

# 南方上证 380 交易型开放式指数证券 投资基金联接基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 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.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	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合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 本报告期投资基金情况.....	49

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	49
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.13 投资组合报告附注 .....	50
§8 基金份额持有人信息 .....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	52
§9 开放式基金份额变动 .....	52
§10 重大事件揭示 .....	53
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
§12 备查文件目录 .....	55
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	南方上证 380ETF 联接	
基金主代码	202025	
前端交易代码	202025	
后端交易代码	202026	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 9 月 20 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	70,551,281.36 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方上证 380ETF 联接 A	南方上证 380ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	202025	007571
报告期末下属分级基金的份 额总额	68,228,799.81 份	2,322,481.55 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 380”。

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	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
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	中国建设银行股份有限公司

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“380ETF”或“上证 380ETF”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于上证 380 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称 380ETF），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 380ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资 380ETF。本基金并不参与 380ETF 的管理。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为上证 380 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货

	币市场基金。同时本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
--	--

### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，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公司	中国建设银行股份有限公司
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	021-60637111
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	杨小松（代为履行法定代表人职责）	田国立

因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长缺位，根据相关法律法规和公司章程，公司董事会决定由公司总经理杨小松先生代为履行公司董事长职务（包括代为履行公司法定代表人职责以及法定、公司章程和制度规定的公司董事长其他各项职责）。该决定自 2021 年 2 月 19 日起生效。

## 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	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

#### 1、南方上证 380ETF 联接 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	13,780,307.95
本期利润	13,484,729.59
加权平均基金份额本期利润	0.1870
本期加权平均净值利润率	10.32%
本期基金份额净值增长率	10.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	43,405,618.51
期末可供分配基金份额利润	0.6361
期末基金资产净值	133,529,466.22
期末基金份额净值	1.9571
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	95.71%
-------------	--------

## 2、南方上证 380ETF 联接 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	369,616.10
本期利润	424,581.20
加权平均基金份额本期利润	0.2146
本期加权平均净值利润率	11.90%
本期基金份额净值增长率	10.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,445,713.73
期末可供分配基金份额利润	0.6224
期末基金资产净值	4,511,268.77
期末基金份额净值	1.9424
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	48.92%

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 2019 年 7 月 12 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2019 年 7 月 15 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

南方上证 380ETF 联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.50%	0.65%	1.65%	0.61%	1.85%	0.04%
过去三个月	10.65%	0.63%	6.93%	0.61%	3.72%	0.02%
过去六个月	10.77%	0.95%	6.66%	0.92%	4.11%	0.03%



过去一年	24.52%	1.10%	17.76%	1.09%	6.76%	0.01%
过去三年	46.65%	1.29%	29.28%	1.29%	17.37%	0.00%
自基金合同生效起至今	95.71%	1.54%	68.71%	1.55%	27.00%	-0.01%

南方上证 380ETF 联接 C

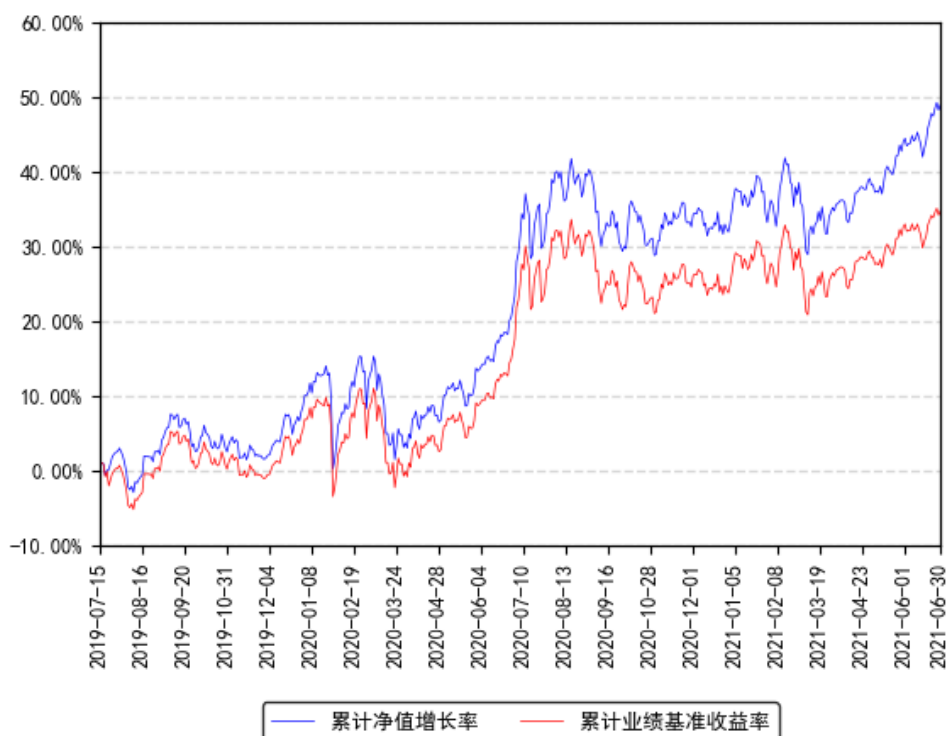
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.46%	0.65%	1.65%	0.61%	1.81%	0.04%
过去三个月	10.53%	0.63%	6.93%	0.61%	3.60%	0.02%
过去六个月	10.55%	0.95%	6.66%	0.92%	3.89%	0.03%
过去一年	24.04%	1.10%	17.76%	1.09%	6.28%	0.01%
自基金合同生效起至今	48.92%	1.16%	34.74%	1.15%	14.18%	0.01%

### 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

南方上证380ETF联接A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方上证380ETF联接C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金从 2019 年 7 月 12 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2019 年 7 月 15 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) 2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙) 2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙) 2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙) 2.20%。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 1.4 万亿元，旗下管理 245 只开放式基金，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		
孙伟	本基金基金经理	2019 年 7 月 12 日	-	11 年	管理学学士，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、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。

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券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，两两组间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现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%的情况。

## 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

本报告期内上证 380 指数上涨 6.98%。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

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

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

(3) 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) 新股上市初期涨幅较大的影响。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.9571 元，报告期内，份额净值增长率为 10.77%，同期业绩基准增长率为 6.66%；本基金 C 份额净值为 1.9424 元，报告期内，份额净值增长率为 10.55%，同期业绩基准增长率为 6.66%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

