

上证 380 交易型开放式指数证券投资 基金 2024 年中期报告

2024 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 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.....	9
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.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	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.....	11
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.....	11
§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.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46

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	46
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12	投资组合报告附注	47
§8	基金份额持有人信息	48
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2	期末上市基金前十名持有人	48
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	49
§9	开放式基金份额变动	49
§10	重大事件揭示	49
10.1	基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4	基金投资策略的改变	50
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8	其他重大事件	52
§11	影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	52
§12	备查文件目录	53
12.1	备查文件目录	53
12.2	存放地点	53
12.3	查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方上证 380ETF
场内简称	380ETF; 上证 380ETF
基金主代码	510290
交易代码	510290
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 16 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	90,448,915.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 11 月 8 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	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。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。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。
业绩比较基准	上证 380 指数，简称 380 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	中国建设银行股份有限公司

	公司	
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	021-60637228
传真	0755-82763889	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518017	100033
法定代表人	周易	张金良

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	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(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,508,595.73
本期利润	-5,990,414.12
加权平均基金份额本期利润	-0.0643
本期加权平均净值利润率	-3.52%
本期基金份额净值增长率	-4.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	70,432,420.19
期末可供分配基金份额利润	0.7786

期末基金资产净值	160,881,335.19
期末基金份额净值	1.7787
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	77.87%

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

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

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

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
过去一个月	-5.71%	0.81%	-6.93%	0.83%	1.22%	-0.02%
过去三个月	-2.39%	0.95%	-3.89%	0.96%	1.50%	-0.01%
过去六个月	-4.00%	1.28%	-5.38%	1.28%	1.38%	0.00%
过去一年	-11.23%	1.04%	-12.86%	1.04%	1.63%	0.00%
过去三年	-14.95%	1.08%	-21.05%	1.08%	6.10%	0.00%
自基金合同生效起至今	77.87%	1.52%	32.01%	1.52%	45.86%	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

南方上证380ETF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



§ 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	2019 年 7 月 12 日	-	14 年	北京大学工商管理硕士，特许金融分析师（CFA）、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，两两组合同单日、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 69 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

2024 年开年，A 股市场延续了 23 年的下行趋势，并于 2 月初创出年内新低后企稳反弹。

经济方面，上半年国内经济保持总体平稳、稳中有进的良好态势，工业生产加速回暖，制造业投资回升，企业盈利修复，但依然存在有效需求不足和地产数据持续下滑的隐忧。

政策方面，发力点包括推动内需扩大、优化房地产政策、以及通过发行国债支持基础设施投资等，支持效应持续显现。

流动性方面，海外流动性迎来拐点，国内宏观流动性继续宽松且无风险利率持续下行，但资本市场总体缺少增量资金入市。

在 A 股生态环境变化和监管趋严的背景下，小微市值风格股票大幅下跌，大小盘市值风格走势分化显著，市场总体呈现较低风险偏好。

上证 380 指数由上海证券交易所中规模适中、流动性好、代表性强的 380 家上市公司股票组成，反映上海市场中型上市公司的整体表现。本报告期内，上证 380 指数下跌 5.38%。

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 ETF 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) 新股上市初期涨幅较大的影响；
- (2) 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；
- (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。

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 1.7787 元，报告期内，份额净值增长率为-4.00%，同期业绩基准增长率为-5.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济结构将继续优化，服务业和消费对经济增长的贡献将持续加大，新质生产力将推动新产业、新业态的涌现和发展。

A 股资本市场有效性不断提升，机构化、国际化和长期化依然是未来长期发展趋势。

当前主要宽基指数的估值普遍处于历史低位，为长期配置提供了较佳的时间窗口。

虽然市场短期缺乏增量资金，但长期看，低利率时代下稳定高回报资产的稀缺，决定了未来居民在权益市场投资上巨大的增长潜力。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、现金及债券指数投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变

估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：上证 380 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.3.1	1,028,446.66	706,795.65
结算备付金		2,137.17	489,397.72
存出保证金		430.13	130,858.70
交易性金融资产	6.4.3.2	160,693,922.08	170,268,724.60
其中：股票投资		160,644,918.43	170,223,721.64
基金投资		-	-
债券投资		49,003.65	45,002.96
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	-
资产总计		161,724,936.04	171,595,776.67
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		-	-
应付清算款		638,682.62	35,316.95

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		66,822.59	69,688.05
应付托管费		13,364.53	13,937.64
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.16	0.10
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	124,730.95	190,122.57
负债合计		843,600.85	309,065.31
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	90,448,915.00	92,448,915.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	70,432,420.19	78,837,796.36
净资产合计		160,881,335.19	171,286,711.36
负债和净资产总计		161,724,936.04	171,595,776.67

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7787 元，基金份额总额 90,448,915.00 份。

6.2 利润表

会计主体：上证 380 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-5,327,659.66	5,131,668.22
1.利息收入		1,246.51	7,019.93
其中：存款利息收入	6.4.3.9	1,246.51	7,019.93
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）		-848,893.57	4,242,686.38
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-3,718,998.34	1,742,146.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	11,150.37	57,180.22
资产支持证券投资		-	-

