

南方沪深 300 交易型开放式指数证券 投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
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	12
§6 中期财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
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	53
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	53

7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§9 开放式基金份额变动	56
§10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方沪深 300ETF
场内简称	沪深 300ETF 南方
基金主代码	159925
交易代码	159925
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 18 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	522,320,856.00 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	2013 年 4 月 11 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用指数复制法，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。基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。 本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数：沪深 300 指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用指数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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95588

传真	0755-82763889	(010) 66105798
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码	518017	100140
法定代表人	周易	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	339,455,034.51
本期利润	231,323,366.35
加权平均基金份额本期利润	0.4187
本期加权平均净值利润率	8.76%
本期基金份额净值增长率	8.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,461,938,724.11
期末可供分配基金份额利润	2.7989
期末基金资产净值	2,645,058,685.68
期末基金份额净值	5.0640
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	153.16%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	12.93%	1.25%	11.90%	1.26%	1.03%	-0.01%
过去六个月	8.78%	1.13%	7.55%	1.13%	1.23%	0.00%
过去一年	29.81%	1.02%	26.51%	1.02%	3.30%	0.00%
过去三年	40.04%	1.11%	29.59%	1.11%	10.45%	0.00%
过去五年	7.98%	1.12%	-4.68%	1.12%	12.66%	0.00%
过去七年	62.06%	1.16%	30.16%	1.17%	31.90%	-0.01%
过去十年	111.80%	1.15%	57.88%	1.15%	53.92%	0.00%
自基金合同 生效起至今	153.16%	1.34%	81.90%	1.35%	71.26%	-0.01%

3.2.2 自基金转型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

南方沪深300ETF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：本基金自 2013 年 2 月 18 日起由开元证券投资基金转型而来。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理	证券	说明
----	----	-----------	----	----

		(助理) 期限		从业 年限	
		任职日期	离任日期		
罗文杰	本基金 基金经 理	2013 年 5 月 17 日	-	21 年	中国国籍，女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月 17 日至 2015 年 6 月 16 日，任南方策略基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2019 年 4 月 18 日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 3 月 27 日，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至 2020 年 3 月 27 日，任南方 H 股联接基金经理；2014 年 10 月 30 日至 2020 年 12 月 23 日，任 500 医药基金经理；2021 年 3 月 12 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理；2021 年 10 月 22 日至 2023 年 2 月 24 日，任南方中证全指医疗保健 ETF 基金经理；2020 年 12 月 25 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方策略基金经理；2021 年 7 月 2 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方中证香港科技 ETF（QDII）基金经理；2022 年 6 月 17 日至 2023 年 8 月 25 日，任南方恒生香港上市生物科技 ETF（QDII）基金经理；2023 年 5 月 30 日至 2024 年 7 月 5 日，任南方恒生香港上市生物科技 ETF 发起联接（QDII）基金经理；2024 年 7 月 5 日至 2025 年 7 月 25 日，任南方基金南方东英沙特阿拉伯 ETF（QDII）基金经理；2024 年 11 月 4 日至 2025 年 12 月 5 日，任南方中证沪深港黄金产业股票指数发起基金经理；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；2024 年 6 月 26 日至今，任南方中证国新港股通央企红利 ETF 基金经理；2024 年 9 月 12 日至今，任南方港股通央企红利 ETF 联接基金经理；2025 年 6 月 30 日至今，任南方中证港股通科技 ETF 基金经理；2025 年 9 月 18 日至今，任南方中证港股通科技 ETF 发起联接基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券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	61,288,011,599.50	2013 年 04 月 22 日
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	1	922,311,474.24	2026 年 03 月 12 日
	合计	15	62,210,323,073.74	-

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》及其他有关法律法规的规定及本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公

平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 24 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，沪深 300 指数涨 7.55%。作为 A 股核心宽基指数的代表，现下沪深 300 指数市盈率为 15 倍左右，位列全球主要市场末端，未来估值修复空间较大。

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) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；

(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，本基金份额净值为 5.0640 元，报告期内，份额净值增长率为 8.78%，同期业绩基准增长率为 7.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年还是比较乐观的，一是国内整体经济温和复苏，6 月 PPI 转正至 4.1%，工业利润 1-6 月累计同比高增 18% 以上，“十五五”开局叠加“反内卷”与再通胀双轮驱动，慢牛下半场的盈利基础比 2025 年更扎实。二是流动性结构在持续优化，支撑 A 股成为全球波动中“更安全的避风港”，人民币汇率稳中偏强也有助于外资持续加配。三是产业主线极为清晰：

Agent 时代到来推动 AI PCB、存储涨价、光模块、算力硬件景气持续验证。综合来看，指数在科技板块推动下有望温和上行，下半年仍具备重返高点并向上打开空间的条件。作为 A 股核心宽基指数的代表，沪深 300 指数市盈率及市净率现下位列全球主要市场末端，持续估值修复的空间较大。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括财务负责人、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、指数研究部总经理、现金及债券指数投资部总经理、国际投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。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 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	22,457,484.04	8,963,418.48
结算备付金		84,927,221.47	3,760,360.35
存出保证金		16,153,225.12	2,149,051.90
交易性金融资产	6.4.7.2	2,519,114,116.45	2,731,353,762.66
其中：股票投资		2,519,113,116.39	2,731,353,762.66
基金投资		-	-
债券投资		1,000.06	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		9,850,278.69	3,121,733.73
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,652,502,325.77	2,749,348,327.12
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		812,719.14	27,896.60
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		320,180.55	356,827.92
应付托管费		106,726.84	118,942.62
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	6,204,013.56	7,167,793.12
负债合计		7,443,640.09	7,671,460.26
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,183,119,961.57	1,333,977,022.96
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	1,461,938,724.11	1,407,699,843.90
净资产合计		2,645,058,685.68	2,741,676,866.86
负债和净资产总计		2,652,502,325.77	2,749,348,327.12