21 年春节后，自 16 年开启的大盘风格占优画风突变，上证 380 指数代表的中盘市值风格相对上证 180 表征的大盘风格明显走强。当前中盘风格相对低的历史估值分位数和匹配的业绩成长性展现出较高的投资性价比，未来有望受到资金持续认可。

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、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

本基金基金合同约定，由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；本基金收益每年最多分配 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

#### 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，本基金未实施利润分配。

#### 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：南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.4.1	3,144,972.04	1,169,501.32
结算备付金		83,379.41	3,928.26
存出保证金		7,245.16	10,173.69
交易性金融资产	6.4.4.2	140,210,093.05	145,783,888.27
其中：股票投资		6,825,626.72	10,197,829.47
基金投资		127,076,466.33	128,913,368.80
债券投资		6,308,000.00	6,672,690.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		-	249,170.23
应收利息	6.4.4.5	130,168.15	67,815.15
应收股利		-	-
应收申购款		915,844.94	107,176.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	105.00	105.00
资产总计		144,491,807.75	147,391,758.76
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		4,900,000.00	4,300,000.00
应付证券清算款		1,911.15	-
应付赎回款		1,450,909.14	899,530.05
应付管理人报酬		6,319.48	5,728.18
应付托管费		1,263.90	1,145.62
应付销售服务费		1,250.23	1,462.75
应付交易费用	6.4.4.7	1,383.50	1,689.27
应交税费		-	0.20
应付利息		2,778.90	-1,260.13
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	85,256.46	160,560.12
负债合计		6,451,072.76	5,368,856.06
所有者权益：			
实收基金	6.4.4.9	70,551,281.36	80,396,268.14
未分配利润	6.4.4.10	67,489,453.63	61,626,634.56
所有者权益合计		138,040,734.99	142,022,902.70
负债和所有者权益总计		144,491,807.75	147,391,758.76

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，南方上证 380ETF 联接 A 份额净值 1.9571 元，基金份额总额 68,228,799.81 份；南方上证 380ETF 联接 C 份额净值 1.9424 元，基金份额总额 2,322,481.55 份；总份额合计 70,551,281.36 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		14,134,800.65	17,191,259.64
1. 利息收入		71,374.30	61,748.43
其中：存款利息收入	6.4.4.11	3,184.56	22,696.62



债券利息收入		68,189.74	39,051.81
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）		14,263,487.16	744,087.37
其中：股票投资收益	6.4.4.12	1,385,826.61	470,229.42
基金投资收益	6.4.4.13	12,778,893.01	254,655.86
债券投资收益	6.4.4.14	2,046.50	3,939.25
资产支持证券投资	6.4.4.15	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.4.16	-	-
衍生工具收益	6.4.4.17	-	-
股利收益	6.4.4.18	96,721.04	15,262.84
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.19	-240,613.26	16,343,683.40
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.20	40,552.45	41,740.44
减：二、费用		225,489.86	176,972.30
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	37,782.65	24,448.16
2. 托管费	6.4.7.2.2	7,556.56	4,889.74
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	7,024.27	3,411.12
4. 交易费用	6.4.4.21	38,666.71	55,868.18
5. 利息支出		47,892.00	1,590.10
其中：卖出回购金融资产支出		47,892.00	1,590.10
6. 税金及附加		0.01	-
7. 其他费用	6.4.4.22	86,567.66	86,765.00

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,909,310.79	17,014,287.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,909,310.79	17,014,287.34

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	80,396,268.14	61,626,634.56	142,022,902.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,909,310.79	13,909,310.79
三、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）	-9,844,986.78	-8,046,491.72	-17,891,478.50
其中：1. 基金申购款	21,286,039.84	17,375,239.07	38,661,278.91
2. 基金赎回款	-31,131,026.62	-25,421,730.79	-56,552,757.41
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	70,551,281.36	67,489,453.63	138,040,734.99
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益	128,584,569.91	53,774,714.82	182,359,284.73

(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,014,287.34	17,014,287.34
三、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)	-26,664,124.00	-12,524,227.90	-39,188,351.90
其中: 1. 基金申购款	22,359,786.30	9,535,711.70	31,895,498.00
2. 基金赎回款	-49,023,910.30	-22,059,939.60	-71,083,849.90
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	101,920,445.91	58,264,774.26	160,185,220.17

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 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.4.2 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。

#### 6.4.2.1 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

### 6.4.3 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.3.1 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。

#### 6.4.3.2 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。

#### 6.4.3.3 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。

### 6.4.4 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	3,144,972.04
定期存款	-
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	-
合计	3,144,972.04

#### 6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	6,684,886.84	6,825,626.72	140,739.88
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,283,430.00	24,570.00
	银行间市场	-	-
	合计	6,283,430.00	24,570.00
资产支持证券	-	-	-
基金	103,617,970.33	127,076,466.33	23,458,496.00
其他	-	-	-
合计	116,586,287.17	140,210,093.05	23,623,805.88

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。

#### 6.4.4.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

**6.4.4.4 买入返售金融资产****6.4.4.4.1 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。

**6.4.4.4.2 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。

**6.4.4.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	243.47
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	37.50
应收债券利息	129,883.88
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	3.30
合计	130,168.15

**6.4.4.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	-
可收退补款	105.00
应收退补款	-
合计	105.00

**6.4.4.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,383.50
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,383.50

**6.4.4.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
----	---------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	953.90
应付证券出借违约金	-
应退替代款	-
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	-
可退替代款	-
其他	-
合计	85,256.46

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。

#### 6.4.4.9 实收基金

金额单位: 人民币元

南方上证 380ETF 联接 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	78,211,868.15	78,211,868.15
本期申购	16,034,043.98	16,034,043.98
本期赎回 (以“-”号填列)	-26,017,112.32	-26,017,112.32
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	68,228,799.81	68,228,799.81

南方上证 380ETF 联接 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	2,184,399.99	2,184,399.99
本期申购	5,251,995.86	5,251,995.86
本期赎回 (以“-”号填列)	-5,113,914.30	-5,113,914.30
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	2,322,481.55	2,322,481.55

