

南方中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金联接基金 (LOF) 2022 年中期报 告

2022 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：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 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.....	5
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遵规守信情况的说明.....	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.....	12
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.....	13
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遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
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.....	61
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.....	62
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.....	62
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.....	62
7.10 本报告期投资基金情况.....	62

7.11 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.13 投资组合报告附注	62
§8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末上市基金前十名持有人	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
§9 开放式基金份额变动	65
§10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
10.8 其他重大事件	68
§11 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	
基金简称	南方中证 500ETF 联接 (LOF)	
场内简称	南方 500	
基金主代码	160119	
前端交易代码	160119	
后端交易代码	160120	
基金运作方式	上市型开放式(LOF)	
基金合同生效日	2009 年 9 月 25 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	5,285,428,798.15 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2009 年 11 月 11 日	
下属分级基金的基金简称	南方中证 500ETF 联接(LOF) A	南方中证 500ETF 联接(LOF) C
下属分级基金的场内简称	南方 500	
下属分级基金的交易代码	160119	004348
下属分级基金的前端交易代码	160119	
下属分级基金的后端交易代码	160120	
报告期末下属分级基金的份额总额	4,977,227,700.22 份	308,201,097.93 份

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方 500”或“500ETF 联接 LOF”。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 日
基金管理人名称	南方基金管理股份有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“500ETF”或“中证 500ETF”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，以中证 500ETF 作为其主要投资标的。为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了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，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	本基金的标的指数为中证 500 指数。 本基金业绩比较基准：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95599
传真	0755-82763889	010-68121816

注册地址	深圳市福田区莲花街道 益田路 5999 号基金大 厦 32-42 楼	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道 益田路 5999 号基金大 厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518017	100031
法定代表人	周易	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地 址、基金上市交易的证券交易所（如 有）

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司 \南方基金管理股份有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号深圳 市福田区莲花街道益田路 5999 号基 金大厦 32-42 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、南方中证 500ETF 联接（LOF）A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	47,684,574.38
本期利润	-867,758,499.20
加权平均基金份额本期利润	-0.1829
本期加权平均净值利润率	-10.83%
本期基金份额净值增长率	-10.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	3,660,585,544.26
期末可供分配基金份额利润	0.7354
期末基金资产净值	8,637,813,244.48
期末基金份额净值	1.7355
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	89.36%

2、南方中证 500ETF 联接 (LOF) C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,232,790.32
本期利润	-71,593,205.10
加权平均基金份额本期利润	-0.2101
本期加权平均净值利润率	-12.64%
本期基金份额净值增长率	-10.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	217,905,814.65
期末可供分配基金份额利润	0.7070
期末基金资产净值	526,106,912.58
期末基金份额净值	1.7070
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	8.50%

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

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

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

4、本基金从 2017 年 2 月 23 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2017 年 2 月 28 日起存续。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方中证 500ETF 联接 (LOF) A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.64%	1.05%	6.74%	1.05%	0.90%	0.00%
过去三个月	3.38%	1.66%	1.99%	1.66%	1.39%	0.00%
过去六个月	-10.35%	1.55%	-11.65%	1.55%	1.30%	0.00%
过去一年	-2.89%	1.26%	-4.83%	1.26%	1.94%	0.00%
过去三年	37.90%	1.29%	29.13%	1.28%	8.77%	0.01%
自基金合同生效起至今	89.36%	1.56%	81.11%	1.56%	8.25%	0.00%

南方中证 500ETF 联接 (LOF) C

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

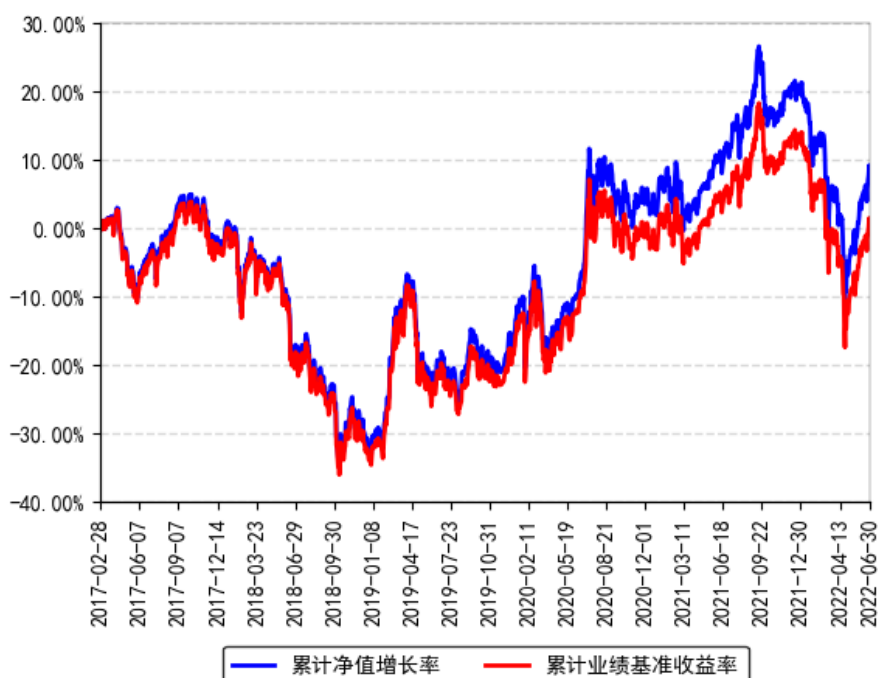
	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	7.60%	1.05%	6.74%	1.05%	0.86%	0.00%
过去三个月	3.27%	1.66%	1.99%	1.66%	1.28%	0.00%
过去六个月	-10.53%	1.55%	-11.65%	1.55%	1.12%	0.00%
过去一年	-3.28%	1.26%	-4.83%	1.26%	1.55%	0.00%
过去三年	36.25%	1.29%	29.13%	1.28%	7.12%	0.01%
自基金合同生效起至今	8.50%	1.31%	0.73%	1.30%	7.77%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方中证500ETF联接（LOF）A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方中证500ETF联接（LOF）C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金从 2017 年 2 月 23 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2017 年 2 月 28 日起存续。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019 年 7 月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙) 1.72%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙) 2.24%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙) 2.25%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙) 2.32%。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。

截至本报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 1.69 万亿元，旗下管理 296 只公募基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日	-	17 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月 17 日至 2015 年 6 月 16 日，任南方策略基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2019 年 4 月 18 日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 3 月 27 日，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至 2020 年 3 月 27 日，任南方 H 股联接基金经理；2014 年 10 月 30 日至 2020 年 12 月 23 日，任 500 医药基金经理；2013 年 4 月 22 日至今，任南方 500、南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月 17 日至今，任南方 300、南方 300 联接基金经理；2015 年 2 月 16 日至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2017 年 7 月 21 日至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月 24 日至今，任南方房地产联接基金经理；2017 年 8 月 25 日至今，任南方房地产 ETF 基金经理；2018 年 4 月 3 日至今，任 MSCI 基金基金经理；2018 年 6 月 8 日至今，任 MSCI 联接基金经理；2020 年 7 月 24 日至今，兼任投资经理；2020 年 12 月 25 日至今，任南方策略基金经理；2021 年 3 月 12 日至今，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理；2021 年 7 月 2 日至今，任南方中证香港科技 ETF（QDII）基金经理；2021 年 10 月 22 日至今，任南方中证全指医疗保健 ETF 基

					金经理；2022 年 6 月 17 日至今，任南方恒生香港上市生物科技 ETF（QDII）基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
罗文杰	公募基金	15	67,195,576,481.91	2013 年 4 月 22 日
	私募资产管理计划	8	3,690,743,708.86	2020 年 8 月 7 日
	其他组合	-	-	-
	合计	23	70,886,320,190.77	-

