

南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 2020 年中期报告

2020 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：2020 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 2020 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 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.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	54
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.....	54
7.10 本报告期投资基金情况.....	54

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.13 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末上市基金前十名持有人	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§9 开放式基金份额变动	57
§10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 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	南方 500	
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	7,205,834,278.30 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
下属分级基金的场内简称	南方 500	
下属分级基金的交易代码	160119	004348
下属分级基金的前端交易代码	160119	160119
下属分级基金的后端交易代码	160120	160120
报告期末下属分级基金的份额总额	5,922,306,338.25 份	1,283,527,940.05 份

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方 500”。

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

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“500ETF”或“中证 500ETF”。

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，其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	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	贺倩
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.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益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码	518017	100031
法定代表人	张海波	周慕冰

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(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	253,764,153.99
本期利润	1,162,782,030.81
加权平均基金份额本期利润	0.1752
本期加权平均净值利润率	12.63%
本期基金份额净值增长率	11.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,975,956,233.70
期末可供分配基金份额利润	0.5024
期末基金资产净值	8,898,262,571.95
期末基金份额净值	1.5025
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	63.93%

2、南方中证 500ETF 联接 (LOF) C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	51,271,320.42
本期利润	231,883,520.03
加权平均基金份额本期利润	0.1589
本期加权平均净值利润率	11.54%
本期基金份额净值增长率	11.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	628,594,319.97
期末可供分配基金份额利润	0.4897
期末基金资产净值	1,912,122,260.02
期末基金份额净值	1.4897
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 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。

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 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	8.85%	0.85%	8.04%	0.84%	0.81%	0.01%
过去三个月	16.72%	1.08%	15.47%	1.08%	1.25%	0.00%
过去六个月	11.58%	1.70%	10.84%	1.70%	0.74%	0.00%
过去一年	19.39%	1.39%	17.63%	1.39%	1.76%	0.00%
过去三年	-0.53%	1.39%	-3.83%	1.39%	3.30%	0.00%

自基金合同 生效起至今	63.93%	1.61%	64.98%	1.61%	-1.05%	0.00%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

南方中证 500ETF 联接 (LOF) C

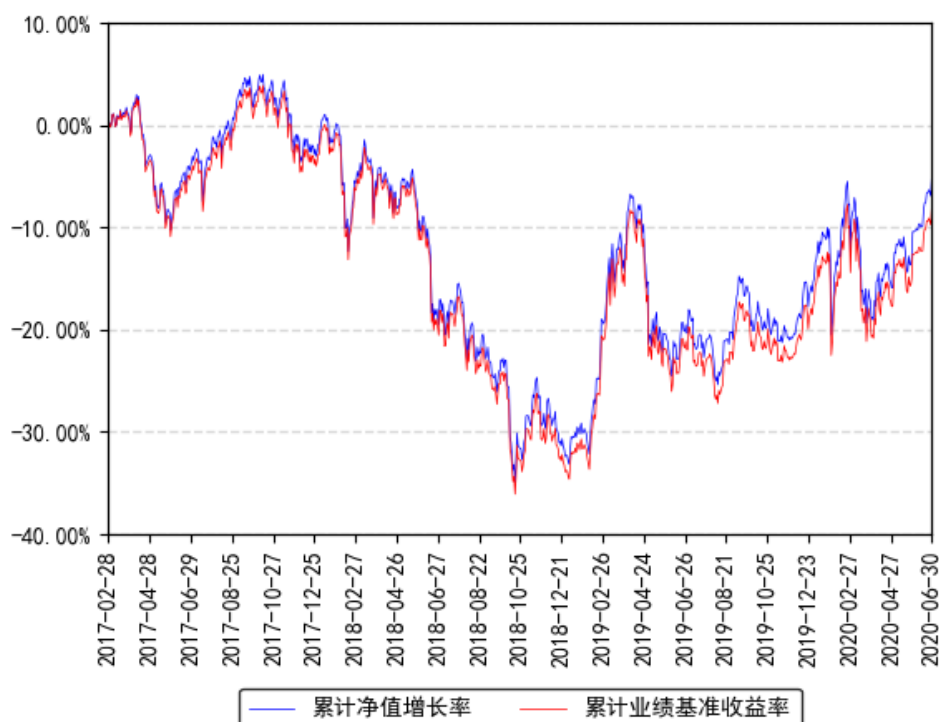
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	8.81%	0.85%	8.04%	0.84%	0.77%	0.01%
过去三个月	16.60%	1.08%	15.47%	1.08%	1.13%	0.00%
过去六个月	11.35%	1.71%	10.84%	1.70%	0.51%	0.01%
过去一年	18.91%	1.39%	17.63%	1.39%	1.28%	0.00%
过去三年	-1.72%	1.39%	-3.83%	1.39%	2.11%	0.00%
自基金合同 生效起至今	-5.31%	1.35%	-8.24%	1.35%	2.93%	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



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。

§ 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。2019年7月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为36172万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司41.16%、深圳市投资控股有限公司27.44%、厦门国际信托有限公司13.72%、兴业证券股份有限公司9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)2.20%。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。

截至报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 10000 亿元，旗下管理 220 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

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	-	15 年	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；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；2014 年 10 月 30 日至今，任 500 医药基金经理；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。

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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 3 次，是由于接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

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 指数上涨 11.33%。

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（包括调出指数成分股）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 1.5025 元, 报告期内, 份额净值增长率为 11.58%, 同期业绩基准增长率为 10.84%; 本基金 C 份额净值为 1.4897 元, 报告期内, 份额净值增长率为 11.35%, 同期业绩基准增长率为 10.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年受疫情影响, 全球经济放缓, 但 A 股显示较强韧性, 境内外对 A 股配置关注度提升。展望下半年, 海内外货币政策保持宽松, 随着全球复工, 经济逐渐回暖, 国内资本市场加速开放, 预期中长期资金持续流入。大中华地区权益市场不少优质资产, 凸显长期配置价值。

本基金为指数基金, 作为基金管理人, 我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨, 力求实现对标的指数的有效跟踪, 为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格, 借助投资本基金参与市场。

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、指数投资部总经理、现金投资部总经理、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

本基金基金合同约定，由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。同一类别每一基金份额享有同等分配权；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多 6 次，每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

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《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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日基金的投资运作，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《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《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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	162,533,826.88	371,455,471.52
结算备付金		5,441,463.23	2,088,390.14
存出保证金		1,046,472.46	459,544.14
交易性金融资产	6.4.3.2	10,863,218,900.28	11,109,595,499.35
其中：股票投资		152,047,593.95	156,021,583.73
基金投资		10,318,052,550.03	10,717,787,794.32
债券投资		393,118,756.30	235,786,121.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		164,248,613.98	6,738,502.70
应收利息	6.4.3.5	7,468,823.03	4,639,294.63
应收股利		-	-
应收申购款		40,773,427.62	14,608,953.98

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	14,600,169.41	2,505,708.00
资产总计		11,259,331,696.89	11,512,091,364.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		210,000,000.00	45,000,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		237,447,917.07	52,534,486.91
应付管理人报酬		206,498.35	275,611.56
应付托管费		41,299.70	55,122.29
应付销售服务费		608,650.59	627,311.66
应付交易费用	6.4.3.7	72,057.95	20,299.63
应交税费		2.92	6.50
应付利息		-	-3,301.67
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	570,438.34	441,232.94
负债合计		448,946,864.92	98,950,769.82
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	7,205,834,278.30	8,486,018,807.14
未分配利润	6.4.3.10	3,604,550,553.67	2,927,121,787.50
所有者权益合计		10,810,384,831.97	11,413,140,594.64
负债和所有者权益总计		11,259,331,696.89	11,512,091,364.46

