

南方中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金联接基金 (LOF) 2026 年中期报 告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告.....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告.....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 净资产变动表.....	20
6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	48
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	64
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	64
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	64
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	64
7.10 本报告期投资基金情况.....	64

7.11 本基金投资股指期货的投资政策.....	65
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	65
7.13 投资组合报告附注.....	65
§8 基金份额持有人信息.....	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	67
§9 开放式基金份额变动.....	67
§10 重大事件揭示.....	68
10.1 基金份额持有人大会决议.....	68
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
10.4 基金投资策略的改变.....	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	68
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	68
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....	69
10.8 其他重大事件.....	70
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
§12 备查文件目录.....	71
12.1 备查文件目录.....	71
12.2 存放地点.....	71
12.3 查阅方式.....	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)			
基金简称	南方中证 500ETF 联接（LOF）			
场内简称	500ETF 联接 LOF			
基金主代码	160119			
前端交易代码	160119			
后端交易代码	160120			
基金运作方式	上市型开放式(LOF)			
基金合同生效日	2009 年 9 月 25 日			
基金管理人	南方基金管理股份有限公司			
基金托管人	中国农业银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	3,550,547,362.69 份			
基金合同存续期	不定期			
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所			
上市日期	2009 年 11 月 11 日			
下属分级基金的基金简称	南方中证 500ETF 联接（LOF）A	南方中证 500ETF 联接（LOF）C	南方中证 500ETF 联接（LOF）I	南方中证 500ETF 联接 Y
下属分级基金的场内简称	500ETF 联接 LOF			
下属分级基金的交易代码	160119	004348	021059	022921
下属分级基金的前端交易代码	160119			
下属分级基金的后端交易代码	160120			
报告期末下属分级基金的份额总额	3,033,450,255.70 份	347,558,324.84 份	151,900,632.82 份	17,638,149.33 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510500
基金运作方式	交易型开放式

基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 日
基金管理人名称	南方基金管理股份有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，以中证 500ETF 作为其主要投资标的。为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	本基金的标的指数为中证 500 指数。 本基金业绩比较基准：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，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。

2.2.1 目标基金产品说明

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	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	任航
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	400-889-8899	95599
传真	0755-82763889	010-68121816
注册地址	深圳市福田区莲花街道 益田路 5999 号基金大 厦 32-42 楼	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道 益田路 5999 号基金大 厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518017	100031
法定代表人	周易	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人的办公地 址、基金上市交易的证券交易所 (如有)

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司 南方基金管理股份有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号 深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、南方中证 500ETF 联接（LOF）A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	428,139,521.97
本期利润	1,428,667,109.51
加权平均基金份额本期利润	0.4423
本期加权平均净值利润率	19.11%
本期基金份额净值增长率	20.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	4,501,465,149.35
期末可供分配基金份额利润	1.4839
期末基金资产净值	7,682,221,384.38
期末基金份额净值	2.5325

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	176.31%

2、南方中证 500ETF 联接（LOF）C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	42,975,135.35
本期利润	131,406,724.99
加权平均基金份额本期利润	0.3752
本期加权平均净值利润率	16.73%
本期基金份额净值增长率	20.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	493,532,605.87
期末可供分配基金份额利润	1.4199
期末基金资产净值	852,075,482.18
期末基金份额净值	2.4516
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	55.84%

3、南方中证 500ETF 联接（LOF）I

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	28,957,804.46
本期利润	75,743,316.90
加权平均基金份额本期利润	0.3551
本期加权平均净值利润率	15.32%
本期基金份额净值增长率	20.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	225,350,262.53
期末可供分配基金份额利润	1.4835
期末基金资产净值	384,609,890.63
期末基金份额净值	2.5320
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	72.17%

4、南方中证 500ETF 联接 Y

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,172,304.45
本期利润	5,331,063.75
加权平均基金份额本期利润	0.3406
本期加权平均净值利润率	14.68%
本期基金份额净值增长率	20.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	26,172,151.78
期末可供分配基金份额利润	1.4838
期末基金资产净值	44,667,137.44
期末基金份额净值	2.5324

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	51.43%

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；

本基金从 2017 年 2 月 23 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2017 年 2 月 28 日起存续；

本基金从 2024 年 4 月 8 日起新增 I 类份额，I 类份额自 2024 年 4 月 9 日起存续；

本基金从 2024 年 12 月 13 日起新增 Y 类份额，Y 类份额自 2024 年 12 月 16 日起存续。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方中证 500ETF 联接（LOF）A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	18.52%	1.57%	17.61%	1.56%	0.91%	0.01%
过去六个月	20.80%	1.58%	19.93%	1.58%	0.87%	0.00%
过去一年	51.89%	1.36%	49.68%	1.35%	2.21%	0.01%
过去三年	53.46%	1.41%	48.14%	1.41%	5.32%	0.00%
过去五年	41.71%	1.29%	31.61%	1.30%	10.10%	-0.01%
过去七年	101.23%	1.30%	78.58%	1.29%	22.65%	0.01%
过去十年	69.61%	1.28%	46.44%	1.28%	23.17%	0.00%
自基金合同 生效起至今	176.31%	1.50%	150.47%	1.50%	25.84%	0.00%

南方中证 500ETF 联接（LOF）C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	18.41%	1.57%	17.61%	1.56%	0.80%	0.01%
过去六个月	20.56%	1.58%	19.93%	1.58%	0.63%	0.00%
过去一年	51.29%	1.36%	49.68%	1.35%	1.61%	0.01%
过去三年	51.62%	1.41%	48.14%	1.41%	3.48%	0.00%
过去五年	38.92%	1.29%	31.61%	1.30%	7.31%	-0.01%

过去七年	95.69%	1.30%	78.58%	1.29%	17.11%	0.01%
自基金合同生效起至今	55.84%	1.30%	39.31%	1.30%	16.53%	0.00%

南方中证 500ETF 联接 (LOF) I

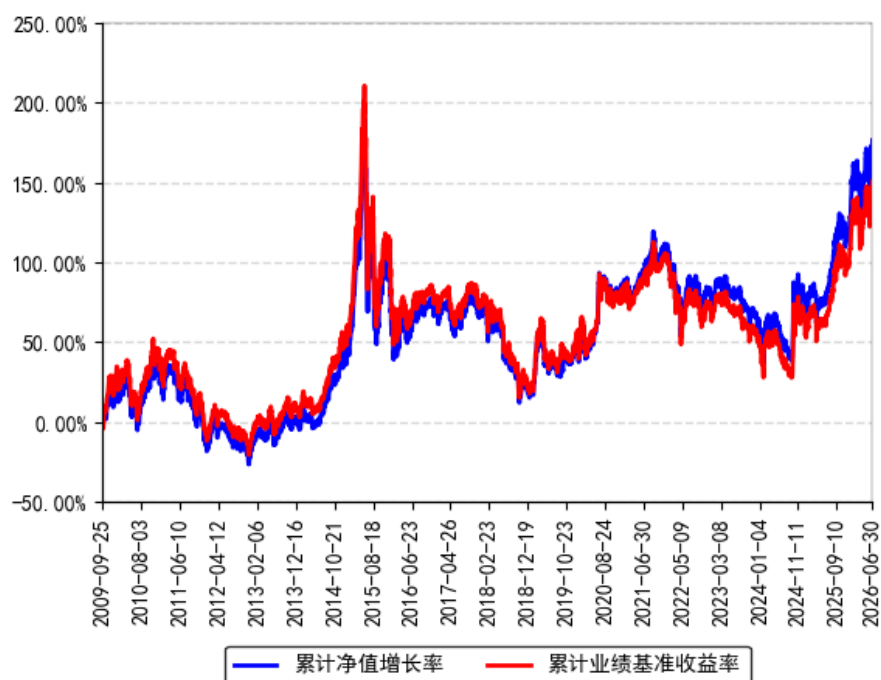
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	18.52%	1.57%	17.61%	1.56%	0.91%	0.01%
过去六个月	20.80%	1.58%	19.93%	1.58%	0.87%	0.00%
过去一年	51.88%	1.36%	49.68%	1.35%	2.20%	0.01%
自基金合同生效起至今	72.17%	1.46%	66.53%	1.46%	5.64%	0.00%

南方中证 500ETF 联接 Y

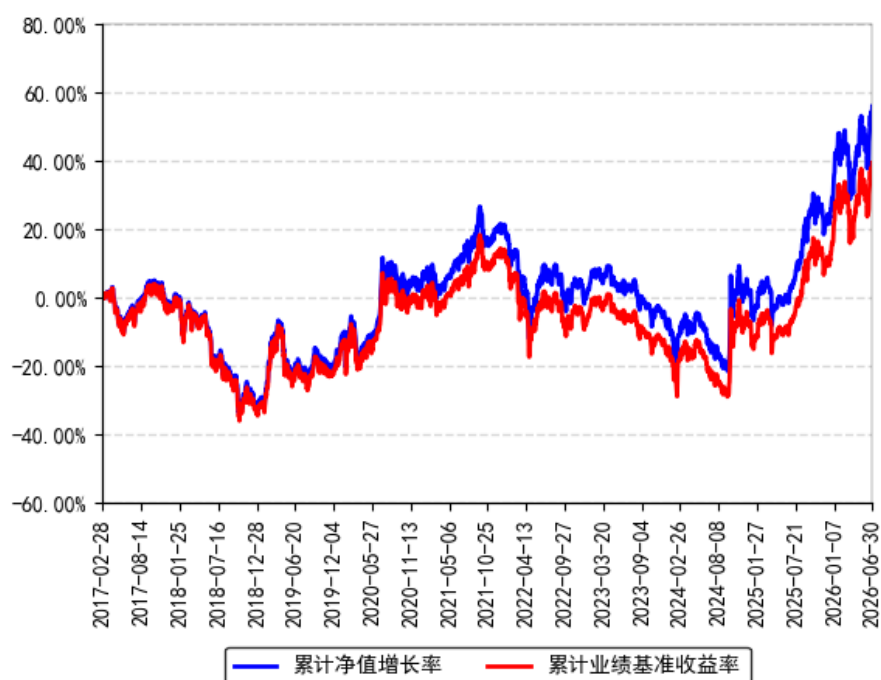
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	18.52%	1.57%	17.61%	1.56%	0.91%	0.01%
过去六个月	20.80%	1.58%	19.93%	1.58%	0.87%	0.00%
过去一年	51.90%	1.36%	49.68%	1.35%	2.22%	0.01%
自基金合同生效起至今	51.43%	1.33%	48.05%	1.33%	3.38%	0.00%

