

南方中证 1000 交易型开放式指数证券 投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	57
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	105

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	111
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	111
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	111
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	111
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	111
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	111
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	111
8.12 投资组合报告附注.....	112
§9 基金份额持有人信息.....	113
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	113
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	113
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	113
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	114
§10 开放式基金份额变动.....	114
§11 重大事件揭示.....	114
11.1 基金份额持有人大会决议.....	114
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	114
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	114
11.4 基金投资策略的改变.....	115
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	115
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	115
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	115
11.8 其他重大事件.....	117
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	118
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	118
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	119
§13 备查文件目录.....	119
13.1 备查文件目录.....	119
13.2 存放地点.....	119
13.3 查阅方式.....	119

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 1000ETF
场内简称	1000ETF；中证 1000ETF
基金主代码	512100
交易代码	512100
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2016 年 9 月 29 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	22,253,217,646.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016 年 11 月 4 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	中证 1000 指数
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	张姗
	联系电话	0755-82763888	400-61-95555
	电子邮箱	manager@southernfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-889-8899	400-61-95555
传真		0755-82763889	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518017	518040
法定代表人	周易	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	9,718,234,129.89	-206,484,218.25	-653,796,784.69
本期利润	12,174,500,187.63	-195,824,808.82	-1,236,512,758.70
加权平均基金份额本期利润	0.7860	-0.0493	-0.3325
本期加权平均净值利润率	35.80%	-1.91%	-20.91%
本期基金份额净值增长率	2.10%	-5.54%	-21.20%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	-7,002,922,771.78	-1,409,579,027.13	-952,386,207.36
期末可供分配基金份额利润	-0.3147	-0.3645	-0.2254
期末基金资产净值	53,872,818,371.16	9,169,553,589.41	10,608,824,206.07
期末基金份额净值	2.4209	2.3711	2.5102
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	-11.50%	-13.32%	-8.24%

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。

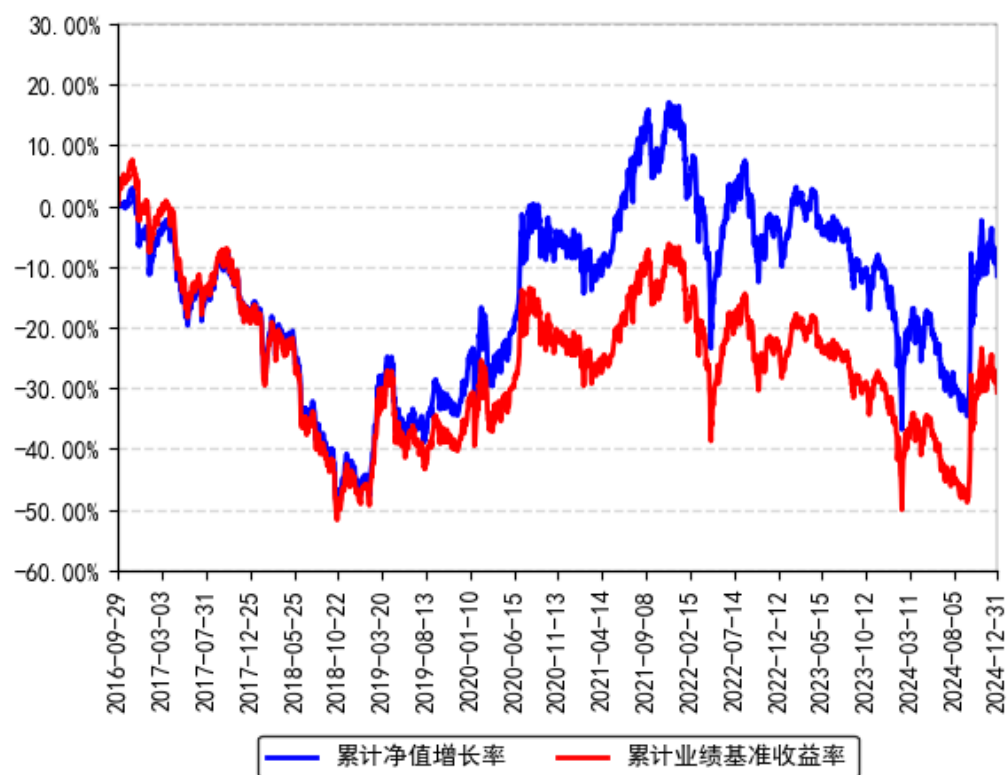
3.2 基金净值表现

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	4.24%	2.39%	4.36%	2.40%	-0.12%	-0.01%
过去六个月	21.97%	2.24%	21.69%	2.24%	0.28%	0.00%
过去一年	2.10%	2.11%	1.20%	2.12%	0.90%	-0.01%
过去三年	-24.01%	1.62%	-25.62%	1.62%	1.61%	0.00%
过去五年	23.96%	1.57%	7.02%	1.57%	16.94%	0.00%
自基金合同 生效起至今	-11.50%	1.49%	-30.66%	1.50%	19.16%	-0.01%

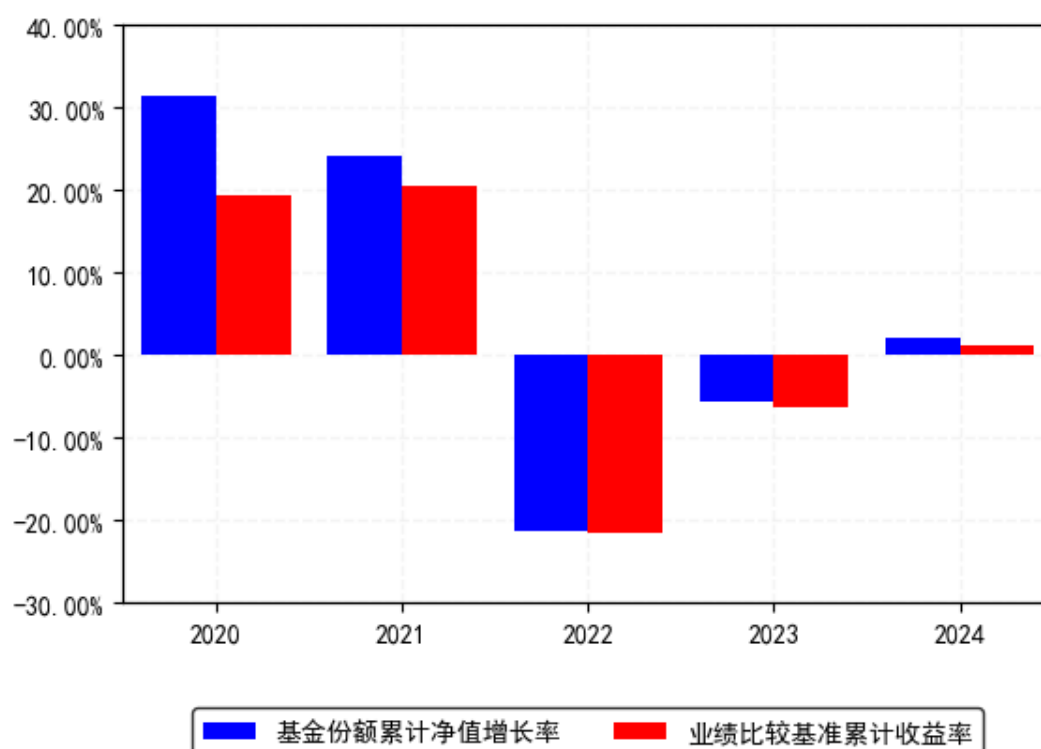
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方中证1000ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方中证1000ETF每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
崔蕾	本基金 基金经 理	2019 年 7 月 12 日	-	9 年	女，康奈尔大学金融工程硕士，具有基金从业资格。2015 年 2 月加入南方基金，历任量化投资部助理研究员、研究员，指数投资部研究员；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 4 月 23 日，任南方小康 ETF、南方小康 ETF 联接基金经理；2019 年 6 月 28 日至 2022 年 2 月 18 日，任大数据 300 基金经理；2020 年 3 月 26 日至 2023 年 3 月 27 日，任南方粤港澳大湾区联接基金经理；2019 年 11 月 29 日至 2023 年 7 月 4 日，任南方粤港澳大湾区 ETF 基金经理；2018 年 11 月 8 日至 2023 年 12 月 29 日，任南方中证 500 增强基金经理；2022 年 12 月 1 日至 2023 年 12 月 29 日，任南方上证科创板 50 成份增强策略 ETF 基金经理；2019 年 6 月 12 日至今，任南方顶峰 TOPIX ETF (QDII) 基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任有色金属、南方有色金属联接、1000ETF 基金经理；2020 年 1 月 17 日至今，任红利 50 基金经理；2020 年 1 月 21 日至今，任南方大盘红利 50 基金经理；2021 年 6 月 24 日至今，任南方中证科创创业 50ETF 基金经理；2021 年 8 月 19 日至今，任南方中证科创创业 50ETF 联接基金经理；2021 年 9 月 27 日至今，任南方中证 1000 联接基金经理；2021 年 12 月 29 日至今，任南方国证在线消费 ETF 基金经理；2022 年 1 月 26 日至今，任南方中证 500 增强策略 ETF 基金经理；2022 年 11 月 23 日至今，任南方国证交通运输行业 ETF 基金经理；2023 年 11 月 24 日至今，任南方国证交通运输行业 ETF 发起联接基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理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，并且交易占优比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 129 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，中证 1000 指数涨 1.2%。期间我们通过自建的指数化交易系统、日内择时交易模型、跟踪误差归因分析系统、ETF 现金流精算系统等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

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

(2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

(3) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；

(4) 报告期内，我们根据指数定期的成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 2.4209 元，报告期内，份额净值增长率为 2.10%，同期业绩基准增长率为 1.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观层面上，预计我国经济整体保持复苏趋势，货币政策总体宽松，流动性合理充裕，后续经济基本面底部反弹有望为小盘股弹性修复提供基础。行业层面上，在国内新质生产力发展的大趋势下，以人工智能、机器人、半导体等为代表的新兴成长行业迎来发展机遇，中证 1000 指数集聚 270 余只属战略新兴行业的成分上市公司，成长空间广阔。从估值上看，指数当前市盈率、市净率分位数分别位于近 10 年 P45、P17 附近，仍具备估值优势。从风格轮动角度看，小盘相对大盘风格走势正处于向上的均值回复阶段，无论是国内流动性还是产业发展趋势都支持小盘风格相对占优。

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，力求实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

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

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

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全各项管理制度，不断提高监察稽核及合规管理工作的科学性和有效性，坚持“看不清管不住则不展业”，落实全面风险管理与全员合规管理要求，持续推进合规数智化在更广更深的范围

应用及融合，努力防范和管理各类风险，覆盖各类业务、场景及人员，切实维护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2025）审字第 70027797_H40 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他

	责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

	(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	高 鹤	邓 雯
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层	
审计报告日期	2025 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	170,215,322.31	53,155,537.79
结算备付金		732,760,603.64	131,010,670.01
存出保证金		137,982,008.76	24,529,144.50
交易性金融资产	7.4.7.2	52,919,663,438.62	9,006,030,078.74
其中：股票投资		52,919,663,438.62	9,004,077,344.25
基金投资		-	-
债券投资		-	1,952,734.49
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-

债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		53,269,754.26	38,241,915.45
应收股利		-	465.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	377,027.15
资产总计		54,013,891,127.59	9,253,344,838.64
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		5,902,092.90	18,264,019.20
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,204,671.93	3,332,807.60
应付托管费		2,401,557.31	666,561.52
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,996,618.26	41,457.29
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	120,567,816.03	61,486,403.62
负债合计		141,072,756.43	83,791,249.23
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	60,875,741,142.94	10,579,132,616.54
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-7,002,922,771.78	-1,409,579,027.13
净资产合计		53,872,818,371.16	9,169,553,589.41
负债和净资产总计		54,013,891,127.59	9,253,344,838.64

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.4209 元，基金份额总额 22,253,217,646.00 份。

7.2 利润表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		12,366,269,875.54	-130,078,016.24
1.利息收入		17,694,876.80	37,775,823.69
其中：存款利息收入	7.4.7.9	9,866,696.09	2,414,803.84
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		7,828,180.71	35,361,019.85
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,105,522,736.84	-220,227,179.01
其中：股票投资收益	7.4.7.10	9,490,944,581.50	-314,477,989.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	1,981,330.74	6,876,810.87
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	211,117,848.00	-7,434,864.08
股利收益	7.4.7.13	401,478,976.60	94,808,863.69
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	2,456,266,057.74	10,659,409.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-213,213,795.84	41,713,929.65
减：二、营业总支出		191,769,687.91	65,746,792.58
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	149,276,144.03	51,795,817.14
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	31,143,194.21	10,359,163.39
3.销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		789,614.19	169,507.81
8.其他费用	7.4.7.16	10,560,735.48	3,422,304.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,174,500,187.63	-195,824,808.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,174,500,187.63	-195,824,808.82
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		12,174,500,187.63	-195,824,808.82

7.3 净资产变动表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	10,579,132,616.54	-	-1,409,579,027.13	9,169,553,589.41
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	10,579,132,616.54	-	-1,409,579,027.13	9,169,553,589.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	50,296,608,526.40	-	-5,593,343,744.65	44,703,264,781.75
（一）、综合收益总额	-	-	12,174,500,187.63	12,174,500,187.63
（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）	50,296,608,526.40	-	-17,767,843,932.28	32,528,764,594.12
其中：1.基金申购款	178,661,563,336.15	-	-38,441,982,800.12	140,219,580,536.03
2.基金赎回款	-128,364,954,809.75	-	20,674,138,867.84	-107,690,815,941.91
（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	60,875,741,142.94	-	-7,002,922,771.78	53,872,818,371.16
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	11,561,210,413.43	-	-952,386,207.36	10,608,824,206.07
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	11,561,210,413.43	-	-952,386,207.36	10,608,824,206.07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-982,077,796.89	-	-457,192,819.77	-1,439,270,616.66
（一）、综合收益总额	-	-	-195,824,808.82	-195,824,808.82
（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）	-982,077,796.89	-	-261,368,010.95	-1,243,445,807.84
其中：1.基金申购款	33,683,353,724.68	-	-1,853,068,791.19	31,830,284,933.49
2.基金赎回款	-34,665,431,521.57	-	1,591,700,780.24	-33,073,730,741.33
（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	10,579,132,616.54	-	-1,409,579,027.13	9,169,553,589.41
-----------	-------------------	---	-------------------	------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

南方中证 1000 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[2016]366 号《关于准予南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由南方基金管理股份有限公司(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《南方中证 1000 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 587,892,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1149 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 587,892,000.00 份,无认购资金利息折份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2016]264 号审核同意,本基金 587,892,000.00 份基金份额于 2016 年 11 月 4 日在上交所挂牌交易。

根据《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《南方基金管理股份有限公司关于南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额合并结果的公告》的有关规定,本基金的基金管理人确定 2022 年 9 月 2 日为本基金的基金份额合并日。当日合并前基金份额总额为 10,207,092,000 份,基金份额净值为 0.9910 元。根据基金份额合并公式,基金份额合并比例为 0.36555,合并后基金份额总额为 3,731,217,646 份,基金份额净值为 2.7109 元。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述合并比例,对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了合并,并于 2022 年 9 月 2 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 1000 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中证 1000 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;此外,本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转

换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。基金管理人根据相关规定可参与转融通证券出借业务。本基金可投资于存托凭证。在正常市场情况下，力争控制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：中证 1000 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，募集成立了南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“南方中证 1000 联接基金”)。南方中证 1000 联接基金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。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

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

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

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

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。由于基金份额合并引起的实收基金份额变动于基金份额合并日根据合并前的基金份额数及确定的合并比例计算认列。

7.4.4.8 损益平准金

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

比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

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

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

（1）增值税及附加

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

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

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

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

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

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

（2）企业所得税

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

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

(3) 个人所得税

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

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

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

(4) 印花税（如适用）

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

(5) 境外投资

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	170,215,322.31	53,155,537.79
等于：本金	170,189,314.08	53,151,852.61
加：应计利息	26,008.23	3,685.18
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	170,215,322.31	53,155,537.79

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		50,906,439,812.99	-	52,919,663,438.62	2,013,223,625.63
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		50,906,439,812.99	-	52,919,663,438.62	2,013,223,625.63
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		9,478,761,741.56	-	9,004,077,344.25	-474,684,397.31
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,952,600.00	134.49	1,952,734.49	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,952,600.00	134.49	1,952,734.49	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-