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 5.0640 元，基金份额总额 522,320,856.00 份。

6.2 利润表

会计主体：南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		234,043,412.55	41,697,105.40
1.利息收入		214,213.62	53,871.30
其中：存款利息收入	6.4.7.9	214,213.62	53,871.30
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		341,392,861.46	204,358,253.88
其中：股票投资收益	6.4.7.10	314,897,420.92	155,650,108.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	0.06	93,180.34
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	2,255,312.80	-537,447.73
股利收益	6.4.7.14	24,240,127.68	49,152,412.41
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.15	-108,131,668.16	-165,400,202.15
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.16	568,005.63	2,685,182.37
减：二、营业总支出		2,720,046.20	4,704,747.07
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,964,468.90	3,217,135.54
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	654,822.92	1,072,378.58
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-

7.税金及附加		16,108.82	0.18
8.其他费用	6.4.7.18	84,645.56	415,232.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		231,323,366.35	36,992,358.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		231,323,366.35	36,992,358.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		231,323,366.35	36,992,358.33

6.3 净资产变动表

会计主体：南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,333,977,022.96	-	1,407,699,843.90	2,741,676,866.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,333,977,022.96	-	1,407,699,843.90	2,741,676,866.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-150,857,061.39	-	54,238,880.21	-96,618,181.18
（一）、综合收益总额	-	-	231,323,366.35	231,323,366.35
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-150,857,061.39	-	-177,084,486.14	-327,941,547.53
其中：1.基金申购款	1,133,466,569.53	-	1,260,006,995.43	2,393,473,564.96
2.基金赎回款	-1,284,323,630.92	-	-1,437,091,481.57	-2,721,415,112.49
（三）、本期向基金份额持有	-	-	-	-

人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,183,119,961.57	-	1,461,938,724.11	2,645,058,685.68
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,950,593,910.30	-	2,200,888,001.93	5,151,481,912.23
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,950,593,910.30	-	2,200,888,001.93	5,151,481,912.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-923,489,848.64	-	-643,404,616.20	-1,566,894,464.84
（一）、综合收益总额	-	-	36,992,358.33	36,992,358.33
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-923,489,848.64	-	-680,396,974.53	-1,603,886,823.17
其中：1.基金申购款	462,764,228.77	-	326,233,377.79	788,997,606.56
2.基金赎回款	-1,386,254,077.41	-	-1,006,630,352.32	-2,392,884,429.73
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,027,104,061.6	-	1,557,483,385.7	3,584,587,447.3

资产	6		3	9
----	---	--	---	---

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____杨小松____	____蔡忠评____	____徐超____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(原名为“南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金”，以下简称“本基金”)是根据原开元证券投资基金(以下简称“基金开元”)基金份额持有人大会 2013 年 1 月 4 日决议通过的《关于开元证券投资基金转型有关事项的议案》，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]61 号《关于核准开元证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》核准，由原基金基金开元转型而来。原基金基金开元为契约型封闭式基金，于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市，存续期限为 15 年期，至 2013 年 3 月 27 日止。根据深交所深证上[2013]55 号《终止上市通知书》，原基金基金开元于 2013 年 2 月 8 日提前终止上市权利登记。自 2013 年 2 月 18 日起，原基金基金开元终止上市，并更名为南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)。原《开元证券投资基金基金合同》失效，《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期间不定。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司，已于 2018 年 1 月 4 日办理完成工商变更登记)，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

原基金基金开元于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 1,853,841,542.50 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《关于南方开元沪深 300ETF 基金集中申购结果和原基金开元份额折算结果的公告》的有关规定，本基金以 2013 年 3 月 11 日为基金份额折算基准日对投资人持有的原基金基金开元份额进行了折算，折算比例为 0.876726296，并于 2013 年 3 月 13 日完成了变更登记。

本基金于基金合同生效后自 2013 年 2 月 25 日至 2013 年 3 月 11 日期间内开放集中申购，共募集人民币 2,205,746,859.00 元(含集中申购募集股票市值)，其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息 69,869.00 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 146 号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2013 年 3 月 11 日基金份额折算后的基金份额净值 1.0000 元折合为 2,205,746,859.00 份基金份额，其中包括集中申购资金利息折合的 69,869.00 份基金份额，并于 2013 年 3 月 15 日进行了确认登记。

经深交所深证上[2013]111 号审核同意，本基金 3,959,199,451.00 份基金份额于 2013 年 4 月 11 日在深交所挂牌交易。

根据《关于南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金更名的公告》，自 2019 年 4 月 23 日起，南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更名为南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金。

根据《南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《南方基金管理股份有限公司关于南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额合并结果的公告》的有关规定，本基金的基金管理人确定 2024 年 1 月 26 日为本基金的基金份额合并日。当日合并前基金份额总额为 1,357,199,451.00 份，基金份额净值为 1.6786 元。根据基金份额合并公式，基金份额合并比例为 0.503545799，合并后基金份额总额为 683,420,856.00 份，基金份额净值为 3.3335 元。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述合并比例，对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了合并，并于 2024 年 1 月 26 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数沪深 300 指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。本基金主要投资于标的指数的成份股和备选成份股；为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票以及存托凭证）、一级市场新股或增发的股票（含存托凭证）、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数。

本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司以本基金为目标 ETF，根据《南方沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的约定于 2013 年 4 月 17 日召开基金份额持有人大会审议通过《关于南方沪深 300 指数证券投资基金变更投资范围及其相关事项的议案》，并经中国证监会证监许可[2013]674 号《关于核准南方沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金投资范围等事项决议的批复》核准，于 2013 年 5 月 16 日将管理的南方沪深 300 指数证券投资基金变更为南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原名为“南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，以下简称“南方沪深 300ETF 联接基金”）。南方沪深 300ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