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

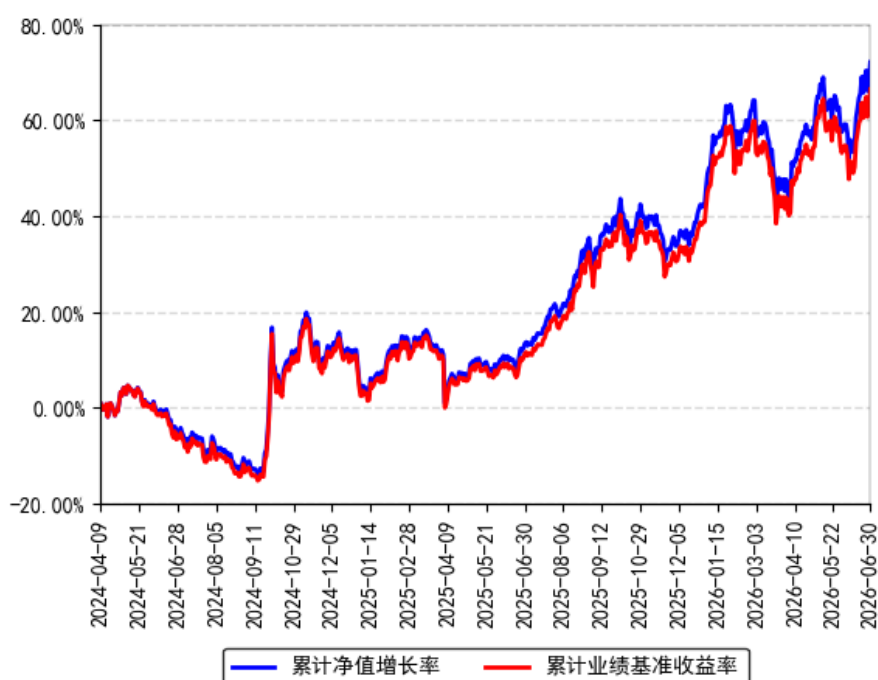
南方中证500ETF联接（LOF）A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



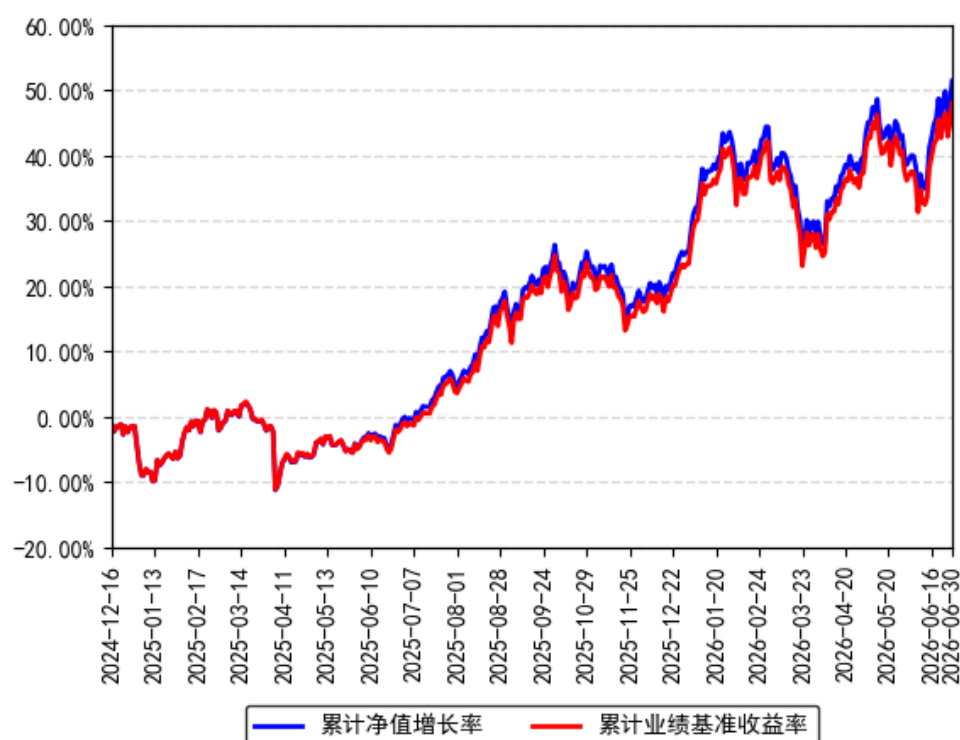
南方中证500ETF联接（LOF）C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方中证500ETF联接（LOF）I 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



注：本基金从 2017 年 2 月 23 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2017 年 2 月 28 日起存续；
 本基金从 2024 年 4 月 8 日起新增 I 类份额，I 类份额自 2024 年 4 月 9 日起存续；
 本基金从 2024 年 12 月 13 日起新增 Y 类份额，Y 类份额自 2024 年 12 月 16 日起存续。

§ 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		
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日	-	21 年	中国国籍，女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月 17 日至 2015 年 6 月 16 日，任南方策略基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2019 年 4 月 18 日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 3 月 27 日，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至 2020 年 3 月 27 日，任南方 H 股联接基金经理；2014 年 10 月 30 日至 2020 年 12 月 23 日，任 500 医药基金经理；2021 年 3 月 12 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理；2021 年 10 月 22 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证全指医疗保健 ETF 基金经理；2020 年 12 月 25 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方策略基金经理；2021 年 7 月 2 日至 2023 年 8 月 25 日，任南

					方中证香港科技 ETF（QDII）基金经理；2022 年 6 月 17 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方恒生香港上市生物科技 ETF（QDII）基金经理；2023 年 5 月 30 日至 2024 年 7 月 5 日，任南方恒生香港上市生物科技 ETF 发起联接（QDII）基金经理；2024 年 7 月 5 日至 2025 年 7 月 25 日，任南方基金南方东英沙特阿拉伯 ETF（QDII）基金经理；2024 年 11 月 4 日至 2025 年 12 月 5 日，任南方中证沪深港黄金产业股票指数发起基金经理；2013 年 4 月 22 日至今，任南方 500、南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月 17 日至今，任南方 300、南方 300 联接基金经理；2015 年 2 月 16 日至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2017 年 7 月 21 日至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月 24 日至今，任南方房地产联接基金经理；2017 年 8 月 25 日至今，任南方房地产 ETF 基金经理；2018 年 4 月 3 日至今，任 MSCI 基金基金经理；2018 年 6 月 8 日至今，任 MSCI 联接基金经理；2020 年 7 月 24 日至今，兼任投资经理；2024 年 6 月 26 日至今，任南方中证国新港股通央企红利 ETF 基金经理；2024 年 9 月 12 日至今，任南方港股通央企红利 ETF 联接基金经理；2025 年 6 月 30 日至今，任南方中证港股通科技 ETF 基金经理；2025 年 9 月 18 日至今，任南方中证港股通科技 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》中关于证券基金从业人员范围的相关规定；

3、报告截止日至批准送出日期间，自 2026 年 7 月 24 日起龚涛新任本基金的基金经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量 (只)	资产净值(元)	任职时间
罗文杰	公募基金	14	61,288,011,599.50	2013 年 04 月 22 日
	私募资产管理	-	-	-

	计划			
	其他组合	1	922,311,474.24	2026 年 03 月 12 日
	合计	15	62,210,323,073. 74	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，中证 500 指数涨 20.97%。中证 500 是 A 股市场核心中盘股指数，随着 A 股市场扩容与成分股市值增长，中证 500 总市值不断扩大，目前已增长至约 21 万亿元，流通市值约 10 万亿元。成分股总市值中位数从 2010 年的 60 多亿元增长至目前的 290 多亿元。随着中国经济转型发展和 A 股市场的变迁，中证 500 的行业构成不断迭代，房地产、基础化

工等传统行业权重逐渐下滑，而电子、电力设备、机械设备等新兴行业权重逐渐占据主导地位。现下指数仍被大幅低估，具有较高的安全边际。

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，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 A 份额净值为 2.5325 元，报告期内，份额净值增长率为 20.80%，同期业绩基准增长率为 19.93%；本基金 C 份额净值为 2.4516 元，报告期内，份额净值增长率为 20.56%，同期业绩基准增长率为 19.93%；本基金 I 份额净值为 2.5320 元，报告期内，份额净值增长率为 20.80%，同期业绩基准增长率为 19.93%；本基金 Y 份额净值为 2.5324 元，报告期内，份额净值增长率为 20.80%，同期业绩基准增长率为 19.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年还是比较乐观的，一是国内整体经济温和复苏，6 月 PPI 转正至 4.1%，工业利润 1-6 月累计同比高增 18%以上，“十五五”开局叠加“反内卷”与再通胀双轮驱动，慢牛下半场的盈利基础比 2025 年更扎实。二是流动性结构在持续优化，支撑 A 股成为全球波动中“更安全的避风港”，人民币汇率稳中偏强也有助于外资持续加配。三是产业主线极为清晰：Agent 时代到来推动 AI PCB、存储涨价、光模块、算力硬件景气持续验证。综合来看，指数在科技板块推动下有望温和上行，下半年仍具备重返高点并向上打开空间的条件。

