

南方深证成份交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 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 2025 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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	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 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50

7.10 本报告期投资基金情况.....	50
7.11 本基金投资股指期货的投资政策.....	50
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.13 投资组合报告附注.....	51
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
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.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	南方深证成份 ETF 联接	
基金主代码	202017	
前端交易代码	202017	
后端交易代码	202018	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 12 月 9 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	202,967,196.99 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方深证成份 ETF 联接 A	南方深证成份 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	202017	004345
下属分级基金的前端交易代码	202017	
下属分级基金的后端交易代码	202018	
报告期末下属分级基金的份额总额	156,610,601.50 份	46,356,595.49 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159903
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 4 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 2 月 2 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	中国工商银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于深成 ETF，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	本基金为完全被动式指数基金，以深成 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资深成 ETF。本基金并不参与深成 ETF 的管理。为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于深成 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，

	其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。在正常市场情况下，本基金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%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	深证成份指数收益率×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，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时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	本基金为完全被动式指数基金，原则上采用完全复制法，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。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，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。 存托凭证的投资策略：本基金将根据法律法规和监管机构的要求，制定存托凭证投资策略，关注发行人有关信息披露情况，关注发行人基本面情况、市场估值等因素，通过定性分析和定量分析相结合的办法，参与存托凭证的投资，谨慎决定存托凭证的权重配置和标的选择。
业绩比较基准	深证成份指数
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	郭明
	联系电话	0755-82763888	(010) 66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
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	南方基金管理股份有限公司	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、南方深证成份 ETF 联接 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	216,209.21
本期利润	2,184,235.41
加权平均基金份额本期利润	0.0133
本期加权平均净值利润率	1.40%
本期基金份额净值增长率	1.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-4,607,727.77
期末可供分配基金份额利润	-0.0294
期末基金资产净值	152,002,873.73
期末基金份额净值	0.9706
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-2.94%

2、南方深证成份 ETF 联接 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-31,216.53
本期利润	1,122,363.25

加权平均基金份额本期利润	0.0204
本期加权平均净值利润率	2.21%
本期基金份额净值增长率	1.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-2,771,618.86
期末可供分配基金份额利润	-0.0598
期末基金资产净值	43,584,976.63
期末基金份额净值	0.9402
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	10.89%

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；

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

南方深证成份 ETF 联接 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	4.49%	0.76%	4.02%	0.76%	0.47%	0.00%
过去三个月	0.46%	1.44%	-0.32%	1.44%	0.78%	0.00%
过去六个月	1.30%	1.31%	0.53%	1.32%	0.77%	-0.01%
过去一年	19.02%	1.71%	17.52%	1.73%	1.50%	-0.02%
过去三年	-15.09%	1.32%	-17.68%	1.33%	2.59%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	-2.94%	1.47%	-21.01%	1.48%	18.07%	-0.01%

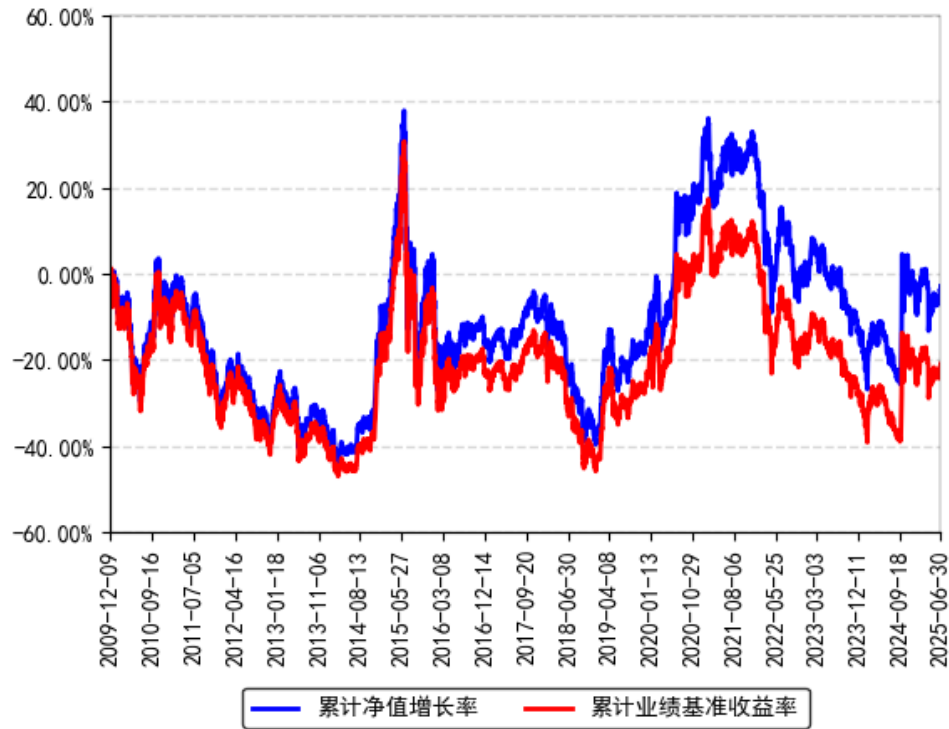
南方深证成份 ETF 联接 C

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	4.46%	0.76%	4.02%	0.76%	0.44%	0.00%

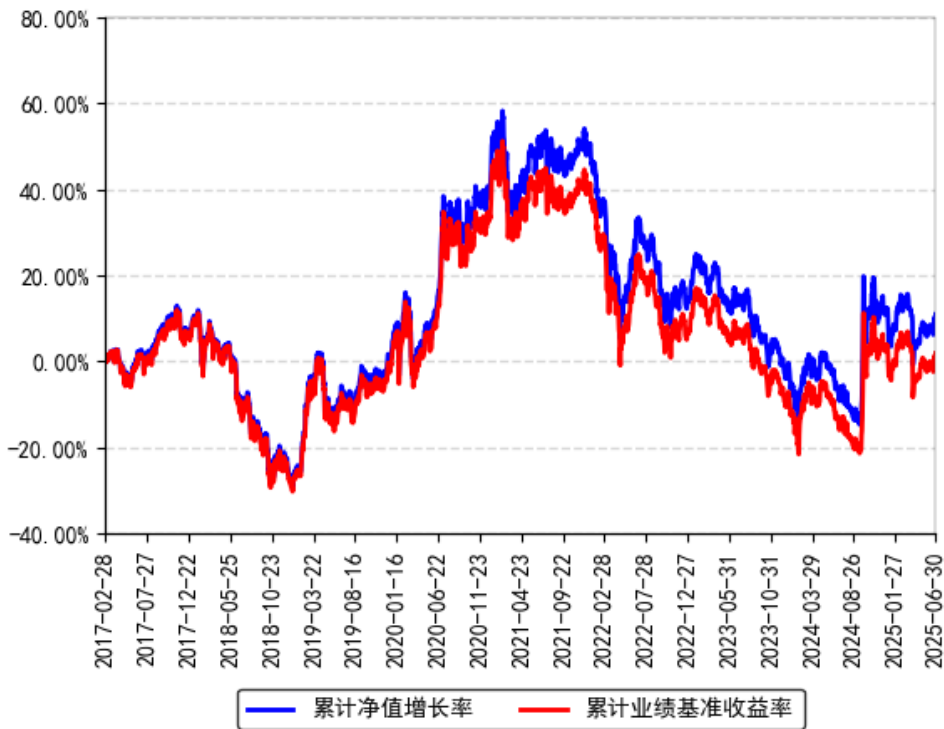
过去三个月	0.35%	1.44%	-0.32%	1.44%	0.67%	0.00%
过去六个月	1.10%	1.31%	0.53%	1.32%	0.57%	-0.01%
过去一年	18.53%	1.71%	17.52%	1.73%	1.01%	-0.02%
过去三年	-16.10%	1.32%	-17.68%	1.33%	1.58%	-0.01%
自基金合同生效起至今	10.89%	1.34%	1.80%	1.34%	9.09%	0.00%