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，并且交易占优比也没有明显异常，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 2 次，是由于投资组合的投资策略需要以及接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，中证 500 指数下跌 12.30%。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) 大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

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

(3) 报告期内，我们根据指数定期的成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.7355 元，报告期内，份额净值增长率为-10.35%，同期业绩基准增长率为-11.65%；本基金 C 份额净值为 1.7070 元，报告期内，份额净值增长率为-10.53%，同期业绩基准增长率为-11.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年海内外宏观环境较为复杂，俄乌冲突、美元紧缩等，也带来 A 股市场调整。调整后，估值下行空间收窄，大中华地区权益市场仍具长期配置价值。本基金标的指数中证 500 指数，PE 估值倍数已经达到历史底部区域，性价比较高，具有较高的配置价值。

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，力求实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	200,179,889.15	195,118,357.01
结算备付金		3,682,889.23	2,533,514.84
存出保证金		224,366.84	233,308.18
交易性金融资产	6.4.3.2	8,976,173,924.52	8,946,786,998.91
其中：股票投资		187,108,787.59	136,753,426.98
基金投资		8,503,723,508.64	8,539,797,205.73
债券投资		285,341,628.29	270,236,366.20
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		17,513.11	2,067,599.05
应收股利		-	-
应收申购款		24,648,165.72	14,621,703.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	-	4,505,700.12
资产总计		9,204,926,748.57	9,165,867,181.56
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		-	7,000,000.00
应付清算款		12,001,808.22	-
应付赎回款		28,360,517.44	24,897,666.78
应付管理人报酬		251,837.58	238,582.86
应付托管费		50,367.51	47,716.57
应付销售服务费		174,610.96	178,214.81
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	167,449.80	284,265.52
负债合计		41,006,591.51	32,646,446.54
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	5,285,428,798.15	4,721,675,344.19
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	3,878,491,358.91	4,411,545,390.83
净资产合计		9,163,920,157.06	9,133,220,735.02
负债和净资产总计		9,204,926,748.57	9,165,867,181.56

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，南方中证 500ETF 联接（LOF）A 份额净值 1.7355 元，基金份额总额 4,977,227,700.22 份；南方中证 500ETF 联接（LOF）C 份额净值 1.7070 元，基金份额总额 308,201,097.93 份；总份额合计 5,285,428,798.15 份。

6.2 利润表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

一、营业总收入		-936,034,809.78	653,367,204.41
1.利息收入		1,387,097.02	5,018,374.75
其中：存款利息收入	6.4.3.9	1,387,097.02	1,258,795.34
债券利息收入		-	3,759,579.41
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		51,394,517.90	408,074,315.58
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-12,794,664.03	19,696,350.59
基金投资收益	6.4.3.11	58,906,121.57	387,794,336.88
债券投资收益	6.4.3.12	3,174,276.91	-626,715.66
资产支持证券投资	6.4.3.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.3.14	-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	2,108,783.45	1,210,343.77
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）	6.4.3.17	-989,269,069.00	238,853,608.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	452,644.30	1,420,905.26
减：二、营业总支出		3,316,894.52	4,648,268.10
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	1,451,255.69	1,264,203.98
2.托管费	6.4.6.2.2	290,251.15	252,840.84
3.销售服务费	6.4.6.2.3	1,124,219.56	1,057,109.55
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		318,031.56	788,728.97
其中：卖出回购金融资产支出		318,031.56	788,728.97
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		0.09	0.59
8.其他费用	6.4.3.19	133,136.47	1,285,384.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-939,351,704.30	648,718,936.31

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-939,351,704.30	648,718,936.31
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-939,351,704.30	648,718,936.31

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	4,721,675,344.19	-	4,411,545,390.83	9,133,220,735.02
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	4,721,675,344.19	-	4,411,545,390.83	9,133,220,735.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	563,753,453.96	-	-533,054,031.92	30,699,422.04
（一）、综合收益总额	-	-	-939,351,704.30	-939,351,704.30
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	563,753,453.96	-	406,297,672.38	970,051,126.34
其中：1.基金申购款	1,756,995,493.36	-	1,207,114,161.38	2,964,109,654.74
2.基金赎回款	-1,193,242,039.40	-	-800,816,489.00	-1,994,058,528.40
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-

(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	5,285,428,798.15	-	3,878,491,358.91	9,163,920,157.06
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	5,486,465,930.47	-	3,621,824,345.98	9,108,290,276.45
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	5,486,465,930.47	-	3,621,824,345.98	9,108,290,276.45
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-724,520,962.25	-	119,243,998.24	-605,276,964.01
(一)、综合收益总额	-	-	648,718,936.31	648,718,936.31
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-724,520,962.25	-	-529,474,938.07	-1,253,995,900.32
其中: 1.基金申购款	1,965,645,025.58	-	1,346,296,546.16	3,311,941,571.74
2.基金赎回款	-2,690,165,987.83	-	-1,875,771,484.23	-4,565,937,472.06
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	4,761,944,968.22	-	3,741,068,344.22	8,503,013,312.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

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

6.4 报表附注

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

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。除下述会计政策外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.1.1 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.1.2 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.1.3 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.1.4 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未

能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度可比期间的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 195,118,357.01 元、2,533,514.84 元、233,308.18 元、4,505,700.12 元、2,067,599.05 元和 14,621,703.45 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 195,205,285.92 元、2,534,654.94 元、233,413.18 元、0.00 元、2,067,599.05 元和 14,621,703.45 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 8,946,786,998.91 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 8,951,204,525.02 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 7,000,000.00 元、24,897,666.78 元、238,582.86 元、47,716.57 元、178,214.81 元、6,801.20 元、-1,953.25 元和 39,417.57 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 6,998,046.75 元、24,897,666.78 元、238,582.86 元、47,716.57 元、178,214.81 元、6,801.20 元、0.00 元和 39,417.57 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	200,179,889.15
等于：本金	200,104,524.67
加：应计利息	75,364.48
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	200,179,889.15

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	178,666,593.14	-	187,108,787.59	8,442,194.45
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	3,994,300.29	285,341,628.29	102,610.60
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,994,300.29	285,341,628.29	102,610.60
资产支持证券	-	-	-	-
基金	7,008,662,174.58	-	8,503,723,508.64	1,495,061,334.06
其他	-	-	-	-
合计	7,468,573,485.12	3,994,300.29	8,976,173,924.52	1,503,606,139.11

注：基金投资均为本基金持有的目标ETF的份额，按估值日目标ETF的份额净值确定公允价值。本基金可采用全现金替代申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF份额的买卖。

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 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	30,491.01
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	17,944.05
其中：交易所市场	17,944.05
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	-
预提费用	119,014.74
应付指数使用费	-
可退替代款	-
其他	-
合计	167,449.80

注：1. 可退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

2. 应退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方中证 500ETF 联接 (LOF) A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	4,449,109,231.19	4,449,109,231.19

本期申购	1,355,845,615.38	1,355,845,615.38
本期赎回（以“-”号填列）	-827,727,146.35	-827,727,146.35
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	4,977,227,700.22	4,977,227,700.22

南方中证 500ETF 联接（LOF）C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	272,566,113.00	272,566,113.00
本期申购	401,149,877.98	401,149,877.98
本期赎回（以“-”号填列）	-365,514,893.05	-365,514,893.05
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	308,201,097.93	308,201,097.93

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.3.8 未分配利润

单位：人民币元

南方中证 500ETF 联接（LOF）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	4,988,143,070.83	-824,083,295.23	4,164,059,775.60
本期利润	47,684,574.38	-915,443,073.58	-867,758,499.20
本期基金份额交易产生的变动数	593,019,581.42	-228,735,313.56	364,284,267.86
其中：基金申购款	1,524,813,897.69	-584,584,780.63	940,229,117.06
基金赎回款	-931,794,316.27	355,849,467.07	-575,944,849.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,628,847,226.63	-1,968,261,682.37	3,660,585,544.26

