

南方上证 380 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：中国建设银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	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.....	7
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	14
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
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.....	53
§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.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	54
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.....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
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.....	56
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.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	南方上证 380ETF 联接	
基金主代码	202025	
前端交易代码	202025	
后端交易代码	202026	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 9 月 20 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	52,488,661.88 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方上证 380ETF 联接 A	南方上证 380ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	202025	007571
下属分级基金的前端交易代码	202025	
下属分级基金的后端交易代码	202026	
报告期末下属分级基金的份额总额	45,296,304.72 份	7,192,357.16 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510290
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 16 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 11 月 8 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	中国建设银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于上证 380 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称 380ETF），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 380ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资 380ETF。本基金并不参与 380ETF 的管理。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为上证 380 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，预期风险与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	本基金为完全被动式指数基金，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。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使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。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	上证 380 指数，简称 380 指数
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	021-60637228
传真	0755-82763889	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518017	100033
法定代表人	周易	张金良

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	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、南方上证 380ETF 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	6,929,355.12
本期利润	19,389,284.95
加权平均基金份额本期利润	0.3799
本期加权平均净值利润率	15.29%
本期基金份额净值增长率	16.78%
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	47,029,326.44
期末可供分配基金份额利润	1.0382
期末基金资产净值	120,850,894.89
期末基金份额净值	2.6680
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	166.80%

2、南方上证 380ETF 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	1,008,841.03
本期利润	2,765,995.67
加权平均基金份额本期利润	0.3475
本期加权平均净值利润率	14.36%
本期基金份额净值增长率	16.55%
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	7,038,154.12

期末可供分配基金份额利润	0.9785
期末基金资产净值	18,669,116.30
期末基金份额净值	2.5957
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	99.01%

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 2019 年 7 月 12 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2019 年 7 月 15 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

南方上证 380ETF 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	14.56%	1.35%	13.47%	1.36%	1.09%	-0.01%
过去六个月	16.78%	1.39%	15.40%	1.40%	1.38%	-0.01%
过去一年	38.96%	1.19%	36.31%	1.19%	2.65%	0.00%
过去三年	41.77%	1.21%	34.19%	1.21%	7.58%	0.00%
过去五年	36.32%	1.15%	22.39%	1.15%	13.93%	0.00%
过去七年	102.27%	1.15%	62.57%	1.15%	39.70%	0.00%
过去十年	90.86%	1.16%	43.02%	1.17%	47.84%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	166.80%	1.42%	106.48%	1.43%	60.32%	-0.01%

南方上证 380ETF 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	14.44%	1.35%	13.47%	1.36%	0.97%	-0.01%
过去六个月	16.55%	1.39%	15.40%	1.40%	1.15%	-0.01%
过去一年	38.41%	1.19%	36.31%	1.19%	2.10%	0.00%
过去三年	40.08%	1.21%	34.19%	1.21%	5.89%	0.00%

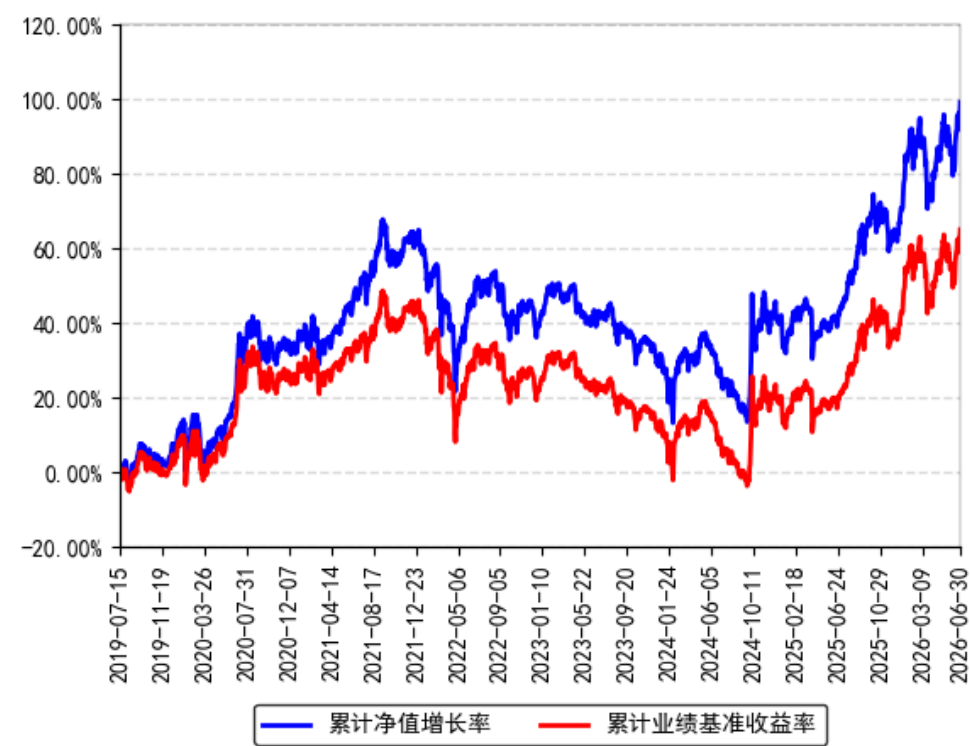
过去五年	33.63%	1.15%	22.39%	1.15%	11.24%	0.00%
自基金合同生效起至今	99.01%	1.15%	64.91%	1.15%	34.10%	0.00%