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

南方深证成份ETF联接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



南方深证成份ETF联接C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。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	说明
----	----	-----------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
孙伟	本基金基金经理	2016 年 8 月 19 日	-	15 年	北京大学工商管理硕士，注册会计师（CPA），具有基金从业资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010 年 2 月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员、基金经理助理；2015 年 5 月 22 日至 2016 年 7 月 29 日，任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 7 月 2 日至 2020 年 12 月 1 日，任改革基金、高铁基金基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 7 日，任南方中证 500 工业 ETF 基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 14 日，任南方中证 500 原材料 ETF 基金经理；2020 年 12 月 1 日至 2021 年 4 月 19 日，任改革基金基金经理；2015 年 7 月 10 日至今，任 500 信息基金经理；2016 年 5 月 13 日至今，任南方创业板 ETF 基金经理；2016 年 5 月 20 日至今，任南方创业板 ETF 联接基金经理；2016 年 8 月 17 日至今，任 500 信息联接基金经理；2016 年 8 月 19 日至今，任深成 ETF、南方深成基金经理；2017 年 3 月 8 日至今，任南方全指证券 ETF 联接基金经理；2017 年 3 月 10 日至今，任南方中证全指证券 ETF 基金经理；2017 年 6 月 28 日至今，任南方中证银行 ETF 基金经理；2017 年 6 月 29 日至今，任南方银行联接基金经理；2018 年 2 月 8 日至今，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至今，任南方 H 股联接基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任南方上证 380ETF、南方上证 380ETF 联接基金经理；2020 年 12 月 1 日至今，任高铁基金基金经理；2022 年 3 月 3 日至今，任南方上海金 ETF 基金经理；2023 年 7 月 25 日至今，任南方上海金 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。

4.2 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 96 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

2025 年上半年，深证成指以 0.48% 的微幅上涨收官，呈现“政策底支撑下的结构性博弈”特征。政策层面继续推动高质量发展，强调科技创新与产业升级，这对以科技、消费和先进制造为代表的深市上市公司形成积极支撑。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

（1）接受申购赎回所带来的股票仓位偏离，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

(2) 本基金大额换购目标 ETF 所带来的成份股权重偏离, 对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行应对;

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

(4) 根据指数成份股调整进行的基金调仓, 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, 将跟踪误差控制在理想范围内;

(5) 新股上市初期涨幅较大的影响。

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 0.9706 元, 报告期内, 份额净值增长率为 1.30%, 同期业绩基准增长率为 0.53%; 本基金 C 份额净值为 0.9402 元, 报告期内, 份额净值增长率为 1.10%, 同期业绩基准增长率为 0.53%。

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, 深证成指的投资价值仍值得关注。一方面, 随着权益类资产估值水平的回落, 市场具备一定的配置吸引力; 另一方面, 部分优质企业的盈利能力在成本端改善和需求端回暖的双重驱动下有望回升; 此外, 新能源、高端制造等新兴领域的持续投入也将为市场注入新的增长动能。

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、现金及债券指数投资部总经理、国际业务部总经理、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

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遵规守信、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 2025 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：南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30	上年度末 2024 年 12 月
----	-----	-------------------	------------------

		日	31 日
资产：			
货币资金	6.4.3.1	10,092,563.36	10,967,367.74
结算备付金		10,529.39	23,952.51
存出保证金		13,097.56	21,047.83
交易性金融资产	6.4.3.2	186,976,546.92	211,623,663.91
其中：股票投资		1,859,059.25	152,698.18
基金投资		183,911,998.78	209,546,961.18
债券投资		1,205,488.89	1,924,004.55
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		2,208,539.29	-
应收股利		-	-
应收申购款		185,084.17	345,489.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		199,486,360.69	222,981,521.30
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		-	1,000,373.14
应付清算款		3,716.65	-
应付赎回款		3,784,006.29	1,311,808.25
应付管理人报酬		4,910.01	5,258.87
应付托管费		982.00	1,051.80
应付销售服务费		15,251.64	19,650.24
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	6.4.3.6	89,643.74	176,557.68

负债合计		3,898,510.33	2,514,699.98
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	202,967,196.99	231,862,612.51
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	-7,379,346.63	-11,395,791.19
净资产合计		195,587,850.36	220,466,821.32
负债和净资产总计		199,486,360.69	222,981,521.30

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，南方深证成份 ETF 联接 A 份额净值 0.9706 元，基金份额总额 156,610,601.50 份；南方深证成份 ETF 联接 C 份额净值 0.9402 元，基金份额总额 46,356,595.49 份；总份额合计 202,967,196.99 份。

6.2 利润表

会计主体：南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,535,683.87	-9,576,811.52
1.利息收入		17,458.30	17,025.48
其中：存款利息收入	6.4.3.9	17,458.30	17,025.48
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）		315,167.68	-1,157,373.13
其中：股票投资收益	6.4.3.10	222,014.40	32,212.87
基金投资收益	6.4.3.11	46,219.28	-1,227,640.12
债券投资收益	6.4.3.12	12,096.12	9,644.85
资产支持证券投资	6.4.3.13	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	34,837.88	28,409.27
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）	6.4.3.16	3,121,605.98	-8,586,879.88
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	81,451.91	150,416.01
减：二、营业总支出		229,085.21	207,922.31
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	33,234.78	33,542.30
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.6.2.2	6,646.96	6,708.54
3.销售服务费	6.4.6.2.3	100,999.48	81,952.93
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		3,736.23	1,075.18
其中：卖出回购金融资产支出		3,736.23	1,075.18
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		57.20	-
8.其他费用	6.4.3.18	84,410.56	84,643.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,306,598.66	-9,784,733.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,306,598.66	-9,784,733.83
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,306,598.66	-9,784,733.83

