

深证成份交易型开放式指数证券投资 基金 2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	49
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	49
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	49

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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末上市基金前十名持有人	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	51
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方深证成份 ETF
场内简称	深成 ETF
基金主代码	159903
交易代码	159903
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 4 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	376,154,507.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 2 月 2 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。 存托凭证的投资策略：本基金将根据法律法规和监管机构的要求，制定存托凭证投资策略，关注发行人有关信息披露情况，关注发行人基本面情况、市场估值等因素，通过定性分析和定量分析相结合的办法，参与存托凭证的投资，谨慎决定存托凭证的权重配置和标的选择。
业绩比较基准	深证成份指数
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	鲍文革	郭明
	联系电话	0755-82763888	(010) 66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	(010) 66105798
注册地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518017	100140
法定代表人		周易	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	20,483,235.29
本期利润	14,774,822.07
加权平均基金份额本期利润	0.0350
本期加权平均净值利润率	2.84%
本期基金份额净值增长率	1.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-34,208,829.56
期末可供分配基金份额利润	-0.0909
期末基金资产净值	475,580,838.63

期末基金份额净值	1.2643
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-6.71%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	4.72%	0.80%	4.23%	0.80%	0.49%	0.00%
过去三个月	0.48%	1.52%	-0.37%	1.52%	0.85%	0.00%
过去六个月	1.31%	1.39%	0.48%	1.39%	0.83%	0.00%
过去一年	19.87%	1.82%	18.27%	1.82%	1.60%	0.00%
过去三年	-16.15%	1.40%	-18.85%	1.40%	2.70%	0.00%
自基金合同 生效起至今	-6.71%	1.55%	-24.63%	1.56%	17.92%	-0.01%

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

南方深证成份ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业	说明
----	----	-----------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
孙伟	本基金基金经理	2016 年 8 月 19 日	-	15 年	北京大学工商管理硕士，注册会计师（CPA），具有基金从业资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010 年 2 月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员、基金经理助理；2015 年 5 月 22 日至 2016 年 7 月 29 日，任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 7 月 2 日至 2020 年 12 月 1 日，任改革基金、高铁基金基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 7 日，任南方中证 500 工业 ETF 基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 14 日，任南方中证 500 原材料 ETF 基金经理；2020 年 12 月 1 日至 2021 年 4 月 19 日，任改革基金基金经理；2015 年 7 月 10 日至今，任 500 信息基金经理；2016 年 5 月 13 日至今，任南方创业板 ETF 基金经理；2016 年 5 月 20 日至今，任南方创业板 ETF 联接基金经理；2016 年 8 月 17 日至今，任 500 信息联接基金经理；2016 年 8 月 19 日至今，任深成 ETF、南方深成基金经理；2017 年 3 月 8 日至今，任南方全指证券 ETF 联接基金经理；2017 年 3 月 10 日至今，任南方中证全指证券 ETF 基金经理；2017 年 6 月 28 日至今，任南方中证银行 ETF 基金经理；2017 年 6 月 29 日至今，任南方银行联接基金经理；2018 年 2 月 8 日至今，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至今，任南方 H 股联接基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任南方上证 380ETF、南方上证 380ETF 联接基金经理；2020 年 12 月 1 日至今，任高铁基金基金经理；2022 年 3 月 3 日至今，任南方上海金 ETF 基金经理；2023 年 7 月 25 日至今，任南方上海金 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 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 96 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年上半年，深证成指以 0.48% 的微幅上涨收官，呈现“政策底支撑下的结构性博弈”特征。政策层面继续推动高质量发展，强调科技创新与产业升级，这对以科技、消费和先进制造为代表的深市上市公司形成积极支撑。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

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

(2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离；

(3) 根据指数成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内；

(4) 新股上市初期涨幅较大的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.2643 元，报告期内，份额净值增长率为 1.31%，同期业绩基准增长率为 0.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，深证成指的投资价值仍值得关注。一方面，随着权益类资产估值水平的回落，市场具备一定的配置吸引力；另一方面，部分优质企业的盈利能力在成本端改善和需求端回暖的双重驱动下有望回升；此外，新能源、高端制造等新兴领域的持续投入也将为市场注入新的增长动能。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括财务负责人、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、现金及债券指数投资部总经理、国际业务部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.3.1	669,326.52	410,033.34
结算备付金		36,575.04	19,393.23
存出保证金		12,106.09	24,342.03

交易性金融资产	6.4.3.2	475,186,279.07	562,924,619.18
其中：股票投资		475,167,577.84	562,924,619.18
基金投资		-	-
债券投资		18,701.23	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		11,940.84	2,424.45
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		475,916,227.56	563,380,812.23
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,060.19	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		202,683.92	243,196.04
应付托管费		40,536.79	48,639.19
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	89,108.03	100,605.02
负债合计		335,388.93	392,440.31
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	509,789,668.19	611,434,668.93
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	-34,208,829.56	-48,446,297.01

净资产合计		475,580,838.63	562,988,371.92
负债和净资产总计		475,916,227.56	563,380,812.23

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2643 元，基金份额总额 376,154,507.00 份。

6.2 利润表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		16,447,041.47	-16,285,371.37
1.利息收入		1,676.51	1,414.96
其中：存款利息收入	6.4.3.9	1,676.51	1,414.96
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）		22,210,660.43	-7,139,916.47
其中：股票投资收益	6.4.3.10	16,428,858.09	-11,817,982.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	36,914.83	4,686.74
资产支持证券投资	6.4.3.12	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.13	-	-
股利收益	6.4.3.14	5,744,887.51	4,673,379.44
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.15	-5,708,413.22	-9,075,477.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-56,882.25	-71,392.39

减：二、营业总支出		1,672,219.40	1,237,876.58
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	1,293,691.71	902,575.17
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.6.2.2	258,738.39	180,515.03
3.销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		0.07	0.02
8.其他费用	6.4.3.17	119,789.23	154,786.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,774,822.07	-17,523,247.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,774,822.07	-17,523,247.95
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		14,774,822.07	-17,523,247.95

6.3 净资产变动表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	611,434,668.93	-	-48,446,297.01	562,988,371.92
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	611,434,668.93	-	-48,446,297.01	562,988,371.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-101,645,000.74	-	14,237,467.45	-87,407,533.29
（一）、综合收益总额	-	-	14,774,822.07	14,774,822.07
（二）、本期基金	-101,645,000.74	-	-537,354.62	-102,182,355.36