中证 500 是 A 股市场的核心中盘股指数，在我国逐渐转向创新驱动发展的过程中，指数不仅受益于国家对科技创新领域的政策支持、新经济行业本身快速增长的红利，还能够享受各细分行业龙头公司在经济转型与集中度提升下的竞争优势。近期正处半年报业绩预披露期，目前有 157 只指数成份股公布半年报业绩预告，预喜率高达 76%，平均净利润增速高达 140%左右。这波 AI 驱动的超级大周期下，相信会有进一步盈利和估值的提升。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国农业银行股份有限公司(以下简称“本基金托管人”)在本基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	196,694,337.16	211,784,808.95
结算备付金		1,025,469.59	458,032.32
存出保证金		410,645.05	1,238,763.00
交易性金融资产	6.4.7.2	8,812,377,191.59	8,052,504,571.77
其中：股票投资		159,314,463.03	132,821,638.45
基金投资		8,387,658,550.98	7,654,986,000.75
债券投资		265,404,177.58	264,696,932.57
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-

应收清算款		14,936,295.86	122,349.99
应收股利		-	-
应收申购款		21,695,759.76	10,218,793.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		9,047,139,699.01	8,276,327,319.30
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		24,002,840.02	52,013,215.55
应付清算款		-	3,002,517.73
应付赎回款		56,650,383.09	46,417,458.13
应付管理人报酬		68,003.94	64,093.31
应付托管费		22,667.98	21,364.44
应付销售服务费		261,920.27	198,020.76
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,396,788.82	1,695,298.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	163,200.26	234,247.68
负债合计		83,565,804.38	103,646,215.65
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	3,550,547,362.69	3,906,741,764.81
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	5,413,026,531.94	4,265,939,338.84
净资产合计		8,963,573,894.63	8,172,681,103.65
负债和净资产总计		9,047,139,699.01	8,276,327,319.30

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，南方中证 500ETF 联接（LOF）A 份额净值 2.5325 元，基金份额总额 3,033,450,255.70 份；南方中证 500ETF 联接（LOF）C 份额净值 2.4516 元，基金份额总额 347,558,324.84 份；南方中证 500ETF 联接（LOF）I 份额净值 2.5320 元，基金份额总额 151,900,632.82 份；南方中证 500ETF 联接 Y 份额净值 2.5324 元，基金份额总额 17,638,149.33 份；总份额合计 3,550,547,362.69 份。

6.2 利润表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,644,942,187.86	354,349,555.40
1.利息收入		1,272,560.67	1,173,016.68
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,272,560.67	1,173,016.68
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		503,870,550.65	188,237,915.15
其中：股票投资收益	6.4.7.10	26,851,160.77	3,825,103.67
基金投资收益	6.4.7.11	410,474,683.77	49,524,299.45
债券投资收益	6.4.7.12	1,871,444.84	1,767,747.71
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	64,673,261.27	133,120,764.32
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,138,903,448.92	164,521,446.32
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	895,627.62	417,177.25
减：二、营业总支出		3,793,972.71	2,974,560.93
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	414,782.97	409,898.07
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	138,261.01	136,632.66
3.销售服务费	6.4.10.2.3	1,576,223.39	1,520,979.24
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		342,143.17	612,855.16
其中：卖出回购金融资产支出		342,143.17	612,855.16
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		1,199,337.76	178,434.96

8.其他费用	6.4.7.19	123,224.41	115,760.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,641,148,215.15	351,374,994.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,641,148,215.15	351,374,994.47
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,641,148,215.15	351,374,994.47

6.3 净资产变动表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,906,741,764.81	-	4,265,939,338.84	8,172,681,103.65
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,906,741,764.81	-	4,265,939,338.84	8,172,681,103.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-356,194,402.12	-	1,147,087,193.10	790,892,790.98
（一）、综合收益总额	-	-	1,641,148,215.15	1,641,148,215.15
（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）	-356,194,402.12	-	-494,061,022.05	-850,255,424.17
其中：1.基金申购款	1,567,241,450.67	-	2,005,191,416.43	3,572,432,867.10
2.基金赎回款	-1,923,435,852.79	-	-2,499,252,438.48	-4,422,688,291.27

(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	3,550,547,362.69	-	5,413,026,531.94	8,963,573,894.63
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,563,880,816.08	-	3,330,451,863.40	8,894,332,679.48
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	5,563,880,816.08	-	3,330,451,863.40	8,894,332,679.48
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-387,665,164.42	-	102,413,637.94	-285,251,526.48
(一)、综合收益总额	-	-	351,374,994.47	351,374,994.47
(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)	-387,665,164.42	-	-248,961,356.53	-636,626,520.95
其中：1.基金申购款	742,909,245.14	-	445,895,502.81	1,188,804,747.95
2.基金赎回款	-1,130,574,409.56	-	-694,856,859.34	-1,825,431,268.90
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变	-	-	-	-

动（净资产减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	5,176,215,651.66	-	3,432,865,501.34	8,609,081,153.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____杨小松____ ____蔡忠评____ ____徐超____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) (以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]755 号《关于核准南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司,已于 2018 年 1 月 4 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,222,521,419.53 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 187 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2009 年 9 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,223,217,818.45 份基金份额,其中认购资金利息折合 696,398.92 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2009]147 号审核同意,本基金 581,411,748.00 份基金份额于 2009 年 11 月 11 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关约定,基金管理人经与基金托管人协商一致,将南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)更名为南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF),并对《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)的基金合同》进行了修订,修订后的《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》于 2013 年 2 月 22 日经中国证监会备案后生效。

根据本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2017 年 2 月 20 日发布的《关于南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)增加 C 类份额并修改基金合同的公告》、2024 年 4 月 8 日发布的《南方基金管理股份有限公司关于旗下部分指数基金增设 I 类基金份额并修订基金合同的公告》、2024 年 12 月 12 日发布的《南方基金管理股份有限公司关于旗下部分指数基金增加个人养老金单独份额类别并修订基金合同、托管协议的公告》以及更新后的《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》的有关规定,自 2017 年 2 月 23 日起,本基金增设 C 类基金份额;自 2024 年 4 月 8 日起,本基金增设 I 类基金份额;自 2024 年 12 月 13 日起,本基金增设 Y 类基金份额。

本基金根据费率设置的不同,将基金份额分为不同的类别,不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额或 I 类基金份额;投资人通过个人养老金资金账户申购的基金份额类别(个人养老金相关制度另有规定的除外),称为 Y 类基金份额,本类别基金资产不计提销售服务费。本基金 A 类基金份额的申购与赎回包括场外和场内两种方式,本基金 C 类、I 类、Y 类基金份额在场外申购和赎回。A 类基金份额和 C 类、I 类、Y 类基金份额之间不能互相转换。本基金 A 类、C 类、I 类和 Y 类基金份额分别设置代码并分别计算并公告基金份额净值。

本基金为中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对中证 500 指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%,年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,于 2013 年 2 月 22 日前,本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证 500 指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中,中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,权证及其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》的有关规定,自 2013 年 2 月 22 日起,本基金的投资范围为目标 ETF、中证 500 指数成份股和备选成份股,本基金可少量投资于新股(一级市场初次发行或增发)、债券及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金可投资存托凭证。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%(已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内),基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集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》《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策,会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	196,694,337.16
等于：本金	196,642,181.80
加：应计利息	52,155.36
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	196,694,337.16

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		124,857,968.21	-	159,314,463.03	34,456,494.82
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	263,394,193.00	1,943,987.58	265,404,177.58	65,997.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	263,394,193.00	1,943,987.58	265,404,177.58	65,997.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		5,203,022,099.25	-	8,387,658,550.98	3,184,636,451.73
其他		-	-	-	-
合计		5,591,274,260.46	1,943,987.58	8,812,377,191.59	3,219,158,943.55

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	50,570.54
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	8,491.37
其中：交易所市场	8,491.37
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	-
预提费用	104,138.35
应付指数使用费	-
可退替代款	-
合计	163,200.26

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方中证 500ETF 联接（LOF）A		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,485,811,266.33	3,485,811,266.33
本期申购	700,105,392.47	700,105,392.47
本期赎回（以“-”号填列）	-1,152,466,403.10	-1,152,466,403.10
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	3,033,450,255.70	3,033,450,255.70

南方中证 500ETF 联接（LOF）C		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	278,114,470.86	278,114,470.86
本期申购	630,604,142.61	630,604,142.61
本期赎回（以“-”号填列）	-561,160,288.63	-561,160,288.63
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	347,558,324.84	347,558,324.84

南方中证 500ETF 联接（LOF）I	
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	137,621,193.57	137,621,193.57
本期申购	214,099,714.36	214,099,714.36
本期赎回（以“-”号填列）	-199,820,275.11	-199,820,275.11
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	151,900,632.82	151,900,632.82

南方中证 500ETF 联接 Y		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,194,834.05	5,194,834.05
本期申购	22,432,201.23	22,432,201.23
本期赎回（以“-”号填列）	-9,988,885.95	-9,988,885.95
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	17,638,149.33	17,638,149.33

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

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

南方中证 500ETF 联接（LOF）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,707,750,440.33	-885,787,812.12	3,821,962,628.21
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,707,750,440.33	-885,787,812.12	3,821,962,628.21
本期利润	428,139,521.97	1,000,527,587.54	1,428,667,109.51
本期基金份额交易产生的变动数	-634,424,812.95	32,566,203.91	-601,858,609.04
其中：基金申购款	982,516,085.85	-61,175,706.58	921,340,379.27
基金赎回款	-1,616,940,898.80	93,741,910.49	-1,523,198,988.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,501,465,149.35	147,305,979.33	4,648,771,128.68