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

南方上证380ETF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



南方上证380ETF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



注：本基金从 2019 年 7 月 12 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2019 年 7 月 15 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	说明
----	----	-----------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
孙伟	本基金基金经理	2019 年 7 月 12 日	-	16 年	中国国籍，北京大学工商管理硕士，注册会计师（CPA），具有基金从业资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010 年 2 月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员、基金经理助理；2015 年 5 月 22 日至 2016 年 7 月 29 日，任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 7 月 2 日至 2020 年 12 月 1 日，任改革基金、高铁基金基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 7 日，任南方中证 500 工业 ETF 基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 14 日，任南方中证 500 原材料 ETF 基金经理；2020 年 12 月 1 日至 2021 年 4 月 19 日，任改革基金基金经理；2015 年 7 月 10 日至今，任 500 信息基金经理；2016 年 5 月 13 日至今，任南方创业板 ETF 基金经理；2016 年 5 月 20 日至今，任南方创业板 ETF 联接基金经理；2016 年 8 月 17 日至今，任 500 信息联接基金经理；2016 年 8 月 19 日至今，任深成 ETF、南方深成基金经理；2017 年 3 月 8 日至今，任南方全指证券 ETF 联接基金经理；2017 年 3 月 10 日至今，任南方中证全指证券 ETF 基金经理；2017 年 6 月 28 日至今，任南方中证银行 ETF 基金经理；2017 年 6 月 29 日至今，任南方银行联接基金经理；2018 年 2 月 8 日至今，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至今，任南方 H 股联接基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任南方上证 380ETF、南方上证 380ETF 联接基金经理；2020 年 12 月 1 日至今，任高铁基金基金经理；2022 年 3 月 3 日至今，任南方上海金 ETF 基金经理；2023 年 7 月 25 日至今，任南方上海金 ETF 发起联接基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占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

本报告期内，上证 380 指数上涨 16.19%，显著跑赢同期上证指数。上证 380 指数作为反映沪市中等市值上市公司整体表现的重要宽基指数，在 2025 年 6 月编制方案优化后，指数对中盘股的代表性进一步提升，与上证 180 指数的层次分工更加清晰，构建起完整的沪市大中盘投资链条。2026 年上半年，上证 380 指数在先进制造、创新药、TMT、专精特新等中盘成长方向的带动下表现活跃，同时部分高股息价值蓝筹提供了下行支撑，指数整体呈现“成长为矛、价值为盾”的均衡上行特征。中盘蓝筹作为连接大型蓝筹与小型成长股的关键环节，在盈利质量和成长弹性上展现出较强的综合吸引力。

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”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

- （1）新股上市初期涨幅较大的影响；
- （2）大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- （3）本基金大额换购目标 ETF 所带来的成份股权重偏离，对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行应对；
- （4）报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离；
- （5）根据指数成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 2.6680 元，报告期内，份额净值增长率为 16.78%，同期业绩基准增长率为 15.40%；本基金 C 份额净值为 2.5957 元，报告期内，份额净值增长率为 16.55%，同期业绩基准增长率为 15.40%。

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，上证 380 指数作为沪市中等市值上市公司的核心代表，将在多重政策与市场生态变化中呈现较高的相对配置价值。从指数生态看，2025 年 6 月编制方案优化落地后，上证 50、上证 180、上证 380 三层指数体系分工进一步清晰：上证 50 锚定超大市值蓝筹，上证 180 聚焦大中型核心资产，上证 380 则专注中盘成长与转型标的，形成“大盘价值-核心蓝筹-中盘成长”的完整投资链条。编制方案调整后，指数对沪市专精特新“小巨人”、战略性新兴产业和沪港通标的的覆盖度提升，成分股中新能源、创新药、高端装备、半导体材料等方向的权重稳步抬升。从盈利质量看，中盘公司整体 ROE 水平在 2026 年上半年财报中呈现企稳回升迹象，与沪深 300、上证 180 等大盘指数相比，上证 380 在营收增速与净利润弹性上具备明显的“向上斜率”优势。从资金面看，长期资金对沪市中盘蓝筹的战略配置比例明显偏低，随着中长期资金入市方案和被动指数产品扩容的持续推进，以及 ESG 评价体系纳入沪市中盘公司范围扩大，指数有望获得增量资金持续流入。从产品生态看，跟踪上证 380 指数的 ETF、场外指数基金、指数增强产品数量与规模均处于稳步扩容通道，指数化投资的“工具属性”日益强化，配合 ETF 互联互通等制度红利，指数运作效率与流动性有望进一步改善。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方上证 380 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	6,636,734.61	4,027,022.11
结算备付金		6,669.47	10,537.56
存出保证金		7,155.87	5,560.75
交易性金融资产	6.4.7.2	133,527,018.16	136,159,035.66
其中：股票投资		2,377,237.01	1,097,874.42
基金投资		130,040,651.01	131,422,167.49
债券投资		1,109,130.14	3,638,993.75
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		-	430,604.40
应收股利		-	-

应收申购款		85,411.75	78,067.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	105.00	105.00
资产总计		140,263,094.86	140,710,933.05
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		212.38	-
应付赎回款		650,647.86	897,794.09
应付管理人报酬		3,373.56	4,246.41
应付托管费		674.71	849.29
应付销售服务费		6,015.74	5,313.58
应付投资顾问费		-	-
应交税费		35.95	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	82,123.47	151,539.27
负债合计		743,083.67	1,059,742.64
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	52,488,661.88	61,301,790.09
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	87,031,349.31	78,349,400.32
净资产合计		139,520,011.19	139,651,190.41
负债和净资产总计		140,263,094.86	140,710,933.05

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，南方上证 380ETF 联接 A 份额净值 2.6680 元，基金份额总额 45,296,304.72 份；南方上证 380ETF 联接 C 份额净值 2.5957 元，基金份额总额 7,192,357.16 份；总份额合计 52,488,661.88 份。

6.2 利润表

会计主体：南方上证 380 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		22,304,480.09	5,649,537.30
1.利息收入		12,476.82	9,920.29

