

深证成份交易型开放式指数证券投资 基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	52
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.....	52
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.....	52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	52

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	55
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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 南方
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	304,154,507.00 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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、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(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	110,777,793.27
本期利润	104,520,788.94
加权平均基金份额本期利润	0.3601
本期加权平均净值利润率	20.26%
本期基金份额净值增长率	20.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	188,342,419.07
期末可供分配基金份额利润	0.6192
期末基金资产净值	600,552,886.55

期末基金份额净值	1.9745
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	45.69%

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。

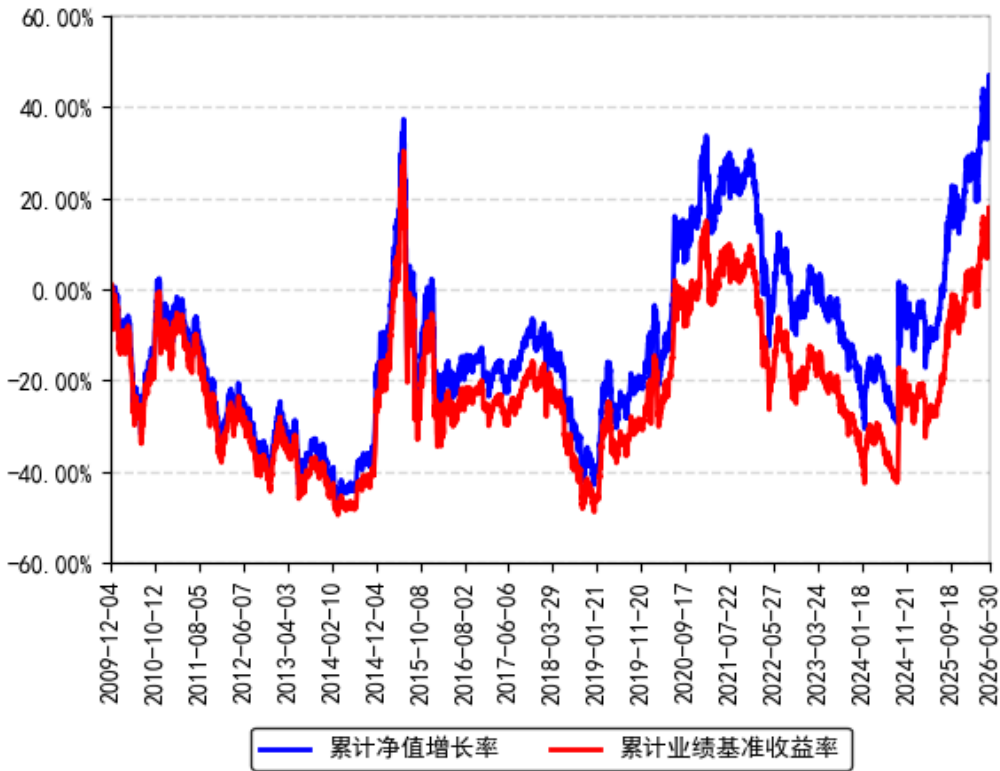
3.2 基金净值表现

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	20.97%	1.71%	20.24%	1.72%	0.73%	-0.01%
过去六个月	20.40%	1.54%	19.82%	1.54%	0.58%	0.00%
过去一年	56.17%	1.40%	54.85%	1.40%	1.32%	0.00%
过去三年	51.84%	1.49%	46.97%	1.50%	4.87%	-0.01%
过去五年	13.37%	1.40%	6.88%	1.40%	6.49%	0.00%
过去七年	95.71%	1.42%	76.56%	1.42%	19.15%	0.00%
过去十年	76.67%	1.39%	54.49%	1.39%	22.18%	0.00%
自基金合同 生效起至今	45.69%	1.54%	16.71%	1.55%	28.98%	-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	-	16 年	中国国籍，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》及其他有关法律法规的规定及本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，深证成指累计上涨 19.82%，呈现“科技成长引领、结构分化明显”的运行特征。宏观层面，国内经济总量增速温和回升，社融、工业企业利润等中观数据边际改善，稳增长政策工具箱持续发力；产业层面，人工智能、机器人、半导体、创新药、新能源等新兴产业成为深市上市公司业绩增长的主要来源，先进制造与消费电子出口在全球库存周期回补的带动下呈现回暖迹象。整体看，深证成指以科技、消费和先进制造为主体的成分股结构，与国家高质量发展和新质生产力的政策导向高度契合。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

- (1) 新股上市初期涨幅较大的影响；
- (2) 大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- (3) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离；
- (4) 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。

4.4.2 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 1.9745 元，报告期内，份额净值增长率为 20.40%，同期业绩基准增长率为 19.82%。

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，深证成指的运行逻辑仍将围绕“新质生产力+产业升级”的核心叙事展开。产业层面，人形机器人从 Demo 阶段迈向量产爬坡，头部主机厂开始批量下达零部件订单，深市减速器、丝杠、传感器、伺服电机等产业链公司订单能见度显著改善；消费电子在全球 AI 手机、AI PC、可穿戴设备渗透率提升的带动下迎来新一轮换机周期，深市面板、光学、结构件、SoC 等公司业绩弹性明显；AI 端侧应用与算力芯片在自主可控框架下呈现“国产替代+需求扩容”双轮驱动。政策层面，深交所 2026 年落地的并购重组新规、专精特新“小巨人”扩容、创业板注册制配套完善以及地方专项债与超长期特别国债对基础设施与科技的定向支持，均对深市成份股形成实质性利好；汇率保持基本稳定，为深市出口链公司的美元收入与利润提供稳定的换算基础。下半年重点关注三季报窗口的业绩兑现节奏、海外流动性变化以及部分成长板块估值消化过程中的波动。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术，建立了估值委员会，组成人员包括财务负责人、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、指数研究部总经理、现金及债券指数投资部总经理、国际投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据

法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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 2026 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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	7,775,861.84	235,438.69
结算备付金		84,369.26	144,410.77
存出保证金		36,014.46	16,157.09
交易性金融资产	6.4.7.2	595,940,789.87	498,702,418.19
其中：股票投资		595,870,988.34	498,702,418.19
基金投资		-	-
债券投资		69,801.53	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		15,905.82	14,052.30
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		603,852,941.25	499,112,477.04
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,149,430.45	966.15
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		233,567.64	215,310.09
应付托管费		46,713.54	43,062.02

应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.05	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,870,343.02	54,494.36
负债合计		3,300,054.70	313,832.62
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	412,210,467.48	412,210,467.49
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	188,342,419.07	86,588,176.93
净资产合计		600,552,886.55	498,798,644.42
负债和净资产总计		603,852,941.25	499,112,477.04