份额交易产生的 净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中：1.基金申 购款	195,158,401.29	-	-23,697,712.54	171,460,688.75
2.基金赎 回款	-296,803,402.03	-	23,160,357.92	-273,643,044.11
(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	509,789,668.19	-	-34,208,829.56	475,580,838.63
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产	404,078,867.51	-	-68,729,518.90	335,349,348.61
加：会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净 资产	404,078,867.51	-	-68,729,518.90	335,349,348.61
三、本期增减变 动额(减少以“-” 号填列)	73,184,400.49	-	-37,115,325.80	36,069,074.69
(一)、综合收益 总额	-	-	-17,523,247.95	-17,523,247.95
(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)	73,184,400.49	-	-19,592,077.85	53,592,322.64
其中：1.基金申 购款	182,961,001.25	-	-40,641,524.95	142,319,476.30
2.基金赎 回款	-109,776,600.76	-	21,049,447.10	-88,727,153.66

(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	477,263,268.00	-	-105,844,844.70	371,418,423.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____杨小松_____

_____蔡忠评_____

_____徐超_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	669,326.52
等于：本金	669,283.12
加：应计利息	43.40
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	669,326.52

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		447,084,968.02	-	475,167,577.84	28,082,609.82
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	18,700.00	1.23	18,701.23	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	18,700.00	1.23	18,701.23	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		447,103,668.02	1.23	475,186,279.07	28,082,609.82

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.3.5 其他资产

无。

6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,805.47
其中：交易所市场	4,805.47
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	-
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	-
可退替代款	-
合计	89,108.03

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	451,154,507.00	611,434,668.93
本期申购	144,000,000.00	195,158,401.29
本期赎回（以“-”号填列）	-219,000,000.00	-296,803,402.03
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	376,154,507.00	509,789,668.19

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

6.4.3.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	325,745,429.20	-374,191,726.21	-48,446,297.01
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	325,745,429.20	-374,191,726.21	-48,446,297.01
本期利润	20,483,235.29	-5,708,413.22	14,774,822.07
本期基金份额交易产生的变动数	-55,996,197.57	55,458,842.95	-537,354.62
其中：基金申购款	107,146,903.70	-130,844,616.24	-23,697,712.54

基金赎回款	-163,143,101.27	186,303,459.19	23,160,357.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	290,232,466.92	-324,441,296.48	-34,208,829.56

6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,547.76
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	98.42
其他	30.33
合计	1,676.51

6.4.3.10 股票投资收益

6.4.3.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-766,688.62
股票投资收益——赎回差价收入	17,195,546.71
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	16,428,858.09

6.4.3.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	20,815,386.67
减：卖出股票成本总额	21,561,013.02
减：交易费用	21,062.27
买卖股票差价收入	-766,688.62

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.3.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	273,643,044.11
减：现金支付赎回款总额	30,761.11
减：赎回股票成本总额	256,416,736.29
减：交易费用	-
赎回差价收入	17,195,546.71

6.4.3.11 债券投资收益

6.4.3.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	25.35
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	36,889.48
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	36,914.83

6.4.3.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	281,025.54
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	244,100.00
减：应计利息总额	24.80
减：交易费用	11.26
买卖债券差价收入	36,889.48

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.3.12 资产支持证券投资收益

6.4.3.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.3.13 衍生工具收益

6.4.3.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.3.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.3.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,744,887.51
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	5,744,887.51

6.4.3.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-5,708,413.22
——股票投资	-5,708,413.22
——债券投资	-
——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	-5,708,413.22

6.4.3.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-56,882.25
合计	-56,882.25

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额，或强制退款的被替代证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.3.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	35,264.67
银行费用	222.00
合计	119,789.23

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），规定自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

6.4.5 关联方关系

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

无。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
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
南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“南方深证成份 ETF 联接”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	-	-	6,242,808.74	16.28%

6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	-	-	36,290.67	100.00%

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 权证交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	624.38	16.28%	12.90	0.51%

注：1. 上述佣金费率参考市场价格确定。

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

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,293,691.71	902,575.17
其中：应支付销售机构的客户维护费	51,538.63	-
应支付基金管理人的净管理费	1,242,153.08	902,575.17

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

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
----	------------------------------------	---

当期发生的基金应支付的托管费	258,738.39	180,515.03
----------------	------------	------------

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。

6.4.6.2.3 销售服务费

无。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券股份有限公司	780,009.00	0.21%	814,409.00	0.18%
中国工商银行股份有限公司—南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	145,465,474.00	38.67%	167,919,674.00	37.22%

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

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	669,326.52	1,547.76	638,351.65	1,119.83

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	127108	太能转债	配债	858	85,800.00

上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	-	-	-	-	-

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

6.4.8 期末（2025 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123257	安克转债	2025 年 6 月 16 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.01	187	18,700.00	18,701.23	-

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值	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
------	------	------	------	------	------	--------	-------	--------	--------	----

				单价						
000627	*ST 天茂	2025 年 5 月 6 日	未按交易所要求按时披露重要信息	2.74	2025 年 7 月 8 日	2.60	74,200	249,329.58	203,308.00	-
400174	中天 3	2023 年 8 月 30 日	暂停转让	0.14	-	-	100,100	332,602.15	14,014.00	-

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，紧密跟踪深证成份指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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

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

6.4.9.2 信用风险

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

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

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

6.4.9.3 流动性风险

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

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

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

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	669,326.52	-	-	-	669,326.52
结算备付金	36,575.04	-	-	-	36,575.04
存出保证金	12,106.09	-	-	-	12,106.09
交易性金融资产	-	-	18,701.23	475,167,577.84	475,186,279.07
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	-	-	-	11,940.84	11,940.84
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	718,007.65	-	18,701.23	475,179,518.68	475,916,227.56
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	-	-	-	3,060.19	3,060.19
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	202,683.92	202,683.92
应付托管费	-	-	-	40,536.79	40,536.79
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	-	-	-	89,108.03	89,108.03
负债总计	-	-	-	335,388.93	335,388.93
利率敏感度缺口	718,007.65	-	18,701.23	474,844,129.75	475,580,838.63
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	410,033.34	-	-	-	410,033.34
结算备付金	19,393.23	-	-	-	19,393.23
存出保证金	24,342.03	-	-	-	24,342.03
交易性金融资产	-	-	-	562,924,619.18	562,924,619.18
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	-	-	-	2,424.45	2,424.45
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	453,768.60	-	-	562,927,043.63	563,380,812.23
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	243,196.04	243,196.04
应付托管费	-	-	-	48,639.19	48,639.19