南方中证 500ETF 联接（LOF）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	299,070,898.75	-51,585,283.52	247,485,615.23
本期利润	2,232,790.32	-73,825,995.42	-71,593,205.10
本期基金份额交易产生的变动数	38,811,979.26	3,201,425.26	42,013,404.52
其中：基金申购款	439,940,584.49	-173,055,540.17	266,885,044.32
基金赎回款	-401,128,605.23	176,256,965.43	-224,871,639.80
本期已分配利润	-	-	-

本期末	340,115,668.33	-122,209,853.68	217,905,814.65
-----	----------------	-----------------	----------------

6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,350,634.05
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	30,998.55
其他	5,464.42
合计	1,387,097.02

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,599,080.25
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-9,195,583.78
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-12,794,664.03

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	227,127,750.43
减：卖出股票成本总额	230,369,189.42
减：交易费用	357,641.26
买卖股票差价收入	-3,599,080.25

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.3.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

6.4.3.10.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	506,404,430.00
减：现金支付申购款总额	248,837,190.95
减：申购股票成本总额	266,762,822.83
减：交易费用	-
申购差价收入	-9,195,583.78

6.4.3.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

6.4.3.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	460,565,403.50
减：卖出/赎回基金成本总额	401,610,984.16
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	48,297.77
基金投资收益	58,906,121.57

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	3,502,969.62
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-328,692.71
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	3,174,276.91

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	205,080,277.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	200,465,602.40
减：应计利息总额	4,943,150.58
减：交易费用	217.53
买卖债券差价收入	-328,692.71

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.3.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.3.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.3.13 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

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.3.14 贵金属投资收益**6.4.3.14.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.3.14.2 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.3.15 衍生工具收益**6.4.3.15.1 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。

6.4.3.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,108,783.45
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	2,108,783.45

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-989,269,069.00
——股票投资	-2,296,764.90
——债券投资	415,780.90
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-987,388,085.00
——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	-989,269,069.00
----	-----------------

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	451,292.63
基金转换费收入	1,351.67
合计	452,644.30

注：

1 本基金的 A 类基金份额的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产；C 类基金份额的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入基金资产。

2 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中，A 类基金份额场内部分的赎回费率为 0.5%，场外部分的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产；C 类基金份额的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入转出基金的基金资产。

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	14,121.73
合计	133,136.47

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构

华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(“目标 ETF”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	49,218,024.63	9.33%	36,857,848.86	3.90%

6.4.6.1.2 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.6.1.3 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	4,924.11	9.34%	3,086.79	17.20%
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	3,686.06	3.90%	1,520.89	5.71%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,451,255.69	1,264,203.98
其中：支付销售机构的客户维护费	6,306,696.82	5,167,083.08

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = (前一日基金资产净值 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 0.50% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	290,251.15	252,840.84

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = (前一日基金资产净值 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 0.10% / 当年天数。

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	合计
华泰证券	-	7,074.14	7,074.14
南方基金	-	329,005.91	329,005.91
农业银行	-	140.11	140.11
合计	-	336,220.16	336,220.16
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	合计

华泰证券	-	5,398.50	5,398.50
南方基金	-	603,433.47	603,433.47
农业银行	-	-	-
合计	-	608,831.97	608,831.97

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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	200,179,889.15	1,350,634.05	97,113,264.62	1,194,062.72

注：本基金由基金托管人中国农业银行保管的银行存款，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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	688048	长光华芯	网下申购	6,790	548,632.00
华泰联合	301207	华兰疫苗	网下申购	5,687	323,476.56
华泰联合	688046	药康生物	网下申购	12,070	271,937.10
华泰联合	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64

上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	688083	中望软件	网下申购	1,837	276,468.50
华泰联合	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
华泰联合	600909	华安证券	配股	15,182	55,869.76
华泰联合	688633	星球石墨	网下申购	1,558	52,379.96
华泰联合	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合	688260	昀冢科技	网下申购	2,990	28,793.70
华泰联合	300975	商络电子	网下申购	4,917	26,945.16
华泰联合	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合	605208	永茂泰	网下申购	801	10,733.40
兴业证券	300979	华利集团	网下申购	9,246	307,152.12
兴业证券	300941	创识科技	网下申购	3,989	85,005.59
兴业证券	688639	华恒生物	网下申购	2,302	53,314.32
兴业证券	688195	腾景科技	网下申购	2,693	36,624.80
兴业证券	688597	煜邦电力	网下申购	3,907	22,973.16
兴业证券	605298	必得科技	网下申购	391	6,252.09
兴业证券	605086	龙高股份	网下申购	443	5,696.98

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 2022 年 06 月 30 日，本基金持有基金管理人南方基金所管理的公开募集证券投资基金，成本总额为人民币 7,008,662,174.58 元，估值总额为人民币 8,503,723,508.64 元，占本基金基金资产净值的比例为 92.80%（于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有基金管理人南方

基金所管理的公开募集证券投资基金，成本总额为人民币 6,057,347,786.67 元，估值总额为人民币 8,539,797,205.73 元，占本基金基金资产净值的比例为 93.50%）。

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（2022 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
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股锁定期	34.81	16.14	1,225	42,642.25	19,771.50	-
301109	军信股份	2022 年 6 月 17 日	1-6 个月（含）	锁定期转增	-	16.14	613	-	9,893.82	-
301150	中一科技	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定期	163.56	82.76	269	43,997.64	22,262.44	-
301150	中一科技	2022 年 6 月 10 日	1-6 个月（含）	锁定期转增	-	82.76	135	-	11,172.60	-
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁定期	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301181	标榜股份	2022 年 2 月 11 日	6 个月	新股锁定期	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定期	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新股锁定期	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定期	173.98	87.82	321	55,847.58	28,190.22	-
301219	腾远钴业	2022 年	1-6 个月	锁定期	-	87.82	257	-	22,569.74	-

		5月24日	月(含)	转增						
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	新股锁定期	19.18	32.07	3,497	67,072.46	112,148.79	-
301248	杰创智能	2022年4月13日	6个月	新股锁定期	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
600938	中国海油	2022年4月14日	6个月	新股锁定期	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688223	晶科能源	2022年1月19日	6个月	新股锁定期	5.00	14.47	213,000	1,065,000.00	3,082,110.00	-

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
127064	杭氧转债	2022年5月19日	1-6个月(含)	配债未上市	100.00	100.02	53	5,301.00	5,301.00	-
113060	浙22转债	2022年6月17日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	10	1,000.07	1,000.07	-

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
002670	国盛金控	2022年6月1日	重大事项停牌	9.60	2022年7月14日	9.99	32,263	308,951.29	309,724.80	-

本基金截至 2022 年 06 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金紧密跟踪标的指数，具有和标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资的金融工具主要包括基金投资和股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和

款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

同时，基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按

公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	200,179,889.15	-	-	-	200,179,889.15
结算备付金	3,682,889.23	-	-	-	3,682,889.23
存出保证金	224,366.84	-	-	-	224,366.84
交易性金融资产	285,335,327.22	-	6,301.07	8,690,832,296.23	8,976,173,924.52
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	-	-	-	17,513.11	17,513.11
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	425,134.86	-	-	24,223,030.86	24,648,165.72
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	489,847,607.30	-	6,301.07	8,715,072,840.20	9,204,926,748.57
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	-	-	-	12,001,808.22	12,001,808.22
应付赎回款	-	-	-	28,360,517.44	28,360,517.44
应付管理人报酬	-	-	-	251,837.58	251,837.58
应付托管费	-	-	-	50,367.51	50,367.51
应付销售服务费	-	-	-	174,610.96	174,610.96
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	-	-	-	167,449.80	167,449.80
负债总计	-	-	-	41,006,591.51	41,006,591.51
利率敏感度缺口	489,847,607.30	-	6,301.07	8,674,066,248.69	9,163,920,157.06
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	195,118,357.01	-	-	-	195,118,357.01
结算备付金	2,533,514.84	-	-	-	2,533,514.84
存出保证金	233,308.18	-	-	-	233,308.18