注: 申购含转换入份额; 赎回含转换出份额。

#### 6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

南方上证 380ETF 联接 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34,755,498.81	25,217,527.10	59,973,025.91
本期利润	13,780,307.95	-295,578.36	13,484,729.59
本期基金份额交易产生的变动数	-5,130,188.25	-3,026,900.84	-8,157,089.09
其中：基金申购款	8,262,162.91	4,830,832.45	13,092,995.36
基金赎回款	-13,392,351.16	-7,857,733.29	-21,250,084.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,405,618.51	21,895,047.90	65,300,666.41

南方上证 380ETF 联接 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	951,268.07	702,340.58	1,653,608.65
本期利润	369,616.10	54,965.10	424,581.20
本期基金份额交易产生的变动数	124,829.56	-14,232.19	110,597.37
其中：基金申购款	2,773,479.00	1,508,764.71	4,282,243.71
基金赎回款	-2,648,649.44	-1,522,996.90	-4,171,646.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,445,713.73	743,073.49	2,188,787.22

#### 6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,196.45
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	821.38
其他	166.73
合计	3,184.56

#### 6.4.4.12 股票投资收益

##### 6.4.4.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	943,765.64
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	442,060.97
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	1,385,826.61

**6.4.4.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	28,659,147.69
减：卖出股票成本总额	27,715,382.05
买卖股票差价收入	943,765.64

**6.4.4.12.3 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。

**6.4.4.12.4 股票投资收益——申购差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	58,737,400.00
减：现金支付申购款总额	69,962.29
减：申购股票成本总额	58,225,376.74
申购差价收入	442,060.97

**6.4.4.12.5 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。

**6.4.4.13 基金投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	73,791,819.53
减：卖出/赎回基金成本总额	61,012,926.52
基金投资收益	12,778,893.01

**6.4.4.14 债券投资收益****6.4.4.14.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	2,046.50
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	2,046.50

**6.4.4.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑	551,646.40



付)成交总额	
减: 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	543,600.00
减: 应收利息总额	5,999.90
买卖债券差价收入	2,046.50

#### 6.4.4.14.3 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。

#### 6.4.4.14.4 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。

#### 6.4.4.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.4.16 贵金属投资收益

##### 6.4.4.16.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.4.16.2 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。

##### 6.4.4.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

##### 6.4.4.16.4 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。

#### 6.4.4.17 衍生工具收益

##### 6.4.4.17.1 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。

##### 6.4.4.17.2 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。

#### 6.4.4.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	96,721.04
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	96,721.04

#### 6.4.4.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-240,613.26
——股票投资	10,906.41
——债券投资	11,910.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-263,429.67
——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	-240,613.26

#### 6.4.4.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	35,451.92
基金转换费收入	5,100.53
合计	40,552.45

注：

1. 本基金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。
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，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.4.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	35,613.14
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	3,053.57
其中：申购费	-
赎回费	-
场内交易费	31.48
其他	3,022.09

合计	38,666.71
----	-----------

#### 6.4.4.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,265.10
合计	86,567.66

#### 6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.5.1 或有事项

无。

##### 6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.6 关联方关系

##### 6.4.6.1 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。

##### 6.4.6.2 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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
上证 380 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。

#### 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.7.1.1 股票交易

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股票交易。

###### 6.4.7.1.2 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。

### 6.4.7.1.3 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。

### 6.4.7.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 6.4.7.2 关联方报酬

#### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	37,782.65	24,448.16
其中：支付销售机构的客户维护费	108,575.37	67,229.12

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。

#### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,556.56	4,889.74

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建设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。

#### 6.4.7.2.3 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 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

	南方上证 380ETF 联接 A	南方上证 380ETF 联接 C	合计
南方基金	-	1,027.03	1,027.03
合计	-	1,027.03	1,027.03
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方上证 380ETF 联接 A	南方上证 380ETF 联接 C	合计
南方基金	-	426.89	426.89
合计	-	426.89	426.89

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：

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

#### 6.4.7.3 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。

#### 6.4.7.4 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

##### 6.4.7.4.1 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。

##### 6.4.7.4.2 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。

#### 6.4.7.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.7.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.7.5.2 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。

#### 6.4.7.6 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
建设银行	3,144,972.04	2,196.45	7,473,766.68	22,416.15

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

#### 6.4.7.7 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 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
兴业证券	605086	龙高股份	网下申购	443	5,696.98
华泰联合证券	605208	永茂泰	网下申购	801	10,733.40
兴业证券	605298	必得科技	网下申购	391	6,252.09
华泰联合证券	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合证券	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64

上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
兴业证券	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-

#### 6.4.7.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.7.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2021 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 103,617,970.33 元，估值总额为人民币 127,076,466.33 元，占本基金基金资产净值的比例为 92.06%（于 2020 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 105,191,443.13 元，估值总额为人民币 128,913,368.80 元，占本基金基金资产净值的比例为 90.77%）。

#### 6.4.8 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 6.4.9 期末（2021 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
113051	节能转债	2021 年 6 月 21 日	2021 年 7 月 22 日	配债未上市	100.00	100.00	70	7,000.00	7,000.00	-
113626	伯特转债	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 21 日	配债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

#### 6.4.9.2 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
600093	*ST 易见	2021 年 5 月 6 日	重大事项停牌	5.93	2021 年 8 月 24 日	2.67	1,600	10,360.01	9,488.00	-
600460	士兰微	2021 年 6 月 30 日	重大事项停牌	56.35	2021 年 7 月 1 日	59.49	1,600	73,994.06	90,160.00	-
600811	东方集团	2021 年 6 月 30 日	重大事项停牌	3.05	2021 年 7 月 14 日	3.36	5,800	18,045.95	17,690.00	-

本基金截至 2021 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。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 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。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 4,900,000.00 元，截至 2021 年 7 月 1 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.9.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.10 金融工具风险及管理

#### 6.4.10.1 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。



### 6.4.10.2 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建设银行，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。

### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.3.1 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%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

#### 6.4.10.4 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。

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	3,144,972.04	-	-	-	3,144,972.04
结算备付金	83,379.41	-	-	-	83,379.41
存出保证金	7,245.16	-	-	-	7,245.16
交易性金融	6,300,000.00	-	8,000.00	133,902,093.	140,210,093.