收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.12	-51,431.82	-8,905.54
股利收益	6.4.3.13	2,910,386.22	2,452,265.09
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）	6.4.3.14	-4,481,818.39	881,961.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.15	1,805.79	-
减：二、营业总支出		662,754.46	653,561.63
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	423,378.35	415,868.07
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.6.2.2	84,675.72	83,173.56
3.销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
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		-	-
7.税金及附加		0.03	37.44
8.其他费用	6.4.3.16	154,700.36	154,482.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,990,414.12	4,478,106.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,990,414.12	4,478,106.59
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-5,990,414.12	4,478,106.59

6.3 净资产变动表

会计主体：上证 380 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	92,448,915.00	-	78,837,796.36	171,286,711.36

资产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	92,448,915.00	-	78,837,796.36	171,286,711.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,000,000.00	-	-8,405,376.17	-10,405,376.17
（一）、综合收益总额	-	-	-5,990,414.12	-5,990,414.12
（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）	-2,000,000.00	-	-2,414,962.05	-4,414,962.05
其中：1.基金申购款	6,000,000.00	-	4,577,570.97	10,577,570.97
2.基金赎回款	-8,000,000.00	-	-6,992,533.02	-14,992,533.02
（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	90,448,915.00	-	70,432,420.19	160,881,335.19
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	84,448,915.00	-	80,636,584.66	165,085,499.66
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	84,448,915.00	-	80,636,584.66	165,085,499.66

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,000,000.00	-	2,118,187.09	118,187.09
(一)、综合收益总额	-	-	4,478,106.59	4,478,106.59
(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)	-2,000,000.00	-	-2,359,919.50	-4,359,919.50
其中：1.基金申购款	2,000,000.00	-	1,965,106.49	3,965,106.49
2.基金赎回款	-4,000,000.00	-	-4,325,025.99	-8,325,025.99
(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	82,448,915.00	-	82,754,771.75	165,203,686.75

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____ ____常克川____ ____徐超____
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,028,446.66
等于：本金	1,028,366.80
加：应计利息	79.86
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	1,028,446.66

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	186,463,656.32	-	160,644,918.43	-25,818,737.89	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	49,000.00	3.65	49,003.65	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	49,000.00	3.65	49,003.65	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	186,512,656.32	3.65	160,693,922.08	-25,818,737.89	

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,195.59
其中：交易所市场	5,195.59
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	-
预提费用	84,535.36
应付指数使用费	35,000.00
可退替代款	-
合计	124,730.95

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	92,448,915.00	92,448,915.00
本期申购	6,000,000.00	6,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-8,000,000.00	-8,000,000.00
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	90,448,915.00	90,448,915.00

注：红利再投及转入份额计入本期申购，转出份额计入本期赎回。

6.4.3.8 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	100,657,452.03	-21,819,655.67	78,837,796.36
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	100,657,452.03	-21,819,655.67	78,837,796.36
本期利润	-1,508,595.73	-4,481,818.39	-5,990,414.12
本期基金份额交易产生的变动数	-2,112,143.45	-302,818.60	-2,414,962.05
其中：基金申购款	6,495,559.05	-1,917,988.08	4,577,570.97
基金赎回款	-8,607,702.50	1,615,169.48	-6,992,533.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	97,036,712.85	-26,604,292.66	70,432,420.19

6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	593.39
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	649.73
其他	3.39
合计	1,246.51

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,139,061.26
股票投资收益——赎回差价收入	-1,579,937.08
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	-3,718,998.34

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	26,918,893.08

减：卖出股票成本总额	29,035,159.76
减：交易费用	22,794.58
买卖股票差价收入	-2,139,061.26

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.3.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	14,992,533.02
减：现金支付赎回款总额	12,272.02
减：赎回股票成本总额	16,560,198.08
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,579,937.08

6.4.3.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.3.11 债券投资收益

6.4.3.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	9.53
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	11,140.84
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	11,150.37

6.4.3.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	60,152.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	49,000.00
减：应计利息总额	9.18
减：交易费用	2.41
买卖债券差价收入	11,140.84

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.3.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.3.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.3.12 衍生工具收益

6.4.3.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.3.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	-51,431.82

6.4.3.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,910,386.22
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	2,910,386.22

6.4.3.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-4,475,498.39
——股票投资	-4,475,498.39
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-6,320.00
——权证投资	-
——期货投资	-6,320.00
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	-4,481,818.39

6.4.3.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,805.79

合计	1,805.79
----	----------

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。

6.4.3.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	70,000.00
银行费用	165.00
合计	154,700.36

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司("南方基金")	基金管理人
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人
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
南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金("南方上证 380ETF 联接基金")	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	2,627,566.01	4.62%	1,214,225.00	2.80%

6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	-	105,428.45	39.31%

6.4.6.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.6.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	262.77	4.62%	26.25	0.51%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	121.38	2.73%	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 该类佣金协议的服务范围符合《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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	423,378.35	415,868.07
其中：应支付销售机构的客	-	-

户维护费		
应支付基金管理人的净管理费	423,378.35	415,868.07

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 0.50% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	84,675.72	83,173.56

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.6.2.3 销售服务费

无。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	330,000.00	0.36%	385,800.00	0.42%
中国建设银行股份有限公司—南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	78,513,441.00	86.80%	78,513,441.00	84.93%

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。

6.4.6.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
中国建设银行	1,028,446.66	593.39	918,660.06	1,385.66

