

南方中证 500 增强策略交易型开放式 指数证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 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。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§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	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 审计报告	13
6.1 审计报告基本信息	13
6.2 审计报告的基本内容	13
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	18
7.4 报表附注	20
§8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	49
8.3 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	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
8.6 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.....	70
8.7 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.....	70
8.8 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.....	70
8.9 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.....	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
8.12 投资组合报告附注.....	70
§9 基金份额持有人信息.....	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	72
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
9.4 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.....	72
§10 开放式基金份额变动.....	72
§11 重大事件揭示.....	73
11.1 基金份额持有人大会决议.....	73
11.2 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.....	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
11.4 基金投资策略的改变.....	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
11.8 其他重大事件.....	75
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
12.1 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.....	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
§13 备查文件目录.....	77
13.1 备查文件目录.....	77
13.2 存放地点.....	77
13.3 查阅方式.....	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 500 增强策略 ETF
场内简称	中证 500 增强 ETF
基金主代码	560100
交易代码	560100
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 1 月 26 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	104,580,333.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2022 年 2 月 16 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强策略交易型开放式指数证券投资基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.5%。
投资策略	本基金主要通过量化投资模型，在控制组合跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。主要投资策略包括：1、以增强指数投资收益为目的的股票投资策略；2、金融衍生品投资策略；3、债券投资策略；4、转融通证券出借业务投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、存托凭证投资策略
业绩比较基准	比较基准的标的指数：中证 500 指数 本基金的业绩比较基准：中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，一般而言，其风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革
	联系电话	0755-82763888
		郭明
		010-66105799

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年 1 月 26 日 -2022 年 12 月 31 日
本期已实现收益	8,850,474.39	-3,683,327.86	-7,926,165.23
本期利润	12,391,396.33	-2,301,712.23	-12,243,202.30
加权平均基金份额本期利润	0.1050	-0.0187	-0.0615
本期加权平均净值利润率	12.00%	-2.02%	-6.42%
本期基金份额净值增长率	9.98%	-3.87%	-9.76%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	-4,795,394.57	-17,230,140.90	-13,425,273.46
期末可供分配基金份额利润	-0.0459	-0.1325	-0.0976
期末基金资产净值	99,784,938.43	112,850,192.10	124,155,059.54
期末基金份额净值	0.9541	0.8675	0.9024
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	-4.59%	-13.25%	-9.76%

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

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

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

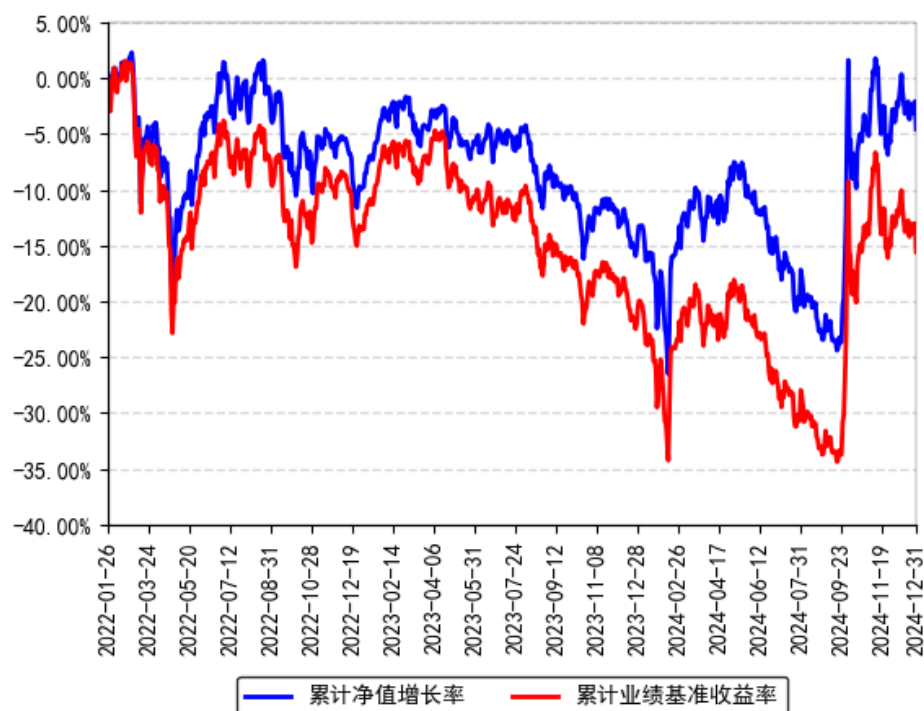
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-0.78%	1.85%	-0.30%	2.03%	-0.48%	-0.18%
过去六个月	12.74%	1.87%	15.84%	2.01%	-3.10%	-0.14%
过去一年	9.98%	1.69%	5.46%	1.82%	4.52%	-0.13%
自基金合同 生效起至今	-4.59%	1.32%	-15.58%	1.41%	10.99%	-0.09%

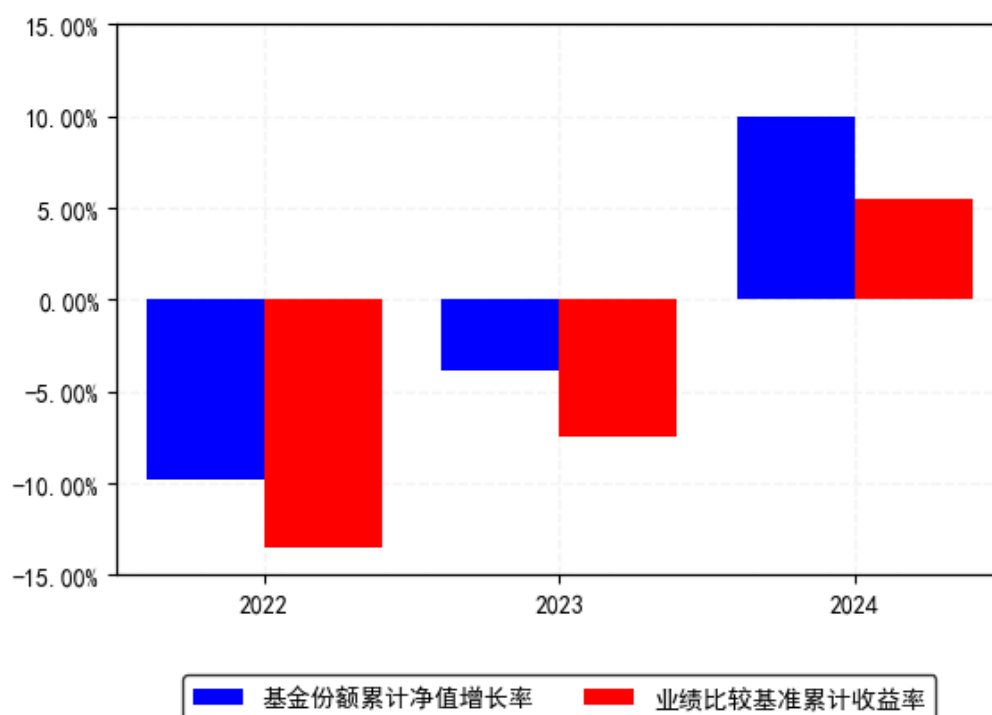
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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500增强策略ETF每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2022 年 1 月 26 日成立，自基金合同生效日以来未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
崔蕾	本基金 基金经 理	2022 年 1 月 26 日	-	9 年	女，康奈尔大学金融工程硕士，具有基金从业资格。2015 年 2 月加入南方基金，历任量化投资部助理研究员、研究员，指数投资部研究员；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 4 月 23 日，任南方小康 ETF、南方小康 ETF 联接基金经理；2019 年 6 月 28 日至 2022 年 2 月 18 日，任大数据 300 基金经理；2020 年 3 月 26 日至 2023 年 3 月 27 日，任南方粤港澳大湾区联接基金经理；2019 年 11 月 29 日至 2023 年 7 月 4 日，任南方粤港澳大湾区 ETF 基金经理；2018 年 11 月 8 日至 2023 年 12 月 29 日，任南方中证 500 增强基金经理；2022 年 12 月 1 日至 2023 年 12 月 29 日，任南方上证科创板 50 成份增强策略 ETF

					基金经理: 2019 年 6 月 12 日至今, 任南方顶峰 TOPIX ETF (QDII) 基金经理; 2019 年 7 月 12 日至今, 任有色金属、南方有色金属联接、1000ETF 基金经理; 2020 年 1 月 17 日至今, 任红利 50 基金经理; 2020 年 1 月 21 日至今, 任南方大盘红利 50 基金经理; 2021 年 6 月 24 日至今, 任南方中证科创创业 50ETF 基金经理; 2021 年 8 月 19 日至今, 任南方中证科创创业 50ETF 联接基金经理; 2021 年 9 月 27 日至今, 任南方中证 1000 联接基金经理; 2021 年 12 月 29 日至今, 任南方国证在线消费 ETF 基金经理; 2022 年 1 月 26 日至今, 任南方中证 500 增强策略 ETF 基金经理; 2022 年 11 月 23 日至今, 任南方国证交通运输行业 ETF 基金经理; 2023 年 11 月 24 日至今, 任南方国证交通运输行业 ETF 发起联接基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定, 针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动, 以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节, 建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则, 投资管理制度和细则, 集中交易管理办法, 公平交易操作指引, 异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执

行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 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《证券投资基金管理人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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，建立和完善了兼任相关的制度及流程，确保兼任基金经理公平对待其管理的所有投资组合。通过对基金经理的投资交易行为进行监控和分析，本报告期内，两两组合间各项操作、流程及事后分析均正常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.3 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 129 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内指数涨跌幅 5.46%，产品净值涨跌幅 9.98%，超额收益 4.52%。2024 年在经济整体弱复苏的大背景下，A 股市场主线行情不明显，风险偏好较弱，市场情绪不明确且各类风格轮动较快。

