上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国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.....4
2.4 信息披露方式.....5
2.5 其他相关资料.....5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....5
3.1 主要会计数据和财务指标.....5
3.2 基金净值表现.....6
§4 管理人报告.....7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....11
§5 托管人报告.....11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....12
6.1 资产负债表.....12
6.2 利润表.....13
6.3 净资产变动表.....14
6.4 报表附注.....16
§7 投资组合报告.....37
7.1 期末基金资产组合情况.....37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....38
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.....39
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.....51
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.....51
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 本基金投资股指期货的投资政策.....51

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....51
7.12 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.....53
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.....53
10.1 基金份额持有人大会决议.....53
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.....53
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.....54
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.....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.....57

§2 基金简介

2.1 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
基金简称	南方上证 380ETF
场内简称	上证 380ETF 南方
基金主代码	510290
交易代码	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	54,448,915.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 11 月 8 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。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	中国建设银行股份有限公司

		公司	
信息披露负责人	姓名	鲍文革	王小飞
	联系电话	0755-82763888	021-60637103
	电子邮箱	manager@southernfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.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	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	21,535,197.99
本期利润	27,112,575.20
加权平均基金份额本期利润	0.4442
本期加权平均净值利润率	16.56%
本期基金份额净值增长率	17.83%
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	85,406,988.02
期末可供分配基金份额利润	1.5685

期末基金资产净值	157,672,105.07
期末基金份额净值	2.8958
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	189.58%

注：基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

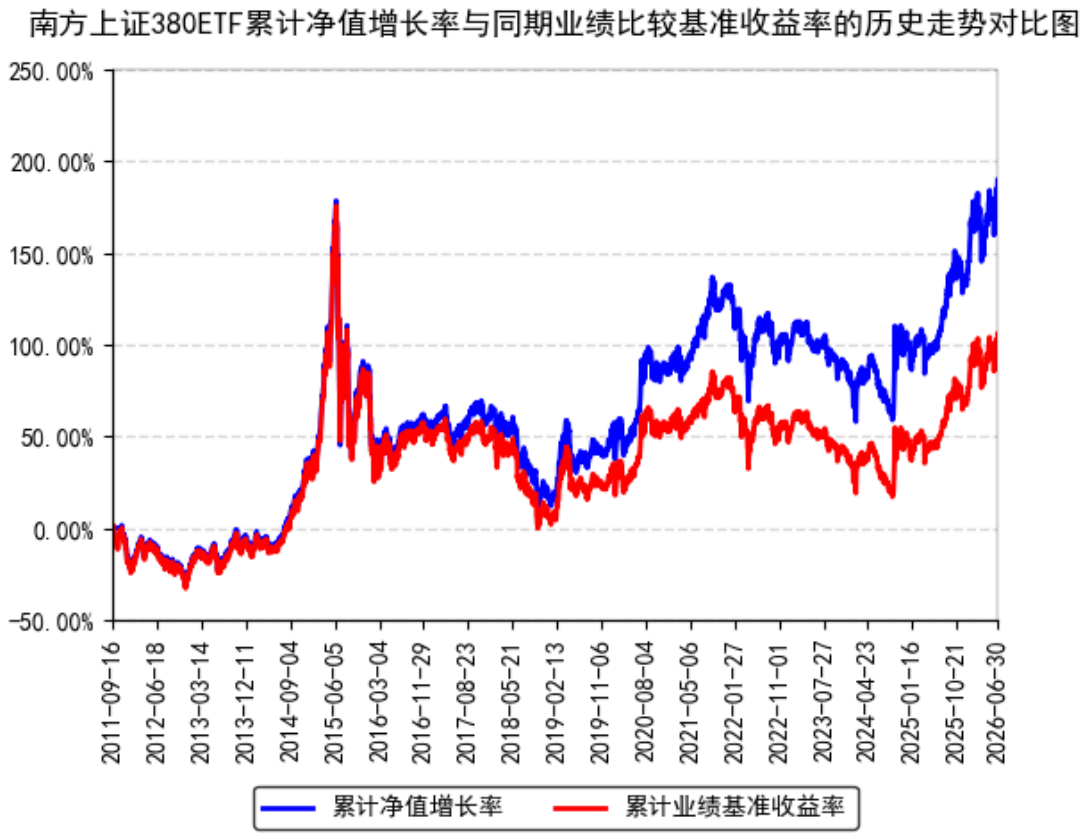
对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	15.62%	1.42%	14.19%	1.44%	1.43%	-0.02%
过去六个月	17.83%	1.47%	16.19%	1.47%	1.64%	0.00%
过去一年	41.53%	1.25%	38.39%	1.25%	3.14%	0.00%
过去三年	44.52%	1.28%	35.80%	1.28%	8.72%	0.00%
过去五年	38.47%	1.21%	23.04%	1.21%	15.43%	0.00%
过去七年	109.23%	1.21%	65.53%	1.21%	43.70%	0.00%
过去十年	97.30%	1.22%	44.13%	1.23%	53.17%	-0.01%
自基金合同生效起至今	189.58%	1.50%	105.73%	1.50%	83.85%	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



§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。

4.2 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

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

（1）新股上市初期涨幅较大的影响；

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

（3）报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离；

（4）根据指数成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 2.8958 元，报告期内，份额净值增长率为 17.83%，同期业绩基准增长率为 16.19%。