资产				05	05
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	130,168.15	130,168.15
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	201,892.96	-	-	713,951.98	915,844.94
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	105.00	105.00
资产总计	9,737,489.57	-	8,000.00	134,746,318.18	144,491,807.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,450,909.14	1,450,909.14
应付管理人报酬	-	-	-	6,319.48	6,319.48
应付托管费	-	-	-	1,263.90	1,263.90
应付证券清算款	-	-	-	1,911.15	1,911.15
卖出回购金融资产款	4,900,000.00	-	-	-	4,900,000.00
应付销售服务费	-	-	-	1,250.23	1,250.23
应付交易费用	-	-	-	1,383.50	1,383.50
应付利息	-	-	-	2,778.90	2,778.90
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	85,256.46	85,256.46
负债总计	4,900,000.00	-	-	1,551,072.76	6,451,072.76
利率敏感度缺口	4,837,489.57	-	8,000.00	133,195,245.42	138,040,734.99
上年度末					
2020 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	1,169,501.32	-	-	-	1,169,501.32
结算备付金	3,928.26	-	-	-	3,928.26
存出保证金	10,173.69	-	-	-	10,173.69
交易性金融资产	6,591,690.00	-	81,000.00	139,111,198.27	145,783,888.27
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	67,815.15	67,815.15

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	1,709.00	-	-	105,467.84	107,176.84
应收证券清算款	-	-	-	249,170.23	249,170.23
其他资产	-	-	-	105.00	105.00
资产总计	7,777,002.27	-	81,000.00	139,533,756.49	147,391,758.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	899,530.05	899,530.05
应付管理人报酬	-	-	-	5,728.18	5,728.18
应付托管费	-	-	-	1,145.62	1,145.62
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	4,300,000.00	-	-	-	4,300,000.00
应付销售服务费	-	-	-	1,462.75	1,462.75
应付交易费用	-	-	-	1,689.27	1,689.27
应付利息	-	-	-	-1,260.13	-1,260.13
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.20	0.20
其他负债	-	-	-	160,560.12	160,560.12
负债总计	4,300,000.00	-	-	1,068,856.06	5,368,856.06
利率敏感度缺口	3,477,002.27	-	81,000.00	138,464,900.43	142,022,902.70

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。

#### 6.4.10.4.1.2 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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	-801.18	-9,642.44
2.市场利率平行下降25个基点	804.88	9,693.85	

#### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.4.3 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，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。

##### 6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	6,825,626.72	4.94	10,197,829.47	7.18
交易性金融资产-基金投资	127,076,466.33	92.06	128,913,368.80	90.77
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	133,902,093.05	97.00	139,111,198.27	97.95

注：交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标 ETF 份额。

##### 6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	6,607,987.21	6,738,795.97
2.组合自身基准下降 5%	-6,607,987.21	-6,738,795.97	

### 6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 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	6,825,626.72	4.72
	其中：股票	6,825,626.72	4.72
2	基金投资	127,076,466.33	87.95
3	固定收益投资	6,308,000.00	4.37
	其中：债券	6,308,000.00	4.37
	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	3,228,351.45	2.23
8	其他资产	1,053,363.25	0.73
9	合计	144,491,807.75	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	6,700.00	0.00
B	采矿业	300,971.98	0.22
C	制造业	4,009,031.74	2.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	338,939.29	0.25
E	建筑业	185,529.31	0.13
F	批发和零售业	364,803.32	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	298,011.98	0.22
H	住宿和餐饮业	69,906.40	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	299,451.95	0.22
J	金融业	404,410.90	0.29
K	房地产业	229,161.40	0.17
L	租赁和商务服务业	79,253.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	79,706.82	0.06

N	水利、环境和公共设施管理业	89,501.93	0.06
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	56,866.50	0.04
S	综合	13,380.20	0.01
	合计	6,825,626.72	4.94

### 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	688036	传音控股	462	96,789.00	0.07
2	603486	科沃斯	400	91,232.00	0.07
3	600460	士兰微	1,600	90,160.00	0.07
4	601233	桐昆股份	3,200	77,088.00	0.06
5	603345	安井食品	300	76,206.00	0.06
6	600015	华夏银行	12,100	74,899.00	0.05
7	600885	宏发股份	1,080	67,716.00	0.05
8	603899	晨光文具	800	67,648.00	0.05
9	601636	旗滨集团	3,200	59,392.00	0.04
10	688008	澜起科技	936	58,387.68	0.04
11	603737	三棵树	325	57,200.00	0.04
12	600795	国电电力	23,300	56,619.00	0.04
13	601838	成都银行	4,300	54,352.00	0.04
14	600079	人福医药	1,900	53,713.00	0.04
15	600704	物产中大	6,600	51,942.00	0.04
16	600219	南山铝业	14,200	51,120.00	0.04
17	603816	顾家家居	620	47,913.60	0.03
18	600332	白云山	1,400	47,390.00	0.03
19	600754	锦江酒店	800	45,560.00	0.03
20	600845	宝信软件	892	45,402.80	0.03
21	601799	星宇股份	200	45,144.00	0.03
22	600486	扬农化工	400	44,708.00	0.03
23	603127	昭衍新药	240	44,100.00	0.03
24	603939	益丰药房	784	43,974.56	0.03
25	688298	东方生物	200	43,520.00	0.03
26	601727	上海电气	10,100	42,824.00	0.03

