

南方中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金联接基金 (LOF) 2024 年中期报 告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 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，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	15
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.....	15
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
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.....	59
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.....	59
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.....	60
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.....	60

7.10	本报告期投资基金情况.....	60
7.11	本基金投资股指期货的投资政策.....	60
7.12	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
7.13	投资组合报告附注.....	60
§8	基金份额持有人信息.....	61
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	62
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
8.4	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.....	62
§9	开放式基金份额变动.....	63
§10	重大事件揭示.....	63
10.1	基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4	基金投资策略的改变.....	64
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	64
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8	其他重大事件.....	66
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	66
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.....	66
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	66
§12	备查文件目录.....	67
12.1	备查文件目录.....	67
12.2	存放地点.....	67
12.3	查阅方式.....	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)		
基金简称	南方中证 500ETF 联接 (LOF)		
场内简称	500ETF 联接 LOF		
基金主代码	160119		
前端交易代码	160119		
后端交易代码	160120		
基金运作方式	上市型开放式(LOF)		
基金合同生效日	2009 年 9 月 25 日		
基金管理人	南方基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	5,668,921,336.88 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2009 年 11 月 11 日		
下属分级基金的基金简称	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	南方中证 500ETF 联接 (LOF) I
下属分级基金的场内简称	500ETF 联接 LOF		
下属分级基金的交易代码	160119	004348	021059
下属分级基金的前端交易代码	160119		
下属分级基金的后端交易代码	160120		
报告期末下属分级基金的份额总额	5,251,293,908.23 份	415,808,877.00 份	1,818,551.65 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 日
基金管理人名称	南方基金管理股份有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

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

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95599
传真	0755-82763889	010-68121816
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道	北京市西城区复兴门内大街 28

	益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518017	100031
法定代表人	周易	谷澍

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、南方中证 500ETF 联接（LOF）A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	120,927,626.92
本期利润	-590,347,620.89
加权平均基金份额本期利润	-0.1110
本期加权平均净值利润率	-7.61%
本期基金份额净值增长率	-7.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,061,008,430.52
期末可供分配基金份额利润	0.3924
期末基金资产净值	7,312,302,338.75
期末基金份额净值	1.3925
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	51.93%

2、南方中证 500ETF 联接（LOF）C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	8,414,444.37
本期利润	-46,818,557.73

加权平均基金份额本期利润	-0.1012
本期加权平均净值利润率	-7.10%
本期基金份额净值增长率	-7.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	149,187,160.92
期末可供分配基金份额利润	0.3587
期末基金资产净值	564,996,037.92
期末基金份额净值	1.3588
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-13.63%

3、南方中证 500ETF 联接 (LOF) I

3.1.1 期间数据和指标	2024 年 4 月 9 日-2024 年 6 月 30 日
本期已实现收益	22,671.76
本期利润	-171,959.06
加权平均基金份额本期利润	-0.1640
本期加权平均净值利润率	-11.17%
本期基金份额净值增长率	-5.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	713,750.29
期末可供分配基金份额利润	0.3924
期末基金资产净值	2,532,301.94
期末基金份额净值	1.3925
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-5.31%

注：1、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；

2、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、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；

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方中证 500ETF 联接 (LOF) A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④
----	--------------	--------------	--------------	--------------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去一个月	-5.93%	0.92%	-6.55%	0.91%	0.62%	0.01%
过去三个月	-5.09%	1.09%	-6.16%	1.09%	1.07%	0.00%
过去六个月	-7.55%	1.52%	-8.46%	1.53%	0.91%	-0.01%
过去一年	-15.62%	1.21%	-16.71%	1.21%	1.09%	0.00%
过去三年	-22.08%	1.14%	-26.01%	1.14%	3.93%	0.00%
自基金合同 生效起至今	51.93%	1.50%	40.82%	1.50%	11.11%	0.00%

南方中证 500ETF 联接 (LOF) C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-5.97%	0.92%	-6.55%	0.91%	0.58%	0.01%
过去三个月	-5.18%	1.08%	-6.16%	1.09%	0.98%	-0.01%
过去六个月	-7.73%	1.52%	-8.46%	1.53%	0.73%	-0.01%
过去一年	-15.96%	1.21%	-16.71%	1.21%	0.75%	0.00%
过去三年	-23.01%	1.14%	-26.01%	1.14%	3.00%	0.00%
自基金合同 生效起至今	-13.63%	1.25%	-21.68%	1.24%	8.05%	0.01%

南方中证 500ETF 联接 (LOF) I

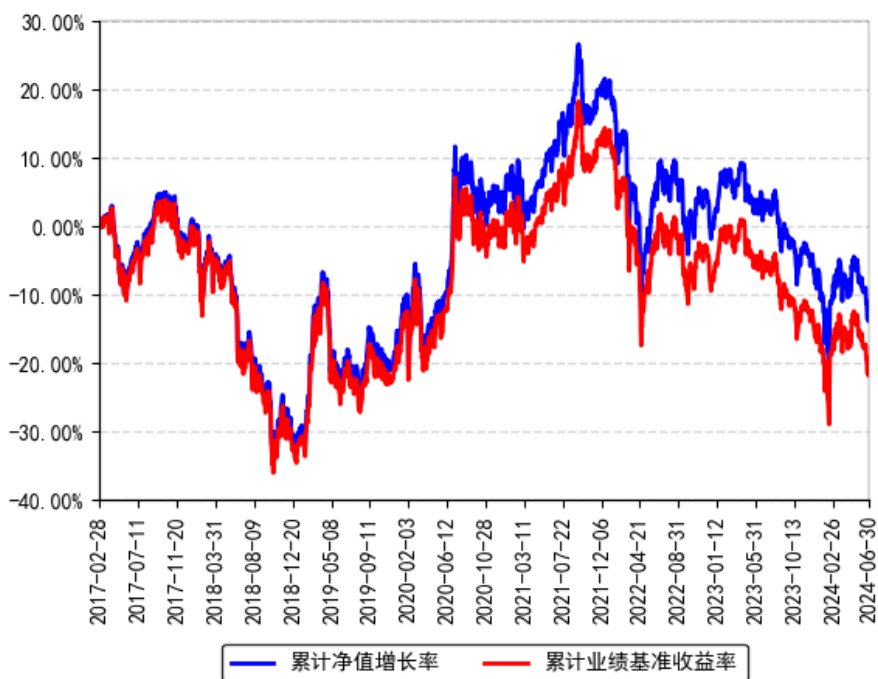
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-5.93%	0.91%	-6.55%	0.91%	0.62%	0.00%
自基金合同 生效起至今	-5.31%	1.07%	-6.37%	1.07%	1.06%	0.00%

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

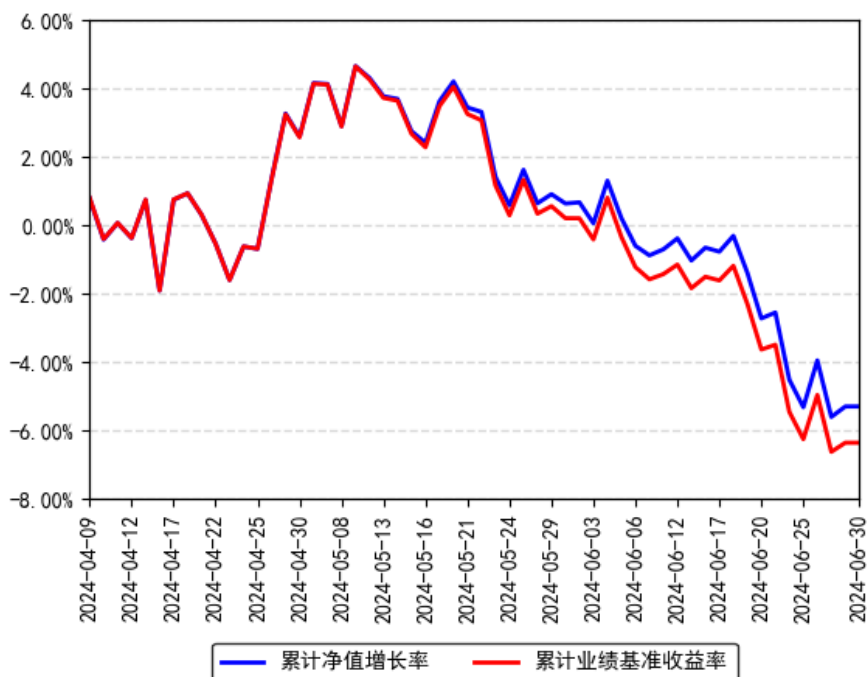
南方中证500ETF联接（LOF）A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