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.06	0.06
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	100,605.02	100,605.02
负债总计	-	-	-	392,440.31	392,440.31
利率敏感度缺口	453,768.60	-	-	562,534,603.32	562,988,371.92

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。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2025 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2024 年 12 月 31 日 ）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	0.00	0.00
	2.市场利率平行下降 25 个基点	0.00	0.00

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	475,167,577.84	99.91	562,924,619.18	99.99
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	475,167,577.84	99.91	562,924,619.18	99.99

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	23,656,251.59	27,988,715.22
	2.组合自身基准下降 5%	-23,656,251.59	-27,988,715.22

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日
第一层次	474,950,255.84
第二层次	222,009.23
第三层次	14,014.00
合计	475,186,279.07

6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	475,167,577.84	99.84
	其中：股票	475,167,577.84	99.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,701.23	0.00
	其中：债券	18,701.23	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	705,901.56	0.15
8	其他各项资产	24,046.93	0.01
9	合计	475,916,227.56	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而行业分类的合计项中不含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	9,401,516.55	1.98
B	采矿业	6,185,557.26	1.30
C	制造业	346,422,620.94	72.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,937,320.20	1.25
E	建筑业	790,474.00	0.17
F	批发和零售业	5,002,443.00	1.05
G	交通运输、仓储和邮政业	7,863,371.28	1.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,098,778.26	6.54
J	金融业	40,467,553.56	8.51
K	房地产业	3,926,087.40	0.83
L	租赁和商务服务业	6,324,043.02	1.33
M	科学研究和技术服务业	3,632,105.10	0.76
N	水利、环境和公共设施管理业	958,724.40	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	590,580.00	0.12
Q	卫生和社会工作	2,935,770.08	0.62
R	文化、体育和娱乐业	3,413,310.79	0.72
S	综合	-	-
	合计	474,950,255.84	99.87

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	203,308.00	0.04
K	房地产业	14,014.00	0.00
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	217,322.00	0.05

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	104,260	26,296,457.20	5.53
2	000333	美的集团	199,291	14,388,810.20	3.03
3	300059	东方财富	506,681	11,719,531.53	2.46
4	002594	比亚迪	34,236	11,363,270.76	2.39
5	000858	五粮液	73,441	8,732,134.90	1.84
6	000651	格力电器	176,040	7,907,716.80	1.66
7	002475	立讯精密	189,208	6,563,625.52	1.38
8	000725	京东方 A	1,341,242	5,351,555.58	1.13
9	300124	汇川技术	80,491	5,197,303.87	1.09
10	300308	中际旭创	34,832	5,080,595.52	1.07
11	002371	北方华创	11,400	5,041,194.00	1.06
12	300760	迈瑞医疗	22,100	4,966,975.00	1.04
13	300502	新易盛	35,426	4,499,810.52	0.95
14	002352	顺丰控股	89,483	4,363,191.08	0.92
15	002714	牧原股份	101,483	4,263,300.83	0.90
16	002415	海康威视	152,781	4,236,617.13	0.89
17	000063	中兴通讯	129,133	4,195,531.17	0.88
18	000001	平安银行	343,112	4,141,361.84	0.87
19	300274	阳光电源	58,988	3,997,616.76	0.84
20	002142	宁波银行	138,411	3,786,924.96	0.80
21	002230	科大讯飞	78,670	3,766,719.60	0.79
22	300498	温氏股份	215,809	3,686,017.72	0.78
23	000568	泸州老窖	30,592	3,469,132.80	0.73
24	300476	胜宏科技	24,700	3,319,186.00	0.70

25	000100	TCL 科技	735,378	3,184,186.74	0.67
26	000338	潍柴动力	206,408	3,174,555.04	0.67
27	002027	分众传媒	408,696	2,983,480.80	0.63
28	000425	徐工机械	336,508	2,614,667.16	0.55
29	000792	盐湖股份	144,500	2,468,060.00	0.52
30	300014	亿纬锂能	51,151	2,343,227.31	0.49
31	002463	沪电股份	54,720	2,329,977.60	0.49
32	002241	歌尔股份	98,810	2,304,249.20	0.48
33	002625	光启技术	56,390	2,254,472.20	0.47
34	002050	三花智控	85,360	2,251,796.80	0.47
35	000625	长安汽车	175,836	2,243,667.36	0.47
36	300015	爱尔眼科	176,088	2,197,578.24	0.46
37	300033	同花顺	8,000	2,184,080.00	0.46
38	000977	浪潮信息	41,986	2,136,247.68	0.45
39	002384	东山精密	51,400	1,941,378.00	0.41
40	000776	广发证券	114,059	1,917,331.79	0.40
41	002179	中航光电	46,086	1,860,030.96	0.39
42	002311	海大集团	31,240	1,830,351.60	0.38
43	300433	蓝思科技	78,858	1,758,533.40	0.37
44	000938	紫光股份	73,158	1,755,060.42	0.37
45	000002	万科 A	271,758	1,744,686.36	0.37
46	002049	紫光国微	26,478	1,743,841.08	0.37
47	000538	云南白药	30,520	1,702,710.80	0.36
48	300408	三环集团	50,900	1,700,060.00	0.36
49	002028	思源电气	23,000	1,676,930.00	0.35
50	002422	科伦药业	46,578	1,673,081.76	0.35
51	000166	申万宏源	331,069	1,661,966.38	0.35
52	000988	华工科技	34,000	1,598,340.00	0.34
53	300339	润和软件	31,300	1,590,979.00	0.33
54	002304	洋河股份	24,361	1,572,502.55	0.33
55	002460	赣锋锂业	45,060	1,521,676.20	0.32
56	000768	中航西飞	52,790	1,443,278.60	0.30
57	000157	中联重科	197,527	1,428,120.21	0.30
58	002074	国轩高科	43,900	1,424,994.00	0.30
59	300394	天孚通信	17,804	1,421,471.36	0.30
60	002456	欧菲光	118,002	1,398,323.70	0.29
61	002966	苏州银行	157,980	1,387,064.40	0.29
62	002517	恺英网络	71,200	1,374,872.00	0.29
63	002252	上海莱士	198,340	1,362,595.80	0.29
64	000807	云铝股份	84,200	1,345,516.00	0.28
65	002466	天齐锂业	41,900	1,342,476.00	0.28
66	002001	新和成	62,928	1,338,478.56	0.28
67	000975	山金国际	68,604	1,299,359.76	0.27