6.3 净资产变动表

会计主体：南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	231,862,612.51	-	-11,395,791.19	220,466,821.32
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	231,862,612.51	-	-11,395,791.19	220,466,821.32

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-28,895,415.52	-	4,016,444.56	-24,878,970.96
（一）、综合收益总额	-	-	3,306,598.66	3,306,598.66
（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）	-28,895,415.52	-	709,845.90	-28,185,569.62
其中：1.基金申购款	64,617,761.93	-	-5,272,320.31	59,345,441.62
2.基金赎回款	-93,513,177.45	-	5,982,166.21	-87,531,011.24
（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	202,967,196.99	-	-7,379,346.63	195,587,850.36
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	192,768,750.25	-	-26,570,957.45	166,197,792.80
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	192,768,750.25	-	-26,570,957.45	166,197,792.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	22,802,267.74	-	-14,379,736.57	8,422,531.17
（一）、综合收益总额	-	-	-9,784,733.83	-9,784,733.83
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	22,802,267.74	-	-4,595,002.74	18,207,265.00

（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	111,180,693.57	-	-19,766,559.28	91,414,134.29
2.基金赎回款	-88,378,425.83	-	15,171,556.54	-73,206,869.29
（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	215,571,017.99	-	-40,950,694.02	174,620,323.97

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	10,092,563.36
等于：本金	10,091,720.45
加：应计利息	842.91
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	10,092,563.36

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,857,169.49	-	1,859,059.25	1,889.76
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,196,612.00	6,368.89	1,205,488.89	2,508.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,196,612.00	6,368.89	1,205,488.89	2,508.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		186,227,985.45	-	183,911,998.78	-2,315,986.67
其他		-	-	-	-
合计		189,281,766.94	6,368.89	186,976,546.92	-2,311,588.91

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

无。

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

无。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.3.5 其他资产

无。

6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,281.42
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,059.76
其中：交易所市场	2,059.76
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	-
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	-
可退替代款	-
合计	89,643.74

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方深证成份 ETF 联接 A		
项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	172,110,852.62	172,110,852.62
本期申购	19,274,323.46	19,274,323.46
本期赎回（以“-”号填列）	-34,774,574.58	-34,774,574.58
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	156,610,601.50	156,610,601.50

南方深证成份 ETF 联接 C		
项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	59,751,759.89	59,751,759.89
本期申购	45,343,438.47	45,343,438.47
本期赎回（以“-”号填列）	-58,738,602.87	-58,738,602.87

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	46,356,595.49	46,356,595.49

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）。

6.4.3.8 未分配利润

单位：人民币元

南方深证成份 ETF 联接 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	103,003,333.05	-110,214,281.72	-7,210,948.67
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	103,003,333.05	-110,214,281.72	-7,210,948.67
本期利润	216,209.21	1,968,026.20	2,184,235.41
本期基金份额交易产生的变动数	-9,292,711.54	9,711,697.03	418,985.49
其中：基金申购款	11,551,046.65	-12,704,364.64	-1,153,317.99
基金赎回款	-20,843,758.19	22,416,061.67	1,572,303.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	93,926,830.72	-98,534,558.49	-4,607,727.77

南方深证成份 ETF 联接 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	33,728,102.15	-37,912,944.67	-4,184,842.52
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	33,728,102.15	-37,912,944.67	-4,184,842.52
本期利润	-31,216.53	1,153,579.78	1,122,363.25
本期基金份额交易产生的变动数	-7,556,512.54	7,847,372.95	290,860.41
其中：基金申购款	25,595,359.64	-29,714,361.96	-4,119,002.32
基金赎回款	-33,151,872.18	37,561,734.91	4,409,862.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,140,373.08	-28,911,991.94	-2,771,618.86

6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	17,195.32
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	47.38
其他	215.60
合计	17,458.30

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	222,014.40
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	222,014.40

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	29,072,927.63
减：卖出股票成本总额	28,829,751.86
减：交易费用	21,161.37
买卖股票差价收入	222,014.40

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.3.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	28,793,703.37
减：卖出/赎回基金成本总额	28,746,343.16
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	476.74
减：交易费用	664.19
基金投资收益	46,219.28

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	13,821.29

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,725.17
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	12,096.12

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,931,129.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,902,645.00
减：应计利息总额	30,210.07
减：交易费用	0.04
买卖债券差价收入	-1,725.17

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.3.13 资产支持证券投资收益

6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.3.14 衍生工具收益

6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	34,837.88
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	34,837.88

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	3,121,605.98

——股票投资	9,102.22
——债券投资	1,123.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	3,111,380.76
——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	3,121,605.98

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	78,562.49
基金转换费收入	2,889.42
合计	81,451.91

6.4.3.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	108.00
合计	84,410.56

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），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。

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

无。

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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	6,759,853.00	16.74%	44,415,462.88	100.00%

6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	-	1,305,475.38	100.00%

6.4.6.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华泰证券	-	-	3,150,000.00	100.00%

6.4.6.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
-------	------------------------------------	---

	成交金额	占当期基金 成交总额的比例	成交金额	占当期基金 成交总额的比例
华泰证券	-	-	30,598,029.90	100.00%

6.4.6.1.5 权证交易

无。

6.4.6.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	675.56	16.75%	405.91	19.71%
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	4,442.11	100.00%	1,783.36	101.11%

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。

6.4.6.2 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	33,234.78	33,542.30
其中：应支付销售机构的客户维护费	174,383.83	150,320.07
应支付基金管理人的净管理费	-141,149.05	-116,777.77

注 本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付销售机构的客户维护费不因投资于目标 ETF 而调减，因此可能导致应支付基金管理人的净管理费为负。支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除本基金持有的目标 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,646.96	6,708.54

注：本基金投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的目标 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方深证成份 ETF 联接 A	南方深证成份 ETF 联接 C	合计
工商银行	-	4,558.65	4,558.65
华泰证券	-	713.72	713.72
南方基金	-	6,758.55	6,758.55
合计	-	12,030.92	12,030.92
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方深证成份 ETF 联接 A	南方深证成份 ETF 联接 C	合计
工商银行	-	1,170.71	1,170.71
华泰证券	-	632.48	632.48
南方基金	-	3,264.76	3,264.76
合计	-	5,067.95	5,067.95

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

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.40%÷当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

