南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录.....1
1.1 重要提示.....1
1.2 目录.....2
§2 基金简介.....4
2.1 基金基本情况.....4
2.2 基金产品说明.....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.....12
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遵规守信情况的说明.....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遵规守信情况声明.....16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见.....16
§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.....19
6.4 报表附注.....21
§7 投资组合报告.....47
7.1 期末基金资产组合情况.....47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....48
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.....48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....50
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.....50
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.....50
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.....50
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.....51
7.10 本报告期投资基金情况.....51

7.11 本基金投资股指期货的投资政策.....51
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....51
7.13 投资组合报告附注.....51
§8 基金份额持有人信息.....52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....53
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.....53
§9 开放式基金份额变动.....54
§10 重大事件揭示.....54
10.1 基金份额持有人大会决议.....54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....54
10.4 基金投资策略的改变.....55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....55
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....55
10.8 其他重大事件.....57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....57
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.....57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....57
§12 备查文件目录.....57
12.1 备查文件目录.....57
12.2 存放地点.....57
12.3 查阅方式.....58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金			
基金简称	南方沪深 300ETF 联接			
基金主代码	202015			
前端交易代码	202015			
后端交易代码	202016			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2013 年 5 月 16 日			
基金管理人	南方基金管理股份有限公司			
基金托管人	中国工商银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	1,061,526,666.93 份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	南方沪深 300ETF 联接 A	南方沪深 300ETF 联接 C	南方沪深 300ETF 联接 I	南方沪深 300ETF 联接 Y
下属分级基金的交易代码	202015	004342	021022	022924
下属分级基金的前端交易代码	202015			
下属分级基金的后端交易代码	202016			
报告期末下属分级基金的份额总额	805,420,305.23 份	230,298,271.20 份	19,932,576.72 份	5,875,513.78 份

注：本基金转型日期为 2013 年 5 月 16 日，该日起由原“南方沪深 300 指数证券投资基金”转型为“南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159925
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 18 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013 年 4 月 11 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	中国工商银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	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	本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，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、非成份股、新股、权证、债券资产、资产支持证券、固定收益类资产、现金资产、货币市场工具、衍生工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了使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	本基金标的指数为中证指数有限公司所编制并发布的沪深 300 指数及其未来可能发生的变更。 本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金属股票型联接基金，预期风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时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，采用指数复制法，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。 基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。 本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。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。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数：沪深 300 指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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	南方基金管理股份有限公司	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、南方沪深 300ETF 联接 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	65,428,865.76
本期利润	110,254,839.26
加权平均基金份额本期利润	0.1295
本期加权平均净值利润率	8.04%
本期基金份额净值增长率	8.16%
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	562,750,663.11

期末可供分配基金份额利润	0.6987
期末基金资产净值	1,368,170,968.34
期末基金份额净值	1.6987
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	162.43%

2、南方沪深 300ETF 联接 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	16,739,745.59
本期利润	28,748,621.78
加权平均基金份额本期利润	0.1218
本期加权平均净值利润率	7.80%
本期基金份额净值增长率	7.95%
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	148,897,019.49
期末可供分配基金份额利润	0.6465
期末基金资产净值	379,195,290.69
期末基金份额净值	1.6465
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	79.16%

3、南方沪深 300ETF 联接 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	1,711,533.76
本期利润	3,311,321.23
加权平均基金份额本期利润	0.1490
本期加权平均净值利润率	9.27%
本期基金份额净值增长率	8.16%
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	13,920,530.53
期末可供分配基金份额利润	0.6983
期末基金资产净值	33,853,107.25
期末基金份额净值	1.6984
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	44.66%

4、南方沪深 300ETF 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	414,122.36
本期利润	760,484.56
加权平均基金份额本期利润	0.1440
本期加权平均净值利润率	8.48%
本期基金份额净值增长率	8.18%
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	4,641,549.41

期末可供分配基金份额利润	0.7899
期末基金资产净值	10,517,063.19
期末基金份额净值	1.7900
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	28.99%

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 27 日起存续；

本基金从 2024 年 3 月 19 日起新增 I 类份额，I 类份额自 2024 年 3 月 20 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

南方沪深 300ETF 联接 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	12.16%	1.19%	11.30%	1.19%	0.86%	0.00%
过去六个月	8.16%	1.07%	7.20%	1.07%	0.96%	0.00%
过去一年	27.50%	0.97%	25.13%	0.97%	2.37%	0.00%
过去三年	36.65%	1.06%	28.26%	1.06%	8.39%	0.00%
过去五年	7.12%	1.06%	-4.03%	1.06%	11.15%	0.00%
过去七年	58.01%	1.11%	29.32%	1.11%	28.69%	0.00%
过去十年	105.19%	1.09%	55.77%	1.09%	49.42%	0.00%
自基金合同生效起至今	162.43%	1.28%	95.04%	1.28%	67.39%	0.00%

南方沪深 300ETF 联接 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	12.04%	1.19%	11.30%	1.19%	0.74%	0.00%
过去六个月	7.95%	1.07%	7.20%	1.07%	0.75%	0.00%