合计	9,480,714,341.56	134.49	9,006,030,078.74	-474,684,397.31
----	------------------	--------	------------------	-----------------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	962,549,679.49	-	-	-
—股指期货	962,549,679.49	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	962,549,679.49	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	160,563,754.29	-	-	-
—股指期货	160,563,754.29	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	160,563,754.29	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2501	IM2501	83.00	98,866,280.00	-4,011,759.49
IM2503	IM2503	706.00	830,453,680.00	-29,217,960.00
合计				-33,229,719.49
减：可抵销期货暂收款				-33,229,719.49
净额				0.00

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	-	377,027.15
待摊费用	-	-
合计	-	377,027.15

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	8,720,615.46	950,311.38
其中：交易所市场	8,720,615.46	950,311.38
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应退退补款	104,324,360.86	59,210,081.55
预提费用	200,000.00	270,000.00
应付指数使用费	4,536,912.37	681,084.18
可退替代款	2,785,927.34	374,926.51
合计	120,567,816.03	61,486,403.62

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,867,217,646.00	10,579,132,616.54
本期申购	65,310,000,000.00	178,661,563,336.15
本期赎回（以“-”号填列）	-46,924,000,000.00	-128,364,954,809.75
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	22,253,217,646.00	60,875,741,142.94

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

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	591,061,265.09	-2,000,640,292.22	-1,409,579,027.13
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	591,061,265.09	-2,000,640,292.22	-1,409,579,027.13
本期利润	9,718,234,129.89	2,456,266,057.74	12,174,500,187.63
本期基金份额交易产生的变动数	286,468,377.56	-18,054,312,309.84	-17,767,843,932.28
其中：基金申购款	8,955,732,620.03	-47,397,715,420.15	-38,441,982,800.12
基金赎回款	-8,669,264,242.47	29,343,403,110.31	20,674,138,867.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,595,763,772.54	-17,598,686,544.32	-7,002,922,771.78

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	784,132.94	174,079.68
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	8,896,272.97	2,107,637.91
其他	186,290.18	133,086.25
合计	9,866,696.09	2,414,803.84

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,037,171,370.84	-215,392,901.13
股票投资收益——赎回差价收入	2,453,773,210.66	-99,085,088.36
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	9,490,944,581.50	-314,477,989.49

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	80,456,839,255.13	27,396,266,845.26
减：卖出股票成本总额	73,349,903,648.67	27,578,902,491.46
减：交易费用	69,764,235.62	32,757,254.93
买卖股票差价收入	7,037,171,370.84	-215,392,901.13

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	107,690,815,941.91	33,073,730,741.33
减：现金支付赎回款总额	60,687,083,738.91	19,600,372,581.33
减：赎回股票成本总额	44,549,958,992.34	13,572,443,248.36
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	2,453,773,210.66	-99,085,088.36

7.4.7.11 债券投资收益**7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	3,413.50	3,770.30
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,977,917.24	6,873,040.57
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	1,981,330.74	6,876,810.87

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	33,529,908.04	34,564,901.67
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	31,547,000.00	27,686,500.00

减：应计利息总额	3,650.45	3,978.51
减：交易费用	1,340.35	1,382.59
买卖债券差价收入	1,977,917.24	6,873,040.57

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

7.4.7.11.3 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.12 衍生工具收益

7.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货-投资收益	211,117,848.00	-7,434,864.08

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	401,478,976.60	94,808,863.69
其中：证券出借权益补偿收入	8,959,988.87	20,559,520.17
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	401,478,976.60	94,808,863.69

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	2,487,908,022.94	3,656,363.72
——股票投资	2,487,908,022.94	3,656,416.88
——债券投资	-	-53.16
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-31,641,965.20	7,003,045.71
——权证投资	-	-
——期货投资	-31,641,965.20	7,003,045.71
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	2,456,266,057.74	10,659,409.43

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-213,213,795.84	41,491,297.65
其他	-	222,632.00
合计	-213,213,795.84	41,713,929.65

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

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00	150,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	10,308,932.17	3,107,748.99
银行费用	51,803.31	44,555.25
合计	10,560,735.48	3,422,304.24

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2025 年 1 月 10 日宣告 2024 年度第 1 次分红，向截至 2025 年 1 月 14 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.3700 元。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

厦门国际信托有限公司(“厦门国际信托”)	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司(“深圳投资控股”)	基金管理人的股东
厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
华泰长城资本管理有限公司(“华泰长城”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
南方资本管理有限公司(“南方资本”)	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司(“南方东英”)	基金管理人的子公司
南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(“南方中证 1000 联接基金”)	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	34,610,161,745.69	19.23%	14,170,314,243.73	26.13%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	1,352,312.39	4.03%	17,796,790.81	51.49%

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	3,459,615.68	19.23%	2,922,886.02	33.52%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	1,417,175.07	26.12%	229,435.90	24.14%

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

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	149,276,144.03	51,795,817.14
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,205,342.42	911,637.96
应支付基金管理人的净管理费	147,070,801.61	50,884,179.18

注：1、支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% ÷ 当年天数。

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	31,143,194.21	10,359,163.39

注：1、支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.05%÷当年天数。

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

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	-	-	-	-

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	1,492,000,012.00	1,082,463.36	-	-

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

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间（%）	加权平均费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	3,250,466,027.00	1.1~3.5	1.28	1,639,252.76	-	-

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间（%）	加权平均费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	5,633,773,531.00	1.1~3.5	1.58	3,911,045.37	401,728,865.00	114,923.52
兴业证券	19,105,479.00	3~3.5	3.01	21,704.01	-	-

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰长城资本管理有限公司	848,500.00	0.00%	-	-
华泰证券股份有限公司	120,982,787.00	0.54%	312,692,949.00	8.09%
兴业证券股份有限公司	38,483,643.00	0.17%	17,400,735.00	0.45%
招商银行股份有限公司—南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	424,678,785.00	1.91%	334,430,936.00	8.65%

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

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	170,215,322.31	784,132.94	53,155,537.79	174,079.68

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	688709	成都华微	网下申购	10,448	163,929.12
华泰联合	301606	绿联科技	网下申购	3,959	83,970.39
华泰联合	688605	先锋精科	网下申购	7,433	83,918.57
华泰联合	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
华泰联合	301622	英思特	网下申购	3,056	68,332.16

华泰联合	301587	中瑞股份	网下申购	3,056	66,406.88
华泰联合	603312	西典新能	网下申购	1,296	37,609.92
兴业证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	127084	柳工转 2	配债	16,419	1,641,900.00
华泰联合	127100	神码转债	配债	9,266	926,600.00
华泰联合	113666	爱玛转债	配债	7,070	707,000.00
华泰联合	123208	孩王转债	配债	5,350	535,000.00
华泰联合	113674	华设转债	配债	4,800	480,000.00
华泰联合	123188	水羊转债	配债	4,258	425,800.00
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	4,013	130,502.76
华泰联合	301421	波长光电	网下申购	3,315	97,394.70
华泰联合	301519	舜禹股份	网下申购	4,414	92,385.02
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合	301413	安培龙	网下申购	1,633	54,297.25
华泰联合	301566	达利凯普	网下申购	5,755	51,219.50
华泰联合	301487	盟固利	网下申购	8,662	46,081.84
华泰联合	688720	艾森股份	网下申购	1,644	46,081.32
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
兴业证券	127083	山路转债	配债	21,705	2,170,500.00
兴业证券	301322	绿通科技	网下申购	2,604	341,410.44
兴业证券	301315	威士顿	网下申购	2,253	72,749.37
兴业证券	301578	辰奕智能	网下申购	1,175	57,504.50
兴业证券,华泰联合	688469	芯联集成	网下申购	137,994	785,185.86

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：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。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300757	罗博特科	2024年10月21日	6个月	大宗受限锁定	171.60	198.34	50,000	8,580,000.00	9,917,000.00	-
300757	罗博特科	2024年10月23日	6个月	大宗受限锁定	169.69	198.25	30,000	5,090,700.00	5,947,500.00	-
300757	罗博特科	2024年10月31日	6个月	大宗受限锁定	170.40	197.75	30,000	5,112,000.00	5,932,500.00	-
300757	罗博特科	2024年10月22日	6个月	大宗受限锁定	172.00	198.21	20,000	3,440,000.00	3,964,200.00	-
300570	太辰光	2024年11月19日	6个月	大宗受限锁定	63.94	63.84	400,000	25,576,000.00	25,536,000.00	-
688484	南芯科技	2024年12月13日	6个月	大宗受限锁定	38.34	32.79	640,000	24,537,600.00	20,985,600.00	-
300456	赛微电子	2024年12月2日	6个月	大宗受限锁定	18.05	15.47	1,200,000	21,660,000.00	18,564,000.00	-
688139	海尔生物	2024年11月20日	6个月	大宗受限锁定	32.80	32.29	530,000	17,384,000.00	17,113,700.00	-
300783	三只松鼠	2024年10月17日	6个月	大宗受限锁定	21.89	33.02	300,000	6,567,000.00	9,906,000.00	-
300783	三只松鼠	2024年10月22日	6个月	大宗受限锁定	23.17	32.98	200,000	4,634,000.00	6,596,000.00	-
688548	广钢气体	2024年12月11日	6个月	大宗受限锁定	10.50	9.27	1,000,000	10,500,000.00	9,270,000.00	-
688548	广钢气体	2024年12月12日	6个月	大宗受限锁定	10.50	9.28	450,000	4,725,000.00	4,176,000.00	-
688548	广钢气体	2024年12月5日	6个月	大宗受限锁定	9.30	9.28	250,000	2,325,000.00	2,320,000.00	-
300705	九典制药	2024年12月	6个月	大宗受限锁定	24.07	16.46	750,000	18,052,500.00	12,345,000.00	-

		月 13 日								
688270	臻镭科技	2024 年 12 月 11 日	6 个月	大宗受限锁定	41.81	30.92	380,000	15,887,800.00	11,749,600.00	-
002243	力合科创	2024 年 10 月 29 日	6 个月	大宗受限锁定	8.20	7.42	500,000	4,100,000.00	3,710,000.00	-
002243	力合科创	2024 年 10 月 30 日	6 个月	大宗受限锁定	8.45	7.42	500,000	4,225,000.00	3,710,000.00	-
002243	力合科创	2024 年 10 月 31 日	6 个月	大宗受限锁定	9.30	7.42	500,000	4,650,000.00	3,710,000.00	-
605507	国邦医药	2024 年 11 月 26 日	6 个月	大宗受限锁定	20.00	19.85	250,000	5,000,000.00	4,962,500.00	-
605507	国邦医药	2024 年 11 月 25 日	6 个月	大宗受限锁定	20.00	19.85	150,000	3,000,000.00	2,977,500.00	-
605507	国邦医药	2024 年 9 月 2 日	6 个月	大宗受限锁定	16.98	20.27	118,000	2,003,640.00	2,391,860.00	-
603876	鼎胜新材	2024 年 11 月 11 日	6 个月	大宗受限锁定	10.10	8.29	1,200,000	12,120,000.00	9,948,000.00	-
688503	聚和材料	2024 年 9 月 4 日	6 个月	大宗受限锁定	26.01	40.98	130,000	3,381,300.00	5,327,400.00	-
688503	聚和材料	2024 年 11 月 12 日	6 个月	大宗受限锁定	58.50	39.26	100,000	5,850,000.00	3,926,000.00	-
301239	普瑞眼科	2024 年 11 月 14 日	6 个月	大宗受限锁定	50.00	41.51	200,000	10,000,000.00	8,302,000.00	-
688690	纳微科技	2024 年 12 月 9 日	6 个月	大宗受限锁定	18.92	15.88	500,000	9,460,000.00	7,940,000.00	-
301153	中科江南	2024 年 11 月 28 日	6 个月	大宗受限锁定	28.33	24.72	290,000	8,215,700.00	7,168,800.00	-
001337	四川黄金	2024 年 10 月 29 日	6 个月	大宗受限锁定	22.40	19.88	120,000	2,688,000.00	2,385,600.00	-
001337	四川黄金	2024	6 个月	大宗受	21.76	19.87	120,00	2,611,200.00	2,384,400.00	-

		年 11 月 5 日		限锁定			0			
001337	四川黄金	2024 年 11 月 6 日	6 个月	大宗受限锁定	22.01	19.87	120,000	2,641,200.00	2,384,400.00	-
688408	中信博	2024 年 7 月 17 日	6 个月	大宗受限锁定	57.46	70.66	100,000	5,746,000.00	7,066,000.00	-
600903	贵州燃气	2024 年 8 月 1 日	6 个月	大宗受限锁定	5.82	7.58	400,000	2,328,000.00	3,032,000.00	-
600903	贵州燃气	2024 年 8 月 2 日	6 个月	大宗受限锁定	5.72	7.58	400,000	2,288,000.00	3,032,000.00	-
688268	华特气体	2024 年 12 月 3 日	6 个月	大宗受限锁定	48.46	41.97	138,000	6,687,480.00	5,791,860.00	-
688206	概伦电子	2024 年 12 月 12 日	6 个月	大宗受限锁定	21.00	16.99	180,000	3,780,000.00	3,058,200.00	-
688206	概伦电子	2024 年 11 月 8 日	6 个月	大宗受限锁定	22.79	17.11	150,000	3,418,500.00	2,566,500.00	-
301376	致欧科技	2024 年 12 月 12 日	6 个月	大宗受限锁定	20.10	17.66	300,000	6,030,000.00	5,298,000.00	-
300613	富瀚微	2024 年 10 月 29 日	6 个月	大宗受限锁定	43.52	52.61	100,000	4,352,000.00	5,261,000.00	-
603719	良品铺子	2024 年 12 月 9 日	6 个月	大宗受限锁定	12.04	12.98	400,000	4,816,000.00	5,192,000.00	-
301291	明阳电气	2024 年 7 月 8 日	6 个月	大宗受限锁定	30.17	43.07	120,000	3,620,400.00	5,168,400.00	-
003009	中天火箭	2024 年 12 月 17 日	6 个月	大宗受限锁定	36.85	36.47	140,000	5,159,000.00	5,105,800.00	-
603219	富佳股份	2024 年 12 月 5 日	6 个月	大宗受限锁定	13.13	13.07	200,000	2,626,000.00	2,614,000.00	-
603219	富佳股份	2024 年 12 月 12 日	6 个月	大宗受限锁定	13.12	13.07	155,000	2,033,600.00	2,025,850.00	-

688776	国光电气	2024 年 12 月 12 日	6 个月	大宗受 限锁定	55.87	42.10	110,00 0	6,145,700.00	4,631,000.00	-
301381	赛维时代	2024 年 12 月 10 日	6 个月	大宗受 限锁定	24.65	20.83	200,00 0	4,930,000.00	4,166,000.00	-
688789	宏华数科	2024 年 12 月 10 日	6 个月	大宗受 限锁定	60.83	61.31	50,000	3,041,500.00	3,065,500.00	-
605011	杭州热电	2024 年 9 月 26 日	6 个月	大宗受 限锁定	19.02	20.30	120,00 0	2,282,400.00	2,436,000.00	-
301510	固高科技	2024 年 11 月 13 日	6 个月	大宗受 限锁定	26.21	23.68	100,00 0	2,621,000.00	2,368,000.00	-
301511	德福科技	2024 年 10 月 23 日	6 个月	大宗受 限锁定	13.72	11.20	200,00 0	2,744,000.00	2,240,000.00	-
001236	弘业期货	2024 年 12 月 11 日	6 个月	大宗受 限锁定	10.26	8.67	200,00 0	2,052,000.00	1,734,000.00	-
301626	苏州天脉	2024 年 10 月 17 日	6 个月	新股锁 定期	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
688615	合合信息	2024 年 9 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	55.18	165.7 8	289	15,947.02	47,910.42	-
301611	珂玛科技	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股锁 定期	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
688449	联芸科技	2024 年 11 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-
688605	先锋精科	2024 年 12 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688708	佳驰科技	2024 年 11 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-
001391	国货航	2024 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁 定期	2.30	6.80	4,686	10,777.80	31,864.80	-
301551	无线传媒	2024 年 9 月	6 个月	新股锁 定期	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-

		19 日								
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	1 个月 内（含）	新股未 上市	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
688750	金天钛业	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-
301522	上大股份	2024 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
688721	龙图光罩	2024 年 7 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
301556	托普云农	2024 年 10 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301631	壹连科技	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	72.99	101.9 6	153	11,167.47	15,599.88	-
301606	绿联科技	2024 年 7 月 17 日	6 个月	新股锁 定期	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301571	国科天成	2024 年 8 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301622	英思特	2024 年 11 月 26 日	6 个月	新股锁 定期	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301608	博实结	2024 年 7 月 25 日	6 个月	新股锁 定期	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301613	新铝时代	2024 年 10 月 18 日	6 个月	新股锁 定期	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-
301586	佳力奇	2024 年 8 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301617	博苑股份	2024 年 12 月 3 日	6 个月	新股锁 定期	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301603	乔锋智能	2024	6 个月	新股锁	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-

		年 7 月 3 日		定期						
301607	富特科技	2024 年 8 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
603194	中力股份	2024 年 12 月 17 日	6 个月	新股锁 定期	20.32	28.13	291	5,913.12	8,185.83	-
301552	科力装备	2024 年 7 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301585	蓝宇股份	2024 年 12 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
603395	红四方	2024 年 11 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
603310	巍华新材	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股锁 定期	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603391	力聚热能	2024 年 7 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁 定期	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603205	健尔康	2024 年 10 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股票 名称	停牌日期	停牌 原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌开 盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688139	海尔 生物	2024 年 12 月 23 日	重大 事项 停牌	35.20	2025 年 1 月 7 日	30.60	1,026,138	34,176,037.65	36,120,057.60	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证 1000 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，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证 1000 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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约可能性很小，在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于本期末，本基金无债券投资（上期末：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金净资产的比例为 0.02%）。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限

制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	170,215,322.31	-	-	-	170,215,322.31
结算备付金	732,760,603.	-	-	-	732,760,603.

