# 南方中证1000交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金2026年第3季度报告

2026年09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：招商银行股份有限公司

送出日期：2026年10月27日

# §1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

# §2 基金产品概况

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 南方中证 1000ETF 发起联接 |
| 基金主代码 | 011860 |
| 交易代码 | 011860 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 9 月 27 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,062,505,728.39 份 |
| 投资目标 | 本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。 |
| 投资策略 | 本基金为完全被动式指数基金，主要投资于目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。主要投资策略包括：资产配置策略、目标 ETF 投资策略、成份股、备选成份股投资策略、金融衍生品投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略等以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。 |
| 业绩比较基准 | 中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金的目标 ETF 为股票型基金，一般而言，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 及标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。 | | | |
| 基金管理人 | 南方基金管理股份有限公司 | | | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 南方中证 1000ETF 发起联接 A | 南方中证 1000ETF 发起联接 C | 南方中证 1000ETF 发起联接 E | 南方中证 1000ETF 发起联接 I |
| 下属分级基金的交易代码 | 011860 | 011861 | 016643 | 021116 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 440,934,700.39 份 | 605,188,228.83 份 | 8,464,833.35 份 | 7,917,965.82 份 |

## 2.2 目标基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码 | 512100 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 9 月 29 日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2016 年 11 月 4 日 |
| 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 | 招商银行股份有限公司 |

## 2.3 目标基金产品说明

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

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2026 年 7 月 1 日－2026 年 9 月 30 日） | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 南方中证 | 南方中证 | 南方中证 | 南方中证 |

| | 1000ETF 发起联接 A | 1000ETF 发起联接 C | 1000ETF 发起联接 E | 1000ETF 发起联接 I |
|---|---|---|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 6,937,202.78 | 9,333,555.88 | 142,480.13 | 85,673.06 |
| 2.本期利润 | -70,717,134.18 | -62,966,188.67 | -1,139,478.34 | -671,357.89 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1680 | -0.1056 | -0.1277 | -0.1150 |
| 4.期末基金资产净值 | 445,399,233.38 | 608,277,299.44 | 8,448,835.68 | 7,995,714.57 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0101 | 1.0051 | 0.9981 | 1.0098 |

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。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方中证 1000ETF 发起联接 A

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -15.73% | 1.95% | -16.31% | 1.97% | 0.58% | -0.02% |
| 过去六个月 | -2.41% | 1.77% | -3.90% | 1.78% | 1.49% | -0.01% |
| 过去一年 | -1.69% | 1.57% | -3.30% | 1.58% | 1.61% | -0.01% |
| 过去三年 | 22.45% | 1.63% | 19.67% | 1.65% | 2.78% | -0.02% |
| 过去五年 | 0.96% | 1.49% | -0.56% | 1.50% | 1.52% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.01% | 1.48% | -4.12% | 1.51% | 5.13% | -0.03% |

南方中证 1000ETF 发起联接 C

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -15.76% | 1.95% | -16.31% | 1.97% | 0.55% | -0.02% |
| 过去六个月 | -2.46% | 1.77% | -3.90% | 1.78% | 1.44% | -0.01% |
| 过去一年 | -1.79% | 1.57% | -3.30% | 1.58% | 1.51% | -0.01% |
| 过去三年 | 22.08% | 1.63% | 19.67% | 1.65% | 2.41% | -0.02% |
| 过去五年 | 0.46% | 1.49% | -0.56% | 1.50% | 1.02% | -0.01% |
| 自基金合同 | 0.51% | 1.48% | -4.12% | 1.51% | 4.63% | -0.03% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 生效起至今 | | | | | | |

