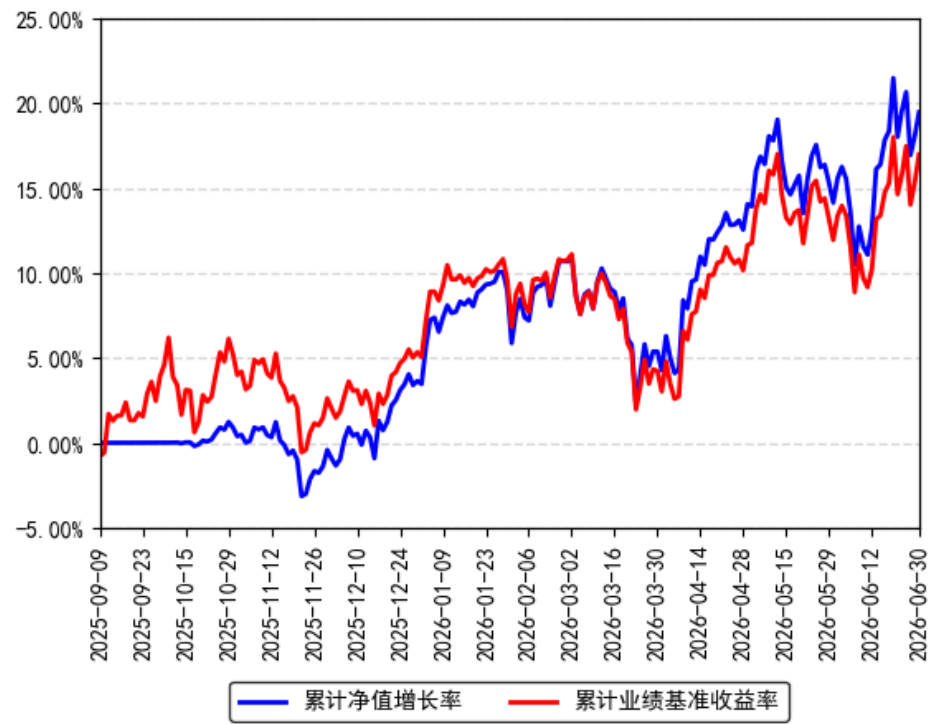
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	14.57%	1.39%	13.54%	1.34%	1.03%	0.05%
过去六个月	15.46%	1.26%	11.34%	1.22%	4.12%	0.04%
自基金合同 生效起至今	19.46%	1.04%	16.97%	1.13%	2.49%	-0.09%

南方中证 A500 指数增强 C

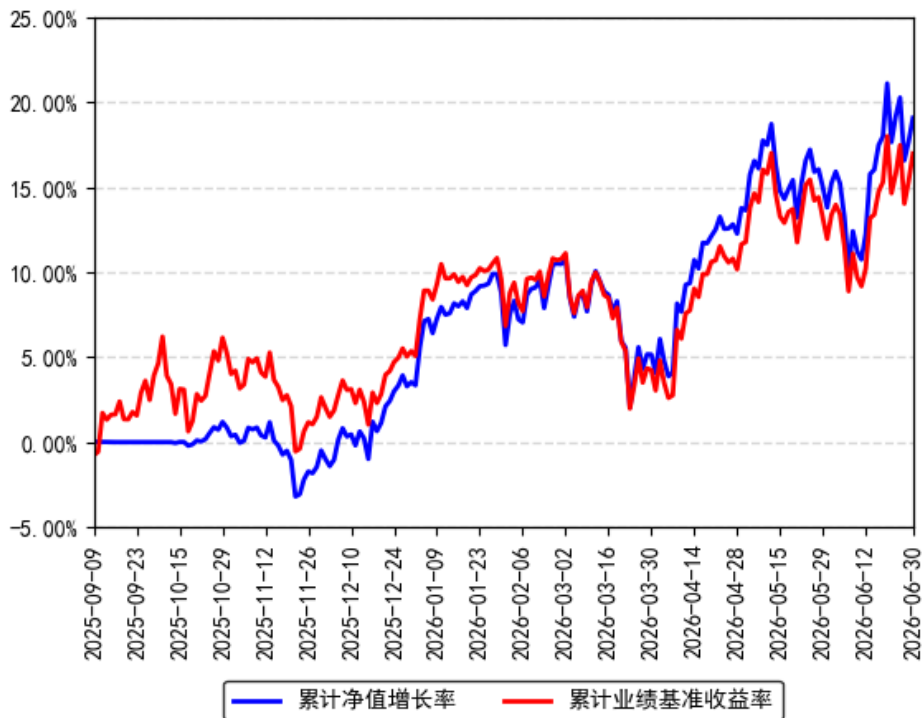
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	14.46%	1.39%	13.54%	1.34%	0.92%	0.05%
过去六个月	15.23%	1.26%	11.34%	1.22%	3.89%	0.04%
自基金合同 生效起至今	19.07%	1.04%	16.97%	1.13%	2.10%	-0.09%

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A500指数增强A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



南方中证A500指数增强C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



注：本基金合同于 2025 年 9 月 9 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	证券	说明
----	----	-----------	----	----

		(助理) 期限		从业年限	
		任职日期	离任日期		
解锐	本基金基金经理	2025 年 9 月 9 日	-	8 年	中国国籍，清华大学金融专业硕士，具有基金从业资格。2017 年 7 月加入南方基金，任数量化投资部量化研究员；2020 年 8 月 10 日至 2022 年 2 月 18 日，任投资经理；2022 年 2 月 18 日至今，任南方沪深 300 增强、大数据 300 基金经理；2024 年 12 月 6 日至今，任南方大数据 100 指数基金经理；2025 年 9 月 9 日至今，任南方中证 A500 指数增强基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 24 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年 A 股整体震荡上涨，一季度美伊冲突爆发带来阶段性调整，二季度在地缘冲击缓和后风险偏好快速回升。具体来看，上半年沪深 300、中证 500、中证 1000、创业板指、科创 50 分别上涨 7.55%、20.97%、15.99%、35.58%、64.25%。行业层面，由于宏观经济呈现明显分化，以 AI 算力和半导体为代表的成长风格演绎进一步趋于极致，电子、通信、建材表现居前，涨幅分别为 86.29%、73.59%、46.26%，而内需消费景气下行，股价表现承压，商贸零售、农林牧渔、美容护理表现靠后，涨幅分别为-29.42%、-25.26%、-24.86%。