南方中证 500ETF 联接 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	360,212,940.69	-72,783,358.39	287,429,582.30
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	360,212,940.69	-72,783,358.39	287,429,582.30
本期利润	42,975,135.35	88,431,589.64	131,406,724.99
本期基金份额交易产生的变动数	90,344,529.83	-4,663,679.78	85,680,850.05
其中：基金申购款	849,139,824.67	-60,810,113.54	788,329,711.13
基金赎回款	-758,795,294.84	56,146,433.76	-702,648,861.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	493,532,605.87	10,984,551.47	504,517,157.34

南方中证 500ETF 联接 (LOF) I			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	185,831,751.87	-34,980,015.64	150,851,736.23
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	185,831,751.87	-34,980,015.64	150,851,736.23
本期利润	28,957,804.46	46,785,512.44	75,743,316.90
本期基金份额交易产生的变动数	10,560,706.20	-4,446,501.52	6,114,204.68
其中：基金申购款	290,172,204.61	-24,400,390.70	265,771,813.91
基金赎回款	-279,611,498.41	19,953,889.18	-259,657,609.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	225,350,262.53	7,358,995.28	232,709,257.81

南方中证 500ETF 联接 Y			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,015,312.19	-1,319,920.09	5,695,392.10
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	7,015,312.19	-1,319,920.09	5,695,392.10
本期利润	2,172,304.45	3,158,759.30	5,331,063.75
本期基金份额交易产生的变动数	16,984,535.14	-982,002.88	16,002,532.26

其中：基金申购款	31,251,691.27	-1,502,179.15	29,749,512.12
基金赎回款	-14,267,156.13	520,176.27	-13,746,979.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,172,151.78	856,836.33	27,028,988.11

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,256,170.69
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	2,288.58
其他	14,101.40
合计	1,272,560.67

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	20,958,983.68
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	5,892,177.09
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	26,851,160.77

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	154,828,837.00
减：卖出股票成本总额	133,747,606.14
减：交易费用	122,247.18
买卖股票差价收入	20,958,983.68

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	200,949,920.00
减：现金支付申购款总额	106,495,728.64
减：申购股票成本总额	88,562,014.27
减：交易费用	-
申购差价收入	5,892,177.09

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	1,265,839,681.01
减：卖出/赎回基金成本总额	845,340,073.94
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	9,970,414.69
减：交易费用	54,508.61
基金投资收益	410,474,683.77

注：上述交易费用（如有）包含基金买卖或申赎产生的交易费用。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	1,719,523.13
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	151,921.71
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	1,871,444.84

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	235,526,331.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	232,303,867.00
减：应计利息总额	3,070,540.38
减：交易费用	2.24
买卖债券差价收入	151,921.71

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	972,694.27
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	63,700,567.00
合计	64,673,261.27

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	1,138,903,448.92
——股票投资	9,471,115.40
——债券投资	-132,798.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	1,129,565,131.52
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,138,903,448.92

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	869,206.78
基金转换费收入	26,420.84
合计	895,627.62

6.4.7.18 信用减值损失

无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

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

审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	19,044.69
其他	41.37
合计	123,224.41

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司（“南方基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
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
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
中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（“目标 ETF”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

华泰证券	29,908,373.04	10.95%	68,718,603.88	34.52%
------	---------------	--------	---------------	--------

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	9,793.49	0.00%	60,860.23	0.11%

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	2,982.99	10.93%	2,931.03	34.52%
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	6,866.13	34.51%	4,154.97	47.02%

注：1. 上述佣金费率参考市场价格确定。

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管	414,782.97	409,898.07

理费		
其中：应支付销售机构的客 户维护费	2,445,873.65	2,357,517.00
应支付基金管理人的 净管理费	-2,031,090.68	-1,947,618.93

注 本基金投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付销售机构的客户维护费不因投资于目标 ETF 而调减，因此可能导致应支付基金管理人的净管理费为负。

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扣除本基金持有的目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 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-前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产） $\times$ 0.15% $\div$ 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托 管费	138,261.01	136,632.66

注 本基金投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）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-前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产） $\times$ 0.05% $\div$ 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服 务费的各关 联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	南方中证 500ETF 联接 (LOF) I	南方中证 500ETF 联接 Y	合计
华泰证券	-	18,422.79	-	-	18,422.79
南方基金	-	79,755.04	24,613.24	-	104,368.28
农业银行	-	18,899.49	-	-	18,899.49
兴业证券	-	132.17	-	-	132.17
合计	-	117,209.49	24,613.24	-	141,822.73
获得销售服 务费的各关 联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	南方中证	南方中证	南方中证	南方中证	合计

	500ETF 联接 (LOF) A	500ETF 联接 (LOF) C	500ETF 联接 (LOF) I	500ETF 联接 Y	
华泰证券	-	9,311.85	-	-	9,311.85
南方基金	-	35,869.85	724.70	-	36,594.55
农业银行	-	248,140.21	-	-	248,140.21
兴业证券	-	71.02	-	-	71.02
合计	-	293,392.93	724.70	-	294,117.63

注：1. 支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类、I 类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给各基金销售机构。C 类、I 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.40%、0.10%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日各类基金份额的基金资产净值 × 约定年费率 ÷ 当年天数。

2. 根据《南方基金关于开展旗下部分基金销售服务费费率优惠活动的公告》，自 2024 年 4 月 9 日起，本基金 I 类基金份额的销售服务费适用 0.01% 的年费率。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	196,694,337.16	1,256,170.69	214,030,357.13	1,166,591.32

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	603293	埃泰克	网下申购	716	23,978.84
华泰联合	113704	春风转债	配债	210	21,000.00

上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	301458	钧崑电子	网下申购	7,005	72,852.00
华泰联合	603014	威高血净	网下申购	2,045	54,192.50
华泰联合	688757	胜科纳米	网下申购	5,357	48,641.56
华泰联合	127108	太能转债	配债	381	38,100.00

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于本期末，本基金持有目标 ETF 基金份额，成本总额为人民币 5,203,022,099.25 元，估值总额为人民币 8,387,658,550.98 元，占本基金基金净资产的比例为 93.57%（于上期末，本基金持有目标 ETF 基金份额，成本总额为人民币 5,599,914,680.54 元，估值总额为人民币 7,654,986,000.75 元，占本基金基金净资产的比例为 93.67%）。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

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

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001248	华润新能源	2026 年 6 月	6 个月	新股锁定期	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-

		24 日								
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内 (含)	新股未上市	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定期	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定期	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定期	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定期	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股锁定期	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定期	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁定期	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁定期	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
688811	有研复材	2026	6 个月	新股锁	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-

		年 4 月 1 日		定期						
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股锁 定期	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	58.00	112.1 6	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	78.38	121.7 7	96	7,524.48	11,689.92	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁 定期	22.68	47.61	217	4,921.56	10,331.37	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月	6 个月	新股锁 定期	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-

		15 日								
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定期	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
920193	吉和昌	2026 年 6 月 18 日	1 个月内 (含)	新股未上市	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定期	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定期	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
920189	康美特	2026 年 6 月 30 日	1 个月内 (含)	新股未上市	8.14	8.14	200	1,628.00	1,628.00	-
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定期	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026 年 6 月 26 日	1 个月内 (含)	新债未上市	100.00	100.00	280	28,000.00	28,000.37	-
113704	春风转债	2026 年 6 月 11 日	1 个月内 (含)	新债未上市	100.00	100.00	210	21,000.00	21,000.97	-
118071	华峰转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月内 (含)	新债未上市	100.00	100.00	70	7,000.00	7,000.12	-
118070	南芯转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月内 (含)	新债未上市	100.00	100.01	10	1,000.00	1,000.06	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天 3	2023 年 8 月 30 日	暂停转让	0.14	-	-	95,400	100,170.00	13,356.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 24,002,840.02 元,于 2026 年 7 月 14 日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金,本基金紧密跟踪标的指数,具有和标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资的金融工具主要包括基金投资和股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内,使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”的风险收益目标。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金

持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合该要求。

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

同时，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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	196,694,337.16	-	-	-	196,694,337.16
结算备付金	1,025,469.59	-	-	-	1,025,469.59
存出保证金	410,645.05	-	-	-	410,645.05
交易性金融	265,347,176.	-	57,001.52	8,546,973,01	8,812,377,19

资产	06			4.01	1.59
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	14,936,295.86	14,936,295.86
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	238,080.90	-	-	21,457,678.86	21,695,759.76
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	463,715,708.76	-	57,001.52	8,583,366,988.73	9,047,139,699.01
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	24,002,840.02	-	-	-	24,002,840.02
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	56,650,383.09	56,650,383.09
应付管理人报酬	-	-	-	68,003.94	68,003.94
应付托管费	-	-	-	22,667.98	22,667.98
应付销售服务费	-	-	-	261,920.27	261,920.27
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2,396,788.82	2,396,788.82
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	163,200.26	163,200.26

负债总计	24,002,840.0 2	-	-	59,562,964.3 6	83,565,804.3 8
利率敏感度 缺口	439,712,868. 74	-	57,001.52	8,523,804,02 4.37	8,963,573,89 4.63
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	211,784,808. 95	-	-	-	211,784,808. 95
结算备付金	458,032.32	-	-	-	458,032.32
存出保证金	1,238,763.00	-	-	-	1,238,763.00
交易性金融 资产	264,681,932. 34	-	15,000.23	7,787,807,63 9.20	8,052,504,57 1.77
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	-	-	-	122,349.99	122,349.99
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	285,139.52	-	-	9,933,653.75	10,218,793.2 7
递延所得税 资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	478,448,676. 13	-	15,000.23	7,797,863,64 2.94	8,276,327,31 9.30
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	52,013,215.5 5	-	-	-	52,013,215.5 5
应付清算款	-	-	-	3,002,517.73	3,002,517.73
应付赎回款	-	-	-	46,417,458.1 3	46,417,458.1 3

应付管理人报酬	-	-	-	64,093.31	64,093.31
应付托管费	-	-	-	21,364.44	21,364.44
应付销售服务费	-	-	-	198,020.76	198,020.76
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,695,298.05	1,695,298.05
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	234,247.68	234,247.68
负债总计	52,013,215.55	-	-	51,633,000.10	103,646,215.65
利率敏感度缺口	426,435,460.58	-	15,000.23	7,746,230,642.84	8,172,681,103.65