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：上证 380 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	409,739.56	385,192.67
结算备付金		708.63	6,593.90
存出保证金		1,881.30	622.13
交易性金融资产	6.4.7.2	157,589,311.34	163,162,440.86
其中：股票投资		157,466,307.27	163,133,440.42
基金投资		-	-
债券投资		123,004.07	29,000.44
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		158,001,640.83	163,554,849.56
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		169,702.38	0.45
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		62,668.25	67,429.09
应付托管费		12,533.66	13,485.85
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.03	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	84,631.44	164,937.57
负债合计		329,535.76	245,852.96
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	54,448,915.00	66,448,915.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	103,223,190.07	96,860,081.60
净资产合计		157,672,105.07	163,308,996.60
负债和净资产总计		158,001,640.83	163,554,849.56

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.8958 元，基金份额总额 54,448,915.00 份。

6.2 利润表

会计主体：上证 380 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		27,679,665.31	7,381,705.57
1.利息收入		1,241.54	752.05
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,241.54	752.05
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）		22,085,301.23	3,370,192.84

其中：股票投资收益	6.4.7.10	20,905,964.93	1,220,043.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	48,831.43	26,405.82
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	1,130,504.87	2,123,743.21
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	5,577,377.21	4,010,760.68
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	15,745.33	-
减：二、营业总支出		567,090.11	597,610.43
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	406,289.11	422,031.30
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	81,257.81	84,406.28
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		-	0.03
8.其他费用	6.4.7.18	79,543.19	91,172.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		27,112,575.20	6,784,095.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		27,112,575.20	6,784,095.14
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		27,112,575.20	6,784,095.14

6.3 净资产变动表

会计主体：上证 380 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	66,448,915.00	-	96,860,081.60	163,308,996.60
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	66,448,915.00	-	96,860,081.60	163,308,996.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-12,000,000.00	-	6,363,108.47	-5,636,891.53
（一）、综合收益总额	-	-	27,112,575.20	27,112,575.20
（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）	-12,000,000.00	-	-20,749,466.73	-32,749,466.73
其中：1.基金申购款	6,000,000.00	-	9,998,637.29	15,998,637.29
2.基金赎回款	-18,000,000.00	-	-30,748,104.02	-48,748,104.02
（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	54,448,915.00	-	103,223,190.07	157,672,105.07
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	94,448,915.00	-	91,389,441.03	185,838,356.03

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	94,448,915.00	-	91,389,441.03	185,838,356.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-14,000,000.00	-	-7,234,303.27	-21,234,303.27
（一）、综合收益总额	-	-	6,784,095.14	6,784,095.14
（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）	-14,000,000.00	-	-14,018,398.41	-28,018,398.41
其中：1.基金申购款	2,000,000.00	-	2,041,896.58	4,041,896.58
2.基金赎回款	-16,000,000.00	-	-16,060,294.99	-32,060,294.99
（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	80,448,915.00	-	84,155,137.76	164,604,052.76

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

上证 380 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]1096 号《关于核准上证 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《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 330,429,892.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 381 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 330,448,915.00 份基金份额，其中通过直销机构网下现金认购部分的认购资金利息折合 19,023.00 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数上证 380 指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。本基金主要投资于标的指数的成份股和备选成份股；本基金也可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票以及存托凭证)、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。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，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。本基金的业绩比较基准为上证 380 指数。

本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司以本基金为目标 ETF，于 2011 年 9 月 20 日募集成立了上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“南方上证 380ETF 联接基金”)。南方上证 380ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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	409,739.56
等于：本金	409,698.06
加：应计利息	41.50
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	409,739.56

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		132,076,239.10	-	157,466,307.27	25,390,068.17
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	123,000.00	4.07	123,004.07	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	123,000.00	4.07	123,004.07	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		132,199,239.10	4.07	157,589,311.34	25,390,068.17

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,288.28
其中：交易所市场	5,288.28
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	84,631.44

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	66,448,915.00	66,448,915.00
本期申购	6,000,000.00	6,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-18,000,000.00	-18,000,000.00
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	54,448,915.00	54,448,915.00

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

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	79,663,774.30	17,196,307.30	96,860,081.60
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	79,663,774.30	17,196,307.30	96,860,081.60
本期利润	21,535,197.99	5,577,377.21	27,112,575.20
本期基金份额交易产生的变动数	-15,791,984.27	-4,957,482.46	-20,749,466.73
其中：基金申购款	7,416,786.05	2,581,851.24	9,998,637.29
基金赎回款	-23,208,770.32	-7,539,333.70	-30,748,104.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	85,406,988.02	17,816,202.05	103,223,190.07

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,175.99
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	62.90
其他	2.65
合计	1,241.54

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	12,140,711.39
股票投资收益——赎回差价收入	8,765,253.54
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	20,905,964.93

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	29,245,055.07
减：卖出股票成本总额	17,079,587.80
减：交易费用	24,755.88
买卖股票差价收入	12,140,711.39

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	48,748,104.02
减：现金支付赎回款总额	36,677.02
减：赎回股票成本总额	39,946,173.46
减：交易费用	-
赎回差价收入	8,765,253.54

6.4.7.10.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	6.74
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	48,824.69
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	48,831.43

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	97,831.73
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	49,000.00
减：应计利息总额	3.14
减：交易费用	3.90
买卖债券差价收入	48,824.69

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,130,504.87
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	1,130,504.87

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	5,577,377.21
——股票投资	5,577,377.21
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	5,577,377.21

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	15,745.33

合计	15,745.33

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

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	125.00
其他	75.03
合计	79,543.19