本基金投资以多策略量化指数增强模型选股投资为主，使用多因子，量化基本面，事件驱动等模型，以多策略融合模型进行股票投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.1946 元，报告期内，份额净值增长率为 15.46%，同期业绩基准增长率为 11.34%；本基金 C 份额净值为 1.1907 元，报告期内，份额净值增长率为 15.23%，同期业绩基准增长率为 11.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对下半年 A 股表现较为乐观。目前 A 股风险溢价处于中性水平，不存在估值扩张或收缩的动能；受 PPI 上行拉动，全 A 盈利增速预计将延续改善态势，则可能出现估值稳定、EPS 增长转化为股价的提升，驱动 A 股上行。但由于 EPS 增长相较估值变化速度更慢，A 股整体上行斜率可能较为平缓，不易出现类似 24 年、25 年下半年的快速上涨行情。结构上，宏观的产业分化趋势尚未出现收敛迹象，AI 产业蓬勃发展，算力扩张需求旺盛，硬件产能瓶颈在多个环节涌现，形成涨价趋势，而传统消费、地产基本面均呈现压力，尤其是耐用消费品，开始出现需求透支效应。因此下半年可能还是结构性行情为主。主要变量可能来自于新一轮促消费政策的推出和财政支出发力。

本基金为指数增强基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度，力求实现在对中证 A500 指数有效跟踪的前提下，为投资者提供稳健的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术，建立了估值委员会，组成人员包括财务负责人、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在南方中证 A500 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、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 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	47,794,579.48	96,189,551.95
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	454,247,632.92	698,557,335.13
其中：股票投资		454,240,632.60	698,182,788.12
基金投资		-	-
债券投资		7,000.32	374,547.01
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		7,405,009.20	1,054,868.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		509,447,221.60	795,801,755.31
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30	上年度末 2025 年 12 月

		日	31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,977,084.34	46,767,199.13
应付管理人报酬		319,278.35	716,222.64
应付托管费		39,909.81	89,527.83
应付销售服务费		54,649.48	89,709.69
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.91
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	84,061.16	40,015.19
负债合计		3,474,983.14	47,702,675.39
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	424,070,331.93	723,370,436.87
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	81,901,906.53	24,728,643.05
净资产合计		505,972,238.46	748,099,079.92
负债和净资产总计		509,447,221.60	795,801,755.31

注 1. 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，南方中证 A500 指数增强 A 份额净值 1.1946 元，基金份额总额 266,689,907.43 份；南方中证 A500 指数增强 C 份额净值 1.1907 元，基金份额总额 157,380,424.50 份；总份额合计 424,070,331.93 份。

2. 基金合同生效日为 2025 年 09 月 09 日, 2025 年度实际报告期间为 2025 年 09 月 09 日至 2025 年 12 月 31 日。

6.2 利润表

会计主体：南方中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		96,822,462.06
1.利息收入		59,489.10
其中：存款利息收入	6.4.7.9	59,489.10
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）		92,881,021.45
其中：股票投资收益	6.4.7.10	88,007,308.54
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	315,445.23
资产支持证券投资	6.4.7.12	-
收益		
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	4,558,267.68
以摊余成本计量的金		
融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	3,786,871.41
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	95,080.10
减：二、营业总支出		3,001,537.22
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	2,268,512.25
其中：暂估管理人报酬		-
2.托管费	6.4.10.2.2	283,564.05
3.销售服务费	6.4.10.2.3	357,483.89
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支		
出		-
6.信用减值损失	6.4.7.17	-
7.税金及附加		0.11
8.其他费用	6.4.7.18	91,976.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		93,820,924.84
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		93,820,924.84
五、其他综合收益的税后净		
额		-
六、综合收益总额		93,820,924.84

6.3 净资产变动表

会计主体：南方中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	723,370,436.87	-	24,728,643.05	748,099,079.92
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	723,370,436.87	-	24,728,643.05	748,099,079.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-299,300,104.94	-	57,173,263.48	-242,126,841.46
（一）、综合收益总额	-	-	93,820,924.84	93,820,924.84
（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）	-299,300,104.94	-	-36,647,661.36	-335,947,766.30
其中：1.基金申购款	521,025,886.78	-	58,038,153.52	579,064,040.30
2.基金赎回款	-820,325,991.72	-	-94,685,814.88	-915,011,806.60
（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	424,070,331.93	-	81,901,906.53	505,972,238.46

净资产				
-----	--	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____杨小松____	____蔡忠评____	____徐超____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

南方中证 A500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]1000 号《关于准予南方中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,722,688,613.39 元，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(25)第 00302 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 9 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,723,636,730.17 份，其中认购资金利息折合 948,116.78 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用、不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票以及存托凭证(下同))、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(简称“港股通股票”)、债券(包括国内依法发行的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、信用衍生品、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权等)以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金可根据相关法

法律法规的规定，参与融资业务和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产（含存托凭证）的比例不低于基金资产的 80%（其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%），投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。在正常市场情况下，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

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

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

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

公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	30,416,294.43
等于：本金	30,414,664.67
加：应计利息	1,629.76
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	17,378,285.05
等于：本金	17,377,650.75
加：应计利息	634.30
减：坏账准备	-
合计	47,794,579.48

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。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	425,867,622.69	-	454,240,632.60	28,373,009.91
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	7,000.00	0.32	7,000.32	-
交易所市场				

	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	7,000.00	0.32	7,000.32	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		425,874,622.69	0.32	454,247,632.92	28,373,009.91

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	176.53
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	-
预提费用	83,310.68
应付指数使用费	-
其他	573.95
合计	84,061.16

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方中证 A500 指数增强 A	
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	516,910,025.20	516,910,025.20
本期申购	318,952,716.52	318,952,716.52
本期赎回（以“-”号填列）	-569,172,834.29	-569,172,834.29
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	266,689,907.43	266,689,907.43

南方中证 A500 指数增强 C		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	206,460,411.67	206,460,411.67
本期申购	202,073,170.26	202,073,170.26
本期赎回（以“-”号填列）	-251,153,157.43	-251,153,157.43
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	157,380,424.50	157,380,424.50

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

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

南方中证 A500 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,144,262.27	9,719,093.69	17,863,355.96
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	8,144,262.27	9,719,093.69	17,863,355.96
本期利润	63,735,147.29	2,104,324.29	65,839,471.58
本期基金份额交易产生的变动数	-24,406,032.74	-7,408,350.09	-31,814,382.83
其中：基金申购款	32,396,701.94	1,770,344.38	34,167,046.32
基金赎回款	-56,802,734.68	-9,178,694.47	-65,981,429.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	47,473,376.82	4,415,067.89	51,888,444.71