在当前市场未完全明确主线行情的背景下，本基金在风格和行业的配置上维持相对均衡比例，并紧密跟踪市场动态，及时调整持仓。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.9541 元，报告期内，份额净值增长率为 9.98%，同期业绩基准增长率为 5.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年以来，宏观层面上，随着稳增长政策持续发力，我国经济整体保持复苏趋势，货币政策总体仍保持宽松，流动性保持合理充裕，后续经济基本面底部反弹有望为中小盘板块弹性修复提供基础。政策层面上，促进新质生产力发展是未来国家发展主方向之一，也是政策支持的重点领域，集中在专精特新和战略新兴产业领域的中小企业或迎来重要发展机遇。

本基金为增强策略交易型开放式指数证券投资基金，作为基金管理人，我们将在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求、自律规则和业务发展情况，严格遵守包括《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》在内的公募基金行业各项法律法规及其他规范要求，有效落实了 2024 年度发布的《关于加强证券公司和公募基金监管加快推进建设一流投资银行和投资机构的意见（试行）》《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》和《证券市场程序化交易管理规定（试行）》等公募基金相关新法律法规。

本基金管理人坚持从保护基金份额持有人利益出发，树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础、合规为先、行稳致远”的合规理念。严守合规底线，持续优化内控和合规管理机制，将合规管理全面深度嵌入各项流程与业务，强化业务风险的防范与管控，努力做到风险“早识别、早预警、早处置”，确保各项法规和管理制度的落实，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人结合新法规、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系制度及业务流程，制订和修订了包括公司《合规手册》《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》《程序化交易管理规定》《投资管理制度》《投资者适当性管理制度》等一系列与监察稽核和合规内控相关的公司管理制度。

在进一步优化制度体系的基础上，本基金管理人贯彻“合规为先，行稳致远”的合规理念，推进落实全面风险管理与全员合规管理要求，持续优化合规及内控管理机制，全面排查风险并针对性完善优化，在投资、销售、运营、合规风控等领域加强管控，大力推进公司廉洁从业合规文化建设，着力创新丰富文化宣传方式，强化廉洁从业及人员管理，优化员工行为管理机制，加强规范检查力度并严格问责；紧跟监管形势，对投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务和相关部门严细深开展各类稽核检查，通过专项稽核和合规检查识别问题、防范风险；根据监管和市场形势并结合业务发展实际情况、各类组合或业务特点，持续完善投资合规风控管理机制，提升系统化监控效能，落实事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，为投资业务平稳合规发展提供保障；全面履行新产品、新业务合规评估程序，保障各类新产品、新业务合规开展，积极响应监管政策要求，不断强化销售合规风险管控，督促完善投资者适当性管理等各项制度机制；加强信息披露专项管理，保障所披露信息

的真实性、准确性和完整性，落实提升投资者获得感，持续加强投资者教育及保护力度，开展各类监管组织的投教活动，监督和落实客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人高度重视反洗钱相关工作，贯彻风险为本，自评估驱动，持续落实反洗钱风险管控。从制度建设、系统功能建设、业务流程规范、宣传培训、监督检查等方面入手，推动反洗钱内控管理依据新《反洗钱法》完善，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程，有效提升了公司反洗钱工作的合规水平。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全各项管理制度，不断提高监察稽核及合规管理工作的科学性和有效性，坚持“看不清管不住则不展业”，落实全面风险管理与全员合规管理要求，持续推进合规数智化在更广更深的范围应用及融合，努力防范和管理各类风险，覆盖各类业务、场景及人员，切实维护基金资产的安全与利益。

4.7 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、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。

4.8 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。

4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2024 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2025）审字第 70027797_H119 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会

	计准则的规定编制，公允反映了南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充

	分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	高 鹤	邓 雯
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层	
审计报告日期	2025 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	3,459,984.89	1,656,911.31
结算备付金		3,968,511.67	1,671,503.63
存出保证金		982,429.39	418,301.74
交易性金融资产	7.4.7.2	91,659,015.75	109,370,625.63

其中：股票投资		91,651,015.50	109,367,925.43
基金投资		-	-
债券投资		8,000.25	2,700.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		190,342.00	248,657.57
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		100,260,283.70	113,365,999.88
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.03	1,010.88
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		46,559.40	44,522.74
应付托管费		4,655.93	4,452.27
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		50,916.73	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	373,213.18	465,821.89
负债合计		475,345.27	515,807.78
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	104,580,333.00	130,080,333.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-4,795,394.57	-17,230,140.90
净资产合计		99,784,938.43	112,850,192.10

负债和净资产总计		100,260,283.70	113,365,999.88
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9541 元，基金份额总额 104,580,333.00 份。

7.2 利润表

会计主体：南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		13,127,944.52	-1,526,314.71
1.利息收入		76,897.84	63,136.49
其中：存款利息收入	7.4.7.9	76,897.84	63,136.49
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）		9,290,387.07	-3,146,736.18
其中：股票投资收益	7.4.7.10	5,199,412.34	-4,571,138.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	9,123.59	33,708.38
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	1,875,127.83	-870,661.84
股利收益	7.4.7.13	2,206,723.31	2,261,355.58
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）	7.4.7.14	3,540,921.94	1,381,615.63
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.15	219,737.67	175,669.35
减：二、营业总支出		736,548.19	775,397.52

1.管理人报酬	7.4.10.2.1	517,669.59	572,577.97
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	51,766.89	57,257.83
3.销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		6,761.25	213.24
8.其他费用	7.4.7.16	160,350.46	145,348.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,391,396.33	-2,301,712.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,391,396.33	-2,301,712.23
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		12,391,396.33	-2,301,712.23

7.3 净资产变动表

会计主体：南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	130,080,333.00	-	-17,230,140.90	112,850,192.10
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	130,080,333.00	-	-17,230,140.90	112,850,192.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-25,500,000.00	-	12,434,746.33	-13,065,253.67
（一）、综合收益总额	-	-	12,391,396.33	12,391,396.33
（二）、本期基金份额交易产生的	-25,500,000.00	-	43,350.00	-25,456,650.00

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中: 1.基金申购 款	192,000,000.00	-	-26,833,566.38	165,166,433.62
2.基金赎 回款	-217,500,000.00	-	26,876,916.38	-190,623,083.62
(三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的净 资产变动(净资 产减少以“-”号 填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合 收益结转留存收 益	-	-	-	-
四、本期期末净 资产	104,580,333.00	-	-4,795,394.57	99,784,938.43
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产	137,580,333.00	-	-13,425,273.46	124,155,059.54
加: 会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净 资产	137,580,333.00	-	-13,425,273.46	124,155,059.54
三、本期增减变 动额(减少以“-” 号填列)	-7,500,000.00	-	-3,804,867.44	-11,304,867.44
(一)、综合收益 总额	-	-	-2,301,712.23	-2,301,712.23
(二)、本期基金 份额交易产生的 净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)	-7,500,000.00	-	-1,503,155.21	-9,003,155.21
其中: 1.基金申购 款	292,500,000.00	-	-20,165,828.32	272,334,171.68
2.基金赎 回款	-300,000,000.00	-	18,662,673.11	-281,337,326.89
(三)、本期向基	-	-	-	-

金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	130,080,333.00	-	-17,230,140.90	112,850,192.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]3580 号《关于准予南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 746,577,500.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0042 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2022 年 1 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 746,580,333.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,833.00 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2022]38 号审核同意，本基金 746,580,333.00 份基金份额于 2022 年 2 月 16 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，力争实现超越目标指数的投资收益。主要投资于标的指数成份股、备选成份股。此外，本基金可少量投资于非成份股(包含主板、创业板及其他经中国证监会核准/注册发行的股票)、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、次级债、可转换债券、可交换债券、

央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可投资存托凭证。基金管理人根据相关规定可参与转融通证券出借业务。本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%, 投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产净值的 80%。每个交易日日终, 在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后, 本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在正常市场情况下, 本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%, 年跟踪误差不超过 6.5%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2025 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制, 同时, 在信息披露和估值方面, 也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度, 即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外, 均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在

估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险,以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括:通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值,以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时,该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时,本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债),按照公允价值进行后续计量,所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债,采用实际利率法,按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满,则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,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;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具,按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值;估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值。

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价;

(2) 不存在活跃市场的金融工具,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值;

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(4) 如有新增事项,按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的

按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）本基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，本基金的基金管理人可进行收益分配。以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则确定收益分配。本基金收益每年最多分配 12 次，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人作为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

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

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

(4) 印花税（如适用）

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	3,459,984.89	1,656,911.31
等于：本金	3,459,559.07	1,656,752.38
加：应计利息	425.82	158.93
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-

加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	3,459,984.89	1,656,911.31

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		90,828,035.00	-	91,651,015.50	822,980.50
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	8,000.00	0.25	8,000.25	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,000.00	0.25	8,000.25	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		90,836,035.00	0.25	91,659,015.75	822,980.50
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		112,292,653.54	-	109,367,925.43	-2,924,728.11
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,700.00	0.20	2,700.20	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,700.00	0.20	2,700.20	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		112,295,353.54	0.20	109,370,625.63	-2,924,728.11

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	8,163,040.00	-	-	-
一股指期货	8,163,040.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,163,040.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 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	3,272,773.33	-	-	-
一股指期货	3,272,773.33	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,272,773.33	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2503	IC2503	7.00	7,945,560.00	-217,480.00
合计				-217,480.00
减：可抵销期货暂收款				-217,480.00
净额				0.00

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的利率/货币/权益/其他衍生工具为国债/外汇/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债/外汇/股指/商品期货投资合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债/外汇/股指/商品期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	30,472.07	8,697.65
其中：交易所市场	30,472.07	8,697.65
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应退退补款	182,531.31	312,124.24
预提费用	160,000.00	145,000.00
应付指数使用费	-	-
可退替代款	209.80	-
合计	373,213.18	465,821.89

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	130,080,333.00	130,080,333.00
本期申购	192,000,000.00	192,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-217,500,000.00	-217,500,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	104,580,333.00	104,580,333.00

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

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-9,250,783.79	-7,979,357.11	-17,230,140.90
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-9,250,783.79	-7,979,357.11	-17,230,140.90

