

南方上证 380 交易型开放式指数证券 投资基金联接基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
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.....	8
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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	12
§5 托管人报告.....	12
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）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	55
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.....	55
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.....	55
7.10 本报告期投资基金情况.....	55
7.11 本基金投资股指期货的投资政策.....	55

7.12	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.13	投资组合报告附注.....	56
§8	基金份额持有人信息.....	57
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
§9	开放式基金份额变动.....	58
§10	重大事件揭示.....	58
10.1	基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4	基金投资策略的改变.....	58
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	59
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8	其他重大事件.....	60
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	60
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.....	60
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12	备查文件目录.....	60
12.1	备查文件目录.....	60
12.2	存放地点.....	61
12.3	查阅方式.....	61

§ 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	82,968,784.58 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	70,372,173.67 份	12,596,610.91 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	周易	田国立

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	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(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,790,944.73
本期利润	-10,697,423.73
加权平均基金份额本期利润	-0.1568
本期加权平均净值利润率	-8.19%
本期基金份额净值增长率	-8.16%
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	55,401,118.18
期末可供分配基金份额利润	0.7872
期末基金资产净值	140,270,436.98
期末基金份额净值	1.9933
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	99.33%

2、南方上证 380ETF 联接 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	141,498.36
本期利润	-2,815,676.67
加权平均基金份额本期利润	-0.1763
本期加权平均净值利润率	-9.35%
本期基金份额净值增长率	-8.35%
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	9,628,859.71
期末可供分配基金份额利润	0.7644
期末基金资产净值	24,821,991.90
期末基金份额净值	1.9705

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	51.08%

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 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	7.13%	1.00%	6.37%	1.01%	0.76%	-0.01%
过去三个月	4.92%	1.60%	3.88%	1.59%	1.04%	0.01%
过去六个月	-8.16%	1.51%	-8.96%	1.51%	0.80%	0.00%
过去一年	1.85%	1.24%	-1.33%	1.23%	3.18%	0.01%
过去三年	51.12%	1.19%	31.07%	1.18%	20.05%	0.01%
自基金合同生效起至今	99.33%	1.52%	66.47%	1.52%	32.86%	0.00%

南方上证 380ETF 联接 C

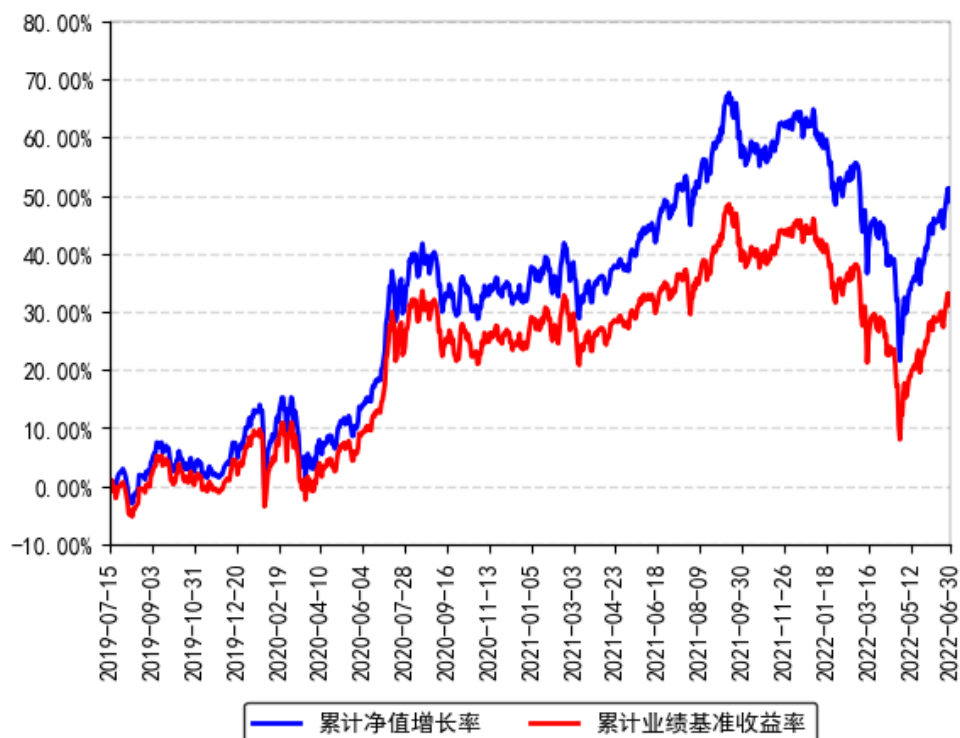
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.09%	1.00%	6.37%	1.01%	0.72%	-0.01%
过去三个月	4.81%	1.60%	3.88%	1.59%	0.93%	0.01%
过去六个月	-8.35%	1.51%	-8.96%	1.51%	0.61%	0.00%
过去一年	1.45%	1.24%	-1.33%	1.23%	2.78%	0.01%
自基金合同生效起至今	51.08%	1.19%	32.95%	1.18%	18.13%	0.01%

