

南方中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金联接基金 (LOF) 2023 年中期报 告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
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.....	58
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.....	58
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.....	59

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	59
7.10	本报告期投资基金情况	59
7.11	本基金投资股指期货的投资政策	59
7.12	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.13	投资组合报告附注	60
§8	基金份额持有人信息	60
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2	期末上市基金前十名持有人	61
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	62
§10	重大事件揭示	62
10.1	基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4	基金投资策略的改变	63
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8	其他重大事件	65
§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	66
12.1	备查文件目录	66
12.2	存放地点	66
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	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	5,426,662,223.51 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	
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	5,069,724,556.88 份	356,937,666.63 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	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(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	142,606,211.65
本期利润	299,523,608.20
加权平均基金份额本期利润	0.0578
本期加权平均净值利润率	3.43%
本期基金份额净值增长率	3.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	3,297,030,589.43
期末可供分配基金份额利润	0.6503
期末基金资产净值	8,366,755,146.31
期末基金份额净值	1.6503
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	80.06%

2、南方中证 500ETF 联接（LOF）C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	9,983,171.07
本期利润	5,767,759.80
加权平均基金份额本期利润	0.0130

本期加权平均净值利润率	0.78%
本期基金份额净值增长率	3.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	220,180,572.68
期末可供分配基金份额利润	0.6168
期末基金资产净值	577,118,239.31
期末基金份额净值	1.6169
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	2.78%

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。

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	-0.11%	0.90%	-0.77%	0.89%	0.66%	0.01%
过去三个月	-4.06%	0.79%	-5.11%	0.78%	1.05%	0.01%
过去六个月	3.29%	0.75%	2.20%	0.75%	1.09%	0.00%
过去一年	-4.91%	0.91%	-6.65%	0.91%	1.74%	0.00%
过去三年	9.84%	1.13%	2.48%	1.13%	7.36%	0.00%
自基金合同生效起至今	80.06%	1.52%	69.07%	1.52%	10.99%	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	-0.14%	0.90%	-0.77%	0.89%	0.63%	0.01%
过去三个月	-4.15%	0.79%	-5.11%	0.78%	0.96%	0.01%

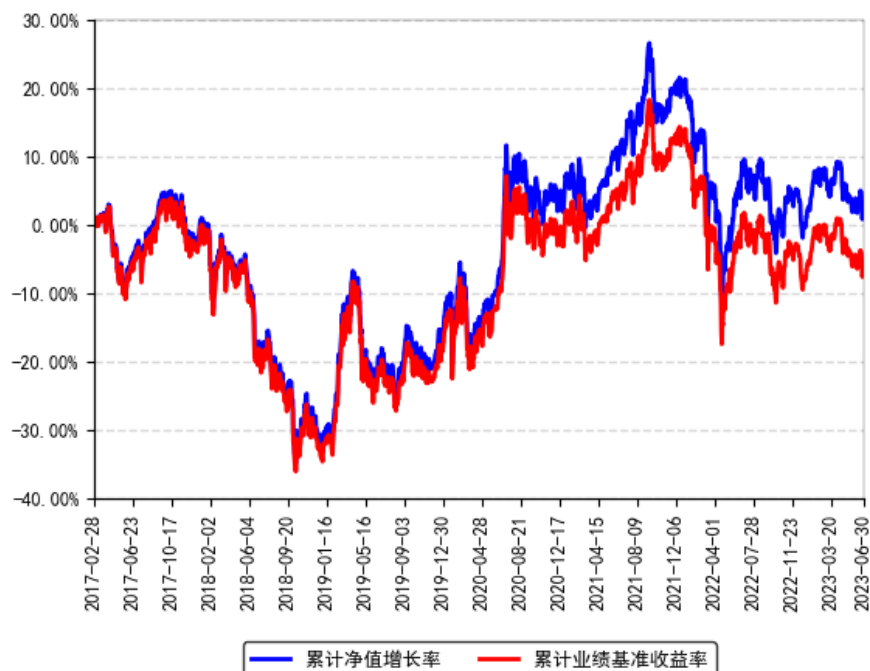
过去六个月	3.09%	0.75%	2.20%	0.75%	0.89%	0.00%
过去一年	-5.28%	0.91%	-6.65%	0.91%	1.37%	0.00%
过去三年	8.54%	1.13%	2.48%	1.13%	6.06%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.78%	1.25%	-5.97%	1.25%	8.75%	0.00%

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：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，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	-	18 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；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；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；2020 年 12 月 25 日至今，任南方策略基金经理；2021 年 7 月 2 日至今，任南方中证香港科技 ETF (QDII) 基金经理；2022 年 6 月 17 日至今，任南方恒生香港上市生物科技 ETF (QDII) 基金经理；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。
--	--	--	--	---

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	14	67,807,323,128.94	2013 年 04 月 22 日
	私募资产管理计划	8	2,779,034,023.98	2020 年 08 月 07 日
	其他组合	-	-	-
	合计	22	70,586,357,152.92	-

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 13 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 指数涨 2.29%。期间我们通过自建的指数化交易系统、日内择时交易模型、跟踪误差归因分析系统、ETF 现金流精算系统等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

(1) 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 1.6503 元，报告期内，份额净值增长率为 3.29%，同期业绩基准增长率为 2.20%；本基金 C 份额净值为 1.6169 元，报告期内，份额净值增长率为 3.09%，同期业绩基准增长率为 2.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年中国经济增长持续修复，权益市场整体情绪不高，呈现结构性行情。现阶段，大中华权益市场估值继续处于历史底部区域，下行空间收窄，具长期配置价值。中证 500 作为 A 股核心宽基指数，是配置 A 股市场的重要标的。

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、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《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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30	上年度末 2022 年 12 月
----	-----	-------------------	------------------

		日	31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	50,838,231.74	28,605,316.89
结算备付金		3,151,829.75	3,072,144.06
存出保证金		331,223.47	207,865.99
交易性金融资产	6.4.3.2	9,023,657,662.87	8,942,443,415.82
其中：股票投资		150,692,260.37	153,212,293.20
基金投资		8,345,716,931.22	8,358,947,235.53
债券投资		527,248,471.28	430,283,887.09
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
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		323,303.27	138,311.47
应收股利		-	-
应收申购款		9,313,873.82	13,311,202.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		9,087,616,124.92	8,987,778,257.17
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		130,032,142.93	1,000,271.24
应付清算款		-	-
应付赎回款		12,523,442.28	31,322,674.68
应付管理人报酬		245,462.63	261,014.47
应付托管费		49,092.50	52,202.90
应付销售服务费		193,225.96	232,907.76
应付投资顾问费		-	-
应交税费		531,728.22	318,504.67
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	167,644.78	264,099.88

负债合计		143,742,739.30	33,451,675.60
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	5,426,662,223.51	5,611,709,723.31
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	3,517,211,162.11	3,342,616,858.26
净资产合计		8,943,873,385.62	8,954,326,581.57
负债和净资产总计		9,087,616,124.92	8,987,778,257.17