本期利润	8,850,474.39	3,540,921.94	12,391,396.33
本期基金份额交易产生的变动数	359,137.18	-315,787.18	43,350.00
其中：基金申购款	-18,804,716.80	-8,028,849.58	-26,833,566.38
基金赎回款	19,163,853.98	7,713,062.40	26,876,916.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-41,172.22	-4,754,222.35	-4,795,394.57

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	10,711.80	8,742.79
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	65,861.82	53,733.27
其他	324.22	660.43
合计	76,897.84	63,136.49

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,223,338.68	-4,128,891.61
股票投资收益——赎回差价收入	976,073.66	-442,246.69
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	5,199,412.34	-4,571,138.30

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	472,449,809.31	701,514,281.93
减：卖出股票成本总额	467,836,537.15	704,763,054.90
减：交易费用	389,933.48	880,118.64
买卖股票差价收入	4,223,338.68	-4,128,891.61

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	190,623,083.62	281,337,326.89
减：现金支付赎回款总额	83,875,458.62	129,519,234.89
减：赎回股票成本总额	105,771,551.34	152,260,338.69
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	976,073.66	-442,246.69

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	5.47	20.91
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	9,118.12	33,687.47
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	9,123.59	33,708.38

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	51,625.63	191,810.63
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	42,500.00	158,100.00
减：应计利息总额	5.42	20.99
减：交易费用	2.09	2.17
买卖债券差价收入	9,118.12	33,687.47

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

7.4.7.11.3 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.12 衍生工具收益

7.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货-投资收益	1,875,127.83	-870,661.84

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,206,723.31	2,261,355.58
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	2,206,723.31	2,261,355.58

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	3,747,708.61	931,872.60
——股票投资	3,747,708.61	931,872.60
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-206,786.67	449,743.03
——权证投资	-	-
——期货投资	-206,786.67	449,743.03
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	3,540,921.94	1,381,615.63

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	219,737.67	175,669.35
合计	219,737.67	175,669.35

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。

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	25,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	333.00	338.00
其他	17.46	10.48
合计	160,350.46	145,348.48

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司(“厦门国际信托”)	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司(“深圳投资控股”)	基金管理人的股东
厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
南方资本管理有限公司(“南方资本”)	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司(“南方东英”)	基金管理人的子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	286,782,097.77	30.64%	648,483,424.27	46.07%
兴业证券	153,007,623.54	16.35%	508,872,555.96	36.16%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	1,887.60	3.66%	124,728.15	65.03%
兴业证券	-	-	15,665.89	8.17%

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	28,665.08	30.64%	3,500.03	11.49%
兴业证券	15,303.99	16.36%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	64,843.96	46.07%	1,550.16	17.82%
兴业证券	50,899.11	36.16%	4,101.57	47.16%

注：1、上述佣金按协议约定的费率计算，佣金费率参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定；

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣

金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	517,669.59	572,577.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	19,157.27	14,647.86
应支付基金管理人的净管理费	498,512.32	557,930.11

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	51,766.89	57,257.83

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

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

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	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	2,695,400.00	2.58%	1,600,000.00	1.23%

注：本基金其他关联方投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

7.4.10.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	3,459,984.89	10,711.80	1,656,911.31	8,742.79

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。

7.4.10.7 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	688605	先锋精科	网下申购	4,406	49,743.74

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	113066	平煤转债	配债	850	85,000.00
华泰联合	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	1,364	44,357.28

华泰联合	688512	慧智微	网下申购	1,838	38,450.96
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	1,483	28,473.60
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合	127100	神码转债	配债	27	2,700.00
兴业证券,华泰联合	688469	芯联集成	网下申购	12,695	72,234.55

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
688605	先锋精科	2024 年 12 月 4 日	6 个月	新股锁定期	11.29	53.68	441	4,978.89	23,672.88	-
688449	联芸科技	2024 年 11 月 20 日	6 个月	新股锁定期	11.25	29.44	457	5,141.25	13,454.08	-
688750	金天钛业	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股锁定期	7.16	15.44	725	5,191.00	11,194.00	-
688708	佳驰科技	2024 年 11 月 27 日	6 个月	新股锁定期	27.08	48.95	198	5,361.84	9,692.10	-
603395	红四方	2024 年 11 月 19 日	6 个月	新股锁定期	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
7.4.12.1.2 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
110098	南药转债	2024 年 12 月 26 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.00	80	8,000.00	8,000.25	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证 500 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

7.4.13.2 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约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

于本期末,本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金净资产的比例为 0.0080% (上期末:本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金净资产的比例为 0.0024%)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金为履行与金融负债有关的义务而调整基金投资组合时,由于部分成份股流动性差,导致本基金难以及时完成组合调整,或承受较大市场冲击成本,可能产生基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的进行期货投资,以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

于本期末,本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式,流动性风险相对较低。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	3,459,984.89	-	-	-	3,459,984.89
结算备付金	3,968,511.67	-	-	-	3,968,511.67
存出保证金	28,962.19	-	-	953,467.20	982,429.39
交易性金融 资产	-	-	8,000.25	91,651,015.5 0	91,659,015.7 5

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	-	-	-	190,342.00	190,342.00
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,457,458.75	-	8,000.25	92,794,824.70	100,260,283.70
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	0.03	0.03
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	46,559.40	46,559.40
应付托管费	-	-	-	4,655.93	4,655.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	50,916.73	50,916.73
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	373,213.18	373,213.18
负债总计	-	-	-	475,345.27	475,345.27
利率敏感度缺口	7,457,458.75	-	8,000.25	92,319,479.43	99,784,938.43
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2023 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	1,656,911.31	-	-	-	1,656,911.31
结算备付金	1,671,503.63	-	-	-	1,671,503.63
存出保证金	26,852.14	-	-	391,449.60	418,301.74
交易性金融资产	-	-	2,700.20	109,367,925.43	109,370,625.63
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	248,657.57	248,657.57
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,355,267.08	-	2,700.20	110,008,032.60	113,365,999.88
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	1,010.88	1,010.88
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	44,522.74	44,522.74
应付托管费	-	-	-	4,452.27	4,452.27
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	465,821.89	465,821.89
负债总计	-	-	-	515,807.78	515,807.78
利率敏感度缺口	3,355,267.08	-	2,700.20	109,492,224.82	112,850,192.10

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

7.4.13.4.1.2 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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	0.00	0.00
	2.市场利率平行下降 25 个基点	0.00	0.00

7.4.13.4.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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

本基金原则上采用指数复制法，跟踪中证 500 指数，根据标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产净值的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产	公允价值	占基金资产

		净值比例(%)		净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	91,651,015.50	91.85	109,367,925.43	96.91
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	91,651,015.50	91.85	109,367,925.43	96.91

7.4.13.4.3.2 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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	4,571,558.61	4,991,377.52
	2.组合自身基准下降 5%	-4,571,558.61	-4,991,377.52

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	91,587,493.86	109,342,835.45
第二层次	8,000.25	2,700.20
第三层次	63,521.64	25,089.98
合计	91,659,015.75	109,370,625.63

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	25,089.98	25,089.98
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	28,650.28	28,650.28
转出第三层次	-	36,953.18	36,953.18
当期利得或损失总额	-	46,734.56	46,734.56
其中：计入损益的利得或损失	-	46,734.56	46,734.56
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	63,521.64	63,521.64
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	41,619.74	41,619.74
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	131,383.70	131,383.70
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	125,620.20	125,620.20
转出第三层次	-	270,111.31	270,111.31
当期利得或损失总额	-	38,197.39	38,197.39
其中：计入损益的利得或损失	-	38,197.39	38,197.39
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	25,089.98	25,089.98
期末仍持有的第三层次	-	5,447.01	5,447.01

次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益			
-----------------------------------	--	--	--

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	63,521.64	平均价格亚式期权模型	预期波动率	1.4783~4.9648	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	25,089.98	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2146~2.1988	负相关

7.4.14.3 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(上期末：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	91,651,015.50	91.41
	其中：股票	91,651,015.50	91.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,000.25	0.01
	其中：债券	8,000.25	0.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,428,496.56	7.41
8	其他各项资产	1,172,771.39	1.17
9	合计	100,260,283.70	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。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	486,182.00	0.49
B	采矿业	3,687,873.50	3.70
C	制造业	58,531,467.55	58.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,902,505.00	2.91
E	建筑业	1,107,420.40	1.11
F	批发和零售业	2,363,230.27	2.37
G	交通运输、仓储和邮政业	1,649,646.00	1.65
H	住宿和餐饮业	179,428.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,091,444.21	9.11
J	金融业	6,323,989.10	6.34
K	房地产业	1,621,626.00	1.63
L	租赁和商务服务业	577,931.00	0.58
M	科学研究和技术服务业	529,904.23	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	731,227.20	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	67,076.00	0.07
Q	卫生和社会工作	113,714.40	0.11
R	文化、体育和娱乐业	1,333,781.00	1.34
S	综合	260,990.00	0.26
	合计	91,559,435.86	91.76

8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	50,067.56	0.05
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	41,456.08	0.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	91,523.64	0.09

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 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

8.3.1 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	002625	光启技术	21,000	1,003,800.00	1.01
2	300866	安克创新	10,151	991,143.64	0.99
3	688563	航材股份	12,820	715,868.80	0.72
4	002138	顺络电子	19,600	617,008.00	0.62
5	300002	神州泰岳	48,800	565,592.00	0.57
6	600418	江淮汽车	15,000	562,500.00	0.56
7	002128	电投能源	28,600	559,988.00	0.56
8	688516	奥特维	12,840	556,100.40	0.56
9	300476	胜宏科技	12,800	538,752.00	0.54
10	300207	欣旺达	23,900	533,209.00	0.53
11	688819	天能股份	19,562	532,477.64	0.53