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



注：1、本基金从 2017 年 2 月 23 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2017 年 2 月 28 日起存续；
2、本基金从 2024 年 4 月 8 日起新增 I 类份额，I 类份额自 2024 年 4 月 9 日起存续。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

南方基金管理股份有限公司旗下管理公募基金、全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合，已发展成为产品种类丰富、业务领域全面、经营业绩优秀、资产管理规模位居前列的基金管理公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

罗文杰	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日	-	19 年	<p>女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月 17 日至 2015 年 6 月 16 日，任南方策略基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2019 年 4 月 18 日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 3 月 27 日，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至 2020 年 3 月 27 日，任南方 H 股联接基金经理；2014 年 10 月 30 日至 2020 年 12 月 23 日，任 500 医药基金经理；2021 年 3 月 12 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理；2021 年 10 月 22 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证全指医疗保健 ETF 基金经理；2020 年 12 月 25 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方策略基金经理；2021 年 7 月 2 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方中证香港科技 ETF（QDII）基金经理；2022 年 6 月 17 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方恒生香港上市生物科技 ETF（QDII）基金经理；2013 年 4 月 22 日至今，任南方 500、南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月 17 日至今，任南方 300、南方 300 联接基金经理；2015 年 2 月 16 日至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2017 年 7 月 21 日至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月 24 日至今，任南方房地产联接基金经理；2017 年 8 月 25 日至今，任南方房地产 ETF 基金经理；2018 年 4 月 3 日至今，任 MSCI 基金基金经理；2018 年 6 月 8 日至今，任 MSCI 联接基金经理；2020 年 7 月 24 日至今，兼任投资经理；2023 年 5 月 30 日至今，任南方恒生香港上市生物科技 ETF 发起联接（QDII）基金经理；2024 年 6 月 26 日至今，任南方中证国新港股通央企红利 ETF 基金经理。</p>
-----	---------	-----------------	---	------	--

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
罗文杰	公募基金	12	94,898,159,790.48	2013 年 04 月 22 日
	私募资产管理计划	8	2,644,004,064.49	2020 年 08 月 07 日
	其他组合	-	-	-
	合计	20	97,542,163,854.97	-

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》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，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最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 69 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，中证 500 指数跌 8.96%。

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) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

(3) 报告期内，我们根据指数定期的成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.3925 元，报告期内，份额净值增长率为-7.55%，同期业绩基准增长率为-8.46%；本基金 C 份额净值为 1.3588 元，报告期内，份额净值增长率为-7.73%，同期业绩基准增长率为-8.46%；本基金 I 份额净值为 1.3925 元，报告期内，份额净值增长率为-5.31%，同期业绩基准增长率为-6.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中证 500 是 A 股市场核心中盘股指数，随着 A 股市场扩容与成分股市值增长，中证 500 总市值不断扩大，目前已增长至约 12 万亿元，流通市值约 6 万亿元。成分股总市值中位数从 2010 年的 60 多亿元增长至目前的 200 多亿元。随着中国经济转型发展和 A 股市场的变迁，中证 500 的行业构成不断迭代，房地产、基础化工等传统行业权重逐渐下滑，而医药生物、电子、电力设备等新兴行业权重逐渐占据主导地位。从申万二级行业上看，中证 500 成分股共涉及 100 多个细分行业，并且成分股在 80 多个细分行业中总市值位居前 10%，在 80 多个细分行业中营业收入位居前 10%。在我国逐渐转向创新驱动发展的过程中，中证 500 指数不仅受益于国家对科技创新领域的政策支持、新经济行业本身快速增长的红利，还能够享受各细分行业龙头公司在经济转型与集中度提升下的竞争优势。当前内外部环境均现好转，随着经济逐步复苏回暖，中小盘股盈利有望见底回升。而指数仍被大幅低估，具有较高的安全边际。

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,组成人员包括副总经理、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、现金及债券指数投资部总经理、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 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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司本报告期基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.4.1	163,199,253.33	156,224,612.84
结算备付金		2,775,980.24	1,538,402.03
存出保证金		210,925.52	193,659.00
交易性金融资产	6.4.4.2	7,744,195,059.59	8,613,477,115.78
其中：股票投资		125,868,643.67	138,068,711.08
基金投资		7,361,565,327.32	8,171,533,653.08
债券投资		256,761,088.60	303,874,751.62
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
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		-	28,494,119.11
应收股利		-	-
应收申购款		6,932,179.96	10,344,703.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.5	-	4,525,927.00
资产总计		7,917,313,398.64	8,814,798,539.46
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		26,007,491.48	39,018,281.40
应付清算款		3,476,888.58	60,130,660.49
应付赎回款		7,416,555.11	26,199,512.92
应付管理人报酬		214,927.98	281,130.03
应付托管费		42,985.60	56,226.03
应付销售服务费		193,985.50	235,735.15
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	6.4.4.6	129,885.78	282,238.81
负债合计		37,482,720.03	126,203,784.83
净资产：			
实收基金	6.4.4.7	5,668,921,336.88	5,778,609,398.08
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.4.8	2,210,909,341.73	2,909,985,356.55
净资产合计		7,879,830,678.61	8,688,594,754.63
负债和净资产总计		7,917,313,398.64	8,814,798,539.46

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，南方中证 500ETF 联接（LOF）A 份额净值 1.3925 元，基金份额总额 5,251,293,908.23 份；南方中证 500ETF 联接（LOF）C 份额净值 1.3588 元，基金份额总额 415,808,877.00 份；南方中证 500ETF 联接（LOF）I 份额净值 1.3925 元，基金份额总额 1,818,551.65 份；总份额合计 5,668,921,336.88 份。

6.2 利润表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2023
----	-----	--------------------	--------------

		2024 年 6 月 30 日	年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-633,886,029.73	309,671,354.00
1.利息收入		1,352,906.79	1,752,623.70
其中：存款利息收入	6.4.4.9	1,352,906.79	1,752,623.70
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）		131,156,681.87	154,726,828.81
其中：股票投资收益	6.4.4.10	-364,626.13	5,236,749.45
基金投资收益	6.4.4.11	-1,729,542.11	144,593,404.36
债券投资收益	6.4.4.12	2,655,261.68	3,163,294.34
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.4.13	-	-
股利收益	6.4.4.14	130,595,588.43	1,733,380.66
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）	6.4.4.15	-766,702,880.73	152,701,985.28
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.16	307,262.34	489,916.21
减：二、营业总支出		3,452,107.95	4,379,986.00
1.管理人报酬	6.4.7.2.1	1,335,279.22	1,528,803.10
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.7.2.2	267,055.85	305,760.61
3.销售服务费	6.4.7.2.3	1,309,420.35	1,458,872.43
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		408,190.85	586,967.52
其中：卖出回购金融资产		408,190.85	586,967.52
支出			
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		-	365,987.50
8.其他费用	6.4.4.17	132,161.68	133,594.84

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-637,338,137.68	305,291,368.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-637,338,137.68	305,291,368.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-637,338,137.68	305,291,368.00

6.3 净资产变动表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,778,609,398.08	-	2,909,985,356.55	8,688,594,754.63
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	5,778,609,398.08	-	2,909,985,356.55	8,688,594,754.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-109,688,061.20	-	-699,076,014.82	-808,764,076.02
（一）、综合收益总额	-	-	-637,338,137.68	-637,338,137.68
（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）	-109,688,061.20	-	-61,737,877.14	-171,425,938.34
其中：1.基金申购款	972,681,392.47	-	417,832,947.03	1,390,514,339.50
2.基金赎回款	-1,082,369,453.67	-	-479,570,824.17	-1,561,940,277.84
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资	-	-	-	-

产减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	5,668,921,336.88	-	2,210,909,341.73	7,879,830,678.61
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,611,709,723.31	-	3,342,616,858.26	8,954,326,581.57
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	5,611,709,723.31	-	3,342,616,858.26	8,954,326,581.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-185,047,499.80	-	174,594,303.85	-10,453,195.95
(一)、综合收益总额	-	-	305,291,368.00	305,291,368.00
(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）	-185,047,499.80	-	-130,697,064.15	-315,744,563.95
其中：1.基金申购款	1,418,178,902.53	-	966,468,989.69	2,384,647,892.22
2.基金赎回款	-1,603,226,402.33	-	-1,097,166,053.84	-2,700,392,456.17
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	5,426,662,223.51	-	3,517,211,162.11	8,943,873,385.62