其中：存款利息收入	6.4.7.9	12,476.82	9,920.29
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）		8,040,707.27	849,450.96
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-13,840.92	-116,126.91
基金投资收益	6.4.7.11	8,026,281.30	923,545.31
债券投资收益	6.4.7.12	13,437.27	18,669.90
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	14,829.62	23,362.66
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	14,217,084.47	4,773,641.98
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	34,211.53	16,524.07
减：二、营业总支出		149,199.47	157,575.11
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	24,485.08	23,463.33
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	4,897.02	4,692.66
3.销售服务费	6.4.10.2.3	38,184.41	40,159.49
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		878.24	7,643.13
其中：卖出回购金融资产支出		878.24	7,643.13
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		9.75	856.35
8.其他费用	6.4.7.19	80,744.97	80,760.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,155,280.62	5,491,962.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以		22,155,280.62	5,491,962.19

“-”号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		22,155,280.62	5,491,962.19

6.3 净资产变动表

会计主体：南方上证 380 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	61,301,790.09	-	78,349,400.32	139,651,190.41
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	61,301,790.09	-	78,349,400.32	139,651,190.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,813,128.21	-	8,681,948.99	-131,179.22
（一）、综合收益总额	-	-	22,155,280.62	22,155,280.62
（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）	-8,813,128.21	-	-13,473,331.63	-22,286,459.84
其中：1.基金申购款	16,145,877.08	-	23,478,215.71	39,624,092.79
2.基金赎回款	-24,959,005.29	-	-36,951,547.34	-61,910,552.63
（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）	-	-	-	-

列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	52,488,661.88	-	87,031,349.31	139,520,011.19
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	86,559,868.65	-	73,187,369.18	159,747,237.83
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	86,559,868.65	-	73,187,369.18	159,747,237.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,452,458.87	-	-2,699,644.41	-12,152,103.28
(一)、综合收益总额	-	-	5,491,962.19	5,491,962.19
(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）	-9,452,458.87	-	-8,191,606.60	-17,644,065.47
其中：1.基金申购款	9,536,631.98	-	8,092,225.09	17,628,857.07
2.基金赎回款	-18,989,090.85	-	-16,283,831.69	-35,272,922.54
(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	77,107,409.78	-	70,487,724.77	147,595,134.55

净资产				
-----	--	--	--	--

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

南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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[2011]1096 号《关于核准南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司,已于 2018 年 1 月 4 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 324,062,176.29 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(2011)第 390 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2011 年 9 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 324,134,578.45 份基金份额,其中认购资金利息折合 72,402.16 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2019 年 7 月 5 日发布的《关于南方上证 380 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》以及更新的《南方上证 380 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 2019 年 7 月 12 日起,本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取前端申购费用,且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,且不收取申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 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。

本基金为上证 380 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上证 380 指数紧密跟踪的被动指数基金,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《南方上证 380 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,本基金的投资范围为目标 ETF、上证 380 指数成份股

和备选成份股，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票以及存托凭证）、新股、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行，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：上证 380 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 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	6,636,734.61
等于：本金	6,636,057.87
加：应计利息	676.74
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	6,636,734.61
----	--------------

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		2,352,184.33	-	2,377,237.01	25,052.68
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,103,189.00	6,140.14	1,109,130.14	-199.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,103,189.00	6,140.14	1,109,130.14	-199.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		87,083,698.36	-	130,040,651.01	42,956,952.65
其他		-	-	-	-
合计		90,539,071.69	6,140.14	133,527,018.16	42,981,806.33

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	-
可收退补款	105.00
应收退补款	-
合计	105.00

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	618.31
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,162.00
其中：交易所市场	2,162.00
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	-
预提费用	79,343.16
应付指数使用费	-
可退替代款	-
合计	82,123.47

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方上证 380ETF 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	54,348,133.29	54,348,133.29
本期申购	8,929,145.28	8,929,145.28
本期赎回（以“-”号填列）	-17,980,973.85	-17,980,973.85
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	45,296,304.72	45,296,304.72

南方上证 380ETF 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	6,953,656.80	6,953,656.80
本期申购	7,216,731.80	7,216,731.80
本期赎回（以“-”号填列）	-6,978,031.44	-6,978,031.44
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	7,192,357.16	7,192,357.16

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

南方上证 380ETF 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	48,790,707.66	21,025,851.48	69,816,559.14
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	48,790,707.66	21,025,851.48	69,816,559.14
本期利润	6,929,355.12	12,459,929.83	19,389,284.95
本期基金份额交易产生的变动数	-8,690,736.34	-4,960,517.58	-13,651,253.92
其中：基金申购款	8,335,018.25	4,941,787.32	13,276,805.57
基金赎回款	-17,025,754.59	-9,902,304.90	-26,928,059.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	47,029,326.44	28,525,263.73	75,554,590.17

南方上证 380ETF 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	5,886,686.41	2,646,154.77	8,532,841.18
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	5,886,686.41	2,646,154.77	8,532,841.18
本期利润	1,008,841.03	1,757,154.64	2,765,995.67
本期基金份额交易产生的变动数	142,626.68	35,295.61	177,922.29
其中：基金申购款	6,358,282.56	3,843,127.58	10,201,410.14
基金赎回款	-6,215,655.88	-3,807,831.97	-10,023,487.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,038,154.12	4,438,605.02	11,476,759.14

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	12,372.32
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	20.57
其他	83.93
合计	12,476.82

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	-13,840.92
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	-13,840.92

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	28,843,590.71
减：卖出股票成本总额	28,837,820.46
减：交易费用	19,611.17
买卖股票差价收入	-13,840.92

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	27,381,991.74
减：卖出/赎回基金成本总额	19,355,125.96
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	584.48
基金投资收益	8,026,281.30

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	8,119.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,318.00
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	13,437.27

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	3,644,070.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,594,682.00
减：应计利息总额	44,070.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	5,318.00