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	-283,341.57	-177,261.73
	2.市场利率平行下降 25 个基点	284,038.08	177,568.18

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股和备选成份股，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。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产- 股票投资	159,314,463.03	1.78	132,821,638.45	1.63
交易性金融资产- 基金投资	8,387,658,550.98	93.57	7,654,986,000.75	93.67
交易性金融资产- 债券投资	57,001.52	0.00	15,000.23	0.00
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	8,547,030,015.53	95.35	7,787,822,639.43	95.29

注：交易性金融资产-债券投资项目仅包含可转换公司债券或可交换公司债券。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2026 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）
	1.组合自身基准上升 5%	426,155,058.39	388,164,221.25
	2.组合自身基准下降 5%	-426,155,058.39	-388,164,221.25

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	8,544,058,877.53

第二层次	266,258,653.02
第三层次	2,059,661.04
合计	8,812,377,191.59

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	159,314,463.03	1.76
	其中：股票	159,314,463.03	1.76
2	基金投资	8,387,658,550.98	92.71
3	固定收益投资	265,404,177.58	2.93
	其中：债券	265,404,177.58	2.93
	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	197,719,806.75	2.19
8	其他各项资产	37,042,700.67	0.41
9	合计	9,047,139,699.01	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	491,907.00	0.01
B	采矿业	4,932,879.02	0.06
C	制造业	119,374,244.34	1.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,698,488.30	0.05
E	建筑业	903,397.02	0.01
F	批发和零售业	2,927,507.12	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	1,855,386.65	0.02
H	住宿和餐饮业	118,734.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,067,204.89	0.11
J	金融业	8,901,935.25	0.10
K	房地产业	673,712.00	0.01
L	租赁和商务服务业	1,600,682.60	0.02
M	科学研究和技术服务业	1,152,793.44	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	516,351.16	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	384,290.84	0.00
R	文化、体育和娱乐业	714,949.40	0.01
S	综合	-	-
	合计	159,314,463.03	1.78

7.2.2 期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	688498	源杰科技	1,374	2,591,364.00	0.03
2	300604	长川科技	6,100	2,082,662.00	0.02
3	001309	德明利	2,200	2,074,380.00	0.02
4	688347	华虹宏力	5,629	1,893,032.70	0.02

5	688120	华海清科	5,460	1,759,102.80	0.02
6	002281	光迅科技	6,700	1,721,498.00	0.02
7	002008	大族激光	11,400	1,711,254.00	0.02
8	300136	信维通信	13,400	1,597,950.00	0.02
9	300857	协创数据	4,620	1,570,338.00	0.02
10	688361	中科飞测	3,381	1,453,830.00	0.02
11	300475	香农芯创	4,500	1,350,000.00	0.02
12	300223	北京君正	5,300	1,319,170.00	0.01
13	002436	兴森科技	23,500	1,197,325.00	0.01
14	300285	国瓷材料	11,000	1,134,980.00	0.01
15	300054	鼎龙股份	10,400	1,102,088.00	0.01
16	600105	永鼎股份	16,100	1,086,428.00	0.01
17	300666	江丰电子	2,900	1,068,940.00	0.01
18	688777	中控技术	8,777	1,031,297.50	0.01
19	688200	华峰测控	1,937	1,017,118.70	0.01
20	300757	罗博特科	1,600	990,400.00	0.01
21	688037	芯源微	2,227	977,764.35	0.01
22	002851	麦格米特	5,600	936,208.00	0.01
23	000021	深科技	14,500	931,915.00	0.01
24	601869	长飞光纤	1,700	928,030.00	0.01
25	300548	长芯博创	3,300	917,400.00	0.01
26	300346	南大光电	9,500	880,175.00	0.01
27	002409	雅克科技	3,900	875,550.00	0.01
28	300567	精测电子	2,700	857,520.00	0.01
29	688019	安集科技	2,511	852,384.06	0.01
30	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.01
31	002185	华天科技	37,500	836,625.00	0.01
32	002407	多氟多	16,400	823,772.00	0.01
33	600498	烽火通信	11,100	816,960.00	0.01
34	002138	顺络电子	11,100	811,410.00	0.01
35	688313	仕佳光子	4,365	805,997.25	0.01
36	300620	光库科技	2,100	794,220.00	0.01
37	688002	睿创微纳	5,083	786,289.27	0.01
38	300395	菲利华	5,800	775,634.00	0.01
39	600879	航天电子	36,420	775,381.80	0.01
40	688469	芯联集成	72,977	774,285.97	0.01
41	300390	天华新能	8,070	754,625.70	0.01
42	688017	绿的谐波	1,795	750,058.70	0.01
43	301526	国际复材	15,600	728,052.00	0.01
44	300373	扬杰科技	4,500	707,535.00	0.01
45	300058	蓝色光标	49,560	681,945.60	0.01
46	002273	水晶光电	19,188	680,790.24	0.01
47	300037	新宙邦	7,271	675,112.35	0.01

48	603256	宏和科技	2,500	663,325.00	0.01
49	688172	燕东微	7,878	659,073.48	0.01
50	688702	盛科通信	1,670	651,283.30	0.01
51	300751	迈为股份	2,200	621,412.00	0.01
52	301377	鼎泰高科	1,100	605,990.00	0.01
53	600988	赤峰黄金	23,000	605,360.00	0.01
54	605358	立昂微	7,800	605,280.00	0.01
55	600392	盛和资源	20,310	604,628.70	0.01
56	688099	晶晨股份	5,787	595,482.30	0.01
57	605589	圣泉集团	9,300	591,201.00	0.01
58	002738	中矿资源	9,940	586,360.60	0.01
59	600885	宏发股份	16,944	584,398.56	0.01
60	002126	银轮股份	11,700	582,660.00	0.01
61	000960	锡业股份	13,600	580,584.00	0.01
62	600601	方正科技	41,300	571,592.00	0.01
63	000831	中国稀土	10,300	571,547.00	0.01
64	001389	广合科技	2,400	569,400.00	0.01
65	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.01
66	002812	恩捷股份	8,100	541,971.00	0.01
67	600497	驰宏锌锗	44,300	536,473.00	0.01
68	600378	昊华科技	7,100	535,198.00	0.01
69	301358	湖南裕能	7,000	531,090.00	0.01
70	601179	中国西电	35,400	528,168.00	0.01
71	600141	兴发集团	11,184	525,312.48	0.01
72	688234	天岳先进	2,964	514,283.64	0.01
73	002195	岩山科技	78,258	511,807.32	0.01
74	300570	太辰光	2,000	493,420.00	0.01
75	002850	科达利	2,600	492,180.00	0.01
76	002261	拓维信息	17,400	487,374.00	0.01
77	600157	永泰能源	301,200	484,932.00	0.01
78	688052	纳芯微	1,648	475,134.88	0.01
79	600143	金发科技	30,600	472,770.00	0.01
80	000783	长江证券	48,400	471,900.00	0.01
81	600711	盛屯矿业	42,600	467,322.00	0.01
82	002340	格林美	70,600	466,666.00	0.01
83	600352	浙江龙盛	37,800	457,758.00	0.01
84	601555	东吴证券	57,700	456,984.00	0.01
85	002821	凯莱英	2,800	453,600.00	0.01
86	600909	华安证券	40,688	452,043.68	0.01
87	003031	中瓷电子	2,500	450,750.00	0.01
88	002131	利欧股份	93,400	443,650.00	0.00
89	688220	翱捷科技	3,565	443,200.80	0.00
90	300017	网宿科技	34,000	442,340.00	0.00

91	688411	海博思创	1,510	439,712.00	0.00
92	000703	恒逸石化	32,100	435,597.00	0.00
93	301200	大族数控	1,200	432,780.00	0.00
94	601233	桐昆股份	19,900	430,835.00	0.00
95	002966	苏州银行	61,700	429,432.00	0.00
96	688629	华丰科技	2,289	429,210.39	0.00
97	688213	思特威	3,984	426,566.88	0.00
98	603659	璞泰来	14,700	425,271.00	0.00
99	300339	润和软件	11,000	423,610.00	0.00
100	688027	国盾量子	838	422,360.38	0.00
101	002472	双环传动	10,100	419,251.00	0.00
102	688122	西部超导	6,614	415,425.34	0.00
103	300759	康龙化成	14,300	413,699.00	0.00
104	300001	特锐德	10,888	411,893.04	0.00
105	601108	财通证券	47,200	408,280.00	0.00
106	002517	恺英网络	25,100	407,875.00	0.00
107	002203	海亮股份	17,600	402,160.00	0.00
108	002797	第一创业	61,200	402,084.00	0.00
109	603308	应流股份	6,600	398,640.00	0.00
110	688235	百济神州	1,562	397,700.82	0.00
111	301611	珂玛科技	2,200	396,154.00	0.00
112	688387	信科移动	19,842	393,665.28	0.00
113	601958	金钼股份	14,000	393,540.00	0.00
114	300207	欣旺达	20,400	387,396.00	0.00
115	603129	春风动力	1,500	383,700.00	0.00
116	600563	法拉电子	2,000	381,600.00	0.00
117	300458	全志科技	9,620	379,605.20	0.00
118	002601	龙佰集团	23,000	379,040.00	0.00
119	601198	东兴证券	27,400	372,366.00	0.00
120	002465	海格通信	29,100	371,607.00	0.00
121	300115	长盈精密	13,100	366,014.00	0.00
122	002056	横店东磁	12,000	365,760.00	0.00
123	601991	大唐发电	51,300	363,204.00	0.00
124	002155	湖南黄金	15,120	360,914.40	0.00
125	601665	齐鲁银行	62,500	360,625.00	0.00
126	300024	机器人	18,500	357,605.00	0.00
127	688578	艾力斯	3,265	356,538.00	0.00
128	601162	天风证券	103,000	347,110.00	0.00
129	300454	深信服	3,600	346,320.00	0.00
130	002429	兆驰股份	33,100	343,909.00	0.00
131	603156	养元饮品	7,000	343,490.00	0.00
132	300012	华测检测	24,600	340,956.00	0.00
133	603179	新泉股份	6,860	340,599.00	0.00