交易性金融资产	270,220,366.20	-	16,000.00	8,676,550.63 2.71	8,946,786.99 8.91
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	-	-	-	2,067,599.05	2,067,599.05
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	788,565.54	-	-	13,833,137.91	14,621,703.45
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	4,505,700.12	4,505,700.12
资产总计	468,894,111.77	-	16,000.00	8,696,957.06 9.79	9,165,867.18 1.56
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	7,000,000.00	-	-	-	7,000,000.00
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	24,897,666.78	24,897,666.78
应付管理人报酬	-	-	-	238,582.86	238,582.86
应付托管费	-	-	-	47,716.57	47,716.57
应付销售服务费	-	-	-	178,214.81	178,214.81
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	-	-	-	284,265.52	284,265.52

负债总计	7,000,000.00	-	-	25,646,446.54	32,646,446.54
利率敏感度缺口	461,894,111.77	-	16,000.00	8,671,310.623.25	9,133,220.735.02

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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	-278,825.45	-233,775.10
	2.市场利率平行下降25个基点	279,853.63	234,605.24

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出的目标ETF份额以及证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%；本基金投资于目标ETF的方式以申购和赎回为主，但在目标ETF二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以通过二级市场交易买卖目标ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标ETF以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	187,108,787.59	2.04	136,753,426.98	1.50
交易性金融资产-基金投资	8,503,723,508.64	92.80	8,539,797,205.73	93.50
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	8,690,832,296.23	94.84	8,676,550,632.71	95.00

注：交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标 ETF 份额。

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	1.组合自身基准上升 5%	433,851,520.34	433,122,344.25
	2.组合自身基准下降 5%	-433,851,520.34	-433,122,344.25

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

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	8,685,800,413.67
第二层次	285,651,353.09
第三层次	4,722,157.76
合计	8,976,173,924.52

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，确定相关股票和债券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 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	187,108,787.59	2.03
	其中：股票	187,108,787.59	2.03
2	基金投资	8,503,723,508.64	92.38
3	固定收益投资	285,341,628.29	3.10
	其中：债券	285,341,628.29	3.10
	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	203,862,778.38	2.21
8	其他资产	24,890,045.67	0.27
9	合计	9,204,926,748.57	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,744,246.00	0.02

B	采矿业	9,958,411.15	0.11
C	制造业	114,152,335.31	1.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,790,859.32	0.06
E	建筑业	2,163,184.46	0.02
F	批发和零售业	6,779,531.28	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	5,279,366.91	0.06
H	住宿和餐饮业	348,539.20	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,536,275.76	0.14
J	金融业	14,189,180.42	0.15
K	房地产业	4,503,746.53	0.05
L	租赁和商务服务业	2,051,142.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	2,133,212.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	1,510,763.47	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	496,884.70	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,969,987.54	0.02
S	综合	1,501,121.54	0.02
	合计	187,108,787.59	2.04

7.2.2 期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688223	晶科能源	213,000	3,082,110.00	0.03
2	600522	中天科技	77,000	1,778,700.00	0.02
3	300769	德方纳米	3,700	1,512,116.00	0.02
4	600563	法拉电子	7,023	1,440,838.68	0.02
5	601615	明阳智能	42,000	1,419,600.00	0.02
6	688099	晶晨股份	14,000	1,414,000.00	0.02
7	000519	中兵红箭	48,100	1,402,115.00	0.02
8	600256	广汇能源	133,000	1,401,820.00	0.02
9	600096	云天化	42,600	1,341,048.00	0.01
10	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.01
11	300012	华测检测	55,700	1,292,797.00	0.01
12	002497	雅化集团	38,200	1,247,230.00	0.01
13	002407	多氟多	25,400	1,242,314.00	0.01
14	002240	盛新锂能	20,100	1,213,236.00	0.01

15	300390	天华超净	13,600	1,188,640.00	0.01
16	000009	中国宝安	83,269	1,123,298.81	0.01
17	002180	纳思达	21,600	1,093,392.00	0.01
18	300073	当升科技	11,800	1,066,012.00	0.01
19	600157	ST 永泰	644,000	1,023,960.00	0.01
20	002756	永兴材料	6,700	1,019,807.00	0.01
21	600372	中航电子	51,000	988,890.00	0.01
22	002028	思源电气	27,118	967,027.88	0.01
23	600392	盛和资源	42,010	949,426.00	0.01
24	600765	中航重机	29,486	948,859.48	0.01
25	603267	鸿远电子	7,000	940,310.00	0.01
26	600486	扬农化工	7,000	932,960.00	0.01
27	600141	兴发集团	21,084	927,485.16	0.01
28	601058	赛轮轮胎	81,200	915,124.00	0.01
29	600499	科达制造	43,800	904,032.00	0.01
30	000983	山西焦煤	67,400	902,486.00	0.01
31	603613	国联股份	10,150	899,290.00	0.01
32	300285	国瓷材料	25,000	898,000.00	0.01
33	600399	抚顺特钢	49,000	877,100.00	0.01
34	300037	新宙邦	16,560	870,393.60	0.01
35	688180	君实生物	11,458	863,245.72	0.01
36	600233	圆通速递	42,000	856,380.00	0.01
37	688122	西部超导	9,228	850,821.60	0.01
38	601108	财通证券	107,700	847,599.00	0.01
39	002385	大北农	107,400	838,794.00	0.01
40	600026	中远海能	79,900	825,367.00	0.01
41	601555	东吴证券	119,000	824,670.00	0.01
42	600885	宏发股份	19,603	820,385.55	0.01
43	600487	亨通光电	56,000	814,240.00	0.01
44	603127	昭衍新药	7,000	796,600.00	0.01
45	000738	航发控制	28,200	792,420.00	0.01
46	000630	铜陵有色	234,800	765,448.00	0.01
47	000970	中科三环	40,720	764,721.60	0.01
48	000783	长江证券	128,300	760,819.00	0.01
49	002572	索菲亚	27,200	748,000.00	0.01
50	000988	华工科技	31,900	739,123.00	0.01
51	603077	和邦生物	173,020	737,065.20	0.01
52	603456	九洲药业	14,000	723,800.00	0.01
53	600418	江淮汽车	42,068	721,886.88	0.01
54	688777	中控技术	9,879	718,796.04	0.01
55	002056	横店东磁	26,700	710,754.00	0.01
56	600732	爱旭股份	21,000	693,420.00	0.01
57	688521	芯原股份	14,000	691,600.00	0.01