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，南方中证 500ETF 联接(LOF)A 份额净值 1.5025 元，基金份额总额 5,922,306,338.25 份；南方中证 500ETF 联接(LOF)C 份额净值 1.4897 元，基金份额总额 1,283,527,940.05 份；总份额合计 7,205,834,278.30 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		1,404,808,004.16	947,917,432.00
1. 利息收入		7,589,442.86	3,898,992.51
其中：存款利息收入	6.4.3.11	3,555,328.71	2,289,666.05
债券利息收入		4,034,114.15	1,609,326.46
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		297,652,585.17	-88,215,275.84
其中：股票投资收益	6.4.3.12	45,624,181.03	26,337,793.66
基金投资收益	6.4.3.13	251,242,096.11	-115,324,017.82
债券投资收益	6.4.3.14	-226,992.17	-516,874.07
资产支持证券投资	6.4.3.15	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.3.16	-	-
衍生工具收益	6.4.3.17	-	-
股利收益	6.4.3.18	1,013,300.20	1,287,822.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.19	1,089,630,076.43	1,022,179,326.53
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.20	9,935,899.70	10,054,388.80
减：二、费用		10,142,453.32	9,329,116.87
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	1,627,440.73	1,598,598.67

2. 托管费	6. 4. 6. 2. 2	325, 488. 22	319, 719. 71
3. 销售服务费	6. 4. 6. 2. 3	4, 001, 630. 16	3, 089, 862. 16
4. 交易费用	6. 4. 3. 21	2, 750, 560. 19	3, 614, 131. 23
5. 利息支出		1, 173, 095. 78	527, 644. 16
其中：卖出回购金融资产支出		1, 173, 095. 78	527, 644. 16
6. 税金及附加		0. 30	0. 53
7. 其他费用	6. 4. 3. 22	264, 237. 94	179, 160. 41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1, 394, 665, 550. 84	938, 588, 315. 13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1, 394, 665, 550. 84	938, 588, 315. 13

6.3 所有者权益（基金净值）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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	8, 486, 018, 807. 14	2, 927, 121, 787. 50	11, 413, 140, 594. 64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1, 394, 665, 550. 84	1, 394, 665, 550. 84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1, 280, 184, 528. 84	-717, 236, 784. 67	-1, 997, 421, 313. 51
其中：1. 基金申购款	4, 720, 081, 827. 76	1, 642, 594, 407. 33	6, 362, 676, 235. 09
2. 基金赎回款	-6, 000, 266, 356. 60	-2, 359, 831, 192. 00	-8, 360, 097, 548. 60
四、本期向基金份额持有人分配利润产生	-	-	-

的基金净值变动（净值减少以“—”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	7,205,834,278.30	3,604,550,553.67	10,810,384,831.97
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	6,138,478,178.78	408,910,434.47	6,547,388,613.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	938,588,315.13	938,588,315.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“—”号填列）	2,848,157,262.81	968,656,593.84	3,816,813,856.65
其中：1. 基金申购款	9,076,448,118.02	2,876,610,073.51	11,953,058,191.53
2. 基金赎回款	-6,228,290,855.21	-1,907,953,479.67	-8,136,244,334.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“—”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	8,986,635,441.59	2,316,155,343.44	11,302,790,785.03

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____ ____徐超____ ____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 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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 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。

6.4.2.2 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。

6.4.2.3 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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	162,533,826.88
定期存款	-
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	-
合计	162,533,826.88

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	147,959,432.05	152,047,593.95	4,088,161.90
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	394,618,266.07	393,118,756.30
	银行间市场	-	-
	合计	394,618,266.07	393,118,756.30
资产支持证券	-	-	-
基金	9,082,936,513.13	10,318,052,550.03	1,235,116,036.90
其他	-	-	-
合计	9,625,514,211.25	10,863,218,900.28	1,237,704,689.03

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。本基金可采用全现金替代申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF份额的买卖。

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 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。

6.4.3.4.2 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。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	112,150.83
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,203.83
应收债券利息	7,354,044.56
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	423.81
合计	7,468,823.03

6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	-
可收退补款	11,835,046.00
应收退补款	2,765,123.41
合计	14,600,169.41

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	72,057.95
银行间市场应付交易费用	-
合计	72,057.95

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	401,367.62
应付证券出借违约金	-
应退替代款	-
预提费用	169,070.72
应付指数使用费	-
可退替代款	-
其他	-
合计	570,438.34

注:1. 可退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时, 替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

2. 应退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时, 替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

6.4.3.9 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	6,904,911,915.32	6,904,911,915.32
本期申购	3,624,394,383.91	3,624,394,383.91
本期赎回 (以“-”号填列)	-4,606,999,960.98	-4,606,999,960.98
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	5,922,306,338.25	5,922,306,338.25

南方中证 500ETF 联接(LOF)C		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,581,106,891.82	1,581,106,891.82
本期申购	1,095,687,443.85	1,095,687,443.85
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,393,266,395.62	-1,393,266,395.62
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	1,283,527,940.05	1,283,527,940.05

注:

1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.3.10 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	5,847,348,005.73	-3,454,316,328.10	2,393,031,677.63
本期利润	253,764,153.99	909,017,876.82	1,162,782,030.81
本期基金份额交易产生的变动数	-859,249,910.68	279,392,435.94	-579,857,474.74
其中：基金申购款	3,125,589,180.69	-1,876,077,370.17	1,249,511,810.52
基金赎回款	-3,984,839,091.37	2,155,469,806.11	-1,829,369,285.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,241,862,249.04	-2,265,906,015.34	2,975,956,233.70

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	1,326,192,191.94	-792,102,082.07	534,090,109.87
本期利润	51,271,320.42	180,612,199.61	231,883,520.03
本期基金份额交易产生的变动数	-255,653,189.90	118,273,879.97	-137,379,309.93
其中：基金申购款	933,356,745.37	-540,274,148.56	393,082,596.81
基金赎回款	-1,189,009,935.27	658,548,028.53	-530,461,906.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,121,810,322.46	-493,216,002.49	628,594,319.97

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,434,248.47
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	63,638.22
其他	57,442.02
合计	3,555,328.71

6.4.3.12 股票投资收益

6.4.3.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	45,579,046.17
股票投资收益——赎回差价收入	-

股票投资收益——申购差价收入	45,134.86
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	45,624,181.03

6.4.3.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,033,287,605.32
减：卖出股票成本总额	1,987,708,559.15
买卖股票差价收入	45,579,046.17

6.4.3.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

6.4.3.12.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	1,375,691,160.00
减：现金支付申购款总额	746,812,344.74
减：申购股票成本总额	628,833,680.40
申购差价收入	45,134.86

6.4.3.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

6.4.3.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	3,619,906,233.47
减：卖出/赎回基金成本总额	3,368,664,137.36
基金投资收益	251,242,096.11

6.4.3.14 债券投资收益

6.4.3.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-226,992.17
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	-226,992.17

6.4.3.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	239,348,747.27
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	233,054,575.20
减：应收利息总额	6,521,164.24
买卖债券差价收入	-226,992.17

6.4.3.14.3 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。

6.4.3.14.4 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。

6.4.3.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.3.16 贵金属投资收益**6.4.3.16.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.3.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.3.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.3.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.3.17 衍生工具收益**6.4.3.17.1 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。

6.4.3.17.2 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。

6.4.3.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,013,300.20
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	1,013,300.20

6.4.3.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	1,089,630,076.43
——股票投资	-7,627,254.09
——债券投资	-1,659,593.88
——资产支持证券投资	-
——基金投资	1,098,916,924.40
——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	1,089,630,076.43

6.4.3.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	9,917,117.19
基金转换费收入	18,782.51
合计	9,935,899.70

注：1 本基金的 A 类基金份额的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产；C 类基金份额的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中 A 类基金份额场内部分的赎回费率为 0.5%，场外部分的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产；C 类基金份额的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入基金资产。

6.4.3.21 交易费用

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,653,765.98
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	96,794.21
其中：申购费	-

赎回费	-
场内交易费	21,824.35
其他	74,969.86
合计	2,750,560.19

6.4.3.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	79,563.12
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	25,167.22
上市费	29,835.26
其他	70,000.00
合计	264,237.94