27	603613	国联股份	425	42,487.25	0.03
28	601058	赛轮轮胎	4,224	42,197.76	0.03
29	600315	上海家化	700	42,098.00	0.03
30	601117	中国化学	4,800	42,048.00	0.03
31	600705	中航产融	10,600	41,022.00	0.03
32	600392	盛和资源	2,350	40,796.00	0.03
33	603678	火炬电子	600	40,500.00	0.03
34	603605	珀莱雅	200	39,342.00	0.03
35	603456	九洲药业	800	38,864.00	0.03
36	600177	雅戈尔	5,500	36,245.00	0.03
37	601997	贵阳银行	5,000	35,800.00	0.03
38	603185	上机数控	200	35,790.00	0.03
39	600549	厦门钨业	1,700	35,411.00	0.03
40	600655	豫园股份	3,000	34,770.00	0.03
41	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.03
42	688002	睿创微纳	347	34,641.01	0.03
43	600316	洪都航空	900	34,632.00	0.03
44	600988	赤峰黄金	2,300	34,477.00	0.02
45	603236	移远通信	200	34,122.00	0.02
46	600848	上海临港	1,900	34,010.00	0.02
47	601128	常熟银行	5,400	33,480.00	0.02
48	600171	上海贝岭	1,100	33,473.00	0.02
49	600380	健康元	2,371	32,553.83	0.02
50	600018	上港集团	6,800	32,436.00	0.02
51	600879	航天电子	4,300	32,336.00	0.02
52	688208	道通科技	371	32,273.29	0.02
53	600674	川投能源	2,600	32,058.00	0.02
54	603290	斯达半导	100	32,000.00	0.02
55	600563	法拉电子	200	31,672.00	0.02
56	600369	西南证券	6,500	31,655.00	0.02
57	600559	老白干酒	1,202	31,612.60	0.02
58	601615	明阳智能	1,900	30,761.00	0.02
59	601998	中信银行	6,000	30,600.00	0.02
60	600529	山东药玻	900	30,555.00	0.02
61	600642	申能股份	4,900	30,086.00	0.02
62	600711	盛屯矿业	4,200	29,946.00	0.02
63	601567	三星医疗	1,400	29,820.00	0.02
64	601866	中远海发	7,800	29,250.00	0.02
65	600998	九州通	1,900	29,203.00	0.02
66	600236	桂冠电力	4,660	28,938.60	0.02
67	601699	潞安环能	2,400	28,344.00	0.02
68	600415	小商品城	5,400	27,810.00	0.02
69	600153	建发股份	3,400	27,540.00	0.02



70	603638	艾迪精密	640	27,436.80	0.02
71	600256	广汇能源	8,000	26,640.00	0.02
72	600667	太极实业	2,900	26,390.00	0.02
73	600008	首创环保	8,700	26,187.00	0.02
74	600188	兖州煤业	1,700	26,112.00	0.02
75	600498	烽火通信	1,400	26,082.00	0.02
76	688122	西部超导	400	25,948.00	0.02
77	600141	兴发集团	1,360	25,608.80	0.02
78	603267	鸿远电子	200	25,584.00	0.02
79	603338	浙江鼎力	434	25,471.46	0.02
80	600233	圆通速递	2,500	25,025.00	0.02
81	600765	中航重机	1,100	24,915.00	0.02
82	600372	中航电子	1,500	24,825.00	0.02
83	688088	虹软科技	444	24,753.00	0.02
84	603858	步长制药	1,100	24,739.00	0.02
85	600801	华新水泥	1,400	24,598.00	0.02
86	601717	郑煤机	2,100	24,423.00	0.02
87	600170	上海建工	8,800	24,288.00	0.02
88	600409	三友化工	2,400	24,264.00	0.02
89	600160	巨化股份	2,700	23,868.00	0.02
90	603489	八方股份	100	23,638.00	0.02
91	603027	千禾味业	884	23,240.36	0.02
92	600663	陆家嘴	1,740	23,176.80	0.02
93	603707	健友股份	555	23,171.25	0.02
94	603260	合盛硅业	300	23,073.00	0.02
95	600325	华发股份	3,400	22,916.00	0.02
96	600258	首旅酒店	940	22,428.40	0.02
97	600363	联创光电	800	22,280.00	0.02
98	603198	迎驾贡酒	500	22,150.00	0.02
99	600567	山鹰国际	6,400	22,080.00	0.02
100	601016	节能风电	5,900	22,066.00	0.02
101	601992	金隅集团	8,200	22,058.00	0.02
102	600027	华电国际	6,400	22,016.00	0.02
103	603128	华贸物流	1,560	21,980.40	0.02
104	603077	和邦生物	10,520	21,881.60	0.02
105	601231	环旭电子	1,300	21,853.00	0.02
106	603225	新风鸣	1,076	21,842.80	0.02
107	600323	瀚蓝环境	1,000	21,790.00	0.02
108	600282	南钢股份	6,100	21,716.00	0.02
109	603712	七一二	600	21,660.00	0.02
110	603927	中科软	500	21,475.00	0.02
111	601577	长沙银行	2,400	21,456.00	0.02
112	688139	海尔生物	203	21,335.30	0.02

113	603588	高能环境	1,470	21,285.60	0.02
114	603866	桃李面包	680	21,216.00	0.02
115	600580	卧龙电驱	1,588	21,120.40	0.02
116	603883	老百姓	400	21,072.00	0.02
117	600216	浙江医药	1,300	20,813.00	0.02
118	600641	万业企业	1,140	20,793.60	0.02
119	603233	大参林	406	20,750.66	0.02
120	600728	佳都科技	2,800	20,748.00	0.02
121	600808	马钢股份	4,700	20,163.00	0.01
122	600596	新安股份	1,120	19,846.40	0.01
123	603008	喜临门	600	19,806.00	0.01
124	688006	杭可科技	232	19,720.00	0.01
125	600966	博汇纸业	1,500	19,575.00	0.01
126	600820	隧道股份	3,700	19,573.00	0.01
127	600583	海油工程	4,300	19,350.00	0.01
128	600970	中材国际	2,100	19,257.00	0.01
129	603650	彤程新材	400	19,240.00	0.01
130	600803	新奥股份	1,150	18,986.50	0.01
131	603000	人民网	1,100	18,909.00	0.01
132	600755	厦门国贸	2,300	18,883.00	0.01
133	688166	博瑞医药	451	18,856.31	0.01
134	600459	贵研铂业	766	18,843.60	0.01
135	601018	宁波港	4,700	18,565.00	0.01
136	603520	司太立	300	18,495.00	0.01
137	600197	伊力特	600	18,396.00	0.01
138	601908	京运通	1,900	18,240.00	0.01
139	600252	中恒集团	5,500	18,095.00	0.01
140	600782	新钢股份	3,200	17,856.00	0.01
141	600348	华阳股份	2,400	17,808.00	0.01
142	600260	凯乐科技	2,000	17,760.00	0.01
143	600811	东方集团	5,800	17,690.00	0.01
144	600185	格力地产	2,400	17,688.00	0.01
145	600039	四川路桥	2,800	17,556.00	0.01
146	600273	嘉化能源	2,000	17,400.00	0.01
147	603885	吉祥航空	1,140	17,396.40	0.01
148	600993	马应龙	600	17,328.00	0.01
149	600597	光明乳业	1,200	17,292.00	0.01
150	600329	中新药业	615	17,275.35	0.01
151	601808	中海油服	1,200	17,232.00	0.01
152	600577	精达股份	2,700	17,226.00	0.01
153	600967	内蒙一机	1,700	17,204.00	0.01
154	600206	有研新材	1,200	17,160.00	0.01
155	600985	淮北矿业	1,400	17,094.00	0.01