过去一年	26.98%	0.97%	25.13%	0.97%	1.85%	0.00%
过去三年	35.02%	1.06%	28.26%	1.06%	6.76%	0.00%
过去五年	5.00%	1.06%	-4.03%	1.06%	9.03%	0.00%
过去七年	53.65%	1.11%	29.32%	1.11%	24.33%	0.00%
自基金合同生效起至今	79.16%	1.12%	42.89%	1.11%	36.27%	0.01%

南方沪深 300ETF 联接 I

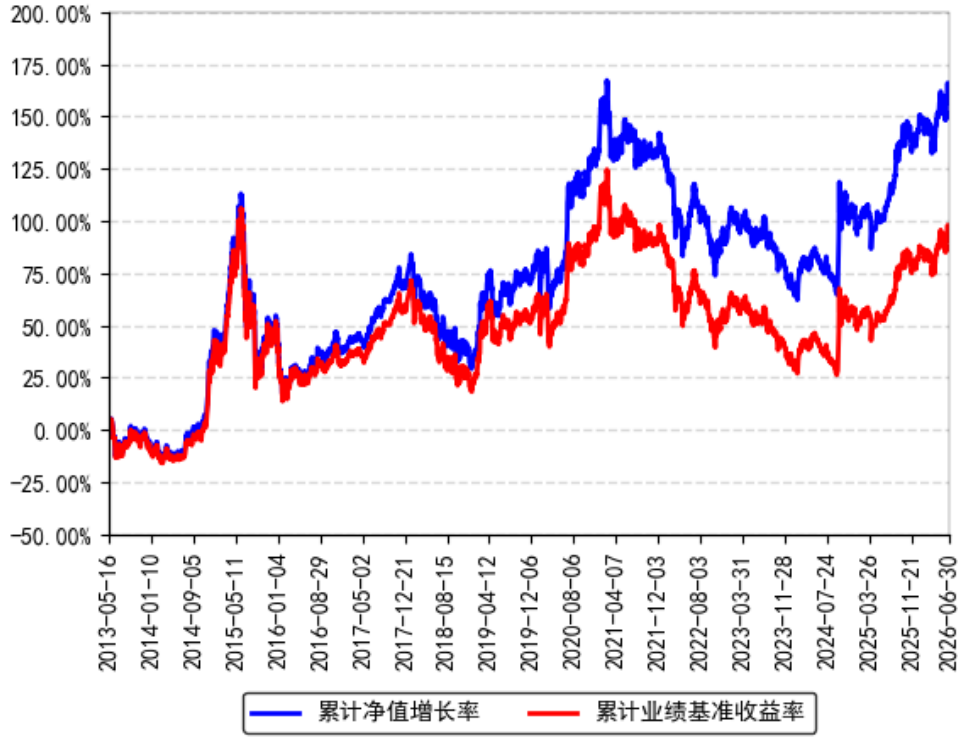
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	12.16%	1.19%	11.30%	1.19%	0.86%	0.00%
过去六个月	8.16%	1.07%	7.20%	1.07%	0.96%	0.00%
过去一年	27.49%	0.97%	25.13%	0.97%	2.36%	0.00%
自基金合同生效起至今	44.66%	1.11%	37.20%	1.11%	7.46%	0.00%

南方沪深 300ETF 联接 Y

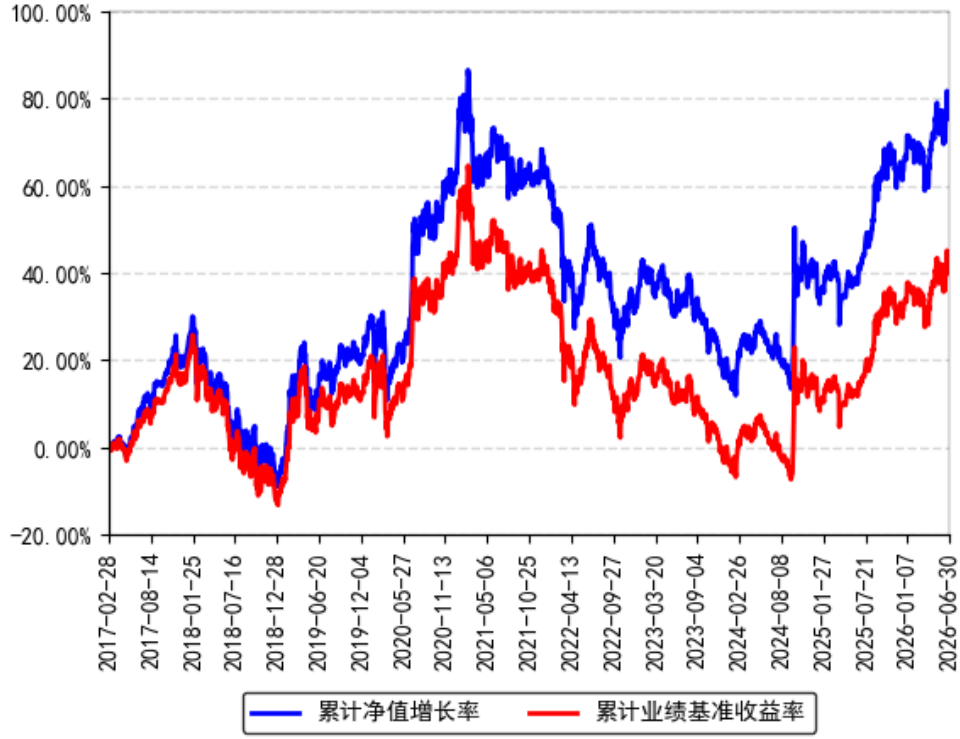
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	12.16%	1.19%	11.30%	1.19%	0.86%	0.00%
过去六个月	8.18%	1.07%	7.20%	1.07%	0.98%	0.00%
过去一年	27.52%	0.97%	25.13%	0.97%	2.39%	0.00%
自基金合同生效起至今	28.99%	0.96%	25.26%	0.96%	3.73%	0.00%