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，南方中证 500ETF 联接（LOF）A 份额净值 1.6503 元，基金份额总额 5,069,724,556.88 份；南方中证 500ETF 联接（LOF）C 份额净值 1.6169 元，基金份额总额 356,937,666.63 份；总份额合计 5,426,662,223.51 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		309,671,354.00	-936,034,809.78
1.利息收入		1,752,623.70	1,387,097.02
其中：存款利息收入	6.4.3.9	1,752,623.70	1,387,097.02
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		154,726,828.81	51,394,517.90
其中：股票投资收益	6.4.3.10	5,236,749.45	-12,794,664.03
基金投资收益	6.4.3.11	144,593,404.36	58,906,121.57
债券投资收益	6.4.3.12	3,163,294.34	3,174,276.91
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.13	-	-
股利收益	6.4.3.14	1,733,380.66	2,108,783.45
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）	6.4.3.15	152,701,985.28	-989,269,069.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	489,916.21	452,644.30
减：二、营业总支出		4,379,986.00	3,316,894.52
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	1,528,803.10	1,451,255.69
2.托管费	6.4.6.2.2	305,760.61	290,251.15
3.销售服务费	6.4.6.2.3	1,458,872.43	1,124,219.56
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		586,967.52	318,031.56
其中：卖出回购金融资产支出		586,967.52	318,031.56
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		365,987.50	0.09
8.其他费用	6.4.3.17	133,594.84	133,136.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		305,291,368.00	-939,351,704.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		305,291,368.00	-939,351,704.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		305,291,368.00	-939,351,704.30

6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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(基金净值)	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(基金净值)	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基金净值变动数(净值减少以“-”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基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	5,426,662,223.51	-	3,517,211,162.11	8,943,873,385.62
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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(基金净值)	4,721,675,344.19	-	4,411,545,390.83	9,133,220,735.02
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	4,721,675,344.19	-	4,411,545,390.83	9,133,220,735.02
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	563,753,453.96	-	-533,054,031.92	30,699,422.04
(一)、综合收益总额	-	-	-939,351,704.30	-939,351,704.30
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	563,753,453.96	-	406,297,672.38	970,051,126.34

(净值减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	1,756,995,493.36	-	1,207,114,161.38	2,964,109,654.74
2.基金赎回款	-1,193,242,039.40	-	-800,816,489.00	-1,994,058,528.40
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	5,285,428,798.15	-	3,878,491,358.91	9,163,920,157.06

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。

6.4.1.1 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	50,838,231.74
等于：本金	50,795,242.45
加：应计利息	42,989.29
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	50,838,231.74

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	153,669,424.30	-	150,692,260.37	-2,977,163.93
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	6,741,476.48	527,248,471.28	66,774.79
	银行间市场	-	-	-
	合计	6,741,476.48	527,248,471.28	66,774.79
资产支持证券	-	-	-	-
基金	7,468,268,580.22	-	8,345,716,931.22	877,448,351.00
其他	-	-	-	-
合计	8,142,378,224.53	6,741,476.48	9,023,657,662.87	874,537,961.86

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。

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 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。

6.4.3.4 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 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,781.20
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	44,848.84
其中：交易所市场	44,848.84
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	-
预提费用	119,014.74
应付指数使用费	-
可退替代款	-
其他	-
合计	167,644.78

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。

6.4.3.7 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	5,192,344,063.66	5,192,344,063.66
本期申购	814,606,098.02	814,606,098.02
本期赎回 (以“-”号填列)	-937,225,604.80	-937,225,604.80

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	5,069,724,556.88	5,069,724,556.88

南方中证 500ETF 联接（LOF）C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	419,365,659.65	419,365,659.65
本期申购	603,572,804.51	603,572,804.51
本期赎回（以“-”号填列）	-666,000,797.53	-666,000,797.53
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	356,937,666.63	356,937,666.63

6.4.3.8 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	5,919,269,846.23	-2,815,064,384.75	3,104,205,461.48
本期利润	142,606,211.65	156,917,396.55	299,523,608.20
本期基金份额交易产生的变动数	-142,895,688.16	36,197,207.91	-106,698,480.25
其中：基金申购款	936,298,886.11	-380,155,172.81	556,143,713.30
基金赎回款	-1,079,194,574.27	416,352,380.72	-662,842,193.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,918,980,369.72	-2,621,949,780.29	3,297,030,589.43

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	465,160,419.46	-226,749,022.68	238,411,396.78
本期利润	9,983,171.07	-4,215,411.27	5,767,759.80
本期基金份额交易产生的变动数	-70,752,857.36	46,754,273.46	-23,998,583.90
其中：基金申购款	676,345,384.55	-266,020,108.16	410,325,276.39
基金赎回款	-747,098,241.91	312,774,381.62	-434,323,860.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	404,390,733.17	-184,210,160.49	220,180,572.68

6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,700,482.95
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	36,926.28
其他	15,214.47
合计	1,752,623.70

6.4.3.10 股票投资收益

6.4.3.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,527,151.72
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	709,597.73
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	5,236,749.45

6.4.3.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	280,740,563.20
减：卖出股票成本总额	275,817,292.19
减：交易费用	396,119.29
买卖股票差价收入	4,527,151.72

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.3.10.3 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。

6.4.3.10.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	528,751,760.00
减：现金支付申购款总额	257,022,260.37
减：申购股票成本总额	271,019,901.90
减：交易费用	-
申购差价收入	709,597.73

6.4.3.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.3.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	1,092,679,610.09
减：卖出/赎回基金成本总额	944,983,998.22
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	3,049,895.34
减：交易费用	52,312.17
基金投资收益	144,593,404.36

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。

6.4.3.12 债券投资收益

6.4.3.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	3,132,576.52
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	30,717.82
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	3,163,294.34

6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	171,802,678.55
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	168,219,754.30
减：应计利息总额	3,552,204.08
减：交易费用	2.35
买卖债券差价收入	30,717.82

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.3.12.3 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。

6.4.3.12.4 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。

6.4.3.13 衍生工具收益

6.4.3.13.1 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。

6.4.3.13.2 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。

6.4.3.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,733,380.66
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	1,733,380.66

6.4.3.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	152,701,985.28
——股票投资	3,532,640.57
——债券投资	337,978.57
——资产支持证券投资	-
——基金投资	148,831,366.14
——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	152,701,985.28

6.4.3.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	489,101.94
基金转换费收入	814.27
合计	489,916.21

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. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，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% 归入转出基金的基金资产；C 类基金份额的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入转出基金的基金资产。

6.4.3.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	14,515.88
其他	64.22
合计	133,594.84

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、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。

6.4.6 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	150,254,322.40	23.86%	49,218,024.63	9.33%

6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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%	136,028.20	0.06%

6.4.6.1.3 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。

6.4.6.1.4 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。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	4,924.11	9.34%	3,086.79	17.20%

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,528,803.10	1,451,255.69
其中：支付销售机构的客户	7,622,609.52	6,306,696.82

维护费		
-----	--	--

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	305,760.61	290,251.15

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股份有限公司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 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	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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	7,074.14	7,074.14
南方基金	-	329,005.91	329,005.91
农业银行	-	140.11	140.11
合计	-	336,220.16	336,220.16

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 X 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

无。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	50,838,231.74	1,700,482.95	200,179,889.15	1,350,634.05

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 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

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	688048	长光华芯	网下申购	6,790	548,632.00
华泰联合	301207	华兰疫苗	网下申购	5,687	323,476.56
华泰联合	688046	药康生物	网下申购	12,070	271,937.10
华泰联合	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64