南方中证 A500 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,987,524.36	3,877,762.73	6,865,287.09
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,987,524.36	3,877,762.73	6,865,287.09
本期利润	26,298,906.14	1,682,547.12	27,981,453.26
本期基金份额交易产生的变动数	-1,870,492.92	-2,962,785.61	-4,833,278.53
其中：基金申购款	23,713,509.04	157,598.16	23,871,107.20
基金赎回款	-25,584,001.96	-3,120,383.77	-28,704,385.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,415,937.58	2,597,524.24	30,013,461.82

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	44,373.44
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	12,544.11
结算备付金利息收入	-
其他	2,571.55
合计	59,489.10

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。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	88,007,308.54
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	88,007,308.54

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,893,142,892.58

减：卖出股票成本总额	2,802,795,665.76
减：交易费用	2,339,918.28
买卖股票差价收入	88,007,308.54

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	27.33
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	315,417.90
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	315,445.23

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	655,098.95
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	339,600.00
减：应计利息总额	54.87
减：交易费用	26.18
买卖债券差价收入	315,417.90

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,558,267.68
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	4,558,267.68

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	3,786,871.41
——股票投资	3,821,791.41
——债券投资	-34,920.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,786,871.41

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	77,084.91
基金转换费收入	17,995.19
合计	95,080.10

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	23,803.31
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	8,666.24

合计	91,976.92
----	-----------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	5,445,920,758.49	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	655,098.95	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	544,055.72	100.00%	-	-

注：1. 上述佣金费率参考市场价格确定。

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,268,512.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	979,272.94
应支付基金管理人的净管理费	1,289,239.31

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 0.80% 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×0.80%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	283,564.05

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方中证 A500 指数增强 A	南方中证 A500 指数增强 C	合计
华泰证券	-	176,342.39	176,342.39
南方基金	-	5,068.45	5,068.45
中国银行	-	88,836.11	88,836.11
合计	-	270,246.95	270,246.95

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.40% ÷ 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行-银行存款	30,416,294.43	44,373.44
华泰证券-券商保证金	17,378,285.05	12,544.11

注：1. 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。

2. 本基金的券商保证金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，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	603293	埃泰克	网下申购	716	23,978.84
华泰联合	113704	春风转债	配债	70	7,000.00

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

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

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股锁定期	114.28	676.94	4,479	511,860.12	3,032,014.26	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁定期	104.66	768.89	3,195	334,388.70	2,456,603.55	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定期	46.08	463.33	793	36,541.44	367,420.69	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月	6 个月	新股锁定期	10.11	10.11	16,524	167,057.64	167,057.64	-

		24 日								
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月 内 (含)	新股未 上市	10.11	10.11	7,081	71,588.91	71,588.91	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	81.88	1,584 .33	133	10,890.04	210,715.89	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新股锁 定期	22.68	42.16	4,752	107,775.36	200,344.32	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁 定期	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	19.68	141.4 9	714	14,051.52	101,023.86	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	44.56	468.6 7	194	8,644.64	90,921.98	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	10.12	27.73	2,628	26,595.36	72,874.44	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	92.18	463.1 5	116	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	26.28	172.0 9	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	40.98	308.1 9	128	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026	6 个月	新股锁	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-

		年 3 月 31 日		定期						
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	27.19	31.31	529	14,383.51	16,562.99	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	30.38	38.99	374	11,362.12	14,582.26	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股锁 定期	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	58.00	112.1 6	117	6,786.00	13,122.72	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	53.26	58.74	220	11,717.20	12,922.80	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	78.38	121.7 7	96	7,524.48	11,689.92	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	11.18	17.59	609	6,808.62	10,712.31	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月	6 个月	新股锁 定期	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-

		9 日								
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定期	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定期	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113704	春风转债	2026 年 6 月 11 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	70	7,000.00	7,000.32	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	3,826	1,788,394.28	3,365,081.78	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场

风险。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

于本期末,本基金的卖出回购金融资产款(若有)计息且利息金额不重大;除此之外,本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息,该部分账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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	47,794,579.48	-	-	-	47,794,579.48
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	7,000.32	454,240,632.60	454,247,632.92
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	-	-	-	7,405,009.20	7,405,009.20
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	47,794,579.48	-	7,000.32	461,645,641.80	509,447,221.60
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	-	-	-	2,977,084.34	2,977,084.34
应付管理人报酬	-	-	-	319,278.35	319,278.35
应付托管费	-	-	-	39,909.81	39,909.81
应付销售服务费	-	-	-	54,649.48	54,649.48
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	-	-	-	84,061.16	84,061.16
负债总计	-	-	-	3,474,983.14	3,474,983.14
利率敏感度缺口	47,794,579.48	-	7,000.32	458,170,658.66	505,972,238.46
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	96,189,551.95	-	-	-	96,189,551.95
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	374,547.01	698,182,788.12	698,557,335.13
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	-	-	-	1,054,868.23	1,054,868.23
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	96,189,551.95	-	374,547.01	699,237,656.35	795,801,755.31
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	-	-	-	46,767,199.13	46,767,199.13
应付管理人报酬	-	-	-	716,222.64	716,222.64
应付托管费	-	-	-	89,527.83	89,527.83
应付销售服务费	-	-	-	89,709.69	89,709.69
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.91	0.91
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	40,015.19	40,015.19
负债总计	-	-	-	47,702,675.39	47,702,675.39
利率敏感度缺口	96,189,551.95	-	374,547.01	651,534,980.96	748,099,079.92

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变
----	--------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2026 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	0.00	0.00
	2.市场利率平行下降 25 个基点	0.00	0.00

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金本期末的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金为增强型股票指数基金，在力求对跟踪的标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，利用量化投资模型，控制组合跟踪误差。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	454,240,632.60	89.78	698,182,788.12	93.33
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	7,000.32	0.00	374,547.01	0.05
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	454,247,632.92	89.78	698,557,335.13	93.38

注：交易性金融资产-债券投资项目仅包含可转换公司债券或可交换公司债券。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2026 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）
	1.组合自身基准上升 5%	22,129,007.42	17,956,089.02
	2.组合自身基准下降 5%	-22,129,007.42	-17,956,089.02

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	443,531,007.35
第二层次	3,610,728.65
第三层次	7,105,896.92
合计	454,247,632.92

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元			
序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	454,240,632.60	89.16
	其中：股票	454,240,632.60	89.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,000.32	0.00
	其中：债券	7,000.32	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	47,794,579.48	9.38
8	其他各项资产	7,405,009.20	1.45
9	合计	509,447,221.60	100.00