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：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)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		
孙伟	本基金基金经理	2019 年 7 月 12 日	-	12 年	北京大学工商管理硕士，特许金融分析师（CFA）、注册会计师（CPA），具有基金从业资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010 年 2 月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员、基金经理助理；2015 年 5 月 22 日至 2016 年 7 月 29 日，任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 7 月 2 日至 2020 年 12 月 1 日，任改革基金、高铁基金基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 7 日，任南方中证 500 工业 ETF 基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 14 日，任南方中证 500 原材料 ETF 基金经理；2020 年 12 月 1 日至 2021 年

				4月19日，任改革基金基金经理；2015年7月10日至今，任500信息基金经理；2016年5月13日至今，任南方创业板ETF基金经理；2016年5月20日至今，任南方创业板ETF联接基金经理；2016年8月17日至今，任500信息联接基金经理；2016年8月19日至今，任深成ETF、南方深成基金经理；2017年3月8日至今，任南方全指证券ETF联接基金经理；2017年3月10日至今，任南方中证全指证券ETF基金经理；2017年6月28日至今，任南方中证银行ETF基金经理；2017年6月29日至今，任南方银行联接基金经理；2018年2月8日至今，任H股ETF基金经理；2018年2月12日至今，任南方H股联接基金经理；2019年7月12日至今，任南方上证380ETF、南方上证380ETF联接基金经理；2020年12月1日至今，任高铁基金基金经理；2022年3月3日至今，任南方上海金ETF基金经理。
--	--	--	--	--

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》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

本报告期内上证 380 指数下跌 9.48%。

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) 本基金申购赎回目标 ETF 所带来的成份股权重偏离，对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行应对；

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

(4) 根据指数成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内；

(5) 新股上市初期涨幅较大的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.9933 元，报告期内，份额净值增长率为-8.16%，同期业绩基准增长率为-8.96%；本基金 C 份额净值为 1.9705 元，报告期内，份额净值增长率为-8.35%，同期业绩基准增长率为-8.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年疫情反复导致企业经营状况恶化，市场大跌。当前 A 股估值处于合理区间，产业政策、防疫政策和货币政策的转向预期推动股市触底反弹。展望下半年，经济增长恢复，流动性和信用回升，上市公司盈利改善，市场有望走强。风格方面，稳增长效果渐进性落地，

利率上行空间有限，在反弹行情中，小盘和成长相对占优，但随着成长反弹进入后周期，预计成长和价值风格将更加趋于平衡。

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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：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	8,099,693.39	2,445,310.83
结算备付金		14,449.55	96,405.75
存出保证金		18,067.55	4,776.57
交易性金融资产	6.4.3.2	158,653,071.13	149,334,261.38
其中：股票投资		3,056,011.13	6,268,534.43
基金投资		154,282,469.73	136,061,626.95
债券投资		1,314,590.27	7,004,100.00
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		-	6,253,022.15
应收股利		-	-
应收申购款		264,537.13	175,349.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	105.00	115,468.10
资产总计		167,049,923.75	158,424,594.22
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		770,071.16	-
应付清算款		248.36	438.06
应付赎回款		1,086,723.34	12,843,766.72
应付管理人报酬		4,004.80	6,764.91
应付托管费		800.95	1,352.97
应付销售服务费		8,530.65	2,985.37
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	87,115.61	157,660.74
负债合计		1,957,494.87	13,012,968.77
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	82,968,784.58	67,035,195.50
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	82,123,644.30	78,376,429.95
净资产合计		165,092,428.88	145,411,625.45
负债和净资产总计		167,049,923.75	158,424,594.22