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

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-
兴业证券,华泰联合	-	-	-	-	-

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
华泰联合	113066	平煤转债	配债	750	75,000.00
华泰联合	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合	113666	爱玛转债	配债	260	26,000.00
兴业证券	113670	金 23 转债	配债	130	13,000.00
兴业证券,华	601916	浙商银行	配股	125,700	253,914.00

泰联合					
-----	--	--	--	--	--

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.8 期末（2024 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.8.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113685	升 24 转债	2024 年 6 月 17 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.01	490	49,000.00	49,003.65	-

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪上证 380 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，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。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，跟踪上证 380 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，将风险控制可在承受的范围之内。

6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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。

6.4.9.3 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同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。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

6.4.9.4 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 2024 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	1,028,446.66	-	-	-	1,028,446.66
结算备付金	2,137.17	-	-	-	2,137.17
存出保证金	430.13	-	-	-	430.13
交易性金融资产	-	-	49,003.65	160,644,918.43	160,693,922.08
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	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,031,013.96	-	49,003.65	160,644,918.43	161,724,936.04
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	-	-	-	638,682.62	638,682.62
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	66,822.59	66,822.59
应付托管费	-	-	-	13,364.53	13,364.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.16	0.16
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	124,730.95	124,730.95
负债总计	-	-	-	843,600.85	843,600.85
利率敏感度缺口	1,031,013.96	-	49,003.65	159,801,317.58	160,881,335.19
上年度末 2023 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	706,795.65	-	-	-	706,795.65
结算备付金	489,397.72	-	-	-	489,397.72
存出保证金	908.30	-	-	129,950.40	130,858.70
交易性金融资产	-	45,002.96	-	170,223,721.64	170,268,724.60
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	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,197,101.67	45,002.96	-	170,353,672.04	171,595,776.67
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	-	-	-	35,316.95	35,316.95
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	69,688.05	69,688.05
应付托管费	-	-	-	13,937.64	13,937.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.10	0.10
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	190,122.57	190,122.57
负债总计	-	-	-	309,065.31	309,065.31
利率敏感度缺口	1,197,101.67	45,002.96	-	170,044,606.73	171,286,711.36

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 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

6.4.9.4.2 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。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，跟踪上证 380 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，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，上证 380 指数成份股和备选成份股股票投资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。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。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	160,644,918.43	99.85	170,223,721.64	99.38
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	160,644,918.43	99.85	170,223,721.64	99.38

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资。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。

6.4.9.4.3.2 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	7,983,985.46	8,521,700.77
	2.组合自身基准下降 5%	-7,983,985.46	-8,521,700.77

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 2024 年 6 月 30 日
第一层次	160,644,918.43
第二层次	49,003.65
第三层次	-
合计	160,693,922.08

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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	160,644,918.43	99.33
	其中：股票	160,644,918.43	99.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	49,003.65	0.03
	其中：债券	49,003.65	0.03
	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	1,030,583.83	0.64
8	其他各项资产	430.13	0.00
9	合计	161,724,936.04	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	405,925.00	0.25
B	采矿业	11,683,408.25	7.26
C	制造业	81,749,786.17	50.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,447,385.50	5.25
E	建筑业	4,289,580.41	2.67

F	批发和零售业	3,438,976.66	2.14
G	交通运输、仓储和邮政业	8,872,459.15	5.51
H	住宿和餐饮业	378,749.80	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,583,825.47	5.34
J	金融业	22,599,145.33	14.05
K	房地产业	2,876,581.10	1.79
L	租赁和商务服务业	2,053,486.98	1.28
M	科学研究和技术服务业	1,375,751.63	0.86
N	水利、环境和公共设施管理业	1,539,475.30	0.96
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	1,863,270.00	1.16
S	综合	487,111.68	0.30
	合计	160,644,918.43	99.85

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.2.3 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。

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 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	601229	上海银行	456,800	3,316,368.00	2.06
2	601009	南京银行	237,600	2,468,664.00	1.53
3	600926	杭州银行	163,400	2,132,370.00	1.33
4	600015	华夏银行	292,400	1,871,360.00	1.16
5	600674	川投能源	89,600	1,680,000.00	1.04
6	600066	宇通客车	61,100	1,576,380.00	0.98
7	601825	沪农商行	221,500	1,488,480.00	0.93
8	601077	渝农商行	284,400	1,427,688.00	0.89
9	600256	广汇能源	211,100	1,414,370.00	0.88
10	601838	成都银行	87,600	1,330,644.00	0.83
11	600161	天坛生物	54,500	1,329,800.00	0.83
12	601021	春秋航空	22,521	1,268,607.93	0.79
13	600845	宝信软件	39,679	1,266,950.47	0.79