12	300339	润和软件	10,500	525,315.00	0.53
13	600096	云天化	23,100	515,130.00	0.52
14	000738	航发控制	23,100	513,744.00	0.51
15	002202	金风科技	48,700	503,071.00	0.50
16	601108	财通证券	61,200	500,004.00	0.50
17	000997	新大陆	25,000	498,750.00	0.50
18	601168	西部矿业	31,000	498,170.00	0.50
19	300724	捷佳伟创	7,700	486,717.00	0.49
20	000423	东阿阿胶	7,700	482,944.00	0.48
21	002532	天山铝业	59,200	465,904.00	0.47
22	600352	浙江龙盛	44,600	458,934.00	0.46
23	000728	国元证券	52,100	435,556.00	0.44
24	000034	神州数码	12,300	431,115.00	0.43
25	002517	恺英网络	31,100	423,271.00	0.42
26	301236	软通动力	7,200	422,712.00	0.42
27	600642	申能股份	43,300	410,917.00	0.41
28	603568	伟明环保	18,900	408,807.00	0.41
29	600060	海信视像	20,401	406,795.94	0.41
30	601577	长沙银行	45,500	404,495.00	0.41
31	600563	法拉电子	3,400	404,328.00	0.41
32	002318	久立特材	17,000	397,970.00	0.40
33	300677	英科医疗	15,500	391,840.00	0.39
34	600998	九州通	75,759	387,886.08	0.39
35	000988	华工科技	8,900	385,370.00	0.39
36	600177	雅戈尔	42,700	380,030.00	0.38
37	601990	南京证券	43,300	374,978.00	0.38
38	002384	东山精密	12,800	373,760.00	0.37
39	600143	金发科技	43,100	372,384.00	0.37
40	002500	山西证券	58,000	364,240.00	0.37
41	000513	丽珠集团	9,500	361,000.00	0.36
42	600487	亨通光电	20,900	359,898.00	0.36
43	002368	太极股份	15,100	357,568.00	0.36
44	688188	柏楚电子	1,837	356,837.25	0.36
45	600879	航天电子	39,500	353,920.00	0.35
46	002797	第一创业	42,200	352,370.00	0.35
47	002595	豪迈科技	7,000	351,330.00	0.35
48	002432	九安医疗	8,600	350,708.00	0.35
49	002281	光迅科技	6,700	349,539.00	0.35
50	000401	冀东水泥	66,400	347,272.00	0.35
51	600901	江苏金租	66,080	344,937.60	0.35
52	300373	扬杰科技	7,900	343,808.00	0.34
53	688099	晶晨股份	4,939	339,210.52	0.34
54	002373	千方科技	33,400	338,676.00	0.34

55	601001	晋控煤业	24,600	336,282.00	0.34
56	002262	恩华药业	13,800	336,030.00	0.34
57	600820	隧道股份	46,700	335,773.00	0.34
58	002558	巨人网络	26,400	335,016.00	0.34
59	688002	睿创微纳	7,114	334,429.14	0.34
60	002064	华峰化学	40,700	332,926.00	0.33
61	002831	裕同科技	12,200	330,620.00	0.33
62	000623	吉林敖东	18,900	326,403.00	0.33
63	601216	君正集团	62,000	326,120.00	0.33
64	002430	杭氧股份	14,900	324,820.00	0.33
65	002294	信立泰	10,400	321,672.00	0.32
66	688213	思特威	4,125	320,595.00	0.32
67	002444	巨星科技	9,900	320,265.00	0.32
68	002557	洽洽食品	11,000	319,550.00	0.32
69	688777	中控技术	6,378	316,795.26	0.32
70	600885	宏发股份	9,900	315,018.00	0.32
71	300515	三德科技	26,400	314,424.00	0.32
72	300009	安科生物	36,100	311,904.00	0.31
73	002340	格林美	47,400	309,522.00	0.31
74	600839	四川长虹	31,800	306,870.00	0.31
75	300699	光威复材	8,800	304,920.00	0.31
76	300054	鼎龙股份	11,500	299,230.00	0.30
77	600380	健康元	26,500	298,655.00	0.30
78	601665	齐鲁银行	53,400	298,506.00	0.30
79	600764	中国海防	10,500	297,360.00	0.30
80	600316	洪都航空	9,100	292,292.00	0.29
81	000921	海信家电	10,100	291,890.00	0.29
82	002408	齐翔腾达	57,800	290,734.00	0.29
83	601231	环旭电子	17,400	287,100.00	0.29
84	603893	瑞芯微	2,600	286,156.00	0.29
85	600848	上海临港	28,300	285,830.00	0.29
86	600208	衢州发展	96,400	285,344.00	0.29
87	000060	中金岭南	60,200	282,338.00	0.28
88	601098	中南传媒	18,800	282,188.00	0.28
89	600968	海油发展	66,000	281,820.00	0.28
90	600970	中材国际	29,500	279,660.00	0.28
91	601966	玲珑轮胎	15,500	279,620.00	0.28
92	603444	吉比特	1,270	277,926.80	0.28
93	600582	天地科技	44,900	277,482.00	0.28
94	600704	物产中大	54,800	277,288.00	0.28
95	601717	郑煤机	21,200	275,176.00	0.28
96	002065	东华软件	37,900	275,154.00	0.28
97	000559	万向钱潮	44,500	273,675.00	0.27

98	600008	首创环保	83,200	272,896.00	0.27
99	601918	新集能源	37,900	272,122.00	0.27
100	600170	上海建工	102,600	271,890.00	0.27
101	600707	彩虹股份	33,000	271,260.00	0.27
102	600529	山东药玻	10,500	270,585.00	0.27
103	601000	唐山港	57,300	269,883.00	0.27
104	600566	济川药业	9,200	267,536.00	0.27
105	600038	中直股份	6,900	266,064.00	0.27
106	603179	新泉股份	6,200	264,740.00	0.27
107	300529	健帆生物	9,000	264,060.00	0.26
108	603298	杭叉集团	14,740	263,698.60	0.26
109	600673	东阳光	23,000	259,670.00	0.26
110	002185	华天科技	22,200	257,742.00	0.26
111	000537	中绿电	28,100	256,272.00	0.26
112	601965	中国汽研	14,500	255,490.00	0.26
113	000783	长江证券	37,400	255,068.00	0.26
114	002563	森马服饰	36,200	254,124.00	0.25
115	300001	特锐德	11,500	252,425.00	0.25
116	603596	伯特利	5,660	252,379.40	0.25
117	600583	海油工程	45,400	248,338.00	0.25
118	300383	光环新网	17,000	248,030.00	0.25
119	000066	中国长城	17,000	247,690.00	0.25
120	002508	老板电器	11,500	246,445.00	0.25
121	600325	华发股份	42,400	244,224.00	0.24
122	600282	南钢股份	51,400	241,066.00	0.24
123	002019	亿帆医药	22,400	240,128.00	0.24
124	300118	东方日升	20,000	239,600.00	0.24
125	002958	青农商行	78,600	238,944.00	0.24
126	603087	甘李药业	5,400	238,140.00	0.24
127	601156	东航物流	14,000	236,180.00	0.24
128	300919	中伟股份	6,500	234,780.00	0.24
129	603338	浙江鼎力	3,600	232,272.00	0.23
130	002056	横店东磁	17,900	231,984.00	0.23
131	601598	中国外运	43,200	231,120.00	0.23
132	002120	韵达股份	30,500	229,360.00	0.23
133	000967	盈峰环境	45,700	227,129.00	0.23
134	601179	中国西电	29,900	226,941.00	0.23
135	601019	山东出版	19,800	224,730.00	0.23
136	300474	景嘉微	2,400	224,376.00	0.22
137	002025	航天电器	4,600	223,376.00	0.22
138	002465	海格通信	20,300	222,894.00	0.22
139	600499	科达制造	28,500	222,300.00	0.22
140	603129	春风动力	1,400	219,898.00	0.22

141	000932	华菱钢铁	52,500	219,450.00	0.22
142	000050	深天马 A	24,300	219,429.00	0.22
143	000021	深科技	11,500	219,190.00	0.22
144	603979	金诚信	6,000	217,800.00	0.22
145	600295	鄂尔多斯	22,300	217,648.00	0.22
146	601666	平煤股份	21,500	215,430.00	0.22
147	600720	中交设计	24,300	215,298.00	0.22
148	600373	中文传媒	17,100	214,605.00	0.22
149	300951	博硕科技	7,100	212,077.00	0.21
150	600155	华创云信	28,600	211,640.00	0.21
151	000739	普洛药业	12,800	208,128.00	0.21
152	601866	中远海发	79,100	206,451.00	0.21
153	600988	赤峰黄金	13,200	206,052.00	0.21
154	300532	今天国际	17,900	204,418.00	0.20
155	603816	顾家家居	7,400	204,092.00	0.20
156	002683	广东宏大	7,700	203,896.00	0.20
157	688578	艾力斯	3,394	203,300.60	0.20
158	600637	东方明珠	26,100	202,536.00	0.20
159	000878	云南铜业	16,600	202,354.00	0.20
160	300765	新诺威	7,600	202,084.00	0.20
161	600995	南网储能	19,800	200,376.00	0.20
162	600398	海澜之家	26,700	200,250.00	0.20
163	300146	汤臣倍健	16,500	198,825.00	0.20
164	000733	振华科技	4,700	198,199.00	0.20
165	600350	山东高速	19,100	196,348.00	0.20
166	688278	特宝生物	2,673	196,118.01	0.20
167	600873	梅花生物	19,399	194,571.97	0.19
168	688772	珠海冠宇	12,096	194,503.68	0.19
169	002690	美亚光电	13,070	193,697.40	0.19
170	600867	通化东宝	23,400	188,604.00	0.19
171	002372	伟星新材	14,900	188,187.00	0.19
172	002203	海亮股份	17,500	188,125.00	0.19
173	002653	海思科	5,600	186,200.00	0.19
174	000403	派林生物	8,800	185,944.00	0.19
175	000987	越秀资本	26,400	185,328.00	0.19
176	000960	锡业股份	13,100	183,793.00	0.18
177	600062	华润双鹤	9,200	182,160.00	0.18
178	600131	国网信通	9,600	181,536.00	0.18
179	600299	安迪苏	14,400	180,720.00	0.18
180	600755	厦门国贸	27,100	179,944.00	0.18
181	000048	京基智农	9,900	178,200.00	0.18
182	600298	安琪酵母	4,928	177,654.40	0.18
183	300017	网宿科技	16,800	177,576.00	0.18