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 2023 年 06 月 30 日, 本基金持有基金管理人南方基金所管理的公开募集证券投资基金, 成本总额为人民币 7,468,268,580.22 元, 估值总额为人民币 8,345,716,931.22 元, 占本基金基金资产净值的比例为 93.31% (于 2022 年 12 月 31 日, 本基金持有基金管理人南方基金所管理的公开募集证券投资基金, 成本总额为人民币 7,630,330,250.67 元, 估值总额为人民币 8,358,947,235.53 元, 占本基金基金资产净值的比例为 93.35%)。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 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。

6.4.8 期末(2023 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

6.4.8.1.1 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
688515	裕太微	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定期	92.00	162.75	4,183	384,836.00	680,783.25	-

301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	57.66	57.66	4,820	277,921.20	277,921.20	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁 定期	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	55.00	55.00	1,391	76,505.00	76,505.00	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24	6 个月	新股锁 定期	152.3 8	135.9 7	346	52,723.48	47,045.62	-

		日								
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	76.80	107.9 5	364	27,955.20	39,293.80	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	135.8 0	120.4 1	240	32,592.00	28,898.40	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	245.5 6	122.1 1	150	36,834.00	18,316.50	-
688507	索辰科技	2023 年 6 月 20 日	1-6 个 月(含)	锁定期 转增	-	122.1 1	72	-	8,791.92	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	131.1 1	53.24	261	34,219.71	13,895.64	-
301322	绿通科技	2023 年 5 月 25 日	1-6 个 月(含)	锁定期 转增	-	53.24	131	-	6,974.44	-
688458	美芯晟	2023 年	6 个月	新股锁	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-

		5月15日		定期						
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股锁定期	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股锁定期	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股锁定期	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股锁定期	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股锁定期	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股锁定期	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股锁定期	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股锁定期	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股锁定期	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股锁定期	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定期	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股锁定期	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股锁定期	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股锁定期	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-

688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	10.36	11.84	802	8,308.72	9,495.68	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28	6 个月	新股锁 定期	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-

		日								
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

6.4.8.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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
601298	青岛 港	2023 年 6 月 28 日	重大 事项 停牌	6.97	2023 年 7 月 3 日	7.40	15,000	103,226.75	104,550.00	-
000540	*ST 中天	2023 年 5 月 19 日	退市	0.14	-	-	95,400	100,170.00	13,356.00	-

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 2023 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 130,032,142.93 元，截至 2023 年 7 月 5 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，将风险控制在可承受的范围内。

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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，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。

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。

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

限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，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%。

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。

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 2023	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
----------	-------	-------	-------	-----	----

年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	50,838,231.74	-	-	-	50,838,231.74
结算备付金	3,151,829.75	-	-	-	3,151,829.75
存出保证金	331,223.47	-	-	-	331,223.47
交易性金融资产	527,248,471.28	-	-	8,496,409,191.59	9,023,657,662.87
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	-	-	-	323,303.27	323,303.27
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	404,612.77	-	-	8,909,261.05	9,313,873.82
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	581,974,369.01	-	-	8,505,641,755.91	9,087,616,124.92
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	130,032,142.93	-	-	-	130,032,142.93
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	12,523,442.28	12,523,442.28
应付管理人报酬	-	-	-	245,462.63	245,462.63
应付托管费	-	-	-	49,092.50	49,092.50
应付销售服务费	-	-	-	193,225.96	193,225.96
应付投资顾问费	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	531,728.22	531,728.22
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	167,644.78	167,644.78
负债总计	130,032,142.93	-	-	13,710,596.37	143,742,739.30
利率敏感度缺口	451,942,226.08	-	-	8,491,931,159.54	8,943,873,385.62
上年度末 2022 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	28,605,316.89	-	-	-	28,605,316.89
结算备付金	3,072,144.06	-	-	-	3,072,144.06
存出保证金	207,865.99	-	-	-	207,865.99
交易性金融资产	430,283,887.09	-	-	8,512,159,528.73	8,942,443,415.82
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	-	-	-	138,311.47	138,311.47
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	425,276.19	-	-	12,885,926.75	13,311,202.94
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	462,594,490.22	-	-	8,525,183,766.95	8,987,778,257.17
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	1,000,271.24	-	-	-	1,000,271.24
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	31,322,674.68	31,322,674.68
应付管理人报酬	-	-	-	261,014.47	261,014.47
应付托管费	-	-	-	52,202.90	52,202.90
应付销售服务费	-	-	-	232,907.76	232,907.76
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	318,504.67	318,504.67
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	264,099.88	264,099.88
负债总计	1,000,271.24	-	-	32,451,404.36	33,451,675.60
利率敏感度缺口	461,594,218.98	-	-	8,492,732,362.59	8,954,326,581.57

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

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	-487,219.57	-356,709.35
2.市场利率平行下降25个基点	489,276.27	358,027.52	

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	150,692,260.37	1.68	153,212,293.20	1.71
交易性金融资产-基金投资	8,345,716,931.22	93.31	8,358,947,235.53	93.35
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	8,496,409,191.59	95.00	8,512,159,528.73	95.06

注：交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标ETF份额。

6.4.9.4.3.2 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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1.组合自身基准上升 5%	422,059,018.83	423,759,242.41
	2.组合自身基准下降 5%	-422,059,018.83	-423,759,242.41

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 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。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	8,493,600,770.49
第二层次	527,963,404.42
第三层次	2,093,487.96
合计	9,023,657,662.87

6.4.10.2.2 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、债券和基金，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、债券和基金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，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.10.4 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。

§ 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	150,692,260.37	1.66
	其中：股票	150,692,260.37	1.66

2	基金投资	8,345,716,931.22	91.84
3	固定收益投资	527,248,471.28	5.80
	其中：债券	527,248,471.28	5.80
	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	53,990,061.49	0.59
8	其他资产	9,968,400.56	0.11
9	合计	9,087,616,124.92	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	996,870.00	0.01
B	采矿业	5,379,829.42	0.06
C	制造业	95,173,997.08	1.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,430,732.74	0.05
E	建筑业	1,373,661.14	0.02
F	批发和零售业	4,209,775.03	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	1,899,165.81	0.02
H	住宿和餐饮业	285,273.30	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,565,378.86	0.16
J	金融业	11,407,964.85	0.13
K	房地产业	2,238,647.65	0.03
L	租赁和商务服务业	1,869,083.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	2,077,089.48	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	861,295.60	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	764,540.51	0.01
R	文化、体育和娱乐业	2,135,352.40	0.02
S	综合	1,023,603.50	0.01
	合计	150,692,260.37	1.68