58	002797	第一创业	107,700	690,357.00	0.01
59	600298	安琪酵母	14,000	682,500.00	0.01
60	000960	锡业股份	40,200	674,154.00	0.01
61	601077	渝农商行	182,000	673,400.00	0.01
62	002030	达安基因	39,045	671,183.55	0.01
63	000830	鲁西化工	38,610	667,566.90	0.01
64	601168	西部矿业	56,000	662,480.00	0.01
65	002603	以岭药业	27,260	662,418.00	0.01
66	002185	华天科技	70,000	656,600.00	0.01
67	002505	鹏都农牧	190,900	647,151.00	0.01
68	002422	科伦药业	34,600	647,020.00	0.01
69	603605	珀莱雅	3,900	644,202.00	0.01
70	600153	建发股份	49,000	640,430.00	0.01
71	600521	华海药业	28,000	635,600.00	0.01
72	601636	旗滨集团	49,000	624,750.00	0.01
73	300146	汤臣倍健	28,600	619,190.00	0.01
74	601696	中银证券	45,600	606,480.00	0.01
75	600549	厦门钨业	28,040	606,224.80	0.01
76	601162	天风证券	189,700	603,246.00	0.01
77	000039	中集集团	42,800	592,780.00	0.01
78	002384	东山精密	25,800	591,594.00	0.01
79	002138	顺络电子	21,700	591,325.00	0.01
80	600862	中航高科	21,000	590,100.00	0.01
81	601128	常熟银行	77,024	588,463.36	0.01
82	000932	华菱钢铁	113,720	578,834.80	0.01
83	601872	招商轮船	100,200	577,152.00	0.01
84	600875	东方电气	35,020	576,079.00	0.01
85	002249	大洋电机	93,700	575,318.00	0.01
86	600988	赤峰黄金	35,000	558,250.00	0.01
87	002183	怡亚通	77,300	557,333.00	0.01
88	688002	睿创微纳	14,000	556,080.00	0.01
89	000998	隆平高科	33,200	553,112.00	0.01
90	600160	巨化股份	42,000	552,300.00	0.01
91	002268	卫士通	12,794	548,990.54	0.01
92	600497	驰宏锌锗	105,000	544,950.00	0.01
93	600546	山煤国际	28,000	544,880.00	0.01
94	600348	华阳股份	35,000	541,100.00	0.01
95	300308	中际旭创	17,300	537,165.00	0.01
96	002152	广电运通	57,900	536,733.00	0.01
97	300376	易事特	66,100	536,732.00	0.01
98	002223	鱼跃医疗	20,916	536,704.56	0.01
99	000937	冀中能源	71,900	536,374.00	0.01
100	002372	伟星新材	22,280	535,611.20	0.01

101	600705	中航产融	154,000	532,840.00	0.01
102	300699	光威复材	8,900	523,943.00	0.01
103	002092	中泰化学	66,800	518,368.00	0.01
104	300474	景嘉微	7,500	512,925.00	0.01
105	002353	杰瑞股份	12,700	511,810.00	0.01
106	601699	潞安环能	35,000	511,700.00	0.01
107	600177	雅戈尔	77,000	510,510.00	0.01
108	300026	红日药业	66,300	510,510.00	0.01
109	000778	新兴铸管	105,500	508,510.00	0.01
110	000807	云铝股份	51,200	505,856.00	0.01
111	002390	信邦制药	73,000	504,430.00	0.01
112	300244	迪安诊断	15,977	496,884.70	0.01
113	000959	首钢股份	103,900	494,564.00	0.01
114	000547	航天发展	40,861	487,880.34	0.01
115	000537	广宇发展	37,400	485,826.00	0.01
116	300253	卫宁健康	55,092	483,707.76	0.01
117	600516	方大炭素	63,000	478,800.00	0.01
118	600637	东方明珠	66,000	471,900.00	0.01
119	300296	利亚德	64,400	470,120.00	0.01
120	603568	伟明环保	14,046	468,715.02	0.01
121	002439	启明星辰	23,500	468,355.00	0.01
122	600704	物产中大	91,000	466,830.00	0.01
123	002078	太阳纸业	37,700	464,087.00	0.01
124	688208	道通科技	14,000	460,880.00	0.01
125	603198	迎驾贡酒	7,000	455,980.00	0.00
126	000729	燕京啤酒	47,100	454,986.00	0.00
127	000999	华润三九	10,075	453,375.00	0.00
128	300357	我武生物	8,700	452,661.00	0.00
129	000060	中金岭南	101,300	451,798.00	0.00
130	002299	圣农发展	23,500	450,730.00	0.00
131	601997	贵阳银行	77,000	447,370.00	0.00
132	300363	博腾股份	5,700	444,543.00	0.00
133	600039	四川路桥	42,040	442,681.20	0.00
134	600699	均胜电子	28,066	440,916.86	0.00
135	600482	中国动力	28,000	439,880.00	0.00
136	002507	涪陵榨菜	12,700	438,404.00	0.00
137	601198	东兴证券	49,000	436,100.00	0.00
138	600867	通化东宝	42,000	434,280.00	0.00
139	000581	威孚高科	22,400	431,200.00	0.00
140	300088	长信科技	57,900	429,618.00	0.00
141	600415	小商品城	77,000	428,890.00	0.00
142	002557	洽洽食品	7,500	426,975.00	0.00
143	600236	桂冠电力	70,000	426,300.00	0.00

144	600316	洪都航空	14,085	425,930.40	0.00
145	300618	寒锐钴业	7,300	422,816.00	0.00
146	002002	鸿达兴业	113,000	419,230.00	0.00
147	002683	广东宏大	15,000	417,450.00	0.00
148	002203	海亮股份	36,100	416,955.00	0.00
149	000887	中鼎股份	22,800	415,872.00	0.00
150	300182	捷成股份	75,500	415,250.00	0.00
151	600801	华新水泥	21,080	411,270.80	0.00
152	002465	海格通信	45,200	410,868.00	0.00
153	603589	口子窖	7,000	410,270.00	0.00
154	600879	航天电子	63,020	408,999.80	0.00
155	600739	辽宁成大	28,001	408,254.58	0.00
156	300009	安科生物	40,360	408,039.60	0.00
157	600985	淮北矿业	28,000	407,680.00	0.00
158	000930	中粮科技	45,000	406,800.00	0.00
159	601717	郑煤机	28,092	404,805.72	0.00
160	600580	卧龙电驱	28,011	403,918.62	0.00
161	601016	节能风电	84,000	403,200.00	0.00
162	000400	许继电气	20,800	399,360.00	0.00
163	600642	申能股份	70,099	398,162.32	0.00
164	603707	健友股份	14,060	396,492.00	0.00
165	000402	金融街	66,500	395,675.00	0.00
166	002936	郑州银行	146,849	395,023.81	0.00
167	000050	深天马A	39,300	391,821.00	0.00
168	600529	山东药玻	14,000	391,300.00	0.00
169	000825	太钢不锈	71,700	390,765.00	0.00
170	600369	西南证券	98,000	389,060.00	0.00
171	002212	天融信	38,100	386,715.00	0.00
172	002065	东华软件	60,900	384,888.00	0.00
173	600271	航天信息	35,000	382,900.00	0.00
174	600909	华安证券	84,088	382,600.40	0.00
175	600170	上海建工	126,000	381,780.00	0.00
176	000629	攀钢钒钛	99,600	378,480.00	0.00
177	000718	苏宁环球	102,700	377,936.00	0.00
178	600673	东阳光	42,027	377,822.73	0.00
179	300383	光环新网	36,200	377,204.00	0.00
180	600166	福田汽车	133,000	376,390.00	0.00
181	300257	开山股份	25,100	375,496.00	0.00
182	600511	国药股份	14,018	375,402.04	0.00
183	601005	重庆钢铁	196,000	374,360.00	0.00
184	000975	银泰黄金	38,424	374,249.76	0.00
185	600325	华发股份	49,009	370,998.13	0.00
186	600536	中国软件	9,100	369,369.00	0.00