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.9745 元，基金份额总额 304,154,507.00 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		106,134,460.70	16,447,041.47
1.利息收入		4,181.86	1,676.51
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,181.86	1,676.51
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）		112,240,634.08	22,210,660.43
其中：股票投资收益	6.4.7.10	108,572,329.54	16,428,858.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	3,954.74	36,914.83
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-

股利收益	6.4.7.14	3,664,349.80	5,744,887.51
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-6,257,004.33	-5,708,413.22
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	146,649.09	-56,882.25
减：二、营业总支出		1,613,671.76	1,672,219.40
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,275,124.22	1,293,691.71
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	255,024.86	258,738.39
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		-	0.07
8.其他费用	6.4.7.18	83,522.68	119,789.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		104,520,788.94	14,774,822.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		104,520,788.94	14,774,822.07
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		104,520,788.94	14,774,822.07

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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	412,210,467.49	-	86,588,176.93	498,798,644.42
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	412,210,467.49	-	86,588,176.93	498,798,644.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-0.01	-	101,754,242.14	101,754,242.13
（一）、综合收益总额	-	-	104,520,788.94	104,520,788.94
（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）	-0.01	-	-2,766,546.80	-2,766,546.81
其中：1.基金申购款	528,554,003.43	-	169,786,461.66	698,340,465.09
2.基金赎回款	-528,554,003.44	-	-172,553,008.46	-701,107,011.90
（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	412,210,467.48	-	188,342,419.07	600,552,886.55
项目	上年度可比期间 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）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-101,645,000.74	-	-537,354.62	-102,182,355.36
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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

深证成份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[2009]1066号《关于核准深证成份交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准，由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司，已于2018年1月4日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《深证成份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 4,127,252,482.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 263 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 12 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,127,538,537.00 份基金份额，其中通过代销机构网上现金及直销机构网下现金认购部分的认购资金利息折合 286,055.00 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。

根据《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司确定 2010 年 1 月 13 日为本基金的基金份额折算日。当日深证成份指数收盘值为 13,016.557 点，本基金的基金资产净值为 3,964,290,323.04 元，折算前基金份额总额为 4,127,538,537.00 份，折算前基金份额净值为 0.960 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.73786718，折算后基金份额总额为 3,045,554,507.00 份，折算后基金份额净值为 1.302 元。本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司已根据上述折算比例，对所有基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2010 年 1 月 15 日完成了变更登记。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2010]38 号审核同意，本基金于 2010 年 2 月 2 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《深证成份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紧密跟踪标的指数深证成份指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；主要投资范围为标的指数的成份股和备选成份股以及存托凭证，该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%；本基金可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为深证成份指数。

本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司以本基金为目标 ETF，于 2009 年 12 月 9 日募集成立了南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“南方深证成份 ETF 联接”)。南方深证成份 ETF 联接为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

(3)对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司代扣代缴个人所得税;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。其中,对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股,解禁后取得的股息红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)对于基金从事 A 股买卖,出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,受让方不再缴纳印花税;自 2023 年 8 月 28 日起,出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	7,775,861.84
等于: 本金	7,775,573.50
加: 应计利息	288.34
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	7,775,861.84
----	--------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		517,111,200.02	-	595,870,988.34	78,759,788.32
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	69,800.00	1.53	69,801.53	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	69,800.00	1.53	69,801.53	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		517,181,000.02	1.53	595,940,789.87	78,759,788.32

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	10,778.18
其中：交易所市场	10,778.18

银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	531,417.76
预提费用	83,310.68
应付指数使用费	-
可退替代款	1,244,836.40
合计	1,870,343.02

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	304,154,507.00	412,210,467.49
本期申购	390,000,000.00	528,554,003.43
本期赎回（以“-”号填列）	-390,000,000.00	-528,554,003.44
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	304,154,507.00	412,210,467.48

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

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	303,626,196.66	-217,038,019.73	86,588,176.93
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	303,626,196.66	-217,038,019.73	86,588,176.93
本期利润	110,777,793.27	-6,257,004.33	104,520,788.94
本期基金份额交易产生的变动数	5,926,928.47	-8,693,475.27	-2,766,546.80
其中：基金申购款	468,613,189.13	-298,826,727.47	169,786,461.66
基金赎回款	-462,686,260.66	290,133,252.20	-172,553,008.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	420,330,918.40	-231,988,499.33	188,342,419.07

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

活期存款利息收入	3,935.46
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	191.05
其他	55.35
合计	4,181.86

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,940,811.59
股票投资收益——赎回差价收入	104,631,517.95
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	108,572,329.54

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	39,324,701.98
减：卖出股票成本总额	35,339,184.35
减：交易费用	44,706.04
买卖股票差价收入	3,940,811.59

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	701,107,011.90
减：现金支付赎回款总额	-332,303.10
减：赎回股票成本总额	596,807,797.05
减：交易费用	-
赎回差价收入	104,631,517.95

6.4.7.10.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

债券投资收益——利息收入	1.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,952.84
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	3,954.74

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,853.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,900.00
减：应计利息总额	0.42
减：交易费用	0.44
买卖债券差价收入	3,952.84

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,664,349.80
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	3,664,349.80

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
------	------------------------------------

1.交易性金融资产	-6,257,004.33
——股票投资	-6,257,004.33
——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	-6,257,004.33

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	146,649.09
合计	146,649.09

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。

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	23,803.31
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	212.00
合计	83,522.68

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人
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
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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管	1,275,124.22	1,293,691.71

理费		
其中：应支付销售机构的客 户维护费	66,254.99	51,538.63
应支付基金管理人的 净管理费	1,208,869.23	1,242,153.08

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托 管费	255,024.86	258,738.39

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

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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	888,453.00	0.29%	780,017.00	0.26%
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	107,064,974.00	35.20%	121,164,674.00	39.84%

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。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	7,775,861.84	3,935.46	669,326.52	1,547.76

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	-	-	-	-	-

上年度可比期间 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

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

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

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301377	鼎泰高科	2026年6月8日	6个月	询价转让	270.55	488.17	1,000	270,550.00	488,170.00	-
001399	惠科股份	2026年6月16日	6个月	新股锁定期	10.12	27.73	3,004	30,400.48	83,300.92	-
001365	天海电子	2026年5月11日	6个月	新股锁定期	27.19	31.31	510	13,866.90	15,968.10	-
301669	高特电子	2026年6月2日	6个月	新股锁定期	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301531	春光集团	2026年4月28日	6个月	新股锁定期	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
001237	惠康科技	2026年5月15日	6个月	新股锁定期	53.26	58.74	212	11,291.12	12,452.88	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	新股锁定期	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
001248	华润新能源	2026年6月25日	1个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	500	5,055.00	5,055.00	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
127114	宜化转债	2026年6月26日	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	698	69,800.00	69,801.53	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票	停牌日期	停牌	期末	复牌	复牌开	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	----	------	----	----	----	-----	-------	--------	--------	----