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	300308	中际旭创	12,300	1,813,635.00	0.02
2	688256	寒武纪	7,093	1,333,484.00	0.01
3	688521	芯原股份	15,300	1,100,376.00	0.01
4	002028	思源电气	22,118	1,033,352.96	0.01
5	300418	昆仑万维	24,100	970,748.00	0.01
6	688777	中控技术	14,500	910,310.00	0.01
7	002384	东山精密	34,900	903,910.00	0.01
8	688099	晶晨股份	10,000	843,200.00	0.01
9	300012	华测检测	43,000	838,500.00	0.01
10	000988	华工科技	21,900	832,419.00	0.01
11	000009	中国宝安	66,869	807,108.83	0.01
12	603444	吉比特	1,500	736,665.00	0.01
13	000519	中兵红箭	40,600	734,454.00	0.01
14	002422	科伦药业	24,600	730,128.00	0.01
15	002850	科达利	5,300	700,925.00	0.01
16	600563	法拉电子	5,086	698,307.80	0.01
17	002340	格林美	100,700	695,837.00	0.01
18	300724	捷佳伟创	6,100	685,335.00	0.01
19	688515	裕太微	4,183	680,783.25	0.01
20	300676	华大基因	11,300	677,887.00	0.01
21	002463	沪电股份	30,200	632,388.00	0.01
22	300146	汤臣倍健	25,900	621,082.00	0.01
23	600536	中国软件	13,096	613,940.48	0.01
24	600372	中航电子	40,000	607,200.00	0.01
25	000066	中国长城	43,900	607,137.00	0.01
26	300003	乐普医疗	26,500	599,165.00	0.01
27	300037	新宙邦	11,471	595,230.19	0.01
28	600157	永泰能源	410,000	582,200.00	0.01
29	002223	鱼跃医疗	15,916	572,816.84	0.01
30	603688	石英股份	5,000	569,200.00	0.01
31	600489	中金黄金	55,000	568,150.00	0.01
32	300285	国瓷材料	20,500	561,700.00	0.01
33	002385	大北农	84,700	559,020.00	0.01
34	000423	东阿阿胶	10,400	555,880.00	0.01
35	000807	云铝股份	43,100	548,663.00	0.01
36	600415	小商品城	64,000	545,920.00	0.01
37	600079	人福医药	20,089	541,197.66	0.01

38	300073	当升科技	10,600	533,498.00	0.01
39	002152	广电运通	45,400	532,088.00	0.01
40	000783	长江证券	91,500	530,700.00	0.01
41	002497	雅化集团	29,600	526,288.00	0.01
42	000738	航发控制	21,400	522,160.00	0.01
43	300024	机器人	31,300	521,771.00	0.01
44	300058	蓝色光标	53,900	521,213.00	0.01
45	601555	东吴证券	75,000	520,500.00	0.01
46	002624	完美世界	30,600	516,834.00	0.01
47	002185	华天科技	56,000	515,200.00	0.01
48	600487	亨通光电	35,000	513,100.00	0.01
49	601058	赛轮轮胎	45,000	512,550.00	0.01
50	688390	固德威	3,052	509,256.72	0.01
51	300390	天华新能	14,170	507,286.00	0.01
52	000932	华菱钢铁	105,920	505,238.40	0.01
53	300144	宋城演艺	40,400	500,960.00	0.01
54	002008	大族激光	19,100	500,420.00	0.01
55	000975	银泰黄金	42,624	498,700.80	0.01
56	002407	多氟多	25,060	497,691.60	0.01
57	002153	石基信息	35,542	497,588.00	0.01
58	002625	光启技术	32,100	489,846.00	0.01
59	002966	苏州银行	74,200	486,010.00	0.01
60	002465	海格通信	46,900	484,946.00	0.01
61	603882	金域医学	6,400	483,200.00	0.01
62	002409	雅克科技	6,600	481,008.00	0.01
63	600885	宏发股份	15,003	477,845.55	0.01
64	300474	景嘉微	5,300	476,947.00	0.01
65	002439	启明星辰	16,000	476,160.00	0.01
66	000630	铜陵有色	163,700	473,093.00	0.01
67	000960	锡业股份	30,200	469,610.00	0.01
68	600482	中国动力	20,000	468,800.00	0.01
69	600352	浙江龙盛	50,000	467,500.00	0.01
70	000933	神火股份	35,700	464,100.00	0.01
71	300866	安克创新	5,300	463,750.00	0.01
72	300395	菲利华	9,400	462,480.00	0.01
73	300832	新产业	7,835	462,265.00	0.01
74	002240	盛新锂能	14,500	462,115.00	0.01
75	603737	三棵树	7,000	457,940.00	0.01
76	688002	睿创微纳	10,000	448,000.00	0.01
77	300017	网宿科技	62,400	443,664.00	0.00
78	002156	通富微电	19,600	442,960.00	0.00
79	600418	江淮汽车	35,068	441,506.12	0.00
80	002600	领益智造	63,800	440,858.00	0.00

81	002249	大洋电机	76,900	438,330.00	0.00
82	600486	扬农化工	5,000	437,100.00	0.00
83	002368	太极股份	10,600	436,402.00	0.00
84	601108	财通证券	60,000	434,400.00	0.00
85	002797	第一创业	75,900	434,148.00	0.00
86	000629	钒钛股份	109,600	428,536.00	0.00
87	600096	云天化	25,000	426,750.00	0.00
88	300136	信维通信	21,200	425,696.00	0.00
89	002195	二三四五	146,058	422,107.62	0.00
90	300253	卫宁健康	38,292	414,319.44	0.00
91	601077	渝农商行	115,000	412,850.00	0.00
92	000729	燕京啤酒	32,800	409,016.00	0.00
93	000831	中国稀土	13,800	408,480.00	0.00
94	000400	许继电气	17,700	407,985.00	0.00
95	600161	天坛生物	15,000	407,250.00	0.00
96	002065	东华软件	57,400	405,244.00	0.00
97	600027	华电国际	60,000	401,400.00	0.00
98	600765	中航重机	15,086	399,929.86	0.00
99	000997	新大陆	21,140	399,546.00	0.00
100	601233	桐昆股份	30,000	397,500.00	0.00
101	300118	东方日升	15,500	397,265.00	0.00
102	603596	伯特利	5,000	396,300.00	0.00
103	002294	信立泰	12,700	396,113.00	0.00
104	002131	利欧股份	172,177	396,007.10	0.00
105	300257	开山股份	26,100	395,937.00	0.00
106	000937	冀中能源	61,900	394,922.00	0.00
107	300699	光威复材	12,800	394,880.00	0.00
108	000970	中科三环	30,720	393,830.40	0.00
109	002683	广东宏大	13,300	391,552.00	0.00
110	002268	电科网安	13,994	390,012.78	0.00
111	601162	天风证券	130,000	387,400.00	0.00
112	002373	千方科技	28,300	386,012.00	0.00
113	002078	太阳纸业	36,100	385,909.00	0.00
114	002568	百润股份	10,600	385,310.00	0.00
115	000623	吉林敖东	24,000	384,960.00	0.00
116	688169	石头科技	1,200	384,816.00	0.00
117	000513	丽珠集团	9,852	383,341.32	0.00
118	600705	中航产融	100,000	383,000.00	0.00
119	300001	特锐德	18,388	382,102.64	0.00
120	603816	顾家家居	10,000	381,500.00	0.00
121	002138	顺络电子	15,900	380,169.00	0.00
122	600862	中航高科	15,000	379,650.00	0.00
123	002273	水晶光电	31,688	378,354.72	0.00