14	600233	圆通速递	79,200	1,239,480.00	0.77
15	601233	桐昆股份	77,500	1,236,900.00	0.77
16	600741	华域汽车	72,400	1,185,912.00	0.74
17	600183	生益科技	54,300	1,143,558.00	0.71
18	601567	三星医疗	32,383	1,133,405.00	0.70
19	600885	宏发股份	38,326	1,060,863.68	0.66
20	601898	中煤能源	84,100	1,049,568.00	0.65
21	601128	常熟银行	138,481	1,048,301.17	0.65
22	601699	潞安环能	54,900	995,337.00	0.62
23	601108	财通证券	149,300	986,873.00	0.61
24	600039	四川路桥	120,180	948,220.20	0.59
25	600879	航天电子	121,300	942,501.00	0.59
26	601877	正泰电器	49,400	941,564.00	0.59
27	688617	惠泰医疗	2,015	919,041.50	0.57
28	600873	梅花生物	91,700	918,834.00	0.57
29	688099	晶晨股份	15,412	914,239.84	0.57
30	600177	雅戈尔	127,500	907,800.00	0.56
31	601577	长沙银行	110,900	907,162.00	0.56
32	600079	人福医药	52,500	901,425.00	0.56
33	600109	国金证券	119,300	900,715.00	0.56
34	600025	华能水电	82,600	890,428.00	0.55
35	600803	新奥股份	42,650	887,120.00	0.55
36	603979	金诚信	17,000	859,010.00	0.53
37	688120	华海清科	4,408	835,668.64	0.52
38	600985	淮北矿业	49,500	828,630.00	0.52
39	600536	中国软件	27,602	825,851.84	0.51
40	600348	华阳股份	82,800	824,688.00	0.51
41	688122	西部超导	20,964	803,340.48	0.50
42	600529	山东药玻	30,480	772,363.20	0.48
43	601666	平煤股份	68,211	763,963.20	0.47
44	603260	合盛硅业	16,300	761,373.00	0.47
45	600018	上港集团	128,300	741,574.00	0.46
46	601799	星宇股份	6,600	739,464.00	0.46
47	601717	郑煤机	49,600	734,080.00	0.46
48	603816	顾家家居	22,666	731,885.14	0.45
49	600862	中航高科	38,300	719,274.00	0.45
50	601198	东兴证券	89,100	709,236.00	0.44
51	601997	贵阳银行	134,400	708,288.00	0.44
52	603338	浙江鼎力	11,678	705,584.76	0.44
53	601865	福莱特	35,000	703,500.00	0.44
54	600863	内蒙华电	149,900	695,536.00	0.43
55	688188	柏楚电子	3,760	693,908.00	0.43
56	603195	公牛集团	8,955	690,609.60	0.43

57	600141	兴发集团	35,500	677,340.00	0.42
58	600549	厦门钨业	39,100	674,475.00	0.42
59	600699	均胜电子	45,300	671,346.00	0.42
60	600061	国投资本	118,000	666,700.00	0.41
61	600546	山煤国际	45,500	665,210.00	0.41
62	601677	明泰铝业	57,200	661,232.00	0.41
63	600820	隧道股份	101,100	660,183.00	0.41
64	688578	艾力斯	10,226	651,805.24	0.41
65	600021	上海电力	64,700	639,883.00	0.40
66	601000	唐山港	136,132	639,820.40	0.40
67	600486	扬农化工	11,277	636,586.65	0.40
68	601001	晋控煤业	38,500	636,020.00	0.40
69	603198	迎驾贡酒	11,000	632,500.00	0.39
70	600704	物产中大	143,200	621,488.00	0.39
71	600153	建发股份	69,000	616,170.00	0.38
72	603179	新泉股份	15,700	616,068.00	0.38
73	600559	老白干酒	33,559	610,102.62	0.38
74	603005	晶方科技	29,880	608,954.40	0.38
75	601018	宁波港	178,800	607,920.00	0.38
76	688303	大全能源	29,602	603,584.78	0.38
77	600583	海油工程	101,600	600,456.00	0.37
78	603129	春风动力	4,200	597,828.00	0.37
79	601156	东航物流	29,000	590,150.00	0.37
80	600970	中材国际	48,580	585,874.80	0.36
81	600380	健康元	51,386	573,981.62	0.36
82	601216	君正集团	155,000	571,950.00	0.36
83	600998	九州通	115,830	565,250.40	0.35
84	600282	南钢股份	113,300	564,234.00	0.35
85	600392	盛和资源	64,360	554,783.20	0.34
86	688019	安集科技	4,343	546,349.40	0.34
87	601665	齐鲁银行	111,100	545,501.00	0.34
88	600909	华安证券	129,500	545,195.00	0.34
89	600008	首创环保	202,340	542,271.20	0.34
90	600566	济川药业	17,000	539,070.00	0.34
91	601016	节能风电	178,500	533,715.00	0.33
92	603899	晨光股份	17,042	533,073.76	0.33
93	601456	国联证券	54,900	529,236.00	0.33
94	600170	上海建工	244,900	526,535.00	0.33
95	600582	天地科技	76,060	524,053.40	0.33
96	600499	科达制造	61,700	520,131.00	0.32
97	600498	烽火通信	32,500	516,750.00	0.32
98	600580	卧龙电驱	42,082	511,296.30	0.32
99	600285	羚锐制药	20,877	505,432.17	0.31