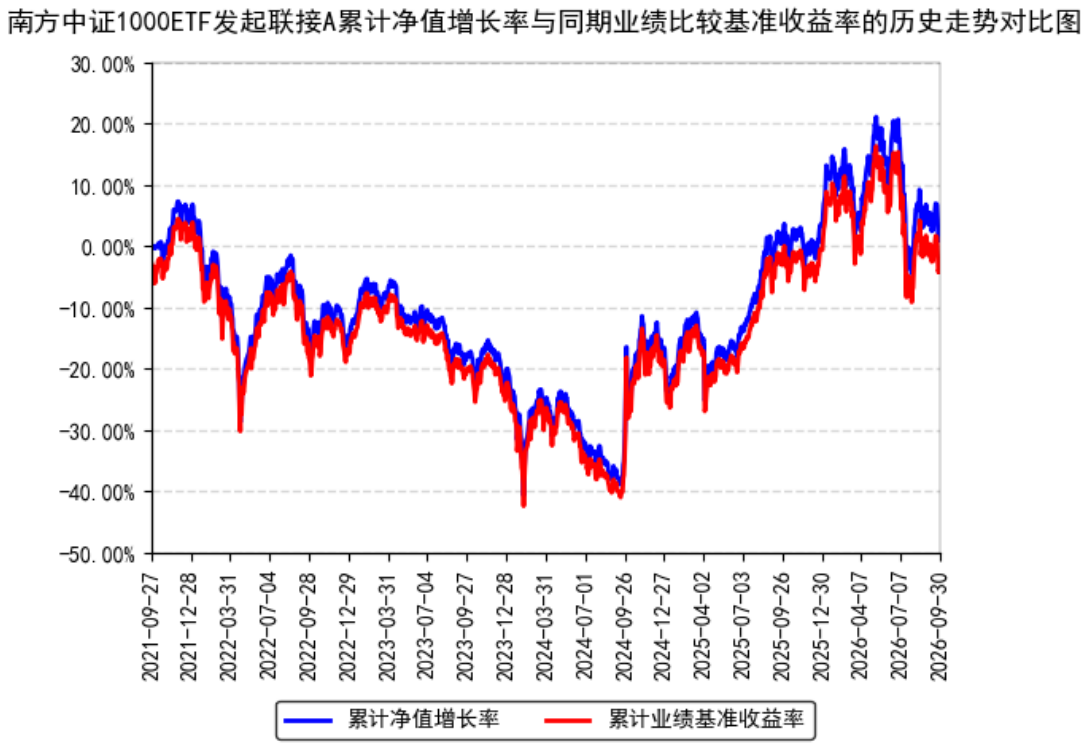
南方中证 1000ETF 发起联接 E

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -15.80% | 1.95% | -16.31% | 1.97% | 0.51% | -0.02% |
| 过去六个月 | -2.56% | 1.77% | -3.90% | 1.78% | 1.34% | -0.01% |
| 过去一年 | -1.98% | 1.57% | -3.30% | 1.58% | 1.32% | -0.01% |
| 过去三年 | 21.36% | 1.63% | 19.67% | 1.65% | 1.69% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.96% | 1.49% | 10.46% | 1.51% | 1.50% | -0.02% |