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人
南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（南方上证 380ETF 联接）	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
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

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	61,781,302.06	100.00%	60,312,510.47	98.18%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	97,831.73	100.00%	103,791.61	87.65%

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	6,173.92	100.00%	5,288.32	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	6,037.06	98.18%	5,826.19	100.00%

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	406,289.11	422,031.30
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,759.67	4,975.03
应支付基金管理人的净管理费	399,529.44	417,056.27

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	81,257.81	84,406.28

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

日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券股份有限公司	431,000.00	0.79%	431,400.00	0.65%
中国建设银行股份有限公司－南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	44,906,641.00	82.47%	53,473,641.00	80.47%

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
中国建设银行	409,739.56	1,175.99	500,613.72	673.46

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	113704	春风转债	配债	370	37,000.00

上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额

华泰联合	688757	胜科纳米	网下申购	5,357	48,641.56

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

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

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定期	81.88	1,584.33	40	3,275.20	63,373.20	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定期	9.47	70.14	491	4,649.77	34,438.74	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期	44.56	468.67	58	2,584.48	27,182.86	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期	26.28	172.09	128	3,363.84	22,027.52	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁定期	40.98	308.19	71	2,909.58	21,881.49	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定期	92.18	463.15	41	3,779.38	18,989.15	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定期	6.41	24.13	505	3,237.05	12,185.65	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁定期	55.95	57.10	66	3,692.70	3,768.60	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	470	47,000.00	47,000.62	-
113704	春风转债	2026 年 6 月 11 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	370	37,000.00	37,001.70	-
118070	南芯转债	2026 年 6 月 22 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	270	27,000.00	27,001.54	-
118071	华峰转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	120	12,000.00	12,000.21	-

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

本基金是被动式指数基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。紧密跟踪上证 380 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪上证 380 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理

人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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	409,739.56	-	-	-	409,739.56
结算备付金	708.63	-	-	-	708.63
存出保证金	1,881.30	-	-	-	1,881.30
交易性金融资产	-	-	123,004.07	157,466,307.27	157,589,311.34
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	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	412,329.49	-	123,004.07	157,466,307.27	158,001,640.83
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	-	-	-	169,702.38	169,702.38
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	62,668.25	62,668.25
应付托管费	-	-	-	12,533.66	12,533.66
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.03	0.03
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	84,631.44	84,631.44
负债总计	-	-	-	329,535.76	329,535.76
利率敏感度缺口	412,329.49	-	123,004.07	157,136,771.51	157,672,105.07
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	385,192.67	-	-	-	385,192.67
结算备付金	6,593.90	-	-	-	6,593.90
存出保证金	622.13	-	-	-	622.13
交易性金融资产	-	-	29,000.44	163,133,440.42	163,162,440.86
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	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	392,408.70	-	29,000.44	163,133,440.42	163,554,849.56

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	-	-	-	0.45	0.45
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	67,429.09	67,429.09
应付托管费	-	-	-	13,485.85	13,485.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	164,937.57	164,937.57
负债总计	-	-	-	245,852.96	245,852.96
利率敏感度缺口	392,408.70	-	29,000.44	162,887,587.46	163,308,996.60

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金采用完全复制法，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	157,466,307.27	99.87	163,133,440.42	99.89
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	123,004.07	0.08	29,000.44	0.02
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	157,589,311.34	99.95	163,162,440.86	99.91

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%	7,823,918.31	8,125,603.67
	2.组合自身基准下降 5%	-7,823,918.31	-8,125,603.67

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	157,262,460.06
第二层次	123,004.07
第三层次	203,847.21
合计	157,589,311.34

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	157,466,307.27	99.66

	其中：股票	157,466,307.27	99.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	123,004.07	0.08
	其中：债券	123,004.07	0.08
	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	410,448.19	0.26
8	其他各项资产	1,881.30	0.00
9	合计	158,001,640.83	100.00

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

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	181,028.00	0.11
B	采矿业	6,716,536.90	4.26
C	制造业	109,394,784.85	69.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,706,659.05	3.62
E	建筑业	2,814,555.50	1.79
F	批发和零售业	1,981,420.71	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	3,016,726.27	1.91
H	住宿和餐饮业	172,186.56	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,122,432.62	5.79
J	金融业	11,281,855.28	7.16
K	房地产业	2,417,199.60	1.53
L	租赁和商务服务业	724,652.96	0.46
M	科学研究和技术服务业	1,211,131.78	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	1,614,167.18	1.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	250,712.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	656,410.80	0.42
S	综合	-	-
	合计	157,262,460.06	99.74

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	203,847.21	0.13
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	203,847.21	0.13

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688498	源杰科技	2,434	4,590,524.00	2.91
2	688347	华虹宏力	9,563	3,216,036.90	2.04
3	688120	华海清科	9,370	3,018,826.60	1.91
4	688361	中科飞测	5,789	2,489,270.00	1.58
5	688777	中控技术	14,903	1,751,102.50	1.11
6	688200	华峰测控	3,231	1,696,598.10	1.08
7	603083	剑桥科技	6,500	1,656,655.00	1.05