187	600859	王府井	14,090	366,058.20	0.00
188	600008	首创环保	126,020	365,458.00	0.00
189	000513	丽珠集团	10,052	363,982.92	0.00
190	600066	宇通客车	42,000	363,300.00	0.00
191	002966	苏州银行	59,400	362,340.00	0.00
192	002191	劲嘉股份	33,800	362,336.00	0.00
193	600062	华润双鹤	14,057	360,702.62	0.00
194	300168	万达信息	38,200	360,608.00	0.00
195	600259	广晟有色	7,083	358,753.95	0.00
196	300251	光线传媒	37,800	357,966.00	0.00
197	603218	日月股份	14,000	355,600.00	0.00
198	688321	微芯生物	14,000	352,660.00	0.00
199	603866	桃李面包	21,211	351,042.05	0.00
200	600171	上海贝岭	14,000	350,420.00	0.00
201	600258	首旅酒店	14,054	348,539.20	0.00
202	600208	新湖中宝	126,000	347,760.00	0.00
203	000012	南玻 A	46,665	346,254.30	0.00
204	600380	健康元	28,013	345,960.55	0.00
205	002444	巨星科技	18,318	345,111.12	0.00
206	000878	云南铜业	30,100	342,839.00	0.00
207	600820	隧道股份	56,000	342,720.00	0.00
208	600970	中材国际	35,054	339,673.26	0.00
209	300072	海新能科	67,000	339,020.00	0.00
210	002273	水晶光电	27,788	336,512.68	0.00
211	601866	中远海发	112,000	336,000.00	0.00
212	603345	安井食品	2,000	335,740.00	0.00
213	002985	北摩高科	5,720	335,077.60	0.00
214	000623	吉林敖东	22,700	335,052.00	0.00
215	002155	湖南黄金	27,500	333,850.00	0.00
216	002127	南极电商	62,500	333,750.00	0.00
217	600998	九州通	28,000	333,480.00	0.00
218	000027	深圳能源	52,020	333,448.20	0.00
219	300144	宋城演艺	21,700	333,095.00	0.00
220	000636	风华高科	17,700	332,583.00	0.00
221	002244	滨江集团	38,400	332,160.00	0.00
222	600863	内蒙华电	91,000	332,150.00	0.00
223	601992	金隅集团	119,000	329,630.00	0.00
224	000750	国海证券	90,610	328,914.30	0.00
225	300058	蓝色光标	50,000	326,500.00	0.00
226	000869	张裕 A	10,900	324,166.00	0.00
227	000883	湖北能源	63,400	323,974.00	0.00
228	000690	宝新能源	73,900	323,682.00	0.00
229	600718	东软集团	28,082	323,223.82	0.00

230	600201	生物股份	35,010	320,691.60	0.00
231	300418	昆仑万维	20,000	320,000.00	0.00
232	600027	华电国际	81,000	318,330.00	0.00
233	002831	裕同科技	10,766	318,135.30	0.00
234	603156	养元饮品	14,000	318,080.00	0.00
235	002434	万里扬	37,100	317,205.00	0.00
236	600038	中直股份	7,000	316,400.00	0.00
237	600755	厦门国贸	42,048	315,360.00	0.00
238	002156	通富微电	20,400	314,160.00	0.00
239	600297	广汇汽车	119,000	310,590.00	0.00
240	600598	北大荒	21,000	309,960.00	0.00
241	600667	太极实业	42,000	309,960.00	0.00
242	603883	老百姓	9,143	309,764.84	0.00
243	002670	国盛金控	32,263	309,724.80	0.00
244	002625	光启技术	17,900	309,133.00	0.00
245	600064	南京高科	28,094	309,034.00	0.00
246	600390	五矿资本	63,000	308,070.00	0.00
247	002131	利欧股份	158,777	308,027.38	0.00
248	000709	河钢股份	136,000	307,360.00	0.00
249	002195	二三四五	136,058	306,130.50	0.00
250	002506	协鑫集成	82,100	305,412.00	0.00
251	002926	华西证券	38,900	304,976.00	0.00
252	300024	机器人	30,200	304,416.00	0.00
253	600498	烽火通信	21,000	304,080.00	0.00
254	002416	爱施德	32,670	303,831.00	0.00
255	600839	四川长虹	105,036	302,503.68	0.00
256	600315	上海家化	7,005	299,463.75	0.00
257	600155	华创阳安	35,000	296,800.00	0.00
258	002004	华邦健康	53,000	295,740.00	0.00
259	000553	安道麦 A	24,400	295,484.00	0.00
260	603517	绝味食品	5,100	294,882.00	0.00
261	600535	天士力	28,040	294,700.40	0.00
262	600056	中国医药	19,695	291,879.90	0.00
263	002958	青农商行	87,800	291,496.00	0.00
264	603026	石大胜华	2,000	290,700.00	0.00
265	002250	联化科技	17,727	290,190.99	0.00
266	600663	陆家嘴	28,000	290,080.00	0.00
267	002867	周大生	18,650	289,634.50	0.00
268	002128	电投能源	20,200	289,264.00	0.00
269	600216	浙江医药	21,094	287,933.10	0.00
270	002745	木林森	29,441	287,638.57	0.00
271	600409	三友化工	35,078	287,288.82	0.00
272	600282	南钢股份	91,000	286,650.00	0.00

273	002690	美亚光电	13,130	284,658.40	0.00
274	002399	海普瑞	16,100	283,038.00	0.00
275	002408	齐翔腾达	34,888	282,941.68	0.00
276	600782	新钢股份	56,000	282,240.00	0.00
277	600118	中国卫星	14,000	281,120.00	0.00
278	002294	信立泰	10,000	281,000.00	0.00
279	600022	山东钢铁	161,060	280,244.40	0.00
280	002326	永太科技	8,500	279,905.00	0.00
281	600500	中化国际	42,081	279,838.65	0.00
282	000717	韶钢松山	79,600	278,600.00	0.00
283	600827	百联股份	21,083	278,506.43	0.00
284	601607	上海医药	15,400	278,432.00	0.00
285	600109	国金证券	30,900	278,100.00	0.00
286	601577	长沙银行	35,000	277,550.00	0.00
287	603858	步长制药	14,000	275,940.00	0.00
288	002266	浙富控股	57,600	275,904.00	0.00
289	601880	辽港股份	161,060	273,802.00	0.00
290	002110	三钢闽光	44,900	273,441.00	0.00
291	000598	兴蓉环境	53,400	272,874.00	0.00
292	300463	迈克生物	13,300	272,517.00	0.00
293	000062	深圳华强	21,448	272,389.60	0.00
294	000967	盈峰环境	53,800	272,228.00	0.00
295	600728	佳都科技	42,000	271,320.00	0.00
296	002624	完美世界	18,800	270,156.00	0.00
297	300017	网宿科技	50,000	268,000.00	0.00
298	600597	光明乳业	21,082	266,265.66	0.00
299	600528	中铁工业	33,060	266,133.00	0.00
300	600808	马钢股份	70,001	265,303.79	0.00
301	600037	歌华有线	28,000	262,920.00	0.00
302	600060	海信视像	21,000	262,500.00	0.00
303	000739	普洛药业	12,700	262,128.00	0.00
304	601179	中国西电	56,000	262,080.00	0.00
305	600895	张江高科	21,000	261,450.00	0.00
306	300001	特锐德	15,088	261,173.28	0.00
307	002368	太极股份	13,586	260,987.06	0.00
308	000089	深圳机场	33,800	260,936.00	0.00
309	002701	奥瑞金	49,800	258,960.00	0.00
310	002815	崇达技术	20,200	258,762.00	0.00
311	600195	中牧股份	21,055	258,134.30	0.00
312	002221	东华能源	27,700	257,887.00	0.00
313	000559	万向钱潮	43,400	257,796.00	0.00
314	601456	国联证券	21,000	257,670.00	0.00
315	600967	内蒙一机	28,032	255,651.84	0.00