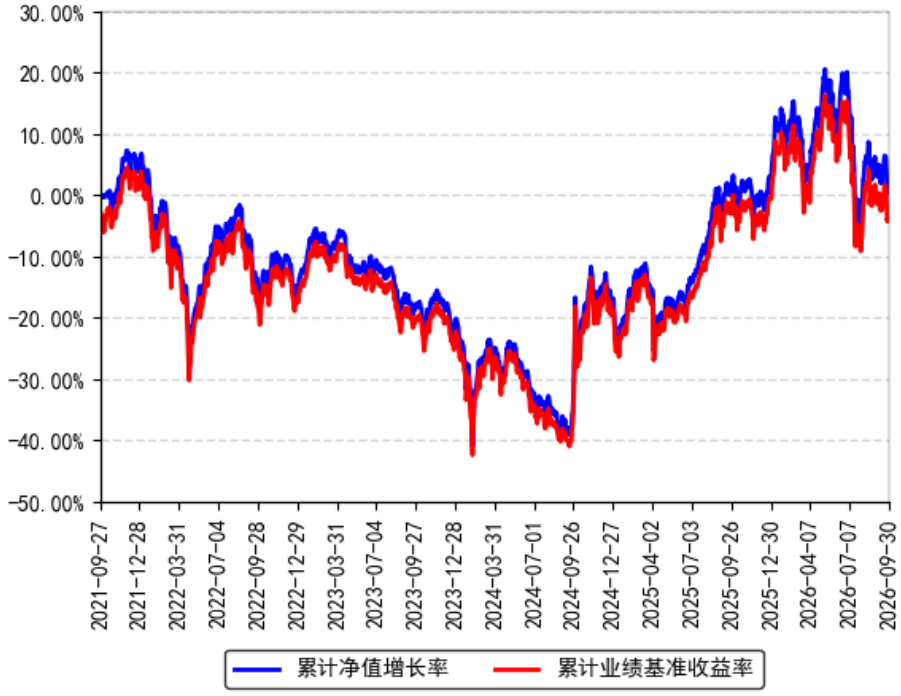
南方中证 1000ETF 发起联接 I

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -15.74% | 1.95% | -16.31% | 1.97% | 0.57% | -0.02% |
| 过去六个月 | -2.42% | 1.77% | -3.90% | 1.78% | 1.48% | -0.01% |
| 过去一年 | -1.69% | 1.57% | -3.30% | 1.58% | 1.61% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 41.59% | 1.61% | 37.49% | 1.64% | 4.10% | -0.03% |

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

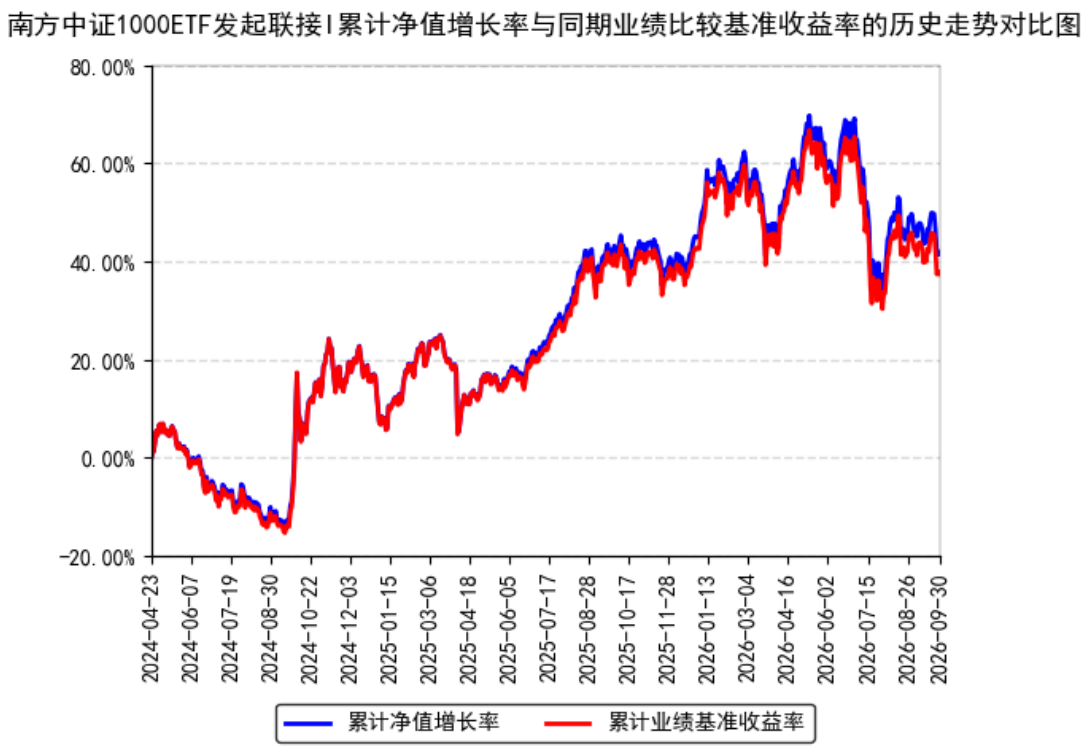


南方中证1000ETF发起联接C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图




南方中证1000ETF发起联接E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 2022 年 9 月 15 日起新增 E 类份额，E 类份额自 2022 年 9 月 16 日起存续；
本基金从 2024 年 4 月 22 日起新增 I 类份额，I 类份额自 2024 年 4 月 23 日起存续。