码	名称		原因	估值 单价	日期	盘单价				
400174	中天 3	2023 年 8 月 30 日	暂停 转让	0.14	-	-	100,100	332,602.15	14,014.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，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，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金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。

6.4.13.3.1 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期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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,775,861.84	-	-	-	7,775,861.84
结算备付金	84,369.26	-	-	-	84,369.26
存出保证金	36,014.46	-	-	-	36,014.46
交易性金融 资产	-	-	69,801.53	595,870,988. 34	595,940,789. 87
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	-	-	-	15,905.82	15,905.82
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税 资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,896,245.56	-	69,801.53	595,886,894. 16	603,852,941. 25
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融 负债	-	-	-	-	-
衍生金融负 债	-	-	-	-	-
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	1,149,430.45	1,149,430.45
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	233,567.64	233,567.64
应付托管费	-	-	-	46,713.54	46,713.54
应付销售服 务费	-	-	-	-	-
应付投资顾 问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.05	0.05
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税 负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,870,343.02	1,870,343.02
负债总计	-	-	-	3,300,054.70	3,300,054.70
利率敏感度 缺口	7,896,245.56	-	69,801.53	592,586,839. 46	600,552,886. 55
上年度末 2025 年 12	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

月 31 日					
资产					
货币资金	235,438.69	-	-	-	235,438.69
结算备付金	144,410.77	-	-	-	144,410.77
存出保证金	16,157.09	-	-	-	16,157.09
交易性金融资产	-	-	-	498,702,418.19	498,702,418.19
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	-	-	-	14,052.30	14,052.30
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	396,006.55	-	-	498,716,470.49	499,112,477.04
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	-	-	-	966.15	966.15
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	215,310.09	215,310.09
应付托管费	-	-	-	43,062.02	43,062.02
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	-	-	-	54,494.36	54,494.36
负债总计	-	-	-	313,832.62	313,832.62
利率敏感度缺口	396,006.55	-	-	498,402,637.87	498,798,644.42

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金采用完全复制法，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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	595,870,988.34	99.22	498,702,418.19	99.98

交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	69,801.53	0.01	-	-
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	595,940,789.87	99.23	498,702,418.19	99.98

注：交易性金融资产-债券投资项目仅包含可转换公司债券或可交换公司债券。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026年6月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	1.组合自身基准上升 5%	29,870,106.99	24,818,534.23
	2.组合自身基准下降 5%	-29,870,106.99	-24,818,534.23

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	595,209,878.72
第二层次	74,856.53
第三层次	656,054.62
合计	595,940,789.87

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、

交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	595,870,988.34	98.68
	其中：股票	595,870,988.34	98.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	69,801.53	0.01
	其中：债券	69,801.53	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	7,860,231.10	1.30
8	其他各项资产	51,920.28	0.01
9	合计	603,852,941.25	100.00

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

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,894,989.05	0.98
B	采矿业	6,120,622.64	1.02
C	制造业	496,497,622.17	82.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,043,893.00	0.84
E	建筑业	846,752.00	0.14
F	批发和零售业	6,065,424.64	1.01
G	交通运输、仓储和邮政业	5,033,536.29	0.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,174,153.62	4.36
J	金融业	29,462,273.14	4.91
K	房地产业	1,950,615.13	0.32
L	租赁和商务服务业	4,780,114.61	0.80
M	科学研究和技术服务业	3,094,951.00	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	645,168.26	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	307,980.00	0.05
Q	卫生和社会工作	1,721,563.56	0.29
R	文化、体育和娱乐业	2,016,506.11	0.34
S	综合	-	-
	合计	595,656,165.22	99.18

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	153,870.62	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,055.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	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	172,939.62	0.03

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	27,332	34,711,640.00	5.78
2	300750	宁德时代	81,060	31,857,390.60	5.30
3	300502	新易盛	38,974	23,657,218.00	3.94
4	000333	美的集团	151,491	11,442,115.23	1.91
5	002371	北方华创	12,455	11,017,194.80	1.83
6	002384	东山精密	39,500	10,362,825.00	1.73
7	002475	立讯精密	145,508	10,243,763.20	1.71
8	000725	京东方 A	1,010,542	8,771,504.56	1.46
9	300059	东方财富	398,056	8,112,381.28	1.35
10	300274	阳光电源	46,488	7,392,521.76	1.23
11	300476	胜宏科技	19,000	6,582,170.00	1.10
12	300408	三环集团	39,250	6,550,825.00	1.09
13	002463	沪电股份	42,420	6,481,776.00	1.08
14	002594	比亚迪	78,058	6,221,222.60	1.04
15	300394	天孚通信	19,546	5,916,183.28	0.99
16	301308	江波龙	7,300	5,137,740.00	0.86
17	000651	格力电器	132,540	4,970,250.00	0.83
18	000988	华工科技	26,500	4,892,165.00	0.81
19	300604	长川科技	13,900	4,745,738.00	0.79
20	000338	潍柴动力	157,908	4,302,993.00	0.72
21	000858	五粮液	56,541	4,184,034.00	0.70
22	001309	德明利	4,400	4,148,760.00	0.69
23	300124	汇川技术	61,791	4,098,597.03	0.68
24	002281	光迅科技	15,500	3,982,570.00	0.66
25	002415	海康威视	115,081	3,935,770.20	0.66
26	002008	大族激光	24,700	3,707,717.00	0.62
27	000063	中兴通讯	98,358	3,559,576.02	0.59