156	603583	捷昌驱动	332	16,805.84	0.01
157	600685	中船防务	800	16,640.00	0.01
158	600026	中远海能	2,700	16,632.00	0.01
159	601222	林洋能源	2,000	16,580.00	0.01
160	600688	上海石化	4,400	16,544.00	0.01
161	601666	平煤股份	2,318	16,480.98	0.01
162	603068	博通集成	200	16,460.00	0.01
163	601200	上海环境	1,360	16,279.20	0.01
164	603113	金能科技	900	16,254.00	0.01
165	603218	日月股份	600	16,248.00	0.01
166	603568	伟明环保	711	16,232.13	0.01
167	600223	鲁商发展	1,000	16,140.00	0.01
168	600446	金证股份	1,100	15,884.00	0.01
169	600167	联美控股	1,760	15,716.80	0.01
170	601598	中国外运	3,100	15,655.00	0.01
171	605168	三人行	100	15,336.00	0.01
172	603733	仙鹤股份	400	15,200.00	0.01
173	600562	国睿科技	1,000	15,070.00	0.01
174	601311	骆驼股份	1,300	15,041.00	0.01
175	600338	西藏珠峰	1,060	15,020.20	0.01
176	603039	泛微网络	220	14,641.00	0.01
177	600120	浙江东方	3,410	14,594.80	0.01
178	600376	首开股份	2,600	14,560.00	0.01
179	603596	伯特利	400	14,300.00	0.01
180	603429	集友股份	440	14,300.00	0.01
181	601333	广深铁路	6,700	14,204.00	0.01
182	600507	方大特钢	2,090	14,170.20	0.01
183	603606	东方电缆	700	14,098.00	0.01
184	601000	唐山港	5,798	13,973.18	0.01
185	601965	中国汽研	800	13,824.00	0.01
186	600373	中文传媒	1,400	13,804.00	0.01
187	600720	祁连山	1,300	13,702.00	0.01
188	600587	新华医疗	600	13,590.00	0.01
189	600850	电科数字	500	13,455.00	0.01
190	603228	景旺电子	512	13,414.40	0.01
191	600673	东阳光	2,980	13,380.20	0.01
192	600056	中国医药	1,100	13,365.00	0.01
193	600643	爱建集团	1,900	13,262.00	0.01
194	600378	昊华科技	600	13,218.00	0.01
195	603301	振德医疗	300	13,176.00	0.01
196	600057	厦门象屿	2,100	13,125.00	0.01
197	600682	南京新百	1,300	13,078.00	0.01
198	603881	数据港	360	13,032.00	0.01

199	600740	山西焦化	2,550	12,954.00	0.01
200	600095	湘财股份	1,100	12,881.00	0.01
201	603187	海容冷链	300	12,864.00	0.01
202	600582	天地科技	3,298	12,862.20	0.01
203	600388	龙净环保	1,507	12,839.64	0.01
204	600062	华润双鹤	1,076	12,815.16	0.01
205	603298	杭叉集团	700	12,698.00	0.01
206	600211	西藏药业	200	12,616.00	0.01
207	603010	万盛股份	600	12,582.00	0.01
208	603355	莱克电气	200	12,446.00	0.01
209	603129	春风动力	100	12,408.00	0.01
210	601098	中南传媒	1,400	12,348.00	0.01
211	603919	金徽酒	300	12,336.00	0.01
212	601958	金钼股份	1,900	12,312.00	0.01
213	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
214	603686	龙马环卫	800	12,168.00	0.01
215	603690	至纯科技	300	12,123.00	0.01
216	600094	大名城	3,200	12,064.00	0.01
217	603599	广信股份	400	12,032.00	0.01
218	600131	国网信通	900	11,916.00	0.01
219	600648	外高桥	800	11,824.00	0.01
220	600984	建设机械	1,100	11,781.00	0.01
221	603368	柳药股份	595	11,745.30	0.01
222	600483	福能股份	1,100	11,539.00	0.01
223	600742	一汽富维	1,128	11,494.32	0.01
224	600210	紫江企业	2,400	11,400.00	0.01
225	601828	美凯龙	950	11,400.00	0.01
226	600764	中国海防	400	11,320.00	0.01
227	603043	广州酒家	440	11,316.80	0.01
228	600776	东方通信	900	11,160.00	0.01
229	603279	景津环保	500	11,080.00	0.01
230	600021	上海电力	1,600	11,056.00	0.01
231	603378	亚士创能	200	11,004.00	0.01
232	600729	重庆百货	400	10,980.00	0.01
233	601611	中国核建	1,500	10,830.00	0.01
234	603713	密尔克卫	100	10,798.00	0.01
235	600295	鄂尔多斯	600	10,734.00	0.01
236	600863	内蒙华电	4,600	10,718.00	0.01
237	600422	昆药集团	1,100	10,670.00	0.01
238	600073	上海梅林	1,300	10,647.00	0.01
239	600968	海油发展	4,100	10,619.00	0.01
240	600612	老凤祥	200	10,594.00	0.01
241	600556	天下秀	1,000	10,560.00	0.01