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	185,447.00	0.04
B	采矿业	21,224,973.00	4.19
C	制造业	300,240,712.97	59.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,962,748.00	0.98
E	建筑业	2,163,609.00	0.43
F	批发和零售业	5,540,003.00	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	9,467,510.04	1.87
H	住宿和餐饮业	989,387.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服	23,681,208.53	4.68

	务业		
J	金融业	37,309,232.00	7.37
K	房地产业	2,623,550.00	0.52
L	租赁和商务服务业	6,223,707.00	1.23
M	科学研究和技术服务业	6,446,999.00	1.27
N	水利、环境和公共设施管理业	4,040,576.00	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	461,460.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	425,561,122.54	84.11

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	193,229.82	0.04
C	制造业	23,719,806.15	4.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	588,386.55	0.12
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	953,995.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	790,794.84	0.16
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	982,128.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	1,012,940.24	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	266,600.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	170,046.00	0.03
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	28,679,510.06	5.67

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	18,000	22,860,000.00	4.52
2	300750	宁德时代	35,200	13,833,952.00	2.73
3	300502	新易盛	18,140	11,010,980.00	2.18
4	603986	兆易创新	11,900	9,698,500.00	1.92
5	600519	贵州茅台	6,100	7,231,489.00	1.43
6	600030	中信证券	195,800	5,625,334.00	1.11
7	688256	寒武纪	3,498	5,581,233.90	1.10
8	688008	澜起科技	16,697	5,174,400.30	1.02
9	600150	中国船舶	152,336	5,147,433.44	1.02
10	601318	中国平安	104,600	4,993,604.00	0.99
11	601899	紫金矿业	196,400	4,937,496.00	0.98
12	603259	药明康德	38,700	4,818,537.00	0.95
13	002384	东山精密	17,800	4,669,830.00	0.92
14	002415	海康威视	134,900	4,613,580.00	0.91
15	688111	金山办公	21,541	4,589,310.05	0.91
16	002475	立讯精密	62,100	4,371,840.00	0.86
17	688002	睿创微纳	27,342	4,229,533.98	0.84
18	002463	沪电股份	26,600	4,064,480.00	0.80
19	000792	盐湖股份	128,400	3,876,396.00	0.77
20	600887	伊利股份	161,500	3,869,540.00	0.76
21	600183	生益科技	21,900	3,797,460.00	0.75
22	601166	兴业银行	221,900	3,674,664.00	0.73
23	600487	亨通光电	32,800	3,586,352.00	0.71
24	688072	拓荆科技	3,826	3,365,081.78	0.67
25	601398	工商银行	469,300	3,317,951.00	0.66
26	601872	招商轮船	177,400	3,116,918.00	0.62
27	300475	香农芯创	10,300	3,090,000.00	0.61
28	300476	胜宏科技	8,800	3,048,584.00	0.60
29	600346	恒力石化	171,800	3,042,578.00	0.60
30	000001	平安银行	294,000	2,954,700.00	0.58
31	605117	德业股份	27,560	2,926,320.80	0.58
32	600309	万华化学	42,600	2,914,266.00	0.58
33	603993	洛阳钼业	161,100	2,827,305.00	0.56
34	300014	亿纬锂能	43,300	2,815,799.00	0.56
35	688981	中芯国际	17,618	2,798,090.76	0.55
36	000651	格力电器	74,400	2,790,000.00	0.55
37	600489	中金黄金	147,500	2,662,375.00	0.53

38	601288	农业银行	438,600	2,662,302.00	0.53
39	002532	天山铝业	244,731	2,625,963.63	0.52
40	600036	招商银行	73,900	2,623,450.00	0.52
41	000333	美的集团	34,000	2,568,020.00	0.51
42	601888	中国中免	46,500	2,497,515.00	0.49
43	601233	桐昆股份	115,032	2,490,442.80	0.49
44	000408	藏格矿业	35,700	2,474,724.00	0.49
45	600026	中远海能	137,800	2,472,132.00	0.49
46	002027	分众传媒	500,500	2,422,420.00	0.48
47	603799	华友钴业	50,140	2,419,756.40	0.48
48	002049	紫光国微	26,800	2,378,500.00	0.47
49	000426	兴业银锡	72,000	2,373,120.00	0.47
50	300408	三环集团	13,700	2,286,530.00	0.45
51	002266	浙富控股	451,600	2,285,096.00	0.45
52	688012	中微公司	4,827	2,261,449.50	0.45
53	000933	神火股份	105,800	2,242,960.00	0.44
54	600482	中国动力	67,300	2,207,440.00	0.44
55	000425	徐工机械	272,400	2,203,716.00	0.44
56	600499	科达制造	151,500	2,090,700.00	0.41
57	601328	交通银行	316,000	2,031,880.00	0.40
58	600176	中国巨石	27,600	2,011,488.00	0.40
59	002493	荣盛石化	186,500	2,004,875.00	0.40
60	300857	协创数据	5,500	1,869,450.00	0.37
61	600549	厦门钨业	21,700	1,848,840.00	0.37
62	600893	航发动力	47,500	1,821,150.00	0.36
63	605499	东鹏饮料	14,590	1,800,843.70	0.36
64	300049	福瑞医科	46,300	1,800,144.00	0.36
65	002558	巨人网络	65,100	1,794,156.00	0.35
66	600233	圆通速递	110,300	1,737,225.00	0.34
67	300394	天孚通信	5,620	1,701,061.60	0.34
68	301358	湖南裕能	22,034	1,671,719.58	0.33
69	000338	潍柴动力	60,500	1,648,625.00	0.33
70	002916	深南电路	3,600	1,648,440.00	0.33
71	600522	中天科技	26,700	1,620,156.00	0.32
72	601600	中国铝业	191,400	1,573,308.00	0.31
73	601601	中国太保	55,100	1,571,452.00	0.31
74	300919	中伟新材	35,800	1,566,250.00	0.31
75	300115	长盈精密	55,200	1,542,288.00	0.30
76	002185	华天科技	68,700	1,532,697.00	0.30
77	300124	汇川技术	23,000	1,525,590.00	0.30
78	600875	东方电气	52,900	1,521,933.00	0.30
79	600104	上汽集团	155,900	1,521,584.00	0.30
80	688578	艾力斯	13,930	1,521,156.00	0.30