28	002916	深南电路	7,699	3,525,372.10	0.59
29	000100	TCL 科技	593,478	3,454,041.96	0.58
30	300857	协创数据	9,980	3,392,202.00	0.56
31	300433	蓝思科技	60,658	3,254,908.28	0.54
32	300475	香农芯创	10,500	3,150,000.00	0.52
33	002142	宁波银行	105,631	3,136,184.39	0.52
34	002028	思源电气	17,900	3,096,700.00	0.52
35	000792	盐湖股份	102,300	3,088,437.00	0.51
36	300136	信维通信	24,860	2,964,555.00	0.49
37	002050	三花智控	66,466	2,913,204.78	0.49
38	300014	亿纬锂能	44,147	2,870,879.41	0.48
39	002353	杰瑞股份	18,687	2,849,767.50	0.47
40	002156	通富微电	36,880	2,798,085.60	0.47
41	300223	北京君正	11,100	2,762,790.00	0.46
42	000657	中钨高新	28,712	2,748,312.64	0.46
43	300285	国瓷材料	26,250	2,708,475.00	0.45
44	002714	牧原股份	76,683	2,683,138.17	0.45
45	000001	平安银行	261,212	2,625,180.60	0.44
46	300760	迈瑞医疗	18,900	2,567,187.00	0.43
47	002602	世纪华通	177,600	2,504,160.00	0.42
48	002230	科大讯飞	59,870	2,445,090.80	0.41
49	300666	江丰电子	6,600	2,432,760.00	0.41
50	002436	兴森科技	47,100	2,399,745.00	0.40
51	002352	顺丰控股	73,783	2,306,456.58	0.38
52	300054	鼎龙股份	21,600	2,288,952.00	0.38
53	002460	赣锋锂业	34,760	2,273,304.00	0.38
54	000977	浪潮信息	31,886	2,232,020.00	0.37
55	002709	天赐材料	43,056	2,214,370.08	0.37
56	000776	广发证券	94,259	2,205,660.60	0.37
57	300033	同花顺	9,031	2,176,471.00	0.36
58	000021	深科技	33,031	2,122,902.37	0.35
59	300498	温氏股份	171,909	2,117,918.88	0.35
60	000425	徐工机械	260,908	2,110,745.72	0.35
61	002851	麦格米特	12,600	2,106,468.00	0.35
62	002938	鹏鼎控股	19,900	2,097,062.00	0.35
63	002428	云南锗业	17,100	2,055,078.00	0.34
64	300548	长芯博创	7,200	2,001,600.00	0.33
65	300567	精测电子	6,150	1,953,240.00	0.33
66	002409	雅克科技	8,700	1,953,150.00	0.33
67	002466	天齐锂业	31,700	1,943,844.00	0.32
68	002080	中材科技	21,497	1,934,730.00	0.32
69	002202	金风科技	80,413	1,921,870.70	0.32
70	300757	罗博特科	3,100	1,918,900.00	0.32

71	000938	紫光股份	66,058	1,906,433.88	0.32
72	000636	风华高科	26,200	1,892,688.00	0.32
73	300661	圣邦股份	12,807	1,837,548.36	0.31
74	002837	英维克	23,024	1,831,789.44	0.31
75	002185	华天科技	81,922	1,827,679.82	0.30
76	002049	紫光国微	20,278	1,799,672.50	0.30
77	300442	润泽科技	21,540	1,789,327.80	0.30
78	000568	泸州老窖	22,992	1,782,339.84	0.30
79	300395	菲利华	13,200	1,765,236.00	0.29
80	002484	江海股份	16,800	1,764,000.00	0.29
81	002241	歌尔股份	78,010	1,757,565.30	0.29
82	002600	领益智造	99,091	1,718,237.94	0.29
83	300346	南大光电	18,248	1,690,677.20	0.28
84	300390	天华新能	17,900	1,673,829.00	0.28
85	002179	中航光电	35,486	1,639,453.20	0.27
86	301526	国际复材	34,500	1,610,115.00	0.27
87	002407	多氟多	31,960	1,605,350.80	0.27
88	002138	顺络电子	21,900	1,600,890.00	0.27
89	000408	藏格矿业	22,200	1,538,904.00	0.26
90	300058	蓝色光标	111,447	1,533,510.72	0.26
91	002027	分众传媒	311,596	1,508,124.64	0.25
92	002625	光启技术	49,690	1,506,600.80	0.25
93	000630	铜陵有色	233,800	1,486,968.00	0.25
94	300620	光库科技	3,900	1,474,980.00	0.25
95	000807	云铝股份	64,700	1,432,458.00	0.24
96	300373	扬杰科技	9,060	1,424,503.80	0.24
97	300037	新宙邦	15,160	1,407,606.00	0.23
98	002273	水晶光电	39,254	1,392,731.92	0.23
99	300450	先导智能	34,099	1,388,511.28	0.23
100	002422	科伦药业	35,278	1,358,908.56	0.23
101	002001	新和成	47,728	1,356,429.76	0.23
102	301511	德福科技	9,400	1,352,190.00	0.23
103	000426	兴业银锡	41,000	1,351,360.00	0.23
104	300751	迈为股份	4,618	1,304,400.28	0.22
105	300570	太辰光	5,200	1,282,892.00	0.21
106	002648	卫星化学	53,601	1,259,087.49	0.21
107	000960	锡业股份	29,472	1,258,159.68	0.21
108	002812	恩捷股份	18,380	1,229,805.80	0.20
109	301217	铜冠铜箔	7,400	1,221,518.00	0.20
110	300672	国科微	4,100	1,209,500.00	0.20
111	000066	中国长城	62,338	1,187,538.90	0.20
112	002126	银轮股份	23,800	1,185,240.00	0.20
113	300782	卓胜微	10,786	1,181,929.88	0.20

114	000831	中国稀土	21,100	1,170,839.00	0.19
115	002738	中矿资源	19,680	1,160,923.20	0.19
116	300015	爱尔眼科	139,488	1,152,170.88	0.19
117	300316	晶盛机电	18,910	1,142,164.00	0.19
118	000166	申万宏源	258,469	1,137,263.60	0.19
119	002222	福晶科技	12,200	1,125,816.00	0.19
120	300418	昆仑万维	27,700	1,117,972.00	0.19
121	001389	广合科技	4,700	1,115,075.00	0.19
122	002129	TCL 中环	91,500	1,099,830.00	0.18
123	301377	鼎泰高科	2,100	1,094,160.00	0.18
124	000538	云南白药	22,920	1,085,720.40	0.18
125	002850	科达利	5,700	1,079,010.00	0.18
126	300803	指南针	11,704	1,072,905.68	0.18
127	000625	长安汽车	147,879	1,060,292.43	0.18
128	002195	岩山科技	161,983	1,059,368.82	0.18
129	000157	中联重科	150,727	1,050,567.19	0.17
130	002311	海大集团	23,340	1,041,197.40	0.17
131	000933	神火股份	49,000	1,038,800.00	0.17
132	301358	湖南裕能	13,660	1,036,384.20	0.17
133	002821	凯莱英	6,380	1,033,560.00	0.17
134	002558	巨人网络	36,700	1,011,452.00	0.17
135	002532	天山铝业	93,700	1,005,401.00	0.17
136	002203	海亮股份	43,300	989,405.00	0.16
137	002340	格林美	148,700	982,907.00	0.16
138	002240	盛新锂能	21,600	968,328.00	0.16
139	002236	大华股份	58,509	964,813.41	0.16
140	300776	帝尔激光	4,323	929,272.08	0.15
141	002074	国轩高科	33,439	919,906.89	0.15
142	300438	鹏辉能源	11,100	919,635.00	0.15
143	002261	拓维信息	32,800	918,728.00	0.15
144	000783	长江证券	94,219	918,635.25	0.15
145	002456	欧菲光	97,002	917,638.92	0.15
146	300236	上海新阳	6,900	907,350.00	0.15
147	300339	润和软件	23,400	901,134.00	0.15
148	000975	山金国际	52,304	889,168.00	0.15
149	300759	康龙化成	30,700	888,151.00	0.15
150	002517	恺英网络	54,600	887,250.00	0.15
151	300017	网宿科技	68,145	886,566.45	0.15
152	003031	中瓷电子	4,900	883,470.00	0.15
153	300458	全志科技	22,232	877,274.72	0.15
154	002493	荣盛石化	80,725	867,793.75	0.14
155	002736	国信证券	86,600	865,134.00	0.14
156	002131	利欧股份	180,143	855,679.25	0.14