8	688037	芯源微	3,741	1,642,486.05	1.04
9	601869	长飞光纤	2,900	1,583,110.00	1.00
10	600460	士兰微	27,500	1,503,150.00	0.95
11	688019	安集科技	4,247	1,441,686.62	0.91
12	600498	烽火通信	19,200	1,413,120.00	0.90
13	688002	睿创微纳	8,889	1,375,039.41	0.87
14	688313	仕佳光子	7,431	1,372,134.15	0.87
15	600879	航天电子	62,200	1,324,238.00	0.84
16	688469	芯联集成	118,570	1,258,027.70	0.80
17	688017	绿的谐波	2,936	1,226,836.96	0.78
18	688630	芯碁微装	2,221	1,220,195.19	0.77
19	603256	宏和科技	4,300	1,140,919.00	0.72
20	688172	燕东微	13,453	1,125,477.98	0.71
21	688702	盛科通信	2,805	1,093,921.95	0.69
22	600988	赤峰黄金	39,100	1,029,112.00	0.65
23	688099	晶晨股份	9,912	1,019,944.80	0.65
24	605589	圣泉集团	16,000	1,017,120.00	0.65
25	600885	宏发股份	29,176	1,006,280.24	0.64
26	600667	太极实业	34,395	1,003,646.10	0.64
27	600392	盛和资源	32,960	981,219.20	0.62
28	600601	方正科技	70,500	975,720.00	0.62
29	600141	兴发集团	19,800	930,006.00	0.59
30	600378	昊华科技	12,200	919,636.00	0.58
31	601179	中国西电	60,400	901,168.00	0.57
32	688234	天岳先进	5,034	873,449.34	0.55
33	600497	驰宏锌锗	71,100	861,021.00	0.55
34	603005	晶方科技	15,380	828,520.60	0.53
35	600157	永泰能源	512,600	825,286.00	0.52
36	688629	华丰科技	4,305	807,230.55	0.51
37	600711	盛屯矿业	72,900	799,713.00	0.51
38	600909	华安证券	71,100	789,921.00	0.50
39	605111	新洁能	7,872	780,430.08	0.49
40	688411	海博思创	2,675	778,960.00	0.49
41	600143	金发科技	50,400	778,680.00	0.49
42	601126	四方股份	11,800	745,760.00	0.47
43	600352	浙江龙盛	61,400	743,554.00	0.47
44	601555	东吴证券	93,400	739,728.00	0.47
45	601233	桐昆股份	33,600	727,440.00	0.46
46	603659	璞泰来	25,100	726,143.00	0.46
47	688220	翱捷科技	5,818	723,293.76	0.46
48	688213	思特威	6,689	716,191.23	0.45
49	688235	百济神州	2,811	715,708.71	0.45
50	601058	赛轮轮胎	61,800	712,554.00	0.45

51	688578	艾力斯	6,365	695,058.00	0.44
52	688027	国盾量子	1,375	693,013.75	0.44
53	603588	高能环境	35,828	687,897.60	0.44
54	688388	嘉元科技	15,621	687,324.00	0.44
55	688122	西部超导	10,678	670,685.18	0.43
56	601108	财通证券	76,400	660,860.00	0.42
57	601456	国联民生	73,900	653,276.00	0.41
58	601958	金钼股份	22,800	640,908.00	0.41
59	603129	春风动力	2,500	639,500.00	0.41
60	688387	信科移动	32,213	639,105.92	0.41
61	688385	复旦微电	8,929	636,548.41	0.40
62	601117	中国化学	86,100	632,835.00	0.40
63	600641	先导基电	15,640	623,410.40	0.40
64	601991	大唐发电	87,400	618,792.00	0.39
65	601198	东兴证券	45,500	618,345.00	0.39
66	688123	聚辰股份	2,906	617,815.60	0.39
67	600563	法拉电子	3,227	615,711.60	0.39
68	688322	奥比中光	4,701	613,715.55	0.39
69	601878	浙商证券	64,500	612,750.00	0.39
70	600839	四川长虹	86,800	605,864.00	0.38
71	688301	奕瑞科技	4,862	602,888.00	0.38
72	603179	新泉股份	11,800	585,870.00	0.37
73	603156	养元饮品	11,900	583,933.00	0.37
74	601665	齐鲁银行	101,200	583,924.00	0.37
75	603063	禾望电气	10,800	571,212.00	0.36
76	603650	彤程新材	5,800	568,284.00	0.36
77	603678	火炬电子	6,700	556,100.00	0.35
78	688676	金盘科技	6,534	553,037.76	0.35
79	603379	三美股份	7,200	546,408.00	0.35
80	688331	荣昌生物	4,148	540,318.48	0.34
81	601099	太平洋	160,200	539,874.00	0.34
82	600109	国金证券	61,000	535,580.00	0.34
83	603688	石英股份	6,400	528,704.00	0.34
84	689009	九号公司	13,751	524,600.65	0.33
85	601021	春秋航空	11,500	524,170.00	0.33
86	688333	铂力特	5,111	523,366.40	0.33
87	603979	金诚信	8,800	519,464.00	0.33
88	600256	广汇能源	105,100	519,194.00	0.33
89	600298	安琪酵母	14,300	517,660.00	0.33
90	688728	格科微	24,517	515,837.68	0.33
91	600060	海信视像	18,400	512,808.00	0.33
92	600021	上海电力	33,200	500,324.00	0.32
93	601128	常熟银行	85,694	498,739.08	0.32