81	002130	沃尔核材	80,200	1,520,592.00	0.30
82	300454	深信服	15,700	1,510,340.00	0.30
83	000683	博源化工	261,800	1,507,968.00	0.30
84	688041	海光信息	3,992	1,478,237.60	0.29
85	300432	富临精工	73,500	1,476,615.00	0.29
86	002028	思源电气	8,400	1,453,200.00	0.29
87	600547	山东黄金	61,200	1,413,108.00	0.28
88	002353	杰瑞股份	9,200	1,403,000.00	0.28
89	000807	云铝股份	62,900	1,392,606.00	0.28
90	000975	山金国际	81,100	1,378,700.00	0.27
91	600000	浦发银行	159,500	1,373,295.00	0.27
92	002281	光迅科技	5,300	1,361,782.00	0.27
93	002050	三花智控	31,000	1,358,730.00	0.27
94	688166	博瑞医药	38,500	1,347,885.00	0.27
95	300274	阳光电源	8,200	1,303,964.00	0.26
96	601857	中国石油	146,900	1,275,092.00	0.25
97	300059	东方财富	62,400	1,271,712.00	0.25
98	600900	长江电力	47,500	1,257,325.00	0.25
99	000568	泸州老窖	16,200	1,255,824.00	0.25
100	002241	歌尔股份	54,100	1,218,873.00	0.24
101	300604	长川科技	3,500	1,194,970.00	0.24
102	002600	领益智造	68,500	1,187,790.00	0.23
103	601127	赛力斯	19,100	1,169,875.00	0.23
104	688396	华润微	11,984	1,169,039.20	0.23
105	601100	恒立液压	10,800	1,161,648.00	0.23
106	688469	芯联集成	108,421	1,150,346.81	0.23
107	601211	国泰海通	62,300	1,133,860.00	0.22
108	300450	先导智能	27,800	1,132,016.00	0.22
109	002625	光启技术	37,300	1,130,936.00	0.22
110	600989	宝丰能源	54,700	1,112,051.00	0.22
111	603659	璞泰来	38,400	1,110,912.00	0.22
112	600276	恒瑞医药	21,200	1,103,248.00	0.22
113	600938	中国海油	40,600	1,102,290.00	0.22
114	600089	特变电工	47,800	1,075,500.00	0.21
115	688266	泽璟制药	9,161	1,068,722.26	0.21
116	000963	华东医药	38,000	1,068,560.00	0.21
117	300012	华测检测	77,000	1,067,220.00	0.21
118	300073	当升科技	22,200	1,066,488.00	0.21
119	002709	天赐材料	20,600	1,059,458.00	0.21
120	002271	东方雨虹	89,200	1,058,804.00	0.21
121	002273	水晶光电	29,600	1,050,208.00	0.21
122	300207	欣旺达	55,028	1,044,981.72	0.21
123	002414	高德红外	78,800	1,044,888.00	0.21

124	000977	浪潮信息	14,900	1,043,000.00	0.21
125	600418	江淮汽车	40,300	1,040,949.00	0.21
126	300033	同花顺	4,280	1,031,480.00	0.20
127	300866	安克创新	9,800	1,024,100.00	0.20
128	300803	指南针	10,900	999,203.00	0.20
129	000617	中油资本	150,500	991,795.00	0.20
130	002025	航天电器	12,900	983,238.00	0.19
131	688122	西部超导	15,562	977,449.22	0.19
132	002008	大族激光	6,500	975,715.00	0.19
133	600699	均胜电子	44,700	965,967.00	0.19
134	601360	三六零	111,100	965,459.00	0.19
135	000786	北新建材	53,300	964,197.00	0.19
136	000100	TCL 科技	162,900	948,078.00	0.19
137	000035	中国天楹	194,600	939,918.00	0.19
138	000039	中集集团	114,900	931,839.00	0.18
139	688472	阿特斯	83,615	904,714.30	0.18
140	600570	恒生电子	42,200	894,218.00	0.18
141	002244	滨江集团	117,200	890,720.00	0.18
142	002851	麦格米特	5,300	886,054.00	0.18
143	600160	巨化股份	16,700	885,267.00	0.17
144	002371	北方华创	1,000	884,560.00	0.17
145	601689	拓普集团	15,300	863,226.00	0.17
146	600028	中国石化	193,400	862,564.00	0.17
147	300724	捷佳伟创	12,200	861,320.00	0.17
148	000960	锡业股份	20,100	858,069.00	0.17
149	002738	中矿资源	14,500	855,355.00	0.17
150	600426	华鲁恒升	35,100	839,592.00	0.17
151	600258	首旅酒店	76,600	836,472.00	0.17
152	002517	恺英网络	51,400	835,250.00	0.17
153	601225	陕西煤业	40,500	824,175.00	0.16
154	600886	国投电力	61,800	822,558.00	0.16
155	603806	福斯特	48,800	819,352.00	0.16
156	601728	中国电信	157,400	816,906.00	0.16
157	002812	恩捷股份	12,200	816,302.00	0.16
158	600323	瀚蓝环境	29,700	815,562.00	0.16
159	002156	通富微电	10,700	811,809.00	0.16
160	688017	绿的谐波	1,903	795,187.58	0.16
161	600486	扬农化工	15,200	770,640.00	0.15
162	000858	五粮液	10,400	769,600.00	0.15
163	601117	中国化学	102,200	751,170.00	0.15
164	300661	圣邦股份	5,100	731,748.00	0.14
165	600050	中国联通	181,600	726,400.00	0.14
166	601985	中国核电	78,800	711,564.00	0.14