124	000537	广宇发展	32,400	378,108.00	0.00
125	300088	长信科技	62,700	378,081.00	0.00
126	002738	中矿资源	7,420	377,974.80	0.00
127	002444	巨星科技	17,218	376,729.84	0.00
128	000728	国元证券	57,700	376,204.00	0.00
129	002595	豪迈科技	10,600	372,378.00	0.00
130	600060	海信视像	15,000	371,250.00	0.00
131	601966	玲珑轮胎	16,700	371,074.00	0.00
132	689009	九号公司	10,000	368,500.00	0.00
133	600066	宇通客车	25,000	368,500.00	0.00
134	300595	欧普康视	12,200	368,318.00	0.00
135	601168	西部矿业	35,000	367,850.00	0.00
136	605358	立昂微	10,000	367,300.00	0.00
137	300568	星源材质	21,200	364,428.00	0.00
138	603893	瑞芯微	5,000	364,250.00	0.00
139	000021	深科技	18,200	363,818.00	0.00
140	002673	西部证券	57,100	362,585.00	0.00
141	000060	中金岭南	76,300	362,425.00	0.00
142	600298	安琪酵母	10,000	362,100.00	0.00
143	600873	梅花生物	40,000	357,200.00	0.00
144	002507	涪陵榨菜	19,500	357,045.00	0.00
145	000998	隆平高科	23,200	356,120.00	0.00
146	300487	蓝晓科技	5,700	355,794.00	0.00
147	002572	索菲亚	20,400	355,368.00	0.00
148	600481	双良节能	25,400	355,092.00	0.00
149	688220	翱捷科技	4,700	354,333.00	0.00
150	002192	融捷股份	5,300	354,199.00	0.00
151	600699	均胜电子	20,066	353,964.24	0.00
152	002430	杭氧股份	10,300	353,908.00	0.00
153	600839	四川长虹	70,036	353,681.80	0.00
154	300212	易华录	10,600	352,238.00	0.00
155	300438	鹏辉能源	7,300	350,692.00	0.00
156	300182	捷成股份	55,500	350,205.00	0.00
157	002056	横店东磁	19,200	349,632.00	0.00
158	600109	国金证券	40,000	346,800.00	0.00
159	600160	巨化股份	25,000	344,500.00	0.00
160	000683	远兴能源	47,700	342,963.00	0.00
161	601128	常熟银行	50,024	341,163.68	0.00
162	688072	拓荆科技	800	340,776.00	0.00
163	600879	航天电子	40,020	339,769.80	0.00
164	000778	新兴铸管	83,000	338,640.00	0.00
165	002025	航天电器	5,300	338,140.00	0.00
166	000878	云南铜业	30,600	338,130.00	0.00

167	600988	赤峰黄金	25,000	336,500.00	0.00
168	600141	兴发集团	15,084	335,166.48	0.00
169	002926	华西证券	40,000	332,400.00	0.00
170	600153	建发股份	30,000	327,300.00	0.00
171	601990	南京证券	40,000	327,200.00	0.00
172	002353	杰瑞股份	13,000	326,690.00	0.00
173	603267	鸿远电子	5,000	326,500.00	0.00
174	600497	驰宏锌锗	65,000	326,300.00	0.00
175	002080	中材科技	15,900	326,268.00	0.00
176	000750	国海证券	97,210	325,653.50	0.00
177	002557	洽洽食品	7,800	324,090.00	0.00
178	688567	孚能科技	15,000	323,850.00	0.00
179	000591	太阳能	47,700	323,406.00	0.00
180	600392	盛和资源	25,010	321,878.70	0.00
181	000039	中集集团	46,700	321,763.00	0.00
182	688516	奥特维	1,700	320,280.00	0.00
183	601696	中银证券	30,000	319,800.00	0.00
184	002739	万达电影	25,500	319,770.00	0.00
185	000027	深圳能源	48,520	319,746.80	0.00
186	603338	浙江鼎力	5,700	319,257.00	0.00
187	002429	兆驰股份	58,000	319,000.00	0.00
188	002372	伟星新材	15,480	317,959.20	0.00
189	000636	风华高科	20,600	316,004.00	0.00
190	600177	雅戈尔	50,000	315,500.00	0.00
191	600642	申能股份	45,099	315,242.01	0.00
192	600637	东方明珠	40,000	312,800.00	0.00
193	000959	首钢股份	88,900	311,150.00	0.00
194	002432	九安医疗	8,800	309,848.00	0.00
195	600998	九州通	29,800	309,324.00	0.00
196	300888	稳健医疗	7,420	309,191.40	0.00
197	002299	圣农发展	16,000	306,400.00	0.00
198	600166	福田汽车	90,000	306,000.00	0.00
199	600399	抚顺特钢	30,000	306,000.00	0.00
200	600498	烽火通信	15,000	305,550.00	0.00
201	600143	金发科技	35,000	305,550.00	0.00
202	002183	怡亚通	59,800	304,980.00	0.00
203	688208	道通科技	10,000	303,100.00	0.00
204	002092	中泰化学	46,800	301,860.00	0.00
205	002936	郑州银行	131,149	301,642.70	0.00
206	002505	鹏都农牧	158,100	298,809.00	0.00
207	600859	王府井	15,090	298,631.10	0.00
208	600704	物产中大	60,000	296,400.00	0.00
209	603026	胜华新材	5,000	296,250.00	0.00

210	600325	华发股份	30,009	295,588.65	0.00
211	300070	碧水源	54,800	293,728.00	0.00
212	603000	人民网	10,000	292,000.00	0.00
213	002203	海亮股份	24,300	291,843.00	0.00
214	688188	柏楚电子	1,546	291,513.76	0.00
215	300748	金力永磁	9,700	290,224.00	0.00
216	688009	中国通号	50,000	290,000.00	0.00
217	002030	达安基因	29,045	289,578.65	0.00
218	600546	山煤国际	20,000	289,400.00	0.00
219	000893	亚钾国际	12,600	289,044.00	0.00
220	000703	恒逸石化	42,400	287,472.00	0.00
221	600416	湘电股份	15,000	286,350.00	0.00
222	600549	厦门钨业	15,040	286,211.20	0.00
223	002532	天山铝业	47,700	285,723.00	0.00
224	600258	首旅酒店	15,054	285,273.30	0.00
225	300383	光环新网	26,500	284,875.00	0.00
226	600499	科达制造	25,000	284,000.00	0.00
227	601997	贵阳银行	55,000	283,800.00	0.00
228	000547	航天发展	28,361	283,610.00	0.00
229	000930	中粮科技	35,000	283,500.00	0.00
230	000830	鲁西化工	26,810	283,113.60	0.00
231	600118	中国卫星	10,000	282,100.00	0.00
232	300244	迪安诊断	10,977	281,340.51	0.00
233	601198	东兴证券	35,000	280,700.00	0.00
234	603077	和邦生物	115,020	279,498.60	0.00
235	600516	方大炭素	45,000	279,000.00	0.00
236	002408	齐翔腾达	43,688	278,292.56	0.00
237	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.00
238	600521	华海药业	15,000	276,150.00	0.00
239	300009	安科生物	27,560	275,600.00	0.00
240	688200	华峰测控	1,800	275,400.00	0.00
241	000581	威孚高科	17,400	274,050.00	0.00
242	603456	九洲药业	10,000	273,800.00	0.00
243	600271	航天信息	20,000	273,800.00	0.00
244	002690	美亚光电	10,630	273,722.50	0.00
245	002019	亿帆医药	18,700	273,020.00	0.00
246	300357	我武生物	8,100	272,403.00	0.00
247	600529	山东药玻	10,000	272,200.00	0.00
248	601577	长沙银行	35,000	271,600.00	0.00
249	002958	青农商行	99,400	270,368.00	0.00
250	000739	普洛药业	15,200	269,648.00	0.00
251	002500	山西证券	48,214	269,034.12	0.00
252	600170	上海建工	100,000	269,000.00	0.00