94	601696	中银证券	39,300	497,145.00	0.32
95	600699	均胜电子	23,000	497,030.00	0.32
96	601636	旗滨集团	48,500	496,155.00	0.31
97	600577	精达股份	50,500	493,890.00	0.31
98	601577	长沙银行	56,700	493,857.00	0.31
99	601615	明阳智能	42,500	491,725.00	0.31
100	603920	世运电路	10,150	487,606.00	0.31
101	601677	明泰铝业	29,200	484,720.00	0.31
102	603606	东方电缆	11,660	484,006.60	0.31
103	688608	恒玄科技	2,877	481,005.63	0.31
104	603087	甘李药业	8,400	476,784.00	0.30
105	603283	赛腾股份	5,830	472,113.40	0.30
106	688127	蓝特光学	4,836	471,993.60	0.30
107	688169	石头科技	4,961	471,146.17	0.30
108	688599	天合光能	32,989	465,804.68	0.30
109	603119	浙江荣泰	6,700	444,478.00	0.28
110	600600	青岛啤酒	8,400	438,732.00	0.28
111	688375	国博电子	4,156	433,470.80	0.27
112	603290	斯达半导	2,800	428,232.00	0.27
113	688390	固德威	3,945	428,071.95	0.27
114	688180	君实生物	12,608	426,402.56	0.27
115	600171	上海贝岭	13,320	425,440.80	0.27
116	688187	时代电气	6,097	418,620.02	0.27
117	603369	今世缘	17,600	417,296.00	0.26
118	600027	华电国际	93,000	413,850.00	0.26
119	603806	福斯特	24,500	411,355.00	0.26
120	688065	凯赛生物	8,572	410,170.20	0.26
121	688188	柏楚电子	3,834	409,087.80	0.26
122	600177	雅戈尔	54,300	408,879.00	0.26
123	603160	汇顶科技	6,600	407,286.00	0.26
124	601607	上海医药	26,200	403,480.00	0.26
125	600642	申能股份	46,000	401,580.00	0.25
126	601699	潞安环能	28,100	401,268.00	0.25
127	603127	昭衍新药	10,426	398,481.72	0.25
128	600918	中泰证券	74,500	396,340.00	0.25
129	688484	南芯科技	7,009	395,938.41	0.25
130	688568	中科星图	9,514	394,545.58	0.25
131	600637	东方明珠	47,400	393,894.00	0.25
132	600061	国投资本	60,100	393,655.00	0.25
133	603225	新凤鸣	19,772	388,519.80	0.25
134	688800	瑞可达	4,021	385,895.37	0.24
135	603345	安井食品	4,800	384,912.00	0.24
136	600369	西南证券	93,600	376,272.00	0.24

137	600499	科达制造	27,000	372,600.00	0.24
138	688700	东威科技	4,162	372,082.80	0.24
139	600085	同仁堂	16,100	372,071.00	0.24
140	605090	九丰能源	10,000	371,700.00	0.24
141	688472	阿特斯	34,227	370,336.14	0.23
142	688617	惠泰医疗	2,033	369,111.48	0.23
143	600536	中国软件	13,102	368,428.24	0.23
144	600515	海南机场	134,300	367,982.00	0.23
145	603596	伯特利	14,791	367,408.44	0.23
146	603699	纽威股份	7,300	367,190.00	0.23
147	688005	容百科技	11,788	360,712.80	0.23
148	603444	吉比特	1,000	358,420.00	0.23
149	601016	节能风电	92,300	358,124.00	0.23
150	600985	淮北矿业	25,300	355,465.00	0.23
151	600862	中航高科	19,700	355,191.00	0.23
152	600521	华海药业	24,600	354,240.00	0.22
153	601216	君正集团	79,300	353,678.00	0.22
154	601717	中创智领	25,400	353,314.00	0.22
155	601997	贵阳银行	68,800	352,944.00	0.22
156	688692	达梦数据	1,428	348,846.12	0.22
157	600888	新疆众和	21,900	347,991.00	0.22
158	600863	华能蒙电	73,600	345,920.00	0.22
159	603766	隆鑫通用	28,900	344,777.00	0.22
160	600704	物产中大	72,900	344,088.00	0.22
161	601001	晋控煤业	19,700	342,583.00	0.22
162	603236	移远通信	6,675	341,559.75	0.22
163	601990	南京证券	51,700	339,669.00	0.22
164	600873	梅花生物	46,100	338,835.00	0.21
165	688538	和辉光电	129,763	337,383.80	0.21
166	603077	和邦生物	145,200	336,864.00	0.21
167	600845	宝信软件	20,200	335,926.00	0.21
168	600459	贵研铂业	11,629	335,845.52	0.21
169	603605	珀莱雅	5,600	335,552.00	0.21
170	600765	中航重机	25,600	330,752.00	0.21
171	600332	白云山	16,500	330,660.00	0.21
172	688116	天奈科技	8,656	330,659.20	0.21
173	688297	中无人机	7,946	330,156.30	0.21
174	600153	建发股份	40,900	324,337.00	0.21
175	600348	华阳股份	42,300	323,595.00	0.21
176	688131	皓元医药	3,417	323,248.20	0.21
177	601611	中国核建	28,400	316,660.00	0.20
178	600323	瀚蓝环境	11,477	315,158.42	0.20
179	600901	江苏金租	54,400	312,800.00	0.20