本基金的主要税项列示如下：

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息

收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	22,457,484.04
等于：本金	22,454,536.13
加：应计利息	2,947.91
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	22,457,484.04

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,268,225,211.43	-	2,519,113,116.39	250,887,904.96
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券 交易所	1,000.00	0.06	1,000.06	-

	市场				
	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	1,000.00	0.06	1,000.06	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,268,226,211.43	0.06	2,519,114,116.45	250,887,904.96

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	120,672,648.00	-	-	-
-股指期货	120,672,648.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	120,672,648.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2607	IF2607	2.00	2,953,200.00	155,952.00
IF2609	IF2609	84.00	122,214,960.00	4,339,560.00
合计				4,495,512.00
减：可抵销期货暂收款				4,495,512.00
净额				0.00

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的利率/货币/权益/其他衍生工具为国债/外汇/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债/外汇/股指/商品期货投资合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债/外汇/股指/商品期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	207,775.82
其中：交易所市场	207,775.82
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	5,158,590.68
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	-
可退替代款	3,344.50
合计	6,204,013.56

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	588,920,856.00	1,333,977,022.96
本期申购	500,400,000.00	1,133,466,569.53
本期赎回（以“-”号填列）	-567,000,000.00	-1,284,323,630.92
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	522,320,856.00	1,183,119,961.57

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

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,254,698,852.70	-846,999,008.80	1,407,699,843.90
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	2,254,698,852.70	-846,999,008.80	1,407,699,843.90
本期利润	339,455,034.51	-108,131,668.16	231,323,366.35
本期基金份额交易产生的变动数	-272,057,351.67	94,972,865.53	-177,084,486.14
其中：基金申购款	2,067,822,775.63	-807,815,780.20	1,260,006,995.43
基金赎回款	-2,339,880,127.30	902,788,645.73	-1,437,091,481.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,322,096,535.54	-860,157,811.43	1,461,938,724.11

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	38,471.61
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	173,808.36
其他	1,933.65
合计	214,213.62

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	148,571,040.45
股票投资收益——赎回差价收入	166,326,380.47
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	314,897,420.92

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,926,483,240.48
减：卖出股票成本总额	1,776,356,848.26
减：交易费用	1,555,351.77
买卖股票差价收入	148,571,040.45

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

赎回基金份额对价总额	2,721,415,112.49
减：现金支付赎回款总额	1,613,017,284.49
减：赎回股票成本总额	942,071,447.53
减：交易费用	-
赎回差价收入	166,326,380.47

6.4.7.10.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	0.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	0.06

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	2,255,312.80

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	24,240,127.68
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	24,240,127.68

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-112,350,820.16
——股票投资	-112,350,820.16
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	4,219,152.00
——权证投资	-
——期货投资	4,219,152.00
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	-108,131,668.16

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	568,005.63
合计	568,005.63

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

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	343.00
合计	84,645.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人
南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（南方沪深 300ETF 联接）	本基金的基金管理人管理的其他基金
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
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	459,352,790.12	12.72%	28,963,894.89	1.23%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	-	-	228,348.65	32.13%

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	45,884.51	12.72%	44,825.31	21.57%
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	2,893.57	1.23%	1,085.72	1.12%

注：1. 上述佣金费率参考市场价格确定。

2. 该类佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（中国证券监督管理委员会公告〔2024〕3 号）相关规定。《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》生效后，被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,964,468.90	3,217,135.54
其中：应支付销售机构的客户维护费	51,591.01	80,586.44
应支付基金管理人的净管理费	1,912,877.89	3,136,549.10

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% ÷ 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	654,822.92	1,072,378.58

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券股份有限公司	1,210,628.00	0.23%	608,494.00	0.10%
兴业证券股份有限公司	185,849.00	0.04%	443,307.00	0.08%
中国工商银行－南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接	320,932,176.00	61.44%	393,993,176.00	66.90%

基金				
----	--	--	--	--

注：本基金其他关联方投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	22,457,484.04	38,471.61	9,222,271.41	16,404.33

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	603293	埃泰克	网下申购	716	23,978.84

上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	301458	钧崑电子	网下申购	7,005	72,852.00
华泰联合	603014	威高血净	网下申购	2,045	54,192.50
华泰联合	688757	胜科纳米	网下申购	5,357	48,641.56

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于本期末，本基金持有关联方华泰证券、兴业证券、中国工商银行发行的普通股，成本总额为人民币 34,206,299.64 元，估值总额为人民币 34,746,641.88 元，占本基金基金净资产的比例为 1.31%（于上期末，本基金持有关联方华泰证券、兴业证券、中国工商银行发行的普通股，成本总额为人民币 39,622,061.90 元，估值总额为人民币 48,137,502.24 元，占本基金基金净资产的比例为 1.76%）。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

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

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688521	芯原股份	2026 年 6 月 24 日	6 个月	大宗受限锁定	264.79	322.11	15,000	3,971,850.00	4,831,650.00	-
002938	鹏鼎控股	2026 年 5 月 22 日	6 个月	大宗受限锁定	92.59	94.95	31,700	2,935,103.00	3,009,915.00	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定期	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内(含)	新股未上市	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定期	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定期	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定期	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定期	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股锁定期	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定期	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026 年	6 个月	新股锁	26.28	172.0	234	6,149.52	40,269.06	-

		3 月 24 日		定期		9				
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁定期	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁定期	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
688811	有研新材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定期	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定期	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定期	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定期	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定期	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股锁定期	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定期	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁定期	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-