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

无。

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

无。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	10,092,563.36	17,195.32	7,982,217.44	16,568.24

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。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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

于本期末，本基金持有目标 ETF 基金份额，成本总额为人民币 186,227,985.45 元，估值总额为人民币 183,911,998.78 元，占基金净资产的比例为 94.03%（于上期末，本基金持有目标 ETF 基金份额，成本总额为人民币 214,974,328.61 元，估值总额为人民币 209,546,961.18 元，占基金净资产的比例为 95.05%）。

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

无。

6.4.8 期末（2025 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：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
123257	安克转债	2025 年 6 月 16 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.01	2	200.00	200.01	-

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
000627	*ST 天茂	2025 年 5 月 6 日	未按交易所要求按时披露重要信息	2.74	2025 年 7 月 8 日	2.60	1,500	4,879.00	4,110.00	-
400174	中天 3	2023 年 8 月 30 日	暂停转让	0.14	-	-	500	698.37	70.00	-

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

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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，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。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资及债券投资。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要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金

管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

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。

于本报告期末,本基金的卖出回购金融资产款(若有)计息且利息金额不重大;除此之外,本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,该部分账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.3.1 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组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时,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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	10,092,563.36	-	-	-	10,092,563.36
结算备付金	10,529.39	-	-	-	10,529.39
存出保证金	13,097.56	-	-	-	13,097.56
交易性金融资产	1,205,288.88	-	200.01	185,771,058.03	186,976,546.92
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	-	-	-	2,208,539.29	2,208,539.29
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	185,084.17	185,084.17
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,321,479.19	-	200.01	188,164,681.49	199,486,360.69
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	-	-	-	3,716.65	3,716.65
应付赎回款	-	-	-	3,784,006.29	3,784,006.29
应付管理人报酬	-	-	-	4,910.01	4,910.01
应付托管费	-	-	-	982.00	982.00
应付销售服务费	-	-	-	15,251.64	15,251.64
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	-	-	-	89,643.74	89,643.74
负债总计	-	-	-	3,898,510.33	3,898,510.33
利率敏感度缺口	11,321,479.19	-	200.01	184,266,171.16	195,587,850.36
上年度末 2024 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	10,967,367.74	-	-	-	10,967,367.74
结算备付金	23,952.51	-	-	-	23,952.51
存出保证金	21,047.83	-	-	-	21,047.83
交易性金融资产	1,924,004.55	-	-	209,699,659.36	211,623,663.91
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	345,489.31	345,489.31
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,936,372.63	-	-	210,045,148.67	222,981,521.30
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	1,000,373.14	-	-	-	1,000,373.14
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,311,808.25	1,311,808.25
应付管理人报酬	-	-	-	5,258.87	5,258.87
应付托管费	-	-	-	1,051.80	1,051.80
应付销售服务费	-	-	-	19,650.24	19,650.24
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	-	-	-	176,557.68	176,557.68
负债总计	1,000,373.14	-	-	1,514,326.84	2,514,699.98
利率敏感度缺口	11,935,999.49	-	-	208,530,821.83	220,466,821.32

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	-1,628.85	-1,510.60
	2.市场利率平行下降 25 个基点	1,633.26	1,512.97

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。本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股和备选成份股，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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	1,859,059.25	0.95	152,698.18	0.07
交易性金融资产-基金投资	183,911,998.78	94.03	209,546,961.18	95.05
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	185,771,058.03	94.98	209,699,659.36	95.12

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（ 2025 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2024 年 12 月 31 日 ）
	1.组合自身基准上升 5%	9,118,675.13	10,268,688.65
	2.组合自身基准下降 5%	-9,118,675.13	-10,268,688.65

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	185,766,878.03
第二层次	1,209,598.89
第三层次	70.00
合计	186,976,546.92

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

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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。

6.4.11 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	1,859,059.25	0.93
	其中：股票	1,859,059.25	0.93
2	基金投资	183,911,998.78	92.19
3	固定收益投资	1,205,488.89	0.60
	其中：债券	1,205,488.89	0.60
	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	10,103,092.75	5.06
8	其他各项资产	2,406,721.02	1.21
9	合计	199,486,360.69	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

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	38,103.50	0.02
B	采矿业	25,775.64	0.01
C	制造业	1,347,105.25	0.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,483.80	0.01
E	建筑业	2,719.00	0.00
F	批发和零售业	21,887.90	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	33,112.68	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	120,567.57	0.06
J	金融业	159,480.84	0.08
K	房地产业	16,931.00	0.01
L	租赁和商务服务业	26,922.20	0.01
M	科学研究和技术服务业	9,603.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	4,319.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,448.00	0.00
Q	卫生和社会工作	11,634.88	0.01
R	文化、体育和娱乐业	12,964.99	0.01
S	综合	-	-
	合计	1,859,059.25	0.95

7.2.2 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

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	300750	宁德时代	440	110,976.80	0.06
2	000333	美的集团	800	57,760.00	0.03
3	300059	东方财富	2,079	48,087.27	0.02
4	000858	五粮液	300	35,670.00	0.02
5	002594	比亚迪	100	33,191.00	0.02
6	000651	格力电器	700	31,444.00	0.02
7	002475	立讯精密	741	25,705.29	0.01
8	300308	中际旭创	168	24,504.48	0.01
9	300760	迈瑞医疗	100	22,475.00	0.01
10	000725	京东方 A	5,600	22,344.00	0.01
11	002352	顺丰控股	400	19,504.00	0.01
12	300124	汇川技术	300	19,371.00	0.01
13	300274	阳光电源	276	18,704.52	0.01
14	000001	平安银行	1,400	16,898.00	0.01
15	300502	新易盛	131	16,639.62	0.01
16	002415	海康威视	587	16,277.51	0.01
17	000063	中兴通讯	500	16,245.00	0.01
18	002714	牧原股份	378	15,879.78	0.01
19	002142	宁波银行	569	15,567.84	0.01
20	300498	温氏股份	884	15,098.72	0.01
21	002230	科大讯飞	300	14,364.00	0.01
22	000338	潍柴动力	900	13,842.00	0.01
23	300476	胜宏科技	100	13,438.00	0.01
24	000100	TCL 科技	3,050	13,206.50	0.01
25	002027	分众传媒	1,736	12,672.80	0.01
26	002517	恺英网络	600	11,586.00	0.01
27	000568	泸州老窖	100	11,340.00	0.01
28	000977	浪潮信息	220	11,193.60	0.01
29	000425	徐工机械	1,400	10,878.00	0.01
30	300014	亿纬锂能	229	10,490.49	0.01
31	002050	三花智控	396	10,446.48	0.01
32	000792	盐湖股份	600	10,248.00	0.01
33	000661	长春高新	100	9,918.00	0.01
34	000625	长安汽车	748	9,544.48	0.00
35	002384	东山精密	250	9,442.50	0.00
36	002241	歌尔股份	400	9,328.00	0.00
37	300015	爱尔眼科	728	9,085.44	0.00