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

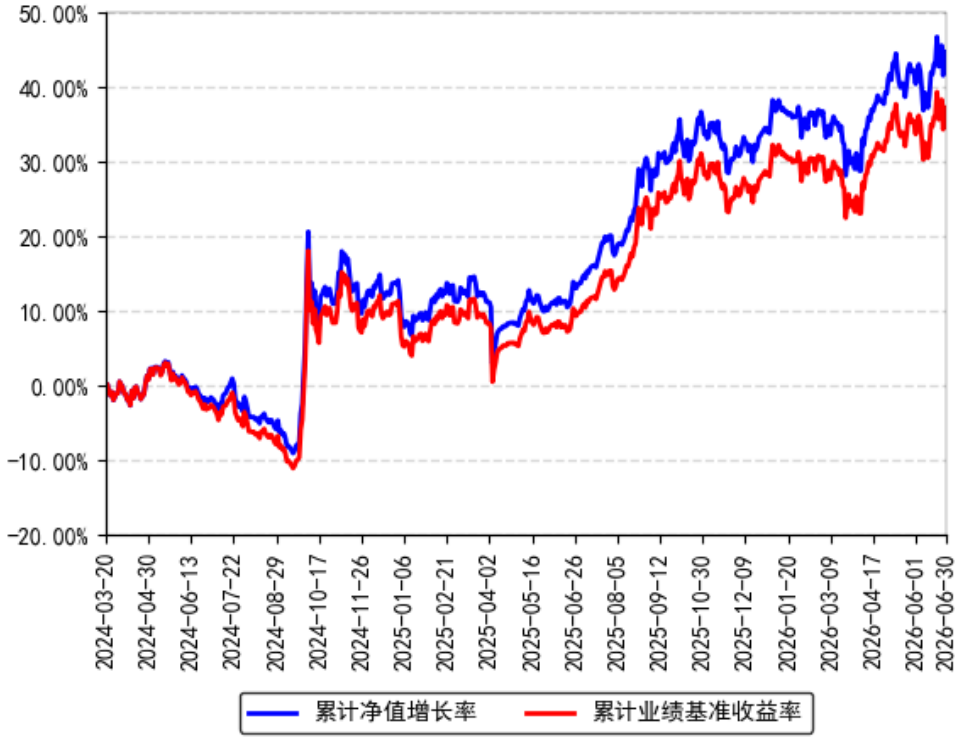
南方沪深300ETF联接A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



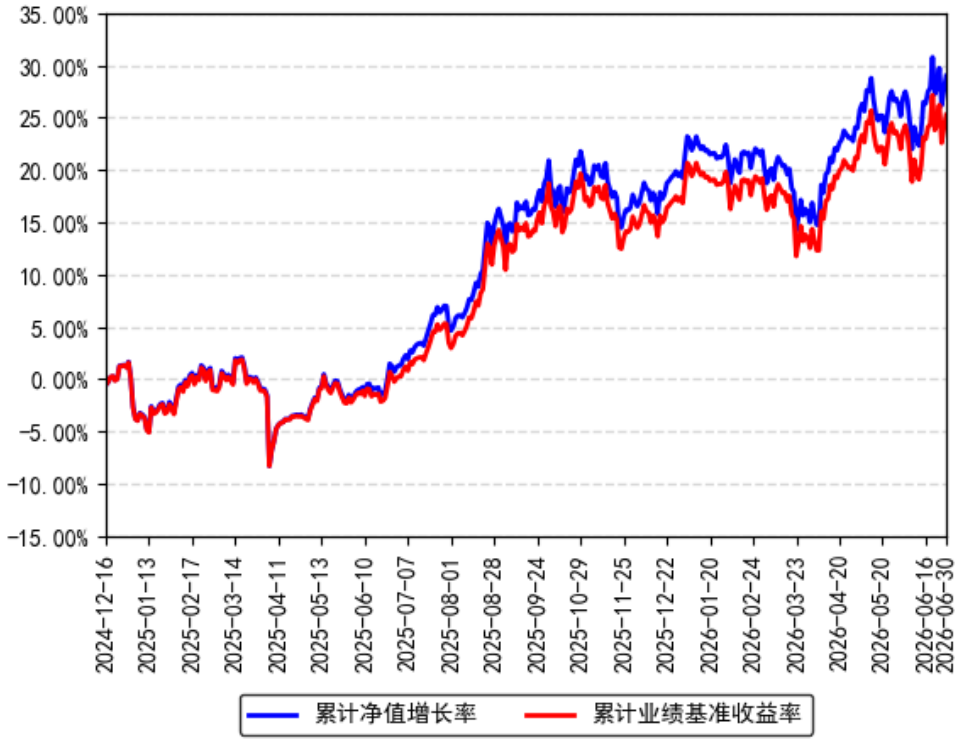
南方沪深300ETF联接C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方沪深300ETF联接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