253	002508	老板电器	10,600	268,074.00	0.00
254	600739	辽宁成大	20,001	263,013.15	0.00
255	002506	协鑫集成	89,600	262,528.00	0.00
256	002670	国盛金控	29,763	261,319.14	0.00
257	600867	通化东宝	25,000	261,000.00	0.00
258	300026	红日药业	48,100	260,702.00	0.00
259	601869	长飞光纤	7,000	259,070.00	0.00
260	603939	益丰药房	7,000	259,000.00	0.00
261	603658	安图生物	5,000	258,650.00	0.00
262	601636	旗滨集团	30,000	258,600.00	0.00
263	002128	电投能源	19,500	257,790.00	0.00
264	000869	张裕 A	8,400	257,544.00	0.00
265	300115	长盈精密	21,520	256,303.20	0.00
266	002221	东华能源	29,600	256,040.00	0.00
267	600970	中材国际	20,054	255,688.50	0.00
268	300296	利亚德	39,100	255,323.00	0.00
269	300529	健帆生物	11,000	254,980.00	0.00
270	300558	贝达药业	5,300	254,559.00	0.00
271	600380	健康元	20,013	254,365.23	0.00
272	300604	长川科技	5,300	251,697.00	0.00
273	600863	内蒙华电	60,000	249,000.00	0.00
274	600528	中铁工业	25,060	247,592.80	0.00
275	000402	金融街	54,700	247,244.00	0.00
276	603156	养元饮品	10,000	247,000.00	0.00
277	300682	朗新科技	10,600	246,768.00	0.00
278	603589	口子窖	5,000	246,750.00	0.00
279	601016	节能风电	67,040	246,036.80	0.00
280	000050	深天马 A	26,800	246,024.00	0.00
281	002155	湖南黄金	20,000	244,000.00	0.00
282	002867	周大生	13,650	242,697.00	0.00
283	002531	天顺风能	15,900	242,157.00	0.00
284	600820	隧道股份	40,000	240,400.00	0.00
285	603228	景旺电子	9,365	240,212.25	0.00
286	600655	豫园股份	35,000	240,100.00	0.00
287	300363	博腾股份	8,100	239,679.00	0.00
288	600848	上海临港	20,000	239,000.00	0.00
289	600348	华阳股份	30,000	237,300.00	0.00
290	600316	洪都航空	10,085	236,493.25	0.00
291	600909	华安证券	50,088	233,910.96	0.00
292	002244	滨江集团	26,500	233,730.00	0.00
293	300677	英科医疗	10,600	233,200.00	0.00
294	600755	厦门国贸	30,048	232,571.52	0.00
295	002985	北摩高科	5,263	232,203.56	0.00

296	603160	汇顶科技	5,000	231,250.00	0.00
297	600435	北方导航	20,098	230,926.02	0.00
298	600008	首创环保	80,020	230,457.60	0.00
299	600985	淮北矿业	20,000	230,400.00	0.00
300	300861	美畅股份	5,300	229,861.00	0.00
301	000155	川能动力	15,900	228,960.00	0.00
302	600329	达仁堂	5,018	225,258.02	0.00
303	002326	永太科技	14,700	224,763.00	0.00
304	601958	金钼股份	20,000	223,000.00	0.00
305	002487	大金重工	7,200	222,048.00	0.00
306	600580	卧龙电驱	15,011	219,310.71	0.00
307	600369	西南证券	60,000	219,000.00	0.00
308	601880	辽港股份	140,060	218,493.60	0.00
309	600535	天士力	15,040	218,230.40	0.00
310	600673	东阳光	30,027	216,494.67	0.00
311	600021	上海电力	20,098	216,455.46	0.00
312	601179	中国西电	40,000	216,400.00	0.00
313	688029	南微医学	2,651	216,215.56	0.00
314	002939	长城证券	26,500	215,445.00	0.00
315	600390	五矿资本	40,000	215,200.00	0.00
316	300373	扬杰科技	5,300	215,021.00	0.00
317	000709	河钢股份	94,900	214,474.00	0.00
318	002518	科士达	5,300	212,053.00	0.00
319	300251	光线传媒	26,000	210,340.00	0.00
320	688082	盛美上海	1,900	209,760.00	0.00
321	600895	张江高科	15,000	208,800.00	0.00
322	000967	盈峰环境	41,300	208,565.00	0.00
323	000156	华数传媒	23,954	208,399.80	0.00
324	000887	中鼎股份	15,900	208,131.00	0.00
325	600398	海澜之家	30,000	206,400.00	0.00
326	603858	步长制药	10,000	205,900.00	0.00
327	000987	越秀资本	32,225	204,628.75	0.00
328	603127	昭衍新药	5,000	204,500.00	0.00
329	600131	国网信通	10,000	201,900.00	0.00
330	600827	百联股份	15,083	201,659.71	0.00
331	002831	裕同科技	8,266	201,607.74	0.00
332	000598	兴蓉环境	37,100	201,453.00	0.00
333	000883	湖北能源	44,100	201,096.00	0.00
334	600373	中文传媒	15,040	200,332.80	0.00
335	600598	北大荒	15,000	199,950.00	0.00
336	000401	冀东水泥	27,031	199,218.47	0.00
337	600038	中直股份	5,000	199,100.00	0.00
338	688185	康希诺	2,437	198,615.50	0.00

339	600208	新潮中宝	80,000	198,400.00	0.00
340	300850	新强联	5,300	198,114.00	0.00
341	002281	光迅科技	5,300	196,577.00	0.00
342	600056	中国医药	15,095	195,933.10	0.00
343	600511	国药股份	5,018	194,949.30	0.00
344	002250	联化科技	18,627	194,838.42	0.00
345	601000	唐山港	55,019	194,217.07	0.00
346	603927	中科软	5,000	192,800.00	0.00
347	688538	和辉光电	75,000	190,500.00	0.00
348	000825	太钢不锈	49,200	190,404.00	0.00
349	002423	中粮资本	23,800	190,400.00	0.00
350	603529	爱玛科技	5,900	190,098.00	0.00
351	603218	日月股份	10,000	189,900.00	0.00
352	601666	平煤股份	25,000	188,500.00	0.00
353	600378	昊华科技	5,000	188,200.00	0.00
354	688778	厦钨新能	3,800	188,100.00	0.00
355	002653	海思科	7,965	187,974.00	0.00
356	601717	郑煤机	15,092	187,895.40	0.00
357	002791	坚朗五金	2,900	187,659.00	0.00
358	003035	南网能源	26,200	186,544.00	0.00
359	600801	华新水泥	15,080	186,238.00	0.00
360	600959	江苏有线	55,050	186,069.00	0.00
361	603517	绝味食品	5,000	185,750.00	0.00
362	600282	南钢股份	55,000	185,350.00	0.00
363	601866	中远海发	75,000	185,250.00	0.00
364	002032	苏泊尔	3,700	185,000.00	0.00
365	600259	广晟有色	5,083	183,699.62	0.00
366	688006	杭可科技	6,016	183,307.52	0.00
367	600171	上海贝岭	10,000	182,500.00	0.00
368	688281	华秦科技	900	182,250.00	0.00
369	601456	国联证券	20,000	182,000.00	0.00
370	600667	太极实业	25,000	181,500.00	0.00
371	300482	万孚生物	6,810	181,350.30	0.00
372	601992	金隅集团	83,000	180,940.00	0.00
373	600906	财达证券	25,000	180,000.00	0.00
374	002468	申通快递	16,600	179,612.00	0.00
375	002511	中顺洁柔	15,900	177,285.00	0.00
376	601665	齐鲁银行	45,000	176,400.00	0.00
377	603568	伟明环保	10,060	176,150.60	0.00
378	002745	木林森	19,141	176,097.20	0.00
379	688276	百克生物	2,800	175,280.00	0.00
380	600062	华润双鹤	10,057	175,192.94	0.00
381	002266	浙富控股	42,400	175,112.00	0.00