100	600325	华发股份	75,900	493,350.00	0.31
101	603658	安图生物	10,700	492,949.00	0.31
102	601231	环旭电子	30,526	489,942.30	0.30
103	603228	景旺电子	15,380	489,084.00	0.30
104	600673	东阳光	69,192	487,111.68	0.30
105	603927	中科软	26,648	482,062.32	0.30
106	603568	伟明环保	23,352	480,584.16	0.30
107	601636	旗滨集团	73,600	474,720.00	0.30
108	688166	博瑞医药	13,537	473,795.00	0.29
109	603298	杭叉集团	24,080	472,931.20	0.29
110	600737	中粮糖业	48,900	468,951.00	0.29
111	603077	和邦生物	284,000	468,600.00	0.29
112	600323	瀚蓝环境	22,377	467,679.30	0.29
113	605111	新洁能	15,272	467,170.48	0.29
114	600563	法拉电子	6,127	466,754.86	0.29
115	601808	中海油服	27,100	466,120.00	0.29
116	688385	复旦微电	14,796	464,298.48	0.29
117	688002	睿创微纳	16,593	464,106.21	0.29
118	600131	国网信通	27,500	463,925.00	0.29
119	600363	联创光电	16,800	462,336.00	0.29
120	601958	金钼股份	44,300	461,163.00	0.29
121	600373	中文传媒	31,000	460,040.00	0.29
122	600655	豫园股份	89,100	458,865.00	0.29
123	688050	爱博医疗	6,248	458,103.36	0.28
124	688037	芯源微	5,126	456,214.00	0.28
125	603893	瑞芯微	7,700	455,609.00	0.28
126	603613	国联股份	23,076	452,520.36	0.28
127	603833	欧派家居	8,400	449,904.00	0.28
128	603885	吉祥航空	40,700	447,293.00	0.28
129	601611	中国核建	55,200	446,568.00	0.28
130	600171	上海贝岭	26,120	435,681.60	0.27
131	600755	厦门国贸	60,688	435,132.96	0.27
132	688390	固德威	7,748	434,817.76	0.27
133	603225	新凤鸣	27,872	434,524.48	0.27
134	600422	昆药集团	24,352	434,196.16	0.27
135	600801	华新水泥	30,900	424,875.00	0.26
136	600329	达仁堂	13,095	424,147.05	0.26
137	601880	辽港股份	344,300	423,489.00	0.26
138	603556	海兴电力	9,010	421,938.30	0.26
139	605090	九丰能源	14,500	420,500.00	0.26
140	603283	赛腾股份	5,500	420,200.00	0.26
141	600435	北方导航	48,100	414,622.00	0.26
142	601222	林洋能源	66,000	413,820.00	0.26

143	600483	福能股份	35,310	411,714.60	0.26
144	601098	中南传媒	33,000	409,860.00	0.25
145	688278	特宝生物	7,608	407,408.40	0.25
146	600598	北大荒	32,500	405,925.00	0.25
147	601598	中国外运	72,100	405,923.00	0.25
148	603393	新天然气	11,684	405,902.16	0.25
149	600750	江中药业	17,346	400,866.06	0.25
150	603236	移远通信	8,539	399,027.47	0.25
151	600848	上海临港	43,800	399,018.00	0.25
152	688568	中科星图	8,324	397,054.80	0.25
153	603083	剑桥科技	12,300	397,044.00	0.25
154	603300	华铁应急	72,200	394,212.00	0.25
155	603505	金石资源	13,925	388,925.25	0.24
156	603712	七一二	21,200	385,628.00	0.24
157	600338	西藏珠峰	41,720	385,492.80	0.24
158	600667	太极实业	67,395	384,825.45	0.24
159	601928	凤凰传媒	35,100	384,696.00	0.24
160	600968	海油发展	93,000	383,160.00	0.24
161	688017	绿的谐波	4,666	383,078.60	0.24
162	603883	老百姓	20,842	382,659.12	0.24
163	600452	涪陵电力	30,162	382,152.54	0.24
164	600258	首旅酒店	30,668	378,749.80	0.24
165	600916	中国黄金	38,400	369,408.00	0.23
166	600993	马应龙	13,808	368,259.36	0.23
167	688301	奕瑞科技	3,178	366,200.94	0.23
168	600378	昊华科技	12,600	364,140.00	0.23
169	600123	兰花科创	40,680	364,086.00	0.23
170	688005	容百科技	15,604	363,261.12	0.23
171	688333	铂力特	7,466	361,727.70	0.22
172	688536	思瑞浦	3,619	353,974.39	0.22
173	600057	厦门象屿	52,000	353,600.00	0.22
174	603588	高能环境	56,228	353,111.84	0.22
175	600641	万业企业	29,840	350,620.00	0.22
176	603737	三棵树	9,642	349,715.34	0.22
177	603279	景津装备	15,920	345,304.80	0.21
178	688596	正帆科技	10,423	343,959.00	0.21
179	688200	华峰测控	3,748	343,879.00	0.21
180	600850	电科数字	18,942	342,850.20	0.21
181	600216	浙江医药	31,035	340,764.30	0.21
182	600612	老凤祥	5,833	339,422.27	0.21
183	603456	九洲药业	24,700	338,884.00	0.21
184	603444	吉比特	1,900	338,219.00	0.21
185	601019	山东出版	28,600	338,052.00	0.21