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____	____常克川____	____徐超____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

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

根据本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2017 年 2 月 20 日发布的《关于南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)增加 C 类份额并修改基金合同的公告》以及更新后的《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》的有关规定,自 2017 年 2 月 23 日起,本基金增设 C 类基金份额。根据本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2024 年 4 月 8 日发布的《南方基金管理股份有限公司关于旗下部分指数基金增设 I 类基金份额并修订基金合同的公告》以及更新后的《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》的有关规定,自 2024 年 4 月 8 日起,本基金增设 I 类基金份额。本基金根据费率设置的不同,将基金份额分为不同的类

别, 不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额, 称为 A 类基金份额; 从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额, 称为 C 类基金份额或 I 类基金份额。本基金 A 类基金份额的申购与赎回包括场外和场内两种方式, C 类基金份额和 I 类基金份额在场外申购和赎回。本基金 A 类基金份额和 C 类、I 类基金份额之间不能互相转换。本基金 A 类、C 类和 I 类基金份额单独设置基金代码, 分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务, 本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》的有关规定, 自 2013 年 2 月 22 日起, 本基金的投资范围为目标 ETF、中证 500 指数成份股和备选成份股, 本基金可少量投资于新股(一级市场初次发行或增发)、债券及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金可投资存托凭证。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%(已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内), 基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为: 中证 500 指数收益率 X95%+ 银行活期存款利率(税后)X5%。

6.4.2 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。

6.4.3 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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。

6.4.3.3 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。

6.4.4 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	163,199,253.33
等于：本金	163,135,651.74
加：应计利息	63,601.59
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	163,199,253.33

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	145,335,425.06	-	125,868,643.67	-19,466,781.39	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	254,049,008.00	2,677,068.60	256,761,088.60	35,012.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	254,049,008.00	2,677,068.60	256,761,088.60	35,012.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	8,041,794,786.83	-	7,361,565,327.32	-680,229,459.51	
其他	-	-	-	-	
合计	8,441,179,219.89	2,677,068.60	7,744,195,059.59	-699,661,228.90	

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按估值日目标 ETF 的份额净值确定公允价值。本基金可采用股票组合申赎的方式或证券二级市场买卖的方式进行目标 ETF 份额的交易。

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

6.4.4.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.4.4 买入返售金融资产

6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.4.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.4.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,932.36
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	7,608.74
其中：交易所市场	7,608.74
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	-
预提费用	119,344.68
应付指数使用费	-
可退替代款	-
合计	129,885.78

6.4.4.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方中证 500ETF 联接 (LOF) A		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	5,317,265,946.34	5,317,265,946.34
本期申购	494,741,306.37	494,741,306.37
本期赎回 (以“-”号填列)	-560,713,344.48	-560,713,344.48

基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	5,251,293,908.23	5,251,293,908.23

南方中证 500ETF 联接（LOF）C		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	461,343,451.74	461,343,451.74
本期申购	476,086,794.97	476,086,794.97
本期赎回（以“-”号填列）	-521,621,369.71	-521,621,369.71
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	415,808,877.00	415,808,877.00

南方中证 500ETF 联接（LOF）I		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	1,853,291.13	1,853,291.13
本期赎回（以“-”号填列）	-34,739.48	-34,739.48
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	1,818,551.65	1,818,551.65

注：红利再投及转入份额计入本期申购，转出份额计入本期赎回。

6.4.4.8 未分配利润

单位：人民币元

南方中证 500ETF 联接（LOF）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,203,760,562.61	-3,511,868,466.84	2,691,892,095.77
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	6,203,760,562.61	-3,511,868,466.84	2,691,892,095.77
本期利润	120,927,626.92	-711,275,247.81	-590,347,620.89
本期基金份额交易产生的变动数	-78,170,343.85	37,634,299.49	-40,536,044.36

其中：基金申购款	579,297,564.00	-361,129,008.69	218,168,555.31
基金赎回款	-657,467,907.85	398,763,308.18	-258,704,599.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,246,517,845.68	-4,185,509,415.16	2,061,008,430.52

南方中证 500ETF 联接 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	520,888,700.46	-302,795,439.68	218,093,260.78
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	520,888,700.46	-302,795,439.68	218,093,260.78
本期利润	8,414,444.37	-55,233,002.10	-46,818,557.73
本期基金份额交易产生的变动数	-51,747,819.32	29,660,277.19	-22,087,542.13
其中：基金申购款	537,717,544.65	-338,955,431.46	198,762,113.19
基金赎回款	-589,465,363.97	368,615,708.65	-220,849,655.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	477,555,325.51	-328,368,164.59	149,187,160.92

南方中证 500ETF 联接 (LOF) I			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	22,671.76	-194,630.82	-171,959.06
本期基金份额交易产生的变动数	2,140,576.27	-1,254,866.92	885,709.35
其中：基金申购款	2,181,710.86	-1,279,432.33	902,278.53
基金赎回款	-41,134.59	24,565.41	-16,569.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,163,248.03	-1,449,497.74	713,750.29

6.4.4.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,335,852.29
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	14,204.09
其他	2,850.41

合计	1,352,906.79
----	--------------

6.4.4.10 股票投资收益

6.4.4.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-596,001.22
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	231,375.09
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-364,626.13

6.4.4.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	30,026,939.85
减：卖出股票成本总额	30,592,687.03
减：交易费用	30,254.04
买卖股票差价收入	-596,001.22

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.4.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	99,311,400.00
减：现金支付申购款总额	51,134,052.60
减：申购股票成本总额	47,945,972.31
减：交易费用	-
申购差价收入	231,375.09

6.4.4.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	413,372,667.05
减：卖出/赎回基金成本总额	415,074,285.69
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	27,923.47
基金投资收益	-1,729,542.11

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。

6.4.4.12 债券投资收益

6.4.4.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	3,003,435.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-348,173.97
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	2,655,261.68

6.4.4.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	281,606,992.61
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	276,076,792.00
减：应计利息总额	5,878,373.41
减：交易费用	1.17
买卖债券差价收入	-348,173.97

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.4.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.4.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.4.13 衍生工具收益**6.4.4.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.4.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.4.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,733,139.32
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	128,862,449.11
合计	130,595,588.43

6.4.4.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-766,702,880.73
——股票投资	-8,787,891.42
——债券投资	260,539.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-758,175,528.31
——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	-766,702,880.73

6.4.4.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	306,326.65
基金转换费收入	935.69
合计	307,262.34

6.4.4.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	59,672.34
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	12,778.48
其他	38.52
合计	132,161.68

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	16,941,773.40	18.24%	150,254,322.40	23.86%

6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	-	2,003,200.00	0.76%

6.4.7.1.3 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	1,694.00	18.24%	1,569.71	20.63%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	15,026.84	23.86%	8,360.90	18.64%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,335,279.22	1,528,803.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,011,280.47	7,622,609.52
应支付基金管理人的净管理费	-5,676,001.25	-6,093,806.42

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所持有目标 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：

日管理人报酬 = (前一日基金资产净值 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 0.50% ÷ 当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	267,055.85	305,760.61

注: 本基金基金财产中投资于目标 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所持有目标 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:

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

6.4.7.2.3 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	南方中证 500ETF 联接 (LOF) I	合计
华泰证券	-	7,185.72	-	7,185.72
南方基金	-	227,390.61	34.84	227,425.45
农业银行	-	875.37	-	875.37
合计	-	235,451.70	34.84	235,486.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	南方中证 500ETF 联接 (LOF) I	合计
华泰证券	-	7,545.40	-	7,545.40
南方基金	-	369,532.36	-	369,532.36
农业银行	-	427.29	-	427.29
合计	-	377,505.05	-	377,505.05

注: 支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额和 I 类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付给南方基金, 再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。C 类基金份额和 I 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.40% 和 0.10%。此外, 根据《南方基金关于开展旗下部分基金销售服务费费率优惠活动的公告》, 自 2024 年 4 月 9 日起, I 类基金份额销售服务费率调整为 0.01%。其计算公式为:

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C/I 类基金份额的基金资产净值} \times \text{约定年费率} \div \text{当年天数}。$$