# §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 崔蕾 | 本基金基金经理 | 2021 年 9 月 27 日 | - | 11 年 | 中国国籍，女，康奈尔大学金融工程硕士，具有基金从业资格。2015 年 2 月加入南方基金，历任数量化投资部助理研究员、研究员，指数投资部研究员；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 4 月 23 日，任南方小康 ETF、南方小康 ETF 联接基金经理；2019 年 6 月 28 日至 2022 年 2 月 18 日，任大数据 300 基金经理；2020 年 3 月 26 日至 2023 年 3 月 27 日，任南方粤港澳大湾区联接基金经理；2019 年 11 月 29 日至 2023 年 7 月 4 日，任南方粤港澳大湾区 ETF 基金经理；2018 年 11 月 8 日至 2023 年 12 月 29 日，任南方中证 500 增强基金经理；2022 年 12 月 1 日 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 至 2023 年 12 月 29 日，任南方上证科创板 50 成份增强策略 ETF 基金经理；2019 年 6 月 12 日至 2025 年 6 月 6 日，任南方顶峰 TOPIX ETF（QDII）基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任南方中证申万有色金属 ETF、南方有色金属 ETF 联接、南方中证 1000ETF 基金经理；2020 年 1 月 17 日至今，任南方标普中国 A 股大盘红利低波 50ETF 基金经理；2020 年 1 月 21 日至今，任南方标普红利低波 50ETF 联接基金经理；2021 年 6 月 24 日至今，任南方中证科创创业 50ETF 基金经理；2021 年 8 月 19 日至今，任南方中证科创创业 50ETF 联接基金经理；2021 年 9 月 27 日至今，任南方中证 1000ETF 发起联接基金经理；2021 年 12 月 29 日至今，任南方国证在线消费 ETF 基金经理；2022 年 1 月 26 日至今，任南方中证 500 增强策略 ETF 基金经理；2022 年 11 月 23 日至今，任南方国证交通运输行业 ETF 基金经理；2023 年 11 月 24 日至今，任南方国证交通运输行业 ETF 发起联接基金经理；2026 年 7 月 29 日至今，任南方国证航天航空行业 ETF 基金经理；2026 年 9 月 23 日至今，任南方中证卫星产业 ETF 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 公平交易专项说明

### 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。

### 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 8 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，中证 1000 指数下跌 17.15%。

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

(2) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离。

2026 年三季度 A 股市场风格剧烈切换，前期强势的科技成长方向集中回调，中小盘成长股回撤明显，中证 1000 指数跌幅大于沪深 300 等大盘指数。7 月市场缩量震荡，指数冲高回落；8 月市场情绪阶段性修复，指数有所反弹；9 月受海外利率上行、风险偏好回落影响，指数再度调整，成交量能逐月下台阶。从基本面角度出发，中证 1000 指数成份股以专精特新为主，覆盖电子、电力设备、医药生物等科技制造领域，前期涨幅积累较大、交易拥挤度较高的方向在本季度承受了更大的估值消化压力；从风格角度看，中证 1000 与价值风格是跷跷板，在市场情绪较好时表现更强，反之则表现较弱，三季度市场整体风险偏好回落，资金向红利等防御方向迁移，对指数表现形成压制。