186	603565	中谷物流	38,423	335,817.02	0.21
187	600064	南京高科	55,300	335,671.00	0.21
188	688639	华恒生物	4,393	335,581.27	0.21
189	688408	中信博	3,644	335,539.52	0.21
190	600596	新安股份	43,269	328,844.40	0.20
191	688139	海尔生物	8,817	327,992.40	0.20
192	601137	博威合金	21,500	327,660.00	0.20
193	600316	洪都航空	19,600	325,948.00	0.20
194	603650	彤程新材	11,000	325,050.00	0.20
195	688082	盛美上海	3,845	324,940.95	0.20
196	603529	爱玛科技	11,870	324,407.10	0.20
197	601187	厦门银行	60,300	321,399.00	0.20
198	600273	嘉化能源	44,500	317,730.00	0.20
199	603871	嘉友国际	17,860	315,943.40	0.20
200	603678	火炬电子	12,700	313,563.00	0.19
201	600120	浙江东方	93,724	313,038.16	0.19
202	603027	千禾味业	23,495	312,483.50	0.19
203	603728	鸣志电器	7,720	310,575.60	0.19
204	600562	国睿科技	22,700	310,082.00	0.19
205	601965	中国汽研	18,300	309,087.00	0.19
206	601298	青岛港	32,000	305,920.00	0.19
207	600633	浙数文化	34,700	305,707.00	0.19
208	603599	广信股份	25,176	305,384.88	0.19
209	688575	亚辉龙	13,036	303,999.52	0.19
210	688516	奥特维	7,232	302,369.92	0.19
211	603619	中曼石油	12,900	302,118.00	0.19
212	600577	精达股份	76,100	302,117.00	0.19
213	600116	三峡水利	43,700	301,530.00	0.19
214	688208	道通科技	12,475	301,146.50	0.19
215	600428	中远海特	49,100	300,492.00	0.19
216	600446	金证股份	30,258	300,461.94	0.19
217	600663	陆家嘴	33,940	299,350.80	0.19
218	603233	大参林	20,903	298,912.90	0.19
219	600395	盘江股份	49,100	295,091.00	0.18
220	600210	紫江企业	55,400	294,728.00	0.18
221	688116	天奈科技	12,583	290,415.64	0.18
222	603108	润达医疗	19,160	290,082.40	0.18
223	603690	至纯科技	12,480	287,164.80	0.18
224	688289	圣湘生物	16,333	287,134.14	0.18
225	600782	新钢股份	86,300	286,516.00	0.18
226	600377	宁沪高速	22,650	285,390.00	0.18
227	603018	华设集团	31,300	284,517.00	0.18
228	600409	三友化工	56,661	284,438.22	0.18

229	600459	贵研铂业	20,929	282,750.79	0.18
230	600967	内蒙一机	38,992	280,742.40	0.17
231	600328	中盐化工	40,330	276,663.80	0.17
232	600350	山东高速	30,950	273,907.50	0.17
233	688029	南微医学	4,385	269,940.60	0.17
234	600295	鄂尔多斯	27,079	268,623.68	0.17
235	688123	聚辰股份	4,389	266,982.87	0.17
236	600888	新疆众和	37,700	266,539.00	0.17
237	600586	金晶科技	45,700	265,060.00	0.16
238	603707	健友股份	22,215	263,914.20	0.16
239	688016	心脉医疗	2,686	263,362.30	0.16
240	688100	威胜信息	6,884	262,624.60	0.16
241	603517	绝味食品	17,000	261,800.00	0.16
242	601992	金隅集团	190,500	260,985.00	0.16
243	688518	联赢激光	15,600	260,520.00	0.16
244	600933	爱柯迪	17,600	260,304.00	0.16
245	601311	骆驼股份	32,130	257,682.60	0.16
246	688032	禾迈股份	2,213	254,008.14	0.16
247	603267	鸿远电子	7,440	253,704.00	0.16
248	600720	中交设计	28,200	250,980.00	0.16
249	601702	华峰铝业	13,700	250,162.00	0.16
250	600248	陕建股份	68,900	250,107.00	0.16
251	603063	禾望电气	16,200	248,346.00	0.15
252	688778	厦钨新能	7,849	245,202.76	0.15
253	600211	西藏药业	7,440	242,395.20	0.15
254	688083	中望软件	3,335	242,187.70	0.15
255	603218	日月股份	23,500	241,345.00	0.15
256	603713	密尔克卫	4,500	240,840.00	0.15
257	600481	双良节能	51,300	239,571.00	0.15
258	600032	浙江新能	32,900	239,512.00	0.15
259	600507	方大特钢	63,903	238,997.22	0.15
260	603920	世运电路	12,050	237,867.00	0.15
261	603786	科博达	3,700	237,355.00	0.15
262	600502	安徽建工	54,868	235,932.40	0.15
263	688556	高测股份	19,814	235,588.46	0.15
264	600095	湘财股份	39,200	233,632.00	0.15
265	603296	华勤技术	4,200	231,966.00	0.14
266	603281	江瀚新材	10,300	231,235.00	0.14
267	603127	昭衍新药	17,326	229,916.02	0.14
268	600740	山西焦化	58,595	229,692.40	0.14
269	600729	重庆百货	10,270	229,637.20	0.14
270	688248	南网科技	7,749	229,602.87	0.14
271	601952	苏垦农发	25,200	227,304.00	0.14