301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	78.38	121.7 7	96	7,524.48	11,689.92	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁 定期	22.68	47.61	217	4,921.56	10,331.37	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
920193	吉和昌	2026 年 6 月 18 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
920189	康美特	2026 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	8.14	8.14	200	1,628.00	1,628.00	-
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代 码	证券名称	成功认 购日	受限期	流通受 限类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 (单 位:张)	期末成本总 额	期末估值总 额	备 注
118070	南芯转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月 内(含)	新债未 上市	100.0 0	100.0 1	10	1,000.00	1,000.06	-

6.4.12.2 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	股票	停牌日期	停牌	期末	复牌	复牌开	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-----	----	------	----	----	----	-----	-------	--------	--------	----

码	名称		原因	估值 单价	日期	盘单价				
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	17,827	11,753,647.06	14,832,064.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是被动式指数基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。紧密跟踪沪深 300 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪沪深 300 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和

出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在此可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	22,457,484.04	-	-	-	22,457,484.04
结算备付金	84,927,221.4	-	-	-	84,927,221.4

	7				7
存出保证金	1,133,045.92	-	-	15,020,179.20	16,153,225.12
交易性金融资产	-	-	1,000.06	2,519,113,116.39	2,519,114,116.45
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	-	-	-	9,850,278.69	9,850,278.69
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	108,517,751.43	-	1,000.06	2,543,983,574.28	2,652,502,325.77
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	812,719.14	812,719.14
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	320,180.55	320,180.55
应付托管费	-	-	-	106,726.84	106,726.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	6,204,013.56	6,204,013.56
负债总计	-	-	-	7,443,640.09	7,443,640.09
利率敏感度缺口	108,517,751.43	-	1,000.06	2,536,539.934.19	2,645,058.685.68
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	8,963,418.48	-	-	-	8,963,418.48
结算备付金	3,760,360.35	-	-	-	3,760,360.35
存出保证金	989,751.10	-	-	1,159,300.80	2,149,051.90
交易性金融资产	-	-	-	2,731,353.762.66	2,731,353.762.66
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	-	-	-	3,121,733.73	3,121,733.73
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,713,529.93	-	-	2,735,634.797.19	2,749,348.327.12
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	27,896.60	27,896.60
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	356,827.92	356,827.92
应付托管费	-	-	-	118,942.62	118,942.62

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	7,167,793.12	7,167,793.12
负债总计	-	-	-	7,671,460.26	7,671,460.26
利率敏感度缺口	13,713,529.93	-	-	2,727,963,336.93	2,741,676,866.86

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,519,113,116.39	95.24	2,731,353,762.66	99.62
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	1,000.06	0.00	-	-
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	2,519,114,116.45	95.24	2,731,353,762.66	99.62

注：1、交易性金融资产-债券投资项目仅包含可转换公司债券或可交换公司债券。

2、其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注“衍生金融资产/负债”）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2026 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2025 年 12 月 31 日 ）
	1.组合自身基准上升 5%	131,503,250.96	136,748,423.22
	2.组合自身基准下降 5%	-131,503,250.96	-136,748,423.22

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	2,493,538,706.91
第二层次	15,687,539.50
第三层次	9,887,870.04
合计	2,519,114,116.45

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,519,113,116.39	94.97
	其中：股票	2,519,113,116.39	94.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,000.06	0.00
	其中：债券	1,000.06	0.00
	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	107,384,705.51	4.05
8	其他各项资产	26,003,503.81	0.98
9	合计	2,652,502,325.77	100.00

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

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	14,328,636.53	0.54
B	采矿业	105,356,834.10	3.98
C	制造业	1,612,378,055.08	60.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	62,503,562.60	2.36
E	建筑业	28,681,253.82	1.08
F	批发和零售业	3,714,463.36	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	60,989,309.37	2.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	135,556,757.06	5.12
J	金融业	440,722,824.49	16.66
K	房地产业	8,267,218.27	0.31
L	租赁和商务服务业	11,461,845.36	0.43
M	科学研究和技术服务业	27,376,636.25	1.04
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,412,098.62	0.13
R	文化、体育和娱乐业	1,462,771.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	2,516,212,265.91	95.13

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	36,149.82	0.00
C	制造业	2,012,755.76	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	850,291.44	0.03
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,900,780.48	0.11

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	99,186	125,966,220.00	4.76
2	300750	宁德时代	235,480	92,545,994.80	3.50
3	300502	新易盛	124,184	75,379,688.00	2.85
4	600519	贵州茅台	55,691	66,021,123.59	2.50
5	603986	兆易创新	59,408	48,417,520.00	1.83
6	601318	中国平安	948,349	45,274,181.26	1.71
7	688256	寒武纪	28,072	44,790,279.60	1.69
8	600036	招商银行	1,101,130	39,090,115.00	1.48
9	601899	紫金矿业	1,469,287	36,937,875.18	1.40
10	002371	北方华创	38,349	33,921,991.44	1.28
11	000333	美的集团	432,110	32,637,268.30	1.23
12	002475	立讯精密	453,460	31,923,584.00	1.21
13	688008	澜起科技	101,839	31,559,906.10	1.19
14	688012	中微公司	66,486	31,148,691.00	1.18
15	688041	海光信息	82,417	30,519,015.10	1.15
16	002384	东山精密	114,000	29,907,900.00	1.13