316	601990	南京证券	30,600	255,204.00	0.00
317	600517	国网英大	49,000	254,310.00	0.00
318	000831	五矿稀土	8,100	253,125.00	0.00
319	603885	吉祥航空	14,026	252,327.74	0.00
320	600567	山鹰国际	91,000	252,070.00	0.00
321	300070	碧水源	47,900	249,559.00	0.00
322	300482	万孚生物	6,110	248,738.10	0.00
323	600572	康恩贝	56,000	248,080.00	0.00
324	002233	塔牌集团	28,000	247,800.00	0.00
325	601958	金钼股份	28,000	247,520.00	0.00
326	002019	亿帆医药	17,700	247,446.00	0.00
327	600507	方大特钢	35,085	245,244.15	0.00
328	603225	新凤鸣	21,000	242,340.00	0.00
329	600435	北方导航	28,098	242,204.76	0.00
330	300630	普利制药	6,863	241,234.45	0.00
331	000401	冀东水泥	22,731	239,130.12	0.00
332	601718	际华集团	77,000	238,700.00	0.00
333	600811	东方集团	84,086	237,963.38	0.00
334	002373	千方科技	21,300	236,856.00	0.00
335	601106	中国一重	77,000	236,390.00	0.00
336	600582	天地科技	49,034	234,382.52	0.00
337	000997	新大陆	17,740	234,345.40	0.00
338	601118	海南橡胶	49,000	234,220.00	0.00
339	000488	晨鸣纸业	41,419	233,603.16	0.00
340	603650	彤程新材	7,095	231,155.10	0.00
341	000686	东北证券	32,700	228,573.00	0.00
342	601778	晶科科技	42,000	226,800.00	0.00
343	002396	星网锐捷	10,000	226,400.00	0.00
344	002500	山西证券	39,414	226,236.36	0.00
345	002382	蓝帆医疗	23,600	225,380.00	0.00
346	002595	豪迈科技	10,000	223,400.00	0.00
347	000528	柳工	34,211	222,713.61	0.00
348	000021	深科技	19,000	221,160.00	0.00
349	603712	七一二	7,000	220,500.00	0.00
350	600446	金证股份	21,000	217,980.00	0.00
351	601000	唐山港	84,019	216,769.02	0.00
352	601869	长飞光纤	7,000	216,440.00	0.00
353	600021	上海电力	21,098	216,254.50	0.00
354	600126	杭钢股份	42,010	215,091.20	0.00
355	601200	上海环境	21,038	213,746.08	0.00
356	601333	广深铁路	98,000	213,640.00	0.00
357	000685	中山公用	27,540	211,507.20	0.00
358	002387	维信诺	31,400	211,008.00	0.00

359	600737	中粮糖业	28,017	210,687.84	0.00
360	002146	荣盛发展	69,500	210,585.00	0.00
361	600373	中文传媒	21,040	210,189.60	0.00
362	600167	联美控股	28,050	210,094.50	0.00
363	300724	捷佳伟创	2,300	205,505.00	0.00
364	603317	天味食品	7,093	201,937.71	0.00
365	002048	宁波华翔	12,500	200,250.00	0.00
366	000158	常山北明	33,260	199,560.00	0.00
367	601098	中南传媒	21,014	198,372.16	0.00
368	300212	易华录	11,400	198,360.00	0.00
369	601598	中国外运	51,000	197,880.00	0.00
370	600120	浙江东方	49,084	196,826.84	0.00
371	600707	彩虹股份	42,000	196,560.00	0.00
372	002242	九阳股份	10,700	196,452.00	0.00
373	002124	天邦食品	29,200	196,224.00	0.00
374	002010	传化智联	30,200	194,186.00	0.00
375	600566	济川药业	7,014	190,500.24	0.00
376	600648	外高桥	14,000	190,400.00	0.00
377	600906	财达证券	21,000	188,790.00	0.00
378	600131	国网信通	14,000	188,300.00	0.00
379	000028	国药一致	6,311	188,004.69	0.00
380	002511	中顺洁柔	15,000	187,800.00	0.00
381	000961	中南建设	61,400	187,270.00	0.00
382	000563	陕国投 A	59,970	187,106.40	0.00
383	000898	鞍钢股份	57,900	186,438.00	0.00
384	000728	国元证券	29,900	185,978.00	0.00
385	601608	中信重工	49,000	185,710.00	0.00
386	600959	江苏有线	56,050	182,723.00	0.00
387	001914	招商积余	10,000	179,700.00	0.00
388	600901	江苏租赁	35,000	179,550.00	0.00
389	002174	游族网络	18,300	178,791.00	0.00
390	600764	中国海防	7,000	176,680.00	0.00
391	600307	酒钢宏兴	91,000	176,540.00	0.00
392	601611	中国核建	21,000	176,190.00	0.00
393	002281	光迅科技	10,000	175,800.00	0.00
394	600329	达仁堂	7,018	172,502.44	0.00
395	600376	首开股份	35,040	172,046.40	0.00
396	000990	诚志股份	15,700	171,915.00	0.00
397	002081	金螳螂	33,500	170,180.00	0.00
398	601991	大唐发电	70,000	170,100.00	0.00
399	600717	天津港	42,057	168,648.57	0.00
400	002653	海思科	10,465	168,591.15	0.00
401	300115	长盈精密	16,320	168,259.20	0.00

402	600398	海澜之家	35,000	166,250.00	0.00
403	002508	老板电器	4,600	165,738.00	0.00
404	002673	西部证券	25,300	165,462.00	0.00
405	603228	景旺电子	7,065	164,826.45	0.00
406	300166	东方国信	17,799	164,106.78	0.00
407	002925	盈趣科技	7,590	163,336.80	0.00
408	603927	中科软	7,000	163,240.00	0.00
409	601860	紫金银行	56,000	160,720.00	0.00
410	600787	中储股份	28,082	159,786.58	0.00
411	600006	东风汽车	21,057	158,980.35	0.00
412	002429	兆驰股份	41,400	158,976.00	0.00
413	000031	大悦城	39,300	157,200.00	0.00
414	002739	万达电影	11,500	156,975.00	0.00
415	603000	人民网	14,000	156,800.00	0.00
416	603379	三美股份	7,000	155,750.00	0.00
417	300136	信维通信	9,200	155,020.00	0.00
418	000671	阳光城	69,700	152,643.00	0.00
419	601928	凤凰传媒	21,016	150,264.40	0.00
420	000156	华数传媒	18,554	147,875.38	0.00
421	600968	海油发展	56,000	144,480.00	0.00
422	002430	杭氧股份	4,600	143,796.00	0.00
423	603638	艾迪精密	7,000	143,500.00	0.00
424	600339	中油工程	49,000	141,610.00	0.00
425	601156	东航物流	7,000	138,600.00	0.00
426	600299	安迪苏	14,000	134,120.00	0.00
427	601228	广州港	35,000	128,450.00	0.00
428	002409	雅克科技	2,300	127,673.00	0.00
429	000415	渤海租赁	57,900	125,643.00	0.00
430	603515	欧普照明	7,065	123,284.25	0.00
431	600928	西安银行	33,000	121,110.00	0.00
432	601969	海南矿业	14,000	120,260.00	0.00
433	600377	宁沪高速	14,000	119,980.00	0.00
434	600623	华谊集团	14,015	116,324.50	0.00
435	600556	天下秀	14,000	115,220.00	0.00
436	601298	青岛港	21,000	114,870.00	0.00
437	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.00
438	002948	青岛银行	30,870	111,749.40	0.00
439	600350	山东高速	21,008	110,292.00	0.00
440	000987	越秀金控	15,525	109,140.75	0.00
441	600095	湘财股份	14,000	107,660.00	0.00
442	600871	石化油服	56,000	105,840.00	0.00
443	002563	森马服饰	17,700	104,784.00	0.00
444	600823	世茂股份	35,000	104,300.00	0.00