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.7.4 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

6.4.7.4.1 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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。

6.4.7.4.2 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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。

6.4.7.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	南方中证 500ETF 联接 (LOF) I
报告期初持有的基金份额	90,863,705.07	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	90,863,705.07	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.60%	-	-

项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	南方中证 500ETF 联接 (LOF) I
报告期初持有的基金份额	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-
报告期末持有的基金	-	-	-

份额占基金总份额比例			
------------	--	--	--

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

6.4.7.5.2 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。

6.4.7.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	163,199,253.33	1,335,852.29	50,838,231.74	1,700,482.95

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。

6.4.7.7 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	688709	成都华微	网下申购	10,448	163,929.12
华泰联合	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
华泰联合	301587	中瑞股份	网下申购	3,056	66,406.88
兴业证券	301392	汇成真空	网下申购	2,189	26,705.80

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	688472	阿特斯	网下申购	62,602	694,882.20
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	4,013	130,502.76
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
兴业证券	301322	绿通科技	网下申购	2,604	341,410.44
兴业证券	301315	威士顿	网下申购	2,253	72,749.37
兴业证券,华泰联合	688469	中芯集成	网下申购	137,994	785,185.86

6.4.7.8 其他关联交易事项的说明

6.4.7.8.1 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 8,041,794,786.83 元，估值总额为人民币 7,361,565,327.32 元，占本基金基金资产净值的比例为 93.42% (于上期末，本基金持有目标 ETF 基金份额，成本总额为人民币 8,093,587,584.28 元，估值总额为人民币 8,171,533,653.08 元，占本基金基金资产净值的比例为 94.05%)。

6.4.8 利润分配情况

6.4.8.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.9 期末（2024 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 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
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股锁定期	126.89	188.01	691	87,680.99	129,914.91	-
301589	诺瓦星云	2024年5月30日	1-6个月（含）	锁定期转增	-	188.01	553	-	103,969.53	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股锁定期	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内（含）	新股未上市	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内（含）	新股未上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股锁定期	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股锁定期	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股锁定期	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-

301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股锁定期	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024年5月22日	1-6个月(含)	锁定期转增	-	91.24	43	-	3,923.32	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股锁定期	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股锁定期	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股锁定期	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股锁定期	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股锁定期	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股锁定期	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股锁定期	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股锁定期	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股锁定期	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股锁定期	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股锁定期	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股锁定期	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301502	华阳智能	2024年1月	6个月	新股锁定期	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-

		26 日								
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股锁定期	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定期	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定期	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
001359	平安电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新股锁定期	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股锁定期	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股锁定期	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	新股锁定期	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
6.4.9.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金持有的上述流通受限证券，根据中国证监会、证券交易所发布的相关规定，在受限期内不得转让：

1. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。
2. 基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。
3. 基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。
4. 基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

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

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 26,007,491.48 元,于 2024 年 7 月 4 日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.9.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 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,属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。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,将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.10.2 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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.3.1 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。

6.4.10.4 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。

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	163,199,253.33	-	-	-	163,199,253.33
结算备付金	2,775,980.24	-	-	-	2,775,980.24
存出保证金	210,925.52	-	-	-	210,925.52
交易性金融资产	256,761,088.60	-	-	7,487,433,970.99	7,744,195,059.59
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	357,544.57	-	-	6,574,635.39	6,932,179.96
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	423,304,792.26	-	-	7,494,008,606.38	7,917,313,398.64
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	26,007,491.48	-	-	-	26,007,491.48
应付清算款	-	-	-	3,476,888.58	3,476,888.58
应付赎回款	-	-	-	7,416,555.11	7,416,555.11
应付管理人报酬	-	-	-	214,927.98	214,927.98
应付托管费	-	-	-	42,985.60	42,985.60
应付销售服务费	-	-	-	193,985.50	193,985.50

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	-	-	-	129,885.78	129,885.78
负债总计	26,007,491.48	-	-	11,475,228.55	37,482,720.03
利率敏感度缺口	397,297,300.78	-	-	7,482,533,377.83	7,879,830,678.61
上年度末 2023 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	156,224,612.84	-	-	-	156,224,612.84
结算备付金	1,538,402.03	-	-	-	1,538,402.03
存出保证金	193,659.00	-	-	-	193,659.00
交易性金融资产	303,874,751.62	-	-	8,309,602,364.16	8,613,477,115.78
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	-	-	-	28,494,119.11	28,494,119.11
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	406,599.21	-	-	9,938,104.49	10,344,703.70
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	4,525,927.00	4,525,927.00
资产总计	462,238,024.70	-	-	8,352,560,514.76	8,814,798,539.46
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	39,018,281.40	-	-	-	39,018,281.40
应付清算款	-	-	-	60,130,660.49	60,130,660.49
应付赎回款	-	-	-	26,199,512.92	26,199,512.92
应付管理人报酬	-	-	-	281,130.03	281,130.03
应付托管费	-	-	-	56,226.03	56,226.03
应付销售服务费	-	-	-	235,735.15	235,735.15
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	-	-	-	282,238.81	282,238.81
负债总计	39,018,281.40	-	-	87,185,503.43	126,203,784.83
利率敏感度缺口	423,219,743.30	-	-	8,265,375.011.33	8,688,594.754.63

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。

6.4.10.4.1.2 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	-324,102.18	-7,456.41
	2.市场利率平行下降25个基点	325,056.42	7,864.25

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.4.3 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。本基金主要投资于能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出的目标 ETF 份额以及证券交易所上市的股票，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。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。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。

6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	125,868,643.67	1.60	138,068,711.08	1.59
交易性金融资产-基金投资	7,361,565,327.32	93.42	8,171,533,653.08	94.05
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	7,487,433,970.99	95.02	8,309,602,364.16	95.64

注：交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标 ETF 份额。

6.4.10.4.3.2 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	372,203,835.08	410,646,031.65
2.组合自身基准下降 5%	-372,203,835.08	-410,646,031.65	

6.4.11 公允价值

6.4.11.1 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。

6.4.11.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.11.2.1 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 2024 年 6 月 30 日
第一层次	7,486,907,529.79
第二层次	256,806,699.71
第三层次	480,830.09
合计	7,744,195,059.59

6.4.11.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.11.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.11.4 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。

6.4.12 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

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	125,868,643.67	1.59
	其中：股票	125,868,643.67	1.59
2	基金投资	7,361,565,327.32	92.98
3	固定收益投资	256,761,088.60	3.24
	其中：债券	256,761,088.60	3.24
	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	165,975,233.57	2.10
8	其他各项资产	7,143,105.48	0.09
9	合计	7,917,313,398.64	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

金额单位：人民币元

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	827,904.00	0.01
B	采矿业	5,794,664.00	0.07
C	制造业	79,234,007.67	1.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,041,325.79	0.06
E	建筑业	1,299,973.24	0.02
F	批发和零售业	2,560,574.41	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	2,165,919.64	0.03
H	住宿和餐饮业	409,823.90	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,989,277.50	0.11
J	金融业	12,774,743.63	0.16
K	房地产业	1,529,698.50	0.02
L	租赁和商务服务业	1,023,094.16	0.01
M	科学研究和技术服务业	1,147,055.51	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	624,298.80	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	493,652.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,730,680.84	0.02
S	综合	221,950.08	0.00
	合计	125,868,643.67	1.60