17	600900	长江电力	1,088,303	28,807,380.41	1.09
18	688981	中芯国际	180,576	28,679,080.32	1.08
19	000725	京东方 A	3,233,682	28,068,359.76	1.06
20	603259	药明康德	219,875	27,376,636.25	1.04
21	601138	工业富联	353,100	25,476,165.00	0.96
22	600030	中信证券	868,107	24,940,714.11	0.94
23	601166	兴业银行	1,505,085	24,924,207.60	0.94
24	300059	东方财富	1,125,466	22,936,997.08	0.87
25	600183	生益科技	129,900	22,524,660.00	0.85
26	600276	恒瑞医药	397,192	20,669,871.68	0.78
27	300274	阳光电源	129,060	20,523,121.20	0.78
28	601398	工商银行	2,877,300	20,342,511.00	0.77
29	300408	三环集团	119,280	19,907,832.00	0.75
30	002594	比亚迪	241,933	19,282,060.10	0.73
31	300476	胜宏科技	54,200	18,776,506.00	0.71
32	601211	国泰海通	1,009,602	18,374,756.40	0.69
33	002463	沪电股份	119,800	18,305,440.00	0.69
34	300394	天孚通信	58,256	17,632,926.08	0.67
35	000988	华工科技	89,300	16,485,673.00	0.62
36	301308	江波龙	22,700	15,976,260.00	0.60
37	600176	中国巨石	213,511	15,560,681.68	0.59
38	601288	农业银行	2,555,374	15,511,120.18	0.59
39	601328	交通银行	2,372,434	15,254,750.62	0.58
40	000651	格力电器	398,564	14,946,150.00	0.57
41	688072	拓荆科技	17,827	14,832,064.00	0.56
42	600522	中天科技	242,400	14,708,832.00	0.56
43	600919	江苏银行	1,305,520	14,073,505.60	0.53
44	688521	芯原股份	39,589	13,957,611.46	0.53
45	603019	中科曙光	130,056	13,945,904.88	0.53
46	603993	洛阳钼业	776,430	13,626,346.50	0.52
47	600150	中国船舶	401,664	13,572,226.56	0.51
48	600887	伊利股份	562,636	13,480,758.56	0.51
49	600584	长电科技	127,334	13,185,435.70	0.50
50	000338	潍柴动力	477,960	13,024,410.00	0.49
51	000858	五粮液	172,678	12,778,172.00	0.48
52	601816	京沪高铁	2,610,900	11,827,377.00	0.45
53	600309	万华化学	167,093	11,430,832.13	0.43
54	300124	汇川技术	168,274	11,161,614.42	0.42
55	002415	海康威视	325,359	11,127,277.80	0.42
56	002916	深南电路	24,050	11,012,495.00	0.42
57	600111	北方稀土	224,594	10,791,741.70	0.41
58	000100	TCL 科技	1,849,229	10,762,512.78	0.41
59	601688	华泰证券	519,000	10,701,780.00	0.40

60	000063	中兴通讯	286,175	10,356,673.25	0.39
61	600000	浦发银行	1,184,619	10,199,569.59	0.39
62	600089	特变电工	448,595	10,093,387.50	0.38
63	601857	中国石油	1,157,243	10,044,869.24	0.38
64	002028	思源电气	55,320	9,570,360.00	0.36
65	601088	中国神华	244,130	9,530,835.20	0.36
66	300433	蓝思科技	176,786	9,486,336.76	0.36
67	600031	三一重工	527,431	9,114,007.68	0.34
68	300014	亿纬锂能	135,200	8,792,056.00	0.33
69	002050	三花智控	198,966	8,720,679.78	0.33
70	002142	宁波银行	293,205	8,705,256.45	0.33
71	601601	中国太保	304,164	8,674,757.28	0.33
72	000001	平安银行	860,511	8,648,135.55	0.33
73	000792	盐湖股份	281,900	8,510,561.00	0.32
74	002714	牧原股份	242,287	8,477,622.13	0.32
75	600549	厦门钨业	98,700	8,409,240.00	0.32
76	002353	杰瑞股份	54,600	8,326,500.00	0.31
77	600406	国电南瑞	354,500	8,100,325.00	0.31
78	601668	中国建筑	1,833,262	7,956,357.08	0.30
79	000657	中钨高新	80,900	7,743,748.00	0.29
80	601229	上海银行	882,914	7,663,693.52	0.29
81	601919	中远海控	560,820	7,436,473.20	0.28
82	002602	世纪华通	522,631	7,369,097.10	0.28
83	300760	迈瑞医疗	53,800	7,307,654.00	0.28
84	601988	中国银行	1,270,955	7,269,862.60	0.27
85	601939	建设银行	751,924	7,241,028.12	0.27
86	603501	豪威集团	75,595	7,170,185.75	0.27
87	600660	福耀玻璃	141,869	7,155,872.36	0.27
88	601728	中国电信	1,377,900	7,151,301.00	0.27
89	600016	民生银行	2,203,824	7,096,313.28	0.27
90	601225	陕西煤业	346,710	7,055,548.50	0.27
91	601012	隆基绿能	537,583	7,053,088.96	0.27
92	002230	科大讯飞	170,607	6,967,589.88	0.26
93	600999	招商证券	329,472	6,951,859.20	0.26
94	600941	中国移动	80,100	6,899,013.00	0.26
95	600690	海尔智家	333,106	6,798,693.46	0.26
96	002352	顺丰控股	212,700	6,649,002.00	0.25
97	601985	中国核电	729,800	6,590,094.00	0.25
98	002460	赣锋锂业	100,210	6,553,734.00	0.25
99	600926	杭州银行	451,300	6,521,285.00	0.25
100	002709	天赐材料	126,774	6,519,986.82	0.25
101	002938	鹏鼎控股	64,900	6,508,531.00	0.25
102	603799	华友钴业	134,716	6,501,394.16	0.25