38	002463	沪电股份	210	8,941.80	0.00
39	000776	广发证券	500	8,405.00	0.00
40	002625	光启技术	210	8,395.80	0.00
41	300433	蓝思科技	340	7,582.00	0.00
42	300474	景嘉微	100	7,300.00	0.00
43	002028	思源电气	100	7,291.00	0.00
44	002422	科伦药业	200	7,184.00	0.00
45	000002	万科 A	1,100	7,062.00	0.00
46	000166	申万宏源	1,400	7,028.00	0.00
47	300223	北京君正	100	6,920.00	0.00
48	000538	云南白药	120	6,694.80	0.00
49	300408	三环集团	200	6,680.00	0.00
50	002304	洋河股份	100	6,455.00	0.00
51	002466	天齐锂业	200	6,408.00	0.00
52	000807	云铝股份	400	6,392.00	0.00
53	002001	新和成	290	6,168.30	0.00
54	000938	紫光股份	255	6,117.45	0.00
55	002179	中航光电	147	5,932.92	0.00
56	002456	欧菲光	500	5,925.00	0.00
57	002595	豪迈科技	100	5,922.00	0.00
58	002311	海大集团	100	5,859.00	0.00
59	000157	中联重科	800	5,784.00	0.00
60	002736	国信证券	500	5,760.00	0.00
61	300832	新产业	100	5,672.00	0.00
62	000963	华东医药	140	5,650.40	0.00
63	002252	上海莱士	800	5,496.00	0.00
64	000768	中航西飞	200	5,468.00	0.00
65	002966	苏州银行	620	5,443.60	0.00
66	002460	赣锋锂业	160	5,403.20	0.00
67	003031	中瓷电子	100	5,321.00	0.00
68	000786	北新建材	200	5,296.00	0.00
69	002340	格林美	830	5,270.50	0.00
70	002049	紫光国微	80	5,268.80	0.00
71	001979	招商蛇口	600	5,262.00	0.00
72	000423	东阿阿胶	100	5,230.00	0.00
73	002074	国轩高科	160	5,193.60	0.00
74	300765	新诺威	100	5,169.00	0.00
75	002648	卫星化学	296	5,129.68	0.00
76	002156	通富微电	200	5,124.00	0.00
77	300395	菲利华	100	5,110.00	0.00
78	000066	中国长城	344	5,091.20	0.00
79	300339	润和软件	100	5,083.00	0.00
80	300661	圣邦股份	69	5,021.13	0.00

81	002851	麦格米特	100	5,014.00	0.00
82	000733	振华科技	100	5,005.00	0.00
83	000933	神火股份	300	4,992.00	0.00
84	300450	先导智能	200	4,970.00	0.00
85	300442	润泽科技	100	4,953.00	0.00
86	002281	光迅科技	100	4,932.00	0.00
87	000895	双汇发展	200	4,882.00	0.00
88	002601	龙佰集团	300	4,863.00	0.00
89	000975	山金国际	256	4,848.64	0.00
90	002797	第一创业	680	4,814.40	0.00
91	002195	岩山科技	851	4,791.13	0.00
92	002236	大华股份	300	4,764.00	0.00
93	002294	信立泰	100	4,733.00	0.00
94	002558	巨人网络	200	4,710.00	0.00
95	300100	双林股份	100	4,708.00	0.00
96	000988	华工科技	100	4,701.00	0.00
97	300255	常山药业	100	4,661.00	0.00
98	002202	金风科技	454	4,653.50	0.00
99	002180	纳思达	200	4,588.00	0.00
100	300604	长川科技	100	4,491.00	0.00
101	300073	当升科技	100	4,387.00	0.00
102	003816	中国广核	1,200	4,368.00	0.00
103	300115	长盈精密	204	4,365.60	0.00
104	300496	中科创达	76	4,348.72	0.00
105	002600	领益智造	500	4,295.00	0.00
106	002335	科华数据	100	4,268.00	0.00
107	000408	藏格矿业	100	4,267.00	0.00
108	300058	蓝色光标	640	4,198.40	0.00
109	002465	海格通信	300	4,182.00	0.00
110	002015	协鑫能科	300	4,179.00	0.00
111	300751	迈为股份	60	4,173.60	0.00
112	002532	天山铝业	500	4,155.00	0.00
113	000627	*ST 天茂	1,500	4,110.00	0.00
114	002812	恩捷股份	140	4,100.60	0.00
115	002185	华天科技	404	4,080.40	0.00
116	300251	光线传媒	200	4,054.00	0.00
117	002078	太阳纸业	300	4,038.00	0.00
118	300207	欣旺达	200	4,012.00	0.00
119	000630	铜陵有色	1,200	4,008.00	0.00
120	002436	兴森科技	300	3,972.00	0.00
121	002128	电投能源	200	3,956.00	0.00
122	300699	光威复材	124	3,927.08	0.00
123	002837	英维克	130	3,862.30	0.00

124	002065	东华软件	400	3,840.00	0.00
125	300316	晶盛机电	140	3,801.00	0.00
126	000034	神州数码	100	3,764.00	0.00
127	000876	新希望	400	3,752.00	0.00
128	000021	深科技	200	3,748.00	0.00
129	002271	东方雨虹	345	3,701.85	0.00
130	300759	康龙化成	150	3,681.00	0.00
131	002129	TCL 中环	475	3,648.00	0.00
132	002432	九安医疗	100	3,643.00	0.00
133	300803	指南针	45	3,629.70	0.00
134	300777	中简科技	100	3,625.00	0.00
135	002673	西部证券	460	3,624.80	0.00
136	002493	荣盛石化	437	3,618.36	0.00
137	000831	中国稀土	100	3,612.00	0.00
138	001965	招商公路	300	3,600.00	0.00
139	300136	信维通信	160	3,584.00	0.00
140	300122	智飞生物	182	3,565.38	0.00
141	300475	香农芯创	100	3,563.00	0.00
142	002223	鱼跃医疗	100	3,560.00	0.00
143	300002	神州泰岳	300	3,540.00	0.00
144	002131	利欧股份	1,010	3,535.00	0.00
145	300037	新宙邦	100	3,520.00	0.00
146	000617	中油资本	480	3,504.00	0.00
147	002353	杰瑞股份	100	3,500.00	0.00
148	300628	亿联网络	100	3,476.00	0.00
149	000783	长江证券	500	3,465.00	0.00
150	002841	视源股份	100	3,460.00	0.00
151	002555	三七互娱	200	3,458.00	0.00
152	300857	协创数据	40	3,442.40	0.00
153	300024	机器人	200	3,436.00	0.00
154	002222	福晶科技	100	3,420.00	0.00
155	002405	四维图新	400	3,416.00	0.00
156	002683	广东宏大	100	3,394.00	0.00
157	300418	昆仑万维	100	3,363.00	0.00
158	300253	卫宁健康	316	3,349.60	0.00
159	002472	双环传动	100	3,349.00	0.00
160	300773	拉卡拉	100	3,345.00	0.00
161	000301	东方盛虹	400	3,332.00	0.00
162	300142	沃森生物	300	3,300.00	0.00
163	002487	大金重工	100	3,290.00	0.00
164	300919	中伟股份	100	3,288.00	0.00
165	002157	正邦科技	1,200	3,276.00	0.00
166	000997	新大陆	100	3,238.00	0.00