南方沪深300ETF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：本基金于 2013 年 5 月 16 日变更为南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，于 2019 年 4 月 23 日由南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金更名为南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

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 27 日起存续；

本基金从 2024 年 3 月 19 日起新增 I 类份额，I 类份额自 2024 年 3 月 20 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 5 月 17 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。

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遵规守信情况的说明

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 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，沪深 300 指数涨 7.55%。作为 A 股核心宽基指数的代表，现下沪深 300 指数市盈率为 15 倍左右，位列全球主要市场末端，未来估值修复空间较大。

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) 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。

4.4.2 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 1.6987 元，报告期内，份额净值增长率为 8.16%，同期业绩基准增长率为 7.20%；本基金 C 份额净值为 1.6465 元，报告期内，份额净值增长率为 7.95%，同期业绩基准增长率为 7.20%；本基金 I 份额净值为 1.6984 元，报告期内，份额净值增长率为 8.16%，同期业绩基准增长率为 7.20%；本基金 Y 份额净值为 1.7900 元，报告期内，份额净值增长率为 8.18%，同期业绩基准增长率为 7.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。作为 A 股核心宽基指数的代表， 沪深 300 指数市盈率及市净率现下位列全球主要市场末端，持续估值修复的空间较大。

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，本基金报告期未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的本基金2026年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	52,651,143.53	23,323,947.92
结算备付金		47,300,267.04	5,781,654.25
存出保证金		9,708,337.46	366,273.97
交易性金融资产	6.4.7.2	1,677,578,644.36	1,913,687,416.94
其中：股票投资		4,184.00	14,300.68
基金投资		1,625,200,539.26	1,834,195,831.55
债券投资		52,373,921.10	79,477,284.71
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		7,767,188.00	1,500,000.00
应收股利		-	-
应收申购款		2,004,533.38	886,863.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,797,010,113.77	1,945,546,156.75
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		-	17,002,038.08
应付清算款		-	-

应付赎回款		4,825,911.00	4,455,986.21
应付管理人报酬		67,144.34	39,235.74
应付托管费		13,444.19	7,851.50
应付销售服务费		121,969.89	57,179.22
应付投资顾问费		-	-
应交税费		152,283.03	139,236.57
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	92,931.85	179,311.15
负债合计		5,273,684.30	21,880,838.47
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,061,526,666.93	1,231,800,306.73
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	730,209,762.54	691,865,011.55
净资产合计		1,791,736,429.47	1,923,665,318.28
负债和净资产总计		1,797,010,113.77	1,945,546,156.75

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，南方沪深 300ETF 联接 A 份额净值 1.6987 元，基金份额总额 805,420,305.23 份；南方沪深 300ETF 联接 C 份额净值 1.6465 元，基金份额总额 230,298,271.20 份；南方沪深 300ETF 联接 I 份额净值 1.6984 元，基金份额总额 19,932,576.72 份；南方沪深 300ETF 联接 Y 份额净值 1.7900 元，基金份额总额 5,875,513.78 份；总份额合计 1,061,526,666.93 份。

6.2 利润表

会计主体：南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		144,564,388.50	24,793,438.68
1.利息收入		168,837.02	172,892.83
其中：存款利息收入	6.4.7.9	168,837.02	172,892.83
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）		85,285,664.52	80,988,688.75

其中：股票投资收益	6.4.7.10	94,596.91	-86,519.28
基金投资收益	6.4.7.11	84,118,614.65	79,074,529.84
债券投资收益	6.4.7.12	402,496.28	612,926.20
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	669,964.33	-
股利收益	6.4.7.15	-7.65	1,387,751.99
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	58,780,999.36	-57,170,889.60
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	328,887.60	802,746.70
减：二、营业总支出		1,489,121.67	1,981,492.05
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	262,775.57	649,904.59
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	52,609.76	129,997.01
3.销售服务费	6.4.10.2.3	732,686.83	573,258.48
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		112,298.13	256,239.01
其中：卖出回购金融资产支出		112,298.13	256,239.01
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		244,161.82	282,513.60
8.其他费用	6.4.7.19	84,589.56	89,579.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		143,075,266.83	22,811,946.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		143,075,266.83	22,811,946.63
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		143,075,266.83	22,811,946.63