134	688385	复旦微电	4,771	340,124.59	0.00
135	688676	金盘科技	3,998	338,390.72	0.00
136	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.00
137	600707	彩虹股份	19,800	334,422.00	0.00
138	000733	振华科技	5,900	334,176.00	0.00
139	002444	巨星科技	10,718	333,329.80	0.00
140	601099	太平洋	98,900	333,293.00	0.00
141	603650	彤程新材	3,400	333,132.00	0.00
142	002414	高德红外	25,000	331,500.00	0.00
143	600109	国金证券	37,700	331,006.00	0.00
144	002130	沃尔核材	17,400	329,904.00	0.00
145	000878	云南铜业	20,600	327,128.00	0.00
146	688322	奥比中光	2,490	325,069.50	0.00
147	603688	石英股份	3,900	322,179.00	0.00
148	688331	荣昌生物	2,455	319,788.30	0.00
149	688301	奕瑞科技	2,576	319,424.00	0.00
150	603979	金诚信	5,400	318,762.00	0.00
151	603379	三美股份	4,200	318,738.00	0.00
152	600298	安琪酵母	8,800	318,560.00	0.00
153	002432	九安医疗	4,500	318,060.00	0.00
154	600060	海信视像	11,400	317,718.00	0.00
155	689009	九号公司	8,326	317,636.90	0.00
156	300748	金力永磁	10,220	315,287.00	0.00
157	300496	中科创达	5,100	315,129.00	0.00
158	000893	亚钾国际	7,700	314,853.00	0.00
159	000034	神州数码	11,200	310,800.00	0.00
160	600884	杉杉股份	22,800	308,940.00	0.00
161	600699	均胜电子	14,266	308,288.26	0.00
162	601128	常熟银行	52,888	307,808.16	0.00
163	600021	上海电力	20,398	307,397.86	0.00
164	002078	太阳纸业	24,600	307,254.00	0.00
165	002487	大金重工	5,300	307,241.00	0.00
166	601696	中银证券	24,200	306,130.00	0.00
167	601615	明阳智能	26,400	305,448.00	0.00
168	601577	长沙银行	35,000	304,850.00	0.00
169	600256	广汇能源	61,700	304,798.00	0.00
170	300142	沃森生物	23,400	303,966.00	0.00
171	000661	长春高新	4,500	299,700.00	0.00
172	603606	东方电缆	7,200	298,872.00	0.00
173	300763	锦浪科技	3,300	298,155.00	0.00
174	300073	当升科技	6,200	297,848.00	0.00
175	002402	和而泰	11,500	297,045.00	0.00
176	603087	甘李药业	5,200	295,152.00	0.00

177	002025	航天电器	3,800	289,636.00	0.00
178	000060	中金岭南	38,200	289,174.00	0.00
179	000728	国元证券	38,200	286,118.00	0.00
180	300919	中伟新材	6,500	284,375.00	0.00
181	688343	云天励飞	3,472	283,523.52	0.00
182	002271	东方雨虹	23,700	281,319.00	0.00
183	000423	东阿阿胶	6,200	281,232.00	0.00
184	002756	永兴材料	4,900	277,536.00	0.00
185	002831	裕同科技	7,803	277,474.68	0.00
186	002335	科华数据	6,525	276,986.25	0.00
187	002252	上海莱士	63,700	276,458.00	0.00
188	002064	华峰化学	29,100	276,159.00	0.00
189	688599	天合光能	19,389	273,772.68	0.00
190	688169	石头科技	2,861	271,709.17	0.00
191	301536	星宸科技	2,100	270,291.00	0.00
192	300623	捷捷微电	6,000	269,940.00	0.00
193	688266	泽璟制药	2,300	268,318.00	0.00
194	300724	捷佳伟创	3,800	268,280.00	0.00
195	300953	震裕科技	2,000	267,400.00	0.00
196	688608	恒玄科技	1,597	267,002.43	0.00
197	300677	英科医疗	6,800	266,356.00	0.00
198	688180	君实生物	7,784	263,254.88	0.00
199	300383	光环新网	21,100	262,484.00	0.00
200	600171	上海贝岭	8,200	261,908.00	0.00
201	000519	中兵红箭	12,400	261,268.00	0.00
202	603290	斯达半导	1,700	259,998.00	0.00
203	603920	世运电路	5,400	259,416.00	0.00
204	603119	浙江荣泰	3,900	258,726.00	0.00
205	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
206	002157	正邦科技	91,900	258,239.00	0.00
207	688375	国博电子	2,469	257,516.70	0.00
208	300432	富临精工	12,700	255,143.00	0.00
209	000786	北新建材	14,100	255,069.00	0.00
210	001203	大中矿业	8,500	254,575.00	0.00
211	002673	西部证券	39,200	254,408.00	0.00
212	300474	景嘉微	4,200	254,016.00	0.00
213	300558	贝达药业	3,900	253,773.00	0.00
214	600177	雅戈尔	33,580	252,857.40	0.00
215	600516	方大炭素	40,900	252,353.00	0.00
216	688065	凯赛生物	5,233	250,399.05	0.00
217	688188	柏楚电子	2,344	250,104.80	0.00
218	000623	吉林敖东	14,100	249,993.00	0.00
219	300699	光威复材	8,700	249,255.00	0.00

220	002624	完美世界	20,000	248,400.00	0.00
221	688187	时代电气	3,596	246,901.36	0.00
222	603160	汇顶科技	4,000	246,840.00	0.00
223	002318	久立特材	10,200	243,780.00	0.00
224	688568	中科星图	5,873	243,553.31	0.00
225	603345	安井食品	3,000	240,570.00	0.00
226	000750	国海证券	65,210	239,972.80	0.00
227	688728	格科微	11,320	238,172.80	0.00
228	000559	万向钱潮	18,300	236,619.00	0.00
229	002065	东华软件	32,800	234,192.00	0.00
230	600369	西南证券	57,900	232,758.00	0.00
231	600637	东方明珠	27,800	231,018.00	0.00
232	600536	中国软件	8,200	230,584.00	0.00
233	600499	科达制造	16,700	230,460.00	0.00
234	002044	美年健康	45,800	230,374.00	0.00
235	000400	许继电气	10,600	230,020.00	0.00
236	002430	杭氧股份	7,400	229,104.00	0.00
237	002223	鱼跃医疗	8,916	228,784.56	0.00
238	300003	乐普医疗	19,300	228,705.00	0.00
239	002085	万丰奥威	20,600	228,454.00	0.00
240	000983	山西焦煤	39,200	227,360.00	0.00
241	603596	伯特利	9,117	226,466.28	0.00
242	000629	钒钛股份	67,800	226,452.00	0.00
243	300002	神州泰岳	28,600	223,366.00	0.00
244	688018	乐鑫科技	1,743	222,964.56	0.00
245	688617	惠泰医疗	1,228	222,955.68	0.00
246	600863	华能蒙电	47,400	222,780.00	0.00
247	600100	同方股份	32,400	221,940.00	0.00
248	000683	博源化工	38,200	220,032.00	0.00
249	600985	淮北矿业	15,600	219,180.00	0.00
250	601216	君正集团	49,000	218,540.00	0.00
251	601212	白银有色	43,000	218,440.00	0.00
252	601717	中创智领	15,692	218,275.72	0.00
253	603806	福斯特	13,000	218,270.00	0.00
254	600862	中航高科	12,100	218,163.00	0.00
255	603225	新凤鸣	11,100	218,115.00	0.00
256	000039	中集集团	26,850	217,753.50	0.00
257	002841	视源股份	6,300	217,539.00	0.00
258	601997	贵阳银行	42,400	217,512.00	0.00
259	600595	中孚实业	38,700	217,494.00	0.00
260	603699	纽威股份	4,300	216,290.00	0.00
261	000738	航发控制	11,700	213,993.00	0.00
262	600704	物产中大	45,200	213,344.00	0.00

263	000155	川能动力	17,800	213,244.00	0.00
264	600873	梅花生物	29,000	213,150.00	0.00
265	601699	潞安环能	14,900	212,772.00	0.00
266	600642	申能股份	24,300	212,139.00	0.00
267	601990	南京证券	32,100	210,897.00	0.00
268	601001	晋控煤业	12,100	210,419.00	0.00
269	601016	节能风电	54,140	210,063.20	0.00
270	300679	电连技术	3,500	209,965.00	0.00
271	000729	燕京啤酒	20,700	209,691.00	0.00
272	000887	中鼎股份	11,700	209,313.00	0.00
273	688538	和辉光电	80,278	208,722.80	0.00
274	600312	平高电气	11,800	208,388.00	0.00
275	603077	和邦生物	89,720	208,150.40	0.00
276	300972	万辰集团	1,200	208,092.00	0.00
277	300487	蓝晓科技	3,500	205,975.00	0.00
278	603605	珀莱雅	3,400	203,728.00	0.00
279	000830	鲁西化工	16,910	202,920.00	0.00
280	000415	渤海租赁	49,300	200,651.00	0.00
281	600166	福田汽车	68,900	200,499.00	0.00
282	600348	华阳股份	26,200	200,430.00	0.00
283	600153	建发股份	25,200	199,836.00	0.00
284	002683	广东宏大	6,800	199,172.00	0.00
285	002939	长城证券	23,500	195,990.00	0.00
286	000967	盈峰环境	18,600	195,858.00	0.00
287	688297	中无人机	4,656	193,456.80	0.00
288	688772	珠海冠宇	9,855	193,453.65	0.00
289	600901	江苏金租	33,600	193,200.00	0.00
290	002266	浙富控股	38,100	192,786.00	0.00
291	600363	联创光电	5,300	189,634.00	0.00
292	688582	芯动联科	2,907	188,955.00	0.00
293	002926	华西证券	23,100	188,727.00	0.00
294	600521	华海药业	13,100	188,640.00	0.00
295	000921	海信家电	6,900	188,508.00	0.00
296	601611	中国核建	16,600	185,090.00	0.00
297	002603	以岭药业	12,300	184,500.00	0.00
298	000591	太阳能	40,000	184,000.00	0.00
299	688615	合合信息	1,622	183,448.20	0.00
300	002739	儒意电影	19,100	183,360.00	0.00
301	603766	隆鑫通用	15,300	182,529.00	0.00
302	600398	海澜之家	34,800	182,004.00	0.00
303	603568	伟明环保	11,832	181,976.16	0.00
304	600737	中粮糖业	14,717	181,460.61	0.00
305	603298	杭叉集团	7,580	180,858.80	0.00