184	300349	金卡智能	12,900	176,343.00	0.18
185	688120	华海清科	1,077	175,540.23	0.18
186	603658	安图生物	4,000	174,560.00	0.17
187	600486	扬农化工	3,010	174,188.70	0.17
188	002266	浙富控股	55,700	173,784.00	0.17
189	601928	凤凰传媒	14,900	171,946.00	0.17
190	002156	通富微电	5,800	171,390.00	0.17
191	002533	金杯电工	17,300	170,232.00	0.17
192	000883	湖北能源	34,000	169,320.00	0.17
193	601162	天风证券	37,600	168,448.00	0.17
194	600598	北大荒	11,400	168,150.00	0.17
195	601319	中国人保	21,900	166,878.00	0.17
196	002244	滨江集团	19,200	165,312.00	0.17
197	601568	北元集团	38,600	162,120.00	0.16
198	600663	陆家嘴	16,400	161,376.00	0.16
199	603589	口子窖	4,100	160,884.00	0.16
200	603786	科博达	2,600	160,680.00	0.16
201	603225	新凤鸣	14,400	160,272.00	0.16
202	000887	中鼎股份	12,200	160,064.00	0.16
203	600348	华阳股份	22,450	159,170.50	0.16
204	603927	中科软	7,280	157,976.00	0.16
205	600021	上海电力	17,100	156,807.00	0.16
206	002439	启明星辰	9,900	156,618.00	0.16
207	000709	河钢股份	70,600	156,026.00	0.16
208	600258	首旅酒店	10,400	152,568.00	0.15
209	600483	福能股份	15,300	152,541.00	0.15
210	301165	锐捷网络	2,100	151,620.00	0.15
211	601099	太平洋	35,400	150,804.00	0.15
212	000636	风华高科	10,500	150,675.00	0.15
213	603600	永艺股份	12,600	149,814.00	0.15
214	002414	高德红外	20,100	149,343.00	0.15
215	000598	兴蓉环境	19,500	148,005.00	0.15
216	300140	节能环保	24,600	147,354.00	0.15
217	002078	太阳纸业	9,900	147,213.00	0.15
218	002850	科达利	1,500	146,520.00	0.15
219	603408	建霖家居	11,600	145,348.00	0.15
220	603228	景旺电子	5,208	144,990.72	0.15
221	600312	平高电气	7,500	144,000.00	0.14
222	603379	三美股份	3,740	143,541.20	0.14
223	603897	长城科技	6,100	143,350.00	0.14
224	002891	中宠股份	4,000	142,800.00	0.14
225	600665	天地源	45,500	142,415.00	0.14
226	688052	纳芯微	1,059	137,987.70	0.14

227	603606	东方电缆	2,600	136,630.00	0.14
228	688616	西力科技	13,100	136,109.00	0.14
229	600872	中炬高新	6,100	134,322.00	0.13
230	603556	海兴电力	3,600	133,164.00	0.13
231	301498	乖宝宠物	1,700	133,144.00	0.13
232	002223	鱼跃医疗	3,600	131,364.00	0.13
233	000563	陕国投 A	36,900	131,364.00	0.13
234	601233	桐昆股份	11,100	130,980.00	0.13
235	600536	中国软件	2,800	130,732.00	0.13
236	600801	华新水泥	10,800	130,680.00	0.13
237	000725	京东方 A	29,700	130,383.00	0.13
238	600612	老凤祥	2,400	130,248.00	0.13
239	688561	奇安信	4,843	129,937.69	0.13
240	300223	北京君正	1,900	129,580.00	0.13
241	601318	中国平安	2,400	126,360.00	0.13
242	600153	建发股份	12,000	126,240.00	0.13
243	300979	华利集团	1,600	125,840.00	0.13
244	300136	信维通信	4,900	124,656.00	0.12
245	605358	立昂微	5,000	123,850.00	0.12
246	300628	亿联网络	3,200	123,520.00	0.12
247	000539	粤电力 A	27,200	123,216.00	0.12
248	300685	艾德生物	5,400	123,120.00	0.12
249	600927	永安期货	9,300	122,667.00	0.12
250	003005	竞业达	4,500	122,040.00	0.12
251	002275	桂林三金	8,000	120,720.00	0.12
252	301059	金三江	9,800	120,540.00	0.12
253	002939	长城证券	14,700	120,540.00	0.12
254	003031	中瓷电子	2,300	120,497.00	0.12
255	300037	新宙邦	3,200	119,808.00	0.12
256	601958	金钼股份	11,900	119,714.00	0.12
257	600737	中粮糖业	11,700	119,457.00	0.12
258	600699	均胜电子	7,600	119,092.00	0.12
259	600578	京能电力	33,800	118,976.00	0.12
260	603156	养元饮品	5,200	118,768.00	0.12
261	002884	凌霄泵业	6,500	118,755.00	0.12
262	600827	百联股份	10,800	118,044.00	0.12
263	600141	兴发集团	5,400	117,180.00	0.12
264	300523	辰安科技	5,900	116,761.00	0.12
265	601611	中国核建	12,900	116,616.00	0.12
266	601128	常熟银行	15,150	114,685.50	0.11
267	002152	广电运通	9,700	113,102.00	0.11
268	688425	铁建重工	25,650	112,860.00	0.11
269	002195	岩山科技	28,400	112,748.00	0.11

270	002429	兆驰股份	19,500	112,710.00	0.11
271	300360	炬华科技	6,700	112,359.00	0.11
272	002088	鲁阳节能	8,700	111,273.00	0.11
273	688475	萤石网络	3,673	110,887.87	0.11
274	601991	大唐发电	38,600	110,010.00	0.11
275	688072	拓荆科技	715	109,874.05	0.11
276	600894	广日股份	7,500	109,500.00	0.11
277	688065	凯赛生物	2,803	108,756.40	0.11
278	601016	节能风电	34,100	108,097.00	0.11
279	603456	九洲药业	7,900	108,072.00	0.11
280	000603	盛达资源	9,000	107,910.00	0.11
281	002507	涪陵榨菜	7,600	107,388.00	0.11
282	688375	国博电子	2,175	107,358.00	0.11
283	300389	艾比森	9,000	107,190.00	0.11
284	600132	重庆啤酒	1,700	107,134.00	0.11
285	002423	中粮资本	8,000	107,120.00	0.11
286	600498	烽火通信	5,500	107,030.00	0.11
287	300870	欧陆通	1,000	106,780.00	0.11
288	300842	帝科股份	2,600	106,652.00	0.11
289	601139	深圳燃气	15,100	106,606.00	0.11
290	600390	五矿资本	16,500	106,425.00	0.11
291	300604	长川科技	2,400	105,912.00	0.11
292	300024	机器人	5,900	105,905.00	0.11
293	301345	涛涛车业	1,600	105,760.00	0.11
294	000039	中集集团	13,600	105,672.00	0.11
295	601601	中国太保	3,100	105,648.00	0.11
296	300514	友讯达	7,300	105,412.00	0.11
297	603100	川仪股份	4,860	104,733.00	0.10
298	300558	贝达药业	1,900	102,467.00	0.10
299	300058	蓝色光标	11,000	102,080.00	0.10
300	301319	唯特偶	3,500	102,060.00	0.10
301	688588	凌志软件	7,349	101,416.20	0.10
302	600378	昊华科技	3,500	101,185.00	0.10
303	301042	安联锐视	2,800	100,772.00	0.10
304	301327	华宝新能	1,300	99,723.00	0.10
305	002802	洪汇新材	8,400	99,540.00	0.10
306	603115	海星股份	7,700	99,407.00	0.10
307	002738	中矿资源	2,800	99,400.00	0.10
308	600329	达仁堂	3,200	98,560.00	0.10
309	688379	华光新材	4,821	98,444.82	0.10
310	600528	中铁工业	12,200	98,332.00	0.10
311	688349	三一重能	3,148	97,210.24	0.10
312	300601	康泰生物	5,600	96,040.00	0.10

313	603855	华荣股份	4,700	95,363.00	0.10
314	688093	世华科技	4,720	95,296.80	0.10
315	002926	华西证券	11,300	93,903.00	0.09
316	300906	日月明	3,600	93,528.00	0.09
317	600862	中航高科	3,700	93,462.00	0.09
318	300114	中航电测	1,300	93,314.00	0.09
319	000544	中原环保	10,600	92,538.00	0.09
320	300408	三环集团	2,400	92,424.00	0.09
321	601997	贵阳银行	15,400	92,400.00	0.09
322	002206	海利得	21,400	91,806.00	0.09
323	000778	新兴铸管	23,900	91,776.00	0.09
324	600757	长江传媒	9,500	90,915.00	0.09
325	600064	南京高科	11,500	89,355.00	0.09
326	688479	友车科技	4,995	88,661.25	0.09
327	688307	中润光学	3,691	88,584.00	0.09
328	300888	稳健医疗	2,100	88,368.00	0.09
329	688047	龙芯中科	667	88,230.76	0.09
330	688005	容百科技	2,794	88,150.70	0.09
331	688233	神工股份	3,751	87,960.95	0.09
332	002385	大北农	20,100	87,033.00	0.09
333	603506	南都物业	10,200	86,802.00	0.09
334	600535	天士力	6,000	86,760.00	0.09
335	600392	盛和资源	8,400	86,352.00	0.09
336	688312	燕麦科技	2,758	84,946.40	0.09
337	000333	美的集团	1,100	82,742.00	0.08
338	603967	中创物流	8,400	82,404.00	0.08
339	603025	大豪科技	5,400	82,350.00	0.08
340	688200	华峰测控	786	82,137.00	0.08
341	002044	美年健康	17,800	81,702.00	0.08
342	600985	淮北矿业	5,800	81,606.00	0.08
343	603886	元祖股份	5,600	80,752.00	0.08
344	600361	创新新材	20,800	80,288.00	0.08
345	688330	宏力达	3,059	80,268.16	0.08
346	000685	中山公用	8,600	79,378.00	0.08
347	600741	华域汽车	4,500	79,245.00	0.08
348	603899	晨光股份	2,600	78,650.00	0.08
349	002745	木林森	9,000	78,480.00	0.08
350	002881	美格智能	2,600	77,896.00	0.08
351	002966	苏州银行	9,600	77,856.00	0.08
352	002818	富森美	5,200	77,688.00	0.08
353	300803	指南针	800	76,760.00	0.08
354	600655	豫园股份	11,900	76,517.00	0.08
355	600640	国脉文化	6,400	76,416.00	0.08