157	300001	特锐德	22,500	851,175.00	0.14
158	002472	双环传动	20,500	850,955.00	0.14
159	002595	豪迈科技	18,175	846,955.00	0.14
160	003816	中国广核	215,200	841,432.00	0.14
161	002555	三七互娱	44,500	839,715.00	0.14
162	002245	蔚蓝锂芯	44,632	835,064.72	0.14
163	301236	软通动力	19,428	824,718.60	0.14
164	002966	苏州银行	118,280	823,228.80	0.14
165	000768	中航西飞	40,190	823,091.20	0.14
166	300115	长盈精密	29,288	818,306.72	0.14
167	002056	横店东磁	26,500	807,720.00	0.13
168	002601	龙佰集团	49,000	807,520.00	0.13
169	300207	欣旺达	41,900	795,681.00	0.13
170	301611	珂玛科技	4,400	792,308.00	0.13
171	301269	华大九天	6,600	788,172.00	0.13
172	300347	泰格医药	16,400	787,200.00	0.13
173	002797	第一创业	119,740	786,691.80	0.13
174	000547	航天发展	40,912	783,464.80	0.13
175	002155	湖南黄金	32,650	779,355.50	0.13
176	300088	长信科技	67,004	777,246.40	0.13
177	000301	东方盛虹	67,600	774,020.00	0.13
178	300456	赛微电子	18,000	764,460.00	0.13
179	300870	欧陆通	2,200	760,518.00	0.13
180	300454	深信服	7,900	759,980.00	0.13
181	000060	中金岭南	99,441	752,768.37	0.13
182	002920	德赛西威	9,200	749,800.00	0.12
183	301536	星宸科技	5,800	746,518.00	0.12
184	002465	海格通信	58,000	740,660.00	0.12
185	000895	双汇发展	32,824	735,257.60	0.12
186	000703	恒逸石化	54,078	733,838.46	0.12
187	300866	安克创新	7,010	732,545.00	0.12
188	300024	机器人	37,590	726,614.70	0.12
189	301200	大族数控	2,000	721,300.00	0.12
190	000893	亚钾国际	17,600	719,664.00	0.12
191	000034	神州数码	25,846	717,226.50	0.12
192	002304	洋河股份	18,639	711,077.85	0.12
193	300623	捷捷微电	15,754	708,772.46	0.12
194	002128	电投能源	30,600	707,472.00	0.12
195	002487	大金重工	12,200	707,234.00	0.12
196	002432	九安医疗	10,000	706,800.00	0.12
197	300568	星源材质	37,676	705,294.72	0.12
198	002429	兆驰股份	66,900	695,091.00	0.12
199	000733	振华科技	12,200	691,008.00	0.12

200	002414	高德红外	51,720	685,807.20	0.11
201	002335	科华数据	16,135	684,930.75	0.11
202	002271	东方雨虹	57,563	683,272.81	0.11
203	300811	铂科新材	7,200	683,208.00	0.11
204	300496	中科创达	10,954	676,847.66	0.11
205	000878	云南铜业	42,396	673,248.48	0.11
206	002402	和而泰	26,000	671,580.00	0.11
207	001979	招商蛇口	104,227	670,179.61	0.11
208	002444	巨星科技	21,500	668,650.00	0.11
209	002025	航天电器	8,723	664,867.06	0.11
210	001267	汇绿生态	12,300	658,050.00	0.11
211	000963	华东医药	23,395	657,867.40	0.11
212	300748	金力永磁	21,163	652,878.55	0.11
213	300432	富临精工	32,440	651,719.60	0.11
214	300142	沃森生物	50,000	649,500.00	0.11
215	002497	雅化集团	31,800	647,766.00	0.11
216	002157	正邦科技	229,300	644,333.00	0.11
217	002252	上海莱士	147,240	639,021.60	0.11
218	300474	景嘉微	10,550	638,064.00	0.11
219	301205	联特科技	1,900	634,790.00	0.11
220	300763	锦浪科技	6,965	629,287.75	0.10
221	000661	长春高新	9,300	619,380.00	0.10
222	002756	永兴材料	10,910	617,942.40	0.10
223	301626	苏州天脉	1,600	614,336.00	0.10
224	000002	万科 A	207,458	614,075.68	0.10
225	000728	国元证券	81,905	613,468.45	0.10
226	000423	东阿阿胶	13,505	612,586.80	0.10
227	002747	埃斯顿	16,400	612,212.00	0.10
228	002078	太阳纸业	48,900	610,761.00	0.10
229	300724	捷佳伟创	8,600	607,160.00	0.10
230	002130	沃尔核材	31,800	602,928.00	0.10
231	300012	华测检测	43,500	602,910.00	0.10
232	300073	当升科技	12,300	590,892.00	0.10
233	002831	裕同科技	16,173	575,111.88	0.10
234	002653	海思科	8,600	570,524.00	0.09
235	002617	露笑科技	54,706	562,924.74	0.09
236	300919	中伟新材	12,860	562,625.00	0.09
237	000519	中兵红箭	26,600	560,462.00	0.09
238	300383	光环新网	44,500	553,580.00	0.09
239	000786	北新建材	30,300	548,127.00	0.09
240	300953	震裕科技	4,080	545,496.00	0.09
241	002378	章源钨业	16,200	542,376.00	0.09
242	300747	锐科激光	10,110	536,739.90	0.09