306	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
307	300627	华测导航	6,320	179,488.00	0.00
308	603444	吉比特	500	179,210.00	0.00
309	600578	京能电力	27,700	178,665.00	0.00
310	601000	唐山港	43,019	178,528.85	0.00
311	000050	深天马 A	18,000	178,380.00	0.00
312	600486	扬农化工	3,500	177,450.00	0.00
313	600765	中航重机	13,686	176,823.12	0.00
314	600316	洪都航空	6,285	175,602.90	0.00
315	600208	衢州发展	61,700	174,611.00	0.00
316	600332	白云山	8,700	174,348.00	0.00
317	600008	首创环保	63,920	173,862.40	0.00
318	000737	北方铜业	13,100	173,182.00	0.00
319	000987	越秀资本	22,025	172,235.50	0.00
320	600170	上海建工	77,400	171,828.00	0.00
321	688692	达梦数据	703	171,735.87	0.00
322	002152	广电运通	18,300	171,654.00	0.00
323	600998	九州通	36,550	171,419.50	0.00
324	600995	南网储能	13,900	170,970.00	0.00
325	002262	恩华药业	9,100	170,625.00	0.00
326	688248	南网科技	2,458	170,044.44	0.00
327	000032	深桑达 A	6,800	169,660.00	0.00
328	002410	广联达	20,700	168,912.00	0.00
329	603486	科沃斯	3,300	167,475.00	0.00
330	001696	宗申动力	8,000	166,480.00	0.00
331	600820	隧道股份	31,900	166,199.00	0.00
332	000932	华菱钢铁	47,720	165,588.40	0.00
333	600282	南钢股份	35,800	164,322.00	0.00
334	600483	福能股份	16,100	164,059.00	0.00
335	600435	北方导航	14,600	163,520.00	0.00
336	601799	星宇股份	1,800	163,116.00	0.00
337	002500	山西证券	31,514	162,612.24	0.00
338	600583	海油工程	32,100	161,463.00	0.00
339	603816	顾家家居	7,200	160,992.00	0.00
340	000513	丽珠集团	5,552	160,397.28	0.00
341	000997	新大陆	9,840	160,392.00	0.00
342	688778	厦钨新能	2,929	159,337.60	0.00
343	603939	益丰药房	8,820	158,583.60	0.00
344	600161	天坛生物	13,600	157,488.00	0.00
345	600546	山煤国际	14,400	157,392.00	0.00
346	601567	三星电气	10,500	156,870.00	0.00
347	603338	浙江鼎力	3,676	156,230.00	0.00
348	601106	中国一重	47,300	156,090.00	0.00

349	000062	深圳华强	4,900	155,918.00	0.00
350	000009	中国宝安	24,969	155,556.87	0.00
351	003022	联泓新科	6,000	155,400.00	0.00
352	002007	华兰生物	12,700	154,813.00	0.00
353	688114	华大智造	3,022	154,363.76	0.00
354	600763	通策医疗	4,543	153,916.84	0.00
355	601666	平煤股份	21,500	153,725.00	0.00
356	600329	达仁堂	4,118	153,271.96	0.00
357	600562	国睿科技	7,200	152,784.00	0.00
358	600801	华新建材	9,780	152,568.00	0.00
359	688295	中复神鹰	2,483	150,320.82	0.00
360	600685	中船防务	5,900	150,096.00	0.00
361	601880	辽港股份	108,760	150,088.80	0.00
362	600380	健康元	15,913	149,900.46	0.00
363	600038	中直股份	5,900	149,211.00	0.00
364	000723	美锦能源	44,500	149,075.00	0.00
365	600390	五矿资本	32,600	148,656.00	0.00
366	601156	东航物流	9,200	148,304.00	0.00
367	603728	鸣志电器	2,400	146,208.00	0.00
368	000739	普洛药业	8,700	144,942.00	0.00
369	600132	重庆啤酒	3,500	144,550.00	0.00
370	603341	龙旗科技	3,400	144,466.00	0.00
371	600511	国药股份	5,518	143,688.72	0.00
372	600535	天士力	10,840	143,413.20	0.00
373	000528	柳工	18,600	140,430.00	0.00
374	600906	财达证券	18,800	140,248.00	0.00
375	000598	兴蓉环境	21,800	139,956.00	0.00
376	002244	滨江集团	18,400	139,840.00	0.00
377	600977	中国电影	10,800	139,536.00	0.00
378	600816	建元信托	57,100	139,324.00	0.00
379	601399	国机重装	39,800	139,300.00	0.00
380	002299	圣农发展	9,100	137,956.00	0.00
381	600970	中材国际	19,154	136,568.02	0.00
382	300146	汤臣倍健	15,100	136,504.00	0.00
383	002120	韵达股份	21,200	134,832.00	0.00
384	601155	新城控股	13,100	134,406.00	0.00
385	300144	宋城演艺	23,000	133,630.00	0.00
386	300676	华大基因	3,800	133,228.00	0.00
387	601236	红塔证券	19,500	132,990.00	0.00
388	000951	中国重汽	6,800	132,668.00	0.00
389	002568	百润股份	7,800	131,976.00	0.00
390	603885	吉祥航空	12,726	130,950.54	0.00
391	000027	深圳能源	20,920	129,704.00	0.00

392	688166	博瑞医药	3,677	128,731.77	0.00
393	600602	云赛智联	8,000	128,640.00	0.00
394	688278	特宝生物	2,361	128,438.40	0.00
395	600131	国网信通	8,700	127,020.00	0.00
396	601608	中信重工	26,600	126,882.00	0.00
397	601866	中远海发	57,000	125,970.00	0.00
398	600095	湘财股份	16,600	124,998.00	0.00
399	600004	白云机场	17,200	124,872.00	0.00
400	603737	三棵树	5,112	123,199.20	0.00
401	000883	湖北能源	28,500	123,120.00	0.00
402	601118	海南橡胶	24,800	122,016.00	0.00
403	000800	一汽解放	20,400	121,380.00	0.00
404	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
405	002984	森麒麟	9,200	120,244.00	0.00
406	600126	杭钢股份	19,610	120,209.30	0.00
407	600871	石化油服	59,000	119,770.00	0.00
408	603565	中谷物流	12,200	119,682.00	0.00
409	300100	双林股份	4,300	119,454.00	0.00
410	600566	济川药业	5,369	119,138.11	0.00
411	600754	锦江酒店	6,600	118,734.00	0.00
412	603000	人民网	8,000	118,320.00	0.00
413	002312	川发龙蟒	12,900	118,293.00	0.00
414	688336	三生国健	2,220	117,882.00	0.00
415	000709	河钢股份	60,300	116,982.00	0.00
416	603858	步长制药	8,000	116,800.00	0.00
417	600517	国网英大	24,900	116,532.00	0.00
418	600655	豫园股份	28,300	116,313.00	0.00
419	600967	内蒙一机	10,600	115,010.00	0.00
420	000582	北部湾港	10,700	114,811.00	0.00
421	000825	太钢不锈	33,400	113,894.00	0.00
422	601598	中国外运	22,900	113,584.00	0.00
423	002423	中粮资本	13,600	111,928.00	0.00
424	600598	北大荒	10,300	111,652.00	0.00
425	001286	陕西能源	11,000	111,540.00	0.00
426	603899	晨光股份	5,300	109,339.00	0.00
427	688281	华秦科技	2,162	108,597.26	0.00
428	601966	玲珑轮胎	10,600	108,014.00	0.00
429	600663	陆家嘴	17,100	107,388.00	0.00
430	600582	天地科技	24,034	106,951.30	0.00
431	000088	盐田港	25,800	105,522.00	0.00
432	003021	兆威机电	1,200	104,820.00	0.00
433	600848	上海临港	13,900	104,111.00	0.00
434	002583	海能达	13,500	103,815.00	0.00