	64				64
存出保证金	26,463,613.56	-	-	111,518,395.20	137,982,008.76
交易性金融资产	-	-	-	52,919,663,438.62	52,919,663,438.62
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	-	-	-	53,269,754.26	53,269,754.26
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	929,439,539.51	-	-	53,084,451,588.08	54,013,891,127.59
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	-	-	-	5,902,092.90	5,902,092.90
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	7,204,671.93	7,204,671.93
应付托管费	-	-	-	2,401,557.31	2,401,557.31
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	4,996,618.26	4,996,618.26
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税	-	-	-	-	-

负债					
其他负债	-	-	-	120,567,816.03	120,567,816.03
负债总计	-	-	-	141,072,756.43	141,072,756.43
利率敏感度缺口	929,439,539.51	-	-	52,943,378,831.65	53,872,818,371.16
上年度末 2023 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	53,155,537.79	-	-	-	53,155,537.79
结算备付金	131,010,670.01	-	-	-	131,010,670.01
存出保证金	5,452,024.50	-	-	19,077,120.00	24,529,144.50
交易性金融资产	-	1,025,067.40	927,667.09	9,004,077,344.25	9,006,030,078.74
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	-	-	-	38,241,915.45	38,241,915.45
应收股利	-	-	-	465.00	465.00
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	377,027.15	377,027.15
资产总计	189,618,232.30	1,025,067.40	927,667.09	9,061,773,871.85	9,253,344,838.64
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	-	-	-	18,264,019.20	18,264,019.20
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	3,332,807.60	3,332,807.60
应付托管费	-	-	-	666,561.52	666,561.52
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	41,457.29	41,457.29
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	61,486,403.62	61,486,403.62
负债总计	-	-	-	83,791,249.23	83,791,249.23
利率敏感度缺口	189,618,232.30	1,025,067.40	927,667.09	8,977,982,622.62	9,169,553,589.41

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	0.00	0.00
	2.市场利率平行下降 25 个基点	0.00	0.00

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的

股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，跟踪中证 1000 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，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，中证 1000 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 90%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	52,919,663,438.62	98.23	9,004,077,344.25	98.20
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	52,919,663,438.62	98.23	9,004,077,344.25	98.20

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	2,677,551,208.26	455,659,718.04
	2.组合自身基准下降 5%	-2,677,551,208.26	-455,659,718.04

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	52,571,528,025.78	8,985,818,117.14
第二层次	36,147,794.10	19,129,325.55
第三层次	311,987,618.74	1,082,636.05
合计	52,919,663,438.62	9,006,030,078.74

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,082,636.05	1,082,636.05
当期购买	-	340,464,220.00	340,464,220.00
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	479,106.59	479,106.59
转出第三层次	-	13,832,294.44	13,832,294.44
当期利得或损失总额	-	-16,206,049.46	-16,206,049.46
其中：计入损益的利得或损失	-	-16,206,049.46	-16,206,049.46
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	311,987,618.74	311,987,618.74
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-18,961,420.46	-18,961,420.46
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		

	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	978,066.39	978,066.39
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,186,206.05	2,186,206.05
转出第三层次	-	2,420,537.65	2,420,537.65
当期利得或损失总额	-	338,901.26	338,901.26
其中：计入损益的利得或损失	-	338,901.26	338,901.26
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,082,636.05	1,082,636.05
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	144,411.29	144,411.29

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	311,987,618.74	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2665~4.9648	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,082,636.05	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1962~2.1988	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上期末：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	52,919,663,438.62	97.97
	其中：股票	52,919,663,438.62	97.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	902,975,925.95	1.67
8	其他各项资产	191,251,763.02	0.35
9	合计	54,013,891,127.59	100.00

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

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	346,616,347.09	0.64
B	采矿业	1,295,333,904.64	2.40
C	制造业	34,350,265,682.35	63.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,468,681,726.05	2.73
E	建筑业	907,965,768.05	1.69
F	批发和零售业	1,639,571,901.55	3.04
G	交通运输、仓储和邮政业	1,706,824,205.37	3.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,218,573,916.15	11.54
J	金融业	1,487,709,149.55	2.76
K	房地产业	856,436,829.08	1.59

L	租赁和商务服务业	1,013,008,796.24	1.88
M	科学研究和技术服务业	418,755,249.50	0.78
N	水利、环境和公共设施管理业	409,921,040.53	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	171,011,948.81	0.32
R	文化、体育和娱乐业	628,659,741.88	1.17
S	综合	-	-
	合计	52,919,336,206.84	98.23

8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	432,115.03	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	31,864.80	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	133,255.37	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	597,235.20	0.00

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	002456	欧菲光	27,321,600	327,312,768.00	0.61
2	002851	麦格米特	3,615,004	222,178,145.84	0.41
3	002130	沃尔核材	8,321,100	210,107,775.00	0.39
4	300757	罗博特科	907,413	200,927,897.16	0.37
5	688608	恒玄科技	607,369	197,619,651.53	0.37
6	002405	四维图新	19,630,950	189,242,358.00	0.35
7	600171	上海贝岭	4,682,800	185,813,504.00	0.34
8	300346	南大光电	4,759,459	183,667,522.81	0.34
9	688027	国盾量子	542,205	161,772,283.80	0.30
10	000528	柳工	13,081,600	157,764,096.00	0.29
11	688235	百济神州	970,142	156,212,264.84	0.29
12	603005	晶方科技	5,388,811	152,233,910.75	0.28
13	002837	英维克	3,665,575	148,089,230.00	0.27
14	600363	联创光电	3,002,490	143,759,221.20	0.27
15	300458	全志科技	3,656,434	141,723,381.84	0.26
16	001696	宗申动力	5,669,200	141,163,080.00	0.26
17	002139	拓邦股份	10,296,900	140,140,809.00	0.26
18	002402	和而泰	7,656,550	138,660,120.50	0.26
19	300623	捷捷微电	4,052,840	138,445,014.40	0.26
20	600100	同方股份	19,393,300	137,886,363.00	0.26

21	002312	川发龙蟒	9,372,114	135,614,489. 58	0.25
22	000415	渤海租赁	35,809,700	135,002,569. 00	0.25
23	300085	银之杰	3,499,161	133,842,908. 25	0.25
24	300459	汤姆猫	23,255,600	133,487,144. 00	0.25
25	300088	长信科技	20,272,117	132,579,645. 18	0.25
26	605589	圣泉集团	5,598,876	132,021,496. 08	0.25
27	300857	协创数据	1,214,636	129,832,442. 04	0.24
28	002126	银轮股份	6,872,600	128,655,072. 00	0.24
29	002583	海能达	9,003,792	127,943,884. 32	0.24
30	600559	老白干酒	6,042,534	126,832,788. 66	0.24
31	300679	电连技术	2,100,671	125,410,058. 70	0.23
32	000766	通化金马	7,982,900	125,331,530. 00	0.23
33	688347	华虹公司	2,682,079	124,636,211. 13	0.23
34	300315	掌趣科技	22,599,800	124,298,900. 00	0.23
35	688018	乐鑫科技	567,670	123,752,060. 00	0.23
36	601677	明泰铝业	10,268,824	123,533,952. 72	0.23
37	000099	中信海直	4,462,810	117,639,671. 60	0.22
38	300068	南都电源	7,212,700	116,412,978. 00	0.22
39	002400	省广集团	14,412,000	115,151,880. 00	0.21
40	300077	国民技术	4,808,344	114,630,920. 96	0.21
41	688568	中科星图	2,243,327	114,476,976. 81	0.21
42	601777	力帆科技	14,951,100	114,375,915. 00	0.21

43	300627	华测导航	2,706,759	113,142,526. 20	0.21
44	002497	雅化集团	9,482,869	110,949,567. 30	0.21
45	300779	惠城环保	1,129,200	110,209,920. 00	0.20
46	688116	天奈科技	2,838,444	110,160,011. 64	0.20
47	688037	芯源微	1,305,289	109,161,319. 07	0.20
48	300762	上海瀚讯	5,190,624	109,158,822. 72	0.20
49	300115	长盈精密	6,714,300	109,040,232. 00	0.20
50	300568	星源材质	11,068,909	107,589,795. 48	0.20
51	300296	利亚德	16,643,073	107,181,390. 12	0.20
52	300666	江丰电子	1,541,124	107,031,061. 80	0.20
53	688019	安集科技	762,709	106,291,126. 24	0.20
54	300229	拓尔思	5,055,200	105,855,888. 00	0.20
55	002176	江特电机	14,130,300	104,705,523. 00	0.19
56	600072	中船科技	7,440,019	104,532,266. 95	0.19
57	603236	移远通信	1,516,374	103,780,636. 56	0.19
58	002389	航天彩虹	5,744,600	103,690,030. 00	0.19
59	300182	捷成股份	17,590,740	103,257,643. 80	0.19
60	300253	卫宁健康	14,403,730	103,130,706. 80	0.19
61	002506	协鑫集成	38,547,116	102,920,799. 72	0.19
62	002245	蔚蓝锂芯	9,525,800	101,830,802. 00	0.19
63	688343	云天励飞	2,049,975	101,678,760. 00	0.19
64	600577	精达股份	13,943,900	101,651,031. 00	0.19

65	002222	福晶科技	3,112,327	100,839,394.80	0.19
66	300170	汉得信息	8,114,500	100,619,800.00	0.19
67	601975	招商南油	32,093,434	100,452,448.42	0.19
68	002416	爱施德	6,138,200	99,868,514.00	0.19
69	601375	中原证券	22,826,800	98,611,776.00	0.18
70	002617	露笑科技	12,796,070	97,889,935.50	0.18
71	688050	爱博医疗	1,071,855	97,570,960.65	0.18
72	601333	广深铁路	28,071,400	96,284,902.00	0.18
73	300570	太辰光	1,360,840	95,389,068.00	0.18
74	002003	伟星股份	6,728,100	95,337,177.00	0.18
75	600323	瀚蓝环境	4,034,900	95,304,338.00	0.18
76	002151	北斗星通	3,585,300	95,153,862.00	0.18
77	002145	中核钛白	22,438,709	95,140,126.16	0.18
78	000875	吉电股份	18,038,500	94,882,510.00	0.18
79	600446	金证股份	5,481,242	94,496,612.08	0.18
80	688266	泽璟制药	1,513,096	94,281,011.76	0.18
81	300432	富临精工	6,049,000	93,033,620.00	0.17
82	300738	奥飞数据	6,392,474	92,690,873.00	0.17
83	605111	新洁能	2,733,349	92,687,864.59	0.17
84	600388	龙净环保	7,296,616	92,302,192.40	0.17
85	000686	东北证券	11,602,359	92,122,730.46	0.17
86	300045	华力创通	4,357,000	91,017,730.00	0.17

87	601528	瑞丰银行	16,156,260	90,959,743.8 0	0.17
88	000628	高新发展	1,458,400	90,843,736.0 0	0.17
89	600761	安徽合力	5,145,500	90,818,075.0 0	0.17
90	002075	沙钢股份	14,507,400	90,816,324.0 0	0.17
91	600601	方正科技	20,686,500	90,813,735.0 0	0.17
92	300674	宇信科技	4,650,540	90,778,540.8 0	0.17
93	000581	威孚高科	4,763,730	89,939,222.4 0	0.17
94	603083	剑桥科技	2,214,600	89,912,760.0 0	0.17
95	600331	宏达股份	11,767,600	89,669,112.0 0	0.17
96	300083	创世纪	13,754,700	89,543,097.0 0	0.17
97	300735	光弘科技	3,171,213	88,762,251.8 7	0.16
98	300181	佐力药业	5,773,039	88,673,879.0 4	0.16
99	002807	江阴银行	20,337,900	88,469,865.0 0	0.16
100	600216	浙江医药	5,568,898	88,322,722.2 8	0.16
101	688208	道通科技	2,243,300	87,847,628.0 0	0.16
102	002484	江海股份	4,909,514	86,309,256.1 2	0.16
103	002698	博实股份	5,064,000	86,088,000.0 0	0.16
104	600908	无锡银行	14,509,000	85,748,190.0 0	0.16
105	002936	郑州银行	40,757,280	85,590,288.0 0	0.16
106	300035	中科电气	5,666,200	84,709,690.0 0	0.16
107	000681	视觉中国	4,056,300	84,452,166.0 0	0.16
108	601222	林洋能源	11,922,600	84,292,782.0 0	0.16

109	600667	太极实业	12,171,300	84,225,396.0 0	0.16
110	600186	莲花控股	14,751,800	84,085,260.0 0	0.16
111	600602	云赛智联	5,312,100	84,037,422.0 0	0.16
112	002701	奥瑞金	14,800,500	83,918,835.0 0	0.16
113	300672	国科微	1,253,175	83,649,431.2 5	0.16
114	000860	顺鑫农业	4,286,699	83,462,029.5 3	0.15
115	000970	中科三环	8,013,600	83,101,032.0 0	0.15
116	002036	联创电子	8,820,735	82,914,909.0 0	0.15
117	600728	佳都科技	17,714,700	82,904,796.0 0	0.15
118	688327	云从科技	6,850,078	82,885,943.8 0	0.15
119	000917	电广传媒	11,723,300	82,883,731.0 0	0.15
120	600285	羚锐制药	3,739,405	82,865,214.8 0	0.15
121	000951	中国重汽	4,854,340	82,426,693.2 0	0.15
122	600133	东湖高新	8,781,339	82,105,519.6 5	0.15
123	300777	中简科技	2,901,514	82,083,831.0 6	0.15
124	002249	大洋电机	13,981,400	82,070,818.0 0	0.15
125	600562	国睿科技	4,102,133	81,755,510.6 9	0.15
126	002428	云南锗业	4,325,200	81,746,280.0 0	0.15
127	300438	鹏辉能源	2,907,600	81,732,636.0 0	0.15
128	300773	拉卡拉	4,608,300	81,566,910.0 0	0.15
129	688183	生益电子	2,063,627	81,017,996.0 2	0.15
130	600850	电科数字	3,379,240	80,763,836.0 0	0.15