445	002153	石基信息	6,440	102,202.80	0.00
446	601139	深圳燃气	14,090	97,784.60	0.00
447	601568	北元集团	15,400	97,636.00	0.00
448	600835	上海机电	7,001	96,123.73	0.00
449	603056	德邦股份	7,000	94,010.00	0.00
450	002939	长城证券	9,200	93,472.00	0.00
451	002532	天山铝业	13,800	90,114.00	0.00
452	002468	申通快递	7,500	89,400.00	0.00
453	600956	新天绿能	7,000	86,240.00	0.00
454	002946	新乳业	6,600	85,734.00	0.00
455	000656	金科股份	29,900	85,514.00	0.00
456	601828	美凯龙	14,000	84,840.00	0.00
457	000540	中天金融	43,300	83,569.00	0.00
458	002423	中粮资本	11,700	78,507.00	0.00
459	001872	招商港口	4,800	74,880.00	0.00
460	001965	招商公路	9,200	70,196.00	0.00
461	601665	齐鲁银行	14,000	68,320.00	0.00
462	300869	康泰医学	2,300	64,998.00	0.00
463	300741	华宝股份	2,300	63,986.00	0.00
464	002705	新宝股份	2,700	59,373.00	0.00
465	601003	柳钢股份	14,000	56,700.00	0.00
466	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
467	600917	重庆燃气	7,000	50,540.00	0.00
468	003035	南网能源	6,900	43,815.00	0.00
469	601187	厦门银行	7,000	41,720.00	0.00
470	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
471	002945	华林证券	2,300	35,075.00	0.00
472	301150	中一科技	404	33,435.04	0.00
473	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
474	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
475	001203	大中矿业	2,300	25,990.00	0.00
476	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
477	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
478	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
479	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
480	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
481	301127	天源环保	85	946.05	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	688005	容百科技	5,064,487.15	0.06
2	688099	晶晨股份	4,797,936.70	0.05
3	600522	中天科技	4,255,291.00	0.05
4	600563	法拉电子	3,798,858.00	0.04
5	600157	ST 永泰	2,992,255.00	0.03
6	603267	鸿远电子	2,955,110.00	0.03
7	601615	明阳智能	2,910,951.00	0.03
8	600765	中航重机	2,570,179.99	0.03
9	601555	东吴证券	2,556,936.20	0.03
10	601117	中国化学	2,446,218.00	0.03
11	600256	广汇能源	2,424,958.00	0.03
12	688521	芯原股份	2,316,908.58	0.03
13	688002	睿创微纳	2,295,988.43	0.03
14	600486	扬农化工	2,284,322.00	0.03
15	600885	宏发股份	2,282,790.08	0.02
16	601689	拓普集团	2,214,763.00	0.02
17	603613	国联股份	2,210,599.00	0.02
18	600188	兖矿能源	2,178,346.00	0.02
19	605358	立昂微	2,171,016.52	0.02
20	600487	亨通光电	2,134,995.00	0.02

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688005	容百科技	3,738,726.22	0.04
2	600256	广汇能源	3,687,422.50	0.04
3	600392	盛和资源	3,525,243.46	0.04
4	600188	兖矿能源	3,466,326.00	0.04
5	688099	晶晨股份	3,388,966.86	0.04
6	600522	中天科技	2,939,511.00	0.03
7	601117	中国化学	2,854,620.80	0.03
8	600563	法拉电子	2,776,591.00	0.03
9	601689	拓普集团	2,523,872.36	0.03
10	600884	杉杉股份	2,422,229.17	0.03
11	600754	锦江酒店	2,267,350.52	0.02
12	601615	明阳智能	2,115,552.00	0.02
13	600486	扬农化工	2,086,316.00	0.02
14	605358	立昂微	1,956,069.82	0.02

15	603893	瑞 芯 微	1,820,296.00	0.02
16	600765	中航重机	1,793,385.17	0.02
17	600885	宏发股份	1,765,437.80	0.02
18	601168	西部矿业	1,743,559.00	0.02
19	600157	ST 永 泰	1,721,327.00	0.02
20	600141	兴发集团	1,683,121.00	0.02

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	311,398,737.76
卖出股票收入（成交）总额	227,127,750.43

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	285,335,327.22	3.11
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）	6,301.07	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	285,341,628.29	3.11

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	019666	22 国债 01	1,537,920	155,518,051.86	1.70
2	019641	20 国债 11	849,600	87,023,666.76	0.95
3	019664	21 国债 16	278,000	28,257,648.93	0.31
4	019629	20 国债 03	144,000	14,535,959.67	0.16
5	127064	杭氧转债	53	5,301.00	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本报告期投资基金情况

7.10.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (人民币 元)	占基金资 产净值比 例 (%)
1	南方中证 500ETF	股票型	交易型开 放式	南方基金 管理股份 有限公司	8,503,723,5 08.64	92.80

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

无。

7.12.2 本期国债期货投资评价

无。

7.13 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

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

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	224,366.84
2	应收清算款	17,513.11
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	24,648,165.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,890,045.67

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

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	688223	晶科能源	3,082,110.00	0.03	新股锁定期
2	600938	中国海油	1,332,303.44	0.01	新股锁定期

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
南方中证500ETF 联	1,371,867	3,628.07	364,820,763.73	7.33%	4,612,406,936.49	92.67%

接 (LOF) A						
南方中证 500ETF 联 接 (LOF) C	37,583	8,200.55	124,192,76 3.98	40.30%	184,008,33 3.95	59.70%
合计	1,409,450	3,749.99	489,013,52 7.71	9.25%	4,796,415,2 70.44	90.75%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	于永祥	1,640,427.00	1.91%
2	潘建阳	1,405,107.00	1.63%
3	郭思含	661,432.00	0.77%
4	薛宜平	636,373.00	0.74%
5	张栋	574,492.00	0.67%
6	杨钢	551,900.00	0.64%
7	姚红伟	529,900.00	0.62%
8	黄小华	518,492.00	0.60%
9	王庆飞	482,024.00	0.56%
10	李鹏	471,000.00	0.55%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	4,874,160.78	0.0979%
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	95,886.86	0.0311%
	合计	4,970,047.64	0.0940%

注：分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	南方中证 500ETF 联接(LOF) A	>100
	南方中证 500ETF 联接(LOF) C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	南方中证 500ETF 联接(LOF) A	50~100
	南方中证 500ETF 联接(LOF) C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C
基金合同生效日(2009 年 9 月 25 日)基金份额总额	3,223,217,818.45	-
本报告期期初基金份额总额	4,449,109,231.19	272,566,113.00
本报告期基金总申购份额	1,355,845,615.38	401,149,877.98
减：报告期基金总赎回份额	827,727,146.35	365,514,893.05
本报告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	4,977,227,700.22	308,201,097.93

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2022 年 5 月 27 日，周易先生任南方基金管理股份有限公司董事长（法定代表人）。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

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，基金管理人收到中国证券监督管理委员会深圳监管局对公司的监管措施。基金管理人已及时按要求改正并报告。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	478,240,816.13	90.67%	47,824.24	90.66%	-
华泰证券	2	49,218,024.63	9.33%	4,924.11	9.34%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；

2、公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告;

3、公司内部管理规范,能满足基金操作的保密要求;

4、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

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

1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座;

2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实,投资建议是否准确;

3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

C: 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况:

新增交易单元:

无

退租交易单元:

无

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安	211,057,109.50	99.94%	1,957,000,000.00	100.00%	-	-	1,812,996,006.72	100.00%
华泰证券	136,028.20	0.06%	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	南方基金关于调整中国银行各交易渠道基金申购费率优惠标准的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-18
3	南方基金管理股份有限公司关于一路财富（北京）基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-25
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-12
5	南方基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金单笔赎回最低份额限制的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-22
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-26
7	南方基金关于旗下部分基金增加海通证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-11
8	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-16
9	南方基金关于旗下部分基金增加西南证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-21
10	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-22
11	南方基金关于旗下部分基金增加华夏财富为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-29
12	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-12
13	南方基金关于旗下部分基金增加中金财富为销	中国证券报、基金管	2022-05-13

	售机构及开通相关业务的公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
14	南方基金关于旗下部分基金增加盛京银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-18
15	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金增加侧袋机制并相应修订基金合同有关条款的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-18
16	南方基金关于旗下部分基金增加吉林银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-27
17	南方基金关于旗下部分基金增加江苏银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-01
18	南方基金关于旗下部分基金增加鼎信汇金为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-16

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的文件；

2、《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金合同》；

3、《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；

6、《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 2022 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>