356	600959	江苏有线	22,700	76,045.00	0.08
357	688579	山大地纬	8,233	75,661.27	0.08
358	002825	纳尔股份	9,600	75,072.00	0.08
359	002001	新和成	3,400	74,698.00	0.07
360	603039	泛微网络	1,500	73,500.00	0.07
361	600516	方大炭素	15,200	73,416.00	0.07
362	300012	华测检测	5,900	73,337.00	0.07
363	600095	湘财股份	10,100	72,720.00	0.07
364	688778	厦钨新能	1,556	71,015.84	0.07
365	688511	天微电子	4,538	70,656.66	0.07
366	603939	益丰药房	2,920	70,459.60	0.07
367	002841	视源股份	1,900	70,129.00	0.07
368	300285	国瓷材料	4,100	69,864.00	0.07
369	002531	天顺风能	8,800	69,608.00	0.07
370	688248	南网科技	2,167	69,539.03	0.07
371	603233	大参林	4,600	69,276.00	0.07
372	600066	宇通客车	2,600	68,588.00	0.07
373	600007	中国国贸	2,800	68,488.00	0.07
374	002487	大金重工	3,300	67,617.00	0.07
375	688127	蓝特光学	2,492	67,533.20	0.07
376	002913	奥士康	2,800	67,508.00	0.07
377	002273	水晶光电	3,000	66,660.00	0.07
378	603185	弘元绿能	4,100	66,625.00	0.07
379	688057	金达莱	5,972	66,289.20	0.07
380	601158	重庆水务	13,400	65,660.00	0.07
381	603529	爱玛科技	1,600	65,632.00	0.07
382	688056	莱伯泰科	2,211	64,472.76	0.06
383	603160	汇顶科技	800	64,432.00	0.06
384	603885	吉祥航空	4,700	64,390.00	0.06
385	600056	中国医药	5,800	64,380.00	0.06
386	002299	圣农发展	4,400	63,712.00	0.06
387	600032	浙江新能	8,600	63,640.00	0.06
388	600712	南宁百货	8,800	63,624.00	0.06
389	600865	百大集团	5,400	63,558.00	0.06
390	002034	旺能环境	4,100	63,550.00	0.06
391	000898	鞍钢股份	26,400	63,360.00	0.06
392	600925	苏能股份	11,900	63,070.00	0.06
393	600551	时代出版	7,300	62,853.00	0.06
394	603680	今创集团	7,500	62,250.00	0.06
395	601566	九牧王	7,400	62,234.00	0.06
396	688372	伟测科技	1,060	62,031.20	0.06
397	600648	外高桥	5,200	61,932.00	0.06
398	600685	中船防务	2,600	61,620.00	0.06

399	688209	英集芯	3,470	61,314.90	0.06
400	600714	金瑞矿业	6,300	61,236.00	0.06
401	688019	安集科技	437	60,900.32	0.06
402	600710	苏美达	6,500	60,450.00	0.06
403	688617	惠泰医疗	162	60,317.46	0.06
404	603277	银都股份	2,600	60,242.00	0.06
405	002416	爱施德	3,700	60,199.00	0.06
406	603380	易德龙	2,400	59,976.00	0.06
407	600098	广州发展	9,300	59,706.00	0.06
408	688107	安路科技	2,002	59,219.16	0.06
409	600977	中国电影	5,100	59,211.00	0.06
410	600475	华光环能	6,500	58,565.00	0.06
411	601212	白银有色	21,000	58,380.00	0.06
412	600271	航天信息	6,400	58,304.00	0.06
413	603868	飞科电器	1,400	58,128.00	0.06
414	002673	西部证券	7,100	57,865.00	0.06
415	600183	生益科技	2,400	57,720.00	0.06
416	603989	艾华集团	3,800	57,304.00	0.06
417	601858	中国科传	2,800	57,064.00	0.06
418	002338	奥普光电	1,500	56,580.00	0.06
419	300395	菲利华	1,500	56,415.00	0.06
420	688114	华大智造	1,204	56,335.16	0.06
421	603883	老百姓	3,407	55,772.59	0.06
422	601811	新华文轩	3,500	55,475.00	0.06
423	603737	三棵树	1,300	55,380.00	0.06
424	002247	聚力文化	21,700	55,335.00	0.06
425	603301	振德医疗	2,500	54,975.00	0.06
426	603697	有友食品	5,400	54,972.00	0.06
427	603385	惠达卫浴	8,600	54,696.00	0.05
428	002550	千红制药	8,800	54,560.00	0.05
429	001206	依依股份	3,300	54,549.00	0.05
430	002852	道道全	6,600	54,516.00	0.05
431	600109	国金证券	6,200	54,126.00	0.05
432	003019	宸展光电	2,115	54,101.70	0.05
433	002506	协鑫集成	20,200	53,934.00	0.05
434	689009	九号公司	1,135	53,912.50	0.05
435	601933	永辉超市	8,500	53,890.00	0.05
436	605058	澳弘电子	2,700	53,541.00	0.05
437	002345	潮宏基	9,200	53,452.00	0.05
438	002780	三夫户外	4,200	53,130.00	0.05
439	002768	国恩股份	2,300	53,061.00	0.05
440	600481	双良节能	9,600	52,800.00	0.05
441	000028	国药一致	1,800	52,650.00	0.05

442	002788	鹭燕医药	6,400	52,544.00	0.05
443	002381	双箭股份	7,800	51,948.00	0.05
444	002955	鸿合科技	2,200	51,744.00	0.05
445	300950	德固特	3,200	51,680.00	0.05
446	002539	云图控股	6,500	50,830.00	0.05
447	688123	聚辰股份	862	50,444.24	0.05
448	000404	长虹华意	6,800	50,320.00	0.05
449	000100	TCL 科技	10,000	50,300.00	0.05
450	000906	浙商中拓	7,600	50,160.00	0.05
451	002008	大族激光	2,000	50,000.00	0.05
452	002567	唐人神	9,800	49,980.00	0.05
453	603355	莱克电气	2,200	49,830.00	0.05
454	688363	华熙生物	973	49,661.92	0.05
455	601567	三星医疗	1,600	49,216.00	0.05
456	600765	中航重机	2,400	49,128.00	0.05
457	601696	中银证券	4,400	49,104.00	0.05
458	002462	嘉事堂	3,800	49,096.00	0.05
459	301221	光庭信息	1,000	48,580.00	0.05
460	603730	岱美股份	5,400	48,546.00	0.05
461	002845	同兴达	3,200	48,512.00	0.05
462	002649	博彦科技	4,000	48,480.00	0.05
463	002982	湘佳股份	2,700	48,195.00	0.05
464	603186	华正新材	2,000	48,180.00	0.05
465	688469	芯联集成	9,379	48,114.27	0.05
466	002353	杰瑞股份	1,300	48,087.00	0.05
467	002380	科远智慧	2,600	48,048.00	0.05
468	605166	聚合顺	4,000	47,880.00	0.05
469	002615	哈尔斯	6,000	47,700.00	0.05
470	300496	中科创达	800	47,648.00	0.05
471	000951	中国重汽	2,800	47,544.00	0.05
472	601138	工业富联	2,200	47,300.00	0.05
473	688018	乐鑫科技	216	47,088.00	0.05
474	603890	春秋电子	4,000	47,000.00	0.05
475	600266	城建发展	9,200	46,920.00	0.05
476	600742	一汽富维	5,300	46,905.00	0.05
477	688122	西部超导	1,095	46,887.90	0.05
478	603611	诺力股份	2,600	46,670.00	0.05
479	601615	明阳智能	3,700	46,657.00	0.05
480	601311	骆驼股份	5,600	46,424.00	0.05
481	301050	雷电微力	900	46,422.00	0.05
482	000825	太钢不锈	13,300	46,284.00	0.05
483	605266	健之佳	2,000	46,140.00	0.05
484	600479	千金药业	4,300	45,924.00	0.05