6.3 净资产变动表

会计主体：南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,231,800,306.73	-	691,865,011.55	1,923,665,318.28
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,231,800,306.73	-	691,865,011.55	1,923,665,318.28
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-170,273,639.80	-	38,344,750.99	-131,928,888.81
（一）、综合收益总额	-	-	143,075,266.83	143,075,266.83
（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）	-170,273,639.80	-	-104,730,515.84	-275,004,155.64
其中：1.基金申购款	149,118,811.78	-	89,446,417.08	238,565,228.86
2.基金赎回款	-319,392,451.58	-	-194,176,932.92	-513,569,384.50
（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	1,061,526,666.93	-	730,209,762.54	1,791,736,429.47
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	2,413,729,963.80	-	906,703,774.94	3,320,433,738.74

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,413,729,963.80	-	906,703,774.94	3,320,433,738.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-547,863,307.61	-	-175,233,599.61	-723,096,907.22
（一）、综合收益总额	-	-	22,811,946.63	22,811,946.63
（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）	-547,863,307.61	-	-198,045,546.24	-745,908,853.85
其中：1.基金申购款	243,457,861.42	-	85,598,511.24	329,056,372.66
2.基金赎回款	-791,321,169.03	-	-283,644,057.48	-1,074,965,226.51
（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	1,865,866,656.19	-	731,470,175.33	2,597,336,831.52

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

南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(原名为“南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”、“南方沪深 300 指数证券投资基金”，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]第 127 号《关于核准南方沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》核准，由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司，已于 2018 年 1 月 4 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方沪深 300 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 1,580,626,128.17 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 053 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方沪深 300 指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 3 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,580,754,997.47 份基金份额，其中认购资金利息折合 128,869.30 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金基金份额持有人大会于 2013 年 4 月 17 日以现场方式审议通过的《关于南方沪深 300 指数证券投资基金变更投资范围及其相关事项的议案》、经中国证监会证监许可[2013]674 号《关于核准南方沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金投资范围等事项决议的批复》核准，自 2013 年 5 月 16 日起，原基金南方沪深 300 指数证券投资基金更名为南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》自 2013 年 5 月 16 日起生效，原《南方沪深 300 指数证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

根据《关于南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告》，自 2017 年 2 月 23 日起，本基金增加 C 类基金份额；根据本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2024 年 3 月 19 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》，自 2024 年 3 月 19 日起，本基金增加 I 类基金份额；根据本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 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》，自 2024 年 12 月 13 日起，本基金增加 Y 类基金份额。根据更新后的《南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定》的有关规定，本基金根据费率设置的不同，将基金份额分为不同的类别。供非个人养老金客户申购、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；供非个人养老金客户申购、从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类或 I 类基金份额；专供个人养老金投资基金业务单独设立，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 Y 类基

金份额。本基金 A 类、C 类、I 类、Y 类基金份额分别设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《关于南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金更名的公告》，自 2019 年 4 月 23 日起，南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金更名为南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

本基金为南方沪深 300 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沪深 300 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，力争控制本基金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《南方沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，于 2013 年 5 月 16 日前，本基金的标的指数为沪深 300 指数，基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 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)、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中，沪深 300 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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金还可以投资于经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定，自 2013 年 5 月 16 日起，本基金的标的指数为沪深 300 指数，基金资产主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。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)。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，持有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%。此外，本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票以及存托凭证)、一级市场新股或增发的股票、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。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 X95%＋银行活期款利率(税后)X5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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>》，中国证券投资基金业协会发布的《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》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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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

本基金的主要税项列示如下：

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人：自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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%的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、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》的规定，自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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《财政部国家税务总局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《财政部国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》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《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《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，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《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，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

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《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《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。

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	52,651,143.53
等于：本金	52,646,283.80
加：应计利息	4,859.73
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	52,651,143.53

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		4,184.00	-	4,184.00	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	52,014,542.00	331,321.10	52,373,921.10	28,058.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	52,014,542.00	331,321.10	52,373,921.10	28,058.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		1,175,266,457.40	-	1,625,200,539.26	449,934,081.86

其他	-	-	-	-
合计	1,227,285,183.40	331,321.10	1,677,578,644.36	449,962,139.86

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 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	77,577,000.00	-	-	-
-股指期货	77,577,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	77,577,000.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

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
IF2607	IF2607	6.00	8,859,600.00	320,520.00
IF2609	IF2609	49.00	71,292,060.00	2,254,140.00
合计				2,574,660.00
减：可抵销期货暂收款				2,574,660.00
净额				0.00

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

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	8,623.00
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6.29
其中：交易所市场	6.29
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	-
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	-
可退替代款	-
合计	92,931.85

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方沪深 300ETF 联接 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	946,972,148.69	946,972,148.69
本期申购	93,861,343.91	93,861,343.91
本期赎回（以“-”号填列）	-235,413,187.37	-235,413,187.37
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	805,420,305.23	805,420,305.23

南方沪深 300ETF 联接 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	249,047,179.36	249,047,179.36
本期申购	37,771,281.30	37,771,281.30
本期赎回（以“-”号填列）	-56,520,189.46	-56,520,189.46
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	230,298,271.20	230,298,271.20