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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、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	基金管理人的股东、基金销售机构
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	388,630,833.64	12.98%	42,383,960.09	0.72%

6.4.6.1.2 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。

6.4.6.1.3 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。

6.4.6.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	38,866.27	12.99%	11,866.12	16.47%
关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	4,238.88	0.72%	2,754.22	1.05%

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还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.6.2 关联方报酬**6.4.6.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,627,440.73	1,598,598.67
其中：支付销售机构的客户维护费	2,846,249.32	1,656,395.06

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。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	325,488.22	319,719.71

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。支付基金托管人中国农业银行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：

日托管费=(前一日基金资产净值-前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产)×0.10%/当年天数。

6.4.6.2.3 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	合计
华泰证券	-	4,723.68	4,723.68
南方基金	-	3,387,980.12	3,387,980.12
合计	-	3,392,703.80	3,392,703.80
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	合计
华泰证券	-	2,578.33	2,578.33
南方基金	-	2,681,492.89	2,681,492.89
合计	-	2,684,071.22	2,684,071.22

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

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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**6.4.6.4.1 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。

6.4.6.4.2 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。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	南方中证 500ETF 联接(LOF)A			
	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
南方资本管理有限公司	3,722,818.14	0.05%	-	-

6.4.6.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	162,533,826.88	3,434,248.47	737,343,459.86	2,068,140.54

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.6.7 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
兴业证券股	000750	国海证券	网上申购	32,310	105,007.50

份有限公司					
-------	--	--	--	--	--

上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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
兴业证券股份有限公司	000750	-	-	-	-

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2020 年 06 月 30 日，本基金持有 1,609,529,927.00 份目标 ETF 基金份额，占其份额的比例为 26.83%(于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有 1,877,777,002.00 份目标 ETF 基金份额，占其份额的比例为 24.06%)。

6.4.7 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.8 期末（2020 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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	可流通日	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
002500	山西证券	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 10 日	配股未上市	5.00	6.54	1,614	8,070.00	10,555.56	-
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 9 日	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688027	国盾量子	2020 年	2020 年	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-

		6 月 30 日	7 月 9 日	上市						
688208	道通科技	2020 年 2 月 6 日	2020 年 8 月 13 日	科创板新股锁定期	24.36	54.23	14,165	345,059.40	768,167.95	-
688277	天智航	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 7 日	新股未上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688365	光云科技	2020 年 4 月 22 日	2020 年 10 月 29 日	科创板新股锁定期	10.80	43.22	8,249	89,089.20	356,521.78	-
688520	神州细胞	2020 年 6 月 11 日	2020 年 12 月 22 日	科创板新股锁定期	25.64	58.82	12,351	316,679.64	726,485.82	-
688568	中科星图	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688600	皖仪科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 3 日	新股未上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-

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	可流通日	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
128115	巨星转债	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 16 日	配债未上市	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.00	-

注：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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.8.2 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
002470	*ST 金正	2020 年 6 月 30 日	重大事项停牌	2.27	2020 年 7 月 1 日	2.16	104,000	314,195.14	236,080.00	-
601880	大连	2020 年 6 月 22 日	重大事项	1.72	2020 年 7 月	1.89	376,060	646,424.56	646,823.20	-

	港		停牌		月 8 日					
--	---	--	----	--	----------	--	--	--	--	--

本基金截至 2020 年 06 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 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。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本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 210,000,000.00 元，截至 2020 年 7 月 1 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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。

6.4.8.4 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。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 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。本基金为被动式指数型基金，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之内。

6.4.9.2 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中国农业银行，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，违约风险可能性很小；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资产净值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。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.0000% (2019 年 12 月 31 日：0.001%)。

6.4.9.3 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可随时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每日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 2020 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 210,000,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.3.1 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，如根据基金合同的规定，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得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 06 月 30 日，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为 0.03%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 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，确保每日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 2020 年 06 月 30 日，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，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逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，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。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资和应收申购款等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	162,533,826.88	-	-	-	162,533,826.88
结算备付金	5,441,463.23	-	-	-	5,441,463.23
存出保证金	1,046,472.46	-	-	-	1,046,472.46
交易性金融资产	393,115,756.30	-	3,000.00	10,470,100.143.98	10,863,218,900.28
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	7,468,823.03	7,468,823.03
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	2,439,818.41	-	-	38,333,609.21	40,773,427.62
应收证券清算款	-	-	-	164,248,613.98	164,248,613.98
其他资产	-	-	-	14,600,169.41	14,600,169.41
资产总计	564,577,337.28	-	3,000.00	10,694,751,359.61	11,259,331,696.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	237,447,917.07	237,447,917.07
应付管理人报酬	-	-	-	206,498.35	206,498.35
应付托管费	-	-	-	41,299.70	41,299.70
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	210,000,000.00	-	-	-	210,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	608,650.59	608,650.59
应付交易费	-	-	-	72,057.95	72,057.95

用					
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2.92	2.92
其他负债	-	-	-	570,438.34	570,438.34
负债总计	210,000,000.00	-	-	238,946,864.92	448,946,864.92
利率敏感度缺口	354,577,337.28	-	3,000.00	10,455,804,494.69	10,810,384,831.97
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	371,455,471.52	-	-	-	371,455,471.52
结算备付金	2,088,390.14	-	-	-	2,088,390.14
存出保证金	459,544.14	-	-	-	459,544.14
交易性金融资产	235,649,121.30	-	137,000.00	10,873,809,378.05	11,109,595,499.35
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	4,639,294.63	4,639,294.63
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	1,179,091.75	-	-	13,429,862.23	14,608,953.98
应收证券清算款	-	-	-	6,738,502.70	6,738,502.70
其他资产	-	-	-	2,505,708.00	2,505,708.00
资产总计	610,831,618.85	-	137,000.00	10,901,122,745.61	11,512,091,364.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	52,534,486.91	52,534,486.91
应付管理人报酬	-	-	-	275,611.56	275,611.56
应付托管费	-	-	-	55,122.29	55,122.29
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	45,000,000.00	-	-	-	45,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	627,311.66	627,311.66
应付交易费	-	-	-	20,299.63	20,299.63

用					
应付利息	-	-	-	-3,301.67	-3,301.67
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	6.50	6.50
其他负债	-	-	-	441,232.94	441,232.94
负债总计	45,000,000.00	-	-	53,950,769.82	98,950,769.82
利率敏感度缺口	565,831,618.85	-	137,000.00	10,847,171.975.79	11,413,140.594.64

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。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 3.64%(2019 年 12 月 31 日：2.07%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 年 12 月 31 日：同)。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.3 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。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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	152,047,593.95	1.41	156,021,583.73	1.37
交易性金融资产- 基金投资	10,318,052,550.03	95.45	10,717,787,794.32	93.91
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	10,470,100,143.98	96.86	10,873,809,378.05	95.27

6.4.9.4.3.2 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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	512,913,512.61	539,034,070.43
	2.组合自身基准下降 5%	-512,913,512.61	-539,034,070.43

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 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	152,047,593.95	1.35
	其中：股票	152,047,593.95	1.35
2	基金投资	10,318,052,550.03	91.64
3	固定收益投资	393,118,756.30	3.49
	其中：债券	393,118,756.30	3.49
	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	167,975,290.11	1.49
8	其他资产	228,137,506.50	2.03
9	合计	11,259,331,696.89	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	1,090,220.00	0.01
B	采矿业	3,520,694.80	0.03
C	制造业	86,178,647.33	0.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,704,322.77	0.03
E	建筑业	2,220,605.04	0.02
F	批发和零售业	11,607,641.70	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	3,905,041.49	0.04
H	住宿和餐饮业	661,322.73	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,774,580.23	0.14
J	金融业	7,185,870.56	0.07
K	房地产业	6,865,674.45	0.06
L	租赁和商务服务业	3,400,708.55	0.03
M	科学研究和技术服务业	853,036.75	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	1,419,322.20	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	132,480.00	0.00
Q	卫生和社会工作	1,039,838.10	0.01
R	文化、体育和娱乐业	2,331,856.49	0.02
S	综合	1,155,730.76	0.01
	合计	152,047,593.95	1.41