103	601169	北京银行	1,313,449	6,435,900.10	0.24
104	300033	同花顺	26,620	6,415,420.00	0.24
105	000977	浪潮信息	91,336	6,393,520.00	0.24
106	600160	巨化股份	120,000	6,361,200.00	0.24
107	000776	广发证券	261,169	6,111,354.60	0.23
108	300442	润泽科技	73,025	6,066,186.75	0.23
109	000425	徐工机械	727,585	5,886,162.65	0.22
110	688126	沪硅产业	146,741	5,853,498.49	0.22
111	300498	温氏股份	474,920	5,851,014.40	0.22
112	000938	紫光股份	202,495	5,844,005.70	0.22
113	002202	金风科技	244,300	5,838,770.00	0.22
114	601600	中国铝业	703,639	5,783,912.58	0.22
115	600028	中国石化	1,291,957	5,762,128.22	0.22
116	600938	中国海油	212,204	5,761,338.60	0.22
117	600460	士兰微	104,300	5,701,038.00	0.22
118	688082	盛美上海	13,064	5,643,648.00	0.21
119	002466	天齐锂业	91,540	5,613,232.80	0.21
120	601766	中国中车	1,079,068	5,611,153.60	0.21
121	002600	领益智造	323,500	5,609,490.00	0.21
122	600050	中国联通	1,397,789	5,591,156.00	0.21
123	300661	圣邦股份	38,374	5,505,901.52	0.21
124	601009	南京银行	549,309	5,432,666.01	0.21
125	002837	英维克	67,900	5,402,124.00	0.20
126	002049	紫光国微	60,320	5,353,400.00	0.20
127	601628	中国人寿	147,653	5,219,533.55	0.20
128	002179	中航光电	112,930	5,217,366.00	0.20
129	601100	恒立液压	47,572	5,116,844.32	0.19
130	000568	泸州老窖	65,534	5,080,195.68	0.19
131	601872	招商轮船	287,100	5,044,347.00	0.19
132	002241	歌尔股份	220,264	4,962,547.92	0.19
133	603288	海天味业	148,560	4,926,249.60	0.19
134	601006	大秦铁路	1,057,406	4,874,641.66	0.18
135	000408	藏格矿业	69,800	4,838,536.00	0.18
136	601658	邮储银行	978,200	4,822,526.00	0.18
137	605117	德业股份	45,025	4,780,754.50	0.18
138	601818	光大银行	1,647,585	4,761,520.65	0.18
139	600809	山西汾酒	43,280	4,733,533.60	0.18
140	600905	三峡能源	1,267,700	4,703,167.00	0.18
141	688396	华润微	48,177	4,699,666.35	0.18
142	600489	中金黄金	257,900	4,655,095.00	0.18
143	601888	中国中免	86,456	4,643,551.76	0.18
144	600893	航发动力	120,941	4,636,877.94	0.18
145	002625	光启技术	152,500	4,623,800.00	0.17

146	000630	铜陵有色	713,534	4,538,076.24	0.17
147	688111	金山办公	21,045	4,483,637.25	0.17
148	600010	包钢股份	2,007,286	4,476,247.78	0.17
149	601127	赛力斯	72,800	4,459,000.00	0.17
150	601689	拓普集团	78,800	4,445,896.00	0.17
151	601336	新华保险	74,317	4,433,752.22	0.17
152	600958	东方证券	466,188	4,400,814.72	0.17
153	688271	联影医疗	43,348	4,388,118.04	0.17
154	600019	宝钢股份	802,285	4,356,407.55	0.16
155	002027	分众传媒	896,540	4,339,253.60	0.16
156	600118	中国卫星	52,300	4,291,215.00	0.16
157	600760	中航沈飞	100,277	4,121,384.70	0.16
158	000807	云铝股份	185,046	4,096,918.44	0.15
159	601838	成都银行	225,900	3,998,430.00	0.15
160	600362	江西铜业	91,895	3,979,053.50	0.15
161	600104	上汽集团	406,641	3,968,816.16	0.15
162	600989	宝丰能源	195,000	3,964,350.00	0.15
163	688183	生益电子	29,869	3,954,655.60	0.15
164	300450	先导智能	96,746	3,939,497.12	0.15
165	601727	上海电气	559,400	3,915,800.00	0.15
166	600875	东方电气	135,300	3,892,581.00	0.15
167	002001	新和成	136,002	3,865,176.84	0.15
168	601825	沪农商行	514,000	3,849,860.00	0.15
169	002422	科伦药业	98,600	3,798,072.00	0.14
170	601390	中国中铁	908,492	3,788,411.64	0.14
171	000538	云南白药	79,304	3,756,630.48	0.14
172	601995	中金公司	103,900	3,755,985.00	0.14
173	603296	华勤技术	50,556	3,754,794.12	0.14
174	600547	山东黄金	161,324	3,724,971.16	0.14
175	601377	兴业证券	612,972	3,702,350.88	0.14
176	600795	国电电力	791,230	3,695,044.10	0.14
177	603893	瑞芯微	19,300	3,635,348.00	0.14
178	600015	华夏银行	568,323	3,631,583.97	0.14
179	600585	海螺水泥	212,753	3,606,163.35	0.14
180	601669	中国电建	764,242	3,591,937.40	0.14
181	601916	浙商银行	1,349,000	3,547,870.00	0.13
182	002648	卫星化学	150,920	3,545,110.80	0.13
183	000166	申万宏源	804,991	3,541,960.40	0.13
184	601698	中国卫通	116,500	3,524,125.00	0.13
185	300316	晶盛机电	58,343	3,523,917.20	0.13
186	300015	爱尔眼科	413,087	3,412,098.62	0.13
187	600346	恒力石化	189,660	3,358,878.60	0.13
188	601066	中信建投	115,400	3,354,678.00	0.13

