

南方中证互联网指数证券投资基金 (LOF) 2023 年第 2 季度报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 7 月 21 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	南方中证互联网指数（LOF）
场内简称	互联基金
基金主代码	160137
交易代码	160137
基金运作方式	上市型开放式（LOF）
基金合同生效日	2020 年 12 月 1 日
报告期末基金份额总额	129,123,490.92 份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，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。 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，并辅之以金融衍生产品投资管理等，力争控制本基金的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 0.30%，年跟踪误差不得超过 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	中证互联网指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金属于股票型基金，一般而言，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	南方中证互联网指数（LOF）A	南方中证互联网指数（LOF）C
下属分级基金的场内简称	互联基金	
下属分级基金的交易代码	160137	018533
报告期末下属分级基金的份额总额	124,044,123.29 份	5,079,367.63 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023年4月1日—2023年6月30日）	
	南方中证互联网指数（LOF）A	南方中证互联网指数（LOF）C
1.本期已实现收益	4,891,068.27	54,215.30
2.本期利润	-1,605,943.04	-77,976.52
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0125	-0.0390
4.期末基金资产净值	133,167,360.51	5,452,068.47
5.期末基金份额净值	1.0735	1.0734

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方中证互联网指数（LOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①-③	②-④
----	----------	------------	------------	------------	-----	-----

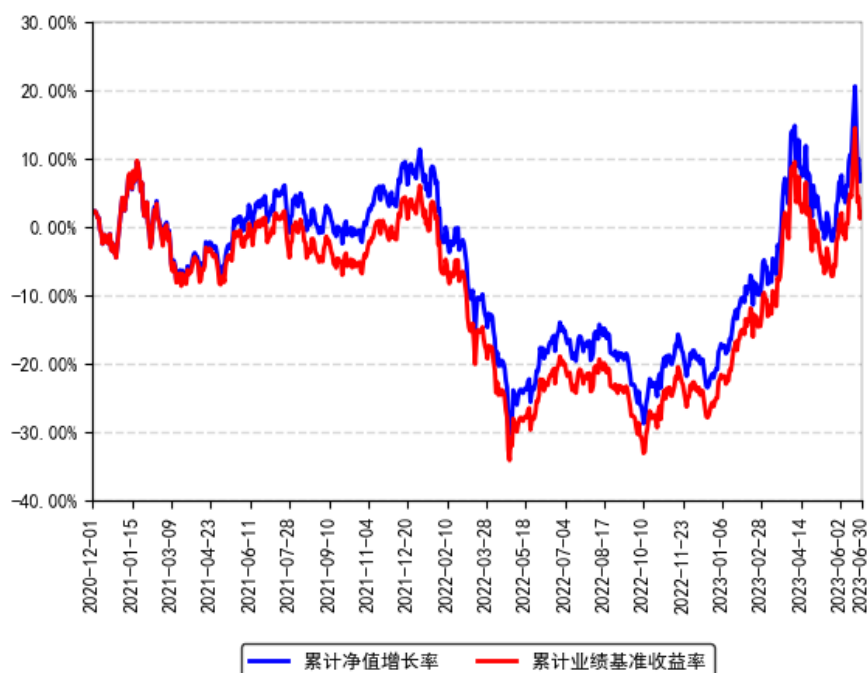
		②		准差④		
过去三个月	-0.78%	2.35%	-1.11%	2.40%	0.33%	-0.05%
过去六个月	35.63%	2.10%	36.06%	2.14%	-0.43%	-0.04%
过去一年	25.81%	1.75%	26.75%	1.79%	-0.94%	-0.04%
自基金合同生效起至今	7.35%	1.58%	1.94%	1.60%	5.41%	-0.02%

南方中证互联网指数（LOF）C

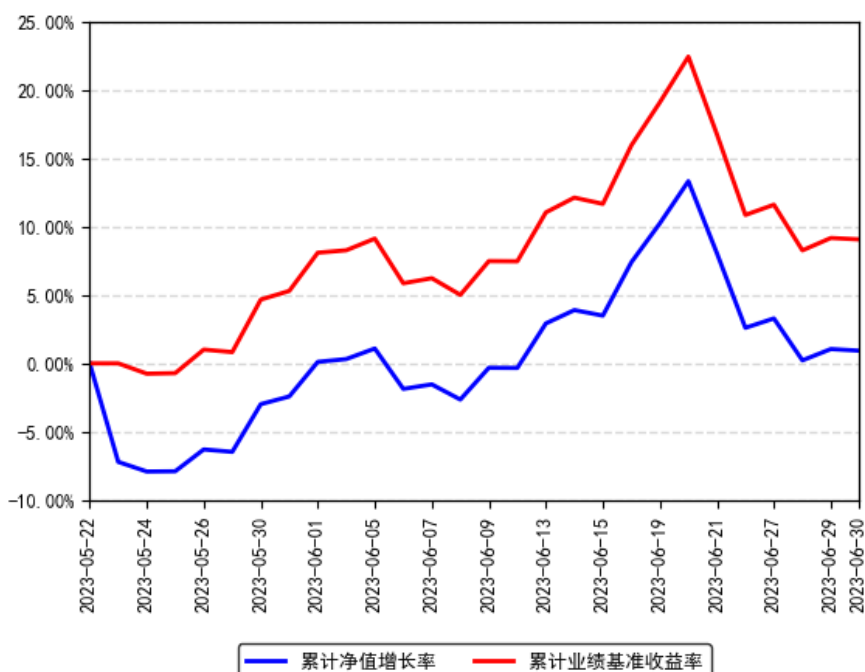
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	7.21%	2.31%	9.07%	2.31%	-1.86%	0.00%