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	14,829.62
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	14,829.62

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	14,217,084.47
——股票投资	-18,518.71
——债券投资	-5,847.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	14,241,450.18
——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	14,217,084.47

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	30,120.14
基金转换费收入	4,091.39
合计	34,211.53

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	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,400.35
其他	1.46
合计	80,744.97

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
上证 380 交易型开放式指数证券投资基金(“目标	本基金的基金管理人管理的其他基金

ETF”)	
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	24,485.08	23,463.33
其中：应支付销售机构的客户维护费	140,540.82	145,501.52
应支付基金管理人的净管理费	-116,055.74	-122,038.19

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 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产}) \times 0.50\% \div \text{当年天数}。$$

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	4,897.02	4,692.66

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 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产}) \times 0.10\% \div \text{当年天数}。$$

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		
	南方上证 380ETF 联 接 A	南方上证 380ETF 联 接 C	合计
南方基金	-	860.69	860.69
合计	-	860.69	860.69
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		
	南方上证 380ETF 联 接 A	南方上证 380ETF 联 接 C	合计
南方基金	-	1,096.79	1,096.79
合计	-	1,096.79	1,096.79

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% \div \text{当年天数}。$$

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
中国建设银行	6,636,734.61	12,372.32	4,972,492.23	9,774.54

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

无。

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 87,083,698.36 元，估值总额为人民币 130,040,651.01 元，占本基金基金净资产的比例为 93.21%（于上期末，本基金持有目标 ETF 基金份额，成本总额为人民币 102,706,665.02 元，估值总额为人民币 131,422,167.49 元，占本基金基金净资产的比例为 94.11%）。

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：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	20	2,000.00	2,000.03	-

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	6,636,734.61	-	-	-	6,636,734.61
结算备付金	6,669.47	-	-	-	6,669.47
存出保证金	7,155.87	-	-	-	7,155.87
交易性金融 资产	1,107,130.11	-	2,000.03	132,417,888. 02	133,527,018. 16
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	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	85,411.75	85,411.75
递延所得税 资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	105.00	105.00
资产总计	7,757,690.06	-	2,000.03	132,503,404. 77	140,263,094. 86
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	-	-	-	212.38	212.38
应付赎回款	-	-	-	650,647.86	650,647.86
应付管理人 报酬	-	-	-	3,373.56	3,373.56
应付托管费	-	-	-	674.71	674.71
应付销售服 务费	-	-	-	6,015.74	6,015.74
应付投资顾	-	-	-	-	-

问费					
应交税费	-	-	-	35.95	35.95
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税 负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	82,123.47	82,123.47
负债总计	-	-	-	743,083.67	743,083.67
利率敏感度 缺口	7,757,690.06	-	2,000.03	131,760,321. 10	139,520,011. 19
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	4,027,022.11	-	-	-	4,027,022.11
结算备付金	10,537.56	-	-	-	10,537.56
存出保证金	5,560.75	-	-	-	5,560.75
交易性金融 资产	3,638,993.75	-	-	132,520,041. 91	136,159,035. 66
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	-	-	-	430,604.40	430,604.40
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	1,409.96	-	-	76,657.61	78,067.57
递延所得税 资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	105.00	105.00
资产总计	7,683,524.13	-	-	133,027,408. 92	140,710,933. 05
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	-	-	-	897,794.09	897,794.09
应付管理人报酬	-	-	-	4,246.41	4,246.41
应付托管费	-	-	-	849.29	849.29
应付销售服务费	-	-	-	5,313.58	5,313.58
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	151,539.27	151,539.27
负债总计	-	-	-	1,059,742.64	1,059,742.64
利率敏感度缺口	7,683,524.13	-	-	131,967,666.28	139,651,190.41

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

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	-1,498.40	-1,055.25
	2.市场利率平行下降 25 个基点	1,502.47	1,056.45

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	2,377,237.01	1.70	1,097,874.42	0.79
交易性金融资产-基金投资	130,040,651.01	93.21	131,422,167.49	94.11
交易性金融资产-债券投资	2,000.03	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	132,419,888.05	94.91	132,520,041.91	94.89

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%	6,569,635.22	6,602,641.28
	2.组合自身基准下降 5%	-6,569,635.22	-6,602,641.28

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	132,417,888.02

第二层次	1,109,130.14
第三层次	-
合计	133,527,018.16

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	2,377,237.01	1.69
	其中：股票	2,377,237.01	1.69
2	基金投资	130,040,651.01	92.71
3	固定收益投资	1,109,130.14	0.79
	其中：债券	1,109,130.14	0.79
	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	6,643,404.08	4.74

8	其他各项资产	92,672.62	0.07
9	合计	140,263,094.86	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	2,840.08	0.00
B	采矿业	124,349.15	0.09
C	制造业	1,589,979.94	1.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	100,576.03	0.07
E	建筑业	48,848.00	0.04
F	批发和零售业	37,019.33	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	53,453.95	0.04
H	住宿和餐饮业	2,620.80	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	106,301.87	0.08
J	金融业	201,015.26	0.14
K	房地产业	41,878.80	0.03
L	租赁和商务服务业	12,722.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	13,227.18	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	26,127.62	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,388.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	12,889.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	2,377,237.01	1.70

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	688361	中科飞测	200	86,000.00	0.06
2	688347	华虹宏力	200	67,260.00	0.05
3	601869	长飞光纤	100	54,590.00	0.04
4	688120	华海清科	100	32,218.00	0.02
5	688172	燕东微	331	27,691.46	0.02