243	000617	中油资本	80,800	532,472.00	0.09
244	002624	完美世界	42,550	528,471.00	0.09
245	300558	贝达药业	8,100	527,067.00	0.09
246	001965	招商公路	57,513	526,819.08	0.09
247	000969	安泰科技	21,400	525,156.00	0.09
248	002716	湖南白银	64,200	519,378.00	0.09
249	300677	英科医疗	13,020	509,993.40	0.08
250	300679	电连技术	8,500	509,915.00	0.08
251	302132	中航成飞	8,700	507,384.00	0.08
252	002064	华峰化学	52,600	499,174.00	0.08
253	000559	万向钱潮	38,540	498,322.20	0.08
254	002673	西部证券	75,954	492,941.46	0.08
255	000623	吉林敖东	27,718	491,440.14	0.08
256	300628	亿联网络	14,500	490,390.00	0.08
257	300102	乾照光电	18,800	489,552.00	0.08
258	002044	美年健康	96,956	487,688.68	0.08
259	002180	奔图科技	29,800	487,528.00	0.08
260	300972	万辰集团	2,800	485,548.00	0.08
261	001203	大中矿业	16,200	485,190.00	0.08
262	300251	光线传媒	43,520	482,636.80	0.08
263	300699	光威复材	16,792	481,090.80	0.08
264	002065	东华软件	67,000	478,380.00	0.08
265	300255	常山药业	20,400	477,768.00	0.08
266	000750	国海证券	129,825	477,756.00	0.08
267	002223	鱼跃医疗	18,600	477,276.00	0.08
268	300487	蓝晓科技	8,100	476,685.00	0.08
269	000958	电投产融	84,200	474,888.00	0.08
270	000032	深桑达 A	19,000	474,050.00	0.08
271	000766	通化金马	24,300	471,420.00	0.08
272	300832	新产业	11,100	466,200.00	0.08
273	001696	宗申动力	22,400	466,144.00	0.08
274	002294	信立泰	14,600	465,594.00	0.08
275	000683	博源化工	80,700	464,832.00	0.08
276	000039	中集集团	56,990	462,188.90	0.08
277	301171	易点天下	13,600	461,856.00	0.08
278	002739	儒意电影	48,100	461,760.00	0.08
279	000415	渤海租赁	112,900	459,503.00	0.08
280	002176	江特电机	45,500	455,455.00	0.08
281	300002	神州泰岳	58,300	455,323.00	0.08
282	002085	万丰奥威	41,028	455,000.52	0.08
283	002318	久立特材	19,000	454,100.00	0.08
284	002459	晶澳科技	55,776	451,785.60	0.08
285	000887	中鼎股份	25,200	450,828.00	0.08

286	002506	协鑫集成	141,756	450,784.08	0.08
287	000983	山西焦煤	77,720	450,776.00	0.08
288	300627	华测导航	15,800	448,720.00	0.07
289	000688	国城矿业	13,100	448,413.00	0.07
290	002015	协鑫能科	27,400	447,168.00	0.07
291	000970	中科三环	29,370	446,130.30	0.07
292	002405	四维图新	68,896	445,757.12	0.07
293	000999	华润三九	19,783	444,919.67	0.07
294	000629	钒钛股份	132,400	442,216.00	0.07
295	300364	中文在线	18,700	441,133.00	0.07
296	000155	川能动力	36,400	436,072.00	0.07
297	000050	深天马 A	44,000	436,040.00	0.07
298	300003	乐普医疗	36,700	434,895.00	0.07
299	000400	许继电气	20,001	434,021.70	0.07
300	000967	盈峰环境	40,500	426,465.00	0.07
301	002266	浙富控股	83,730	423,673.80	0.07
302	002151	北斗星通	13,000	412,750.00	0.07
303	000876	新希望	64,852	406,622.04	0.07
304	300999	金龙鱼	17,458	406,073.08	0.07
305	300122	智飞生物	34,650	405,058.50	0.07
306	002683	广东宏大	13,800	404,202.00	0.07
307	301550	斯菱智驱	4,400	402,292.00	0.07
308	002518	科士达	7,500	401,925.00	0.07
309	002841	视源股份	11,500	397,095.00	0.07
310	000737	北方铜业	29,900	395,278.00	0.07
311	002430	杭氧股份	12,600	390,096.00	0.06
312	301095	广立微	3,300	389,565.00	0.06
313	002249	大洋电机	51,934	389,505.00	0.06
314	000875	电投绿能	75,600	389,340.00	0.06
315	300296	利亚德	68,350	382,760.00	0.06
316	000738	航发控制	20,850	381,346.50	0.06
317	002145	钛能化学	80,435	378,848.85	0.06
318	002007	华兰生物	30,930	377,036.70	0.06
319	002237	恒邦股份	25,600	376,064.00	0.06
320	000591	太阳能	81,500	374,900.00	0.06
321	000729	燕京啤酒	36,900	373,797.00	0.06
322	000830	鲁西化工	31,100	373,200.00	0.06
323	002152	广电运通	39,700	372,386.00	0.06
324	002926	华西证券	45,400	370,918.00	0.06
325	000997	新大陆	22,480	366,424.00	0.06
326	300253	卫宁健康	54,423	366,266.79	0.06
327	300773	拉卡拉	23,820	364,446.00	0.06
328	000528	柳工	48,260	364,363.00	0.06

329	000686	东北证券	42,900	360,360.00	0.06
330	001280	中国铀业	5,400	360,180.00	0.06
331	002603	以岭药业	23,920	358,800.00	0.06
332	002958	青农商行	130,900	358,666.00	0.06
333	002389	航天彩虹	20,100	357,177.00	0.06
334	000951	中国重汽	18,140	353,911.40	0.06
335	000932	华菱钢铁	100,640	349,220.80	0.06
336	300459	汤姆猫	102,669	348,047.91	0.06
337	300896	爱美客	3,980	347,056.00	0.06
338	300182	捷成股份	72,259	343,230.25	0.06
339	002410	广联达	42,047	343,103.52	0.06
340	301297	富乐德	5,600	342,944.00	0.06
341	002939	长城证券	40,900	341,106.00	0.06
342	001287	中电港	10,900	339,535.00	0.06
343	000596	古井贡酒	4,239	338,272.20	0.06
344	300573	兴齐眼药	8,139	331,745.64	0.06
345	000987	越秀资本	42,386	331,458.52	0.06
346	000708	中信特钢	26,230	331,022.60	0.06
347	300726	宏达电子	3,900	329,823.00	0.05
348	301165	锐捷网络	4,092	329,201.40	0.05
349	000422	湖北宜化	23,400	328,770.00	0.05
350	000973	佛塑科技	22,800	327,180.00	0.05
351	002048	宁波华翔	14,200	326,600.00	0.05
352	000062	深圳华强	10,257	326,377.74	0.05
353	000582	北部湾港	30,400	326,192.00	0.05
354	000921	海信家电	11,900	325,108.00	0.05
355	000799	酒鬼酒	7,400	323,380.00	0.05
356	000682	东方电子	25,600	323,328.00	0.05
357	002262	恩华药业	17,000	318,750.00	0.05
358	000009	中国宝安	51,017	317,835.91	0.05
359	301219	腾远钴业	5,790	317,292.00	0.05
360	002270	华明装备	16,600	312,910.00	0.05
361	301029	怡合达	11,572	312,559.72	0.05
362	002139	拓邦股份	32,800	312,256.00	0.05
363	300765	石药创新	11,400	310,422.00	0.05
364	300779	惠城环保	6,160	309,232.00	0.05
365	002607	中公教育	171,100	307,980.00	0.05
366	000513	丽珠集团	10,620	306,811.80	0.05
367	002500	山西证券	59,080	304,852.80	0.05
368	002312	川发龙蟒	33,100	303,527.00	0.05
369	002895	川恒股份	10,300	300,760.00	0.05
370	300229	拓尔思	21,584	298,290.88	0.05
371	000739	普洛药业	17,900	298,214.00	0.05