68	301236	软通动力	23,728	1,296,497.92	0.27
69	002736	国信证券	110,800	1,276,416.00	0.27
70	000963	华东医药	31,095	1,254,994.20	0.26
71	300255	常山药业	26,800	1,249,148.00	0.26
72	000408	藏格矿业	29,200	1,245,964.00	0.26
73	002340	格林美	195,200	1,239,520.00	0.26
74	002236	大华股份	77,178	1,225,586.64	0.26
75	001979	招商蛇口	138,827	1,217,512.79	0.26
76	000661	长春高新	12,200	1,209,996.00	0.25
77	002648	卫星化学	69,801	1,209,651.33	0.25
78	000066	中国长城	81,438	1,205,282.40	0.25
79	300661	圣邦股份	16,507	1,201,214.39	0.25
80	300803	指南针	14,860	1,198,607.60	0.25
81	002195	岩山科技	212,505	1,196,403.15	0.25
82	002558	巨人网络	49,300	1,161,015.00	0.24
83	002156	通富微电	45,180	1,157,511.60	0.24
84	300418	昆仑万维	34,400	1,156,872.00	0.24
85	300251	光线传媒	56,420	1,143,633.40	0.24
86	300347	泰格医药	21,200	1,130,384.00	0.24
87	300207	欣旺达	55,400	1,111,324.00	0.23
88	002797	第一创业	156,740	1,109,719.20	0.23
89	002920	德赛西威	10,800	1,103,004.00	0.23
90	300450	先导智能	44,299	1,100,830.15	0.23
91	002916	深南电路	9,899	1,067,211.19	0.22
92	002202	金风科技	104,013	1,066,133.25	0.22
93	000895	双汇发展	43,524	1,062,420.84	0.22
94	002465	海格通信	75,700	1,055,258.00	0.22
95	002185	华天科技	104,274	1,053,167.40	0.22
96	000933	神火股份	62,500	1,040,000.00	0.22
97	003816	中国广核	282,400	1,027,936.00	0.22
98	300896	爱美客	5,880	1,027,882.80	0.22
99	002555	三七互娱	58,900	1,018,381.00	0.21
100	300779	惠城环保	5,700	1,017,393.00	0.21
101	002601	龙佰集团	62,100	1,006,641.00	0.21
102	000831	中国稀土	27,800	1,004,136.00	0.21
103	302132	中航成飞	11,400	1,002,516.00	0.21
104	300782	卓胜微	13,886	991,043.82	0.21
105	002595	豪迈科技	16,700	988,974.00	0.21
106	000997	新大陆	30,380	983,704.40	0.21
107	002600	领益智造	114,500	983,555.00	0.21
108	002273	水晶光电	48,654	971,620.38	0.20
109	002493	荣盛石化	116,325	963,171.00	0.20
110	000786	北新建材	36,300	961,224.00	0.20

111	300442	润泽科技	19,340	957,910.20	0.20
112	300866	安克创新	8,410	955,376.00	0.20
113	300458	全志科技	24,010	952,956.90	0.20
114	000423	东阿阿胶	18,205	952,121.50	0.20
115	002281	光迅科技	19,200	946,944.00	0.20
116	300058	蓝色光标	143,947	944,292.32	0.20
117	002532	天山铝业	113,300	941,523.00	0.20
118	300759	康龙化成	38,325	940,495.50	0.20
119	000630	铜陵有色	281,000	938,540.00	0.20
120	300474	景嘉微	12,850	938,050.00	0.20
121	001965	招商公路	76,813	921,756.00	0.19
122	002129	TCL 中环	118,800	912,384.00	0.19
123	002294	信立泰	19,200	908,736.00	0.19
124	002180	纳思达	39,600	908,424.00	0.19
125	002472	双环传动	26,900	900,881.00	0.19
126	300002	神州泰岳	76,300	900,340.00	0.19
127	300223	北京君正	13,000	899,600.00	0.19
128	300454	深信服	9,500	894,710.00	0.19
129	300122	智飞生物	45,650	894,283.50	0.19
130	300017	网宿科技	82,945	889,170.40	0.19
131	300395	菲利华	17,400	889,140.00	0.19
132	000783	长江证券	127,119	880,934.67	0.19
133	002709	天赐材料	48,356	876,210.72	0.18
134	000034	神州数码	23,247	875,017.08	0.18
135	301269	华大九天	7,000	867,160.00	0.18
136	002085	万丰奥威	54,128	860,093.92	0.18
137	000426	兴业银锡	54,300	857,940.00	0.18
138	002078	太阳纸业	63,700	857,402.00	0.18
139	002223	鱼跃医疗	23,900	850,840.00	0.18
140	002938	鹏鼎控股	26,500	848,795.00	0.18
141	002851	麦格米特	16,900	847,366.00	0.18
142	000728	国元证券	107,305	846,636.45	0.18
143	002353	杰瑞股份	24,187	846,545.00	0.18
144	300024	机器人	47,990	824,468.20	0.17
145	000766	通化金马	32,300	819,451.00	0.17
146	002738	中矿资源	25,480	819,436.80	0.17
147	002065	东华软件	85,200	817,920.00	0.17
148	002131	利欧股份	233,543	817,400.50	0.17
149	300115	长盈精密	38,188	817,223.20	0.17
150	300496	中科创达	14,254	815,613.88	0.17
151	000733	振华科技	16,200	810,810.00	0.17
152	000021	深科技	43,200	809,568.00	0.17
153	002008	大族激光	33,100	806,647.00	0.17