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	600143	金发科技	114,661	1,510,085.37	0.01
2	600845	宝信软件	25,502	1,506,658.16	0.01
3	600859	王府井	27,090	1,233,949.50	0.01

4	600415	小商品城	231,000	1,124,970.00	0.01
5	600201	生物股份	39,010	1,086,038.40	0.01
6	300253	卫宁健康	45,253	1,038,103.82	0.01
7	600298	安琪酵母	19,500	964,860.00	0.01
8	600315	上海家化	20,005	958,239.50	0.01
9	603517	绝味食品	13,025	921,388.50	0.01
10	600161	天坛生物	19,583	887,697.39	0.01
11	002821	凯 莱 英	3,500	850,500.00	0.01
12	601799	星宇股份	6,621	840,867.00	0.01
13	603939	益丰药房	8,974	816,634.00	0.01
14	600521	华海药业	23,600	800,748.00	0.01
15	603712	七 一 二	20,700	794,466.00	0.01
16	688208	道通科技	14,165	768,167.95	0.01
17	600529	山东药玻	13,200	765,600.00	0.01
18	600739	辽宁成大	39,801	753,432.93	0.01
19	300002	神州泰岳	120,300	744,657.00	0.01
20	601128	常熟银行	99,124	744,421.24	0.01
21	601099	太 平 洋	234,000	741,780.00	0.01
22	600079	人福医药	27,000	734,940.00	0.01
23	688520	神州细胞	12,351	726,485.82	0.01
24	600426	华鲁恒升	39,025	689,962.00	0.01
25	603000	人 民 网	34,500	684,135.00	0.01
26	603338	浙江鼎力	8,979	680,338.83	0.01
27	603659	璞 泰 来	6,518	671,484.36	0.01
28	002127	南极电商	31,550	667,913.50	0.01
29	002152	广电运通	51,200	662,528.00	0.01
30	603883	老 百 姓	6,582	658,463.28	0.01
31	601880	大 连 港	376,060	646,823.20	0.01
32	603233	大 参 林	7,797	633,272.34	0.01
33	600158	中体产业	77,100	630,678.00	0.01
34	600699	均胜电子	26,066	620,631.46	0.01
35	600801	华新水泥	25,965	615,630.15	0.01
36	603882	金域医学	6,500	581,750.00	0.01
37	600884	杉杉股份	49,300	581,247.00	0.01
38	002030	达安基因	21,178	577,735.84	0.01
39	002382	蓝帆医疗	19,100	575,101.00	0.01
40	603858	步长制药	19,500	562,575.00	0.01
41	000564	供销大集	123,900	556,311.00	0.01
42	002572	索 菲 亚	22,700	548,659.00	0.01
43	600486	扬农化工	6,500	536,250.00	0.00
44	600410	华胜天成	39,000	530,400.00	0.00
45	600895	张江高科	26,000	529,620.00	0.00
46	600511	国药股份	13,018	529,442.06	0.00

47	600380	健 康 元	32,533	528,335.92	0.00
48	002385	大 北 农	57,900	527,469.00	0.00
49	002603	以岭药业	16,800	523,992.00	0.00
50	600885	宏发股份	13,059	523,927.08	0.00
51	002185	华天科技	38,500	520,905.00	0.00
52	600729	重庆百货	16,577	517,533.94	0.00
53	300274	阳光电源	35,860	516,025.40	0.00
54	600879	航天电子	79,520	512,108.80	0.00
55	600804	鹏 博 士	56,800	510,064.00	0.00
56	300088	长信科技	45,500	509,600.00	0.00
57	600216	浙江医药	26,094	502,570.44	0.00
58	300009	安科生物	28,050	502,095.00	0.00
59	600642	申能股份	84,599	499,980.09	0.00
60	601233	桐昆股份	39,000	497,640.00	0.00
61	300558	贝达药业	3,500	489,930.00	0.00
62	300595	欧普康视	7,000	485,380.00	0.00
63	300012	华测检测	24,500	484,120.00	0.00
64	600132	重庆啤酒	6,597	481,581.00	0.00
65	002131	利欧股份	122,577	473,147.22	0.00
66	300285	国瓷材料	14,000	469,140.00	0.00
67	002028	思源电气	22,618	462,764.28	0.00
68	600811	东方集团	103,686	458,292.12	0.00
69	300244	迪安诊断	12,977	458,088.10	0.00
70	600166	福田汽车	252,000	453,600.00	0.00
71	002465	海格通信	35,000	452,900.00	0.00
72	002690	美亚光电	8,600	452,360.00	0.00
73	603806	福 斯 特	8,958	447,093.78	0.00
74	002439	启明星辰	10,568	444,595.76	0.00
75	002375	亚厦股份	43,400	443,548.00	0.00
76	600909	华安证券	64,606	441,258.98	0.00
77	600515	海航基础	84,000	436,800.00	0.00
78	300357	我武生物	7,000	435,750.00	0.00
79	000581	威孚高科	20,400	421,872.00	0.00
80	000519	中兵红箭	44,600	420,132.00	0.00
81	603707	健友股份	6,503	419,898.71	0.00
82	000959	首钢股份	96,500	414,950.00	0.00
83	600728	佳都科技	45,500	414,505.00	0.00
84	600325	华发股份	58,568	413,490.08	0.00
85	002387	维 信 诺	28,700	409,836.00	0.00
86	600563	法拉电子	6,623	409,301.40	0.00
87	000636	风华高科	14,000	408,660.00	0.00
88	600779	水 井 坊	6,533	407,789.86	0.00
89	000301	东方盛虹	72,800	404,768.00	0.00

90	600418	江淮汽车	45,568	402,365.44	0.00
91	000967	盈峰环境	48,600	400,950.00	0.00
92	300316	晶盛机电	16,200	400,788.00	0.00
93	601966	玲珑轮胎	19,674	397,414.80	0.00
94	300207	欣旺达	21,020	397,278.00	0.00
95	000402	金融街	59,800	397,072.00	0.00
96	002815	崇达技术	19,500	394,485.00	0.00
97	002075	沙钢股份	31,520	394,000.00	0.00
98	601005	重庆钢铁	263,500	392,615.00	0.00
99	002505	大康农业	174,400	392,400.00	0.00
100	300212	易华录	7,000	392,000.00	0.00
101	000009	中国宝安	45,569	387,792.19	0.00
102	600256	广汇能源	142,600	385,020.00	0.00
103	002223	鱼跃医疗	10,516	382,782.40	0.00
104	600460	士兰微	26,000	381,680.00	0.00
105	002183	怡亚通	71,100	381,096.00	0.00
106	300113	顺网科技	15,000	381,000.00	0.00
107	002557	洽洽食品	7,000	379,330.00	0.00
108	600446	金证股份	19,500	378,300.00	0.00
109	002507	涪陵榨菜	10,500	378,105.00	0.00
110	600167	联美控股	26,350	377,859.00	0.00
111	601168	西部矿业	65,000	377,000.00	0.00
112	600827	百联股份	26,086	376,942.70	0.00
113	002074	国轩高科	14,000	375,760.00	0.00
114	000501	鄂武商A	23,930	375,222.40	0.00
115	600718	东软集团	32,582	374,693.00	0.00
116	002242	九阳股份	10,000	372,700.00	0.00
117	002212	南洋股份	14,000	372,120.00	0.00
118	600839	四川长虹	129,536	371,768.32	0.00
119	600645	中源协和	13,059	368,916.75	0.00
120	600820	隧道股份	65,000	367,250.00	0.00
121	300482	万孚生物	3,500	364,000.00	0.00
122	002273	水晶光电	21,088	361,448.32	0.00
123	002745	木林森	23,441	361,225.81	0.00
124	600754	锦江酒店	13,001	360,777.75	0.00
125	600673	东阳光	52,027	359,506.57	0.00
126	300315	掌趣科技	49,000	359,170.00	0.00
127	600751	海航科技	114,600	358,698.00	0.00
128	600572	康恩贝	65,000	357,500.00	0.00
129	688365	光云科技	8,249	356,521.78	0.00
130	600704	物产中大	84,500	355,745.00	0.00
131	002174	游族网络	13,600	354,688.00	0.00
132	002002	鸿达兴业	98,200	354,502.00	0.00