435	301606	绿联科技	1,700	103,734.00	0.00
436	600350	山东高速	9,300	103,509.00	0.00
437	688318	财富趋势	1,449	103,328.19	0.00
438	601098	中南传媒	10,414	102,473.76	0.00
439	002508	老板电器	7,000	102,340.00	0.00
440	300735	光弘科技	4,500	102,330.00	0.00
441	688563	航材股份	1,959	100,359.57	0.00
442	688363	华熙生物	2,796	100,012.92	0.00
443	603233	大参林	6,610	99,348.30	0.00
444	601865	福莱特	9,400	98,794.00	0.00
445	300888	稳健医疗	3,520	98,524.80	0.00
446	600968	海油发展	29,500	98,235.00	0.00
447	601928	凤凰传媒	11,116	97,709.64	0.00
448	600062	华润双鹤	6,057	97,154.28	0.00
449	603589	口子窖	5,200	97,136.00	0.00
450	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
451	003035	南网能源	16,300	94,866.00	0.00
452	688561	奇安信	3,920	94,001.60	0.00
453	600688	上海石化	31,900	93,467.00	0.00
454	688425	铁建重工	23,216	93,328.32	0.00
455	600295	鄂尔多斯	8,600	92,192.00	0.00
456	300718	长盛轴承	1,500	91,455.00	0.00
457	600098	广州发展	15,300	90,423.00	0.00
458	688709	成都华微	2,372	90,349.48	0.00
459	002670	国盛证券	8,063	88,693.00	0.00
460	601808	中海油服	8,200	88,642.00	0.00
461	688520	神州细胞	2,581	88,296.01	0.00
462	002773	康弘药业	4,300	87,935.00	0.00
463	002153	石基信息	12,142	87,786.66	0.00
464	600808	马钢股份	34,801	87,002.50	0.00
465	300957	贝泰妮	2,700	85,077.00	0.00
466	000429	粤高速 A	6,200	84,630.00	0.00
467	688708	佳驰科技	1,655	84,074.00	0.00
468	000539	粤电力 A	11,900	81,039.00	0.00
469	600292	电投水电	6,600	79,464.00	0.00
470	002032	苏泊尔	2,000	79,200.00	0.00
471	600377	宁沪高速	6,800	78,676.00	0.00
472	301301	川宁生物	9,900	78,606.00	0.00
473	601298	青岛港	9,700	78,085.00	0.00
474	002608	江苏国信	11,100	76,590.00	0.00
475	600339	中油工程	24,300	74,601.00	0.00
476	000785	居然智家	37,300	74,600.00	0.00
477	603529	爱玛科技	3,800	74,138.00	0.00

478	600606	绿地控股	61,200	74,052.00	0.00
479	600032	浙江新能	10,500	74,025.00	0.00
480	000959	首钢股份	20,900	73,359.00	0.00
481	603658	安图生物	2,500	72,550.00	0.00
482	600764	中国海防	4,100	71,463.00	0.00
483	601139	深圳燃气	12,490	70,693.40	0.00
484	688349	三一重能	4,627	70,237.86	0.00
485	603833	欧派家居	2,300	69,253.00	0.00
486	688192	迪哲医药	1,718	68,599.74	0.00
487	000937	冀中能源	17,160	68,296.80	0.00
488	002265	建设工业	3,800	66,120.00	0.00
489	000537	绿发电力	9,000	65,790.00	0.00
490	000898	鞍钢股份	35,000	65,450.00	0.00
491	688475	萤石网络	2,285	62,494.75	0.00
492	300140	节能环保	12,500	62,125.00	0.00
493	601228	广州港	21,900	61,758.00	0.00
494	601019	山东出版	9,100	58,240.00	0.00
495	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
496	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
497	002945	华林证券	3,900	52,377.00	0.00
498	600927	永安期货	4,200	52,290.00	0.00
499	603049	中策橡胶	1,124	50,366.44	0.00
500	603786	科博达	1,200	49,092.00	0.00
501	601112	振石股份	2,675	48,269.25	0.00
502	600299	安迪苏	5,800	45,530.00	0.00
503	688819	天能股份	1,975	43,845.00	0.00
504	301498	乖宝宠物	1,000	40,590.00	0.00
505	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
506	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
507	002461	珠江啤酒	5,200	39,364.00	0.00
508	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
509	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
510	603092	德力佳	500	26,985.00	0.00
511	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
512	001386	马可波罗	1,500	21,240.00	0.00
513	688811	有研新材	834	20,124.42	0.00
514	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
515	001221	悍高集团	460	18,501.20	0.00
516	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
517	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
518	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
519	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
520	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00

521	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
522	400174	中天 3	95,400	13,356.00	0.00
523	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
524	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
525	688781	视涯科技	217	10,331.37	0.00
526	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
527	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
528	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
529	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
530	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
531	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
532	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
533	920189	康美特	200	1,628.00	0.00
534	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688525	佰维存储	2,137,683.81	0.03
2	688498	源杰科技	2,058,691.77	0.03
3	688347	华虹宏力	1,626,861.08	0.02
4	001309	德明利	1,440,655.00	0.02
5	688002	睿创微纳	1,354,012.11	0.02
6	600487	亨通光电	1,334,271.00	0.02
7	600879	航天电子	1,333,316.00	0.02
8	688578	艾力斯	1,285,784.89	0.02
9	688099	晶晨股份	1,262,588.10	0.02
10	600118	中国卫星	1,259,801.00	0.02
11	688213	思特威	1,197,338.90	0.01
12	600549	厦门钨业	1,172,595.00	0.01
13	600580	卧龙电驱	1,118,722.00	0.01
14	688676	金盘科技	1,094,410.86	0.01
15	600988	赤峰黄金	1,013,386.00	0.01
16	688385	复旦微电	980,759.50	0.01
17	600673	东阳光	975,394.00	0.01
18	603228	景旺电子	972,282.00	0.01
19	688122	西部超导	954,713.94	0.01
20	601168	西部矿业	905,104.00	0.01

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688525	佰维存储	5,168,740.67	0.06
2	600487	亨通光电	4,956,117.00	0.06
3	600549	厦门钨业	2,748,646.00	0.03
4	600673	东阳光	1,997,678.00	0.02
5	600118	中国卫星	1,971,582.46	0.02
6	688347	华虹宏力	1,893,090.55	0.02
7	601168	西部矿业	1,809,289.00	0.02
8	600096	云天化	1,774,127.60	0.02
9	600580	卧龙电驱	1,772,111.40	0.02
10	688820	盛合晶微	1,682,464.30	0.02
11	688002	睿创微纳	1,613,907.12	0.02
12	600879	航天电子	1,573,761.00	0.02
13	600988	赤峰黄金	1,531,763.00	0.02
14	688578	艾力斯	1,431,570.28	0.02
15	002353	杰瑞股份	1,400,328.00	0.02
16	603228	景旺电子	1,391,459.25	0.02
17	688099	晶晨股份	1,389,460.78	0.02
18	688676	金盘科技	1,357,174.97	0.02
19	688213	思特威	1,275,990.40	0.02
20	301308	江波龙	1,251,958.38	0.02

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	121,789,304.59
卖出股票收入（成交）总额	154,828,837.00

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	265,347,176.06	2.96
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	57,001.52	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	265,404,177.58	2.96

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值（元）	占基金资产净值 比例（%）
1	019827	26 国债 01	1,690,000	170,095,444.11	1.90
2	019792	25 国债 19	645,000	65,176,755.21	0.73
3	102310	国债 2513	157,000	15,898,220.03	0.18
4	019785	25 国债 13	140,000	14,176,756.71	0.16
5	111025	圣泉转债	280	28,000.37	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本报告期投资基金情况

7.10.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (人民币 元)	占基金资 产净值比 例（%）
1	南方中证 500ETF	股票型	交易型开 放式	南方基金 管理股份	8,387,658, 550.98	93.57

				有限公司		
--	--	--	--	------	--	--

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

无。

7.12.2 本期国债期货投资评价

无。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

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

7.13.3 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	410,645.05
2	应收清算款	14,936,295.86
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	21,695,759.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,042,700.67

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	484,842	6,256.57	35,201,758.14	1.16%	2,998,248,497.56	98.84%
南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	103,515	3,357.56	106,973,494.97	30.78%	240,584,829.87	69.22%
南方中证 500ETF 联接 (LOF) I	615	246,992.90	143,438,018.69	94.43%	8,462,614.13	5.57%
南方中证 500ETF 联接 Y	11,209	1,573.57	-	-	17,638,149.33	100.00%
合计	600,181	5,915.79	285,613,271.80	8.04%	3,264,934,090.89	91.96%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	1,864,081.94	0.0615%
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	62,208.58	0.0179%

	南方中证 500ETF 联接 (LOF) I	351,135.98	0.2312%
	南方中证 500ETF 联接 Y	85,664.91	0.4857%
	合计	2,363,091.41	0.0666%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	10~50
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	0~10
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) I	10~50
	南方中证 500ETF 联接 Y	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	10~50
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	0~10
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) I	10~50
	南方中证 500ETF 联接 Y	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位: 份

项目	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	南方中证 500ETF 联接 (LOF) I	南方中证 500ETF 联接 Y
基金合同生效日(2009 年 9 月 25 日)基金份额总额	3,223,217,818.45	-	-	-
本报告期期初基金份额总额	3,485,811,266.33	278,114,470.86	137,621,193.57	5,194,834.05

本报告期基金总申购份额	700,105,392.47	630,604,142.61	214,099,714.36	22,432,201.23
减：本报告期基金总赎回份额	1,152,466,403.10	561,160,288.63	199,820,275.11	9,988,885.95
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,033,450,255.70	347,558,324.84	151,900,632.82	17,638,149.33

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内无涉及基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	1	243,229,973.11	89.05%	24,311.26	89.07%	-
华泰证券	2	29,908,373.04	10.95%	2,982.99	10.93%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-

注：根据 2024 年 7 月 1 日起施行的《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告〔2024〕3 号），基金管理人制定了证券公司交易单元的选择标准和程序：

1、选择标准

基金管理人建立了选择机制，选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易，并制定了定性与定量相结合的具体标准。

2、选择程序

（1）基金管理人根据上述标准对证券公司进行评估，与符合标准的证券公司签订证券综合研究服务协议后将其入库，并对入库的证券公司开展动态管理，定期检视其是否持续符合选择标准；

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

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权证成交总	成交金额	占当期基金成交总

		额的比例		交总额的 比例		额的比例		额的比例
中金公司	243,096,384.10	100.00%	763,600,000.00	100.00%	-	-	1,713,866,223.95	100.00%
华泰证券	9,793.49	0.00%	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于南方基金管理股份有限公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-21
2	南方基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-11
4	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-24
5	南方基金管理股份有限公司成都分公司工商注册信息变更公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-28
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-12

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的文件；

2、《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》；

3、《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；

6、《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)2026 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>