131	600338	西藏珠峰	7,567,700	80,747,359.0 0	0.15
132	000690	宝新能源	17,997,327	80,628,024.9 6	0.15
133	600452	涪陵电力	7,605,350	80,540,656.5 0	0.15
134	300101	振芯科技	3,718,200	80,536,212.0 0	0.15
135	300624	万兴科技	1,274,593	80,490,547.9 5	0.15
136	002747	埃斯顿	4,324,400	80,001,400.0 0	0.15
137	300133	华策影视	11,014,900	79,527,578.0 0	0.15
138	300303	聚飞光电	11,652,100	79,467,322.0 0	0.15
139	300775	三角防务	3,182,320	79,335,237.6 0	0.15
140	000422	湖北宜化	6,276,200	79,205,644.0 0	0.15
141	688318	财富趋势	462,758	79,131,618.0 0	0.15
142	600641	万业企业	5,395,480	78,881,917.6 0	0.15
143	600120	浙江东方	16,919,951	78,846,971.6 6	0.15
144	600718	东软集团	7,298,200	78,601,614.0 0	0.15
145	601137	博威合金	3,866,600	78,491,980.0 0	0.15
146	000829	天音控股	5,932,714	78,193,170.5 2	0.15
147	688676	金盘科技	1,883,945	78,033,001.9 0	0.14
148	300525	博思软件	5,002,532	77,939,448.5 6	0.14
149	300827	上能电气	1,774,647	77,907,003.3 0	0.14
150	600064	南京高科	10,026,500	77,905,905.0 0	0.14
151	603871	嘉友国际	4,019,875	77,784,581.2 5	0.14
152	600877	电科芯片	5,861,763	77,316,653.9 7	0.14

153	603766	隆鑫通用	8,481,200	77,178,920.0 0	0.14
154	002335	科华数据	2,658,790	76,892,206.8 0	0.14
155	688088	虹软科技	1,985,374	76,556,021.4 4	0.14
156	600206	有研新材	4,884,104	76,533,909.6 8	0.14
157	688408	中信博	1,063,519	76,439,368.0 0	0.14
158	300348	长亮科技	5,344,850	76,431,355.0 0	0.14
159	000627	天茂集团	16,356,800	76,386,256.0 0	0.14
160	688322	奥比中光	1,642,216	76,363,044.0 0	0.14
161	300638	广和通	3,787,593	76,319,998.9 5	0.14
162	600771	广誉远	4,046,492	76,316,839.1 2	0.14
163	688484	南芯科技	2,166,465	75,999,398.6 0	0.14
164	300294	博雅生物	2,494,750	75,541,030.0 0	0.14
165	600864	哈投股份	10,274,200	75,515,370.0 0	0.14
166	605090	九丰能源	2,642,180	75,381,395.4 0	0.14
167	000810	创维数字	4,733,400	75,355,728.0 0	0.14
168	603300	海南华铁	13,019,100	75,250,398.0 0	0.14
169	600399	抚顺特钢	12,967,221	75,209,881.8 0	0.14
170	002270	华明装备	4,446,900	75,108,141.0 0	0.14
171	603662	柯力传感	1,160,784	74,986,646.4 0	0.14
172	002745	木林森	8,573,345	74,759,568.4 0	0.14
173	300811	铂科新材	1,384,873	74,658,503.4 3	0.14
174	000620	新华联	33,876,096	74,188,650.2 4	0.14

175	000543	皖能电力	9,377,500	74,176,025.0 0	0.14
176	002221	东华能源	7,803,040	74,050,849.6 0	0.14
177	000762	西藏矿业	3,439,000	73,938,500.0 0	0.14
178	002396	星网锐捷	3,893,200	73,931,868.0 0	0.14
179	001301	尚太科技	1,078,492	73,930,626.6 0	0.14
180	002354	天娱数科	13,711,300	73,629,681.0 0	0.14
181	688166	博瑞医药	2,438,039	73,628,777.8 0	0.14
182	600986	浙文互联	12,301,940	73,565,601.2 0	0.14
183	300180	华峰超纤	11,661,011	73,464,369.3 0	0.14
184	300783	三只松鼠	2,041,180	73,325,306.6 0	0.14
185	600246	万通发展	9,819,127	73,152,496.1 5	0.14
186	300456	赛微电子	4,364,839	72,935,934.0 2	0.14
187	300657	弘信电子	3,218,327	72,927,289.8 2	0.14
188	002063	远光软件	12,631,228	72,755,873.2 8	0.14
189	301050	雷电微力	1,409,132	72,683,028.5 6	0.13
190	603063	禾望电气	3,638,100	72,616,476.0 0	0.13
191	000801	四川九洲	5,067,898	72,521,620.3 8	0.13
192	600621	华鑫股份	4,394,311	72,418,245.2 8	0.13
193	002544	普天科技	3,376,400	72,356,252.0 0	0.13
194	600330	天通股份	10,181,140	72,286,094.0 0	0.13
195	300409	道氏技术	5,305,100	72,202,411.0 0	0.13
196	600827	百联股份	6,601,700	72,156,581.0 0	0.13

197	300298	三诺生物	2,789,080	71,986,154.8 0	0.13
198	000680	山推股份	7,416,050	71,935,685.0 0	0.13
199	300319	麦捷科技	5,743,700	71,681,376.0 0	0.13
200	002123	梦网科技	6,625,300	71,619,493.0 0	0.13
201	600821	金开新能	13,235,100	71,469,540.0 0	0.13
202	002127	南极电商	16,239,200	71,452,480.0 0	0.13
203	688200	华峰测控	682,919	71,365,035.5 0	0.13
204	600552	凯盛科技	6,248,700	71,297,667.0 0	0.13
205	000682	东方电子	6,656,000	71,285,760.0 0	0.13
206	300776	帝尔激光	1,120,353	71,232,043.7 4	0.13
207	600635	大众公用	15,980,718	71,114,195.1 0	0.13
208	300075	数字政通	4,110,600	71,113,380.0 0	0.13
209	000503	国新健康	6,461,800	70,950,564.0 0	0.13
210	600750	江中药业	3,124,323	70,922,132.1 0	0.13
211	301078	孩子王	6,215,357	70,730,762.6 6	0.13
212	000676	智度股份	8,360,339	70,728,467.9 4	0.13
213	300166	东方国信	7,524,100	70,726,540.0 0	0.13
214	002839	张家港行	16,180,860	70,710,358.2 0	0.13
215	002174	游族网络	7,544,089	70,537,232.1 5	0.13
216	688333	铂力特	1,788,110	70,505,177.3 0	0.13
217	000035	中国天楹	14,474,700	70,491,789.0 0	0.13
218	300130	新国都	3,243,511	70,254,448.2 6	0.13

219	601126	四方股份	4,133,500	70,104,160.0 0	0.13
220	603920	世运电路	2,377,469	69,897,588.6 0	0.13
221	300379	东方通	4,613,067	69,611,181.0 3	0.13
222	600422	昆药集团	4,388,192	69,552,843.2 0	0.13
223	600179	安通控股	24,509,936	69,363,118.8 8	0.13
224	300049	福瑞股份	2,198,300	69,334,382.0 0	0.13
225	600572	康恩贝	14,860,600	69,250,396.0 0	0.13
226	603678	火炬电子	2,270,459	69,248,999.5 0	0.13
227	300036	超图软件	4,075,200	69,196,896.0 0	0.13
228	300598	诚迈科技	1,426,176	69,026,918.4 0	0.13
229	300327	中颖电子	2,814,710	68,875,953.7 0	0.13
230	601860	紫金银行	24,161,700	68,860,845.0 0	0.13
231	600596	新安股份	7,823,720	68,692,261.6 0	0.13
232	603283	赛腾股份	991,500	68,572,140.0 0	0.13
233	688016	心脉医疗	623,432	68,484,005.2 0	0.13
234	002317	众生药业	5,627,073	68,368,936.9 5	0.13
235	603306	华懋科技	2,156,800	68,176,448.0 0	0.13
236	603565	中谷物流	6,938,835	68,000,583.0 0	0.13
237	688596	正帆科技	1,910,055	67,902,455.2 5	0.13
238	601020	华钰矿业	5,377,260	67,861,021.2 0	0.13
239	000902	新洋丰	5,195,000	67,742,800.0 0	0.13
240	000969	安泰科技	6,075,100	67,737,365.0 0	0.13

241	688141	杰华特	2,212,608	67,727,930.8 8	0.13
242	002948	青岛银行	17,435,300	67,648,964.0 0	0.13
243	002183	怡亚通	15,055,800	67,600,542.0 0	0.13
244	300113	顺网科技	4,017,800	67,539,218.0 0	0.13
245	300236	上海新阳	1,807,125	67,532,261.2 5	0.13
246	000685	中山公用	7,312,500	67,494,375.0 0	0.13
247	688498	源杰科技	502,862	67,484,080.4 0	0.13
248	002654	万润科技	5,555,908	67,393,164.0 4	0.13
249	600185	格力地产	9,349,328	67,221,668.3 2	0.12
250	600456	宝钛股份	2,362,400	67,210,280.0 0	0.12
251	603881	数据港	2,955,351	66,938,700.1 5	0.12
252	600587	新华医疗	4,015,272	66,854,278.8 0	0.12
253	002675	东诚药业	5,448,835	66,584,763.7 0	0.12
254	601778	晶科科技	23,593,700	66,534,234.0 0	0.12
255	002239	奥特佳	21,794,980	66,474,689.0 0	0.12
256	600210	紫江企业	10,047,800	66,415,958.0 0	0.12
257	300576	容大感光	1,468,185	66,332,598.3 0	0.12
258	002906	华阳集团	2,156,379	66,308,654.2 5	0.12
259	300663	科蓝软件	3,814,809	66,225,084.2 4	0.12
260	300185	通裕重工	25,744,400	66,163,108.0 0	0.12
261	600151	航天机电	8,290,900	66,161,382.0 0	0.12
262	600420	国药现代	5,535,200	66,090,288.0 0	0.12

263	300026	红日药业	17,408,696	65,978,957.84	0.12
264	301171	易点天下	2,335,900	65,849,021.00	0.12
265	600633	浙数文化	6,294,800	65,843,608.00	0.12
266	600114	东睦股份	4,059,710	65,645,510.70	0.12
267	600595	中孚实业	23,186,536	65,617,896.88	0.12
268	002315	焦点科技	1,570,800	65,470,944.00	0.12
269	688582	芯动联科	1,300,900	65,448,279.00	0.12
270	002215	诺普信	5,823,000	65,392,290.00	0.12
271	688289	圣湘生物	2,879,860	65,372,822.00	0.12
272	002332	仙琚制药	6,557,100	65,177,574.00	0.12
273	002681	奋达科技	10,443,600	65,168,064.00	0.12
274	600993	马应龙	2,491,748	65,059,540.28	0.12
275	600269	赣粤高速	11,596,800	65,058,048.00	0.12
276	600428	中远海特	8,875,400	64,790,420.00	0.12
277	002182	宝武镁业	5,737,880	64,723,286.40	0.12
278	300475	香农芯创	2,270,700	64,692,243.00	0.12
279	600320	振华重工	16,475,300	64,583,176.00	0.12
280	300087	荃银高科	5,472,590	64,576,562.00	0.12
281	002597	金禾实业	2,826,918	64,538,537.94	0.12
282	688409	富创精密	1,248,172	64,368,230.04	0.12
283	600273	嘉化能源	8,062,400	64,257,328.00	0.12
284	603323	苏农银行	12,130,990	64,172,937.10	0.12

285	300079	数码视讯	11,837,600	64,041,416.0 0	0.12
286	688029	南微医学	947,339	64,030,643.0 1	0.12
287	601678	滨化股份	17,003,300	63,932,408.0 0	0.12
288	300109	新开源	4,004,887	63,877,947.6 5	0.12
289	002020	京新药业	4,984,400	63,800,320.0 0	0.12
290	603393	新天然气	2,106,269	63,756,762.6 3	0.12
291	600201	生物股份	9,278,097	63,647,745.4 2	0.12
292	000429	粤高速 A	4,329,100	63,637,770.0 0	0.12
293	300284	苏交科	6,268,456	63,624,828.4 0	0.12
294	002292	奥飞娱乐	7,351,400	63,589,610.0 0	0.12
295	688110	东芯股份	2,549,965	63,494,128.5 0	0.12
296	600123	兰花科创	7,376,434	63,142,275.0 4	0.12
297	002171	楚江新材	7,685,896	63,024,347.2 0	0.12
298	603108	润达医疗	3,945,551	62,852,627.4 3	0.12
299	002212	天融信	9,734,045	62,784,590.2 5	0.12
300	600461	洪城环境	6,295,267	62,637,906.6 5	0.12
301	000727	冠捷科技	22,515,500	62,593,090.0 0	0.12
302	002015	协鑫能科	8,050,900	62,474,984.0 0	0.12
303	300678	中科信息	1,705,750	62,038,127.5 0	0.12
304	600759	洲际油气	27,305,200	61,982,804.0 0	0.12
305	300457	赢合科技	3,220,904	61,648,102.5 6	0.11
306	601718	际华集团	21,689,800	61,599,032.0 0	0.11

307	601519	大智慧	6,641,900	61,437,575.0 0	0.11
308	601187	厦门银行	10,891,490	61,428,003.6 0	0.11
309	688503	聚和材料	1,406,807	61,374,182.0 3	0.11
310	002541	鸿路钢构	3,420,500	61,329,565.0 0	0.11
311	688279	峰岬科技	388,190	61,217,563.0 0	0.11
312	002567	唐人神	11,884,050	60,608,655.0 0	0.11
313	002832	比音勒芬	2,823,233	60,445,418.5 3	0.11
314	002351	漫步者	3,658,481	60,364,936.5 0	0.11
315	002421	达实智能	17,580,500	60,301,115.0 0	0.11
316	300618	寒锐钴业	1,785,224	60,287,014.4 8	0.11
317	002488	金固股份	5,773,200	60,272,208.0 0	0.11
318	600037	歌华有线	8,053,400	60,078,364.0 0	0.11
319	300027	华谊兄弟	22,913,600	60,033,632.0 0	0.11
320	600550	保变电气	7,632,600	59,915,910.0 0	0.11
321	600916	中国黄金	6,946,600	59,879,692.0 0	0.11
322	300034	钢研高纳	3,837,880	59,870,928.0 0	0.11
323	300685	艾德生物	2,625,444	59,860,123.2 0	0.11
324	603997	继峰股份	5,227,715	59,857,336.7 5	0.11
325	000012	南玻 A	11,323,549	59,788,338.7 2	0.11
326	002773	康弘药业	3,048,685	59,754,226.0 0	0.11
327	600057	厦门象屿	9,205,466	59,743,474.3 4	0.11
328	600645	中源协和	3,089,100	59,619,630.0 0	0.11

329	002265	建设工业	2,559,400	59,557,238.0 0	0.11
330	600967	内蒙一机	7,002,100	59,517,850.0 0	0.11
331	301297	富乐德	1,399,189	59,465,532.5 0	0.11
332	002004	华邦健康	13,116,634	59,287,185.6 8	0.11
333	603505	金石资源	2,495,051	59,232,510.7 4	0.11
334	002091	江苏国泰	8,080,630	59,150,211.6 0	0.11
335	002100	天康生物	9,028,000	59,133,400.0 0	0.11
336	300188	国投智能	4,277,780	58,990,586.2 0	0.11
337	000420	吉林化纤	16,234,900	58,607,989.0 0	0.11
338	002649	博彦科技	4,835,154	58,602,066.4 8	0.11
339	002668	TCL 智家	4,459,000	58,502,080.0 0	0.11
340	600717	天津港	11,975,487	58,320,621.6 9	0.11
341	000089	深圳机场	8,449,700	58,218,433.0 0	0.11
342	601963	重庆银行	6,273,300	58,216,224.0 0	0.11
343	000062	深圳华强	2,586,415	57,935,696.0 0	0.11
344	600267	海正药业	6,976,922	57,908,452.6 0	0.11
345	688702	盛科通信	689,235	57,895,740.0 0	0.11
346	603398	沐邦高科	2,502,600	57,584,826.0 0	0.11
347	600328	中盐化工	7,310,210	57,531,352.7 0	0.11
348	300655	晶瑞电材	6,143,525	57,503,394.0 0	0.11
349	603220	中贝通信	2,501,160	57,451,645.2 0	0.11
350	300910	瑞丰新材	1,203,640	57,281,227.6 0	0.11