189	601868	中国能建	1,239,300	3,308,931.00	0.13
190	600482	中国动力	100,600	3,299,680.00	0.12
191	601998	中信银行	475,532	3,295,436.76	0.12
192	002311	海大集团	73,200	3,265,452.00	0.12
193	002558	巨人网络	118,200	3,257,592.00	0.12
194	300418	昆仑万维	79,400	3,204,584.00	0.12
195	600066	宇通客车	118,500	3,176,985.00	0.12
196	000625	长安汽车	440,035	3,155,050.95	0.12
197	600426	华鲁恒升	131,900	3,155,048.00	0.12
198	002532	天山铝业	287,700	3,087,021.00	0.12
199	600221	海航控股	2,274,600	3,070,710.00	0.12
200	000157	中联重科	440,143	3,067,796.71	0.12
201	688036	传音控股	50,873	2,998,963.35	0.11
202	300803	指南针	32,400	2,970,108.00	0.11
203	600011	华能国际	390,200	2,961,618.00	0.11
204	600048	保利发展	638,809	2,957,685.67	0.11
205	605499	东鹏饮料	23,810	2,938,868.30	0.11
206	600438	通威股份	242,000	2,930,620.00	0.11
207	600436	片仔癀	26,600	2,906,848.00	0.11
208	601077	渝农商行	472,100	2,884,531.00	0.11
209	600115	中国东航	756,314	2,881,556.34	0.11
210	002236	大华股份	174,063	2,870,298.87	0.11
211	002493	荣盛石化	266,300	2,862,725.00	0.11
212	600570	恒生电子	134,160	2,842,850.40	0.11
213	600886	国投电力	213,239	2,838,211.09	0.11
214	600188	兖矿能源	158,580	2,817,966.60	0.11
215	688047	龙芯中科	18,008	2,785,297.36	0.11
216	601360	三六零	314,400	2,732,136.00	0.10
217	003816	中国广核	697,200	2,726,052.00	0.10
218	002736	国信证券	272,701	2,724,282.99	0.10
219	601058	赛轮轮胎	233,500	2,692,255.00	0.10
220	000301	东方盛虹	234,600	2,686,170.00	0.10
221	002074	国轩高科	97,200	2,673,972.00	0.10
222	600026	中远海能	148,100	2,656,914.00	0.10
223	601901	方正证券	368,541	2,653,495.20	0.10
224	600009	上海机场	112,840	2,606,604.00	0.10
225	600196	复星医药	114,280	2,567,871.60	0.10
226	000768	中航西飞	123,136	2,521,825.28	0.10
227	601788	光大证券	173,600	2,505,048.00	0.09
228	000975	山金国际	147,300	2,504,100.00	0.09
229	601111	中国国航	413,631	2,502,467.55	0.09
230	600029	南方航空	478,900	2,480,702.00	0.09
231	600415	小商品城	244,000	2,479,040.00	0.09

232	600674	川投能源	174,500	2,472,665.00	0.09
233	601456	国联民生	279,200	2,468,128.00	0.09
234	600219	南山铝业	616,800	2,461,032.00	0.09
235	601881	中国银河	194,700	2,447,379.00	0.09
236	601186	中国铁建	409,603	2,437,137.85	0.09
237	601877	正泰电器	95,800	2,401,706.00	0.09
238	600233	圆通速递	151,700	2,389,275.00	0.09
239	601117	中国化学	324,500	2,385,075.00	0.09
240	601878	浙商证券	247,500	2,351,250.00	0.09
241	301236	软通动力	55,300	2,347,485.00	0.09
242	301269	华大九天	19,534	2,332,750.28	0.09
243	600372	中航机载	214,600	2,328,410.00	0.09
244	688506	百利天恒	7,436	2,186,407.08	0.08
245	000963	华东医药	77,328	2,174,463.36	0.08
246	600741	华域汽车	139,704	2,168,206.08	0.08
247	002920	德赛西威	26,100	2,127,150.00	0.08
248	000895	双汇发展	93,016	2,083,558.40	0.08
249	001979	招商蛇口	320,284	2,059,426.12	0.08
250	002304	洋河股份	53,373	2,036,179.95	0.08
251	300866	安克创新	19,200	2,006,400.00	0.08
252	601021	春秋航空	43,700	1,991,846.00	0.08
253	601898	中煤能源	162,300	1,976,814.00	0.07
254	601319	中国人保	287,400	1,942,824.00	0.07
255	600023	浙能电力	359,500	1,890,970.00	0.07
256	600039	四川路桥	234,680	1,835,197.60	0.07
257	000002	万科 A	617,213	1,826,950.48	0.07
258	601800	中国交建	318,287	1,817,418.77	0.07
259	688223	晶科能源	364,252	1,730,197.00	0.07
260	601633	长城汽车	112,705	1,700,718.45	0.06
261	600588	用友网络	183,621	1,685,640.78	0.06
262	001965	招商公路	183,900	1,684,524.00	0.06
263	600600	青岛啤酒	31,237	1,631,508.51	0.06
264	600027	华电国际	362,300	1,612,235.00	0.06
265	603369	今世缘	67,500	1,600,425.00	0.06
266	601618	中国中冶	639,667	1,560,787.48	0.06
267	601607	上海医药	100,000	1,540,000.00	0.06
268	300628	亿联网络	45,300	1,532,046.00	0.06
269	000617	中油资本	231,600	1,526,244.00	0.06
270	600061	国投资本	232,400	1,522,220.00	0.06
271	302132	中航成飞	26,000	1,516,320.00	0.06
272	600918	中泰证券	284,800	1,515,136.00	0.06
273	603260	合盛硅业	31,300	1,510,538.00	0.06
274	600025	华能水电	167,100	1,485,519.00	0.06