180	688106	金宏气体	7,525	312,137.00	0.20
181	600737	中粮糖业	25,200	310,716.00	0.20
182	601799	星宇股份	3,400	308,108.00	0.20
183	600578	京能电力	47,200	304,440.00	0.19
184	600363	联创光电	8,500	304,130.00	0.19
185	688114	华大智造	5,916	302,189.28	0.19
186	603728	鸣志电器	4,920	299,726.40	0.19
187	603267	鸿远电子	3,840	297,523.20	0.19
188	603568	伟明环保	19,282	296,557.16	0.19
189	600398	海澜之家	56,400	294,972.00	0.19
190	603298	杭叉集团	12,280	293,000.80	0.19
191	688009	中国通号	60,804	289,427.04	0.18
192	601000	唐山港	69,532	288,557.80	0.18
193	601137	博威合金	12,900	288,057.00	0.18
194	600486	扬农化工	5,677	287,823.90	0.18
195	600529	山东药玻	15,580	287,451.00	0.18
196	603341	龙旗科技	6,700	284,683.00	0.18
197	600208	衢州发展	99,900	282,717.00	0.18
198	600316	洪都航空	10,100	282,194.00	0.18
199	600008	首创环保	103,540	281,628.80	0.18
200	688208	道通科技	11,091	279,382.29	0.18
201	603486	科沃斯	5,500	279,125.00	0.18
202	600435	北方导航	24,900	278,880.00	0.18
203	600170	上海建工	125,300	278,166.00	0.18
204	600995	南网储能	22,600	277,980.00	0.18
205	600998	九州通	59,230	277,788.70	0.18
206	688248	南网科技	3,927	271,669.86	0.17
207	600820	隧道股份	51,700	269,357.00	0.17
208	600161	天坛生物	23,200	268,656.00	0.17
209	600282	南钢股份	58,000	266,220.00	0.17
210	600483	福能股份	26,110	266,060.90	0.17
211	603885	吉祥航空	25,700	264,453.00	0.17
212	688303	大全能源	15,125	263,628.75	0.17
213	600583	海油工程	52,000	261,560.00	0.17
214	688778	厦钨新能	4,806	261,446.40	0.17
215	603816	顾家家居	11,566	258,615.76	0.16
216	688516	奥特维	4,501	258,312.39	0.16
217	603939	益丰药房	14,300	257,114.00	0.16
218	688690	纳微科技	5,768	254,368.80	0.16
219	603690	至纯科技	7,180	254,172.00	0.16
220	603338	浙江鼎力	5,978	254,065.00	0.16
221	600546	山煤国际	23,200	253,576.00	0.16
222	688295	中复神鹰	4,185	253,359.90	0.16

223	603281	江瀚新材	6,200	251,906.00	0.16
224	600428	中远海特	32,200	251,482.00	0.16
225	600763	通策医疗	7,400	250,712.00	0.16
226	688166	博瑞医药	7,131	249,656.31	0.16
227	600329	达仁堂	6,695	249,187.90	0.16
228	601666	平煤股份	34,811	248,898.65	0.16
229	600562	国睿科技	11,700	248,274.00	0.16
230	601567	三星电气	16,483	246,256.02	0.16
231	600380	健康元	25,886	243,846.12	0.15
232	600038	中直股份	9,600	242,784.00	0.15
233	603565	中谷物流	24,723	242,532.63	0.15
234	600390	五矿资本	52,900	241,224.00	0.15
235	600761	安徽合力	14,700	240,492.00	0.15
236	601156	东航物流	14,900	240,188.00	0.15
237	601880	辽港股份	173,000	238,740.00	0.15
238	601399	国机重装	67,800	237,300.00	0.15
239	601865	福莱特	22,400	235,424.00	0.15
240	600132	重庆啤酒	5,700	235,410.00	0.15
241	688318	财富趋势	3,294	234,895.14	0.15
242	601236	红塔证券	33,300	227,106.00	0.14
243	600816	建元信托	92,500	225,700.00	0.14
244	688281	华秦科技	4,448	223,423.04	0.14
245	688336	三生国健	4,179	221,904.90	0.14
246	688779	五矿新能	27,289	221,313.79	0.14
247	600970	中材国际	30,880	220,174.40	0.14
248	603613	国联股份	11,876	218,755.92	0.14
249	601155	新城控股	21,200	217,512.00	0.14
250	600967	内蒙一机	20,000	217,000.00	0.14
251	601187	厦门银行	31,000	211,730.00	0.13
252	688006	杭可科技	5,744	209,943.20	0.13
253	600120	浙江东方	48,124	206,933.20	0.13
254	600285	羚锐制药	10,677	206,920.26	0.13
255	600131	国网信通	14,100	205,860.00	0.13
256	688278	特宝生物	3,778	205,523.20	0.13
257	603619	中曼石油	10,900	203,939.00	0.13
258	601528	瑞丰银行	46,100	203,762.00	0.13
259	600064	南京高科	28,500	203,205.00	0.13
260	600095	湘财股份	26,900	202,557.00	0.13
261	600452	涪陵电力	21,627	201,779.91	0.13
262	603737	三棵树	8,323	200,584.30	0.13
263	603505	金石资源	9,895	199,384.25	0.13
264	603305	旭升集团	16,328	197,895.36	0.13
265	688029	南微医学	2,754	197,737.20	0.13