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

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



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



注：本基金从2023年5月22日起新增C类份额，C类份额自2023年5月23日起存续。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
龚涛	本基金基金经理	2020年12月1日	-	15年	伦敦城市大学人工智能博士，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。曾就职于巴克莱资本（伦敦）、摩根大通（伦敦）、中信期货、华泰期货、易方达基金，历任中信期货量化研究团队负责人、华泰期货研究总监兼量化组负责人、易方达基金指数与量化投资部投资经理。2019年5月加入南方基金指数投资部；2019年7月12日至2020年12月1日，任互联基金基金经理；2019年7月12日至今，任南方中证100、南方小康ETF、南方小康ETF联接基金经理；2020年12月1日至今，任互联基金基金经理；2021年1月22日至今，任新能源ETF基金经理；2021年8月24日至今，任南方中证新能源联接基金经理；2021年9月29日

				至今,任南方中证科技100ETF基金经理 2021年11月12日至今,兼任投资经理 2021年11月15日至今,任南方中证物联网主题ETF基金经理 2021年11月26日至今,任长江保护主题ETF基金经理 2021年12月10日至今,任南方上证科创板50成份ETF基金经理; 2021年12月17日至今,任南方富时中国国企开放共赢ETF基金经理; 2022年3月3日至今,任南方上海金ETF基金经理; 2022年9月30日至今,任南方上证科创板新材料ETF基金经理; 2023年4月11日至今,任南方中证长江保护主题ETF联接基金经理 2023年4月27日至今,任南方中证全指电力公用事业ETF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。

4.1.1 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
龚涛	公募基金	15	11,561,043,737.35	2019年07月12日
	私募资产管理计划	2	27,102,795.58	2022年03月10日
	其他组合	-	-	-
	合计	17	11,588,146,532.93	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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。

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 10 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

中证互联网指数报告期内下跌 1.27%。

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

（3）新股上市初期涨幅较大的影响。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.0735 元，报告期内，份额净值增长率为-0.78%，同期业绩基准增长率为-1.11%；本基金 C 份额净值为 1.0734 元，报告期内，份额净值增长率为 7.21%，同期业绩基准增长率为 9.07%。

4.6 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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	131,442,334.54	93.82
	其中：股票	131,442,334.54	93.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,228,122.41	0.88
	其中：债券	1,228,122.41	0.88
	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	6,541,164.05	4.67
8	其他资产	890,246.60	0.64
9	合计	140,101,867.60	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	61,641,708.25	44.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	64,163,210.84	46.29
J	金融业	3,549,637.00	2.56
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	1,836,050.70	1.32
S	综合	-	-
	合计	131,190,606.79	94.64

5.2.2 报告期末积极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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	181,755.72	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,793.85	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,272.63	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,964.29	0.01
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	2,442.40	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,498.86	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	251,727.75	0.18

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	002415	海康威视	336,225	11,132,409.75	8.03
2	000063	中兴通讯	228,920	10,425,016.80	7.52
3	002230	科大讯飞	132,978	9,037,184.88	6.52
4	300308	中际旭创	46,100	6,797,445.00	4.90
5	688111	金山办公	13,158	6,213,470.76	4.48
6	000938	紫光股份	164,194	5,229,578.90	3.77
7	600570	恒生电子	109,071	4,830,754.59	3.48
8	603019	中科曙光	84,000	4,275,600.00	3.08
9	002555	三七互娱	111,400	3,885,632.00	2.80
10	000977	浪潮信息	73,900	3,584,150.00	2.59

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	301486	致尚科技	876	50,510.16	0.04
2	301488	豪恩汽电	1,159	46,105.02	0.03
3	001286	陕西能源	3,485	32,793.85	0.02
4	301202	朗威股份	1,224	31,603.68	0.02
5	301261	恒工精密	281	10,368.90	0.01

5.4 报告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	1,228,122.41	0.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,228,122.41	0.89

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	019638	20 国债 09	12,000	1,228,122.41	0.89

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-2,381.62
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-64,160.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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，三七互娱网络科技集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会的立案调查。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。

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

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

5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	30,386.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	859,859.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	890,246.60

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	301486	致尚科技	50,510.16	0.04	新股未上市
2	301488	豪恩汽电	41,490.54	0.03	新股未上市
3	301488	豪恩汽电	4,614.48	0.00	新股锁定期
4	001286	陕西能源	32,793.85	0.02	新股锁定期
5	301202	朗威股份	31,603.68	0.02	新股未上市
6	301261	恒工精密	10,368.90	0.01	新股未上市

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方中证互联网指数（LOF） A	南方中证互联网指数（LOF） C
报告期期初基金份额总额	119,547,885.42	-
报告期期间基金总申购份额	85,259,974.30	7,271,674.10
减：报告期期间基金总赎回份额	80,763,736.43	2,192,306.47
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	124,044,123.29	5,079,367.63

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《南方中证互联网指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 2、《南方中证互联网指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 3、南方中证互联网指数证券投资基金（LOF）2023 年 2 季度报告原文。

9.2 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。

9.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>