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，南方上证 380ETF 联接 A 份额净值 1.9933 元，基金份额总额 70,372,173.67 份；南方上证 380ETF 联接 C 份额净值 1.9705 元，基金份额总额 12,596,610.91 份；总份额合计 82,968,784.58 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：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		-13,302,423.82	14,134,800.65
1.利息收入		11,223.60	71,374.30
其中：存款利息收入	6.4.3.9	11,223.60	3,184.56
债券利息收入		-	68,189.74
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）		2,102,557.56	14,263,487.16
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-836,814.68	1,385,826.61
基金投资收益	6.4.3.11	2,865,143.41	12,778,893.01
债券投资收益	6.4.3.12	42,997.89	2,046.50
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	31,230.94	96,721.04
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	-15,445,543.49	-240,613.26
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	29,338.51	40,552.45
减：二、营业总支出		210,676.58	225,489.86
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	36,919.57	37,782.65
2.托管费	6.4.6.2.2	7,383.91	7,556.56
3.销售服务费	6.4.6.2.3	57,691.76	7,024.27
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		23,084.75	47,892.00
其中：卖出回购金融资产支出		23,084.75	47,892.00

6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		-	0.01
8.其他费用	6.4.3.19	85,596.59	125,234.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,513,100.40	13,909,310.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,513,100.40	13,909,310.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-13,513,100.40	13,909,310.79

6.3 净资产（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：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）	67,035,195.50	-	78,376,429.95	145,411,625.45
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）	67,035,195.50	-	78,376,429.95	145,411,625.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	15,933,589.08	-	3,747,214.35	19,680,803.43
（一）、综合收益总额	-	-	-13,513,100.40	-13,513,100.40
（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）	15,933,589.08	-	17,260,314.75	33,193,903.83
其中：1.基金申购款	50,556,978.29	-	47,913,732.56	98,470,710.85
2.基金赎回款	-34,623,389.21	-	-30,653,417.81	-65,276,807.02
（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）	82,968,784.58	-	82,123,644.30	165,092,428.88
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）	80,396,268.14	-	61,626,634.56	142,022,902.70
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）	80,396,268.14	-	61,626,634.56	142,022,902.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,844,986.78	-	5,862,819.07	-3,982,167.71
（一）、综合收益总额	-	-	13,909,310.79	13,909,310.79
（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）	-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
（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)	70,551,281.36	-	67,489,453.63	138,040,734.99
-----------------	---------------	---	---------------	----------------

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。

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。

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、应收申购款和其他资产-其他应收款，金额分别为 2,445,310.83 元、96,405.75 元、4,776.57 元、115,363.10 元、6,253,022.15 元、175,349.44 元和 105.00 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、应收申购款和其他资产-其他应收款，金额分别为 2,445,662.59 元、96,453.49 元、4,778.88 元、0.00 元、6,253,022.15 元、175,349.44 元和 105.00 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 149,334,261.38 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 149,449,222.67 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、应付证券清算款、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 0.00 元、438.06 元、12,843,766.72 元、6,764.91 元、1,352.97 元、2,985.37 元、1,966.85 元、-2,102.75 元和 2,796.64 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、应付清算款、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-2,102.75 元、438.06 元、12,843,766.72 元、6,764.91 元、1,352.97 元、2,985.37 元、1,966.85 元、0.00 元和 2,796.64 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	8,099,693.39
等于：本金	8,098,944.17
加：应计利息	749.22
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	8,099,693.39