154	300383	光环新网	56,300	805,090.00	0.17
155	000596	古井贡酒	6,039	804,092.85	0.17
156	000876	新希望	85,652	803,415.76	0.17
157	000999	华润三九	25,683	803,364.24	0.17
158	002271	东方雨虹	74,863	803,279.99	0.17
159	002436	兴森科技	60,300	798,372.00	0.17
160	300054	鼎龙股份	27,800	797,304.00	0.17
161	002128	电投能源	39,900	789,222.00	0.17
162	002138	顺络电子	28,000	787,360.00	0.17
163	000301	东方盛虹	93,900	782,187.00	0.16
164	002673	西部证券	99,254	782,121.52	0.16
165	002850	科达利	6,900	780,873.00	0.16
166	300253	卫宁健康	73,523	779,343.80	0.16
167	300765	新诺威	15,060	778,451.40	0.16
168	000617	中油资本	106,400	776,720.00	0.16
169	002624	完美世界	51,050	774,428.50	0.16
170	300604	长川科技	17,200	772,452.00	0.16
171	300832	新产业	13,600	771,392.00	0.16
172	002157	正邦科技	282,100	770,133.00	0.16
173	002155	湖南黄金	42,950	766,657.50	0.16
174	002405	四维图新	89,396	763,441.84	0.16
175	002126	银轮股份	31,300	759,964.00	0.16
176	002410	广联达	55,847	748,908.27	0.16
177	300346	南大光电	23,668	748,855.52	0.16
178	300857	协创数据	8,700	748,722.00	0.16
179	002402	和而泰	32,000	741,440.00	0.16
180	000519	中兵红箭	33,500	733,315.00	0.15
181	002459	晶澳科技	72,776	726,304.48	0.15
182	300136	信维通信	32,360	724,864.00	0.15
183	300073	当升科技	16,500	723,855.00	0.15
184	300142	沃森生物	65,700	722,700.00	0.15
185	002444	巨星科技	28,300	721,933.00	0.15
186	002821	凯莱英	8,080	713,060.00	0.15
187	000878	云南铜业	55,996	712,269.12	0.15
188	300001	特锐德	29,300	702,321.00	0.15
189	002837	英维克	23,634	702,166.14	0.15
190	002152	广电运通	52,200	701,568.00	0.15
191	000932	华菱钢铁	159,140	700,216.00	0.15
192	000750	国海证券	168,725	695,147.00	0.15
193	300459	汤姆猫	123,389	690,978.40	0.15
194	002812	恩捷股份	23,580	690,658.20	0.15
195	300627	华测导航	19,700	689,500.00	0.14
196	300003	乐普医疗	49,600	683,488.00	0.14

197	300773	拉卡拉	20,400	682,380.00	0.14
198	300316	晶盛机电	24,910	676,306.50	0.14
199	300699	光威复材	21,292	674,317.64	0.14
200	300037	新宙邦	19,060	670,912.00	0.14
201	002414	高德红外	65,420	670,555.00	0.14
202	300674	宇信科技	22,100	669,409.00	0.14
203	300999	金龙鱼	22,658	669,090.74	0.14
204	300012	华测检测	56,500	660,485.00	0.14
205	000893	亚钾国际	21,900	660,066.00	0.14
206	002389	航天彩虹	25,700	657,920.00	0.14
207	000983	山西焦煤	101,920	652,288.00	0.14
208	300628	亿联网络	18,700	650,012.00	0.14
209	002007	华兰生物	41,230	646,074.10	0.14
210	300757	罗博特科	4,300	644,871.00	0.14
211	001696	宗申动力	28,600	642,070.00	0.14
212	002958	青农商行	173,200	625,252.00	0.13
213	300568	星源材质	49,127	622,930.36	0.13
214	300364	中文在线	23,500	622,750.00	0.13
215	000729	燕京啤酒	48,100	621,933.00	0.13
216	002335	科华数据	14,500	618,860.00	0.13
217	000009	中国宝安	69,517	617,310.96	0.13
218	000623	吉林敖东	36,218	613,895.10	0.13
219	002044	美年健康	118,256	607,835.84	0.13
220	300666	江丰电子	8,200	607,620.00	0.13
221	002409	雅克科技	11,100	607,059.00	0.13
222	300373	扬杰科技	11,660	605,154.00	0.13
223	002683	广东宏大	17,800	604,132.00	0.13
224	002739	万达电影	52,300	597,789.00	0.13
225	000528	柳工	62,160	597,357.60	0.13
226	002139	拓邦股份	43,100	595,211.00	0.13
227	002318	久立特材	25,300	591,767.00	0.12
228	000960	锡业股份	38,672	591,681.60	0.12
229	300558	贝达药业	10,200	591,090.00	0.12
230	002607	中公教育	193,000	590,580.00	0.12
231	000039	中集集团	74,490	585,491.40	0.12
232	300748	金力永磁	24,360	580,742.40	0.12
233	300570	太辰光	6,000	578,280.00	0.12
234	000738	航发控制	27,850	577,887.50	0.12
235	002025	航天电器	11,190	575,277.90	0.12
236	000887	中鼎股份	32,600	573,434.00	0.12
237	000400	许继电气	26,200	570,374.00	0.12
238	300724	捷佳伟创	10,500	570,150.00	0.12
239	300919	中伟股份	17,260	567,508.80	0.12

240	300100	双林股份	12,000	564,960.00	0.12
241	002385	大北农	138,950	561,358.00	0.12
242	300144	宋城演艺	64,926	555,117.30	0.12
243	002080	中材科技	28,210	550,095.00	0.12
244	300413	芒果超媒	25,100	547,682.00	0.12
245	300296	利亚德	89,550	546,255.00	0.11
246	300285	国瓷材料	31,350	543,922.50	0.11
247	300432	富临精工	41,440	541,620.80	0.11
248	002222	福晶科技	15,800	540,360.00	0.11
249	300623	捷捷微电	18,054	538,009.20	0.11
250	300638	广和通	18,660	534,235.80	0.11
251	002487	大金重工	16,200	532,980.00	0.11
252	002841	视源股份	15,400	532,840.00	0.11
253	002568	百润股份	20,800	532,688.00	0.11
254	300682	朗新集团	22,550	529,925.00	0.11
255	000513	丽珠集团	14,660	528,346.40	0.11
256	002926	华西证券	58,500	522,990.00	0.11
257	000415	渤海租赁	156,800	522,144.00	0.11
258	002407	多氟多	42,760	521,244.40	0.11
259	300777	中简科技	14,200	514,750.00	0.11
260	301358	湖南裕能	16,300	508,397.00	0.11
261	300088	长信科技	85,104	507,219.84	0.11
262	002312	川发龙蟒	44,000	505,120.00	0.11
263	002245	蔚蓝锂芯	39,300	504,219.00	0.11
264	000683	博源化工	105,200	503,908.00	0.11
265	300763	锦浪科技	8,765	503,023.35	0.11
266	300672	国科微	5,900	501,028.00	0.11
267	000723	美锦能源	115,600	499,392.00	0.11
268	002151	北斗星通	17,400	499,206.00	0.10
269	002432	九安医疗	13,700	499,091.00	0.10
270	300487	蓝晓科技	9,900	497,970.00	0.10
271	300182	捷成股份	89,659	494,021.09	0.10
272	002015	协鑫能科	35,300	491,729.00	0.10
273	300679	电连技术	10,800	490,104.00	0.10
274	300676	华大基因	9,800	487,746.00	0.10
275	002497	雅化集团	41,700	475,380.00	0.10
276	002056	横店东磁	33,500	474,025.00	0.10
277	300229	拓尔思	25,600	472,064.00	0.10
278	000591	太阳能	107,100	470,169.00	0.10
279	002617	露笑科技	61,700	464,601.00	0.10
280	002506	协鑫集成	173,500	463,245.00	0.10
281	000060	中金岭南	100,845	461,870.10	0.10
282	000703	恒逸石化	78,478	461,450.64	0.10