进入四季度，随着前期估值压力的集中释放，中证 1000 的投资逻辑面临新变化。海外方面，美国就业数据降温、美联储进一步加息预期明显回落，成长股估值压制因素边际缓解；国内方面，三季报业绩验证将成为关键，专精特新成份股的业绩兑现情况将主导指数走势。经过三季度深度调整后，指数估值已回落至相对合理区间，若市场量能逐步修复、科技成长风格重新占优，中证 1000 的弹性值得关注。因此，投资者需密切关注三季报业绩兑现、市场成交量的修复情况及海外货币政策走向，四季度中证 1000 指数的投资机会主要在于估值消化后的交易价值。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金A份额净值为1.0101元，报告期内，份额净值增长率为-15.73%，同期业绩基准增长率为-16.31%；本基金C份额净值为1.0051元，报告期内，份额净值增长率为-15.76%，同期业绩基准增长率为-16.31%；本基金E份额净值为0.9981元，报告期内，份额净值增长率为-15.80%，同期业绩基准增长率为-16.31%；本基金I份额净值为1.0098元，报告期内，份额净值增长率为-15.74%，同期业绩基准增长率为-16.31%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 2,839,232.95 | 0.25 |
| | 其中：股票 | 2,839,232.95 | 0.25 |
| 2 | 基金投资 | 970,169,425.07 | 86.81 |
| 3 | 固定收益投资 | 53,318,955.35 | 4.77 |
| | 其中：债券 | 53,318,955.35 | 4.77 |
| | 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 | 75,127,204.65 | 6.72 |
| 8 | 其他资产 | 16,133,047.08 | 1.44 |
| 9 | 合计 | 1,117,587,865.10 | 100.00 |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告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 | 15,180.00 | 0.00 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| B | 采矿业 | 96,940.00 | 0.01 |
| C | 制造业 | 1,888,871.45 | 0.18 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 92,300.00 | 0.01 |
| E | 建筑业 | 40,144.00 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 77,319.00 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 59,997.00 | 0.01 |
| H | 住宿和餐饮业 | 3,303.00 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 306,048.50 | 0.03 |
| J | 金融业 | 85,610.00 | 0.01 |
| K | 房地产业 | 34,101.00 | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | 39,632.00 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 33,844.00 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 28,286.00 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 10,505.00 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 23,400.00 | 0.00 |
| S | 综合 | 3,752.00 | 0.00 |
| | 合计 | 2,839,232.95 | 0.27 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 688110 | 东芯股份 | 200 | 22,762.00 | 0.00 |
| 2 | 603083 | 剑桥科技 | 100 | 20,545.00 | 0.00 |
| 3 | 000636 | 风华高科 | 400 | 19,844.00 | 0.00 |
| 4 | 688141 | 杰华特 | 200 | 19,000.00 | 0.00 |
| 5 | 300672 | 国科微 | 100 | 18,065.00 | 0.00 |
| 6 | 002428 | 云南锗业 | 200 | 17,374.00 | 0.00 |
| 7 | 600641 | 先导基电 | 300 | 14,571.00 | 0.00 |
| 8 | 601208 | 东材科技 | 300 | 14,466.00 | 0.00 |
| 9 | 600330 | 天通股份 | 500 | 13,450.00 | 0.00 |
| 10 | 300776 | 帝尔激光 | 100 | 12,891.00 | 0.00 |

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 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 | 53,318,955.35 | 4.98 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 53,318,955.35 | 4.98 |

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

| 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 | 280,000 | 28,242,395.62 | 2.64 |
| 2 | 019835 | 26 国债 09 | 160,000 | 16,065,880.55 | 1.50 |
| 3 | 019846 | 26 国债 14 | 90,000 | 9,010,679.18 | 0.84 |

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

## 5.7 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。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

无。

## 5.9 报告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

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 南方中证 1000ETF | 股票型 | 交易型开放式 | 南方基金管理股份有限公司 | 970,169,425.07 | 90.66 |

## 5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| IM2611 | IM2611 | 4 | 5,785,920.00 | -75,040.00 | - |
| IM2610 | IM2610 | 13 | 18,978,440.00 | -169,546.67 | - |
| IM2612 | IM2612 | 26 | 37,313,120.00 | -900,560.00 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | -1,145,146.67 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | -3,306,749.10 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | -1,374,306.67 |

### 5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。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。

## 5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 5.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.12 投资组合报告附注

### 5.12.1 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。

### 5.12.2 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。

### 5.12.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 7,634,891.94 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 8,498,155.14 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 16,133,047.08 |

### 5.12.4 报告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。

### 5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 南方中证 1000ETF 发起联接 A | 南方中证 1000ETF 发起联接 C | 南方中证 1000ETF 发起联接 E | 南方中证 1000ETF 发起联接 I |
|---|---|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 370,161,855.76 | 415,916,952.66 | 7,011,476.45 | 3,203,694.31 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 173,640,333.53 | 641,844,997.15 | 10,218,167.25 | 9,192,105.82 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 102,867,488.90 | 452,573,720.98 | 8,764,810.35 | 4,477,834.31 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列） | - | - | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 440,934,700.39 | 605,188,228.83 | 8,464,833.35 | 7,917,965.82 |

# §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

## 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末，基金管理人未持有本基金份额。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

# §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例（%） | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例（%） | 发起份额承诺持有期限 |
|---|---|---|---|---|---|
| 基金管理人固有资金 | - | - | 10,000,000.00 | 0.94 | 自合同生效之日起不少于3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 0.00 | 0.00 | 10,000,000.00 | 0.94 | - |

# §9 影响投资者决策的其他重要信息

## 9.1 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。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

# §10 备查文件目录

## 10.1 备查文件目录

1、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》；

2、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》；

3、南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 2026 年 3 季度报告原文。

## 10.2 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。

## 10.3 查阅方式

网站：http://www.nffund.com