272	600773	西藏城投	21,800	224,976.00	0.14
273	600531	豫光金铅	34,900	224,756.00	0.14
274	603612	索通发展	17,300	220,748.00	0.14
275	688630	芯碁微装	3,514	219,870.98	0.14
276	603197	保隆科技	6,900	217,350.00	0.14
277	688281	华秦科技	2,603	216,881.96	0.13
278	688559	海目星	6,549	215,396.61	0.13
279	600776	东方通信	21,900	215,277.00	0.13
280	603008	喜临门	12,200	211,426.00	0.13
281	603919	金徽酒	11,600	210,772.00	0.13
282	603128	华贸物流	35,870	206,969.90	0.13
283	600675	中华企业	83,600	206,492.00	0.13
284	688779	五矿新能	44,150	204,414.50	0.13
285	603888	新华网	9,500	204,345.00	0.13
286	600007	中国国贸	9,273	203,635.08	0.13
287	600389	江山股份	14,165	199,868.15	0.12
288	603738	泰晶科技	14,240	194,233.60	0.12
289	688006	杭可科技	11,000	191,950.00	0.12
290	688318	财富趋势	2,431	191,830.21	0.12
291	603876	鼎胜新材	20,400	189,108.00	0.12
292	600366	宁波韵升	35,600	185,832.00	0.12
293	603866	桃李面包	36,578	185,450.46	0.12
294	688439	振华风光	2,784	184,996.80	0.11
295	603056	德邦股份	14,100	184,710.00	0.11
296	688700	东威科技	6,983	183,024.43	0.11
297	603383	顶点软件	5,640	180,874.80	0.11
298	603305	旭升集团	17,128	180,871.68	0.11
299	600556	天下秀	49,600	180,544.00	0.11
300	603583	捷昌驱动	8,772	178,773.36	0.11
301	600571	信雅达	17,100	178,524.00	0.11
302	601139	深圳燃气	26,300	175,684.00	0.11
303	603733	仙鹤股份	9,700	170,526.00	0.11
304	688066	航天宏图	9,538	169,776.40	0.11
305	600987	航民股份	24,000	169,440.00	0.11
306	688696	极米科技	2,183	168,614.92	0.10
307	601908	京运通	66,200	167,486.00	0.10
308	603317	天味食品	14,576	166,312.16	0.10
309	603348	文灿股份	6,000	166,140.00	0.10
310	603043	广州酒家	10,400	166,088.00	0.10
311	600284	浦东建设	31,084	165,988.56	0.10
312	688239	航宇科技	4,759	165,613.20	0.10
313	601882	海天精工	7,200	164,952.00	0.10
314	600223	福瑞达	23,200	164,024.00	0.10

315	688276	百克生物	5,730	162,560.10	0.10
316	688690	纳微科技	9,296	161,471.52	0.10
317	600639	浦东金桥	15,482	158,071.22	0.10
318	605123	派克新材	2,800	157,304.00	0.10
319	603801	志邦家居	12,018	157,195.44	0.10
320	688388	嘉元科技	15,586	151,963.50	0.09
321	600648	外高桥	17,114	151,630.04	0.09
322	603730	岱美股份	15,108	150,173.52	0.09
323	600927	永安期货	13,300	148,295.00	0.09
324	603187	海容冷链	12,380	144,350.80	0.09
325	603025	大豪科技	10,140	140,134.80	0.09
326	601858	中国科传	7,300	139,576.00	0.09
327	601869	长飞光纤	5,600	136,248.00	0.08
328	603229	奥翔药业	13,540	136,077.00	0.08
329	688707	振华新材	13,903	135,415.22	0.08
330	601033	永兴股份	8,200	132,758.00	0.08
331	603327	福蓉科技	10,212	131,632.68	0.08
332	605168	三人行	4,894	128,859.02	0.08
333	601158	重庆水务	26,300	126,240.00	0.08
334	600662	外服控股	31,300	125,513.00	0.08
335	603915	国茂股份	12,180	125,332.20	0.08
336	688711	宏微科技	7,792	125,139.52	0.08
337	688800	瑞可达	4,394	123,383.52	0.08
338	603906	龙蟠科技	15,500	120,745.00	0.08
339	603515	欧普照明	6,850	118,779.00	0.07
340	603357	设计总院	12,832	117,926.08	0.07
341	600956	新天绿能	14,100	115,197.00	0.07
342	605009	豪悦护理	2,900	114,376.00	0.07
343	688348	昱能科技	1,930	113,870.00	0.07
344	603355	莱克电气	5,220	112,752.00	0.07
345	688131	皓元医药	5,797	110,896.61	0.07
346	603609	禾丰股份	16,800	109,872.00	0.07
347	603387	基蛋生物	13,878	107,693.28	0.07
348	688268	华特气体	2,076	107,142.36	0.07
349	601330	绿色动力	18,100	105,342.00	0.07
350	601512	中新集团	13,700	104,394.00	0.06
351	603989	艾华集团	7,400	104,044.00	0.06
352	600658	电子城	30,700	101,003.00	0.06
353	688484	南芯科技	2,642	98,018.20	0.06
354	603439	贵州三力	7,500	95,700.00	0.06
355	688526	科前生物	6,418	94,280.42	0.06
356	688202	美迪西	3,601	93,806.05	0.06
357	688295	中复神鹰	4,611	93,603.30	0.06