7.2.2 期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	300502	新易盛	15,000	1,583,250.00	0.02
2	688169	石头科技	3,273	1,284,979.80	0.02
3	002028	思源电气	15,918	1,064,914.20	0.01
4	002340	格林美	127,500	812,175.00	0.01
5	601058	赛轮轮胎	55,239	773,346.00	0.01
6	601168	西部矿业	43,000	771,850.00	0.01
7	600066	宇通客车	29,300	755,940.00	0.01
8	000933	神火股份	36,800	744,464.00	0.01
9	601077	渝农商行	143,800	721,876.00	0.01
10	000630	铜陵有色	191,700	692,037.00	0.01
11	002384	东山精密	33,000	683,100.00	0.01
12	000988	华工科技	22,700	679,411.00	0.01
13	002966	苏州银行	90,300	677,250.00	0.01
14	002625	光启技术	38,800	673,180.00	0.01
15	600418	江淮汽车	41,568	658,437.12	0.01
16	601233	桐昆股份	39,100	624,036.00	0.01
17	600988	赤峰黄金	38,100	622,554.00	0.01
18	600157	永泰能源	524,800	619,264.00	0.01
19	300394	天孚通信	7,000	618,940.00	0.01
20	688188	柏楚电子	3,338	616,027.90	0.01
21	000423	东阿阿胶	9,500	594,700.00	0.01
22	002223	鱼跃医疗	15,416	579,641.60	0.01
23	002273	水晶光电	33,888	575,418.24	0.01
24	002078	太阳纸业	41,000	571,950.00	0.01
25	002353	杰瑞股份	16,100	564,788.00	0.01
26	002156	通富微电	24,900	557,511.00	0.01
27	601555	东吴证券	94,000	554,600.00	0.01
28	600096	云天化	27,500	534,050.00	0.01
29	600352	浙江龙盛	61,600	529,144.00	0.01
30	600885	宏发股份	19,103	528,771.04	0.01
31	002138	顺络电子	19,200	527,232.00	0.01
32	002185	华天科技	63,600	518,340.00	0.01
33	601128	常熟银行	68,336	517,303.52	0.01
34	601108	财通证券	78,200	516,902.00	0.01
35	000400	许继电气	15,000	516,150.00	0.01

36	002532	天山铝业	63,400	514,174.00	0.01
37	300136	信维通信	25,900	507,122.00	0.01
38	600873	梅花生物	49,400	494,988.00	0.01
39	600642	申能股份	55,399	489,173.17	0.01
40	002128	电投能源	22,900	483,190.00	0.01
41	300207	欣旺达	31,500	477,855.00	0.01
42	000783	长江证券	98,800	477,204.00	0.01
43	000932	华菱钢铁	105,420	467,010.60	0.01
44	600109	国金证券	61,800	466,590.00	0.01
45	300017	网宿科技	58,300	460,570.00	0.01
46	600079	人福医药	26,789	459,967.13	0.01
47	600497	驰宏锌锗	86,000	459,240.00	0.01
48	002432	九安医疗	11,300	458,102.00	0.01
49	300003	乐普医疗	30,800	457,072.00	0.01
50	002595	豪迈科技	11,900	454,223.00	0.01
51	600177	雅戈尔	63,700	453,544.00	0.01
52	601567	三星医疗	12,900	451,500.00	0.01
53	002465	海格通信	43,500	450,660.00	0.01
54	600765	中航重机	22,086	450,554.40	0.01
55	000009	中国宝安	52,369	450,373.40	0.01
56	002409	雅克科技	7,100	446,661.00	0.01
57	000039	中集集团	47,850	443,091.00	0.01
58	600536	中国软件	14,696	439,704.32	0.01
59	600348	华阳股份	43,900	437,244.00	0.01
60	688777	中控技术	11,552	435,510.40	0.01
61	002517	恺英网络	45,500	434,525.00	0.01
62	000683	远兴能源	62,400	431,184.00	0.01
63	002008	大族激光	20,700	430,560.00	0.01
64	002281	光迅科技	11,500	429,755.00	0.01
65	603160	汇顶科技	6,200	426,250.00	0.01
66	301236	软通动力	12,100	426,041.00	0.01
67	002673	西部证券	68,500	424,015.00	0.01
68	600060	海信视像	17,100	423,054.00	0.01
69	002797	第一创业	82,400	419,416.00	0.01
70	600298	安琪酵母	14,900	416,157.00	0.01
71	300012	华测检测	41,300	415,478.00	0.01
72	300073	当升科技	12,100	415,151.00	0.01
73	000066	中国长城	47,000	411,250.00	0.01
74	000513	丽珠集团	10,852	403,802.92	0.01
75	603596	伯特利	10,360	403,004.00	0.01
76	000728	国元证券	65,800	398,748.00	0.01
77	601179	中国西电	49,000	393,960.00	0.00
78	688617	惠泰医疗	856	390,421.60	0.00

79	601990	南京证券	50,500	387,840.00	0.00
80	600839	四川长虹	86,236	387,199.64	0.00
81	002444	巨星科技	15,618	385,764.60	0.00
82	603589	口子窖	9,800	384,062.00	0.00
83	002738	中矿资源	14,120	378,416.00	0.00
84	000831	中国稀土	14,900	377,715.00	0.00
85	000703	恒逸石化	53,200	377,188.00	0.00
86	600398	海澜之家	40,800	376,992.00	0.00
87	002155	湖南黄金	20,600	372,860.00	0.00
88	000021	深科技	24,600	371,952.00	0.00
89	002739	万达电影	30,500	368,745.00	0.00
90	601997	贵阳银行	69,800	367,846.00	0.00
91	300724	捷佳伟创	6,800	367,268.00	0.00
92	600863	内蒙华电	78,700	365,168.00	0.00
93	600521	华海药业	21,400	364,870.00	0.00
94	600380	健康元	32,613	364,287.21	0.00
95	300699	光威复材	14,600	362,518.00	0.00
96	002294	信立泰	13,600	362,168.00	0.00
97	600862	中航高科	19,200	360,576.00	0.00
98	600879	航天电子	46,020	357,575.40	0.00
99	002195	岩山科技	142,358	357,318.58	0.00
100	601162	天风证券	163,900	357,302.00	0.00
101	000738	航发控制	17,800	357,246.00	0.00
102	601666	平煤股份	31,800	356,160.00	0.00
103	600282	南钢股份	71,200	354,576.00	0.00
104	601198	东兴证券	44,400	353,424.00	0.00
105	300037	新宙邦	12,171	347,603.76	0.00
106	601696	中银证券	38,200	346,856.00	0.00
107	688385	复旦微电	11,022	345,870.36	0.00
108	000598	兴蓉环境	45,800	344,416.00	0.00
109	601577	长沙银行	42,100	344,378.00	0.00
110	603979	金诚信	6,800	343,604.00	0.00
111	600985	淮北矿业	20,500	343,170.00	0.00
112	300866	安克创新	4,810	342,520.10	0.00
113	600549	厦门钨业	19,840	342,240.00	0.00
114	300144	宋城演艺	42,600	342,078.00	0.00
115	002152	广电运通	32,500	339,950.00	0.00
116	002202	金风科技	50,500	339,360.00	0.00
117	000960	锡业股份	21,900	339,231.00	0.00
118	300285	国瓷材料	19,000	339,150.00	0.00
119	601000	唐山港	71,419	335,669.30	0.00
120	000830	鲁西化工	28,810	333,907.90	0.00
121	688390	固德威	5,901	331,164.12	0.00

122	300058	蓝色光标	60,500	329,120.00	0.00
123	688301	奕瑞科技	2,841	327,368.43	0.00
124	600820	隧道股份	50,100	327,153.00	0.00
125	600153	建发股份	36,600	326,838.00	0.00
126	603816	顾家家居	10,100	326,129.00	0.00
127	000623	吉林敖东	24,300	325,620.00	0.00
128	000878	云南铜业	26,100	325,206.00	0.00
129	688220	翱捷科技	8,675	324,965.50	0.00
130	603338	浙江鼎力	5,376	324,817.92	0.00
131	600511	国药股份	10,518	323,849.22	0.00
132	600021	上海电力	32,698	323,383.22	0.00
133	600566	济川药业	10,169	322,458.99	0.00
134	603444	吉比特	1,800	320,418.00	0.00
135	600141	兴发集团	16,784	320,238.72	0.00
136	300001	特锐德	15,888	319,666.56	0.00
137	002436	兴森科技	30,900	318,888.00	0.00
138	600118	中国卫星	14,234	316,421.82	0.00
139	300146	汤臣倍健	23,300	315,715.00	0.00
140	300024	机器人	32,400	315,576.00	0.00
141	600704	物产中大	72,600	315,084.00	0.00
142	000636	风华高科	24,100	314,746.00	0.00
143	601615	明阳智能	33,200	313,408.00	0.00
144	603939	益丰药房	12,720	312,276.00	0.00
145	600170	上海建工	144,600	310,890.00	0.00
146	000591	太阳能	66,000	310,860.00	0.00
147	300054	鼎龙股份	13,700	310,716.00	0.00
148	002407	多氟多	25,360	310,152.80	0.00
149	002385	大北农	80,300	309,155.00	0.00
150	688200	华峰测控	3,347	307,087.25	0.00
151	600895	张江高科	16,600	306,768.00	0.00
152	000729	燕京啤酒	34,700	306,401.00	0.00
153	002025	航天电器	6,600	306,108.00	0.00
154	300383	光环新网	35,900	303,355.00	0.00
155	688525	佰维存储	4,720	302,788.00	0.00
156	000519	中兵红箭	20,400	299,268.00	0.00
157	600637	东方明珠	48,900	297,312.00	0.00
158	300474	景嘉微	4,700	297,181.00	0.00
159	600529	山东药玻	11,700	296,478.00	0.00
160	600038	中直股份	7,100	291,881.00	0.00
161	000629	钒钛股份	116,700	291,750.00	0.00
162	000883	湖北能源	48,500	291,485.00	0.00
163	300002	神州泰岳	35,800	290,696.00	0.00
164	002372	伟星新材	18,780	289,587.60	0.00