266	600750	华润江中	8,946	197,438.22	0.13
267	600801	华新建材	12,600	196,560.00	0.12
268	600871	石化油服	95,500	193,865.00	0.12
269	600559	老白干酒	17,259	193,300.80	0.12
270	600566	济川药业	8,700	193,053.00	0.12
271	600755	厦门国贸	35,188	190,718.96	0.12
272	600517	国网英大	40,300	188,604.00	0.12
273	600655	豫园股份	45,700	187,827.00	0.12
274	600633	浙数文化	17,800	181,204.00	0.11
275	600598	北大荒	16,700	181,028.00	0.11
276	601598	中国外运	36,400	180,544.00	0.11
277	600216	浙江医药	15,835	180,519.00	0.11
278	600933	爱柯迪	12,100	178,838.00	0.11
279	601222	林洋能源	33,600	178,752.00	0.11
280	601136	首创证券	12,800	178,560.00	0.11
281	603899	晨光股份	8,642	178,284.46	0.11
282	600446	金证股份	17,658	177,639.48	0.11
283	600409	三友化工	29,061	177,562.71	0.11
284	600350	山东高速	15,900	176,967.00	0.11
285	600210	紫江企业	28,500	176,700.00	0.11
286	601966	玲珑轮胎	17,200	175,268.00	0.11
287	600663	陆家嘴	27,740	174,207.20	0.11
288	688192	迪哲医药	4,346	173,535.78	0.11
289	603927	中科软	13,648	173,466.08	0.11
290	600582	天地科技	38,960	173,372.00	0.11
291	600773	西藏城投	13,400	172,458.00	0.11
292	600258	首旅酒店	15,768	172,186.56	0.11
293	688349	三一重能	11,287	171,336.66	0.11
294	603456	九洲药业	12,500	170,750.00	0.11
295	603612	索通发展	9,400	170,422.00	0.11
296	603198	迎驾贡酒	5,700	168,720.00	0.11
297	600848	上海临港	22,500	168,525.00	0.11
298	601098	中南传媒	16,900	166,296.00	0.11
299	603871	嘉友国际	16,104	164,421.84	0.10
300	688083	中望软件	2,487	161,033.25	0.10
301	603233	大参林	10,703	160,866.09	0.10
302	600968	海油发展	47,700	158,841.00	0.10
303	601928	凤凰传媒	17,900	157,341.00	0.10
304	688016	心脉医疗	1,727	153,081.28	0.10
305	600993	马应龙	7,008	151,512.96	0.10
306	601311	骆驼股份	19,330	150,580.70	0.10
307	601808	中海油服	13,900	150,259.00	0.10
308	600295	鄂尔多斯	13,979	149,854.88	0.10

309	600776	东方通信	11,200	147,168.00	0.09
310	600057	厦门象屿	26,700	144,714.00	0.09
311	600211	西藏药业	3,840	143,577.60	0.09
312	603712	七一二	10,900	140,501.00	0.09
313	600292	电投水电	11,300	136,052.00	0.09
314	600916	中国黄金	19,800	135,432.00	0.09
315	600377	宁沪高速	11,700	135,369.00	0.09
316	600399	抚顺特钢	32,400	133,164.00	0.08
317	601298	青岛港	16,500	132,825.00	0.08
318	601702	华峰铝业	9,400	132,540.00	0.08
319	600507	方大特钢	32,603	132,042.15	0.08
320	603833	欧派家居	4,300	129,473.00	0.08
321	600012	皖通高速	8,200	129,232.00	0.08
322	603393	新天然气	5,984	128,117.44	0.08
323	600116	三峡水利	22,500	126,000.00	0.08
324	600328	中盐化工	20,630	123,780.00	0.08
325	603218	日月股份	12,100	123,662.00	0.08
326	600129	太极集团	9,100	123,487.00	0.08
327	600273	嘉化能源	18,500	120,620.00	0.08
328	603529	爱玛科技	6,170	120,376.70	0.08
329	600032	浙江新能	17,000	119,850.00	0.08
330	600325	华发股份	51,700	119,427.00	0.08
331	603786	科博达	2,900	118,639.00	0.08
332	688139	海尔生物	4,486	118,520.12	0.08
333	688289	圣湘生物	8,197	118,036.80	0.07
334	603883	老百姓	10,742	117,732.32	0.07
335	603658	安图生物	4,000	116,080.00	0.07
336	600395	盘江股份	25,200	114,912.00	0.07
337	601139	深圳燃气	20,300	114,898.00	0.07
338	601965	中国汽研	9,500	113,620.00	0.07
339	688050	爱博医疗	3,108	113,286.60	0.07
340	603730	岱美股份	10,110	112,928.70	0.07
341	688439	振华风光	2,443	112,866.60	0.07
342	600782	新钢股份	44,900	111,352.00	0.07
343	603027	千禾味业	15,594	108,690.18	0.07
344	603888	新华网	6,380	108,651.40	0.07
345	600373	中文传媒	15,800	104,754.00	0.07
346	600720	中交设计	21,600	104,112.00	0.07
347	688100	威胜信息	3,393	103,791.87	0.07
348	603049	中策橡胶	2,300	103,063.00	0.07
349	600866	星湖科技	23,400	102,726.00	0.07
350	688032	禾迈股份	1,213	102,522.76	0.07
351	603583	捷昌驱动	4,472	101,961.60	0.06