351	002011	盾安环境	5,289,200	57,176,252.0 0	0.11
352	002706	良信股份	7,442,140	57,155,635.2 0	0.11
353	000758	中色股份	11,528,900	56,952,766.0 0	0.11
354	688362	甬矽电子	1,676,804	56,474,758.7 2	0.10
355	002847	盐津铺子	902,143	56,474,151.8 0	0.10
356	002276	万马股份	6,649,300	56,253,078.0 0	0.10
357	688063	派能科技	1,403,692	56,217,864.6 0	0.10
358	603690	至纯科技	2,235,500	56,133,405.0 0	0.10
359	600252	中恒集团	22,742,300	55,946,058.0 0	0.10
360	600248	陕建股份	12,487,100	55,942,208.0 0	0.10
361	000712	锦龙股份	3,698,663	55,923,784.5 6	0.10
362	300613	富瀚微	961,950	55,685,075.0 0	0.10
363	603699	纽威股份	2,505,200	55,540,284.0 0	0.10
364	603308	应流股份	3,936,080	55,498,728.0 0	0.10
365	300693	盛弘股份	2,057,287	55,464,457.5 2	0.10
366	300323	华灿光电	6,692,500	55,413,900.0 0	0.10
367	002643	万润股份	4,616,350	55,396,200.0 0	0.10
368	600116	三峡水利	7,920,600	55,364,994.0 0	0.10
369	300398	飞凯材料	3,504,560	55,231,865.6 0	0.10
370	600409	三友化工	10,213,300	55,151,820.0 0	0.10
371	688076	诺泰生物	1,060,826	55,078,085.9 2	0.10
372	002716	湖南白银	16,245,425	55,071,990.7 5	0.10

373	002895	川恒股份	2,238,568	55,068,772.8 0	0.10
374	002079	苏州固锔	5,358,600	55,032,822.0 0	0.10
375	688548	广钢气体	5,589,776	54,936,044.3 2	0.10
376	000156	华数传媒	7,614,896	54,827,251.2 0	0.10
377	002539	云图控股	6,991,000	54,669,620.0 0	0.10
378	000795	英洛华	5,616,600	54,649,518.0 0	0.10
379	688798	艾为电子	782,270	54,618,091.4 0	0.10
380	002192	融捷股份	1,709,611	54,536,590.9 0	0.10
381	603599	广信股份	4,511,373	54,362,044.6 5	0.10
382	000811	冰轮环境	4,433,200	54,351,032.0 0	0.10
383	300682	朗新集团	4,454,195	54,341,179.0 0	0.10
384	301039	中集车辆	6,002,364	54,321,394.2 0	0.10
385	300415	伊之密	2,702,242	54,206,974.5 2	0.10
386	688123	聚辰股份	926,049	54,192,387.4 8	0.10
387	600556	天下秀	10,419,400	54,180,880.0 0	0.10
388	300641	正丹股份	2,178,104	54,104,103.3 6	0.10
389	000555	神州信息	4,830,600	54,102,720.0 0	0.10
390	688766	普冉股份	532,570	53,928,038.2 0	0.10
391	688262	国芯科技	1,943,558	53,836,556.6 0	0.10
392	300482	万孚生物	2,391,800	53,600,238.0 0	0.10
393	300747	锐科激光	2,794,042	53,533,844.7 2	0.10
394	000650	仁和药业	9,281,500	53,461,440.0 0	0.10

395	300761	立华股份	2,737,388	53,269,570.48	0.10
396	688139	海尔生物	1,556,138	53,233,757.60	0.10
397	000657	中钨高新	5,766,908	53,113,222.68	0.10
398	600729	重庆百货	1,813,500	53,044,875.00	0.10
399	603588	高能环境	10,086,718	52,854,402.32	0.10
400	002324	普利特	5,546,040	52,853,761.20	0.10
401	688332	中科蓝讯	404,531	52,791,295.50	0.10
402	603039	泛微网络	1,077,000	52,773,000.00	0.10
403	002061	浙江交科	12,933,580	52,769,006.40	0.10
404	600055	万东医疗	3,492,940	52,743,394.00	0.10
405	002458	益生股份	5,481,500	52,677,215.00	0.10
406	000927	中国铁物	20,018,200	52,647,866.00	0.10
407	600933	爱柯迪	3,229,282	52,637,296.60	0.10
408	300633	开立医疗	1,788,299	52,558,107.61	0.10
409	001309	德明利	602,728	52,557,881.60	0.10
410	600158	中体产业	6,353,800	52,545,926.00	0.10
411	600266	城建发展	10,297,700	52,518,270.00	0.10
412	000923	河钢资源	3,770,100	52,404,390.00	0.10
413	688083	中望软件	611,802	52,351,897.14	0.10
414	300357	我武生物	2,575,223	52,328,531.36	0.10
415	600894	广日股份	3,583,276	52,315,829.60	0.10
416	002010	传化智联	11,548,600	52,315,158.00	0.10

417	600782	新钢股份	15,619,700	52,169,798.0 0	0.10
418	600459	贵研铂业	3,782,345	51,931,596.8 5	0.10
419	301029	怡合达	2,087,926	51,613,530.7 2	0.10
420	300470	中密控股	1,368,700	51,599,990.0 0	0.10
421	600509	天富能源	7,968,900	51,558,783.0 0	0.10
422	603027	千禾味业	4,256,541	51,546,711.5 1	0.10
423	603619	中曼石油	2,661,550	51,527,608.0 0	0.10
424	600575	淮河能源	12,959,600	51,449,612.0 0	0.10
425	000821	京山轻机	4,131,987	51,443,238.1 5	0.10
426	002468	申通快递	5,064,000	51,298,320.0 0	0.10
427	301293	三博脑科	1,182,827	51,192,752.5 6	0.10
428	600664	哈药股份	12,386,969	51,158,181.9 7	0.09
429	603218	日月股份	4,241,012	51,104,194.6 0	0.09
430	002048	宁波华翔	4,048,285	51,089,356.7 0	0.09
431	603279	景津装备	2,850,456	50,966,153.2 8	0.09
432	600012	皖通高速	2,884,400	50,909,660.0 0	0.09
433	000735	罗牛山	7,632,400	50,831,784.0 0	0.09
434	300352	北信源	9,624,400	50,816,832.0 0	0.09
435	000901	航天科技	4,619,983	50,681,213.5 1	0.09
436	688629	华丰科技	1,510,149	50,574,890.0 1	0.09
437	600480	凌云股份	4,666,326	50,442,984.0 6	0.09
438	603496	恒为科技	1,849,000	50,255,820.0 0	0.09

439	300620	光库科技	1,033,000	50,203,800.0 0	0.09
440	300031	宝通科技	2,740,000	50,196,800.0 0	0.09
441	688789	宏华数科	758,067	50,066,987.4 6	0.09
442	300224	正海磁材	4,067,100	50,066,001.0 0	0.09
443	300593	新雷能	4,452,200	49,864,640.0 0	0.09
444	002006	精工科技	3,016,622	49,774,263.0 0	0.09
445	002446	盛路通信	7,594,710	49,745,350.5 0	0.09
446	002023	海特高新	4,893,700	49,671,055.0 0	0.09
447	300232	洲明科技	7,213,175	49,554,512.2 5	0.09
448	601369	陕鼓动力	5,690,200	49,504,740.0 0	0.09
449	002726	龙大美食	6,246,171	49,469,674.3 2	0.09
450	002737	葵花药业	2,406,800	49,315,332.0 0	0.09
451	300123	亚光科技	8,455,560	49,042,248.0 0	0.09
452	002043	兔宝宝	4,121,200	48,959,856.0 0	0.09
453	600211	西藏药业	1,324,842	48,939,663.4 8	0.09
454	600017	日照港	15,275,300	48,880,960.0 0	0.09
455	600006	东风股份	6,617,400	48,770,238.0 0	0.09
456	600063	皖维高新	12,191,600	48,766,400.0 0	0.09
457	600597	光明乳业	5,697,558	48,657,145.3 2	0.09
458	300634	彩讯股份	2,231,800	48,653,240.0 0	0.09
459	600888	新疆众和	6,839,505	48,560,485.5 0	0.09
460	603358	华达科技	1,450,578	48,449,305.2 0	0.09

461	002099	海翔药业	9,385,700	48,430,212.0 0	0.09
462	000552	甘肃能化	17,609,900	48,427,225.0 0	0.09
463	600138	中青旅	4,772,300	48,391,122.0 0	0.09
464	603267	鸿远电子	1,332,400	48,272,852.0 0	0.09
465	603337	杰克股份	1,584,276	48,257,046.9 6	0.09
466	601311	骆驼股份	5,816,200	48,216,298.0 0	0.09
467	600757	长江传媒	5,024,900	48,088,293.0 0	0.09
468	002237	恒邦股份	4,750,800	47,983,080.0 0	0.09
469	600835	上海机电	2,671,600	47,875,072.0 0	0.09
470	600094	大名城	13,120,757	47,759,555.4 8	0.09
471	002326	永太科技	5,335,000	47,694,900.0 0	0.09
472	605507	国邦医药	2,310,200	47,663,386.0 0	0.09
473	002226	江南化工	8,746,200	47,404,404.0 0	0.09
474	600502	安徽建工	9,913,900	47,388,442.0 0	0.09
475	002761	浙江建投	5,388,300	47,309,274.0 0	0.09
476	688352	硕中科技	3,892,737	47,218,899.8 1	0.09
477	002254	泰和新材	5,014,305	47,134,467.0 0	0.09
478	002081	金螳螂	13,177,500	47,043,675.0 0	0.09
479	300244	迪安诊断	4,140,015	46,989,170.2 5	0.09
480	000848	承德露露	5,236,700	46,973,199.0 0	0.09
481	600366	宁波韵升	6,379,600	46,953,856.0 0	0.09
482	600059	古越龙山	5,272,700	46,821,576.0 0	0.09

483	600315	上海家化	2,766,152	46,775,630.3 2	0.09
484	300463	迈克生物	3,540,900	46,739,880.0 0	0.09
485	301071	力量钻石	1,289,340	46,738,575.0 0	0.09
486	000913	钱江摩托	2,593,900	46,716,139.0 0	0.09
487	600971	恒源煤电	4,953,070	46,608,388.7 0	0.09
488	002097	山河智能	6,212,957	46,597,177.5 0	0.09
489	000028	国药一致	1,593,040	46,596,420.0 0	0.09
490	600649	城投控股	10,450,310	46,503,879.5 0	0.09
491	600586	金晶科技	8,257,600	46,407,712.0 0	0.09
492	603197	保隆科技	1,228,719	46,384,142.2 5	0.09
493	002993	奥海科技	1,130,949	46,368,909.0 0	0.09
494	600507	方大特钢	11,445,500	46,354,275.0 0	0.09
495	300772	运达股份	3,487,868	46,179,372.3 2	0.09
496	600259	广晟有色	1,659,070	46,138,736.7 0	0.09
497	300770	新媒股份	1,139,636	46,052,690.7 6	0.09
498	300602	飞荣达	2,395,612	46,043,662.6 4	0.09
499	600787	中储股份	7,214,402	46,027,884.7 6	0.09
500	600110	诺德股份	11,479,900	45,919,600.0 0	0.09
501	300446	航天智造	2,780,700	45,909,357.0 0	0.09
502	000737	北方铜业	5,872,200	45,803,160.0 0	0.09
503	603100	川仪股份	2,124,460	45,782,113.0 0	0.08
504	300451	创业慧康	10,216,725	45,770,928.0 0	0.08

505	002163	海南发展	4,892,344	45,743,416.4 0	0.08
506	002815	崇达技术	4,465,200	45,545,040.0 0	0.08
507	600478	科力远	11,022,800	45,524,164.0 0	0.08
508	300260	新莱应材	1,677,625	45,446,861.2 5	0.08
509	002605	姚记科技	1,703,800	45,423,308.0 0	0.08
510	000928	中钢国际	7,126,100	45,393,257.0 0	0.08
511	601200	上海环境	5,555,352	45,387,225.8 4	0.08
512	002233	塔牌集团	5,910,107	45,330,520.6 9	0.08
513	600395	盘江股份	8,893,100	45,265,879.0 0	0.08
514	601702	华峰铝业	2,469,200	45,235,744.0 0	0.08
515	301291	明阳电气	1,031,646	45,207,892.3 2	0.08
516	301035	润丰股份	926,428	45,135,572.1 6	0.08
517	603281	江瀚新材	1,845,140	45,021,416.0 0	0.08
518	600125	铁龙物流	7,584,000	44,973,120.0 0	0.08
519	000837	秦川机床	5,003,400	44,880,498.0 0	0.08
520	688127	蓝特光学	1,655,427	44,862,071.7 0	0.08
521	000049	德赛电池	1,904,848	44,782,976.4 8	0.08
522	300393	中来股份	7,156,423	44,727,643.7 5	0.08
523	000582	北部湾港	5,669,500	44,675,660.0 0	0.08
524	601952	苏垦农发	4,559,170	44,634,274.3 0	0.08
525	688575	亚辉龙	2,822,787	44,600,034.6 0	0.08
526	300151	昌红科技	2,622,600	44,584,200.0 0	0.08

527	601900	南方传媒	2,947,900	44,542,769.0 0	0.08
528	002038	双鹭药业	5,955,700	44,489,079.0 0	0.08
529	000090	天健集团	10,819,900	44,469,789.0 0	0.08
530	601028	玉龙股份	3,874,900	44,406,354.0 0	0.08
531	688739	成大生物	1,719,391	44,325,899.9 8	0.08
532	600776	东方通信	3,953,300	44,237,427.0 0	0.08
533	002219	新里程	16,751,900	44,225,016.0 0	0.08
534	300725	药石科技	1,315,811	44,211,249.6 0	0.08
535	002214	大立科技	3,959,460	44,147,979.0 0	0.08
536	600033	福建高速	11,372,000	44,123,360.0 0	0.08
537	301219	腾远钴业	975,539	44,104,118.1 9	0.08
538	002390	信邦制药	9,682,500	44,055,375.0 0	0.08
539	600866	星湖科技	6,806,600	44,038,702.0 0	0.08
540	600305	恒顺醋业	5,516,741	44,023,593.1 8	0.08
541	688321	微芯生物	2,362,361	43,892,667.3 8	0.08
542	600623	华谊集团	6,247,600	43,733,200.0 0	0.08
543	603866	桃李面包	6,618,914	43,684,832.4 0	0.08
544	600458	时代新材	3,409,210	43,671,980.1 0	0.08
545	002891	中宠股份	1,220,183	43,560,533.1 0	0.08
546	600869	远东股份	9,170,000	43,557,500.0 0	0.08
547	300705	九典制药	2,485,432	43,496,004.4 0	0.08
548	000915	华特达因	1,542,401	43,464,860.1 8	0.08

549	601890	亚星锚链	5,569,901	43,389,528.7 9	0.08
550	688403	汇成股份	4,835,892	43,329,592.3 2	0.08
551	002635	安洁科技	2,719,390	43,292,688.8 0	0.08
552	603033	三维股份	3,404,840	43,207,419.6 0	0.08
553	688100	威胜信息	1,193,248	43,195,577.6 0	0.08
554	300687	赛意信息	2,369,100	43,117,620.0 0	0.08
555	003021	兆威机电	583,060	43,093,964.6 0	0.08
556	002518	科士达	1,911,700	43,070,601.0 0	0.08
557	600996	贵广网络	5,020,600	42,926,130.0 0	0.08
558	301095	广立微	823,781	42,894,276.6 7	0.08
559	600740	山西焦化	10,582,176	42,646,169.2 8	0.08
560	300363	博腾股份	2,695,880	42,514,027.6 0	0.08
561	300119	瑞普生物	2,313,269	42,494,751.5 3	0.08
562	688270	臻镭科技	1,257,574	42,464,690.0 0	0.08
563	000930	中粮科技	7,648,300	42,448,065.0 0	0.08
564	600976	健民集团	1,018,300	42,442,744.0 0	0.08
565	688326	经纬恒润	504,053	42,390,857.3 0	0.08
566	600773	西藏城投	3,926,900	42,331,982.0 0	0.08
567	002077	大港股份	2,884,630	42,317,522.1 0	0.08
568	600675	中华企业	15,055,479	42,305,895.9 9	0.08
569	600313	农发种业	6,263,800	42,280,650.0 0	0.08
570	301316	慧博云通	1,652,096	42,244,094.7 2	0.08