133	600598	北 大 荒	22,000	354,200.00	0.00
134	600260	凯乐科技	25,940	350,708.80	0.00
135	002156	通富微电	14,000	350,700.00	0.00
136	300418	昆仑万维	14,000	349,440.00	0.00
137	002340	格 林 美	70,094	348,367.18	0.00
138	600528	中铁工业	39,460	348,037.20	0.00
139	600875	东方电气	39,020	345,327.00	0.00
140	000988	华工科技	14,000	342,020.00	0.00
141	600171	上海贝岭	19,500	338,910.00	0.00
142	000513	丽珠集团	7,052	338,566.52	0.00
143	600021	上海电力	45,589	337,358.60	0.00
144	002936	郑州银行	97,790	336,397.60	0.00
145	002373	千方科技	14,000	335,860.00	0.00
146	000547	航天发展	24,561	335,748.87	0.00
147	300024	机 器 人	24,500	334,915.00	0.00
148	300134	大富科技	23,900	334,122.00	0.00
149	000778	新兴铸管	97,100	333,053.00	0.00
150	600667	太极实业	28,000	330,960.00	0.00
151	002368	太极股份	7,562	330,383.78	0.00
152	000975	银泰黄金	21,060	330,220.80	0.00
153	600862	中航高科	19,500	329,940.00	0.00
154	603866	桃李面包	6,472	329,360.08	0.00
155	002399	海 普 瑞	13,100	328,024.00	0.00
156	600567	山鹰纸业	110,500	325,975.00	0.00
157	002353	杰瑞股份	10,500	325,500.00	0.00
158	000078	海王生物	77,507	324,754.33	0.00
159	000061	农 产 品	43,800	324,558.00	0.00
160	600535	天 士 力	20,000	324,400.00	0.00
161	002839	张家港行	56,300	324,288.00	0.00
162	002926	华西证券	30,500	324,215.00	0.00
163	600565	迪马股份	116,000	323,640.00	0.00
164	000738	航发控制	23,700	323,505.00	0.00
165	002317	众生药业	18,800	322,608.00	0.00
166	600959	江苏有线	85,750	322,420.00	0.00
167	000060	中金岭南	86,600	322,152.00	0.00
168	600881	亚泰集团	110,563	321,738.33	0.00
169	002019	亿帆医药	14,000	321,580.00	0.00
170	600155	华创阳安	26,800	321,332.00	0.00
171	000869	张 裕 A	9,400	321,010.00	0.00
172	603228	景旺电子	9,021	317,448.99	0.00
173	300026	红日药业	57,400	316,848.00	0.00
174	600195	中牧股份	19,500	316,485.00	0.00
175	000848	承德露露	45,206	316,442.00	0.00

176	600060	海信视像	26,000	315,900.00	0.00
177	002797	第一创业	45,500	314,860.00	0.00
178	600160	巨化股份	45,536	313,743.04	0.00
179	600064	南京高科	32,194	312,925.68	0.00
180	002414	高德红外	10,597	310,280.16	0.00
181	600094	大 名 城	52,000	309,400.00	0.00
182	300168	万达信息	14,000	308,980.00	0.00
183	600549	厦门钨业	26,040	308,313.60	0.00
184	002640	跨 境 通	47,400	307,626.00	0.00
185	600373	中文传媒	26,040	306,751.20	0.00
186	002250	联化科技	14,027	305,788.60	0.00
187	000021	深 科 技	14,000	305,620.00	0.00
188	600497	驰宏锌锗	88,700	305,128.00	0.00
189	000732	泰禾集团	59,900	304,891.00	0.00
190	300376	易 事 特	58,600	304,720.00	0.00
191	600037	歌华有线	20,000	304,000.00	0.00
192	000750	国海证券	70,010	303,843.40	0.00
193	600737	中粮糖业	39,017	303,552.26	0.00
194	000712	锦龙股份	24,200	302,500.00	0.00
195	002419	天虹股份	31,600	301,780.00	0.00
196	000062	深圳华强	20,748	301,675.92	0.00
197	601689	拓普集团	10,800	301,320.00	0.00
198	600755	厦门国贸	45,548	300,616.80	0.00
199	600258	首旅酒店	19,554	300,544.98	0.00
200	000960	锡业股份	35,000	299,600.00	0.00
201	000970	中科三环	30,400	297,312.00	0.00
202	300017	网宿科技	35,000	297,150.00	0.00
203	603816	顾家家居	6,600	297,066.00	0.00
204	300271	华宇软件	10,500	296,205.00	0.00
205	002249	大洋电机	81,900	295,659.00	0.00
206	002195	二三四五	105,058	295,212.98	0.00
207	000718	苏宁环球	95,300	294,477.00	0.00
208	002390	信邦制药	64,500	294,120.00	0.00
209	600282	南钢股份	91,000	293,930.00	0.00
210	002085	万丰奥威	45,200	292,896.00	0.00
211	600435	北方导航	38,698	292,556.88	0.00
212	600580	卧龙电驱	26,011	292,363.64	0.00
213	002233	塔牌集团	24,300	292,329.00	0.00
214	002434	万 里 扬	33,600	291,648.00	0.00
215	600153	建发股份	36,000	291,600.00	0.00
216	000998	隆平高科	17,500	291,375.00	0.00
217	600126	杭钢股份	28,010	291,304.00	0.00
218	600597	光明乳业	19,582	290,988.52	0.00

219	600022	山东钢铁	225,160	290,456.40	0.00
220	300257	开山股份	22,100	288,847.00	0.00
221	600776	东方通信	19,100	288,219.00	0.00
222	002665	首航高科	118,000	287,920.00	0.00
223	601179	中国西电	59,400	287,496.00	0.00
224	000543	皖能电力	71,120	285,902.40	0.00
225	000690	宝新能源	60,400	285,088.00	0.00
226	601118	海南橡胶	58,500	284,310.00	0.00
227	300070	碧水源	35,000	284,200.00	0.00
228	600273	嘉化能源	32,500	284,050.00	0.00
229	600777	新潮能源	186,600	283,632.00	0.00
230	000401	冀东水泥	17,531	281,197.24	0.00
231	600466	蓝光发展	52,065	280,630.35	0.00
232	000717	韶钢松山	72,900	277,020.00	0.00
233	600056	中国医药	19,568	276,887.20	0.00
234	000623	吉林敖东	17,500	275,275.00	0.00
235	300010	立思辰	14,065	275,252.05	0.00
236	601098	中南传媒	26,014	275,228.12	0.00
237	300133	华策影视	37,900	274,775.00	0.00
238	300058	蓝色光标	35,000	273,000.00	0.00
239	600039	四川路桥	71,440	272,900.80	0.00
240	300496	中科创达	3,500	271,950.00	0.00
241	600967	内蒙一机	26,032	270,472.48	0.00
242	601106	中国一重	96,200	270,322.00	0.00
243	600649	城投控股	45,500	270,270.00	0.00
244	000830	鲁西化工	36,110	269,380.60	0.00
245	000158	常山北明	25,760	268,934.40	0.00
246	000050	深天马 A	17,500	268,800.00	0.00
247	000877	天山股份	17,800	268,780.00	0.00
248	600808	马钢股份	104,001	268,322.58	0.00
249	600376	首开股份	45,540	266,864.40	0.00
250	002078	太阳纸业	28,000	266,560.00	0.00
251	000729	燕京啤酒	38,900	266,465.00	0.00
252	002191	劲嘉股份	29,800	265,518.00	0.00
253	002635	安洁科技	10,650	265,185.00	0.00
254	000878	云南铜业	24,900	264,189.00	0.00
255	000630	铜陵有色	136,500	263,445.00	0.00
256	601333	广深铁路	117,000	263,250.00	0.00
257	002503	搜于特	93,600	263,016.00	0.00
258	000039	中集集团	36,300	262,449.00	0.00
259	002092	中泰化学	57,900	262,287.00	0.00
260	002138	顺络电子	10,500	261,975.00	0.00
261	000930	中粮科技	38,300	261,589.00	0.00