6	600460	士兰微	500	27,330.00	0.02
7	603256	宏和科技	100	26,533.00	0.02
8	603083	剑桥科技	100	25,487.00	0.02
9	688220	翱捷科技	203	25,236.96	0.02
10	688777	中控技术	200	23,500.00	0.02
11	600879	航天电子	1,100	23,419.00	0.02
12	688469	芯联集成	2,106	22,344.66	0.02
13	600498	烽火通信	300	22,080.00	0.02
14	688578	艾力斯	200	21,840.00	0.02
15	688099	晶晨股份	200	20,580.00	0.01
16	600885	宏发股份	561	19,348.89	0.01
17	600563	法拉电子	100	19,080.00	0.01
18	605589	圣泉集团	300	19,071.00	0.01
19	600141	兴发集团	400	18,788.00	0.01
20	688313	仕佳光子	100	18,465.00	0.01
21	600988	赤峰黄金	700	18,424.00	0.01
22	600601	方正科技	1,300	17,992.00	0.01
23	600667	太极实业	600	17,508.00	0.01
24	605111	新洁能	175	17,349.50	0.01
25	601179	中国西电	1,100	16,412.00	0.01
26	600392	盛和资源	550	16,373.50	0.01
27	600497	驰宏锌锗	1,300	15,743.00	0.01
28	688002	睿创微纳	100	15,469.00	0.01
29	603290	斯达半导	100	15,294.00	0.01
30	600378	昊华科技	200	15,076.00	0.01
31	600157	永泰能源	9,100	14,651.00	0.01
32	600909	华安证券	1,300	14,443.00	0.01
33	600711	盛屯矿业	1,300	14,261.00	0.01
34	600143	金发科技	900	13,905.00	0.01
35	601555	东吴证券	1,700	13,464.00	0.01
36	600352	浙江龙盛	1,100	13,321.00	0.01
37	601233	桐昆股份	600	12,990.00	0.01
38	603005	晶方科技	240	12,928.80	0.01
39	601058	赛轮轮胎	1,100	12,683.00	0.01
40	601126	四方股份	200	12,640.00	0.01
41	688122	西部超导	200	12,562.00	0.01
42	603283	赛腾股份	152	12,308.96	0.01
43	601636	旗滨集团	1,200	12,276.00	0.01
44	601108	财通证券	1,400	12,110.00	0.01
45	603979	金诚信	200	11,806.00	0.01
46	603659	璞泰来	400	11,572.00	0.01
47	603588	高能环境	600	11,520.00	0.01
48	601456	国联民生	1,300	11,492.00	0.01

49	689009	九号公司	300	11,445.00	0.01
50	688387	信科移动	573	11,368.32	0.01
51	603087	甘李药业	200	11,352.00	0.01
52	601991	大唐发电	1,600	11,328.00	0.01
53	601958	金钼股份	400	11,244.00	0.01
54	601117	中国化学	1,500	11,025.00	0.01
55	603179	新泉股份	220	10,923.00	0.01
56	601198	东兴证券	800	10,872.00	0.01
57	600298	安琪酵母	300	10,860.00	0.01
58	603063	禾望电气	200	10,578.00	0.01
59	688728	格科微	500	10,520.00	0.01
60	600839	四川长虹	1,500	10,470.00	0.01
61	601878	浙商证券	1,100	10,450.00	0.01
62	601665	齐鲁银行	1,800	10,386.00	0.01
63	688114	华大智造	202	10,318.16	0.01
64	688180	君实生物	300	10,146.00	0.01
65	603606	东方电缆	240	9,962.40	0.01
66	603156	养元饮品	200	9,814.00	0.01
67	603650	彤程新材	100	9,798.00	0.01
68	601099	太平洋	2,900	9,773.00	0.01
69	600109	国金证券	1,100	9,658.00	0.01
70	600641	先导基电	240	9,566.40	0.01
71	600256	广汇能源	1,900	9,386.00	0.01
72	601615	明阳智能	800	9,256.00	0.01
73	601021	春秋航空	200	9,116.00	0.01
74	601799	星宇股份	100	9,062.00	0.01
75	600021	上海电力	600	9,042.00	0.01
76	688484	南芯科技	160	9,038.40	0.01
77	601128	常熟银行	1,543	8,980.26	0.01
78	601696	中银证券	700	8,855.00	0.01
79	600577	精达股份	900	8,802.00	0.01
80	688388	嘉元科技	200	8,800.00	0.01
81	601577	长沙银行	1,000	8,710.00	0.01
82	600699	均胜电子	400	8,644.00	0.01
83	603127	昭衍新药	224	8,561.28	0.01
84	600060	海信视像	300	8,361.00	0.01
85	688599	天合光能	589	8,316.68	0.01
86	603678	火炬电子	100	8,300.00	0.01
87	601677	明泰铝业	500	8,300.00	0.01
88	688568	中科星图	200	8,294.00	0.01
89	603688	石英股份	100	8,261.00	0.01
90	603345	安井食品	100	8,019.00	0.01
91	603267	鸿远电子	100	7,748.00	0.01