南方沪深 300ETF 联接 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	31,864,461.35	31,864,461.35
本期申购	13,922,398.25	13,922,398.25
本期赎回（以“-”号填列）	-25,854,282.88	-25,854,282.88
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	19,932,576.72	19,932,576.72

南方沪深 300ETF 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	3,916,517.33	3,916,517.33
本期申购	3,563,788.32	3,563,788.32
本期赎回（以“-”号填列）	-1,604,791.87	-1,604,791.87
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	5,875,513.78	5,875,513.78

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

南方沪深 300ETF 联接 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	971,257,902.40	-430,965,293.08	540,292,609.32
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	971,257,902.40	-430,965,293.08	540,292,609.32
本期利润	65,428,865.76	44,825,973.50	110,254,839.26
本期基金份额交易产生的变动数	-149,401,899.42	61,605,113.95	-87,796,785.47
其中：基金申购款	100,184,718.12	-42,853,799.04	57,330,919.08
基金赎回款	-249,586,617.54	104,458,912.99	-145,127,704.55
本期已分配利润	-	-	-

本期末	887,284,868.74	-324,534,205.63	562,750,663.11

南方沪深 300ETF 联接 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	243,487,610.47	-112,652,903.41	130,834,707.06
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	243,487,610.47	-112,652,903.41	130,834,707.06
本期利润	16,739,745.59	12,008,876.19	28,748,621.78
本期基金份额交易产生的变动数	-18,800,300.25	8,113,990.90	-10,686,309.35
其中：基金申购款	38,416,984.08	-17,100,574.72	21,316,409.36
基金赎回款	-57,217,284.33	25,214,565.62	-32,002,718.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	241,427,055.81	-92,530,036.32	148,897,019.49

南方沪深 300ETF 联接 I			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	32,676,303.08	-14,502,919.42	18,173,383.66
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	32,676,303.08	-14,502,919.42	18,173,383.66
本期利润	1,711,533.76	1,599,787.47	3,311,321.23
本期基金份额交易产生的变动数	-12,434,646.03	4,870,471.67	-7,564,174.36
其中：基金申购款	14,861,207.78	-6,528,111.55	8,333,096.23
基金赎回款	-27,295,853.81	11,398,583.22	-15,897,270.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,953,190.81	-8,032,660.28	13,920,530.53

南方沪深 300ETF 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	4,344,532.40	-1,780,220.89	2,564,311.51
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,344,532.40	-1,780,220.89	2,564,311.51
本期利润	414,122.36	346,362.20	760,484.56

本期基金份额交易产生的变动数	2,230,624.44	-913,871.10	1,316,753.34
其中：基金申购款	4,088,192.53	-1,622,200.12	2,465,992.41
基金赎回款	-1,857,568.09	708,329.02	-1,149,239.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,989,279.20	-2,347,729.79	4,641,549.41

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	71,602.82
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	95,420.63
其他	1,813.57
合计	168,837.02

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	94,596.91
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	94,596.91

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	28,497,527.04
减：卖出股票成本总额	28,384,002.40
减：交易费用	18,927.73
买卖股票差价收入	94,596.91

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.7.11 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	361,060,180.45
减：卖出/赎回基金成本总额	274,918,537.29
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	2,010,903.67

减：交易费用	12,124.84
基金投资收益	84,118,614.65

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	416,077.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-13,581.51
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	402,496.28

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	73,681,920.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	72,713,581.51
减：应计利息总额	981,920.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-13,581.51

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	669,964.33

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	-7.65
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	-7.65

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	56,206,339.36
——股票投资	-7,478.28
——债券投资	18,464.51
——资产支持证券投资	-
——基金投资	56,195,353.13
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	2,574,660.00
——权证投资	-
——期货投资	2,574,660.00
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	58,780,999.36

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	280,023.83
基金转换费收入	48,863.77
合计	328,887.60

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	287.00
合计	84,589.56

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
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	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
南方沪深 300 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
华泰联合证券有限责任公司("华泰联合")	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
南方资本管理有限公司(“南方资本”)	基金管理人的子公司
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

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	69,966.00	0.25%	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

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	6.29	0.22%	6.29	100.00%
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	-	-	-	-

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理费	262,775.57	649,904.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,200,491.57	1,562,269.15
应支付基金管理人的净管理费	-937,716.00	-912,364.56

注：本基金基金财产中投资于目标 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各类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）的一定比例计提，逐日累

计至每月月底，按月支付。A 类、C 类、I 类基金份额的年管理费率为 0.50%，Y 类基金份额的年管理费率为 0.15%。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)×（前一日该类基金资产净值/前一日基金资产净值）×年管理费率÷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	52,609.76	129,997.01