352	688475	萤石网络	3,657	100,018.95	0.06
353	603556	海兴电力	4,510	99,220.00	0.06
354	603175	超颖电子	1,100	97,999.00	0.06
355	600612	老凤祥	3,033	97,510.95	0.06
356	603317	天味食品	7,476	97,262.76	0.06
357	600422	昆药集团	12,452	97,250.12	0.06
358	600729	重百集团	5,170	97,092.60	0.06
359	601952	苏垦农发	12,900	96,621.00	0.06
360	600740	山西焦化	30,095	96,003.05	0.06
361	601019	山东出版	14,727	94,252.80	0.06
362	600248	陕建股份	35,100	93,717.00	0.06
363	603099	长白山	2,600	92,742.00	0.06
364	603915	国茂股份	6,280	89,113.20	0.06
365	600675	中华企业	42,600	87,756.00	0.06
366	601033	永兴股份	6,400	85,760.00	0.05
367	601112	振石股份	4,500	82,035.00	0.05
368	603707	健友股份	11,415	80,704.05	0.05
369	601882	海天精工	3,700	74,851.00	0.05
370	688631	莱斯信息	1,592	74,680.72	0.05
371	600299	安迪苏	9,400	73,790.00	0.05
372	603355	莱克电气	2,720	71,753.60	0.05
373	603025	大豪科技	5,240	71,473.60	0.05
374	601595	上海电影	4,200	69,720.00	0.04
375	688819	天能股份	3,115	69,153.00	0.04
376	600662	外服控股	16,100	64,883.00	0.04
377	601858	中国科传	3,700	64,047.00	0.04
378	605333	沪光股份	3,300	56,265.00	0.04
379	600956	新天绿能	7,200	50,328.00	0.03
380	601022	宁波远洋	6,200	47,244.00	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688808	联讯仪器	40	63,373.20	0.04
2	688818	电科蓝天	491	34,438.74	0.02
3	688797	臻宝科技	58	27,182.86	0.02
4	688813	泰金新能	128	22,027.52	0.01
5	688635	长进光子	71	21,881.49	0.01
6	688785	恒运昌	41	18,989.15	0.01
7	688811	有研复材	505	12,185.65	0.01
8	688816	易思维	66	3,768.60	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	688498	源杰科技	3,479,655.12	2.13
2	688347	华虹宏力	2,187,621.72	1.34
3	688313	仕佳光子	1,144,550.30	0.70
4	688235	百济神州	1,028,249.76	0.63
5	600711	盛屯矿业	978,882.00	0.60
6	600601	方正科技	954,727.00	0.58
7	603256	宏和科技	954,254.00	0.58
8	688411	海博思创	758,850.75	0.46
9	601456	国联民生	737,619.00	0.45
10	601117	中国化学	669,911.00	0.41
11	688629	华丰科技	634,942.06	0.39
12	601878	浙商证券	622,967.00	0.38
13	688322	奥比中光	598,602.72	0.37
14	601021	春秋航空	545,486.00	0.33
15	600600	青岛啤酒	532,091.00	0.33
16	688387	信科移动	530,181.37	0.32
17	603119	浙江荣泰	506,786.00	0.31
18	688331	荣昌生物	497,688.15	0.30
19	600027	华电国际	494,205.00	0.30
20	603369	今世缘	460,350.00	0.28

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	4,697,457.07	2.88
2	688525	佰维存储	2,653,800.66	1.63
3	688521	芯原股份	2,053,530.67	1.26
4	600549	厦门钨业	1,797,454.00	1.10
5	601168	西部矿业	1,278,806.68	0.78
6	600673	东阳光	1,178,192.60	0.72
7	600118	中国卫星	1,161,349.00	0.71
8	600096	云天化	938,854.00	0.57
9	600580	卧龙电驱	937,579.52	0.57
10	603228	景旺电子	907,217.80	0.56

11	600219	南山铝业	808,653.00	0.50
12	688183	生益电子	777,004.56	0.48
13	600026	中远海能	719,733.00	0.44
14	600895	张江高科	656,342.00	0.40
15	601231	环旭电子	587,732.06	0.36
16	600079	ST 人福	576,558.00	0.35
17	688635	长进光子	354,806.00	0.22
18	688027	国盾量子	320,186.00	0.20
19	688818	电科蓝天	278,082.00	0.17
20	688596	正帆科技	261,939.59	0.16

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	32,809,607.01
卖出股票收入（成交）总额	29,245,055.07

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	123,004.07	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	123,004.07	0.08

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	111025	圣泉转债	470	47,000.62	0.03
2	113704	春风转债	370	37,001.70	0.02
3	118070	南芯转债	270	27,001.54	0.02
4	118071	华峰转债	120	12,000.21	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,881.30
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,881.30

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688808	联讯仪器	63,373.20	0.04	新股锁定期
2	688818	电科蓝天	34,438.74	0.02	新股锁定期
3	688797	臻宝科技	27,182.86	0.02	新股锁定期
4	688813	泰金新能	22,027.52	0.01	新股锁定期
5	688635	长进光子	21,881.49	0.01	新股锁定期

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
741	73,480.32	4,009,618.00	7.36%	5,532,656.00	10.16%	44,906,641.00	82.47%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011 年 9 月 16 日)基金份额总额	330,448,915.00
本报告期期初基金份额总额	66,448,915.00
本报告期基金总申购份额	6,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	18,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	54,448,915.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，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	
华泰证券	3	61,781,302.06	100.00%	6,173.92	100.00%	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-

中信证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

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

1、选择标准

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

2、选择程序

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

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

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	97,831.73	100.00%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更场内简称的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-08
2	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加世纪证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-13
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分上交所 ETF 调整基金份额参考净值（IOPV）相关事项并修订基金合同的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-09
4	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加中金公司为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-13
5	南方基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
6	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加民生证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-22
7	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-24
8	南方基金管理股份有限公司成都分公司工商注册信息变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-28
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-12
10	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加华源证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-30

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20260101-20260630	53,473,641.00	3,433,000.00	12,000,000.00	44,906,641.00	82.47%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立上证 380 交易型开放式指数证券投资基金的文件；

2、《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；

6、《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：http://www.nffund.com