92	601607	上海医药	500	7,700.00	0.01
93	603379	三美股份	100	7,589.00	0.01
94	600027	华电国际	1,700	7,565.00	0.01
95	600177	雅戈尔	1,000	7,530.00	0.01
96	605090	九丰能源	200	7,434.00	0.01
97	603225	新凤鸣	376	7,388.40	0.01
98	603596	伯特利	296	7,352.64	0.01
99	600536	中国软件	258	7,254.96	0.01
100	600862	中航高科	400	7,212.00	0.01
101	603920	世运电路	150	7,206.00	0.01
102	600061	国投资本	1,100	7,205.00	0.01
103	600363	联创光电	200	7,156.00	0.01
104	601699	潞安环能	500	7,140.00	0.01
105	688385	复旦微电	100	7,129.00	0.01
106	603369	今世缘	300	7,113.00	0.01
107	600985	淮北矿业	500	7,025.00	0.01
108	600642	申能股份	800	6,984.00	0.01
109	601001	晋控煤业	400	6,956.00	0.00
110	601717	中创智领	500	6,955.00	0.00
111	600085	同仁堂	300	6,933.00	0.00
112	600918	中泰证券	1,300	6,916.00	0.00
113	600499	科达制造	500	6,900.00	0.00
114	600369	西南证券	1,700	6,834.00	0.00
115	688106	金宏气体	164	6,802.72	0.00
116	603806	福斯特	400	6,716.00	0.00
117	603236	移远通信	131	6,703.27	0.00
118	600845	宝信软件	400	6,652.00	0.00
119	600637	东方明珠	800	6,648.00	0.00
120	603119	浙江荣泰	100	6,634.00	0.00
121	688472	阿特斯	610	6,600.20	0.00
122	600515	海南机场	2,400	6,576.00	0.00
123	600765	中航重机	500	6,460.00	0.00
124	600171	上海贝岭	200	6,388.00	0.00
125	600888	新疆众和	400	6,356.00	0.00
126	601216	君正集团	1,400	6,244.00	0.00
127	600459	贵研铂业	216	6,238.08	0.00
128	601016	节能风电	1,600	6,208.00	0.00
129	603160	汇顶科技	100	6,171.00	0.00
130	601997	贵阳银行	1,200	6,156.00	0.00
131	600704	物产中大	1,300	6,136.00	0.00
132	688005	容百科技	200	6,120.00	0.00
133	600348	华阳股份	800	6,120.00	0.00
134	600863	华能蒙电	1,300	6,110.00	0.00

135	688116	天奈科技	158	6,035.60	0.00
136	603077	和邦生物	2,600	6,032.00	0.00
137	688538	和辉光电	2,313	6,013.80	0.00
138	600332	白云山	300	6,012.00	0.00
139	688213	思特威	56	5,995.92	0.00
140	603605	珀莱雅	100	5,992.00	0.00
141	603766	隆鑫通用	500	5,965.00	0.00
142	601990	南京证券	900	5,913.00	0.00
143	600873	梅花生物	800	5,880.00	0.00
144	600521	华海药业	400	5,760.00	0.00
145	600901	江苏金租	1,000	5,750.00	0.00
146	603338	浙江鼎力	134	5,695.00	0.00
147	603298	杭叉集团	235	5,607.10	0.00
148	600316	洪都航空	200	5,588.00	0.00
149	601611	中国核建	500	5,575.00	0.00
150	688166	博瑞医药	159	5,566.59	0.00
151	600153	建发股份	700	5,551.00	0.00
152	600529	山东药玻	300	5,535.00	0.00
153	600323	瀚蓝环境	200	5,492.00	0.00
154	603939	益丰药房	300	5,394.00	0.00
155	603568	伟明环保	349	5,367.62	0.00
156	600398	海澜之家	1,000	5,230.00	0.00
157	600600	青岛啤酒	100	5,223.00	0.00
158	600578	京能电力	800	5,160.00	0.00
159	688009	中国通号	1,083	5,155.08	0.00
160	603885	吉祥航空	500	5,145.00	0.00
161	600208	衢州发展	1,800	5,094.00	0.00
162	603486	科沃斯	100	5,075.00	0.00
163	600486	扬农化工	100	5,070.00	0.00
164	600038	中直股份	200	5,058.00	0.00
165	688208	道通科技	200	5,038.00	0.00
166	603699	纽威股份	100	5,030.00	0.00
167	601000	唐山港	1,198	4,971.70	0.00
168	688297	中无人机	119	4,944.45	0.00
169	600737	中粮糖业	400	4,932.00	0.00
170	600995	南网储能	400	4,920.00	0.00
171	600761	安徽合力	300	4,908.00	0.00
172	600008	首创环保	1,800	4,896.00	0.00
173	600170	上海建工	2,200	4,884.00	0.00
174	601156	东航物流	300	4,836.00	0.00
175	603816	顾家家居	216	4,829.76	0.00
176	688065	凯赛生物	100	4,785.00	0.00
177	600998	九州通	1,009	4,732.21	0.00

178	600820	隧道股份	900	4,689.00	0.00
179	600428	中远海特	600	4,686.00	0.00
180	688676	金盘科技	55	4,655.20	0.00
181	600282	南钢股份	1,000	4,590.00	0.00
182	600583	海油工程	900	4,527.00	0.00
183	603505	金石资源	223	4,493.45	0.00
184	601567	三星电气	300	4,482.00	0.00
185	600435	北方导航	400	4,480.00	0.00
186	601137	博威合金	200	4,466.00	0.00
187	600566	济川药业	200	4,438.00	0.00
188	600380	健康元	471	4,436.82	0.00
189	601666	平煤股份	618	4,418.70	0.00
190	600161	天坛生物	380	4,400.40	0.00
191	600483	福能股份	430	4,381.70	0.00
192	600131	国网信通	300	4,380.00	0.00
193	600546	山煤国际	400	4,372.00	0.00
194	600967	内蒙一机	400	4,340.00	0.00
195	600329	达仁堂	115	4,280.30	0.00
196	601880	辽港股份	3,100	4,278.00	0.00
197	603341	龙旗科技	100	4,249.00	0.00
198	600562	国睿科技	200	4,244.00	0.00
199	601865	福莱特	400	4,204.00	0.00
200	601399	国机重装	1,200	4,200.00	0.00
201	603737	三棵树	173	4,169.30	0.00
202	600132	重庆啤酒	100	4,130.00	0.00
203	603899	晨光股份	200	4,126.00	0.00
204	601155	新城控股	400	4,104.00	0.00
205	600390	五矿资本	900	4,104.00	0.00
206	601187	厦门银行	600	4,098.00	0.00
207	601236	红塔证券	600	4,092.00	0.00
208	603786	科博达	100	4,091.00	0.00
209	603281	江瀚新材	100	4,063.00	0.00
210	600816	建元信托	1,600	3,904.00	0.00
211	603565	中谷物流	397	3,894.57	0.00
212	600285	羚锐制药	200	3,876.00	0.00
213	600064	南京高科	540	3,850.20	0.00
214	600095	湘财股份	500	3,765.00	0.00
215	603619	中曼石油	200	3,742.00	0.00
216	603728	鸣志电器	60	3,655.20	0.00
217	603612	索通发展	200	3,626.00	0.00
218	688187	时代电气	52	3,570.32	0.00
219	600970	中材国际	500	3,565.00	0.00
220	601528	瑞丰银行	800	3,536.00	0.00