262	600640	号百控股	13,031	259,968.45	0.00
263	300630	普利制药	3,500	258,825.00	0.00
264	002056	横店东磁	23,000	258,750.00	0.00
265	600643	爱建集团	32,540	258,693.00	0.00
266	600062	华润双鹤	19,557	258,543.54	0.00
267	601718	际华集团	77,600	257,632.00	0.00
268	000537	广宇发展	35,200	256,960.00	0.00
269	600053	九鼎投资	8,591	256,355.44	0.00
270	300182	捷成股份	64,200	256,158.00	0.00
271	002709	天赐材料	7,580	256,128.20	0.00
272	600633	浙数文化	26,081	255,072.18	0.00
273	002110	三钢闽光	38,200	254,412.00	0.00
274	600120	浙江东方	36,672	251,936.64	0.00
275	300072	三聚环保	58,800	251,664.00	0.00
276	601866	中远海发	136,500	251,160.00	0.00
277	002203	海亮股份	28,600	250,250.00	0.00
278	002013	中航机电	31,500	248,850.00	0.00
279	600026	中远海能	38,500	248,710.00	0.00
280	002396	星网锐捷	7,000	247,310.00	0.00
281	002920	德赛西威	4,000	245,320.00	0.00
282	000739	普洛药业	10,500	244,545.00	0.00
283	002491	通鼎互联	47,406	242,718.72	0.00
284	600008	首创股份	80,400	242,004.00	0.00
285	300115	长盈精密	10,583	241,821.55	0.00
286	603077	和邦生物	182,020	240,266.40	0.00
287	000090	天健集团	34,556	238,781.96	0.00
288	002653	海思科	8,965	238,558.65	0.00
289	300251	光线传媒	21,800	237,838.00	0.00
290	600266	城建发展	46,852	237,539.64	0.00
291	600863	内蒙华电	96,300	236,898.00	0.00
292	601717	郑煤机	40,192	236,730.88	0.00
293	002470	*ST 金正	104,000	236,080.00	0.00
294	300324	旋极信息	35,368	235,550.88	0.00
295	300474	景嘉微	3,500	235,550.00	0.00
296	002051	中工国际	32,222	234,576.16	0.00
297	002511	中顺洁柔	10,500	234,150.00	0.00
298	002670	国盛金控	25,563	233,901.45	0.00
299	000987	越秀金控	20,000	233,200.00	0.00
300	002004	华邦健康	43,300	232,954.00	0.00
301	002867	周大生	10,500	232,785.00	0.00
302	000600	建投能源	45,500	231,595.00	0.00
303	600733	北汽蓝谷	36,000	231,480.00	0.00
304	601000	唐山港	103,619	231,070.37	0.00

305	002589	瑞康医药	43,080	230,908.80	0.00
306	000681	视觉中国	12,400	230,888.00	0.00
307	600500	中化国际	45,581	230,639.86	0.00
308	601975	招商南油	96,300	230,157.00	0.00
309	002281	光迅科技	7,000	230,020.00	0.00
310	300197	铁汉生态	90,450	229,743.00	0.00
311	600823	世茂股份	51,200	228,864.00	0.00
312	600388	龙净环保	26,000	228,800.00	0.00
313	600392	盛和资源	32,410	228,490.50	0.00
314	002268	卫 士 通	10,594	226,075.96	0.00
315	000997	新 大 陆	14,040	224,359.20	0.00
316	600908	无锡银行	45,500	223,405.00	0.00
317	300001	特 锐 德	10,588	221,712.72	0.00
318	002038	双鹭药业	17,225	220,652.25	0.00
319	000400	许继电气	16,700	220,440.00	0.00
320	600835	上海机电	13,001	220,106.93	0.00
321	000089	深圳机场	28,600	219,076.00	0.00
322	002807	江阴银行	55,680	218,822.40	0.00
323	000983	西山煤电	58,000	217,500.00	0.00
324	601699	潞安环能	39,000	217,230.00	0.00
325	300618	寒锐钴业	3,500	217,070.00	0.00
326	002080	中材科技	14,000	217,000.00	0.00
327	000028	国药一致	4,811	216,543.11	0.00
328	001914	招商积余	7,000	215,110.00	0.00
329	002831	裕同科技	7,766	213,642.66	0.00
330	603568	伟明环保	9,146	212,187.20	0.00
331	600782	新钢股份	52,000	212,160.00	0.00
332	300180	华峰超纤	24,600	210,576.00	0.00
333	600409	三友化工	45,171	210,496.86	0.00
334	600639	浦东金桥	13,085	209,098.30	0.00
335	002294	信 立 泰	7,000	207,620.00	0.00
336	000686	东北证券	24,500	207,025.00	0.00
337	002372	伟星新材	17,780	206,781.40	0.00
338	600316	洪都航空	13,085	206,743.00	0.00
339	000999	华润三九	7,075	206,519.25	0.00
340	000598	兴蓉环境	44,500	204,700.00	0.00
341	000937	冀中能源	67,700	204,454.00	0.00
342	600566	济川药业	8,000	203,680.00	0.00
343	002925	盈趣科技	3,500	202,790.00	0.00
344	002416	爱 施 德	28,170	202,260.60	0.00
345	000825	太钢不锈	60,800	201,856.00	0.00
346	600970	中材国际	38,154	201,453.12	0.00
347	600507	方大特钢	38,785	201,294.15	0.00

348	601958	金钼股份	32,500	200,850.00	0.00
349	601608	中信重工	58,500	200,070.00	0.00
350	600765	中航重机	19,522	199,514.84	0.00
351	603486	科 沃 斯	6,558	198,117.18	0.00
352	601228	广 州 港	65,000	197,600.00	0.00
353	600259	广晟有色	6,583	197,490.00	0.00
354	600138	中 青 旅	19,585	193,303.95	0.00
355	002064	华峰氨纶	38,100	193,167.00	0.00
356	600312	平高电气	26,032	193,157.44	0.00
357	000012	南 玻 A	38,465	193,094.30	0.00
358	000553	安道麦 A	21,400	193,028.00	0.00
359	002081	金 螳 螂	24,500	192,570.00	0.00
360	300296	利 亚 德	31,500	191,205.00	0.00
361	000800	一汽解放	17,500	187,950.00	0.00
362	002155	湖南黄金	23,800	187,544.00	0.00
363	000883	湖北能源	53,000	186,560.00	0.00
364	002500	山西证券	28,514	186,481.56	0.00
365	000807	云铝股份	42,500	185,300.00	0.00
366	600073	上海梅林	19,500	185,055.00	0.00
367	002221	东华能源	21,000	184,590.00	0.00
368	000563	陕国投 A	49,570	183,904.70	0.00
369	600648	外 高 桥	13,000	183,820.00	0.00
370	002217	合 力 泰	35,000	183,750.00	0.00
371	600478	科 力 远	39,000	183,690.00	0.00
372	000528	柳 工	29,011	183,059.41	0.00
373	002093	国脉科技	20,600	182,310.00	0.00
374	002583	海 能 达	24,000	182,160.00	0.00
375	000027	深圳能源	39,220	181,980.80	0.00
376	000559	万向钱潮	37,500	181,500.00	0.00
377	600125	铁龙物流	32,500	181,350.00	0.00
378	600557	康缘药业	13,022	181,266.24	0.00
379	000932	华菱钢铁	48,020	181,035.40	0.00
380	600329	中新药业	10,418	180,439.76	0.00
381	002407	多 氟 多	16,950	180,348.00	0.00
382	002124	天邦股份	14,000	179,900.00	0.00
383	603515	欧普照明	6,565	179,684.05	0.00
384	002424	贵州百灵	21,600	179,280.00	0.00
385	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.00
386	603885	吉祥航空	19,500	177,450.00	0.00
387	000156	华数传媒	16,354	177,113.82	0.00
388	600291	西水股份	19,563	177,045.15	0.00
389	601928	凤凰传媒	26,016	176,908.80	0.00
390	000488	晨鸣纸业	35,719	176,451.86	0.00