283	002064	华峰化学	69,700	460,717.00	0.10
284	000155	川能动力	46,800	459,576.00	0.10
285	002756	永兴材料	14,410	457,517.50	0.10
286	002500	山西证券	78,280	457,155.20	0.10
287	000970	中科三环	38,570	453,968.90	0.10
288	002203	海亮股份	43,900	453,048.00	0.10
289	300567	精测电子	7,450	451,544.50	0.09
290	002262	恩华药业	21,700	450,926.00	0.09
291	300146	汤臣倍健	40,100	450,724.00	0.09
292	002939	长城证券	53,600	449,168.00	0.09
293	000818	航锦科技	19,900	447,750.00	0.09
294	000998	隆平高科	45,400	447,190.00	0.09
295	000629	钒钛股份	174,500	446,720.00	0.09
296	002176	江特电机	61,400	445,764.00	0.09
297	300475	香农芯创	12,500	445,375.00	0.09
298	002439	启明星辰	27,800	444,522.00	0.09
299	300390	天华新能	23,300	444,331.00	0.09
300	000403	派林生物	24,270	440,015.10	0.09
301	002249	大洋电机	66,834	439,767.72	0.09
302	000050	深天马 A	51,600	439,632.00	0.09
303	002653	海思科	10,400	439,088.00	0.09
304	002423	中粮资本	35,900	439,057.00	0.09
305	002603	以岭药业	31,120	438,792.00	0.09
306	000958	电投产融	63,700	435,708.00	0.09
307	000547	航天发展	51,700	434,280.00	0.09
308	000636	风华高科	31,500	432,810.00	0.09
309	002984	森麒麟	23,060	432,375.00	0.09
310	002484	江海股份	21,100	432,339.00	0.09
311	000921	海信家电	16,800	431,760.00	0.09
312	000563	陕国投 A	120,830	431,363.10	0.09
313	000099	中信海直	19,700	429,066.00	0.09
314	002145	中核钛白	103,185	428,217.75	0.09
315	000686	东北证券	56,100	428,043.00	0.09
316	002244	滨江集团	43,900	428,025.00	0.09
317	002701	奥瑞金	71,100	423,045.00	0.09
318	000830	鲁西化工	41,000	422,300.00	0.09
319	300775	三角防务	15,700	421,702.00	0.09
320	002747	埃斯顿	20,800	420,992.00	0.09
321	000951	中国重汽	23,840	419,107.20	0.09
322	301078	孩子王	31,900	416,933.00	0.09
323	300677	英科医疗	17,520	414,873.60	0.09
324	002268	电科网安	22,400	409,696.00	0.09
325	002936	郑州银行	198,440	408,786.40	0.09

326	300212	易华录	18,700	406,912.00	0.09
327	000799	酒鬼酒	9,200	404,708.00	0.09
328	002507	涪陵榨菜	31,540	403,396.60	0.08
329	300751	迈为股份	5,758	400,526.48	0.08
330	300438	鹏辉能源	14,500	400,345.00	0.08
331	000708	中信特钢	34,030	400,192.80	0.08
332	002373	千方科技	42,300	393,390.00	0.08
333	001227	兰州银行	156,900	392,250.00	0.08
334	000875	吉电股份	77,500	392,150.00	0.08
335	002948	青岛银行	78,290	389,884.20	0.08
336	000581	威孚高科	20,551	389,235.94	0.08
337	301536	星宸科技	6,400	385,920.00	0.08
338	300735	光弘科技	15,300	384,030.00	0.08
339	300070	碧水源	85,334	384,003.00	0.08
340	002429	兆驰股份	87,400	382,812.00	0.08
341	002544	普天科技	16,300	382,235.00	0.08
342	000598	兴蓉环境	53,000	382,130.00	0.08
343	000559	万向钱潮	49,940	382,041.00	0.08
344	300529	健帆生物	17,700	381,789.00	0.08
345	300601	康泰生物	25,100	381,269.00	0.08
346	002019	亿帆医药	29,300	380,607.00	0.08
347	002221	东华能源	39,300	379,638.00	0.08
348	300009	安科生物	44,967	376,373.79	0.08
349	002773	康弘药业	12,990	376,320.30	0.08
350	002368	太极股份	16,059	376,101.78	0.08
351	000422	湖北宜化	31,400	374,288.00	0.08
352	002240	盛新锂能	29,000	373,520.00	0.08
353	301498	乖宝宠物	3,400	371,858.00	0.08
354	002698	博实股份	23,800	369,852.00	0.08
355	000778	新兴铸管	99,232	369,143.04	0.08
356	003021	兆威机电	3,400	367,710.00	0.08
357	301308	江波龙	4,200	367,458.00	0.08
358	002831	裕同科技	15,580	364,883.60	0.08
359	300910	瑞丰新材	6,300	363,825.00	0.08
360	002430	杭氧股份	18,700	363,154.00	0.08
361	000737	北方铜业	33,400	362,724.00	0.08
362	300718	长盛轴承	5,200	361,348.00	0.08
363	002508	老板电器	18,960	360,429.60	0.08
364	000062	深圳华强	13,412	360,246.32	0.08
365	300573	兴齐眼药	6,928	358,801.12	0.08
366	002675	东诚药业	24,900	358,311.00	0.08
367	301050	雷电微力	6,660	354,978.00	0.07
368	002120	韵达股份	52,961	354,838.70	0.07