485	600089	特变电工	3,600	45,864.00	0.05
486	600987	航民股份	6,600	45,804.00	0.05
487	600895	张江高科	1,700	45,560.00	0.05
488	600713	南京医药	9,100	45,136.00	0.05
489	000831	中国稀土	1,600	44,880.00	0.04
490	000009	中国宝安	4,900	44,835.00	0.04
491	603609	禾丰股份	5,200	44,824.00	0.04
492	600667	太极实业	6,470	44,772.40	0.04
493	000703	恒逸石化	7,100	44,588.00	0.04
494	002048	宁波华翔	3,500	44,170.00	0.04
495	600369	西南证券	9,400	43,898.00	0.04
496	605050	福然德	4,500	43,650.00	0.04
497	002085	万丰奥威	2,300	43,585.00	0.04
498	688314	康拓医疗	1,512	43,545.60	0.04
499	301309	万得凯	1,800	43,506.00	0.04
500	688521	芯原股份	828	43,412.04	0.04
501	688361	中科飞测	493	43,162.15	0.04
502	002472	双环传动	1,400	42,868.00	0.04
503	603368	柳药集团	2,400	42,864.00	0.04
504	600549	厦门钨业	2,200	42,394.00	0.04
505	600761	安徽合力	2,400	42,360.00	0.04
506	603605	珀莱雅	500	42,350.00	0.04
507	603201	常润股份	2,500	42,275.00	0.04
508	301158	德石股份	3,000	42,090.00	0.04
509	002833	弘亚数控	2,500	42,075.00	0.04
510	688536	思瑞浦	454	41,995.00	0.04
511	688249	晶合集成	1,799	41,988.66	0.04
512	002014	永新股份	3,800	41,648.00	0.04
513	002658	雪迪龙	6,500	41,600.00	0.04
514	002546	新联电子	9,600	41,568.00	0.04
515	000030	富奥股份	8,100	41,553.00	0.04
516	000959	首钢股份	13,600	41,480.00	0.04
517	000400	许继电气	1,500	41,295.00	0.04
518	002367	康力电梯	6,000	41,220.00	0.04
519	688525	佰维存储	663	41,086.11	0.04
520	300142	沃森生物	3,400	41,072.00	0.04
521	301358	湖南裕能	900	40,788.00	0.04
522	603345	安井食品	500	40,740.00	0.04
523	600909	华安证券	6,700	40,602.00	0.04
524	003035	南网能源	9,600	40,128.00	0.04
525	003022	联泓新科	2,900	39,933.00	0.04
526	002004	华邦健康	8,800	39,776.00	0.04
527	688348	昱能科技	815	39,772.00	0.04

528	300170	汉得信息	3,200	39,680.00	0.04
529	000750	国海证券	9,100	38,948.00	0.04
530	002436	兴森科技	3,500	38,885.00	0.04
531	688180	君实生物	1,413	38,617.29	0.04
532	600750	江中药业	1,700	38,590.00	0.04
533	002261	拓维信息	2,100	38,451.00	0.04
534	300987	川网传媒	2,700	38,232.00	0.04
535	688273	麦澜德	1,634	38,186.58	0.04
536	001227	兰州银行	15,500	38,130.00	0.04
537	002821	凯莱英	500	38,045.00	0.04
538	600845	宝信软件	1,300	38,038.00	0.04
539	000591	太阳能	7,900	37,604.00	0.04
540	605080	浙江自然	1,600	37,600.00	0.04
541	600521	华海药业	2,100	37,527.00	0.04
542	688657	浩辰软件	945	37,478.70	0.04
543	002991	甘源食品	400	37,408.00	0.04
544	601126	四方股份	2,200	37,312.00	0.04
545	002032	苏泊尔	700	37,247.00	0.04
546	601137	博威合金	1,800	36,540.00	0.04
547	600863	内蒙华电	8,400	36,372.00	0.04
548	300073	当升科技	900	36,252.00	0.04
549	603757	大元泵业	1,800	36,090.00	0.04
550	603788	宁波高发	2,600	35,958.00	0.04
551	603367	辰欣药业	2,600	35,724.00	0.04
552	603508	思维列控	1,500	35,670.00	0.04
553	600497	驰宏锌锗	6,400	35,648.00	0.04
554	002179	中航光电	900	35,370.00	0.04
555	002607	中公教育	10,400	35,360.00	0.04
556	601456	国联证券	2,600	35,152.00	0.04
557	002409	雅克科技	600	34,770.00	0.03
558	000723	美锦能源	7,700	34,727.00	0.03
559	600997	开滦股份	5,100	34,476.00	0.03
560	600118	中国卫星	1,253	34,206.90	0.03
561	002978	安宁股份	1,200	34,104.00	0.03
562	603700	宁水集团	3,400	34,034.00	0.03
563	600502	安徽建工	7,100	33,938.00	0.03
564	601369	陕鼓动力	3,900	33,930.00	0.03
565	603758	秦安股份	4,100	33,866.00	0.03
566	603926	铁流股份	3,800	33,630.00	0.03
567	002461	珠江啤酒	3,400	33,626.00	0.03
568	601608	中信重工	8,000	33,600.00	0.03
569	601399	国机重装	10,900	33,572.00	0.03
570	002498	汉缆股份	9,900	33,561.00	0.03

571	603707	健友股份	2,500	33,175.00	0.03
572	300003	乐普医疗	2,900	32,886.00	0.03
573	000800	一汽解放	4,000	32,800.00	0.03
574	002739	万达电影	2,700	32,778.00	0.03
575	000729	燕京啤酒	2,700	32,508.00	0.03
576	300390	天华新能	1,400	32,270.00	0.03
577	002603	以岭药业	2,000	32,020.00	0.03
578	600763	通策医疗	721	32,012.40	0.03
579	000629	钒钛股份	11,100	31,968.00	0.03
580	002410	广联达	2,700	31,752.00	0.03
581	605098	行动教育	900	31,716.00	0.03
582	603881	数据港	1,400	31,710.00	0.03
583	300751	迈为股份	300	31,545.00	0.03
584	688279	峰岬科技	200	31,540.00	0.03
585	603558	健盛集团	2,900	31,204.00	0.03
586	002407	多氟多	2,600	31,200.00	0.03
587	300925	法本信息	1,400	31,192.00	0.03
588	601880	辽港股份	17,900	30,967.00	0.03
589	600527	江南高纤	14,000	30,940.00	0.03
590	002568	百润股份	1,100	30,811.00	0.03
591	688385	复旦微电	802	30,788.78	0.03
592	300763	锦浪科技	500	30,535.00	0.03
593	300595	欧普康视	1,600	30,320.00	0.03
594	002756	永兴材料	800	30,176.00	0.03
595	603599	广信股份	2,500	30,125.00	0.03
596	603056	德邦股份	2,100	30,093.00	0.03
597	000426	兴业银锡	2,700	30,024.00	0.03
598	300144	宋城演艺	3,200	29,728.00	0.03
599	601992	金隅集团	16,600	29,548.00	0.03
600	300676	华大基因	700	29,379.00	0.03
601	600500	中化国际	7,300	29,346.00	0.03
602	300251	光线传媒	3,100	29,264.00	0.03
603	603799	华友钴业	1,000	29,260.00	0.03
604	601113	华鼎股份	7,500	29,250.00	0.03
605	600580	卧龙电驱	1,700	29,223.00	0.03
606	000519	中兵红箭	2,000	28,900.00	0.03
607	600004	白云机场	3,000	28,800.00	0.03
608	603077	和邦生物	14,100	28,764.00	0.03
609	603000	人民网	1,300	28,652.00	0.03
610	603858	步长制药	1,800	28,440.00	0.03
611	600906	财达证券	4,000	28,400.00	0.03
612	600546	山煤国际	2,400	28,392.00	0.03
613	600416	湘电股份	2,500	28,225.00	0.03

614	600166	福田汽车	11,200	28,112.00	0.03
615	300212	易华录	1,200	28,080.00	0.03
616	001332	锡装股份	800	27,936.00	0.03
617	000998	隆平高科	2,500	27,925.00	0.03
618	300986	志特新材	2,300	27,922.00	0.03
619	300748	金力永磁	1,560	27,892.80	0.03
620	688017	绿的谐波	258	27,879.48	0.03
621	600367	红星发展	2,400	27,696.00	0.03
622	000166	申万宏源	5,100	27,285.00	0.03
623	688567	孚能科技	2,339	27,132.40	0.03
624	603290	斯达半导	300	26,946.00	0.03
625	601061	中信金属	3,700	26,862.00	0.03
626	600754	锦江酒店	1,000	26,860.00	0.03
627	002624	完美世界	2,600	26,858.00	0.03
628	601799	星宇股份	200	26,696.00	0.03
629	688220	翱捷科技	492	26,612.28	0.03
630	300487	蓝晓科技	550	26,328.50	0.03
631	600859	王府井	1,700	26,197.00	0.03
632	002240	盛新锂能	1,900	26,182.00	0.03
633	605376	博迁新材	900	26,055.00	0.03
634	002268	电科网安	1,600	26,000.00	0.03
635	301308	江波龙	300	25,800.00	0.03
636	300567	精测电子	400	25,720.00	0.03
637	600956	新天绿能	3,400	25,636.00	0.03
638	688387	信科移动	4,289	25,562.44	0.03
639	688297	中无人机	634	25,537.52	0.03
640	000917	电广传媒	3,600	25,452.00	0.03
641	301086	鸿富瀚	500	25,435.00	0.03
642	603638	艾迪精密	1,500	25,335.00	0.03
643	605599	菜百股份	2,200	24,970.00	0.03
644	603043	广州酒家	1,500	24,945.00	0.02
645	000818	航锦科技	1,300	24,830.00	0.02
646	688234	天岳先进	484	24,780.80	0.02
647	600129	太极集团	1,000	24,720.00	0.02
648	600435	北方导航	2,500	24,400.00	0.02
649	603171	税友股份	800	24,400.00	0.02
650	000590	启迪药业	3,400	24,174.00	0.02
651	000655	金岭矿业	3,900	23,985.00	0.02
652	601869	长飞光纤	800	23,912.00	0.02
653	601702	华峰铝业	1,300	23,816.00	0.02
654	300070	碧水源	4,700	23,782.00	0.02
655	300781	因赛集团	400	23,612.00	0.02
656	603486	科沃斯	500	23,500.00	0.02