391	603056	德邦股份	13,000	175,890.00	0.00
392	300166	东方国信	14,099	174,968.59	0.00
393	600141	兴发集团	19,500	174,525.00	0.00
394	000685	中山公用	22,540	173,558.00	0.00
395	600717	天 津 港	39,031	172,517.02	0.00
396	600582	天地科技	58,534	171,504.62	0.00
397	000031	大 悦 城	33,600	171,024.00	0.00
398	002648	卫星石化	10,500	170,835.00	0.00
399	600307	酒钢宏兴	110,100	169,554.00	0.00
400	600901	江苏租赁	32,500	169,325.00	0.00
401	601860	紫金银行	40,000	169,200.00	0.00
402	601598	中国外运	52,000	167,960.00	0.00
403	002118	紫鑫药业	37,806	167,858.64	0.00
404	002266	浙富控股	43,300	167,571.00	0.00
405	002818	富 森 美	13,577	166,997.10	0.00
406	600748	上实发展	32,500	166,075.00	0.00
407	601678	滨化股份	39,046	165,555.04	0.00
408	600348	阳泉煤业	39,000	164,580.00	0.00
409	002444	巨星科技	13,818	164,157.84	0.00
410	002701	奥 瑞 金	39,100	163,829.00	0.00
411	600675	中华企业	40,000	162,800.00	0.00
412	002048	宁波华翔	10,500	162,120.00	0.00
413	600017	日 照 港	65,000	161,850.00	0.00
414	601611	中国核建	26,000	160,680.00	0.00
415	002458	益生股份	10,500	160,335.00	0.00
416	600664	哈药股份	52,000	160,160.00	0.00
417	600694	大商股份	6,655	159,653.45	0.00
418	000025	特 力 A	8,646	158,481.18	0.00
419	002440	闰土股份	17,225	157,436.50	0.00
420	600350	山东高速	25,608	157,233.12	0.00
421	000758	中色股份	37,600	157,168.00	0.00
422	601200	上海环境	13,038	156,456.00	0.00
423	600545	卓郎智能	32,991	156,047.43	0.00
424	600869	智慧能源	39,004	156,016.00	0.00
425	002429	兆驰股份	31,500	155,925.00	0.00
426	000008	神州高铁	52,728	155,020.32	0.00
427	000629	攀钢钒钛	77,000	154,770.00	0.00
428	603650	彤程新材	6,500	151,255.00	0.00
429	000887	中鼎股份	19,100	149,935.00	0.00
430	601615	明阳智能	12,000	149,400.00	0.00
431	600277	亿利洁能	45,500	148,330.00	0.00
432	603888	新 华 网	6,550	146,458.00	0.00
433	002506	协鑫集成	56,000	146,160.00	0.00

434	002408	齐翔腾达	23,120	143,575.20	0.00
435	600787	中储股份	32,582	143,034.98	0.00
436	000813	德展健康	23,000	142,600.00	0.00
437	601969	海南矿业	29,000	141,520.00	0.00
438	603198	迎驾贡酒	6,500	141,505.00	0.00
439	002595	豪迈科技	7,000	136,220.00	0.00
440	603328	依顿电子	13,022	135,819.46	0.00
441	000826	启迪环境	18,300	135,786.00	0.00
442	000415	渤海租赁	45,500	135,590.00	0.00
443	600657	信达地产	32,900	135,548.00	0.00
444	002244	滨江集团	31,300	133,651.00	0.00
445	002010	传化智联	24,500	133,280.00	0.00
446	600339	中油工程	58,500	132,795.00	0.00
447	603377	东方时尚	8,000	132,480.00	0.00
448	002285	世 联 行	47,400	132,246.00	0.00
449	000990	诚志股份	10,200	129,438.00	0.00
450	601139	深圳燃气	19,590	127,335.00	0.00
451	603766	隆鑫通用	32,518	125,844.66	0.00
452	600770	综艺股份	26,000	124,800.00	0.00
453	601016	节能风电	58,513	124,047.56	0.00
454	601869	长飞光纤	4,000	123,240.00	0.00
455	601865	福 莱 特	6,500	122,200.00	0.00
456	601019	山东出版	19,506	121,912.50	0.00
457	600428	中远海特	39,060	120,304.80	0.00
458	002128	露天煤业	15,500	120,125.00	0.00
459	002302	西部建设	12,400	119,040.00	0.00
460	600707	彩虹股份	26,000	118,560.00	0.00
461	002544	杰赛科技	8,500	111,775.00	0.00
462	000898	鞍钢股份	45,500	111,475.00	0.00
463	600575	淮河能源	52,000	108,680.00	0.00
464	601801	皖新传媒	19,509	108,470.04	0.00
465	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00
466	002948	青岛银行	21,100	107,399.00	0.00
467	688277	天 智 航	8,810	106,072.40	0.00
468	000046	泛海控股	28,000	105,560.00	0.00
469	600006	东风汽车	26,000	104,780.00	0.00
470	688027	N 国 盾	2,830	102,389.40	0.00
471	002625	光启技术	14,000	101,500.00	0.00
472	600985	淮北矿业	13,000	101,270.00	0.00
473	600623	华谊集团	19,515	100,697.40	0.00
474	600757	长江传媒	19,589	99,708.01	0.00
475	002563	森马服饰	14,000	98,700.00	0.00
476	601127	小康股份	11,457	95,207.67	0.00

477	603556	海兴电力	6,550	94,582.00	0.00
478	600996	贵广网络	13,000	92,690.00	0.00
479	002946	新 乳 业	5,100	88,485.00	0.00
480	601003	柳钢股份	19,500	86,385.00	0.00
481	600874	创业环保	13,000	86,320.00	0.00
482	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.00
483	600338	西藏珠峰	8,080	80,800.00	0.00
484	600058	五矿发展	13,031	78,707.24	0.00
485	300459	金科文化	22,085	76,193.25	0.00
486	603256	宏和科技	6,100	69,784.00	0.00
487	601811	新华文轩	6,500	66,105.00	0.00
488	603225	新 凤 鸣	6,504	64,909.92	0.00
489	600903	贵州燃气	6,500	63,960.00	0.00
490	600335	国机汽车	13,000	60,060.00	0.00
491	002941	新疆交建	4,100	58,015.00	0.00
492	000785	居然之家	7,000	55,440.00	0.00
493	001872	招商港口	3,500	50,925.00	0.00
494	601068	中铝国际	13,000	50,830.00	0.00
495	002423	中粮资本	5,600	48,720.00	0.00
496	603025	大豪科技	6,583	47,858.41	0.00
497	600917	重庆燃气	6,500	46,410.00	0.00
498	601512	中新集团	4,000	46,000.00	0.00
499	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
500	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
501	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
502	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
503	300847	N 中 船	1,421	9,861.74	0.00
504	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
505	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
506	603317	天味食品	84	4,668.72	0.00
507	603868	飞科电器	81	3,995.73	0.00
508	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
509	603355	莱克电气	78	1,941.42	0.00
510	605166	聚 合 顺	41	649.85	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	600745	闻泰科技	15,358,796.60	0.13
2	600536	中国软件	11,235,976.70	0.10