372	002385	大北农	107,550	296,838.00	0.05
373	002948	青岛银行	58,390	296,621.20	0.05
374	300777	中简科技	11,200	294,336.00	0.05
375	000723	美锦能源	87,200	292,120.00	0.05
376	300676	华大基因	8,300	290,998.00	0.05
377	002244	滨江集团	38,200	290,320.00	0.05
378	300144	宋城演艺	49,526	287,746.06	0.05
379	003022	联泓新科	11,100	287,490.00	0.05
380	301316	慧博云通	7,300	287,474.00	0.05
381	300468	四方精创	13,600	285,736.00	0.05
382	300413	芒果超媒	19,300	282,359.00	0.05
383	002299	圣农发展	18,400	278,944.00	0.05
384	300735	光弘科技	12,200	277,428.00	0.05
385	300146	汤臣倍健	30,500	275,720.00	0.05
386	000778	新兴铸管	73,582	272,989.22	0.05
387	300009	安科生物	34,767	272,920.95	0.05
388	002545	东方铁塔	16,700	270,874.00	0.05
389	002468	申通快递	18,500	269,360.00	0.04
390	002568	百润股份	15,900	269,028.00	0.04
391	002439	启明星辰	21,200	268,180.00	0.04
392	002583	海能达	34,700	266,843.00	0.04
393	000628	高新发展	5,600	265,440.00	0.04
394	301275	汉朔科技	5,900	264,910.00	0.04
395	000598	兴蓉环境	41,200	264,504.00	0.04
396	000581	威孚高科	15,451	262,976.02	0.04
397	300775	三角防务	11,900	262,276.00	0.04
398	300674	宇信科技	17,400	261,870.00	0.04
399	000998	隆平高科	34,600	260,884.00	0.04
400	300100	双林股份	9,300	258,354.00	0.04
401	000563	陕国投 A	92,330	254,830.80	0.04
402	300638	广和通	13,760	254,697.60	0.04
403	002507	涪陵榨菜	23,540	254,232.00	0.04
404	002120	韵达股份	39,861	253,515.96	0.04
405	002544	普天科技	13,900	253,258.00	0.04
406	300457	赢合科技	11,800	248,744.00	0.04
407	300034	钢研高纳	14,380	246,473.20	0.04
408	300718	长盛轴承	4,000	243,880.00	0.04
409	002531	天顺风能	28,200	237,726.00	0.04
410	000935	四川双马	9,100	237,419.00	0.04
411	000027	深圳能源	38,140	236,468.00	0.04
412	002701	奥瑞金	54,700	233,022.00	0.04
413	000543	皖能电力	30,700	232,399.00	0.04
414	002984	森麒麟	17,760	232,123.20	0.04

415	000883	湖北能源	53,500	231,120.00	0.04
416	002373	千方科技	32,000	229,760.00	0.04
417	002698	博实股份	19,000	229,330.00	0.04
418	000825	太钢不锈	67,000	228,470.00	0.04
419	002423	中粮资本	27,600	227,148.00	0.04
420	003021	兆威机电	2,600	227,110.00	0.04
421	000709	河钢股份	116,700	226,398.00	0.04
422	300601	康泰生物	19,900	225,666.00	0.04
423	000099	中信海直	15,482	225,417.92	0.04
424	002268	电科网安	17,300	223,170.00	0.04
425	300070	碧水源	69,434	221,494.46	0.04
426	001286	陕西能源	21,800	221,052.00	0.04
427	000429	粤高速 A	16,100	219,765.00	0.04
428	000801	四川九洲	16,800	217,392.00	0.04
429	000088	盐田港	52,600	215,134.00	0.04
430	300682	朗新科技	21,250	210,375.00	0.04
431	002091	江苏国泰	29,000	209,670.00	0.03
432	301345	涛涛车业	900	207,900.00	0.03
433	002019	亿帆医药	22,100	206,635.00	0.03
434	002508	老板电器	14,060	205,557.20	0.03
435	002670	国盛证券	18,660	205,260.00	0.03
436	000902	新洋丰	17,702	204,635.12	0.03
437	000800	一汽解放	34,300	204,085.00	0.03
438	002773	康弘药业	9,934	203,150.30	0.03
439	300357	我武生物	8,640	201,484.80	0.03
440	300529	健帆生物	13,000	200,200.00	0.03
441	000555	神州信息	19,200	197,760.00	0.03
442	000029	深深房 A	8,900	196,245.00	0.03
443	300660	江苏雷利	6,996	194,908.56	0.03
444	002925	盈趣科技	7,830	193,087.80	0.03
445	300957	贝泰妮	6,100	192,211.00	0.03
446	300761	立华股份	11,500	188,715.00	0.03
447	002408	齐翔腾达	39,720	186,286.80	0.03
448	001391	国货航	45,600	185,592.00	0.03
449	000791	甘肃能源	24,400	185,440.00	0.03
450	002906	华阳集团	7,400	184,704.00	0.03
451	003035	南网能源	31,400	182,748.00	0.03
452	002368	太极股份	13,059	182,695.41	0.03
453	000156	华数传媒	28,600	180,466.00	0.03
454	000069	华侨城 A	109,631	179,794.84	0.03
455	002416	爱施德	20,000	179,200.00	0.03
456	000539	粤电力 A	26,300	179,103.00	0.03
457	300979	华利集团	6,000	178,500.00	0.03