657	001286	陕西能源	2,500	23,200.00	0.02
658	603577	汇金通	2,900	23,171.00	0.02
659	688683	莱尔科技	1,161	23,057.46	0.02
660	603103	横店影视	1,600	23,024.00	0.02
661	601636	旗滨集团	4,100	23,001.00	0.02
662	600606	绿地控股	10,900	22,890.00	0.02
663	600330	天通股份	3,200	22,720.00	0.02
664	300777	中简科技	800	22,632.00	0.02
665	688489	三未信安	655	22,597.50	0.02
666	301307	美利信	1,100	22,363.00	0.02
667	002572	索菲亚	1,300	22,334.00	0.02
668	002670	国盛金控	1,700	22,253.00	0.02
669	002248	华东数控	2,800	21,812.00	0.02
670	600061	国投资本	2,900	21,808.00	0.02
671	603728	鸣志电器	400	21,600.00	0.02
672	688172	燕东微	1,072	21,493.60	0.02
673	603712	七一二	1,100	21,417.00	0.02
674	300957	贝泰妮	500	21,345.00	0.02
675	000958	电投产融	3,400	21,182.00	0.02
676	603195	公牛集团	300	21,072.00	0.02
677	600928	西安银行	5,800	20,938.00	0.02
678	300573	兴齐眼药	300	20,934.00	0.02
679	002080	中材科技	1,600	20,928.00	0.02
680	688082	盛美上海	200	20,000.00	0.02
681	688281	华秦科技	210	19,551.00	0.02
682	688295	中复神鹰	977	19,471.61	0.02
683	000630	铜陵有色	5,800	18,734.00	0.02
684	688183	生益电子	474	18,609.24	0.02
685	688283	坤恒顺维	749	18,440.38	0.02
686	000785	居然智家	5,100	18,207.00	0.02
687	688276	百克生物	723	18,154.53	0.02
688	688628	优利德	492	18,125.28	0.02
689	688088	虹软科技	469	18,084.64	0.02
690	300771	智莱科技	1,700	17,884.00	0.02
691	688225	亚信安全	965	17,572.65	0.02
692	688682	霍莱沃	501	17,434.80	0.02
693	688596	正帆科技	484	17,206.20	0.02
694	688100	威胜信息	473	17,122.60	0.02
695	688009	中国通号	2,717	17,008.42	0.02
696	688432	有研硅	1,442	16,294.60	0.02
697	603083	剑桥科技	400	16,240.00	0.02
698	688232	新点软件	558	16,176.42	0.02
699	688078	龙软科技	615	16,119.15	0.02

700	688109	品茗科技	657	16,103.07	0.02
701	688055	龙腾光电	3,898	16,098.74	0.02
702	688153	唯捷创芯	480	16,060.80	0.02
703	688079	美迪凯	1,845	15,977.70	0.02
704	688138	清溢光电	693	15,869.70	0.02
705	688244	永信至诚	608	15,564.80	0.02
706	688728	格科微	1,122	15,079.68	0.02
707	688383	新益昌	331	14,851.97	0.01
708	688001	华兴源创	534	14,471.40	0.01
709	002960	青鸟消防	1,200	14,004.00	0.01
710	688519	南亚新材	614	13,053.64	0.01
711	000156	华数传媒	1,800	12,960.00	0.01
712	603676	卫信康	1,200	11,940.00	0.01
713	688606	奥泰生物	174	11,014.20	0.01
714	601163	三角轮胎	700	10,549.00	0.01
715	688353	华盛锂电	280	6,546.40	0.01
716	301077	星华新材	200	5,346.00	0.01
717	301192	泰祥股份	300	5,223.00	0.01
718	300656	民德电子	100	2,488.00	0.00
719	600562	国睿科技	100	1,993.00	0.00
720	600284	浦东建设	300	1,881.00	0.00
721	000532	华金资本	100	1,320.00	0.00

8.3.2 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	600718	东软集团	2,600	28,002.00	0.03
2	688605	先锋精科	441	23,672.88	0.02
3	688449	联芸科技	457	13,454.08	0.01
4	688750	金天钛业	725	11,194.00	0.01
5	688708	佳驰科技	198	9,692.10	0.01
6	603395	红四方	154	5,508.58	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产 净值比例（%）
1	300502	新易盛	4,265,418.00	3.78

2	300866	安克创新	2,599,475.00	2.30
3	002028	思源电气	2,136,065.00	1.89
4	000423	东阿阿胶	1,940,367.00	1.72
5	002532	天山铝业	1,886,770.00	1.67
6	002517	恺英网络	1,869,586.00	1.66
7	300394	天孚通信	1,835,008.60	1.63
8	000932	华菱钢铁	1,744,775.00	1.55
9	002128	电投能源	1,703,893.00	1.51
10	002064	华峰化学	1,638,231.00	1.45
11	000933	神火股份	1,597,314.00	1.42
12	002625	光启技术	1,593,354.00	1.41
13	688516	奥特维	1,552,945.54	1.38
14	300677	英科医疗	1,542,924.40	1.37
15	000728	国元证券	1,537,481.00	1.36
16	002138	顺络电子	1,517,464.00	1.34
17	002078	太阳纸业	1,488,172.00	1.32
18	000997	新大陆	1,476,703.00	1.31
19	601168	西部矿业	1,469,451.00	1.30
20	002558	巨人网络	1,457,947.00	1.29

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。

8.4.2 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	300502	新易盛	4,844,476.50	4.29
2	002028	思源电气	2,566,540.80	2.27
3	300866	安克创新	2,508,364.00	2.22
4	300394	天孚通信	2,241,557.20	1.99
5	000933	神火股份	2,218,122.00	1.97
6	002532	天山铝业	1,910,493.00	1.69
7	000423	东阿阿胶	1,832,186.10	1.62
8	002128	电投能源	1,822,843.00	1.62
9	000887	中鼎股份	1,799,897.00	1.59
10	000932	华菱钢铁	1,789,074.00	1.59
11	000997	新大陆	1,706,033.00	1.51
12	002517	恺英网络	1,686,427.00	1.49
13	002078	太阳纸业	1,673,179.00	1.48
14	000783	长江证券	1,662,823.00	1.47
15	300088	长信科技	1,588,389.00	1.41
16	000513	丽珠集团	1,565,170.00	1.39

17	300009	安科生物	1,533,051.00	1.36
18	300296	利亚德	1,529,243.00	1.36
19	000728	国元证券	1,528,605.00	1.35
20	002064	华峰化学	1,518,984.00	1.35

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。

8.4.3 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	463,942,657.80
卖出股票收入（成交）总额	472,449,809.31

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。

8.5 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）	8,000.25	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,000.25	0.01

8.6 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	110098	南药转债	80	8,000.25	0.01

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	982,429.39

2	应收清算款	190,342.00
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	1,172,771.39

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值（元）	占基金资产净值 比例（%）	流通受限情况说 明
1	688605	先锋精科	23,672.88	0.02	新股锁定期
2	688449	联芸科技	13,454.08	0.01	新股锁定期
3	688750	金天钛业	11,194.00	0.01	新股锁定期
4	688708	佳驰科技	9,692.10	0.01	新股锁定期

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 （户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,807	57,875.12	24,984,833.00	23.89 %	79,595,500.00	76.11 %

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	东方证券股份有限公司	6,650,790.00	6.36%
2	中信证券股份有限公司	4,798,733.00	4.59%
3	广发证券股份有限公司	3,013,100.00	2.88%

4	方正证券股份有限公司	2,705,710.00	2.59%
5	华泰证券股份有限公司	2,695,400.00	2.58%
6	杜爱明	2,296,300.00	2.20%
7	章伯生	2,000,000.00	1.91%
8	林钦涛	2,000,000.00	1.91%
9	黄时博	1,550,000.00	1.48%
10	徐红	1,500,000.00	1.43%

9.3 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。

9.4 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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022 年 1 月 26 日)基金份额总额	746,580,333.00
本报告期期初基金份额总额	130,080,333.00
本报告期基金总申购份额	192,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	217,500,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	104,580,333.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

2024 年 9 月 21 日，本基金管理人发布了《南方基金管理股份有限公司关于高级管理人员变更的公告》，杨小松先生任公司首席信息官，俞文宏先生任公司董事会秘书，陈莉女士

任公司副总经理，孙鲁闽先生任公司副总经理，侯利鹏先生任公司副总经理，茅炜先生任公司副总经理，常克川先生不再担任公司副总经理、首席信息官、董事会秘书，朱运东先生不再担任公司副总经理，史博先生不再担任公司副总经理。

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。

11.3 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业务的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金的审计事务所由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）改聘为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该变更事项已由南方基金管理股份有限公司董事会审议通过，并已按照相关规定及基金合同约定通知基金托管人；

目前安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 1 年，本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 40,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人、个别高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-12-13
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	警示函、监管谈话
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定与制度执行不到位
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改
其他	—

11.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	286,782,097.77	30.64%	28,665.08	30.64%	-
兴业证券	1	153,007,623.54	16.35%	15,303.99	16.36%	-
国信证券	1	118,065,043.44	12.61%	11,800.02	12.61%	-
中信证券	2	102,611,411.23	10.96%	10,248.26	10.95%	-
海通证券	1	82,990,197.90	8.87%	8,301.88	8.87%	-
国金证券	1	76,076,918.51	8.13%	7,591.92	8.12%	-
国泰君安	2	54,023,420.19	5.77%	5,397.66	5.77%	-
招商证券	1	31,907,577.18	3.41%	3,187.32	3.41%	-
中信建投	1	30,642,410.41	3.27%	3,057.10	3.27%	-
广发证券	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：国金证券、国泰君安、国信证券、中信证券；减少交易单元：无。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	1,887.60	3.66%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

国信证券	460.88	0.89%	-	-	-	-
中信证券	4,681.67	9.07%	-	-	-	-
海通证券	3,056.66	5.92%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	31,220.70	60.48%	-	-	-	-
招商证券	460.88	0.89%	-	-	-	-
中信建投	9,857.24	19.09%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加财达证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-25
2	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加西南证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-26
3	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加联储证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-13
4	南方基金管理股份有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-20
5	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加万和证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-07-05
6	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加东兴证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-07-26
7	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加东方财富证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-08-01
8	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加华鑫证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-08-07
9	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加财通证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-08-28
10	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加国盛证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-09-03
11	南方基金管理股份有限公司关于高级管理人员	证券日报、基金管理	2024-09-21

	变更的公告	人网站、中国证监会 基金电子披露网站	
12	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加 国海证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2024-09-24
13	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加 长江证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2024-10-28
14	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金改聘 会计师事务所公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2024-11-02
15	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加 西部证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2024-11-25
16	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加 山西证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2024-12-04
17	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	2024-12-06
18	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加 国新证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2024-12-12

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的文件;
- 2、《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
- 3、《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告》原文。

13.2 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。

13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>