275	300832	新产业	35,300	1,482,600.00	0.06
276	300251	光线传媒	131,900	1,462,771.00	0.06
277	600085	同仁堂	62,388	1,441,786.68	0.05
278	600515	海南机场	519,400	1,423,156.00	0.05
279	601059	信达证券	87,400	1,415,006.00	0.05
280	600930	华电新能	295,100	1,407,627.00	0.05
281	688472	阿特斯	128,790	1,393,507.80	0.05
282	000999	华润三九	60,395	1,358,283.55	0.05
283	600803	新奥股份	83,100	1,312,980.00	0.05
284	300122	智飞生物	109,642	1,281,714.98	0.05
285	600845	宝信软件	76,908	1,278,980.04	0.05
286	600018	上港集团	266,282	1,256,851.04	0.05
287	300999	金龙鱼	53,600	1,246,736.00	0.05
288	300896	爱美客	13,660	1,191,152.00	0.05
289	000596	古井贡酒	14,783	1,179,683.40	0.04
290	000708	中信特钢	90,700	1,144,634.00	0.04
291	601018	宁波港	358,000	1,127,700.00	0.04
292	688009	中国通号	232,990	1,109,032.40	0.04
293	601238	广汽集团	200,300	1,017,524.00	0.04
294	301165	锐捷网络	12,500	1,005,625.00	0.04
295	688303	大全能源	57,355	999,697.65	0.04
296	300413	芒果超媒	66,604	974,416.52	0.04
297	001280	中国铀业	14,377	958,945.90	0.04
298	603392	万泰生物	34,940	942,331.80	0.04
299	601136	首创证券	49,400	689,130.00	0.03
300	001391	国货航	124,894	508,318.58	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.03
2	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.02
3	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
4	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
5	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
6	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
7	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
8	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
9	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
10	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
11	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00

12	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
13	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
14	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
15	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
16	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
17	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
18	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
19	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
20	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
21	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
22	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
23	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
24	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
25	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
26	688781	视涯科技	217	10,331.37	0.00
27	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
28	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
29	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
30	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
31	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
32	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
33	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
34	920189	康美特	200	1,628.00	0.00
35	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	600519	贵州茅台	77,418,009.00	2.82
2	601318	中国平安	59,816,302.84	2.18
3	601899	紫金矿业	51,652,432.00	1.88
4	600036	招商银行	45,639,116.24	1.66
5	688041	海光信息	32,844,665.15	1.20
6	600900	长江电力	30,311,527.00	1.11
7	601166	兴业银行	28,757,053.50	1.05
8	601138	工业富联	23,874,134.98	0.87
9	600030	中信证券	23,827,853.50	0.87
10	600276	恒瑞医药	22,561,886.52	0.82
11	601398	工商银行	22,192,558.00	0.81
12	603259	药明康德	22,190,322.00	0.81

13	688008	澜起科技	21,185,288.41	0.77
14	688981	中芯国际	20,750,319.64	0.76
15	603986	兆易创新	20,208,655.00	0.74
16	601211	国泰海通	18,824,541.42	0.69
17	601288	农业银行	17,987,513.00	0.66
18	601328	交通银行	16,904,509.00	0.62
19	603993	洛阳钼业	16,850,225.00	0.61
20	601088	中国神华	16,407,635.64	0.60

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	600519	贵州茅台	93,630,526.81	3.42
2	601318	中国平安	71,929,984.70	2.62
3	601899	紫金矿业	62,936,492.23	2.30
4	600036	招商银行	54,637,275.74	1.99
5	688041	海光信息	38,263,654.86	1.40
6	600900	长江电力	36,531,351.00	1.33
7	601166	兴业银行	34,591,985.00	1.26
8	601138	工业富联	29,010,774.95	1.06
9	600030	中信证券	28,976,920.24	1.06
10	600276	恒瑞医药	27,347,760.60	1.00
11	603259	药明康德	27,320,372.20	1.00
12	601398	工商银行	26,728,794.00	0.97
13	688008	澜起科技	25,693,628.91	0.94
14	688981	中芯国际	25,020,741.47	0.91
15	603986	兆易创新	25,001,222.18	0.91
16	601211	国泰海通	22,502,404.30	0.82
17	601288	农业银行	21,733,965.00	0.79
18	601088	中国神华	21,199,324.70	0.77
19	603993	洛阳钼业	20,604,132.00	0.75
20	601328	交通银行	20,336,696.00	0.74

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	1,686,808,520.83
卖出股票收入（成交）总额	1,926,483,240.48

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,000.06	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,000.06	0.00

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	118070	南芯转债	10	1,000.06	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	16,153,225.12
2	应收清算款	9,850,278.69
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	26,003,503.81

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	001248	华润新能源	595,206.03	0.02	新股锁定期
2	001248	华润新能源	255,085.41	0.01	新股未上市
3	301666	大普微	565,262.60	0.02	新股锁定期
4	688820	盛合晶微	338,302.59	0.01	新股锁定期
5	688808	联讯仪器	258,245.79	0.01	新股锁定期
6	001399	惠科股份	179,912.24	0.01	新股锁定期

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		南方沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
18,180	28,730.52	115,546,624.00	22.12%	85,842,056.00	16.43%	320,932,176.00	61.44%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013 年 2 月 18 日)基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	588,920,856.00
本报告期基金总申购份额	500,400,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	567,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	522,320,856.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内无涉及基金财产的诉讼事项。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	2	2,008,252,144.13	55.63%	200,619.55	55.62%	-
国投证券	1	663,403,842.53	18.38%	66,271.39	18.37%	-
华泰证券	4	459,352,790.12	12.72%	45,884.51	12.72%	-
招商证券	1	185,327,331.70	5.13%	18,552.65	5.14%	-
银河证券	2	162,277,330.09	4.50%	16,250.44	4.51%	-
方正证券	1	112,982,918.20	3.13%	11,285.03	3.13%	-
中金公司	2	14,358,176.45	0.40%	1,434.43	0.40%	-
中泰证券	2	4,015,881.93	0.11%	401.14	0.11%	-
国泰海通	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

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

1、选择标准

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

2、选择程序

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

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

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司旗下部分ETF增加世纪证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-13
2	南方基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31

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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-11
4	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-24
5	南方基金管理股份有限公司成都分公司工商注册信息变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-28
6	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加金融街证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-03
7	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加东北证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-23
8	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加华源证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20260101-20260630	393,993,176.00	2,104,800.00	75,165,800.00	320,932,176.00	61.44%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20% 的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>