167	600166	福田汽车	244,100	710,331.00	0.14
168	300054	鼎龙股份	6,700	709,999.00	0.14
169	600460	士兰微	12,900	705,114.00	0.14
170	002460	赣锋锂业	10,500	686,700.00	0.14
171	002466	天齐锂业	11,100	680,652.00	0.13
172	300438	鹏辉能源	8,100	671,085.00	0.13
173	000938	紫光股份	23,100	666,666.00	0.13
174	600879	航天电子	31,000	659,990.00	0.13
175	002074	国轩高科	23,700	651,987.00	0.13
176	002179	中航光电	14,100	651,420.00	0.13
177	600031	三一重工	37,500	648,000.00	0.13
178	300223	北京君正	2,600	647,140.00	0.13
179	601168	西部矿业	23,700	643,218.00	0.13
180	601000	唐山港	153,200	635,780.00	0.13
181	301308	江波龙	900	633,420.00	0.13
182	600372	中航机载	57,900	628,215.00	0.12
183	002436	兴森科技	12,200	621,590.00	0.12
184	002138	顺络电子	8,500	621,350.00	0.12
185	003816	中国广核	156,600	612,306.00	0.12
186	600515	海南机场	218,400	598,416.00	0.12
187	600406	国电南瑞	26,100	596,385.00	0.12
188	000725	京东方 A	68,700	596,316.00	0.12
189	603833	欧派家居	19,800	596,178.00	0.12
190	603816	顾家家居	25,900	579,124.00	0.11
191	688213	思特威	5,408	579,034.56	0.11
192	688390	固德威	5,268	571,630.68	0.11
193	600497	驰宏锌锗	47,100	570,381.00	0.11
194	600535	天士力	43,000	568,890.00	0.11
195	002821	凯莱英	3,500	567,000.00	0.11
196	300759	康龙化成	19,400	561,242.00	0.11
197	300458	全志科技	14,000	552,440.00	0.11
198	300339	润和软件	14,100	542,991.00	0.11
199	002389	航天彩虹	30,500	541,985.00	0.11
200	002340	格林美	81,500	538,715.00	0.11
201	000032	深桑达 A	21,400	533,930.00	0.11
202	002891	中宠股份	19,600	523,712.00	0.10
203	002195	岩山科技	79,800	521,892.00	0.10
204	300001	特锐德	13,700	518,271.00	0.10
205	600019	宝钢股份	94,444	512,830.92	0.10
206	600115	中国东航	134,400	512,064.00	0.10
207	300037	新宙邦	5,500	510,675.00	0.10
208	603288	海天味业	15,400	510,664.00	0.10
209	300017	网宿科技	39,000	507,390.00	0.10

210	600011	华能国际	66,700	506,253.00	0.10
211	603650	彤程新材	5,000	489,900.00	0.10
212	600674	川投能源	34,500	488,865.00	0.10
213	002432	九安医疗	6,900	487,692.00	0.10
214	000034	神州数码	17,180	476,745.00	0.09
215	300496	中科创达	7,700	475,783.00	0.09
216	600588	用友网络	51,200	470,016.00	0.09
217	600066	宇通客车	17,500	469,175.00	0.09
218	002938	鹏鼎控股	4,400	463,672.00	0.09
219	688235	百济神州	1,816	462,371.76	0.09
220	002131	利欧股份	96,800	459,800.00	0.09
221	600415	小商品城	44,900	456,184.00	0.09
222	688617	惠泰医疗	2,502	454,263.12	0.09
223	601668	中国建筑	104,100	451,794.00	0.09
224	000738	航发控制	24,500	448,105.00	0.09
225	301550	斯菱智驱	4,900	448,007.00	0.09
226	600312	平高电气	25,200	445,032.00	0.09
227	600580	卧龙电驱	13,400	443,540.00	0.09
228	002444	巨星科技	14,200	441,620.00	0.09
229	000657	中钨高新	4,600	440,312.00	0.09
230	601567	三星电气	29,000	433,260.00	0.09
231	300699	光威复材	15,100	432,615.00	0.09
232	600941	中国移动	5,000	430,650.00	0.09
233	688188	柏楚电子	3,965	423,065.50	0.08
234	001979	招商蛇口	65,700	422,451.00	0.08
235	000630	铜陵有色	65,600	417,216.00	0.08
236	002318	久立特材	17,200	411,080.00	0.08
237	600816	建元信托	167,700	409,188.00	0.08
238	601155	新城控股	39,200	402,192.00	0.08
239	300760	迈瑞医疗	2,900	393,907.00	0.08
240	300457	赢合科技	18,300	385,764.00	0.08
241	002544	普天科技	21,100	384,442.00	0.08
242	601088	中国神华	9,800	382,592.00	0.08
243	002594	比亚迪	4,700	374,590.00	0.07
244	000988	华工科技	2,000	369,220.00	0.07
245	601216	君正集团	82,600	368,396.00	0.07
246	600741	华域汽车	23,700	367,824.00	0.07
247	600988	赤峰黄金	13,900	365,848.00	0.07
248	600392	盛和资源	12,200	363,194.00	0.07
249	002044	美年健康	72,200	363,166.00	0.07
250	300763	锦浪科技	4,000	361,400.00	0.07
251	600584	长电科技	3,400	352,070.00	0.07
252	300409	道氏技术	17,600	350,768.00	0.07

253	601658	邮储银行	71,000	350,030.00	0.07
254	300677	英科医疗	8,900	348,613.00	0.07
255	601727	上海电气	49,600	347,200.00	0.07
256	000063	中兴通讯	9,300	336,567.00	0.07
257	301078	孩子王	49,700	335,972.00	0.07
258	600352	浙江龙盛	27,706	335,519.66	0.07
259	300142	沃森生物	24,500	318,255.00	0.06
260	688009	中国通号	65,213	310,413.88	0.06
261	600325	华发股份	134,100	309,771.00	0.06
262	600219	南山铝业	76,100	303,639.00	0.06
263	600008	首创环保	107,600	292,672.00	0.06
264	603019	中科曙光	2,700	289,521.00	0.06
265	688120	华海清科	897	288,995.46	0.06
266	688063	派能科技	5,408	288,084.16	0.06
267	000519	中兵红箭	13,300	280,231.00	0.06
268	300433	蓝思科技	5,200	279,032.00	0.06
269	000878	云南铜业	17,400	276,312.00	0.05
270	601816	京沪高铁	60,600	274,518.00	0.05
271	600859	王府井	29,100	267,138.00	0.05
272	601877	正泰电器	10,600	265,742.00	0.05
273	000415	渤海租赁	64,300	261,701.00	0.05
274	600690	海尔智家	12,101	246,981.41	0.05
275	300390	天华新能	2,600	243,126.00	0.05
276	300136	信维通信	2,000	238,500.00	0.05
277	002422	科伦药业	6,000	231,120.00	0.05
278	601677	明泰铝业	13,900	230,740.00	0.05
279	603501	豪威集团	2,400	227,640.00	0.04
280	300442	润泽科技	2,700	224,289.00	0.04
281	000301	东方盛虹	19,500	223,275.00	0.04
282	002065	东华软件	30,300	216,342.00	0.04
283	601919	中远海控	16,200	214,812.00	0.04
284	300972	万辰集团	1,200	208,092.00	0.04
285	002352	顺丰控股	6,100	190,686.00	0.04
286	300757	罗博特科	300	185,700.00	0.04
287	002714	牧原股份	5,300	185,447.00	0.04
288	002497	雅化集团	9,100	185,367.00	0.04
289	601628	中国人寿	5,200	183,820.00	0.04
290	601766	中国中车	34,300	178,360.00	0.04
291	603979	金诚信	3,000	177,090.00	0.03
292	688347	华虹宏力	521	175,212.30	0.03
293	688521	芯原股份	468	173,693.52	0.03
294	600660	福耀玻璃	3,400	171,496.00	0.03
295	688777	中控技术	1,448	170,140.00	0.03