165	600699	均胜电子	19,466	288,486.12	0.00
166	300529	健帆生物	10,600	288,426.00	0.00
167	600546	山煤国际	19,500	285,090.00	0.00
168	600998	九州通	58,050	283,284.00	0.00
169	000750	国海证券	97,210	282,881.10	0.00
170	600008	首创环保	105,420	282,525.60	0.00
171	603345	安井食品	3,800	282,378.00	0.00
172	603228	景旺电子	8,865	281,907.00	0.00
173	600516	方大炭素	65,400	281,874.00	0.00
174	600970	中材国际	23,254	280,443.24	0.00
175	605358	立昂微	12,100	279,994.00	0.00
176	600392	盛和资源	32,410	279,374.20	0.00
177	000060	中金岭南	65,800	278,992.00	0.00
178	601456	国联证券	28,900	278,596.00	0.00
179	601966	玲珑轮胎	15,100	277,387.00	0.00
180	000997	新大陆	19,940	277,365.40	0.00
181	300088	长信科技	59,000	277,300.00	0.00
182	600486	扬农化工	4,900	276,605.00	0.00
183	601231	环旭电子	17,200	276,060.00	0.00
184	600580	卧龙电驱	22,711	275,938.65	0.00
185	600909	华安证券	65,388	275,283.48	0.00
186	600535	天士力	21,840	274,747.20	0.00
187	000921	海信家电	8,500	274,040.00	0.00
188	689009	九号公司	7,440	273,866.40	0.00
189	002831	裕同科技	10,666	272,942.94	0.00
190	002984	森麒麟	11,300	272,217.00	0.00
191	600143	金发科技	41,100	271,671.00	0.00
192	688516	奥特维	6,460	270,092.60	0.00
193	002429	兆驰股份	55,900	268,879.00	0.00
194	600867	通化东宝	32,100	268,677.00	0.00
195	600373	中文传媒	17,840	264,745.60	0.00
196	688536	思瑞浦	2,706	264,673.86	0.00
197	601665	齐鲁银行	53,800	264,158.00	0.00
198	601016	节能风电	88,340	264,136.60	0.00
199	002408	齐翔腾达	46,988	263,132.80	0.00
200	601991	大唐发电	87,300	262,773.00	0.00
201	601717	郑煤机	17,692	261,841.60	0.00
202	688772	珠海冠宇	17,556	261,584.40	0.00
203	301358	湖南裕能	8,300	261,118.00	0.00
204	600872	中炬高新	11,500	260,935.00	0.00
205	002572	索菲亚	17,000	260,610.00	0.00
206	600582	天地科技	37,734	259,987.26	0.00
207	600499	科达制造	30,800	259,644.00	0.00

208	000027	深圳能源	35,420	258,566.00	0.00
209	300677	英科医疗	9,600	257,376.00	0.00
210	002939	长城证券	38,400	257,280.00	0.00
211	601958	金钼股份	24,700	257,127.00	0.00
212	002497	雅化集团	28,800	256,896.00	0.00
213	603087	甘李药业	5,500	254,760.00	0.00
214	002958	青农商行	94,800	254,064.00	0.00
215	300390	天华新能	14,770	253,748.60	0.00
216	600528	中铁工业	34,660	253,711.20	0.00
217	300373	扬杰科技	6,500	252,850.00	0.00
218	603225	新凤鸣	16,200	252,558.00	0.00
219	300253	卫宁健康	42,792	252,472.80	0.00
220	300009	安科生物	29,560	252,442.40	0.00
221	603000	人民网	12,600	251,874.00	0.00
222	600166	福田汽车	111,600	251,100.00	0.00
223	002065	东华软件	55,000	248,600.00	0.00
224	002624	完美世界	32,600	247,760.00	0.00
225	600801	华新水泥	17,980	247,225.00	0.00
226	002670	国盛金控	29,163	247,010.61	0.00
227	300748	金力永磁	18,920	245,203.20	0.00
228	603077	和邦生物	148,220	244,563.00	0.00
229	600325	华发股份	37,609	244,458.50	0.00
230	002373	千方科技	26,900	243,983.00	0.00
231	603179	新泉股份	6,200	243,288.00	0.00
232	002056	横店东磁	19,500	243,165.00	0.00
233	603927	中科软	13,440	243,129.60	0.00
234	000998	隆平高科	24,700	242,801.00	0.00
235	002203	海亮股份	30,400	242,592.00	0.00
236	002430	杭氧股份	10,900	242,525.00	0.00
237	002926	华西证券	36,800	242,512.00	0.00
238	688065	凯赛生物	5,332	242,019.48	0.00
239	002936	郑州银行	139,564	241,445.72	0.00
240	002500	山西证券	51,314	241,175.80	0.00
241	300568	星源材质	29,400	241,080.00	0.00
242	688029	南微医学	3,891	239,529.96	0.00
243	300487	蓝晓科技	5,700	238,032.00	0.00
244	601866	中远海发	92,100	237,618.00	0.00
245	002080	中材科技	18,400	237,360.00	0.00
246	002244	滨江集团	32,600	236,676.00	0.00
247	002507	涪陵榨菜	19,200	235,200.00	0.00
248	600369	西南证券	65,600	234,848.00	0.00
249	603885	吉祥航空	21,326	234,372.74	0.00
250	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.00

251	300395	菲利华	7,600	233,700.00	0.00
252	000050	深天马 A	32,000	232,960.00	0.00
253	601636	旗滨集团	35,900	231,555.00	0.00
254	002439	启明星辰	13,400	231,284.00	0.00
255	600655	豫园股份	44,800	230,720.00	0.00
256	600707	彩虹股份	33,800	230,178.00	0.00
257	002506	协鑫集成	118,100	229,114.00	0.00
258	300296	利亚德	50,700	228,150.00	0.00
259	002240	盛新锂能	17,000	228,140.00	0.00
260	002299	圣农发展	16,700	227,788.00	0.00
261	603156	养元饮品	10,700	227,589.00	0.00
262	600737	中粮糖业	23,717	227,446.03	0.00
263	000887	中鼎股份	18,500	226,440.00	0.00
264	002508	老板电器	10,200	225,420.00	0.00
265	002557	洽洽食品	7,900	222,701.00	0.00
266	600498	烽火通信	14,000	222,600.00	0.00
267	600673	东阳光	31,527	221,950.08	0.00
268	600763	通策医疗	4,100	221,605.00	0.00
269	603650	彤程新材	7,495	221,477.25	0.00
270	603568	伟明环保	10,760	221,440.80	0.00
271	600848	上海临港	24,300	221,373.00	0.00
272	300604	长川科技	8,100	220,077.00	0.00
273	000893	亚钾国际	13,600	219,776.00	0.00
274	601880	辽港股份	178,460	219,505.80	0.00
275	300070	碧水源	52,200	218,718.00	0.00
276	000818	航锦科技	9,900	218,592.00	0.00
277	603786	科博达	3,400	218,110.00	0.00
278	600329	达仁堂	6,718	217,596.02	0.00
279	688520	神州细胞	5,528	217,526.80	0.00
280	688778	厦钨新能	6,952	217,180.48	0.00
281	600258	首旅酒店	17,554	216,791.90	0.00
282	002268	电科网安	15,094	214,787.62	0.00
283	000778	新兴铸管	61,300	213,324.00	0.00
284	688213	思特威	4,387	212,769.50	0.00
285	603658	安图生物	4,600	211,922.00	0.00
286	600755	厦门国贸	29,548	211,859.16	0.00
287	600390	五矿资本	52,100	211,005.00	0.00
288	300251	光线传媒	24,900	209,409.00	0.00
289	002568	百润股份	12,300	207,009.00	0.00
290	002531	天顺风能	23,100	206,514.00	0.00
291	600859	王府井	17,490	205,332.60	0.00
292	000709	河钢股份	105,000	203,700.00	0.00
293	300567	精测电子	3,600	203,436.00	0.00