571	300171	东富龙	3,179,900	42,229,072.0 0	0.08
572	300726	宏达电子	1,356,852	42,198,097.2 0	0.08
573	300841	康华生物	773,303	42,160,479.5 6	0.08
574	300226	上海钢联	1,839,928	42,079,153.3 6	0.08
575	688779	五矿新能	7,908,975	42,075,747.0 0	0.08
576	600490	鹏欣资源	12,746,800	41,936,972.0 0	0.08
577	603128	华贸物流	6,480,762	41,671,299.6 6	0.08
578	688400	凌云光	1,899,833	41,644,339.3 6	0.08
579	601500	通用股份	7,797,900	41,562,807.0 0	0.08
580	688192	迪哲医药	1,000,138	41,475,722.8 6	0.08
581	600169	太原重工	16,649,800	41,458,002.0 0	0.08
582	688388	嘉元科技	2,810,454	41,397,987.4 2	0.08
583	603368	柳药集团	2,311,668	41,286,390.4 8	0.08
584	688559	海目星	1,197,126	41,181,134.4 0	0.08
585	002928	华夏航空	5,298,025	41,112,674.0 0	0.08
586	600389	江山股份	2,840,155	41,040,239.7 5	0.08
587	000603	盛达资源	3,421,600	41,024,984.0 0	0.08
588	603026	石大胜华	1,171,158	40,990,530.0 0	0.08
589	000966	长源电力	8,624,200	40,964,950.0 0	0.08
590	603713	密尔克卫	797,500	40,832,000.0 0	0.08
591	688522	纳睿雷达	724,520	40,819,456.8 0	0.08
592	603328	依顿电子	4,135,700	40,778,002.0 0	0.08

593	688612	威迈斯	1,731,125	40,750,682.5 0	0.08
594	002777	久远银海	2,363,948	40,707,184.5 6	0.08
595	002705	新宝股份	2,707,300	40,609,500.0 0	0.08
596	688106	金宏气体	2,385,775	40,582,032.7 5	0.08
597	000065	北方国际	4,136,677	40,456,701.0 6	0.08
598	002243	力合科创	5,130,934	40,395,328.0 4	0.07
599	600531	豫光金铅	6,291,900	40,393,998.0 0	0.07
600	600197	伊力特	2,340,200	40,368,450.0 0	0.07
601	688556	高测股份	3,610,308	40,363,243.4 4	0.07
602	603305	旭升集团	3,069,296	40,361,242.4 0	0.07
603	300596	利安隆	1,322,938	40,349,609.0 0	0.07
604	000550	江铃汽车	1,716,530	40,252,628.5 0	0.07
605	300660	江苏雷利	1,053,100	40,249,482.0 0	0.07
606	600710	苏美达	4,324,000	40,213,200.0 0	0.07
607	002925	盈趣科技	2,567,219	40,202,649.5 4	0.07
608	688696	极米科技	410,006	40,188,788.1 2	0.07
609	601619	嘉泽新能	12,104,200	40,185,944.0 0	0.07
610	688062	迈威生物	1,988,348	40,164,629.6 0	0.07
611	300820	英杰电气	725,964	40,109,511.0 0	0.07
612	688300	联瑞新材	621,764	40,041,601.6 0	0.07
613	002697	红旗连锁	6,773,000	40,028,430.0 0	0.07
614	601163	三角轮胎	2,637,367	39,745,120.6 9	0.07

615	601326	秦港股份	11,829,700	39,629,495.0 0	0.07
616	000048	京基智农	2,195,800	39,524,400.0 0	0.07
617	688091	上海谊众	989,656	39,507,067.5 2	0.07
618	002550	千红制药	6,364,200	39,458,040.0 0	0.07
619	002967	广电计量	2,405,231	39,445,788.4 0	0.07
620	000061	农产品	5,623,750	39,422,487.5 0	0.07
621	002108	沧州明珠	10,977,489	39,409,185.5 1	0.07
622	688366	昊海生科	649,474	39,345,134.9 2	0.07
623	688639	华恒生物	1,219,686	39,286,086.0 6	0.07
624	600751	海航科技	14,934,100	39,276,683.0 0	0.07
625	601208	东材科技	5,206,500	39,257,010.0 0	0.07
626	600557	康缘药业	2,879,493	39,218,694.6 6	0.07
627	002929	润建股份	1,165,700	39,190,834.0 0	0.07
628	688007	光峰科技	2,648,552	39,172,084.0 8	0.07
629	688372	伟测科技	668,927	39,145,608.0 4	0.07
630	600775	南京熊猫	3,896,200	39,117,848.0 0	0.07
631	601101	昊华能源	4,752,240	39,110,935.2 0	0.07
632	000990	诚志股份	5,046,360	39,109,290.0 0	0.07
633	002537	海联金汇	6,798,540	39,091,605.0 0	0.07
634	002291	遥望科技	6,170,600	38,936,486.0 0	0.07
635	603583	捷昌驱动	1,574,120	38,896,505.2 0	0.07
636	603612	索通发展	2,876,404	38,860,218.0 4	0.07

637	002068	黑猫股份	3,638,300	38,711,512.0 0	0.07
638	002727	一心堂	2,970,082	38,670,467.6 4	0.07
639	300455	航天智装	2,981,500	38,640,240.0 0	0.07
640	002985	北摩高科	1,642,080	38,588,880.0 0	0.07
641	688167	炬光科技	605,055	38,542,003.5 0	0.07
642	000950	重药控股	7,163,700	38,540,706.0 0	0.07
643	300821	东岳硅材	4,955,800	38,457,008.0 0	0.07
644	600163	中闽能源	6,297,800	38,353,602.0 0	0.07
645	603888	新华网	1,715,473	38,323,666.8 2	0.07
646	300261	雅本化学	5,594,100	38,319,585.0 0	0.07
647	001287	中电港	1,886,486	38,314,530.6 6	0.07
648	000719	中原传媒	3,371,900	38,304,784.0 0	0.07
649	002194	武汉凡谷	3,403,152	38,183,365.4 4	0.07
650	688630	芯碁微装	661,366	38,174,045.5 2	0.07
651	603383	顶点软件	1,017,860	38,169,750.0 0	0.07
652	000756	新华制药	2,422,500	38,057,475.0 0	0.07
653	600682	南京新百	5,562,880	38,050,099.2 0	0.07
654	300129	泰胜风能	5,395,714	38,039,783.7 0	0.07
655	002626	金达威	2,513,900	37,959,890.0 0	0.07
656	301155	海力风电	711,886	37,950,642.6 6	0.07
657	600882	妙可蓝多	2,116,300	37,881,770.0 0	0.07
658	000059	华锦股份	7,907,900	37,878,841.0 0	0.07

659	600073	光明肉业	5,454,700	37,855,618.0 0	0.07
660	000557	西部创业	7,265,300	37,706,907.0 0	0.07
661	300580	贝斯特	1,640,814	37,656,681.3 0	0.07
662	688146	中船特气	1,295,306	37,615,686.2 4	0.07
663	605376	博迁新材	1,293,550	37,448,272.5 0	0.07
664	603477	巨星农牧	2,108,838	37,431,874.5 0	0.07
665	300366	创意信息	4,019,500	37,381,350.0 0	0.07
666	300134	大富科技	3,186,502	37,377,668.4 6	0.07
667	002154	报喜鸟	8,454,000	37,282,140.0 0	0.07
668	002498	汉缆股份	10,979,900	37,221,861.0 0	0.07
669	300039	上海凯宝	6,017,800	37,190,004.0 0	0.07
670	001914	招商积余	3,517,300	37,177,861.0 0	0.07
671	600963	岳阳林纸	7,300,450	37,086,286.0 0	0.07
672	688190	云路股份	402,728	37,050,976.0 0	0.07
673	002859	洁美科技	1,782,300	36,982,725.0 0	0.07
674	300183	东软载波	1,910,400	36,966,240.0 0	0.07
675	300443	金雷股份	1,855,003	36,951,659.7 6	0.07
676	600075	新疆天业	8,489,873	36,930,947.5 5	0.07
677	600812	华北制药	7,128,400	36,853,828.0 0	0.07
678	603008	喜临门	2,196,932	36,820,580.3 2	0.07
679	600648	外高桥	3,088,700	36,786,417.0 0	0.07
680	603533	掌阅科技	1,807,200	36,704,232.0 0	0.07

681	000828	东莞控股	3,429,800	36,664,562.0 0	0.07
682	601908	京运通	12,016,300	36,649,715.0 0	0.07
683	002274	华昌化工	4,713,700	36,625,449.0 0	0.07
684	300913	兆龙互连	635,500	36,547,605.0 0	0.07
685	688131	皓元医药	1,023,650	36,544,305.0 0	0.07
686	002511	中顺洁柔	5,348,257	36,421,630.1 7	0.07
687	601595	上海电影	1,473,700	36,400,390.0 0	0.07
688	002545	东方铁塔	5,175,200	36,381,656.0 0	0.07
689	002320	海峡股份	5,547,337	36,335,057.3 5	0.07
690	600861	北京人力	1,877,101	36,321,904.3 5	0.07
691	600217	中再资环	6,850,900	36,309,770.0 0	0.07
692	002987	京北方	2,550,914	36,299,506.2 2	0.07
693	603567	珍宝岛	3,122,100	36,216,360.0 0	0.07
694	002461	珠江啤酒	3,661,700	36,214,213.0 0	0.07
695	002960	青鸟消防	3,088,044	36,037,473.4 8	0.07
696	002349	精华制药	4,703,500	35,981,775.0 0	0.07
697	603733	仙鹤股份	1,743,200	35,962,216.0 0	0.07
698	601609	金田股份	6,082,500	35,886,750.0 0	0.07
699	601969	海南矿业	5,056,500	35,850,585.0 0	0.07
700	688631	莱斯信息	411,582	35,844,676.3 8	0.07
701	688700	东威科技	1,214,156	35,769,035.7 6	0.07
702	688502	茂莱光学	177,347	35,717,685.8 0	0.07

703	300855	图南股份	1,626,360	35,649,811.2 0	0.07
704	601801	皖新传媒	4,844,912	35,561,654.0 8	0.07
705	688598	金博股份	1,687,077	35,529,841.6 2	0.07
706	600997	开滦股份	5,247,300	35,471,748.0 0	0.07
707	600449	宁夏建材	2,360,200	35,450,204.0 0	0.07
708	002191	劲嘉股份	8,433,700	35,421,540.0 0	0.07
709	600301	华锡有色	2,079,399	35,370,576.9 9	0.07
710	601606	长城军工	3,003,600	35,322,336.0 0	0.07
711	601827	三峰环境	4,115,300	35,309,274.0 0	0.07
712	688006	杭可科技	1,974,386	35,262,533.9 6	0.07
713	605333	沪光股份	1,079,783	35,233,319.2 9	0.07
714	600477	杭萧钢构	13,700,082	35,209,210.7 4	0.07
715	603638	艾迪精密	2,081,380	35,154,508.2 0	0.07
716	688066	航天宏图	1,719,632	35,080,492.8 0	0.07
717	300579	数字认证	1,114,190	35,007,849.8 0	0.06
718	002588	史丹利	4,739,100	34,974,558.0 0	0.06
719	002216	三全食品	2,908,898	34,906,776.0 0	0.06
720	603118	共进股份	3,918,700	34,876,430.0 0	0.06
721	600961	株冶集团	4,426,200	34,834,194.0 0	0.06
722	603317	天味食品	2,610,324	34,821,722.1 6	0.06
723	688432	有研硅	3,075,607	34,754,359.1 0	0.06
724	301031	中熔电气	332,673	34,604,645.4 6	0.06

725	300416	苏试试验	2,941,650	34,593,804.0 0	0.06
726	000488	晨鸣纸业	11,337,534	34,579,478.7 0	0.06
727	600651	飞乐音响	8,296,700	34,348,338.0 0	0.06
728	688439	振华风光	669,279	34,327,319.9 1	0.06
729	301510	固高科技	1,323,076	34,290,283.6 0	0.06
730	603229	奥翔药业	3,421,416	34,179,945.8 4	0.06
731	002060	广东建工	9,329,700	34,146,702.0 0	0.06
732	300428	立中集团	2,092,918	34,114,563.4 0	0.06
733	300850	新强联	1,782,960	34,072,365.6 0	0.06
734	600966	博汇纸业	6,602,400	34,068,384.0 0	0.06
735	003006	百亚股份	1,419,900	34,063,401.0 0	0.06
736	000881	中广核技	4,642,800	34,031,724.0 0	0.06
737	600643	爱建集团	6,571,207	33,973,140.1 9	0.06
738	601949	中国出版	4,722,700	33,908,986.0 0	0.06
739	000600	建投能源	5,988,600	33,895,476.0 0	0.06
740	002434	万里扬	5,454,100	33,815,420.0 0	0.06
741	002051	中工国际	4,101,400	33,467,424.0 0	0.06
742	605368	蓝天燃气	2,912,700	33,292,161.0 0	0.06
743	000567	海德股份	4,867,592	33,245,653.3 6	0.06
744	688515	裕太微	335,644	33,228,756.0 0	0.06
745	000029	深深房 A	2,204,396	33,198,203.7 6	0.06
746	000688	国城矿业	2,781,900	33,076,791.0 0	0.06

747	603995	甬金股份	1,804,050	32,996,074.5 0	0.06
748	301175	中科环保	6,105,200	32,968,080.0 0	0.06
749	301205	联特科技	435,143	32,935,973.6 7	0.06
750	002399	海普瑞	3,077,100	32,894,199.0 0	0.06
751	002101	广东鸿图	2,741,700	32,845,566.0 0	0.06
752	002258	利尔化学	3,962,946	32,773,563.4 2	0.06
753	301363	美好医疗	1,009,500	32,727,990.0 0	0.06
754	603919	金徽酒	1,668,614	32,704,834.4 0	0.06
755	002158	汉钟精机	1,763,400	32,658,168.0 0	0.06
756	001270	铖昌科技	853,416	32,515,149.6 0	0.06
757	603876	鼎胜新材	3,749,720	32,513,022.0 0	0.06
758	002840	华统股份	2,567,500	32,376,175.0 0	0.06
759	000767	晋控电力	12,760,000	32,282,800.0 0	0.06
760	688707	振华新材	2,947,212	32,271,971.4 0	0.06
761	300406	九强生物	2,415,200	32,267,072.0 0	0.06
762	301511	德福科技	2,581,812	32,155,558.7 2	0.06
763	300527	中船应急	3,977,535	32,098,707.4 5	0.06
764	002204	大连重工	6,415,300	31,948,194.0 0	0.06
765	301487	盟固利	1,500,900	31,924,143.0 0	0.06
766	301325	曼恩斯特	586,069	31,759,079.1 1	0.06
767	600548	深高速	2,353,800	31,729,224.0 0	0.06
768	002041	登海种业	2,909,799	31,687,711.1 1	0.06

769	688389	普门科技	2,123,846	31,624,066.9 4	0.06
770	301015	百洋医药	1,305,828	31,614,095.8 8	0.06
771	300861	美畅股份	1,584,420	31,609,179.0 0	0.06
772	600223	福瑞达	4,180,800	31,606,848.0 0	0.06
773	002125	湘潭电化	3,134,600	31,596,768.0 0	0.06
774	000088	盐田港	6,454,620	31,433,999.4 0	0.06
775	600508	上海能源	2,374,843	31,419,172.8 9	0.06
776	603043	广州酒家	1,886,820	31,377,816.6 0	0.06
777	605168	三人行	871,167	31,292,318.6 4	0.06
778	600783	鲁信创投	2,465,502	31,237,910.3 4	0.06
779	600639	浦东金桥	2,809,200	31,182,120.0 0	0.06
780	600020	中原高速	7,372,000	31,109,840.0 0	0.06
781	600335	国机汽车	4,976,700	31,004,841.0 0	0.06
782	002267	陕天然气	3,667,800	30,992,910.0 0	0.06
783	000597	东北制药	5,875,358	30,963,136.6 6	0.06
784	000498	山东路桥	5,195,167	30,911,243.6 5	0.06
785	603171	税友股份	1,012,300	30,875,150.0 0	0.06
786	600640	国脉文化	2,585,600	30,872,064.0 0	0.06
787	688549	中巨芯	3,614,853	30,798,547.5 6	0.06
788	002516	旷达科技	6,074,572	30,798,080.0 4	0.06
789	000672	上峰水泥	4,024,500	30,787,425.0 0	0.06
790	688232	新点软件	1,061,997	30,787,293.0 3	0.06