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）的一定比例计提，逐日累计至每月月底，按月支付。A 类、C 类、I 类基金份额的年托管费率为 0.10%，Y 类基金份额的年托管费率为 0.05%。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)×（前一日该类基金资产净值/前一日基金资产净值）×年托管费率÷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				
	南方沪深 300ETF 联接 A	南方沪深 300ETF 联接 C	南方沪深 300ETF 联接 I	南方沪深 300ETF 联接 Y	合计
工商银行	-	11,039.90	-	-	11,039.90
华泰证券	-	5,129.22	-	-	5,129.22
南方基金	-	35,112.66	1,781.48	-	36,894.14
兴业证券	-	65.98	-	-	65.98
合计	-	51,347.76	1,781.48	-	53,129.24
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				
	南方沪深 300ETF 联接 A	南方沪深 300ETF 联接 C	南方沪深 300ETF 联接 I	南方沪深 300ETF 联接 Y	合计
工商银行	-	20,022.82	-	-	20,022.82
华泰证券	-	8,818.82	-	-	8,818.82
南方基金	-	101,265.08	13,360.10	-	114,625.18
兴业证券	-	363.63	-	-	363.63
合计	-	130,470.35	13,360.10	-	143,830.45

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 3 月 20 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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	南方沪深 300ETF 联接 A	南方沪深 300ETF 联接 C	南方沪深 300ETF 联接 I	南方沪深 300ETF 联接 Y
报告期初持有的基金份额	-	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份	-	-	-	-

额				
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	-

项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	南方沪深 300ETF 联接 A	南方沪深 300ETF 联接 C	南方沪深 300ETF 联接 I	南方沪深 300ETF 联接 Y
报告期初持有的基金份额	5,221,381.58	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	5,221,381.58	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.28%	-	-	-

注：基金管理人南方基金投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.5.2 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	南方沪深 300ETF 联接 A			
	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
南方资本管理有限公司	592,228.94	0.06%	592,228.94	0.05%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	52,651,143.53	71,602.82	56,188,451.12	126,894.16

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

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

上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	603014	威高血净	网下申购	2,045	54,192.50

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 1,175,266,457.40 元，估值总额为人民币 1,625,200,539.26 元，占本基金基金净资产的比例为 90.71%（于上期末，本基金持有目标 ETF 基金份额，成本总额为人民币 1,440,457,102.82 元，估值总额为人民币 1,834,195,831.55 元，占本基金基金净资产的比例为 95.35%）。

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	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

						单价	位：股）			
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	-
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	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，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、股票投资和债券投资。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。

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	52,651,143.53	-	-	-	52,651,143.53
结算备付金	47,300,267.04	-	-	-	47,300,267.04
存出保证金	90,138.26	-	-	9,618,199.20	9,708,337.46
交易性金融资产	52,373,921.10	-	-	1,625,204,723.26	1,677,578,644.36
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	-	-	-	7,767,188.00	7,767,188.00
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,004,533.38	2,004,533.38
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	152,415,469.93	-	-	1,644,594,643.84	1,797,010,113.77
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	4,825,911.00	4,825,911.00
应付管理人报酬	-	-	-	67,144.34	67,144.34
应付托管费	-	-	-	13,444.19	13,444.19
应付销售服	-	-	-	121,969.89	121,969.89

务费					
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	152,283.03	152,283.03
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	92,931.85	92,931.85
负债总计	-	-	-	5,273,684.30	5,273,684.30
利率敏感度缺口	152,415,469.93	-	-	1,639,320,959.54	1,791,736,429.47
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	23,323,947.92	-	-	-	23,323,947.92
结算备付金	5,781,654.25	-	-	-	5,781,654.25
存出保证金	366,273.97	-	-	-	366,273.97
交易性金融资产	79,477,284.71	-	-	1,834,210,132.23	1,913,687,416.94
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	-	-	-	1,500,000.00	1,500,000.00
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	886,863.67	886,863.67
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	108,949,160.85	-	-	1,836,596,995.90	1,945,546,156.75
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	17,002,038.08	-	-	-	17,002,038.08
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	4,455,986.21	4,455,986.21
应付管理人报酬	-	-	-	39,235.74	39,235.74
应付托管费	-	-	-	7,851.50	7,851.50
应付销售服务费	-	-	-	57,179.22	57,179.22
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	139,236.57	139,236.57
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	179,311.15	179,311.15
负债总计	17,002,038.08	-	-	4,878,800.39	21,880,838.47
利率敏感度缺口	91,947,122.77	-	-	1,831,718,195.51	1,923,665,318.28

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	-63,782.84	-56,952.85
	2.市场利率平行下降 25 个基点	63,953.34	57,045.60

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	4,184.00	0.00	14,300.68	0.00
交易性金融资产-基金投资	1,625,200,539.26	90.71	1,834,195,831.55	95.35
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	1,625,204,723.26	90.71	1,834,210,132.23	95.35

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注“衍生金融资产/负债”）。在当日无负债结算制度下，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。

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%	85,022,126.05	91,967,864.55
	2.组合自身基准下降 5%	-85,022,126.05	-91,967,864.55

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	1,625,200,539.26
第二层次	52,378,105.10
第三层次	-
合计	1,677,578,644.36

6.4.14.2.2 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。

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	4,184.00	0.00
	其中：股票	4,184.00	0.00
2	基金投资	1,625,200,539.26	90.44
3	固定收益投资	52,373,921.10	2.91
	其中：债券	52,373,921.10	2.91
	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	99,951,410.57	5.56
8	其他各项资产	19,480,058.84	1.08
9	合计	1,797,010,113.77	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,184.00	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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	4,184.00	0.00