294	002261	拓维信息	18,300	202,581.00	0.00
295	000739	普洛药业	14,900	202,193.00	0.00
296	300595	欧普康视	12,800	200,704.00	0.00
297	688281	华秦科技	2,404	200,301.28	0.00
298	002019	亿帆医药	16,200	200,232.00	0.00
299	688538	和辉光电	100,721	199,427.58	0.00
300	600739	辽宁成大	23,801	199,214.37	0.00
301	600968	海油发展	48,300	198,996.00	0.00
302	603486	科沃斯	4,200	198,156.00	0.00
303	600435	北方导航	22,898	197,380.76	0.00
304	603379	三美股份	5,000	195,700.00	0.00
305	600816	建元信托	72,000	195,120.00	0.00
306	002487	大金重工	8,500	194,480.00	0.00
307	600901	江苏金租	38,500	194,425.00	0.00
308	300765	新诺威	7,700	194,271.00	0.00
309	601598	中国外运	34,500	194,235.00	0.00
310	600399	抚顺特钢	34,500	194,235.00	0.00
311	002368	太极股份	8,600	193,930.00	0.00
312	600754	锦江酒店	8,400	193,032.00	0.00
313	000825	太钢不锈	57,100	192,998.00	0.00
314	600959	江苏有线	72,950	192,588.00	0.00
315	300676	华大基因	5,500	192,555.00	0.00
316	000987	越秀资本	38,725	192,076.00	0.00
317	601156	东航物流	9,400	191,290.00	0.00
318	603858	步长制药	12,600	190,890.00	0.00
319	688567	孚能科技	19,834	190,406.40	0.00
320	603290	斯达半导	2,200	189,442.00	0.00
321	603298	杭叉集团	9,600	188,544.00	0.00
322	600271	航天信息	25,500	187,680.00	0.00
323	002266	浙富控股	66,000	184,140.00	0.00
324	300763	锦浪科技	4,400	183,216.00	0.00
325	002683	广东宏大	9,100	183,183.00	0.00
326	601118	海南橡胶	40,100	182,455.00	0.00
327	300558	贝达药业	5,600	182,280.00	0.00
328	300438	鹏辉能源	9,900	181,566.00	0.00
329	002423	中粮资本	24,000	179,760.00	0.00
330	600378	昊华科技	6,200	179,180.00	0.00
331	688052	纳芯微	1,742	179,042.76	0.00
332	601098	中南传媒	14,314	177,779.88	0.00
333	601928	凤凰传媒	16,216	177,727.36	0.00
334	603882	金域医学	6,500	176,735.00	0.00
335	000155	川能动力	16,300	175,551.00	0.00
336	600598	北大荒	14,000	174,860.00	0.00

337	600517	国网英大	40,200	174,066.00	0.00
338	003035	南网能源	39,100	172,040.00	0.00
339	300118	东方日升	14,100	170,610.00	0.00
340	600871	石化油服	96,700	168,258.00	0.00
341	001227	兰州银行	70,600	168,028.00	0.00
342	300357	我武生物	8,300	167,826.00	0.00
343	000937	冀中能源	24,900	166,830.00	0.00
344	603883	老百姓	9,023	165,662.28	0.00
345	688234	天岳先进	3,519	165,111.48	0.00
346	300803	指南针	4,500	163,845.00	0.00
347	002690	美亚光电	9,930	163,845.00	0.00
348	603517	绝味食品	10,600	163,240.00	0.00
349	600483	福能股份	14,000	163,240.00	0.00
350	600131	国网信通	9,600	161,952.00	0.00
351	603712	七一二	8,900	161,891.00	0.00
352	600906	财达证券	28,100	161,013.00	0.00
353	601298	青岛港	16,800	160,608.00	0.00
354	600315	上海家化	8,905	158,330.90	0.00
355	600056	中国医药	15,595	157,821.40	0.00
356	600208	新潮中宝	99,200	156,736.00	0.00
357	600350	山东高速	17,708	156,715.80	0.00
358	601608	中信重工	41,100	156,591.00	0.00
359	603529	爱玛科技	5,600	153,048.00	0.00
360	688017	绿的谐波	1,850	151,885.00	0.00
361	000156	华数传媒	24,154	151,687.12	0.00
362	300682	朗新集团	17,800	151,478.00	0.00
363	600022	山东钢铁	123,960	151,231.20	0.00
364	601212	白银有色	54,100	150,398.00	0.00
365	601155	新城控股	16,500	146,355.00	0.00
366	688276	百克生物	5,107	144,885.59	0.00
367	601106	中国一重	62,200	143,682.00	0.00
368	600967	内蒙一机	19,832	142,790.40	0.00
369	000958	电投产融	38,500	140,910.00	0.00
370	603127	昭衍新药	10,600	140,662.00	0.00
371	000559	万向钱潮	31,000	138,260.00	0.00
372	601992	金隅集团	100,800	138,096.00	0.00
373	002653	海思科	4,465	137,075.50	0.00
374	601611	中国核建	16,900	136,721.00	0.00
375	600062	华润双鹤	6,957	136,218.06	0.00
376	601399	国机重装	52,700	135,966.00	0.00
377	600663	陆家嘴	15,300	134,946.00	0.00
378	601019	山东出版	11,400	134,748.00	0.00
379	688819	天能股份	5,624	134,188.64	0.00

380	600612	老凤祥	2,300	133,837.00	0.00
381	002608	江苏国信	17,100	132,525.00	0.00
382	600827	百联股份	17,783	131,238.54	0.00
383	000967	盈峰环境	31,000	131,130.00	0.00
384	000537	中绿电	13,700	130,561.00	0.00
385	000898	鞍钢股份	61,400	130,168.00	0.00
386	600377	宁沪高速	10,300	129,780.00	0.00
387	300888	稳健医疗	5,120	129,536.00	0.00
388	688107	安路科技	4,977	126,515.34	0.00
389	688002	睿创微纳	4,483	125,389.51	0.00
390	603728	鸣志电器	3,100	124,713.00	0.00
391	600316	洪都航空	7,485	124,475.55	0.00
392	000032	深桑达 A	8,300	124,334.00	0.00
393	600126	杭钢股份	30,210	124,163.10	0.00
394	601965	中国汽研	7,300	123,297.00	0.00
395	603233	大参林	8,610	123,123.00	0.00
396	600098	广州发展	19,200	122,880.00	0.00
397	600481	双良节能	25,900	120,953.00	0.00
398	600339	中油工程	38,600	120,432.00	0.00
399	600095	湘财股份	20,100	119,796.00	0.00
400	600416	湘电股份	12,000	119,280.00	0.00
401	600808	马钢股份	59,001	119,182.02	0.00
402	600578	京能电力	36,700	118,908.00	0.00
403	688561	奇安信	5,010	118,336.20	0.00
404	300212	易华录	7,000	117,810.00	0.00
405	603707	健友股份	9,778	116,162.64	0.00
406	603218	日月股份	11,100	113,997.00	0.00
407	603456	九洲药业	8,300	113,876.00	0.00
408	688779	五矿新能	24,511	113,485.93	0.00
409	002153	石基信息	19,742	113,121.66	0.00
410	002867	周大生	8,650	112,969.00	0.00
411	600299	安迪苏	11,600	112,520.00	0.00
412	601228	广州港	36,800	112,240.00	0.00
413	002563	森马服饰	19,300	112,133.00	0.00
414	000959	首钢股份	41,100	111,792.00	0.00
415	601568	北元集团	28,800	106,848.00	0.00
416	603893	瑞芯微	1,800	106,506.00	0.00
417	688248	南网科技	3,477	103,023.51	0.00
418	603688	石英股份	3,450	102,154.50	0.00
419	688099	晶晨股份	1,718	101,911.76	0.00
420	000401	冀东水泥	25,031	101,625.86	0.00
421	600500	中化国际	28,581	99,747.69	0.00
422	603056	德邦股份	7,600	99,560.00	0.00