382	600582	天地科技	30,034	175,098.22	0.00
383	601005	重庆钢铁	125,000	175,000.00	0.00
384	601098	中南传媒	15,014	174,162.40	0.00
385	000012	南玻 A	29,165	173,823.40	0.00
386	601778	晶科科技	35,000	172,900.00	0.00
387	300618	寒锐钴业	5,300	171,773.00	0.00
388	601928	凤凰传媒	15,016	171,182.40	0.00
389	603233	大参林	6,110	171,141.10	0.00
390	600517	国网英大	30,000	171,000.00	0.00
391	688520	神州细胞	3,000	170,220.00	0.00
392	688779	长远锂科	15,000	169,050.00	0.00
393	000559	万向钱潮	30,900	168,405.00	0.00
394	688289	圣湘生物	10,000	168,400.00	0.00
395	601106	中国一重	50,000	168,000.00	0.00
396	600663	陆家嘴	16,900	166,803.00	0.00
397	603225	新凤鸣	15,000	165,750.00	0.00
398	000089	深圳机场	23,800	165,410.00	0.00
399	688819	天能股份	4,473	164,785.32	0.00
400	000553	安道麦 A	19,400	163,736.00	0.00
401	600737	中粮糖业	20,017	161,136.85	0.00
402	600718	东软集团	15,082	160,774.12	0.00
403	000785	居然之家	42,000	160,020.00	0.00
404	603826	坤彩科技	3,200	160,000.00	0.00
405	001914	招商积余	10,600	159,530.00	0.00
406	000958	电投产融	36,600	158,478.00	0.00
407	600597	光明乳业	15,082	156,852.80	0.00
408	600297	广汇汽车	75,000	156,000.00	0.00
409	002399	海普瑞	13,600	155,992.00	0.00
410	603885	吉祥航空	10,026	154,701.18	0.00
411	600967	内蒙一机	15,032	151,823.20	0.00
412	603712	七一二	5,000	151,050.00	0.00
413	603883	老百姓	5,041	150,473.85	0.00
414	601231	环旭电子	10,000	149,600.00	0.00
415	688107	安路科技	2,700	149,553.00	0.00
416	601991	大唐发电	45,000	148,950.00	0.00
417	002761	浙江建投	9,800	148,764.00	0.00
418	601718	际华集团	50,000	148,500.00	0.00
419	600871	石化油服	75,000	148,500.00	0.00
420	002705	新宝股份	8,200	147,846.00	0.00
421	600566	济川药业	5,014	145,606.56	0.00
422	600315	上海家化	5,005	145,195.05	0.00
423	002081	金螳螂	31,800	143,418.00	0.00
424	688052	纳芯微	900	142,533.00	0.00

425	600022	山东钢铁	100,060	142,085.20	0.00
426	002010	传化智联	26,500	140,980.00	0.00
427	688234	天岳先进	1,900	140,486.00	0.00
428	601598	中国外运	30,000	139,800.00	0.00
429	600500	中化国际	25,081	139,450.36	0.00
430	603650	彤程新材	4,195	137,596.00	0.00
431	002110	三钢闽光	32,400	136,728.00	0.00
432	600409	三友化工	25,078	136,675.10	0.00
433	600764	中国海防	5,000	136,100.00	0.00
434	603707	健友股份	10,078	136,053.00	0.00
435	601118	海南橡胶	30,000	134,400.00	0.00
436	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
437	000898	鞍钢股份	47,700	132,606.00	0.00
438	300442	润泽科技	4,300	132,268.00	0.00
439	600126	杭钢股份	30,010	130,243.40	0.00
440	601156	东航物流	10,000	130,000.00	0.00
441	600782	新钢股份	35,000	129,850.00	0.00
442	002608	江苏国信	17,100	129,447.00	0.00
443	000563	陕国投 A	42,400	129,320.00	0.00
444	601611	中国核建	15,000	126,750.00	0.00
445	601608	中信重工	30,000	126,300.00	0.00
446	601187	厦门银行	25,000	125,500.00	0.00
447	600155	华创云信	20,000	124,400.00	0.00
448	600968	海油发展	40,000	122,800.00	0.00
449	600339	中油工程	30,000	122,100.00	0.00
450	600707	彩虹股份	25,000	119,000.00	0.00
451	001203	大中矿业	10,600	117,766.00	0.00
452	603379	三美股份	5,000	117,550.00	0.00
453	600195	中牧股份	10,055	117,442.40	0.00
454	600095	湘财股份	15,000	117,000.00	0.00
455	600507	方大特钢	25,085	116,143.55	0.00
456	600808	马钢股份	45,001	115,652.57	0.00
457	600901	江苏金租	28,000	115,640.00	0.00
458	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
459	600556	天下秀	15,000	106,350.00	0.00
460	601568	北元集团	20,000	105,400.00	0.00
461	600167	联美控股	15,050	104,898.50	0.00
462	601298	青岛港	15,000	104,550.00	0.00
463	603355	莱克电气	4,100	104,181.00	0.00
464	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
465	002925	盈趣科技	5,300	102,820.00	0.00
466	603638	艾迪精密	5,000	102,600.00	0.00
467	603866	桃李面包	10,073	101,938.76	0.00

468	000415	渤海租赁	47,700	100,170.00	0.00
469	002563	森马服饰	15,900	98,898.00	0.00
470	600377	宁沪高速	10,000	98,300.00	0.00
471	000031	大悦城	26,800	98,088.00	0.00
472	601136	首创证券	6,800	96,356.00	0.00
473	601828	美凯龙	20,000	95,800.00	0.00
474	600350	山东高速	15,008	95,600.96	0.00
475	002945	华林证券	6,900	94,392.00	0.00
476	600623	华谊集团	15,015	93,543.45	0.00
477	001872	招商港口	5,300	91,531.00	0.00
478	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
479	600995	南网储能	8,000	88,080.00	0.00
480	600928	西安银行	25,000	88,000.00	0.00
481	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
482	603786	科博达	1,300	85,410.00	0.00
483	688105	诺唯赞	2,700	82,323.00	0.00
484	600927	永安期货	5,000	81,300.00	0.00
485	600299	安迪苏	10,000	79,700.00	0.00
486	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
487	603056	德邦股份	5,000	77,100.00	0.00
488	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
489	603868	飞科电器	1,200	75,708.00	0.00
490	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
491	603317	天味食品	5,050	73,780.50	0.00
492	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
493	601139	深圳燃气	10,090	73,556.10	0.00
494	688248	南网科技	1,900	72,941.00	0.00
495	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
496	688295	中复神鹰	1,800	66,024.00	0.00
497	601969	海南矿业	10,000	65,800.00	0.00
498	601228	广州港	20,000	64,600.00	0.00
499	600032	浙江新能	5,000	62,800.00	0.00
500	601158	重庆水务	10,000	55,600.00	0.00
501	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
502	300741	华宝股份	2,300	49,266.00	0.00
503	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
504	600956	新天绿能	5,000	43,600.00	0.00
505	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
506	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
507	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
508	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
509	001227	兰州银行	10,600	30,316.00	0.00
510	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00