221	600750	华润江中	160	3,531.20	0.00
222	688303	大全能源	200	3,486.00	0.00
223	600120	浙江东方	810	3,483.00	0.00
224	600871	石化油服	1,700	3,451.00	0.00
225	600216	浙江医药	300	3,420.00	0.00
226	600452	涪陵电力	365	3,405.45	0.00
227	600663	陆家嘴	540	3,391.20	0.00
228	600763	通策医疗	100	3,388.00	0.00
229	600559	老白干酒	302	3,382.40	0.00
230	603613	国联股份	183	3,370.86	0.00
231	600350	山东高速	300	3,339.00	0.00
232	600655	豫园股份	800	3,288.00	0.00
233	600517	国网英大	700	3,276.00	0.00
234	600755	厦门国贸	600	3,252.00	0.00
235	688779	五矿新能	400	3,244.00	0.00
236	600612	老凤祥	100	3,215.00	0.00
237	601222	林洋能源	600	3,192.00	0.00
238	603871	嘉友国际	308	3,144.68	0.00
239	600801	华新建材	200	3,120.00	0.00
240	600582	天地科技	698	3,106.10	0.00
241	600210	紫江企业	500	3,100.00	0.00
242	688333	铂力特	30	3,072.00	0.00
243	601966	玲珑轮胎	300	3,057.00	0.00
244	600409	三友化工	500	3,055.00	0.00
245	603305	旭升集团	252	3,054.24	0.00
246	600633	浙数文化	300	3,054.00	0.00
247	688349	三一重能	200	3,036.00	0.00
248	600446	金证股份	300	3,018.00	0.00
249	603833	欧派家居	100	3,011.00	0.00
250	600968	海油发展	900	2,997.00	0.00
251	600848	上海临港	400	2,996.00	0.00
252	601598	中国外运	600	2,976.00	0.00
253	603198	迎驾贡酒	100	2,960.00	0.00
254	600933	爱柯迪	200	2,956.00	0.00
255	601098	中南传媒	300	2,952.00	0.00
256	603529	爱玛科技	150	2,926.50	0.00
257	603658	安图生物	100	2,902.00	0.00
258	603927	中科软	228	2,897.88	0.00
259	603556	海兴电力	130	2,860.00	0.00
260	600598	北大荒	262	2,840.08	0.00
261	603690	至纯科技	80	2,832.00	0.00
262	601702	华峰铝业	200	2,820.00	0.00
263	601136	首创证券	200	2,790.00	0.00

264	600916	中国黄金	400	2,736.00	0.00
265	603456	九洲药业	200	2,732.00	0.00
266	600129	太极集团	200	2,714.00	0.00
267	600057	厦门象屿	500	2,710.00	0.00
268	603233	大参林	176	2,645.28	0.00
269	601928	凤凰传媒	300	2,637.00	0.00
270	600776	东方通信	200	2,628.00	0.00
271	600258	首旅酒店	240	2,620.80	0.00
272	603712	七一二	200	2,578.00	0.00
273	600773	西藏城投	200	2,574.00	0.00
274	603730	岱美股份	225	2,513.25	0.00
275	603883	老百姓	229	2,509.84	0.00
276	600399	抚顺特钢	600	2,466.00	0.00
277	600328	中盐化工	410	2,460.00	0.00
278	601298	青岛港	300	2,415.00	0.00
279	600292	电投水电	200	2,408.00	0.00
280	601965	中国汽研	200	2,392.00	0.00
281	600507	方大特钢	590	2,389.50	0.00
282	601311	骆驼股份	300	2,337.00	0.00
283	600377	宁沪高速	200	2,314.00	0.00
284	600295	鄂尔多斯	212	2,272.64	0.00
285	603027	千禾味业	324	2,258.28	0.00
286	600116	三峡水利	400	2,240.00	0.00
287	600993	马应龙	100	2,162.00	0.00
288	601808	中海油服	200	2,162.00	0.00
289	600032	浙江新能	300	2,115.00	0.00
290	600325	华发股份	900	2,079.00	0.00
291	603218	日月股份	200	2,044.00	0.00
292	601882	海天精工	100	2,023.00	0.00
293	600373	中文传媒	300	1,989.00	0.00
294	603915	国茂股份	140	1,986.60	0.00
295	600782	新钢股份	800	1,984.00	0.00
296	601139	深圳燃气	350	1,981.00	0.00
297	600273	嘉化能源	300	1,956.00	0.00
298	600720	中交设计	400	1,928.00	0.00
299	601019	山东出版	300	1,920.00	0.00
300	600729	重百集团	100	1,878.00	0.00
301	600395	盘江股份	400	1,824.00	0.00
302	601112	振石股份	100	1,823.00	0.00
303	603317	天味食品	140	1,821.40	0.00
304	600866	星湖科技	400	1,756.00	0.00
305	600740	山西焦化	550	1,754.50	0.00
306	601858	中国科传	100	1,731.00	0.00