458	300910	瑞丰新材	6,360	178,334.40	0.03
459	002153	石基信息	24,582	177,727.86	0.03
460	301606	绿联科技	2,900	176,958.00	0.03
461	000089	深圳机场	28,300	170,649.00	0.03
462	000966	长源电力	43,500	170,520.00	0.03
463	301238	瑞泰新材	6,800	165,920.00	0.03
464	301039	中集车辆	23,100	162,855.00	0.03
465	002010	传化智联	36,400	162,708.00	0.03
466	002032	苏泊尔	4,100	162,360.00	0.03
467	300888	稳健医疗	5,760	161,222.40	0.03
468	002372	伟星新材	19,323	158,255.37	0.03
469	301301	川宁生物	19,800	157,212.00	0.03
470	000877	天山股份	42,803	155,374.89	0.03
471	300428	立中集团	8,300	150,894.00	0.03
472	000537	绿发电力	20,400	149,124.00	0.02
473	301589	诺瓦星云	1,000	148,980.00	0.02
474	002608	江苏国信	21,200	146,280.00	0.02
475	000959	首钢股份	39,900	140,049.00	0.02
476	000927	中国铁物	60,700	137,789.00	0.02
477	002690	美亚光电	9,577	137,238.41	0.02
478	000937	冀中能源	33,743	134,297.14	0.02
479	002847	盐津铺子	3,000	133,800.00	0.02
480	002265	建设工业	7,500	130,500.00	0.02
481	001872	招商港口	6,700	130,181.00	0.02
482	002096	易普力	14,600	128,188.00	0.02
483	002755	奥赛康	9,100	123,942.00	0.02
484	000898	鞍钢股份	65,989	123,399.43	0.02
485	002320	海峡股份	19,625	123,048.75	0.02
486	000785	居然智家	61,400	122,800.00	0.02
487	002945	华林证券	8,700	116,841.00	0.02
488	301155	海力风电	2,700	115,830.00	0.02
489	301656	联合动力	6,700	115,441.00	0.02
490	301498	乖宝宠物	2,800	113,652.00	0.02
491	002563	森马服饰	22,500	113,400.00	0.02
492	002978	安宁股份	4,300	110,209.00	0.02
493	002060	广东建工	35,400	107,262.00	0.02
494	002901	大博医疗	2,300	96,094.00	0.02
495	002461	珠江啤酒	11,200	84,784.00	0.01
496	301267	华夏眼科	5,600	81,704.00	0.01
497	001213	中铁特货	24,300	81,405.00	0.01
498	001289	龙源电力	4,100	64,083.00	0.01
499	001221	悍高集团	1,100	44,242.00	0.01
500	001386	马可波罗	3,000	42,480.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	001399	惠科股份	3,004	83,300.92	0.01
2	001365	天海电子	510	15,968.10	0.00
3	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
4	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
5	400174	中天 3	100,100	14,014.00	0.00
6	001237	惠康科技	212	12,452.88	0.00
7	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
8	001248	华润新能源	500	5,055.00	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	002594	比亚迪	3,028,538.00	0.61
2	300750	宁德时代	2,815,894.40	0.56
3	002602	世纪华通	2,777,872.00	0.56
4	301308	江波龙	2,279,560.00	0.46
5	300308	中际旭创	2,235,055.00	0.45
6	002428	云南锗业	1,655,972.00	0.33
7	300502	新易盛	1,604,459.00	0.32
8	300476	胜宏科技	1,449,553.00	0.29
9	301511	德福科技	1,388,142.49	0.28
10	002371	北方华创	1,382,311.00	0.28
11	300274	阳光电源	1,246,997.00	0.25
12	300620	光库科技	1,237,922.00	0.25
13	002475	立讯精密	1,206,684.00	0.24
14	300059	东方财富	1,203,229.00	0.24
15	301217	铜冠铜箔	1,186,750.00	0.24
16	300394	天孚通信	1,179,090.00	0.24
17	000408	藏格矿业	1,086,261.00	0.22
18	000858	五粮液	967,680.00	0.19
19	001309	德明利	883,973.00	0.18
20	300666	江丰电子	842,477.00	0.17

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	300308	中际旭创	1,276,476.00	0.26
2	300502	新易盛	849,385.00	0.17
3	000333	美的集团	606,206.00	0.12
4	300757	罗博特科	556,271.00	0.11
5	001309	德明利	484,948.00	0.10
6	301377	鼎泰高科	478,159.00	0.10
7	300750	宁德时代	470,111.00	0.09
8	002371	北方华创	457,616.00	0.09
9	300274	阳光电源	457,268.00	0.09
10	300394	天孚通信	447,531.00	0.09
11	002475	立讯精密	421,845.00	0.08
12	300666	江丰电子	410,512.00	0.08
13	300751	迈为股份	394,090.00	0.08
14	002183	怡亚通	326,414.20	0.07
15	001389	广合科技	324,671.00	0.07
16	002281	光迅科技	321,811.00	0.06
17	002594	比亚迪	320,860.00	0.06
18	002916	深南电路	300,398.00	0.06
19	002936	郑州银行	289,511.00	0.06
20	002745	木林森	288,232.00	0.06

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	113,892,711.87
卖出股票收入（成交）总额	39,324,701.98

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）	69,801.53	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	69,801.53	0.01

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	127114	宜化转债	698	69,801.53	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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约定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	36,014.46
2	应收清算款	15,905.82
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	51,920.28

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	001399	惠科股份	83,300.92	0.01	新股锁定期
2	001365	天海电子	15,968.10	0.00	新股锁定期
3	301669	高特电子	15,506.40	0.00	新股锁定期
4	301531	春光集团	14,952.40	0.00	新股锁定期
5	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
11,411	26,654.50	41,091,817.00	13.51%	155,997,716.00	51.29%	107,064,974.00	35.20%

8.2 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。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

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	304,154,507.00
本报告期基金总申购份额	390,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	390,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	304,154,507.00

§ 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，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

中信建投	2	149,491,059.63	97.94%	14,934.43	97.94%	-
中泰证券	1	3,139,205.40	2.06%	313.59	2.06%	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	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证券综合研究服务协议后将其入库，并对入库的证券公司开展动态管理，定期检视其是否持续符合选择标准；

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

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	10,853.70	100.00%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分深交所 ETF 变更场内简称的公告	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	2026-01-08
2	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加德邦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	2026-01-08
3	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加世纪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	2026-01-13
4	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加中金公司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	2026-03-13
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（2025 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	2026-03-31
6	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加民生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	2026-04-22
7	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	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	2026-04-24
8	南方基金管理股份有限公司成都分公司工商注册信息变更公告	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	2026-04-28
9	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加华源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	2026-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20260101-20260630	121,164,674.00	3,000,000.00	17,099,700.00	107,064,974.00	35.20%
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 2026 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>