423	688475	萤石网络	2,879	98,202.69	0.00
424	600928	西安银行	29,500	96,465.00	0.00
425	600361	创新新材	23,800	95,914.00	0.00
426	301267	华夏眼科	4,600	95,312.00	0.00
427	001872	招商港口	4,900	94,325.00	0.00
428	000785	居然之家	38,400	93,312.00	0.00
429	603317	天味食品	8,150	92,991.50	0.00
430	601139	深圳燃气	13,590	90,781.20	0.00
431	000563	陕国投 A	32,400	89,100.00	0.00
432	001203	大中矿业	9,200	88,412.00	0.00
433	600155	华创云信	14,900	88,059.00	0.00
434	002518	科士达	4,900	86,730.00	0.00
435	600927	永安期货	6,900	76,935.00	0.00
436	603868	飞科电器	2,000	76,800.00	0.00
437	600764	中国海防	3,700	72,631.00	0.00
438	688172	燕东微	4,384	70,933.12	0.00
439	000031	大悦城	29,500	69,030.00	0.00
440	688295	中复神鹰	3,352	68,045.60	0.00
441	601158	重庆水务	13,600	65,280.00	0.00
442	002945	华林证券	6,400	63,872.00	0.00
443	601828	美凯龙	24,300	61,965.00	0.00
444	300861	美畅股份	3,200	61,920.00	0.00
445	600956	新天绿能	7,500	61,275.00	0.00
446	002850	科达利	800	61,104.00	0.00
447	601858	中国科传	2,900	55,448.00	0.00
448	301029	怡合达	2,400	47,184.00	0.00
449	300776	帝尔激光	900	41,364.00	0.00
450	301165	锐捷网络	1,200	35,808.00	0.00
451	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
452	600563	法拉电子	386	29,405.48	0.00
453	600032	浙江新能	3,800	27,664.00	0.00
454	603826	坤彩科技	840	24,334.80	0.00
455	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
456	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
457	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
458	002791	坚朗五金	600	15,522.00	0.00
459	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
460	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
461	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
462	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
463	400174	中天 3	95,400	13,356.00	0.00
464	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
465	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00

466	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
467	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
468	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
469	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
470	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
471	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
472	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
473	688006	杭可科技	381	6,648.45	0.00
474	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
475	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
476	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
477	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
478	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
479	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
480	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
481	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
482	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
483	603375	盛景微	72	2,800.80	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	300502	新易盛	1,571,096.00	0.02
2	601058	赛轮轮胎	644,760.00	0.01
3	601168	西部矿业	622,236.00	0.01
4	300394	天孚通信	590,311.00	0.01
5	600066	宇通客车	580,161.00	0.01
6	600160	巨化股份	572,030.00	0.01
7	688099	晶晨股份	515,502.49	0.01
8	688777	中控技术	512,709.92	0.01
9	600988	赤峰黄金	484,951.00	0.01
10	300207	欣旺达	465,561.00	0.01
11	600157	永泰能源	460,845.00	0.01
12	601077	渝农商行	457,380.00	0.01
13	601567	三星医疗	438,763.00	0.01
14	002517	恺英网络	429,107.00	0.00
15	603606	东方电缆	428,072.00	0.00
16	301236	软通动力	426,716.00	0.00
17	601555	东吴证券	415,170.00	0.00
18	600563	法拉电子	407,167.00	0.00

19	601233	桐昆股份	406,422.00	0.00
20	603939	益丰药房	404,655.00	0.00

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002463	沪电股份	1,055,065.00	0.01
2	002422	科伦药业	954,704.00	0.01
3	600160	巨化股份	835,395.00	0.01
4	600161	天坛生物	708,349.00	0.01
5	300418	昆仑万维	707,868.00	0.01
6	600415	小商品城	648,771.00	0.01
7	000975	山金国际	626,196.36	0.01
8	600482	中国动力	587,003.00	0.01
9	688072	拓荆科技	488,355.24	0.01
10	688692	达梦数据	429,544.79	0.00
11	002600	领益智造	372,989.00	0.00
12	688082	盛美上海	307,438.29	0.00
13	301565	中仑新材	294,805.60	0.00
14	301589	诺瓦星云	262,351.00	0.00
15	002131	利欧股份	256,311.65	0.00
16	000547	航天发展	213,051.50	0.00
17	688709	成都华微	206,891.60	0.00
18	000970	中科三环	204,063.40	0.00
19	002092	ST 中泰	201,314.00	0.00
20	000581	威孚高科	199,382.00	0.00

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	64,598,153.35
卖出股票收入（成交）总额	30,026,939.85

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	256,761,088.60	3.26
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	256,761,088.60	3.26

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	019733	24 国债 02	760,000	76,815,532.05	0.97
2	019727	23 国债 24	550,000	56,000,472.61	0.71
3	019698	23 国债 05	402,000	40,692,587.67	0.52
4	019693	22 国债 28	196,000	19,907,623.34	0.25
5	019740	24 国债 09	151,000	15,151,621.31	0.19

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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	占基金资
----	------	------	------	-----	------	------

					(人民币 元)	产净值比 例 (%)
1	南方中证 500ETF	股票型	交易型开 放式	南方基金 管理股份 有限公司	7,361,565,3 27.32	93.42

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

无。

7.12.2 本期国债期货投资评价

无。

7.13 投资组合报告附注

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

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

7.13.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。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没有超出基金合同规定的备选股票库，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	210,925.52
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,932,179.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	7,143,105.48
---	----	--------------

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

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
南方中证 500ETF 联 接(LOF) A	614,912	8,539.91	121,790,294 .82	2.32%	5,129,503,6 13.41	97.68%
南方中证 500ETF 联 接(LOF) C	36,633	11,350.66	144,685,053 .14	34.80%	271,123,823 .86	65.20%
南方中证 500ETF 联 接(LOF) I	113	16,093.38	-	-	1,818,551.6 5	100.00%
合计	651,658	8,699.23	266,475,347 .96	4.70%	5,402,445,9 88.92	95.30%

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 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	于永祥	926,627.00	1.23%
2	蒋颖	721,200.00	0.96%
3	薛宜平	638,396.00	0.85%
4	杨钢	551,900.00	0.73%
5	姚红伟	500,000.00	0.67%
6	李鹏	471,000.00	0.63%

7	黄小华	452,284.00	0.60%
8	郑凯鹏	429,355.00	0.57%
9	解强	369,400.00	0.49%
10	易志发	362,648.00	0.48%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方中证 500ETF 联接（LOF）A	3,040,642.63	0.0579%
	南方中证 500ETF 联接（LOF）C	134,342.74	0.0323%
	南方中证 500ETF 联接（LOF）I	11,778.32	0.6477%
	合计	3,186,763.69	0.0562%

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）。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方中证 500ETF 联	南方中证 500ETF 联	南方中证 500ETF 联
----	---------------	---------------	---------------

	接 (LOF) A	接 (LOF) C	接 (LOF) I
基金合同生效日 (2009 年 9 月 25 日)基金 份额总额	3,223,217,818.45	-	-
本报告期期初基金份 额总额	5,317,265,946.34	461,343,451.74	-
本报告期基金总申购 份额	494,741,306.37	476,086,794.97	1,853,291.13
减: 报告期基金总赎 回份额	560,713,344.48	521,621,369.71	34,739.48
本报告期期间基金拆 分变动份额 (份额减 少以 "-" 填列)	-	-	-
本报告期期末基金份 额总额	5,251,293,908.23	415,808,877.00	1,818,551.65

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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	
国泰君安	1	53,034,857.75	57.10%	5,303.61	57.10%	-
中泰证券	1	22,909,219.68	24.66%	2,291.01	24.66%	-
华泰证券	2	16,941,773.40	18.24%	1,694.00	18.24%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确

3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

C：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
国泰君安	101,317,617.48	43.93%	815,000,000.00	75.96%	-	-	487,245,128.44	62.72%
中泰证券	129,293,168.13	56.07%	258,000,000.00	24.04%	-	-	289,603,638.85	37.28%
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-02
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-24
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资	中国证券报、基金管	2024-03-29

	关联方承销证券的关联交易公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分指数基金增设 I 类基金份额并修订基金合同的公告	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	2024-04-04
5	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)I 类基金份额开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	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	2024-04-08
6	南方基金关于开展旗下部分基金销售费率优惠活动公告	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	2024-04-09
7	南方基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金申购和定投业务金额限制的公告	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	2024-04-23
8	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-30
9	南方基金管理股份有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	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	2024-06-20

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的文件；
- 2、《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》；
- 3、《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；

6、《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)2024 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>