307	605333	沪光股份	100	1,705.00	0.00
308	688019	安集科技	5	1,697.30	0.00
309	601595	上海电影	100	1,660.00	0.00
310	600675	中华企业	800	1,648.00	0.00
311	603888	新华网	95	1,617.85	0.00
312	600248	陕建股份	600	1,602.00	0.00
313	600012	皖通高速	100	1,576.00	0.00
314	600299	安迪苏	200	1,570.00	0.00
315	600422	昆药集团	200	1,562.00	0.00
316	603707	健友股份	216	1,527.12	0.00
317	601952	苏垦农发	200	1,498.00	0.00
318	603393	新天然气	68	1,455.88	0.00
319	688289	圣湘生物	100	1,440.00	0.00
320	601033	永兴股份	100	1,340.00	0.00
321	600662	外服控股	300	1,209.00	0.00
322	600211	西藏药业	30	1,121.70	0.00
323	603025	大豪科技	60	818.40	0.00
324	601022	宁波远洋	100	762.00	0.00
325	603583	捷昌驱动	32	729.60	0.00
326	600956	新天绿能	100	699.00	0.00
327	688123	聚辰股份	3	637.80	0.00
328	688778	厦钨新能	11	598.40	0.00
329	688390	固德威	5	542.55	0.00
330	603355	莱克电气	20	527.60	0.00
331	688248	南网科技	5	345.90	0.00
332	688516	奥特维	5	286.95	0.00
333	688278	特宝生物	5	272.00	0.00
334	688690	纳微科技	6	264.60	0.00
335	688295	中复神鹰	3	181.62	0.00
336	688139	海尔生物	6	158.52	0.00
337	688006	杭可科技	3	109.65	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	688120	华海清科	38,192.00	0.03
2	688361	中科飞测	37,586.00	0.03
3	600549	厦门钨业	33,514.00	0.02
4	688169	石头科技	28,616.00	0.02
5	600096	云天化	25,935.00	0.02

6	603129	春风动力	25,357.00	0.02
7	600580	卧龙电驱	22,830.00	0.02
8	688002	睿创微纳	22,660.00	0.02
9	688333	铂力特	22,516.00	0.02
10	601058	赛轮轮胎	21,115.00	0.02
11	600879	航天电子	21,041.00	0.02
12	600143	金发科技	19,962.00	0.01
13	688578	艾力斯	19,828.00	0.01
14	601555	东吴证券	19,764.00	0.01
15	600673	东阳光	19,629.00	0.01
16	601179	中国西电	19,576.00	0.01
17	600839	四川长虹	19,391.00	0.01
18	603228	景旺电子	19,336.00	0.01
19	600118	中国卫星	19,249.00	0.01
20	600460	士兰微	18,824.00	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	600487	亨通光电	486,793.00	0.35
2	688525	佰维存储	358,565.60	0.26
3	688521	芯原股份	310,266.61	0.22
4	688120	华海清科	279,620.00	0.20
5	688017	绿的谐波	277,781.76	0.20
6	600879	航天电子	274,165.00	0.20
7	688019	安集科技	272,161.58	0.19
8	688702	盛科通信	267,646.00	0.19
9	600549	厦门钨业	263,316.00	0.19
10	688037	芯源微	261,236.00	0.19
11	600988	赤峰黄金	253,023.00	0.18
12	688777	中控技术	228,741.32	0.16
13	600673	东阳光	215,269.00	0.15
14	600118	中国卫星	211,597.00	0.15
15	688002	睿创微纳	211,168.74	0.15
16	688361	中科飞测	203,726.00	0.15
17	601168	西部矿业	199,790.00	0.14
18	603083	剑桥科技	197,696.00	0.14
19	600498	烽火通信	195,161.00	0.14
20	688235	百济神州	191,447.86	0.14

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	2,782,577.76
卖出股票收入（成交）总额	28,843,590.71

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	1,107,130.11	0.79
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）	2,000.03	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,109,130.14	0.79

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	11,000	1,107,130.11	0.79
2	111025	圣泉转债	20	2,000.03	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	南方上证 380ETF	股票型	交易型开 放式	南方基金 管理股份 有限公司	130,040,65 1.01	93.21

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，达到有效跟踪对标的指数的目的。

基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

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	7,155.87
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	85,411.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	105.00
9	合计	92,672.62

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
南方上证 380ETF 联 接 A	9,300	4,870.57	2,073,889.7 6	4.58%	43,222,414. 96	95.42%

南方上证 380ETF 联接 C	1,655	4,345.84	534.67	0.01%	7,191,822.49	99.99%
合计	10,955	4,791.30	2,074,424.43	3.95%	50,414,237.45	96.05%

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	南方上证 380ETF 联接 A	5,332.48	0.0118%
	南方上证 380ETF 联接 C	6.74	0.0001%
	合计	5,339.22	0.0102%

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	南方上证 380ETF 联接 A	0
	南方上证 380ETF 联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	南方上证 380ETF 联接 A	0~10
	南方上证 380ETF 联接 C	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方上证 380ETF 联接 A	南方上证 380ETF 联接 C
基金合同生效日(2011 年 9 月 20 日)基金份额总额	324,134,578.45	-
本报告期期初基金份额总额	54,348,133.29	6,953,656.80
本报告期基金总申购份额	8,929,145.28	7,216,731.80

减：本报告期基金总赎回份额	17,980,973.85	6,978,031.44
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	45,296,304.72	7,192,357.16

§ 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无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内无涉及基金财产的诉讼事项。

本报告期无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及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	
国泰海通	2	21,640,728.99	68.43%	2,162.05	68.43%	-
国信证券	1	9,985,439.48	31.57%	997.51	31.57%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	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	1,101,189.00	100.00%	3,050,000.00	100.00%	-	-	23,327,033.34	74.97%
国信证券	-	-	-	-	-	-	7,787,117.70	25.03%
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

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	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
4	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

§ 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上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件；
- 2、《南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 3、《南方上证 380 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、《南方上证 380 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>