791	002585	双星新材	5,731,251	30,604,880.34	0.06
792	600929	雪天盐业	5,472,800	30,592,952.00	0.06
793	001213	中铁特货	7,334,600	30,585,282.00	0.06
794	301087	可孚医疗	864,545	30,570,311.20	0.06
795	002327	富安娜	3,457,900	30,567,836.00	0.06
796	600874	创业环保	5,089,300	30,383,121.00	0.06
797	603636	南威软件	2,884,003	30,282,031.50	0.06
798	601515	东峰集团	7,600,480	30,249,910.40	0.06
799	601869	长飞光纤	1,011,400	30,230,746.00	0.06
800	002612	朗姿股份	1,836,900	30,051,684.00	0.06
801	300257	开山股份	3,292,034	30,023,350.08	0.06
802	688147	微导纳米	1,114,128	29,958,901.92	0.06
803	688443	智翔金泰	1,192,967	29,931,542.03	0.06
804	002941	新疆交建	2,665,300	29,771,401.00	0.06
805	688150	莱特光电	1,314,692	29,606,863.84	0.05
806	000718	苏宁环球	12,508,200	29,519,352.00	0.05
807	603169	兰石重装	5,413,900	29,505,755.00	0.05
808	600657	信达地产	7,078,500	29,446,560.00	0.05
809	002833	弘亚数控	1,749,060	29,436,679.80	0.05
810	605599	莱百股份	2,578,600	29,267,110.00	0.05
811	688690	纳微科技	1,709,846	29,233,289.60	0.05
812	002489	浙江永强	9,001,500	29,164,860.00	0.05

813	002581	未名医药	2,740,400	29,157,856.0 0	0.05
814	601096	宏盛华源	6,675,718	29,039,373.3 0	0.05
815	002755	奥赛康	2,283,697	29,025,788.8 7	0.05
816	300856	科思股份	1,129,768	28,944,656.1 6	0.05
817	600987	航民股份	4,168,200	28,927,308.0 0	0.05
818	603299	苏盐井神	2,587,300	28,822,522.0 0	0.05
819	601921	浙版传媒	3,650,500	28,765,940.0 0	0.05
820	688380	中微半导	961,143	28,738,175.7 0	0.05
821	002991	甘源食品	306,700	28,682,584.0 0	0.05
822	002190	成飞集成	1,482,200	28,665,748.0 0	0.05
823	301239	普瑞眼科	632,900	28,605,010.0 0	0.05
824	600662	外服控股	5,642,001	28,604,945.0 7	0.05
825	000791	甘肃能源	4,742,940	28,599,928.2 0	0.05
826	001337	四川黄金	1,385,800	28,573,104.0 0	0.05
827	688097	博众精工	1,086,325	28,516,031.2 5	0.05
828	600195	中牧股份	4,249,000	28,510,790.0 0	0.05
829	600475	华光环能	3,162,897	28,497,701.9 7	0.05
830	688107	安路科技	962,391	28,467,525.7 8	0.05
831	301238	瑞泰新材	1,816,788	28,450,900.0 8	0.05
832	688298	东方生物	968,517	28,406,603.6 1	0.05
833	601882	海天精工	1,291,400	28,320,402.0 0	0.05
834	688048	长光华芯	724,933	28,265,137.6 7	0.05

835	601107	四川成渝	5,392,000	28,200,160.0 0	0.05
836	301536	星宸科技	352,893	28,196,150.7 0	0.05
837	000813	德展健康	9,005,700	28,187,841.0 0	0.05
838	603025	大豪科技	1,841,220	28,078,605.0 0	0.05
839	603801	志邦家居	2,173,333	27,840,395.7 3	0.05
840	300737	科顺股份	5,486,560	27,816,859.2 0	0.05
841	300768	迪普科技	1,588,250	27,794,375.0 0	0.05
842	000885	城发环境	2,114,340	27,718,997.4 0	0.05
843	600604	市北高新	5,786,919	27,545,734.4 4	0.05
844	002302	西部建设	4,186,100	27,544,538.0 0	0.05
845	000935	四川双马	1,895,300	27,443,944.0 0	0.05
846	603466	风语筑	2,944,235	27,440,270.2 0	0.05
847	688531	日联科技	573,057	27,294,704.9 1	0.05
848	002034	旺能环境	1,758,200	27,252,100.0 0	0.05
849	600810	神马股份	3,353,331	27,128,447.7 9	0.05
850	300973	立高食品	692,897	27,043,769.9 1	0.05
851	300080	易成新能	6,168,600	26,956,782.0 0	0.05
852	688658	悦康药业	1,865,827	26,886,567.0 7	0.05
853	000025	特力 A	1,627,070	26,879,196.4 0	0.05
854	601038	一拖股份	1,815,793	26,837,420.5 4	0.05
855	301589	诺瓦星云	154,550	26,829,880.0 0	0.05
856	000736	中交地产	3,096,326	26,628,403.6 0	0.05

857	603123	翠微股份	3,301,898	26,580,278.9 0	0.05
858	000968	蓝焰控股	3,995,400	26,569,410.0 0	0.05
859	600780	通宝能源	4,707,300	26,502,099.0 0	0.05
860	000869	张裕 A	1,140,500	26,448,195.0 0	0.05
861	002242	九阳股份	2,535,337	26,266,091.3 2	0.05
862	603609	禾丰股份	3,040,000	26,204,800.0 0	0.05
863	601069	西部黄金	2,280,000	26,106,000.0 0	0.05
864	603297	永新光学	278,148	26,095,845.3 6	0.05
865	605123	派克新材	485,242	26,086,609.9 2	0.05
866	002053	云南能投	2,279,700	25,988,580.0 0	0.05
867	002378	章源钨业	3,992,270	25,829,986.9 0	0.05
868	688261	东微半导	613,027	25,741,003.7 3	0.05
869	301207	华兰疫苗	1,468,091	25,706,273.4 1	0.05
870	301216	万凯新材	2,512,600	25,628,520.0 0	0.05
871	603915	国茂股份	2,185,620	25,615,466.4 0	0.05
872	003012	东鹏控股	3,862,400	25,530,464.0 0	0.05
873	603566	普莱柯	1,996,600	25,476,616.0 0	0.05
874	605020	永和股份	1,251,020	25,433,236.6 0	0.05
875	300723	一品红	1,486,536	25,360,304.1 6	0.05
876	301348	蓝箭电子	987,900	25,309,998.0 0	0.05
877	600058	五矿发展	3,553,401	25,300,215.1 2	0.05
878	688337	普源精电	647,334	25,246,026.0 0	0.05

879	300492	华图山鼎	346,600	25,232,480.0 0	0.05
880	301047	义翘神州	405,725	25,094,091.2 5	0.05
881	688348	昱能科技	513,497	25,058,653.6 0	0.05
882	003040	楚天龙	1,906,800	24,921,876.0 0	0.05
883	688586	江航装备	2,596,927	24,852,591.3 9	0.05
884	688209	英集芯	1,403,766	24,804,545.2 2	0.05
885	001323	慕思股份	655,024	24,766,457.4 4	0.05
886	603055	台华新材	2,228,400	24,690,672.0 0	0.05
887	603730	岱美股份	2,725,964	24,506,416.3 6	0.05
888	002096	易普力	2,059,108	24,462,203.0 4	0.05
889	002959	小熊电器	509,050	24,388,585.5 0	0.05
890	603301	振德医疗	1,106,366	24,328,988.3 4	0.05
891	301153	中科江南	899,880	24,208,847.2 0	0.04
892	603348	文灿股份	1,016,711	24,055,382.2 6	0.04
893	301327	华宝新能	312,286	23,955,459.0 6	0.04
894	688185	康希诺	383,067	23,386,240.3 5	0.04
895	688686	奥普特	305,798	23,121,386.7 8	0.04
896	301526	国际复材	6,247,423	23,115,465.1 0	0.04
897	301217	铜冠铜箔	2,063,521	22,863,812.6 8	0.04
898	601015	陕西黑猫	6,780,190	22,645,834.6 0	0.04
899	603327	福蓉科技	1,846,020	22,410,682.8 0	0.04
900	600903	贵州燃气	2,893,776	22,395,452.8 0	0.04

901	301268	铭利达	1,326,081	21,986,422.9 8	0.04
902	603439	贵州三力	1,686,100	21,919,300.0 0	0.04
903	300926	博俊科技	992,711	21,849,569.1 1	0.04
904	688351	微电生理	1,146,533	21,829,988.3 2	0.04
905	002275	桂林三金	1,442,900	21,773,361.0 0	0.04
906	000030	富奥股份	4,239,500	21,748,635.0 0	0.04
907	688105	诺唯赞	973,993	21,593,424.8 1	0.04
908	002088	鲁阳节能	1,687,750	21,586,322.5 0	0.04
909	603985	恒润股份	1,836,122	21,445,904.9 6	0.04
910	601033	永兴股份	1,479,200	21,389,232.0 0	0.04
911	688336	三生国健	996,890	21,353,383.8 0	0.04
912	603355	莱克电气	942,100	21,338,565.0 0	0.04
913	605116	奥锐特	1,010,100	21,333,312.0 0	0.04
914	002314	南山控股	8,932,000	21,258,160.0 0	0.04
915	603983	丸美生物	654,500	21,114,170.0 0	0.04
916	000899	赣能股份	2,413,637	21,022,778.2 7	0.04
917	301339	通行宝	1,028,100	20,911,554.0 0	0.04
918	002901	大博医疗	677,670	20,899,342.8 0	0.04
919	603162	海通发展	2,261,402	20,804,898.4 0	0.04
920	002946	新乳业	1,421,400	20,624,514.0 0	0.04
921	601886	江河集团	3,777,200	20,396,880.0 0	0.04
922	002534	西子洁能	1,832,300	20,356,853.0 0	0.04

923	301069	凯盛新材	1,371,933	20,332,047.0 6	0.04
924	601083	锦江航运	2,116,073	20,145,014.9 6	0.04
925	605009	豪悦护理	502,123	20,064,835.0 8	0.04
926	688001	华兴源创	737,155	19,976,900.5 0	0.04
927	688206	概伦电子	1,086,296	19,926,257.3 6	0.04
928	000761	本钢板材	6,179,887	19,775,638.4 0	0.04
929	603989	艾华集团	1,309,950	19,754,046.0 0	0.04
930	003009	中天火箭	512,400	19,629,400.0 0	0.04
931	000058	深赛格	2,442,200	19,610,866.0 0	0.04
932	688392	骄成超声	479,892	19,579,593.6 0	0.04
933	688177	百奥泰	1,004,371	19,464,709.9 8	0.04
934	300702	天宇股份	1,143,380	19,048,710.8 0	0.04
935	002913	奥士康	787,100	18,976,981.0 0	0.04
936	002651	利君股份	2,582,100	18,926,793.0 0	0.04
937	603013	亚普股份	1,259,866	18,872,792.6 8	0.04
938	301367	怡和嘉业	298,725	18,819,675.0 0	0.03
939	603719	良品铺子	1,358,600	18,813,706.0 0	0.03
940	301376	致欧科技	1,006,621	18,808,593.5 2	0.03
941	002911	佛燃能源	1,487,711	18,804,667.0 4	0.03
942	002978	安宁股份	656,484	18,657,275.2 8	0.03
943	300869	康泰医学	1,335,900	18,622,446.0 0	0.03
944	300755	华致酒行	1,043,580	18,617,467.2 0	0.03

945	001308	康冠科技	675,897	18,587,167.5 0	0.03
946	300894	火星号	1,355,800	18,574,460.0 0	0.03
947	600618	氯碱化工	1,881,800	18,554,548.0 0	0.03
948	688268	华特气体	414,088	18,469,820.9 6	0.03
949	301371	敷尔佳	485,100	18,331,929.0 0	0.03
950	001258	立新能源	2,296,500	18,280,140.0 0	0.03
951	001236	弘业期货	1,898,200	18,104,648.0 0	0.03
952	603093	南华期货	1,519,300	18,079,670.0 0	0.03
953	301246	宏源药业	1,324,509	17,920,606.7 7	0.03
954	000019	深粮控股	2,726,700	17,914,419.0 0	0.03
955	300741	华宝股份	1,023,400	17,796,926.0 0	0.03
956	000517	荣安地产	7,941,800	17,710,214.0 0	0.03
957	603530	神马电力	714,800	17,662,708.0 0	0.03
958	603877	太平鸟	1,173,615	17,369,502.0 0	0.03
959	688776	国光电气	373,567	17,105,626.1 1	0.03
960	688315	诺禾致源	1,363,515	17,043,937.5 0	0.03
961	601022	宁波远洋	2,113,900	16,974,617.0 0	0.03
962	301558	三态股份	1,929,900	16,905,924.0 0	0.03
963	605296	神农集团	599,900	16,617,230.0 0	0.03
964	688526	科前生物	1,139,910	16,289,313.9 0	0.03
965	688433	华曙高科	691,140	16,131,207.6 0	0.03
966	605222	起帆电缆	1,037,900	15,983,660.0 0	0.03

967	001389	广合科技	317,122	15,951,236.6 0	0.03
968	605577	龙版传媒	1,085,200	15,767,956.0 0	0.03
969	601811	新华文轩	978,900	15,515,565.0 0	0.03
970	001311	多利科技	585,248	15,093,545.9 2	0.03
971	301381	赛维时代	670,900	14,883,684.0 0	0.03
972	688383	新益昌	329,315	14,776,364.0 5	0.03
973	002990	盛视科技	628,800	14,569,296.0 0	0.03
974	603693	江苏新能	1,472,490	14,504,026.5 0	0.03
975	605011	杭州热电	661,700	14,039,214.0 0	0.03
976	001269	欧晶科技	488,320	13,912,236.8 0	0.03
977	688128	中国电研	661,435	13,896,749.3 5	0.03
978	603489	八方股份	574,757	13,690,711.7 4	0.03
979	603057	紫燕食品	677,130	13,603,541.7 0	0.03
980	688523	航天环宇	674,266	13,485,320.0 0	0.03
981	003039	顺控发展	1,024,900	13,405,692.0 0	0.02
982	605365	立达信	825,600	12,961,920.0 0	0.02
983	603219	富佳股份	939,400	12,920,798.0 0	0.02
984	001322	箭牌家居	1,587,747	12,844,873.2 3	0.02
985	301508	中机认检	375,300	12,760,200.0 0	0.02
986	301090	华润材料	1,808,500	12,550,990.0 0	0.02
987	301500	飞南资源	666,200	11,991,600.0 0	0.02
988	600403	大有能源	3,972,400	11,678,856.0 0	0.02

989	301559	中集环科	755,929	11,603,510.15	0.02
990	601068	中铝国际	2,609,100	11,506,131.00	0.02
991	301565	中仑新材	487,911	10,441,295.40	0.02
992	301606	绿联科技	266,818	10,085,201.64	0.02
993	603132	金徽股份	892,100	10,018,283.00	0.02
994	601279	英利汽车	2,585,100	9,900,933.00	0.02
995	603103	横店影视	625,320	8,998,354.80	0.02
996	301262	海看股份	338,382	8,415,560.34	0.02
997	301177	迪阿股份	356,967	8,153,126.28	0.02
998	301180	万祥科技	479,200	7,413,224.00	0.01
999	603075	热威股份	332,500	6,194,475.00	0.01
1,000	001376	百通能源	376,900	5,510,278.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.00
2	688615	合合信息	289	47,910.42	0.00
3	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.00
4	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00
5	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.00
6	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
7	001391	国货航	4,686	31,864.80	0.00
8	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
9	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
10	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.00
11	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
12	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
13	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
14	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
15	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
16	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
17	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
18	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
19	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00

20	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
21	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
22	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
23	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
24	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
25	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
26	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
27	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
28	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
29	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
30	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
31	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002456	欧菲光	794,368,079.36	8.66
2	300339	润和软件	654,734,537.23	7.14
3	300476	胜宏科技	515,577,587.94	5.62
4	002405	四维图新	492,391,066.11	5.37
5	002085	万丰奥威	441,984,384.52	4.82
6	300346	南大光电	436,074,252.66	4.76
7	300573	兴齐眼药	414,162,962.84	4.52
8	300757	罗博特科	395,721,391.22	4.32
9	000528	柳工	387,765,270.95	4.23
10	002312	川发龙鳞	378,195,324.21	4.12
11	000426	兴业银锡	372,468,446.03	4.06
12	002318	久立特材	365,608,857.27	3.99
13	002176	江特电机	363,015,188.13	3.96
14	000034	神州数码	359,285,421.85	3.92
15	002130	沃尔核材	358,678,177.26	3.91
16	002126	银轮股份	356,578,057.55	3.89
17	300315	掌趣科技	349,327,892.01	3.81
18	000766	通化金马	346,068,440.44	3.77
19	002851	麦格米特	337,427,481.28	3.68
20	002837	英维克	327,797,229.44	3.57
21	002139	拓邦股份	326,664,550.72	3.56
22	300459	汤姆猫	325,038,242.44	3.54
23	300458	全志科技	318,555,432.85	3.47
24	300666	江丰电子	318,461,738.05	3.47