3	600584	长电科技	10,032,439.86	0.09
4	600201	生物股份	9,544,444.00	0.08
5	601099	太平洋	9,347,176.00	0.08
6	601128	常熟银行	8,386,450.25	0.07
7	600739	辽宁成大	8,132,788.49	0.07
8	600161	天坛生物	7,744,874.00	0.07
9	600763	通策医疗	7,741,810.22	0.07
10	600426	华鲁恒升	7,415,013.48	0.06
11	600801	华新水泥	7,000,298.59	0.06
12	600298	安琪酵母	6,960,874.88	0.06
13	601799	星宇股份	6,916,858.00	0.06
14	600143	金发科技	6,789,830.00	0.06
15	603517	绝味食品	6,719,826.02	0.06
16	603939	益丰药房	6,454,642.00	0.06
17	600845	宝信软件	6,246,062.94	0.05
18	600879	航天电子	5,916,019.20	0.05
19	601233	桐昆股份	5,876,323.00	0.05
20	600909	华安证券	5,810,373.00	0.05

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 累计买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	600745	闻泰科技	34,254,483.16	0.30
2	600584	长电科技	25,534,477.55	0.22
3	600536	中国软件	24,518,970.96	0.21
4	600201	生物股份	22,610,511.81	0.20
5	601099	太平洋	20,208,404.00	0.18
6	600739	辽宁成大	19,083,961.54	0.17
7	601128	常熟银行	18,512,849.87	0.16
8	600161	天坛生物	17,826,352.77	0.16
9	600426	华鲁恒升	17,503,319.40	0.15
10	600763	通策医疗	16,770,649.52	0.15
11	600298	安琪酵母	16,430,507.69	0.14
12	601799	星宇股份	16,094,891.32	0.14
13	600801	华新水泥	15,827,753.75	0.14
14	600143	金发科技	15,741,650.20	0.14
15	603517	绝味食品	15,731,182.64	0.14
16	600699	均胜电子	14,539,202.54	0.13
17	600845	宝信软件	14,277,926.86	0.13

18	600521	华海药业	14,046,795.01	0.12
19	603939	益丰药房	13,795,647.65	0.12
20	603659	璞泰来	13,572,257.40	0.12

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	971,558,909.86
卖出股票收入（成交）总额	2,033,287,605.32

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	178,533,222.00	1.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	214,582,534.30	1.98
	其中：政策性金融债	214,582,534.30	1.98
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）	3,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	393,118,756.30	3.64

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	019627	20 国债 01	1,784,440	178,533,222.00	1.65
2	018007	国开 1801	1,011,250	101,276,687.50	0.94
3	018061	进出 1911	638,320	63,883,065.60	0.59
4	108902	农发 1802	350,000	35,182,000.00	0.33
5	108801	进出 1901	85,600	8,560,856.00	0.08

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 (人民币 元)	占基金资 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	10,318,052, 550.03	95.45

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

7.11.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.12.3 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	1,046,472.46
2	应收证券清算款	164,248,613.98
3	应收股利	-
4	应收利息	7,468,823.03
5	应收申购款	40,773,427.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	14,600,169.41
9	合计	228,137,506.50

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	596,942	9,921.07	1,510,988,882.97	25.51%	4,411,317,455.28	74.49%

接(LOF)A						
南方中证 500ETF 联接(LOF)C	33,413	38,414.03	1,139,598,611.52	88.79%	143,929,328.53	11.21%
合计	630,355	11,431.39	2,650,587,494.49	36.78%	4,555,246,783.81	63.22%

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	厦门小羽佳家政股份有限公司	1,375,419.00	1.56%
2	陈建仁	1,052,100.00	1.19%
3	周惠冰	1,019,866.00	1.15%
4	徐仰清	1,006,859.00	1.14%
5	何巧英	961,771.00	1.09%
6	陈镇基	794,921.00	0.90%
7	中融国际信托有限公司-中融-日进斗金 11 号证券投资单一资金信托	766,400.00	0.87%
8	张彩玉	741,441.00	0.84%
9	葛强	700,000.00	0.79%
10	朱伟豪	699,100.00	0.79%

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	4,048,257.89	0.0684%
	南方中证 500ETF 联接(LOF)C	52,949.23	0.0041%
	合计	4,101,207.12	0.0569%

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	南方中证 500ETF 联接	>100

投资和研究部门负责人持有 本开放式基金	(LOF)A	
	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C	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	0~10
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方中证 500ETF 联接(LOF)A	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C
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	6,904,911,915.32	1,581,106,891.8 2
本报告期基金总申购份额	3,624,394,383.91	1,095,687,443.8 5
减：报告期基金总赎回份额	4,606,999,960.98	1,393,266,395.6 2
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	5,922,306,338.25	1,283,527,940.0 5

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

根据南方基金管理股份有限公司 2020 年 4 月 29 日发布的《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自本次基金份额持有人大会决议通过之日（即 2020 年 4 月 29 日）起，本次修订的基金合同生效，本基金可以开展转融通证券出借业务，调整后的基金份额赎回费自该日起生效（即自该日起提出的赎回申请适用调整后的基金份额赎回费率）。

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、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

根据南方基金管理股份有限公司 2020 年 4 月 29 日发布的《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自本次基金份额持有人大会决议通过之日（即 2020 年 4 月 29 日）起，本基金可以开展转融通证券出借业务。

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	2,604,423,041.08	87.02%	260,444.00	87.01%	-
华泰证券	1	388,630,833.64	12.98%	38,866.27	12.99%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-

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。

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	312,866,866.80	79.75%	4,338,600,000.00	92.86%	-	-	5,480,590,715.53	100.00%
华泰证券	79,433,128.55	20.25%	333,661,000.00	7.14%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-

日信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	南方基金关于旗下部分基金参加中国民生银行基金定期定额投资手续费率优惠活动的公告	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	2020-01-10
2	南方基金关于旗下部分基金增加中国人寿为销售机构及开通相关业务的公告	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	2020-01-10
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下完全被动型指数基金认购关联方承销证券的公告	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	2020-01-13
4	南方基金管理股份有限公司关于修订公司旗下部分公开募集证券投资基金基金合同信息披露有关条款的公告	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	2020-01-16
5	南方基金管理股份有限公司旗下全部基金 2019 年第四季度报告提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-20
6	南方基金关于旗下部分基金增加万联证券为销售机构及开通相关业务的公告	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	2020-02-12
7	南方基金关于旗下部分基金增加中信期货为销售机构及开通相关业务的公告	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	2020-02-27
8	南方基金关于旗下部分基金增加植信基金为销售机构及开通相关业务的公告	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	2020-02-28
9	南方基金关于旗下部分基金增加华宝证券为销售机构及开通相关业务的公告	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	2020-03-12
10	南方基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金份额持有人大会的公告	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	2020-03-12
11	南方基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金份额持有人大会的第	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	2020-03-13

	一次提示性公告		
12	南方基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-14
13	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-17
14	南方基金关于旗下部分基金增加中信证券（山东）为销售机构及开通相关业务的公告	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	2020-04-02
15	南方基金关于旗下部分基金增加中正达广为销售机构及开通相关业务的公告	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	2020-04-03
16	南方基金关于旗下部分基金增加东兴证券为销售机构及开通相关业务的公告	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	2020-04-27
17	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）基金份额持有人大会计票日开始停牌的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-04-29
18	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	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	2020-04-30
19	南方基金关于旗下部分基金增加中信证券（华南）为销售机构及开通相关业务的公告	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	2020-05-06
20	南方基金关于旗下部分基金增加招商银行为销售机构及开通相关业务的公告	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	2020-05-22
21	南方基金关于旗下部分基金增加申万宏源为销售机构及开通相关业务的公告	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	2020-06-04
22	南方基金关于旗下部分基金增加申万宏源西部为销售机构及开通相关业务的公告	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	2020-06-04
23	南方基金关于旗下部分基金增加平安银行为销售机构及开通相关业务的公告	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	2020-06-15

§ 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) 2020 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>