167	002916	深南电路	30	3,234.30	0.00
168	002459	晶澳科技	324	3,233.52	0.00
169	300017	网宿科技	300	3,216.00	0.00
170	002273	水晶光电	161	3,215.17	0.00
171	002938	鹏鼎控股	100	3,203.00	0.00
172	000728	国元证券	405	3,195.45	0.00
173	300394	天孚通信	40	3,193.60	0.00
174	300776	帝尔激光	60	3,192.60	0.00
175	002085	万丰奥威	200	3,178.00	0.00
176	000426	兴业银锡	200	3,160.00	0.00
177	301358	湖南裕能	100	3,119.00	0.00
178	002709	天赐材料	172	3,116.64	0.00
179	000960	锡业股份	200	3,060.00	0.00
180	002624	完美世界	200	3,034.00	0.00
181	300674	宇信科技	100	3,029.00	0.00
182	000893	亚钾国际	100	3,014.00	0.00
183	000750	国海证券	730	3,007.60	0.00
184	300623	捷捷微电	100	2,980.00	0.00
185	300999	金龙鱼	100	2,953.00	0.00
186	002773	康弘药业	100	2,897.00	0.00
187	002151	北斗星通	100	2,869.00	0.00
188	300054	鼎龙股份	100	2,868.00	0.00
189	300638	广和通	100	2,863.00	0.00
190	300383	光环新网	200	2,860.00	0.00
191	002155	湖南黄金	160	2,856.00	0.00
192	002138	顺络电子	100	2,812.00	0.00
193	300459	汤姆猫	502	2,811.20	0.00
194	002568	百润股份	108	2,765.88	0.00
195	002139	拓邦股份	200	2,762.00	0.00
196	300438	鹏辉能源	100	2,761.00	0.00
197	300003	乐普医疗	200	2,756.00	0.00
198	301236	软通动力	50	2,732.00	0.00
199	000932	华菱钢铁	620	2,728.00	0.00
200	000062	深圳华强	100	2,686.00	0.00
201	300775	三角防务	100	2,686.00	0.00
202	002410	广联达	200	2,682.00	0.00
203	300347	泰格医药	50	2,666.00	0.00
204	300364	中文在线	100	2,650.00	0.00
205	300285	国瓷材料	150	2,602.50	0.00
206	000729	燕京啤酒	200	2,586.00	0.00
207	002738	中矿资源	80	2,572.80	0.00
208	000921	海信家电	100	2,570.00	0.00
209	002245	蔚蓝锂芯	200	2,566.00	0.00

210	000983	山西焦煤	400	2,560.00	0.00
211	002389	航天彩虹	100	2,560.00	0.00
212	002444	巨星科技	100	2,551.00	0.00
213	002044	美年健康	496	2,549.44	0.00
214	000878	云南铜业	200	2,544.00	0.00
215	000623	吉林敖东	150	2,542.50	0.00
216	000766	通化金马	100	2,537.00	0.00
217	002080	中材科技	130	2,535.00	0.00
218	002958	青农商行	700	2,527.00	0.00
219	300568	星源材质	199	2,523.32	0.00
220	300735	光弘科技	100	2,510.00	0.00
221	002414	高德红外	240	2,460.00	0.00
222	002607	中公教育	800	2,448.00	0.00
223	300296	利亚德	400	2,440.00	0.00
224	002008	大族激光	100	2,437.00	0.00
225	002126	银轮股份	100	2,428.00	0.00
226	002385	大北农	600	2,424.00	0.00
227	300413	芒果超媒	110	2,400.20	0.00
228	300001	特锐德	100	2,397.00	0.00
229	000009	中国宝安	269	2,388.72	0.00
230	300088	长信科技	400	2,384.00	0.00
231	300458	全志科技	60	2,381.40	0.00
232	002603	以岭药业	168	2,368.80	0.00
233	000403	派林生物	130	2,356.90	0.00
234	002597	金禾实业	100	2,355.00	0.00
235	300432	富临精工	180	2,352.60	0.00
236	002152	广电运通	175	2,352.00	0.00
237	002544	普天科技	100	2,345.00	0.00
238	002831	裕同科技	100	2,342.00	0.00
239	002318	久立特材	100	2,339.00	0.00
240	300012	华测检测	200	2,338.00	0.00
241	000415	渤海租赁	700	2,331.00	0.00
242	002402	和而泰	100	2,317.00	0.00
243	002312	川发龙蟒	200	2,296.00	0.00
244	301029	怡合达	100	2,286.00	0.00
245	002739	万达电影	200	2,286.00	0.00
246	002497	雅化集团	200	2,280.00	0.00
247	000039	中集集团	290	2,279.40	0.00
248	002617	露笑科技	300	2,259.00	0.00
249	300298	三诺生物	100	2,259.00	0.00
250	000818	航锦科技	100	2,250.00	0.00
251	300146	汤臣倍健	200	2,248.00	0.00
252	001696	宗申动力	100	2,245.00	0.00