358	603868	飞科电器	2,300	88,320.00	0.05
359	603170	宝立食品	7,400	87,912.00	0.05
360	605222	起帆电缆	5,700	87,438.00	0.05
361	688035	德邦科技	2,651	85,415.22	0.05
362	600853	龙建股份	27,800	85,346.00	0.05
363	603938	三孚股份	7,020	82,485.00	0.05
364	601065	江盐集团	8,800	76,296.00	0.05
365	601811	新华文轩	5,400	75,654.00	0.05
366	603708	家家悦	8,760	71,043.60	0.04
367	605337	李子园	7,230	70,998.60	0.04
368	603681	永冠新材	5,200	66,300.00	0.04
369	603489	八方股份	2,340	63,133.20	0.04
370	603032	德新科技	5,387	61,573.41	0.04
371	603429	集友股份	14,380	59,677.00	0.04
372	603312	西典新能	2,300	59,110.00	0.04
373	601022	宁波远洋	6,600	58,212.00	0.04
374	603230	内蒙新华	4,800	55,392.00	0.03
375	688499	利元亨	2,859	54,692.67	0.03
376	603180	金牌家居	2,860	54,654.60	0.03
377	603082	北自科技	1,500	45,360.00	0.03
378	605089	味知香	1,894	40,417.96	0.03
379	605099	共创草坪	2,000	37,820.00	0.02
380	603375	盛景微	900	35,802.00	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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	601009	南京银行	2,236,465.00	1.31
2	600066	宇通客车	1,474,300.00	0.86
3	601021	春秋航空	1,256,085.26	0.73
4	601233	桐昆股份	1,152,407.00	0.67
5	601108	财通证券	1,023,252.00	0.60
6	601877	正泰电器	994,386.00	0.58
7	601006	大秦铁路	931,295.61	0.54
8	688122	西部超导	875,536.20	0.51
9	600025	华能水电	852,223.00	0.50

10	603260	合盛硅业	757,529.00	0.44
11	688303	大全能源	726,066.70	0.42
12	600699	均胜电子	694,859.00	0.41
13	600021	上海电力	645,770.00	0.38
14	688578	艾力斯	635,300.08	0.37
15	600909	华安证券	568,319.00	0.33
16	603833	欧派家居	532,899.00	0.31
17	688390	固德威	484,742.48	0.28
18	603885	吉祥航空	483,399.00	0.28
19	601958	金铂股份	473,897.00	0.28
20	601808	中海油服	446,217.00	0.26

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	601006	大秦铁路	2,776,609.00	1.62
2	600886	国投电力	2,354,908.00	1.37
3	601916	浙商银行	1,919,118.00	1.12
4	601058	赛轮轮胎	1,687,745.00	0.99
5	601901	方正证券	1,540,451.00	0.90
6	688169	石头科技	1,530,959.43	0.89
7	601168	西部矿业	1,520,371.00	0.89
8	600372	中航机载	1,057,661.00	0.62
9	688777	中控技术	1,035,817.77	0.60
10	688072	拓荆科技	834,002.43	0.49
11	605499	东鹏饮料	813,349.00	0.47
12	600236	桂冠电力	730,003.50	0.43
13	600129	太极集团	618,170.00	0.36
14	603000	人民网	527,226.00	0.31
15	600884	杉杉股份	503,099.00	0.29
16	600674	川投能源	377,721.00	0.22
17	600179	安通控股	356,340.00	0.21
18	603026	石大胜华	260,087.00	0.15
19	603881	数据港	214,451.28	0.13
20	600110	诺德股份	212,357.04	0.12

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	29,952,087.22
卖出股票收入（成交）总额	26,918,893.08

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）	49,003.65	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	49,003.65	0.03

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	113685	升 24 转债	490	49,003.65	0.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本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，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，杭州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浙江监管局的处罚；上海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上海监管局的处罚。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规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

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

7.12.3 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	430.13
2	应收清算款	-

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	430.13

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

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。

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§ 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		南方上证 380 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
1,028	87,985.33	2,739,389.00	3.03%	9,196,085.00	10.17%	78,513,441.00	86.80%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	广发证券股份有限公司	800,000.00	0.88%
2	中信证券股份有限公司	642,826.00	0.71%
3	北京无限立通通讯技术有限责任公司	609,600.00	0.67%
4	海通证券股份有限公司	356,100.00	0.39%
5	华泰证券股份有限公司	330,000.00	0.36%
6	米润生	300,000.00	0.33%

7	黄静	270,000.00	0.30%
8	王钧璧	185,300.00	0.20%
9	陈致运	157,000.00	0.17%
10	姚明辉	150,400.00	0.17%
11	中国建设银行股份有限公司-南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	78,513,441.00	86.80%

注：持有人名称与注册登记机构持有人名册保持一致。其中：“中国建设银行股份有限公司-南方上证 380 交易型开放式指数证券”对应的基金全称为“中国建设银行股份有限公司-南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”。

8.3 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。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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(2011年9月16日)基金份额总额	330,448,915.00
本报告期期初基金份额总额	92,448,915.00
本报告期基金总申购份额	6,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	8,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	90,448,915.00

§ 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。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	1	51,727,647.90	90.96%	5,173.05	90.96%	-
华泰证券	2	2,627,566.01	4.62%	262.77	4.62%	-
银河证券	1	2,515,766.39	4.42%	251.63	4.42%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
麦高证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-

中金公司	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48 号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

无

减少交易单元：

中邮证券

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	
	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
中泰证券	52,907.23	87.96%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	7,245.20	12.04%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
麦高证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-

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增加联储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	2024-03-13
2	南方基金管理股份有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-20

§ 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	20240101-20240630	78,513,441.00	2,000,000.00	2,000,000.00	78,513,441.00	86.80%

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。

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

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上证 380 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《上证 380 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、《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2024 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>