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	3,054,667.70	-	3,056,011.13	1,343.43	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,302,880.00	12,640.27	1,314,590.27	-930.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,302,880.00	12,640.27	1,314,590.27	-930.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	139,979,153.	-	154,282,469.	14,303,316.0	
	72	-	73	1	
其他	-	-	-	-	
合计	144,336,701.42	12,640.27	158,653,071.13	14,303,729.44	

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	-
可收退补款	105.00
合计	105.00

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	1,577.11
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,235.94
其中：交易所市场	1,235.94
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	-
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	-
可退替代款	-
其他	-
合计	87,115.61

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

南方上证 380ETF 联接 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	62,854,960.36	62,854,960.36
本期申购	18,612,317.98	18,612,317.98
本期赎回（以“-”号填列）	-11,095,104.67	-11,095,104.67
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	70,372,173.67	70,372,173.67

南方上证 380ETF 联接 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	4,180,235.14	4,180,235.14
本期申购	31,944,660.31	31,944,660.31
本期赎回（以“-”号填列）	-23,528,284.54	-23,528,284.54
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	12,596,610.91	12,596,610.91

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
本期期初	47,761,744.83	25,807,585.37	73,569,330.20
本期利润	1,790,944.73	-12,488,368.46	-10,697,423.73
本期基金份额交易产生的变动数	5,848,428.62	1,177,928.22	7,026,356.84
其中：基金申购款	14,491,223.59	2,689,572.45	17,180,796.04
基金赎回款	-8,642,794.97	-1,511,644.23	-10,154,439.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,401,118.18	14,497,145.13	69,898,263.31

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
本期期初	3,097,741.99	1,709,357.76	4,807,099.75
本期利润	141,498.36	-2,957,175.03	-2,815,676.67
本期基金份额交易产生的变动数	6,389,619.36	3,844,338.55	10,233,957.91
其中：基金申购款	24,207,270.88	6,525,665.64	30,732,936.52
基金赎回款	-17,817,651.52	-2,681,327.09	-20,498,978.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,628,859.71	2,596,521.28	12,225,380.99

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	9,469.31
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	1,575.03
其他	179.26
合计	11,223.60

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	-133,923.49
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-702,891.19
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-836,814.68

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	28,272,569.32
减：卖出股票成本总额	28,362,365.13
减：交易费用	44,127.68
买卖股票差价收入	-133,923.49

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	60,146,200.00
减：现金支付申购款总额	436,122.86
减：申购股票成本总额	60,412,968.33
减：交易费用	-
申购差价收入	-702,891.19

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	29,485,250.91
减：卖出/赎回基金成本总额	26,618,286.98
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	1,820.52
基金投资收益	2,865,143.41

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	54,143.87
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-11,145.98
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	42,997.89

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	7,198,859.70
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,044,800.00
减：应计利息总额	165,204.34
减：交易费用	1.34
买卖债券差价收入	-11,145.98

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	31,230.94
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	31,230.94

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	-15,445,543.49
——股票投资	-147,143.39
——债券投资	13,770.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-15,312,170.10
——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	-15,445,543.49

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	27,313.91
基金转换费收入	2,024.60
合计	29,338.51

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，其中，A 类份额将不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产，C 类份额将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 类份额将不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产，C 类份额将转出基金的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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,294.03
合计	85,596.59

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
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
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。

6.4.6 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

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。

6.4.6.1.2 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

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。

6.4.6.2 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	36,919.57	37,782.65
其中：支付销售机构的客户维护费	136,017.14	108,575.37

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	7,383.91	7,556.56

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。

6.4.6.2.3 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		
	南方上证 380ETF 联接 A	南方上证 380ETF 联接 C	合计
南方基金	-	1,118.50	1,118.50
合计	-	1,118.50	1,118.50
获得销售服务费的	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		

各关联方名称	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

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自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
中国建设银行	8,099,693.39	9,469.31	3,144,972.04	2,196.45

注：本基金由基金托管人中国建设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	113055	成银转债	配债	200	20,000.00

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

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 139,979,153.72 元，估值总额为人民币 154,282,469.73 元，占本基金基金资产净值的比例为 93.45%（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 106,446,140.84 元，估值总额为人民币 136,061,626.95 元，占本基金基金资产净值的比例为 93.57%）。