242	603601	再升科技	900	10,413.00	0.01
243	601952	苏垦农发	1,000	10,380.00	0.01
244	600694	大商股份	500	10,380.00	0.01
245	600072	中船科技	900	10,350.00	0.01
246	603018	华设集团	1,280	10,176.00	0.01
247	603960	克来机电	300	9,930.00	0.01
248	600420	国药现代	1,000	9,850.00	0.01
249	600326	西藏天路	1,450	9,773.00	0.01
250	600377	宁沪高速	1,000	9,760.00	0.01
251	600835	上海机电	600	9,750.00	0.01
252	600491	龙元建设	1,800	9,684.00	0.01
253	600299	安迪苏	800	9,568.00	0.01
254	600639	浦东金桥	700	9,555.00	0.01
255	600531	豫光金铅	1,800	9,504.00	0.01
256	600093	*ST 易见	1,600	9,488.00	0.01
257	601827	三峰环境	1,000	9,470.00	0.01
258	603989	艾华集团	290	9,451.10	0.01
259	600285	羚锐制药	900	9,450.00	0.01
260	600502	安徽建工	2,392	9,280.96	0.01
261	603387	基蛋生物	412	9,261.76	0.01
262	600395	盘江股份	1,300	9,230.00	0.01
263	600477	杭萧钢构	2,578	9,203.46	0.01
264	600337	美克家居	2,180	9,177.80	0.01
265	600787	中储股份	1,700	9,061.00	0.01
266	603313	梦百合	300	9,015.00	0.01
267	600284	浦东建设	1,359	8,982.99	0.01
268	600566	济川药业	500	8,950.00	0.01
269	605266	健之佳	100	8,900.00	0.01
270	600823	世茂股份	2,200	8,888.00	0.01
271	600125	铁龙物流	1,800	8,874.00	0.01
272	600466	蓝光发展	3,000	8,850.00	0.01
273	600750	江中药业	660	8,745.00	0.01
274	603708	家家悦	500	8,685.00	0.01
275	601298	青岛港	1,400	8,652.00	0.01
276	600846	同济科技	1,000	8,520.00	0.01
277	600668	尖峰集团	700	8,358.00	0.01
278	603609	禾丰股份	800	8,336.00	0.01
279	603801	志邦家居	260	8,309.60	0.01
280	603118	共进股份	900	8,307.00	0.01
281	603317	天味食品	280	8,240.40	0.01
282	600748	上实发展	1,790	8,234.00	0.01
283	603915	国茂股份	200	7,900.00	0.01
284	600565	迪马股份	3,100	7,874.00	0.01

285	603108	润达医疗	700	7,861.00	0.01
286	600971	恒源煤电	1,180	7,847.00	0.01
287	603060	国检集团	457	7,796.42	0.01
288	600452	涪陵电力	540	7,759.80	0.01
289	600611	大众交通	2,200	7,700.00	0.01
290	601139	深圳燃气	1,150	7,544.00	0.01
291	600075	新疆天业	1,100	7,480.00	0.01
292	603587	地素时尚	300	7,473.00	0.01
293	603515	欧普照明	290	7,444.30	0.01
294	603766	隆鑫通用	2,050	7,441.50	0.01
295	603888	新华网	350	7,409.50	0.01
296	600350	山东高速	1,200	7,380.00	0.01
297	601869	长飞光纤	300	7,308.00	0.01
298	605009	豪悦护理	100	7,237.00	0.01
299	600007	中国国贸	400	7,184.00	0.01
300	600070	浙江富润	800	7,064.00	0.01
301	601019	山东出版	1,200	6,888.00	0.00
302	603363	傲农生物	660	6,798.00	0.00
303	603305	旭升股份	200	6,746.00	0.00
304	603393	新天然气	368	6,727.04	0.00
305	600975	新五丰	1,000	6,700.00	0.00
306	603916	苏博特	320	6,604.80	0.00
307	603056	德邦股份	600	6,594.00	0.00
308	603197	保隆科技	200	6,578.00	0.00
309	603997	继峰股份	800	6,576.00	0.00
310	600933	爱柯迪	500	6,520.00	0.00
311	601949	中国出版	1,000	6,350.00	0.00
312	603416	信捷电气	100	6,347.00	0.00
313	603728	鸣志电器	360	6,332.40	0.00
314	601069	西部黄金	500	6,255.00	0.00
315	603505	金石资源	320	6,204.80	0.00
316	603012	创力集团	1,000	6,110.00	0.00
317	601512	中新集团	600	5,976.00	0.00
318	603565	中谷物流	200	5,962.00	0.00
319	600657	信达地产	1,700	5,916.00	0.00
320	601003	柳钢股份	1,000	5,900.00	0.00
321	600020	中原高速	1,800	5,850.00	0.00
322	603887	城地香江	580	5,794.20	0.00
323	601158	重庆水务	1,100	5,742.00	0.00
324	603533	掌阅科技	200	5,700.00	0.00
325	601187	厦门银行	600	5,688.00	0.00
326	601801	皖新传媒	1,200	5,664.00	0.00
327	600874	创业环保	905	5,529.55	0.00

328	603985	恒润股份	320	5,424.00	0.00
329	600510	黑牡丹	800	5,336.00	0.00
330	600548	深高速	600	5,232.00	0.00
331	601789	宁波建工	1,402	5,159.36	0.00
332	603258	电魂网络	200	5,118.00	0.00
333	603556	海兴电力	430	5,039.60	0.00
334	603639	海利尔	276	4,965.24	0.00
335	603367	辰欣药业	400	4,960.00	0.00
336	603920	世运电路	350	4,910.50	0.00
337	600917	重庆燃气	600	4,902.00	0.00
338	603610	麒盛科技	270	4,846.50	0.00
339	603180	金牌厨柜	100	4,769.00	0.00
340	603466	风语筑	290	4,741.50	0.00
341	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
342	603626	科森科技	500	4,550.00	0.00
343	601858	中国科传	500	4,455.00	0.00
344	601330	绿色动力	500	4,445.00	0.00
345	600802	福建水泥	640	4,416.00	0.00
346	605099	共创草坪	100	4,238.00	0.00
347	603730	岱美股份	231	4,208.82	0.00
348	603868	飞科电器	100	4,206.00	0.00
349	603053	成都燃气	400	4,064.00	0.00
350	603357	设计总院	440	3,810.40	0.00
351	600368	五洲交通	1,100	3,806.00	0.00
352	600903	贵州燃气	400	3,680.00	0.00
353	600738	丽尚国潮	600	3,666.00	0.00
354	603982	泉峰汽车	200	3,368.00	0.00
355	601686	友发集团	300	3,348.00	0.00
356	603360	百傲化学	240	3,345.60	0.00
357	603871	嘉友国际	200	3,226.00	0.00
358	603808	歌力思	200	3,160.00	0.00
359	603600	永艺股份	300	3,084.00	0.00
360	605136	丽人丽妆	100	3,043.00	0.00
361	603327	福蓉科技	200	3,018.00	0.00
362	603283	赛腾股份	100	2,942.00	0.00
363	603421	鼎信通讯	380	2,872.80	0.00
364	603508	思维列控	140	2,745.40	0.00
365	601811	新华文轩	300	2,616.00	0.00
366	603681	永冠新材	100	2,520.00	0.00
367	600956	新天绿能	200	2,342.00	0.00
368	603598	引力传媒	200	2,094.00	0.00
369	603121	华培动力	200	2,064.00	0.00
370	605222	起帆电缆	100	2,038.00	0.00