296	002230	科大讯飞	4,100	167,444.00	0.03
297	002202	金风科技	6,700	160,130.00	0.03
298	002837	英维克	2,010	159,915.60	0.03
299	300567	精测电子	500	158,800.00	0.03
300	600803	新奥股份	9,900	156,420.00	0.03
301	600754	锦江酒店	8,500	152,915.00	0.03
302	002064	华峰化学	15,700	148,993.00	0.03
303	300346	南大光电	1,500	138,975.00	0.03
304	600585	海螺水泥	7,800	132,210.00	0.03
305	600153	建发股份	15,900	126,087.00	0.02
306	688271	联影医疗	1,234	124,917.82	0.02
307	601006	大秦铁路	26,600	122,626.00	0.02
308	300782	卓胜微	1,100	120,538.00	0.02
309	600667	太极实业	4,000	116,720.00	0.02
310	688169	石头科技	1,210	114,913.70	0.02
311	600118	中国卫星	1,400	114,870.00	0.02
312	600010	宝钢股份	51,500	114,845.00	0.02
313	688126	沪硅产业	2,838	113,207.82	0.02
314	300751	迈为股份	400	112,984.00	0.02
315	601319	中国人保	16,200	109,512.00	0.02
316	000538	云南白药	2,304	109,140.48	0.02
317	601390	中国中铁	25,900	108,003.00	0.02
318	002001	新和成	3,800	107,996.00	0.02
319	688525	佰维存储	218	107,851.14	0.02
320	300395	菲利华	800	106,984.00	0.02
321	300316	晶盛机电	1,700	102,680.00	0.02
322	603129	春风动力	400	102,320.00	0.02
323	601179	中国西电	6,700	99,964.00	0.02
324	300015	爱尔眼科	11,900	98,294.00	0.02
325	600398	海澜之家	18,700	97,801.00	0.02
326	601669	中国电建	19,900	93,530.00	0.02
327	603939	益丰药房	5,200	93,496.00	0.02
328	302132	中航成飞	1,600	93,312.00	0.02
329	002080	中材科技	1,000	90,000.00	0.02
330	688506	百利天恒	301	88,503.03	0.02
331	688099	晶晨股份	820	84,378.00	0.02
332	600885	宏发股份	2,400	82,776.00	0.02
333	600111	北方稀土	1,700	81,685.00	0.02
334	600436	片仔癀	700	76,496.00	0.02
335	000157	中联重科	10,700	74,579.00	0.01
336	600760	中航沈飞	1,800	73,980.00	0.01
337	002129	TCL 中环	6,000	72,120.00	0.01
338	601111	中国国航	11,900	71,995.00	0.01

339	601633	长城汽车	4,700	70,923.00	0.01
340	600018	上港集团	14,600	68,912.00	0.01
341	688036	传音控股	1,150	67,792.50	0.01
342	600905	三峡能源	18,100	67,151.00	0.01
343	002648	卫星化学	2,700	63,423.00	0.01
344	601868	中国能建	23,300	62,211.00	0.01
345	688047	龙芯中科	371	57,382.57	0.01
346	600029	南方航空	9,500	49,210.00	0.01
347	002236	大华股份	2,900	47,821.00	0.01
348	600795	国电电力	10,200	47,634.00	0.01
349	601800	中国交建	8,100	46,251.00	0.01
350	001965	招商公路	69	632.04	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688795	摩尔线程	4,479	3,032,014.26	0.60
2	688802	沐曦股份	3,195	2,456,603.55	0.49
3	688797	臻宝科技	1,932	1,290,333.16	0.26
4	600113	浙江东日	29,600	982,128.00	0.19
5	300991	创益通	22,200	781,662.00	0.15
6	001309	德明利	800	754,320.00	0.15
7	300213	佳讯飞鸿	116,900	708,414.00	0.14
8	605358	立昂微	8,100	628,560.00	0.12
9	301188	力诺药包	9,300	622,170.00	0.12
10	600563	法拉电子	3,100	591,480.00	0.12
11	688308	欧科亿	2,873	522,340.13	0.10
12	688182	灿勤科技	11,442	492,806.94	0.10
13	301389	隆扬电子	5,000	433,950.00	0.09
14	603186	华正新材	1,900	428,070.00	0.08
15	605020	永和股份	10,000	407,200.00	0.08
16	603516	淳中科技	3,000	403,830.00	0.08
17	688258	卓易信息	3,125	370,437.50	0.07
18	301666	大普微	793	367,420.69	0.07
19	601061	中信金属	34,100	367,257.00	0.07
20	600391	航发科技	10,900	364,605.00	0.07
21	688717	艾罗能源	4,272	352,739.04	0.07
22	605196	华通线缆	13,500	352,350.00	0.07
23	603031	安孚科技	6,600	351,450.00	0.07
24	603223	恒通股份	26,800	349,740.00	0.07
25	688710	益诺思	5,139	345,340.80	0.07

26	300628	亿联网络	10,200	344,964.00	0.07
27	000417	合百集团	38,400	336,000.00	0.07
28	688045	必易微	4,103	331,440.34	0.07
29	001208	华菱线缆	23,100	327,789.00	0.06
30	688221	前沿生物	14,494	324,665.60	0.06
31	603198	迎驾贡酒	10,800	319,680.00	0.06
32	688539	高华科技	9,733	310,288.04	0.06
33	002045	国光电器	39,300	308,505.00	0.06
34	688275	万润新能	2,315	295,278.25	0.06
35	605060	联德股份	5,200	295,048.00	0.06
36	300822	贝仕达克	25,100	293,670.00	0.06
37	300940	南极光	19,300	291,044.00	0.06
38	300032	金龙机电	74,200	281,960.00	0.06
39	300774	倍杰特	24,800	266,600.00	0.05
40	301072	中捷精工	6,500	266,565.00	0.05
41	605186	健麾信息	8,400	263,424.00	0.05
42	603095	越剑智能	18,300	262,056.00	0.05
43	301068	大地海洋	10,800	257,040.00	0.05
44	002403	爱仕达	28,800	256,896.00	0.05
45	300698	万马科技	9,400	255,680.00	0.05
46	000701	厦门信达	56,600	250,738.00	0.05
47	001248	华润新能源	23,605	238,646.55	0.05
48	688293	奥浦迈	5,596	233,297.24	0.05
49	603933	睿能科技	10,000	225,500.00	0.04
50	001399	惠科股份	6,568	223,303.64	0.04
51	300254	仟源医药	26,900	215,469.00	0.04
52	300844	山水比德	9,500	210,995.00	0.04
53	688808	联讯仪器	133	210,715.89	0.04
54	001336	楚环科技	9,200	202,584.00	0.04
55	688781	视涯科技	4,752	200,344.32	0.04
56	600498	烽火通信	2,500	184,000.00	0.04
57	002409	雅克科技	800	179,600.00	0.04
58	002949	华阳国际	17,900	177,031.00	0.03
59	002716	湖南白银	21,700	175,553.00	0.03
60	002328	新朋股份	23,600	173,224.00	0.03
61	000526	学大教育	6,700	170,046.00	0.03
62	688809	强一股份	259	161,357.00	0.03
63	000603	盛达资源	6,800	157,080.00	0.03
64	603936	博敏电子	5,500	146,905.00	0.03
65	300285	国瓷材料	1,300	134,134.00	0.03
66	603931	格林达	2,100	124,740.00	0.02
67	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.02
68	688309	恒誉环保	1,800	109,584.00	0.02