369	001389	广合科技	6,000	352,620.00	0.07
370	002270	华明装备	21,000	351,540.00	0.07
371	300456	赛微电子	20,300	348,957.00	0.07
372	000032	深桑达 A	17,200	347,956.00	0.07
373	000657	中钨高新	29,100	345,126.00	0.07
374	300118	东方日升	35,900	343,922.00	0.07
375	000801	四川九洲	21,900	342,078.00	0.07
376	300979	华利集团	6,500	341,705.00	0.07
377	000739	普洛药业	24,200	338,800.00	0.07
378	002048	宁波华翔	18,400	338,744.00	0.07
379	002670	国盛金控	22,460	338,023.00	0.07
380	002847	盐津铺子	4,200	337,680.00	0.07
381	000762	西藏矿业	17,600	337,568.00	0.07
382	002183	怡亚通	72,640	334,870.40	0.07
383	000682	东方电子	32,700	334,848.00	0.07
384	000709	河钢股份	154,700	334,152.00	0.07
385	002299	圣农发展	23,200	331,528.00	0.07
386	300457	赢合科技	14,300	328,900.00	0.07
387	000069	华侨城 A	145,249	326,810.25	0.07
388	003031	中瓷电子	6,100	324,581.00	0.07
389	000987	越秀资本	47,186	323,695.96	0.07
390	000902	新洋丰	23,302	322,266.66	0.07
391	300294	博雅生物	12,350	320,976.50	0.07
392	002572	索菲亚	22,864	320,324.64	0.07
393	000027	深圳能源	50,140	319,893.20	0.07
394	300957	贝泰妮	7,200	318,384.00	0.07
395	002003	伟星股份	29,100	317,481.00	0.07
396	002416	爱施德	26,300	316,126.00	0.07
397	000555	神州信息	22,200	315,684.00	0.07
398	000825	太钢不锈	87,700	314,843.00	0.07
399	301301	川宁生物	26,100	314,244.00	0.07
400	300595	欧普康视	20,520	313,340.40	0.07
401	002597	金禾实业	13,300	313,215.00	0.07
402	000883	湖北能源	69,400	312,994.00	0.07
403	300026	红日药业	84,800	312,912.00	0.07
404	300034	钢研高纳	18,680	310,648.40	0.07
405	300776	帝尔激光	5,823	309,841.83	0.07
406	002032	苏泊尔	5,900	309,101.00	0.06
407	000800	一汽解放	44,900	308,014.00	0.06
408	301029	怡合达	13,272	303,397.92	0.06
409	002266	浙富控股	98,430	303,164.40	0.06
410	000967	盈峰环境	42,900	298,155.00	0.06
411	002745	木林森	37,700	297,076.00	0.06

412	000156	华数传媒	37,400	296,956.00	0.06
413	300747	锐科激光	12,310	291,500.80	0.06
414	300888	稳健医疗	7,080	290,988.00	0.06
415	000543	皖能电力	41,400	289,800.00	0.06
416	002906	华阳集团	8,900	289,339.00	0.06
417	002265	建设工业	9,300	284,115.00	0.06
418	000628	高新发展	6,600	280,698.00	0.06
419	301155	海力风电	3,900	280,410.00	0.06
420	300298	三诺生物	12,400	280,116.00	0.06
421	002153	石基信息	32,182	278,696.12	0.06
422	002091	江苏国泰	38,200	277,714.00	0.06
423	000429	粤高速 A	20,700	275,931.00	0.06
424	000035	中国天楹	63,300	271,557.00	0.06
425	300633	开立医疗	9,100	270,452.00	0.06
426	002010	传化智联	48,400	270,072.00	0.06
427	002468	申通快递	25,200	269,388.00	0.06
428	301219	腾远钴业	5,000	265,600.00	0.06
429	002531	天顺风能	36,900	263,466.00	0.06
430	002237	恒邦股份	22,300	263,140.00	0.06
431	301165	锐捷网络	4,280	263,048.80	0.06
432	002557	洽洽食品	12,100	261,602.00	0.06
433	002372	伟星新材	25,220	261,279.20	0.05
434	000877	天山股份	56,200	260,768.00	0.05
435	001286	陕西能源	29,700	258,390.00	0.05
436	000582	北部湾港	31,300	258,225.00	0.05
437	000088	盐田港	56,800	257,304.00	0.05
438	000966	长源电力	57,000	256,500.00	0.05
439	000089	深圳机场	37,000	255,300.00	0.05
440	002541	鸿路钢构	15,200	254,448.00	0.05
441	000810	创维数字	21,000	247,380.00	0.05
442	000785	居然智家	80,800	246,440.00	0.05
443	002865	钧达股份	6,297	245,583.00	0.05
444	300482	万孚生物	11,330	241,895.50	0.05
445	000937	冀中能源	41,900	240,925.00	0.05
446	002096	易普力	19,000	235,790.00	0.05
447	300761	立华股份	12,500	234,875.00	0.05
448	003022	联泓新科	14,700	232,701.00	0.05
449	000537	中绿电	27,400	229,064.00	0.05
450	300357	我武生物	11,040	227,865.60	0.05
451	002408	齐翔腾达	50,820	227,673.60	0.05
452	002867	周大生	17,125	225,707.50	0.05
453	301095	广立微	4,000	224,960.00	0.05
454	002608	江苏国信	30,100	220,633.00	0.05