371	605108	同庆楼	100	1,918.00	0.00
372	603956	威派格	100	1,830.00	0.00
373	603680	今创集团	160	1,784.00	0.00
374	603711	香飘飘	100	1,702.00	0.00
375	603687	大胜达	200	1,568.00	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 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	603345	安井食品	113,504.00	0.08
2	688019	安集科技	110,864.00	0.08
3	688008	澜起科技	103,313.05	0.07
4	688202	美迪西	101,972.00	0.07
5	601233	桐昆股份	90,956.00	0.06
6	603444	吉比特	89,451.00	0.06
7	600015	华夏银行	85,601.00	0.06
8	600426	华鲁恒升	83,507.00	0.06
9	688188	柏楚电子	76,689.25	0.05
10	603899	晨光文具	74,299.00	0.05
11	603486	科沃斯	72,033.00	0.05
12	603613	国联股份	71,248.00	0.05
13	603882	金域医学	70,534.00	0.05
14	688036	传音控股	69,344.00	0.05
15	600219	南山铝业	68,757.00	0.05
16	603489	八方股份	66,942.00	0.05
17	600885	宏发股份	66,730.00	0.05
18	600392	盛和资源	64,330.00	0.05
19	600486	扬农化工	64,061.00	0.05
20	603127	昭衍新药	63,552.00	0.04

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600426	华鲁恒升	382,387.00	0.27



2	603444	吉比特	349,703.00	0.25
3	603882	金域医学	334,671.00	0.24
4	600015	华夏银行	316,505.00	0.22
5	688008	澜起科技	300,426.63	0.21
6	601233	桐昆股份	297,244.00	0.21
7	600132	重庆啤酒	295,036.00	0.21
8	603486	科沃斯	271,007.50	0.19
9	601799	星宇股份	269,004.00	0.19
10	600079	人福医药	263,143.00	0.19
11	601966	玲珑轮胎	259,578.97	0.18
12	603806	福斯特	258,456.26	0.18
13	603899	晨光文具	254,747.00	0.18
14	600885	宏发股份	234,235.00	0.16
15	603345	安井食品	225,854.00	0.16
16	600219	南山铝业	220,530.36	0.16
17	603613	国联股份	213,326.00	0.15
18	688002	睿创微纳	210,948.60	0.15
19	603816	顾家家居	209,793.00	0.15
20	601838	成都银行	198,740.00	0.14

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	8,754,964.63
卖出股票收入（成交）总额	28,659,147.69

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	6,300,000.00	4.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	8,000.00	0.01
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	6,308,000.00	4.57

## 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	019640	20 国债 10	63,000	6,300,000.00	4.56
2	113051	节能转债	70	7,000.00	0.01
3	113626	伯特转债	10	1,000.00	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	南方上证 380ETF	股票型	交易型开放式	南方基金管理股份有限公司	127,076,466.33	92.06

## 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

### 7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

本基金管理人对股指期货及其他金融衍生品的运用将进行充分的论证，运用股指期货的情形主要包括：对冲系统性风险；对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票和目标 ETF 仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪对标的指数的目的。

基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

## 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 7.12.3 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除华夏银行（证券代码 600015）外其他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。

华夏银行 2020 年 9 月 4 日公告称，因内控制度执行不到位，严重违反审慎经营规则、生产系统存在重大风险隐患，严重违反审慎经营规则、账务管理工作存在重大错漏，长期未发现异常挂账情况，严重违反审慎经营规则等原因，中国银行保险监督管理委员会对公司罚款 110 万元。

华夏银行 2021 年 5 月 21 日公告称，因违规使用自营资金、理财资金购买本行转让的信贷资产、贷前审查及贷后管理不严等原因，中国银行保险监督管理委员会对公司罚款 9830 万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资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。

### 7.13.2 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	7,245.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	130,168.15
5	应收申购款	915,844.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	105.00
9	合计	1,053,363.25

### 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	600460	士兰微	90,160.00	0.07	重大事项停牌

## § 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
南方上证 380ETF 联接 A	12,681	5,380.40	584.31	0.00%	68,228,215.50	100.00%

南方上证 380ETF 联接 C	811	2,863.73	-	-	2,322,481.55	100.00%
合计	13,492	5,229.12	584.31	0.00%	70,550,697.05	100.00%

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

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方上证 380ETF 联接 A	12.97	0.0000%
	南方上证 380ETF 联接 C	5.30	0.0002%
	合计	18.27	0.0000%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	南方上证 380ETF 联接 A	0
	南方上证 380ETF 联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	南方上证 380ETF 联接 A	0~10
	南方上证 380ETF 联接 C	0~10
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方上证 380ETF 联接 A	南方上证 380ETF 联接 C
基金合同生效日(2011 年 9 月 20 日)基金份额总额	324,134,578.45	-
本报告期期初基金份额总额	78,211,868.15	2,184,399.99
本报告期基金总申购份额	16,034,043.98	5,251,995.86
减：报告期基金总赎回份额	26,017,112.32	5,113,914.30
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	68,228,799.81	2,322,481.55

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未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

因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长病逝缺位，根据相关法律法规和公司章程，公司董事会决定由公司总经理杨小松先生代为履行公司董事长职务。该决定自 2021 年 2 月 19 日起生效。

2021 年 5 月 19 日，公司副总经理常克川兼任首席信息官。

本基金本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、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	

海通证券	1	36,830,663.55	100.00%	3,683.86	100.00%	-
中金公司	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。

### 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
海通证券	245,676.40	100.00%	93,600,000.00	100.00%	-	-	133,229,054.33	100.00%
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	2021-02-23
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资	中国证券报、基金管	2021-03-02

	关联方承销证券的公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	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	2021-03-16
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分指数基金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	2021-03-30
5	南方基金管理股份有限公司关于中信建投期货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	2021-04-02
6	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	2021-04-08
7	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	2021-04-13
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	2021-05-21
9	南方基金管理股份有限公司关于北京加和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	2021-06-08
10	南方基金管理股份有限公司关于大河财富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	2021-06-18

## § 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上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件；
- 2、《南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 3、《南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2021 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>