25	300627	华测导航	310,105,011.45	3.38
26	000415	渤海租赁	309,712,327.07	3.38
27	301308	江波龙	307,320,418.61	3.35
28	300068	南都电源	303,848,640.84	3.31
29	688235	百济神州	292,414,635.31	3.19
30	002402	和而泰	291,370,746.87	3.18
31	300623	捷捷微电	285,698,534.14	3.12
32	002151	北斗星通	284,315,288.02	3.10
33	300624	万兴科技	281,174,978.17	3.07
34	002389	航天彩虹	276,273,747.65	3.01
35	002145	中核钛白	275,251,282.85	3.00
36	300762	上海瀚讯	273,126,821.69	2.98
37	300679	电连技术	267,769,417.39	2.92
38	000690	宝新能源	267,500,537.46	2.92
39	300182	捷成股份	265,730,470.99	2.90
40	300775	三角防务	264,180,498.60	2.88
41	000422	湖北宜化	263,688,956.25	2.88
42	002400	省广集团	263,472,454.33	2.87
43	000686	东北证券	260,274,842.67	2.84
44	000875	吉电股份	259,971,365.20	2.84
45	300456	赛微电子	259,053,112.83	2.83
46	300083	创世纪	259,046,425.76	2.83
47	000403	派林生物	258,654,153.61	2.82
48	300085	银之杰	258,459,337.20	2.82
49	300049	福瑞股份	258,300,583.41	2.82
50	000951	中国重汽	255,518,278.58	2.79
51	300077	国民技术	253,115,360.82	2.76
52	002222	福晶科技	252,360,397.33	2.75
53	300735	光弘科技	251,324,004.20	2.74
54	002245	蔚蓝锂芯	249,918,947.96	2.73
55	002807	江阴银行	248,198,909.79	2.71
56	300298	三诺生物	244,490,785.31	2.67
57	000581	威孚高科	240,231,334.16	2.62
58	002484	江海股份	240,151,451.62	2.62
59	300777	中简科技	238,951,996.22	2.61
60	001696	宗申动力	238,170,567.30	2.60
61	300633	开立医疗	237,727,306.54	2.59
62	300045	华力创通	237,040,365.37	2.59
63	002583	海能达	236,536,059.78	2.58
64	000543	皖能电力	235,427,909.92	2.57
65	000860	顺鑫农业	234,728,499.64	2.56
66	002832	比音勒芬	232,559,891.53	2.54
67	300115	长盈精密	232,191,570.69	2.53

68	002617	露笑科技	231,084,956.97	2.52
69	002221	东华能源	230,717,068.17	2.52
70	300525	博思软件	230,686,601.27	2.52
71	002332	仙琚制药	228,414,553.39	2.49
72	001309	德明利	227,378,047.44	2.48
73	300827	上能电气	227,365,399.12	2.48
74	300236	上海新阳	226,531,640.60	2.47
75	000762	西藏矿业	226,196,779.84	2.47
76	002675	东诚药业	225,958,217.81	2.46
77	300229	拓尔思	225,122,838.57	2.46
78	002003	伟星股份	224,347,515.80	2.45
79	300672	国科微	222,791,623.88	2.43
80	300294	博雅生物	222,624,214.59	2.43
81	002335	科华数据	222,555,438.79	2.43
82	300101	振芯科技	219,404,398.67	2.39
83	002317	众生药业	218,699,607.20	2.39
84	000917	电广传媒	217,568,637.66	2.37
85	002249	大洋电机	216,971,392.91	2.37
86	300773	拉卡拉	216,103,440.64	2.36
87	002416	爱施德	215,793,042.54	2.35
88	301047	义翘神州	215,626,298.08	2.35
89	002063	远光软件	214,789,390.62	2.34
90	002036	联创电子	212,707,842.48	2.32
91	002544	普天科技	212,621,640.45	2.32
92	002701	奥瑞金	212,252,314.35	2.31
93	300133	华策影视	212,120,653.43	2.31
94	002597	金禾实业	211,506,581.10	2.31
95	300036	超图软件	211,224,793.54	2.30
96	002745	木林森	210,951,804.21	2.30
97	300034	钢研高纳	209,731,547.01	2.29
98	002075	沙钢股份	208,633,433.07	2.28
99	002270	华明装备	208,216,703.63	2.27
100	000035	中国天楹	207,924,164.88	2.27
101	002698	博实股份	207,869,826.21	2.27
102	300130	新国都	207,720,341.59	2.27
103	000028	国药一致	206,922,142.40	2.26
104	300674	宇信科技	206,584,667.81	2.25
105	300857	协创数据	206,271,958.72	2.25
106	000923	河钢资源	205,552,858.31	2.24
107	000682	东方电子	205,340,194.04	2.24
108	300685	艾德生物	205,210,844.96	2.24
109	300327	中颖电子	205,107,947.43	2.24
110	002015	协鑫能科	203,892,186.93	2.22

111	301035	润丰股份	203,380,399.48	2.22
112	000902	新洋丰	203,342,613.06	2.22
113	300738	奥飞数据	202,945,525.86	2.21
114	002396	星网锐捷	202,577,334.21	2.21
115	300638	广和通	201,646,535.71	2.20
116	688608	恒玄科技	201,562,198.82	2.20
117	300475	香农芯创	201,384,594.40	2.20
118	002839	张家港行	200,048,352.92	2.18
119	002747	埃斯顿	199,533,623.27	2.18
120	300075	数字政通	198,733,798.26	2.17
121	000970	中科三环	197,789,750.74	2.16
122	002773	康弘药业	197,705,100.17	2.16
123	300170	汉得信息	197,703,138.67	2.16
124	002906	华阳集团	196,708,358.79	2.15
125	002567	唐人神	196,654,092.60	2.14
126	000927	中国铁物	195,870,724.00	2.14
127	002100	天康生物	195,470,865.43	2.13
128	000676	智度股份	194,880,042.36	2.13
129	300618	寒锐钴业	194,686,883.33	2.12
130	300811	铂科新材	194,602,141.58	2.12
131	002182	宝武镁业	194,504,313.13	2.12
132	000012	南玻 A	193,762,447.01	2.11
133	300761	立华股份	193,674,749.03	2.11
134	000829	天音控股	192,616,342.30	2.10
135	002174	游族网络	191,867,518.83	2.09
136	300303	聚飞光电	189,470,877.25	2.07
137	300180	华峰超纤	189,259,222.66	2.06
138	600171	上海贝岭	189,236,823.92	2.06
139	002011	盾安环境	188,641,234.34	2.06
140	000685	中山公用	188,592,120.79	2.06
141	301050	雷电微力	187,451,220.84	2.04
142	300166	东方国信	187,350,726.47	2.04
143	301155	海力风电	187,086,394.43	2.04
144	000915	华特达因	186,842,158.73	2.04
145	300415	伊之密	186,514,435.45	2.03
146	300841	康华生物	185,995,484.21	2.03
147	002091	江苏国泰	185,722,020.18	2.03
148	002020	京新药业	184,914,432.47	2.02
149	002192	融捷股份	184,113,846.86	2.01

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300339	润和软件	1,017,002,004.78	11.09
2	002456	欧菲光	653,454,460.13	7.13
3	300476	胜宏科技	640,097,450.51	6.98
4	002085	万丰奥威	593,799,446.88	6.48
5	000034	神州数码	427,928,940.32	4.67
6	000426	兴业银锡	418,033,100.42	4.56
7	300573	兴齐眼药	412,888,922.03	4.50
8	002318	久立特材	405,897,553.35	4.43
9	002405	四维图新	400,352,105.64	4.37
10	002312	川发龙蟒	386,311,696.45	4.21
11	300346	南大光电	353,547,818.88	3.86
12	301308	江波龙	340,143,914.46	3.71
13	300757	罗博特科	339,914,308.88	3.71
14	002130	沃尔核材	307,659,918.45	3.36
15	601099	太平洋	289,232,914.35	3.15
16	000528	柳工	287,560,946.05	3.14
17	002837	英维克	284,536,702.63	3.10
18	300458	全志科技	280,302,329.98	3.06
19	002176	江特电机	278,940,068.49	3.04
20	300315	掌趣科技	278,537,684.42	3.04
21	300666	江丰电子	272,208,711.00	2.97
22	300068	南都电源	269,551,768.27	2.94
23	300459	汤姆猫	268,746,273.01	2.93
24	002126	银轮股份	265,901,151.65	2.90
25	002851	麦格米特	262,521,070.76	2.86
26	000403	派林生物	262,109,333.54	2.86
27	300627	华测导航	255,186,375.51	2.78
28	002139	拓邦股份	253,255,349.33	2.76
29	300077	国民技术	253,110,063.95	2.76
30	300623	捷捷微电	247,382,963.54	2.70
31	002583	海能达	245,393,618.60	2.68
32	000415	渤海租赁	244,819,693.71	2.67
33	300085	银之杰	242,256,729.83	2.64
34	300762	上海瀚讯	240,576,832.10	2.62
35	002402	和而泰	238,267,052.38	2.60
36	300624	万兴科技	235,784,859.69	2.57
37	002389	航天彩虹	227,488,056.68	2.48
38	300735	光弘科技	223,549,273.30	2.44
39	300182	捷成股份	220,988,965.92	2.41
40	001696	宗申动力	220,282,479.53	2.40

41	300679	电连技术	217,355,037.68	2.37
42	002151	北斗星通	217,041,580.42	2.37
43	002145	中核钛白	216,288,405.07	2.36
44	000422	湖北宜化	214,707,819.45	2.34
45	000766	通化金马	213,630,339.18	2.33
46	002400	省广集团	211,760,050.14	2.31
47	300456	赛微电子	209,672,536.66	2.29
48	300775	三角防务	207,019,574.51	2.26
49	002222	福晶科技	206,857,265.92	2.26
50	300083	创世纪	204,930,195.14	2.23
51	000686	东北证券	204,465,884.02	2.23
52	002245	蔚蓝锂芯	200,570,957.57	2.19
53	000690	宝新能源	199,075,394.11	2.17
54	000951	中国重汽	197,932,907.40	2.16
55	301047	义翘神州	197,886,993.03	2.16
56	002436	兴森科技	197,225,031.67	2.15
57	300777	中简科技	196,193,700.04	2.14
58	000875	吉电股份	194,806,115.35	2.12
59	300827	上能电气	194,669,703.91	2.12
60	301301	川宁生物	192,345,150.33	2.10
61	002467	二六三	191,858,161.67	2.09
62	300298	三诺生物	191,796,491.19	2.09
63	002484	江海股份	189,058,715.65	2.06
64	300633	开立医疗	188,873,224.21	2.06
65	300343	联创股份	188,633,294.64	2.06
66	300236	上海新阳	188,059,805.57	2.05
67	300101	振芯科技	187,004,567.34	2.04
68	300525	博思软件	186,437,517.12	2.03
69	002807	江阴银行	185,847,508.23	2.03
70	002335	科华数据	184,840,053.84	2.02
71	300674	宇信科技	184,381,998.17	2.01
72	300672	国科微	183,732,990.80	2.00
73	300002	神州泰岳	183,709,858.52	2.00

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	99,551,743,930.72
卖出股票收入（成交）总额	80,456,839,255.13

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

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

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

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

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	137,982,008.76
2	应收清算款	53,269,754.26
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	191,251,763.02

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	300757	罗博特科	25,761,200.00	0.05	大宗交易锁定期

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301626	苏州天脉	62,951.46	0.00	新股锁定期
2	688615	合合信息	47,910.42	0.00	新股锁定期
3	301611	珂玛科技	45,104.40	0.00	新股锁定期
4	688449	联芸科技	41,392.64	0.00	新股锁定期
5	688605	先锋精科	39,937.92	0.00	新股锁定期

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		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
64,366	345,729.39	20,106,756,299.00	90.35%	1,721,782,562.00	7.74%	424,678,785.00	1.91%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中央汇金投资有限责任公司	8,956,692,256.00	40.25%
2	中央汇金资产管理有限责任公司	7,557,031,966.00	33.96%
3	中信证券股份有限公司	434,163,478.00	1.95%
4	平安证券股份有限公司	207,303,812.00	0.93%
5	中国人寿保险股份有限公司	199,913,396.00	0.90%
6	华泰证券股份有限公司	120,982,787.00	0.54%
7	友邦人寿保险有限公司—传统	97,663,900.00	0.44%
8	银华基金—中国人寿保险股份有限公司—传统险—银华基金国寿股份均衡股票传统可供出	88,799,600.00	0.40%
9	银华基金—中国人寿保险股份有限公司—分红险—银华基金国寿股份均衡股票型组合单一	88,182,500.00	0.40%
10	国泰君安证券股份有限公司	73,441,512.00	0.33%
11	招商银行股份有限公司—南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	424,678,785.00	1.91%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016 年 9 月 29 日)基金份额总额	587,892,000.00
本报告期期初基金份额总额	3,867,217,646.00
本报告期基金总申购份额	65,310,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	46,924,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	22,253,217,646.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2024 年 9 月 21 日，本基金管理人发布了《南方基金管理股份有限公司关于高级管理人员变更的公告》，杨小松先生任公司首席信息官，俞文宏先生任公司董事会秘书，陈莉女士任公司副总经理，孙鲁闽先生任公司副总经理，侯利鹏先生任公司副总经理，茅炜先生任公司副总经理，常克川先生不再担任公司副总经理、首席信息官、董事会秘书，朱运东先生不再担任公司副总经理，史博先生不再担任公司副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内无涉及基金财产业务的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

目前安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 1 年，本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 80,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	54,195,446,639.93	30.11%	5,416,763.11	30.11%	-
华泰证券	4	34,610,161,745.69	19.23%	3,459,615.68	19.23%	-
广发证券	2	20,246,674,288.97	11.25%	2,022,949.79	11.24%	-
国泰君安	2	18,539,462,905.31	10.30%	1,852,409.41	10.30%	-
中金公司	1	16,532,494,004.13	9.18%	1,651,754.00	9.18%	-

国信证券	1	12,889,826,089.08	7.16%	1,288,731.98	7.16%	-
国金证券	2	11,343,770,268.69	6.30%	1,133,337.38	6.30%	-
国投证券	2	5,909,274,069.71	3.28%	591,532.63	3.29%	-
长江证券	1	5,737,497,395.68	3.19%	574,057.47	3.19%	-
华创证券	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：广发证券、国金证券、国泰君安、国投证券、中金公司；减少交易单元：华泰证券、万联证券、银河证券、招商证券。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	9,783,587.43	29.18%	-	-	-	-
华泰证券	1,352,312.39	4.03%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	8,781,537.27	26.19%	-	-	-	-
中金公司	3,463,988.26	10.33%	-	-	-	-
国信证券	10,148,482.69	30.27%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-06
2	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加中原证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-18
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-02
4	关于南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金调整最小申购、赎回单位的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-21
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-24
6	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加渤海证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-15
7	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
8	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-24
9	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加湘财证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-29
10	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-30
11	关于南方基金管理股份有限公司旗下基金调整股票估值方法的提示性公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-15
12	南方基金管理股份有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-20
13	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加万和证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-07-05
14	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资	证券日报、基金管理	2024-07-19

	关联方承销证券的关联交易公告	人网站、中国证监会基金电子披露网站	
15	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加东兴证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-07-26
16	南方基金管理股份有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-09-21
17	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-11-02
18	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加中银证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-11-07
19	南方基金管理股份有限公司关于调低旗下部分指数基金管理费率、托管费率并修订基金合同的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-11-19
20	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-11-28
21	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-12-06
22	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加国新证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-12-12

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240718-20241231	-	7,557,031,966.00	-	7,557,031,966.00	33.96%
机构	2	20240205-20241231	-	8,956,692,256.00	-	8,956,692,256.00	40.25%
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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告》原文。

13.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>