69	688820	盛合晶微	714	101,023.86	0.02
70	600637	东方明珠	10,700	88,917.00	0.02
71	603269	海鸥股份	3,360	55,339.20	0.01
72	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
73	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
74	688609	九联科技	4,649	51,185.49	0.01
75	688796	百奥赛图	423	46,276.20	0.01
76	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
77	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
78	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
79	603459	红板科技	330	27,825.60	0.01
80	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
81	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
82	001365	天海电子	529	16,562.99	0.00
83	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
84	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
85	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
86	001393	维通利	374	14,582.26	0.00
87	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
88	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
89	001237	惠康科技	220	12,922.80	0.00
90	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
91	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
92	601112	振石股份	609	10,712.31	0.00
93	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
94	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
95	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
96	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
97	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
98	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	300308	中际旭创	19,405,040.00	2.59
2	000792	盐湖股份	17,643,224.28	2.36
3	002415	海康威视	17,221,641.00	2.30
4	300502	新易盛	17,055,711.00	2.28
5	601398	工商银行	16,049,586.00	2.15
6	002532	天山铝业	15,698,881.02	2.10

7	603986	兆易创新	15,670,213.00	2.09
8	688008	澜起科技	14,991,691.02	2.00
9	600150	中国船舶	14,870,925.88	1.99
10	300014	亿纬锂能	14,758,002.31	1.97
11	688111	金山办公	14,615,055.57	1.95
12	300750	宁德时代	14,263,135.60	1.91
13	601899	紫金矿业	14,053,610.00	1.88
14	002475	立讯精密	14,035,888.00	1.88
15	000408	藏格矿业	13,152,580.00	1.76
16	603259	药明康德	12,914,025.00	1.73
17	600346	恒力石化	12,493,653.00	1.67
18	600030	中信证券	12,195,899.00	1.63
19	600489	中金黄金	11,805,007.00	1.58
20	601318	中国平安	11,748,263.00	1.57

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	300750	宁德时代	31,225,626.58	4.17
2	601318	中国平安	29,748,053.00	3.98
3	300308	中际旭创	23,064,616.00	3.08
4	601899	紫金矿业	20,454,172.00	2.73
5	000792	盐湖股份	20,046,489.40	2.68
6	002475	立讯精密	19,613,205.00	2.62
7	300502	新易盛	19,181,511.00	2.56
8	002415	海康威视	18,425,611.62	2.46
9	603986	兆易创新	17,752,830.00	2.37
10	600519	贵州茅台	17,422,186.18	2.33
11	601398	工商银行	16,997,042.00	2.27
12	688008	澜起科技	16,667,633.85	2.23
13	601601	中国太保	16,328,038.20	2.18
14	600036	招商银行	16,193,348.40	2.16
15	600183	生益科技	15,851,808.81	2.12
16	002916	深南电路	15,551,033.00	2.08
17	603259	药明康德	15,516,787.80	2.07
18	601166	兴业银行	14,869,088.00	1.99
19	000338	潍柴动力	14,688,466.68	1.96
20	300014	亿纬锂能	13,250,684.59	1.77

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	2,555,031,718.83
卖出股票收入（成交）总额	2,893,142,892.58

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）	7,000.32	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,000.32	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	113704	春风转债	70	7,000.32	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。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，以达到降低投资组合整体风险的目的。

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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.12 投资组合报告附注

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

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

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	7,405,009.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,405,009.20

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	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	3,032,014.26	0.60	新股锁定期
2	688802	沐曦股份	2,456,603.55	0.49	新股锁定期
3	688797	臻宝科技	90,921.98	0.02	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

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
南方中证 A500 指数增强 A	3,638	73,306.74	53,713,327.38	20.14%	212,976,580.05	79.86%
南方中证 A500 指数增强 C	4,920	31,987.89	3,502,240.90	2.23%	153,878,183.60	97.77%
合计	8,558	49,552.50	57,215,568.28	13.49%	366,854,763.65	86.51%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方中证 A500 指数增强 A	82,515.81	0.0309%
	南方中证 A500 指数增强 C	462.32	0.0003%
	合计	82,978.13	0.0196%

注：分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方中证 A500 指数增强 A	南方中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日(2025 年 9 月 9 日)基金份额总额	1,190,231,227.71	533,405,502.46
本报告期期初基金份额总额	516,910,025.20	206,460,411.67
本报告期基金总申购份额	318,952,716.52	202,073,170.26
减：本报告期基金总赎回份额	569,172,834.29	251,153,157.43
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	266,689,907.43	157,380,424.50

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内无涉及基金财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			额的比例			
华泰证券	3	5,445,920,758.49	100.00%	544,055.72	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证券综合研究服务协议后将其入库，并对入库的证券公司开展动态管理，定期检视其是否持续符合选择标准；

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

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	655,098.95	100.00%	-	-	-	-

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	关于南方基金管理股份有限公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-21
2	南方基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
3	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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-11
4	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会	2026-04-24

		会基金电子披露网站	
5	南方基金管理股份有限公司成都分公司工商注册信息变更公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-28
6	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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-12
7	关于南方基金管理股份有限公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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
机构	1	20260416-20260511	-	162,818,080.40	162,818,080.40	-	-
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 指数增强型证券投资基金的文件；
- 2、《南方中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方中证 A500 指数增强型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 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>