253	002268	电科网安	120	2,194.80	0.00
254	000519	中兵红箭	100	2,189.00	0.00
255	000099	中信海直	100	2,178.00	0.00
256	002176	江特电机	300	2,178.00	0.00
257	000400	许继电气	100	2,177.00	0.00
258	300212	易华录	100	2,176.00	0.00
259	002557	洽洽食品	100	2,162.00	0.00
260	000723	美锦能源	500	2,160.00	0.00
261	000999	华润三九	69	2,158.32	0.00
262	300529	健帆生物	100	2,157.00	0.00
263	000703	恒逸石化	356	2,093.28	0.00
264	002262	恩华药业	100	2,078.00	0.00
265	000738	航发控制	100	2,075.00	0.00
266	300573	兴齐眼药	40	2,071.60	0.00
267	002203	海亮股份	200	2,064.00	0.00
268	000060	中金岭南	450	2,061.00	0.00
269	000830	鲁西化工	200	2,060.00	0.00
270	300144	宋城演艺	240	2,052.00	0.00
271	000958	电投产融	300	2,052.00	0.00
272	002484	江海股份	100	2,049.00	0.00
273	002747	埃斯顿	100	2,024.00	0.00
274	000032	深桑达 A	100	2,023.00	0.00
275	002007	华兰生物	129	2,021.43	0.00
276	000528	柳工	210	2,018.10	0.00
277	300782	卓胜微	28	1,998.36	0.00
278	300034	钢研高纳	120	1,995.60	0.00
279	002064	华峰化学	300	1,983.00	0.00
280	002249	大洋电机	300	1,974.00	0.00
281	000998	隆平高科	200	1,970.00	0.00
282	000155	川能动力	200	1,964.00	0.00
283	002407	多氟多	160	1,950.40	0.00
284	002244	滨江集团	200	1,950.00	0.00
285	002019	亿帆医药	150	1,948.50	0.00
286	002430	杭氧股份	100	1,942.00	0.00
287	002221	东华能源	200	1,932.00	0.00
288	300182	捷成股份	349	1,922.99	0.00
289	000762	西藏矿业	100	1,918.00	0.00
290	000683	博源化工	400	1,916.00	0.00
291	002508	老板电器	100	1,901.00	0.00
292	300346	南大光电	60	1,898.40	0.00
293	000581	威孚高科	100	1,894.00	0.00
294	300761	立华股份	100	1,879.00	0.00
295	002984	森麒麟	100	1,875.00	0.00

296	002368	太极股份	80	1,873.60	0.00
297	002506	协鑫集成	700	1,869.00	0.00
298	002373	千方科技	200	1,860.00	0.00
299	300229	拓尔思	100	1,844.00	0.00
300	002048	宁波华翔	100	1,841.00	0.00
301	300070	碧水源	400	1,800.00	0.00
302	000629	钒钛股份	700	1,792.00	0.00
303	002926	华西证券	200	1,788.00	0.00
304	002701	奥瑞金	300	1,785.00	0.00
305	000887	中鼎股份	100	1,759.00	0.00
306	000591	太阳能	400	1,756.00	0.00
307	002500	山西证券	300	1,752.00	0.00
308	001227	兰州银行	700	1,750.00	0.00
309	300456	赛微电子	100	1,719.00	0.00
310	000563	陕国投 A	480	1,713.60	0.00
311	000050	深天马 A	200	1,704.00	0.00
312	002145	中核钛白	405	1,680.75	0.00
313	000547	航天发展	200	1,680.00	0.00
314	002939	长城证券	200	1,676.00	0.00
315	002270	华明装备	100	1,674.00	0.00
316	000987	越秀资本	241	1,653.26	0.00
317	000708	中信特钢	140	1,646.40	0.00
318	002936	郑州银行	790	1,627.40	0.00
319	002832	比音勒芬	100	1,605.00	0.00
320	002439	启明星辰	100	1,599.00	0.00
321	000156	华数传媒	200	1,588.00	0.00
322	003022	联泓新科	100	1,583.00	0.00
323	002745	木林森	200	1,576.00	0.00
324	000801	四川九洲	100	1,562.00	0.00
325	002865	钧达股份	40	1,560.00	0.00
326	002698	博实股份	100	1,554.00	0.00
327	002948	青岛银行	310	1,543.80	0.00
328	002507	涪陵榨菜	120	1,534.80	0.00
329	002429	兆驰股份	350	1,533.00	0.00
330	000559	万向钱潮	200	1,530.00	0.00
331	300595	欧普康视	100	1,527.00	0.00
332	000686	东北证券	200	1,526.00	0.00
333	300009	安科生物	182	1,523.34	0.00
334	000875	吉电股份	300	1,518.00	0.00
335	002670	国盛金控	100	1,505.00	0.00
336	000778	新兴铸管	400	1,488.00	0.00
337	300026	红日药业	400	1,476.00	0.00
338	300747	锐科激光	62	1,468.16	0.00

339	002091	江苏国泰	200	1,454.00	0.00
340	000598	兴蓉环境	200	1,442.00	0.00
341	002675	东诚药业	100	1,439.00	0.00
342	000825	太钢不锈	400	1,436.00	0.00
343	002299	圣农发展	100	1,429.00	0.00
344	002531	天顺风能	200	1,428.00	0.00
345	000555	神州信息	100	1,422.00	0.00
346	002056	横店东磁	100	1,415.00	0.00
347	000970	中科三环	120	1,412.40	0.00
348	000951	中国重汽	80	1,406.40	0.00
349	002572	索菲亚	100	1,401.00	0.00
350	000739	普洛药业	100	1,400.00	0.00
351	300627	华测导航	40	1,400.00	0.00
352	000543	皖能电力	200	1,400.00	0.00
353	000967	盈峰环境	200	1,390.00	0.00
354	002183	怡亚通	300	1,383.00	0.00
355	000902	新洋丰	100	1,383.00	0.00
356	000089	深圳机场	200	1,380.00	0.00
357	000636	风华高科	100	1,374.00	0.00
358	000800	一汽解放	200	1,372.00	0.00
359	000883	湖北能源	300	1,353.00	0.00
360	000069	华侨城 A	600	1,350.00	0.00
361	000429	粤高速 A	100	1,333.00	0.00
362	002153	石基信息	152	1,316.32	0.00
363	301078	孩子王	100	1,307.00	0.00
364	300294	博雅生物	50	1,299.50	0.00
365	000709	河钢股份	600	1,296.00	0.00
366	002240	盛新锂能	100	1,288.00	0.00
367	000035	中国天楹	300	1,287.00	0.00
368	002096	易普力	100	1,241.00	0.00
369	300748	金力永磁	52	1,239.68	0.00
370	001914	招商积余	100	1,237.00	0.00
371	002266	浙富控股	400	1,232.00	0.00
372	002423	中粮资本	100	1,223.00	0.00
373	300601	康泰生物	80	1,215.20	0.00
374	301301	川宁生物	100	1,204.00	0.00
375	002416	爱施德	100	1,202.00	0.00
376	000422	湖北宜化	100	1,192.00	0.00
377	000657	中钨高新	100	1,186.00	0.00
378	002237	恒邦股份	100	1,180.00	0.00
379	002120	韵达股份	176	1,179.20	0.00
380	000810	创维数字	100	1,178.00	0.00
381	300682	朗新集团	50	1,175.00	0.00