455	000552	甘肃能化	88,900	219,583.00	0.05
456	301091	深城交	7,390	216,083.60	0.05
457	002832	比音勒芬	13,300	213,465.00	0.04
458	002690	美亚光电	12,589	212,376.43	0.04
459	001914	招商积余	16,900	209,053.00	0.04
460	002518	科士达	9,200	207,828.00	0.04
461	301039	中集车辆	25,500	207,315.00	0.04
462	000927	中国铁物	79,900	205,343.00	0.04
463	300726	宏达电子	5,700	203,775.00	0.04
464	000898	鞍钢股份	87,769	203,624.08	0.04
465	301589	诺瓦星云	1,400	203,462.00	0.04
466	003035	南网能源	42,900	196,911.00	0.04
467	000935	四川双马	10,400	189,488.00	0.04
468	002925	盈趣科技	10,430	187,531.40	0.04
469	000959	首钢股份	55,100	187,340.00	0.04
470	001872	招商港口	9,300	184,698.00	0.04
471	001287	中电港	10,000	183,100.00	0.04
472	000401	冀东水泥	41,164	180,298.32	0.04
473	002737	葵花药业	10,800	169,776.00	0.04
474	301238	瑞泰新材	8,800	169,136.00	0.04
475	002461	珠江啤酒	14,900	168,221.00	0.04
476	002705	新宝股份	11,400	167,580.00	0.04
477	000028	国药一致	6,630	165,285.90	0.03
478	002320	海峡股份	25,225	164,971.50	0.03
479	002945	华林证券	11,300	162,381.00	0.03
480	002060	广东建工	46,500	161,820.00	0.03
481	001203	大中矿业	17,100	161,595.00	0.03
482	300140	节能环保	25,900	159,803.00	0.03
483	000688	国城矿业	11,900	158,389.00	0.03
484	002498	汉缆股份	46,400	156,832.00	0.03
485	300428	立中集团	8,600	156,692.00	0.03
486	002563	森马服饰	29,600	155,696.00	0.03
487	000539	粤电力 A	33,400	151,636.00	0.03
488	301611	珂玛科技	2,700	148,527.00	0.03
489	000791	甘肃能源	22,500	143,550.00	0.03
490	301267	华夏眼科	6,800	130,356.00	0.03
491	001213	中铁特货	31,700	128,702.00	0.03
492	000567	海德股份	19,870	117,630.40	0.02
493	301207	华兰疫苗	6,300	106,218.00	0.02
494	002901	大博医疗	2,900	105,096.00	0.02
495	301015	百洋医药	5,100	102,306.00	0.02
496	002978	安宁股份	3,100	97,898.00	0.02
497	001289	龙源电力	5,900	95,462.00	0.02

498	001308	康冠科技	3,960	89,575.20	0.02
499	301551	无线传媒	1,700	82,858.00	0.02
500	301606	绿联科技	1,500	77,145.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000627	*ST 天茂	74,200	203,308.00	0.04
2	400174	中天 3	100,100	14,014.00	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	300255	常山药业	1,459,737.00	0.26
2	300779	惠城环保	998,873.00	0.18
3	300750	宁德时代	971,678.00	0.17
4	002594	比亚迪	866,239.00	0.15
5	002335	科华数据	653,484.00	0.12
6	300059	东方财富	630,366.00	0.11
7	300570	太辰光	602,038.00	0.11
8	002139	拓邦股份	594,967.00	0.11
9	300100	双林股份	543,486.00	0.10
10	002222	福晶科技	533,611.00	0.09
11	300760	迈瑞医疗	510,495.00	0.09
12	300033	同花顺	506,247.00	0.09
13	301078	孩子王	453,896.00	0.08
14	000333	美的集团	433,988.00	0.08
15	002475	立讯精密	403,952.00	0.07
16	002371	北方华创	391,585.00	0.07
17	000858	五粮液	391,316.00	0.07
18	000657	中钨高新	371,700.00	0.07
19	002847	盐津铺子	365,996.00	0.07
20	000651	格力电器	363,760.00	0.06

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	760,458.00	0.14
2	002317	众生药业	468,508.00	0.08
3	002594	比亚迪	369,296.00	0.07
4	000690	宝新能源	344,110.00	0.06
5	300896	爱美客	300,103.00	0.05
6	000596	古井贡酒	294,356.00	0.05
7	000792	盐湖股份	294,082.00	0.05
8	301035	润丰股份	286,832.00	0.05
9	300769	德方纳米	274,886.36	0.05
10	002643	万润股份	268,435.00	0.05
11	002099	海翔药业	261,639.00	0.05
12	002727	一心堂	249,137.00	0.04
13	000012	南玻 A	244,989.14	0.04
14	000568	泸州老窖	232,422.00	0.04
15	300059	东方财富	217,163.00	0.04
16	300171	东富龙	213,332.00	0.04
17	300033	同花顺	212,812.00	0.04
18	002081	金螳螂	209,071.92	0.04
19	000930	中粮科技	206,575.00	0.04
20	300757	罗博特科	197,753.00	0.04

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	44,164,873.75
卖出股票收入（成交）总额	20,815,386.67

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）	18,701.23	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,701.23	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123257	安克转债	187	18,701.23	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

相关证券的投资决策程序做出说明

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

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	12,106.09
2	应收清算款	11,940.84
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	24,046.93

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	000627	*ST 天茂	203,308.00	0.04	未按交易所要求按时披露重要信息
2	400174	中天 3	14,014.00	0.00	暂停转让

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
11,881	31,660.17	27,762,543.00	7.38%	202,926,490.00	53.95%	145,465,474.00	38.67%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	上海优优财富投资管理有限公司－优财周期与成长一号私募证券投资基金	14,337,800.00	3.81%
2	卢光青	8,265,800.00	2.20%
3	章斌	2,526,375.00	0.67%
4	东方证券股份有限公司	2,448,203.00	0.65%
5	众安在线财产保险股份有限公司－自有资金	2,167,800.00	0.58%
6	浙商证券股份有限公司	2,005,180.00	0.53%
7	缪小燕	1,714,700.00	0.46%
8	陈绍华	1,678,500.00	0.45%
9	广发证券股份有限公司	1,615,170.00	0.43%
10	张翠红	1,526,600.00	0.41%
11	中国工商银行股份有限公司－南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	145,465,474.00	38.67%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009 年 12 月 4 日)基金份额总额	4,127,538,537.00
本报告期期初基金份额总额	451,154,507.00
本报告期基金总申购份额	144,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	219,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	376,154,507.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内无涉及基金财产的诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	1	44,484,898.42	68.46%	4,443.80	68.46%	-
国信证券	1	20,495,362.00	31.54%	2,047.19	31.54%	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	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：无；减少交易单元：方正证券、中信证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		券回购成 交总额的 比例		证成交总 额的比例
申万宏源	281,025.54	100.00%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于直销平台相关业务费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-01
2	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加华金证券为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-08
3	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加瑞银证券为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-02-20
4	关于南方基金管理股份有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-19
5	南方基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31
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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-04-01

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20250101-20250630	167,919,674.00	-	22,454,200.00	145,465,474.00	38.67%
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深证成份交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《深证成份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、《深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2025 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>