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	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00

2	920189	康美特	200	1,628.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	920126	永大股份	4,674.00	0.00
2	920161	龙辰科技	4,605.00	0.00
3	920218	新天力	3,657.00	0.00
4	920206	彩客科技	3,028.00	0.00
5	920193	吉和昌	2,556.00	0.00
6	920083	金戈新材	1,930.00	0.00
7	920189	康美特	1,628.00	0.00

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	2,414,752.00	0.13
2	300308	中际旭创	1,958,603.00	0.10
3	300502	新易盛	1,319,494.00	0.07
4	000333	美的集团	1,065,868.00	0.06
5	002594	比亚迪	820,483.00	0.04
6	300059	东方财富	815,891.00	0.04
7	002371	北方华创	813,520.00	0.04
8	002475	立讯精密	792,912.00	0.04
9	300274	阳光电源	662,305.18	0.03
10	000858	五粮液	534,038.00	0.03
11	000651	格力电器	523,797.00	0.03
12	300476	胜宏科技	514,232.00	0.03
13	300394	天孚通信	503,232.00	0.03
14	000725	京东方 A	462,655.00	0.02
15	002916	深南电路	452,467.00	0.02
16	002714	牧原股份	407,024.00	0.02
17	300124	汇川技术	378,497.00	0.02
18	002230	科大讯飞	374,218.00	0.02
19	000338	潍柴动力	365,676.00	0.02
20	002050	三花智控	357,796.00	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	22,078.00
卖出股票收入（成交）总额	28,497,527.04

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	52,373,921.10	2.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	52,373,921.10	2.92

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	460,000	46,298,168.22	2.58
2	019785	25 国债 13	60,000	6,075,752.88	0.34

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	南方沪深 300ETF	股票型	交易型开放式	南方基金管理股份有限公司	1,625,200,539.26	90.71

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

本基金管理人对股指期货及其他金融衍生品的运用将进行充分的论证，运用股指期货的情形主要包括：对冲系统性风险；对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票和目标 ETF 仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪标的指数的目的。

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	9,708,337.46
2	应收清算款	7,767,188.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,004,533.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,480,058.84

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

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	920193	吉和昌	2,556.00	0.00	新股未上市
2	920189	康美特	1,628.00	0.00	新股未上市

§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
南方沪深 300ETF 联	57,973	13,893.02	176,399,894.33	21.90%	629,020,410.90	78.10%

接 A						
南方沪深 300ETF 联接 C	17,471	13,181.75	146,184,273.05	63.48%	84,113,998.15	36.52%
南方沪深 300ETF 联接 I	874	22,806.15	3,023,086.48	15.17%	16,909,490.24	84.83%
南方沪深 300ETF 联接 Y	7,051	833.29	-	-	5,875,513.78	100.00%
合计	83,369	12,732.87	325,607,253.86	30.67%	735,919,413.07	69.33%

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	南方沪深 300ETF 联接 A	733,477.91	0.0911%
	南方沪深 300ETF 联接 C	217,219.32	0.0943%
	南方沪深 300ETF 联接 I	96,747.75	0.4854%
	南方沪深 300ETF 联接 Y	154,639.14	2.6319%
	合计	1,202,084.12	0.1132%

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	南方沪深 300ETF 联接 A	10~50
	南方沪深 300ETF 联接 C	0
	南方沪深 300ETF 联接 I	0
	南方沪深 300ETF 联接 Y	0~10
	合计	10~50

本基金基金经理持有本开放式基金	南方沪深 300ETF 联接 A	0
	南方沪深 300ETF 联接 C	0
	南方沪深 300ETF 联接 I	0
	南方沪深 300ETF 联接 Y	0~10
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方沪深 300ETF 联接 A	南方沪深 300ETF 联接 C	南方沪深 300ETF 联接 I	南方沪深 300ETF 联接 Y
基金合同生效日(2013 年 5 月 16 日)基金份额总额	3,053,936,913.71	-	-	-
本报告期期初基金份额总额	946,972,148.69	249,047,179.36	31,864,461.35	3,916,517.33
本报告期基金总申购份额	93,861,343.91	37,771,281.30	13,922,398.25	3,563,788.32
减：本报告期基金总赎回份额	235,413,187.37	56,520,189.46	25,854,282.88	1,604,791.87
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	805,420,305.23	230,298,271.20	19,932,576.72	5,875,513.78

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内无涉及基金财产的诉讼事项。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰海通	1	28,413,447.57	99.70%	2,838.60	99.73%	-
华泰证券	1	69,966.00	0.25%	6.29	0.22%	-
方正证券	1	14,113.47	0.05%	1.41	0.05%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰海通	-	-	-	-	-	-	202,388,110.96	54.59%
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	46,016,717.00	100.00%	246,500,000.00	99.54%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	1,150,000.00	0.46%	-	-	168,358,963.59	45.41%
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会	2026-03-31

	度）	基金电子披露网站	
2	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-24
3	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-28

§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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件;

2、《南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；

3、《南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

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、《南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2026 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：http://www.nffund.com