382	000937	冀中能源	200	1,150.00	0.00
383	300457	赢合科技	50	1,150.00	0.00
384	300390	天华新能	60	1,144.20	0.00
385	002461	珠江啤酒	100	1,129.00	0.00
386	002010	传化智联	200	1,116.00	0.00
387	002003	伟星股份	100	1,091.00	0.00
388	000737	北方铜业	100	1,086.00	0.00
389	002468	申通快递	100	1,069.00	0.00
390	000682	东方电子	100	1,024.00	0.00
391	000027	深圳能源	160	1,020.80	0.00
392	002690	美亚光电	60	1,012.20	0.00
393	002541	鸿路钢构	60	1,004.40	0.00
394	000552	甘肃能化	400	988.00	0.00
395	300118	东方日升	100	958.00	0.00
396	002756	永兴材料	30	952.50	0.00
397	000898	鞍钢股份	410	951.20	0.00
398	300677	英科医疗	40	947.20	0.00
399	001203	大中矿业	100	945.00	0.00
400	000877	天山股份	200	928.00	0.00
401	003035	南网能源	200	918.00	0.00
402	000785	居然智家	300	915.00	0.00
403	000088	盐田港	200	906.00	0.00
404	000966	长源电力	200	900.00	0.00
405	002408	齐翔腾达	200	896.00	0.00
406	001286	陕西能源	100	870.00	0.00
407	000537	中绿电	100	836.00	0.00
408	000582	北部湾港	100	825.00	0.00
409	301039	中集车辆	100	813.00	0.00
410	000927	中国铁物	300	771.00	0.00
411	000401	冀东水泥	176	770.88	0.00
412	002608	江苏国信	100	733.00	0.00
413	002320	海峡股份	112	732.48	0.00
414	000513	丽珠集团	20	720.80	0.00
415	002925	盈趣科技	40	719.20	0.00
416	002060	广东建工	200	696.00	0.00
417	000959	首钢股份	200	680.00	0.00
418	002498	汉缆股份	200	676.00	0.00
419	000791	甘肃能源	100	638.00	0.00
420	002372	伟星新材	60	621.60	0.00
421	300140	节能环保	100	617.00	0.00
422	002563	森马服饰	100	526.00	0.00
423	000539	粤电力 A	100	454.00	0.00
424	001213	中铁特货	100	406.00	0.00

425	002867	周大生	25	329.50	0.00
426	000567	海德股份	45	266.40	0.00
427	400174	中天 3	500	70.00	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	300750	宁德时代	588,436.00	0.27
2	000333	美的集团	380,338.00	0.17
3	002594	比亚迪	291,705.00	0.13
4	300059	东方财富	281,440.12	0.13
5	000858	五粮液	261,212.00	0.12
6	000651	格力电器	208,550.00	0.09
7	002475	立讯精密	169,823.00	0.08
8	002371	北方华创	167,006.00	0.08
9	000725	京东方 A	141,060.00	0.06
10	300760	迈瑞医疗	136,563.00	0.06
11	300124	汇川技术	128,159.00	0.06
12	000063	中兴通讯	113,615.00	0.05
13	002415	海康威视	109,194.00	0.05
14	002714	牧原股份	101,670.00	0.05
15	000001	平安银行	98,787.00	0.04
16	002352	顺丰控股	95,443.00	0.04
17	300498	温氏股份	93,743.00	0.04
18	002230	科大讯飞	92,394.00	0.04
19	300274	阳光电源	89,052.00	0.04
20	000568	泸州老窖	87,793.00	0.04

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	300750	宁德时代	1,575,281.00	0.71
2	000333	美的集团	921,557.00	0.42
3	002594	比亚迪	811,331.00	0.37
4	300059	东方财富	720,002.00	0.33
5	000858	五粮液	605,428.00	0.27
6	000651	格力电器	485,609.00	0.22

7	002475	立讯精密	435,065.00	0.20
8	002371	北方华创	382,919.00	0.17
9	300760	迈瑞医疗	358,416.00	0.16
10	000725	京东方 A	351,120.00	0.16
11	300124	汇川技术	314,969.00	0.14
12	002415	海康威视	278,450.00	0.13
13	000063	中兴通讯	277,245.00	0.13
14	000001	平安银行	249,236.00	0.11
15	300274	阳光电源	248,739.00	0.11
16	002714	牧原股份	247,563.00	0.11
17	300308	中际旭创	245,584.00	0.11
18	002352	顺丰控股	238,984.00	0.11
19	002230	科大讯飞	232,385.00	0.11
20	300498	温氏股份	227,924.00	0.10

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	11,297,958.71
卖出股票收入（成交）总额	29,072,927.63

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	1,205,288.88	0.62
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）	200.01	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,205,488.89	0.62

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	019766	25 国债 01	12,000	1,205,288.88	0.62
2	123257	安克转债	2	200.01	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

无。

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	南方深证成份 ETF	股票型	交易型开放式	南方基金管理股份有限公司	183,911,998.78	94.03

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（如有）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	13,097.56
2	应收清算款	2,208,539.29
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	185,084.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,406,721.02

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

无。

§ 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

南方深证成份 ETF 联接 A	13,020	12,028.46	317,871.39	0.20%	156,292,730.11	99.80%
南方深证成份 ETF 联接 C	5,375	8,624.48	-	-	46,356,595.49	100.00%
合计	18,395	11,033.82	317,871.39	0.16%	202,649,325.60	99.84%

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	南方深证成份 ETF 联接 A	1,249,493.86	0.7978%
	南方深证成份 ETF 联接 C	53.86	0.0001%
	合计	1,249,547.72	0.6156%

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）。

8.3 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

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	南方深证成份 ETF 联接 A	>100
	南方深证成份 ETF 联接 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	南方深证成份 ETF 联接 A	0~10
	南方深证成份 ETF 联接 C	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方深证成份 ETF 联接 A	南方深证成份 ETF 联接 C
基金合同生效日(2009 年 12 月 9 日)基金份额总额	3,272,356,687.80	-

本报告期期初基金份额总额	172,110,852.62	59,751,759.89
本报告期基金总申购份额	19,274,323.46	45,343,438.47
减：本报告期基金总赎回份额	34,774,574.58	58,738,602.87
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	156,610,601.50	46,356,595.49

§ 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，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

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。

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	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	
国信证券	1	33,611,033.34	83.26%	3,358.76	83.25%	-
华泰证券	3	6,759,853.00	16.74%	675.56	16.75%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	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交易单元租用协议后将其入库，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
国信证券	919.94	0.08%	-	-	-	-	28,793,703.37	100.00%
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	1,196,412.00	99.92%	10,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-

信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-

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	南方基金关于直销平台相关业务费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-01
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(2024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	2025-03-31

§ 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深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件;
- 2、《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》;
- 3、《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》;
- 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、《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2025 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>