511	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
512	688352	硕中科技	2,361	28,497.27	0.00
513	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
514	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
515	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
516	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
517	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
518	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
519	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
520	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
521	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
522	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
523	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
524	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
525	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
526	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
527	000540	*ST 中天	95,400	13,356.00	0.00
528	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
529	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
530	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
531	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
532	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
533	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
534	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
535	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
536	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
537	601065	江盐集团	802	9,495.68	0.00
538	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
539	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
540	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
541	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
542	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
543	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
544	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
545	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
546	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
547	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
548	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
549	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
550	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
551	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
552	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
553	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00

554	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
555	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
556	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	688777	中控技术	4,009,981.20	0.04
2	603605	珀莱雅	3,583,376.60	0.04
3	688122	西部超导	3,559,808.46	0.04
4	603345	安井食品	3,318,891.00	0.04
5	688099	晶晨股份	3,286,986.03	0.04
6	600563	法拉电子	3,145,699.00	0.04
7	603688	石英股份	2,793,936.91	0.03
8	600157	永泰能源	2,650,896.00	0.03
9	603737	三棵树	2,468,180.00	0.03
10	603606	东方电缆	2,312,168.00	0.03
11	600487	亨通光电	2,284,770.00	0.03
12	600489	中金黄金	2,274,494.29	0.03
13	600536	中国软件	2,238,495.70	0.02
14	600096	云天化	2,204,695.00	0.02
15	600079	人福医药	2,182,286.00	0.02
16	601555	东吴证券	2,163,264.00	0.02
17	605358	立昂微	2,153,459.00	0.02
18	600885	宏发股份	2,108,950.00	0.02
19	600352	浙江龙盛	2,097,769.00	0.02
20	600486	扬农化工	2,057,228.00	0.02

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	688777	中控技术	3,187,206.75	0.04
2	688122	西部超导	3,019,346.51	0.03
3	603345	安井食品	2,908,681.00	0.03
4	688099	晶晨股份	2,887,932.38	0.03
5	603605	珀莱雅	2,726,970.82	0.03
6	600157	永泰能源	2,071,436.00	0.02

7	601607	上海医药	2,002,556.00	0.02
8	600536	中国软件	1,919,118.00	0.02
9	600563	法拉电子	1,858,943.73	0.02
10	601555	东吴证券	1,795,315.00	0.02
11	600487	亨通光电	1,746,480.00	0.02
12	601699	潞安环能	1,732,658.00	0.02
13	600079	人福医药	1,691,228.51	0.02
14	601058	赛轮轮胎	1,578,280.00	0.02
15	600415	小商品城	1,576,131.01	0.02
16	601872	招商轮船	1,564,379.90	0.02
17	600885	宏发股份	1,558,129.00	0.02
18	600026	中远海能	1,554,233.00	0.02
19	601108	财通证券	1,520,668.00	0.02
20	601077	渝农商行	1,507,412.00	0.02

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	363,636,840.69
卖出股票收入（成交）总额	280,740,563.20

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	525,589,090.24	5.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,659,381.04	0.02
	其中：政策性金融债	1,659,381.04	0.02
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	527,248,471.28	5.90

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	019679	22 国债 14	1,689,000	171,936,636.90	1.92
2	019703	23 国债 10	1,157,000	116,308,930.69	1.30
3	019670	22 国债 05	946,000	95,462,881.59	1.07
4	019638	20 国债 09	859,000	87,913,095.92	0.98
5	019694	23 国债 01	394,000	39,837,199.67	0.45

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	8,345,716,931.22	93.31

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	331,223.47
2	应收清算款	323,303.27
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,313,873.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,968,400.56

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	682,186	7,431.59	175,087,023 .74	3.45%	4,894,637,5 33.14	96.55%
南方中证 500ETF 联 接 (LOF) C	42,987	8,303.39	101,962,872 .38	28.57%	254,974,794 .25	71.43%
合计	725,173	7,483.27	277,049,896 .12	5.11%	5,149,612,3 27.39	94.89%

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	潘建阳	1,143,107.00	1.50%
2	于永祥	926,627.00	1.21%
3	郭思含	660,932.00	0.86%
4	薛宜平	636,487.00	0.83%
5	杨钢	551,900.00	0.72%
6	姚红伟	529,900.00	0.69%
7	黄小华	502,849.00	0.66%
8	浙江省壹拾贰号职业年金计划-中信 银行	483,472.00	0.63%
9	李鹏	471,000.00	0.62%
10	解强	369,400.00	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	3,781,618.80	0.0746%
	南方中证 500ETF 联 接 (LOF) C	131,070.70	0.0367%
	合计	3,912,689.50	0.0721%

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
	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	50~100
	南方中证 500ETF 联接(LOF) C	0
	合计	50~100

§ 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	5,192,344,063.66	419,365,659.65
本报告期基金总申购份额	814,606,098.02	603,572,804.51
减：报告期基金总赎回份额	937,225,604.80	666,000,797.53
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	5,069,724,556.88	356,937,666.63

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

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	479,439,463.79	76.14%	47,944.13	76.12%	-
华泰证券	2	150,254,322.40	23.86%	15,026.84	23.86%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	18,015.60	0.00%	16.61	0.03%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	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

退租交易单元：

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	222,681,966.28	84.34%	3,756,680,000.00	95.88%	-	-	1,875,052,309.74	100.00%
华泰证券	2,003,200.00	0.76%	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	39,346,810.00	14.90%	161,400,000.00	4.12%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-

英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	南方基金关于旗下部分基金增加兴业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	2023-01-17
2	南方基金关于旗下部分基金增加国金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	2023-02-03
3	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	2023-03-01
4	南方基金管理股份有限公司关于凤凰金信（海口）基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	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	2023-03-13
5	南方基金管理股份有限公司关于凤凰金信（海口）基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	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	2023-03-16
6	南方基金关于旗下部分基金增加招商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	2023-03-17
7	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	2023-03-22
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	2023-04-15
9	南方基金关于旗下部分基金增加红塔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	2023-04-25
10	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	2023-04-29
11	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	2023-05-10
12	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	2023-06-03

		会基金电子披露网站	
13	关于南方基金管理股份有限公司旗下基金调整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	2023-06-10
14	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	2023-06-15
15	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	2023-06-21
16	南方基金关于继续开展直销柜台部分基金赎回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	2023-06-29

§ 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) 2023 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>