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**

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 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 770,071.16 元, 截至 2022 年 7 月 7 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。

6.4.8.4 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。

6.4.9.3 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外,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	8,099,693.39	-	-	-	8,099,693.39
结算备付金	14,449.55	-	-	-	14,449.55
存出保证金	18,067.55	-	-	-	18,067.55
交易性金融资产	1,314,590.27	-	-	157,338,480.86	158,653,071.13
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-

其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	44,306.87	-	-	220,230.26	264,537.13
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	105.00	105.00
资产总计	9,491,107.63	-	-	157,558,816.12	167,049,923.75
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	770,071.16	-	-	-	770,071.16
应付清算款	-	-	-	248.36	248.36
应付赎回款	-	-	-	1,086,723.34	1,086,723.34
应付管理人报酬	-	-	-	4,004.80	4,004.80
应付托管费	-	-	-	800.95	800.95
应付销售服务费	-	-	-	8,530.65	8,530.65
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	-	-	-	87,115.61	87,115.61
负债总计	770,071.16	-	-	1,187,423.71	1,957,494.87
利率敏感度缺口	8,721,036.47	-	-	156,371,392.41	165,092,428.88
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	2,445,310.83	-	-	-	2,445,310.83
结算备付金	96,405.75	-	-	-	96,405.75
存出保证金	4,776.57	-	-	-	4,776.57
交易性金融	7,002,100.00	-	2,000.00	142,330,161.	149,334,261.

资产				38	38
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	-	-	-	6,253,022.15	6,253,022.15
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	1,288.56	-	-	174,060.88	175,349.44
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	115,468.10	115,468.10
资产总计	9,549,881.71	-	2,000.00	148,872,712.51	158,424,594.22
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	-	-	-	438.06	438.06
应付赎回款	-	-	-	12,843,766.72	12,843,766.72
应付管理人报酬	-	-	-	6,764.91	6,764.91
应付托管费	-	-	-	1,352.97	1,352.97
应付销售服务费	-	-	-	2,985.37	2,985.37
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	-	-	-	157,660.74	157,660.74
负债总计	-	-	-	13,012,968.77	13,012,968.77

利率敏感度缺口	9,549,881.71	-	2,000.00	135,859,743.74	145,411,625.45
---------	--------------	---	----------	----------------	----------------

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	-1,740.42	-5,376.81
2.市场利率平行下降 25 个基点	1,747.02	5,394.46	

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，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	3,056,011.13	1.85	6,268,534.43	4.31
交易性金融资产-	154,282,469.73	93.45	136,061,626.95	93.57

基金投资				
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	157,338,480.86	95.30	142,330,161.38	97.88

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%	7,867,993.82	7,059,599.68
2.组合自身基准下降 5%	-7,867,993.82	-7,059,599.68	

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	157,338,480.86
第二层次	1,314,590.27
第三层次	0.00
合计	158,653,071.13

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	3,056,011.13	1.83
	其中:股票	3,056,011.13	1.83
2	基金投资	154,282,469.73	92.36
3	固定收益投资	1,314,590.27	0.79
	其中:债券	1,314,590.27	0.79
	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	8,114,142.94	4.86
8	其他资产	282,709.68	0.17
9	合计	167,049,923.75	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	-	-
B	采矿业	205,085.82	0.12
C	制造业	1,664,902.13	1.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	141,696.06	0.09
E	建筑业	83,977.59	0.05

F	批发和零售业	126,437.82	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	188,356.52	0.11
H	住宿和餐饮业	36,072.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	160,567.90	0.10
J	金融业	234,640.10	0.14
K	房地产业	87,057.40	0.05
L	租赁和商务服务业	20,722.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	36,197.20	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	37,581.79	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	21,209.60	0.01
S	综合	11,507.20	0.01
	合计	3,056,011.13	1.85

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	601229	上海银行	8,200	53,710.00	0.03
2	600256	广汇能源	3,800	40,052.00	0.02
3	688116	天奈科技	200	33,896.00	0.02
4	601138	工业富联	3,300	32,472.00	0.02
5	601006	大秦铁路	4,900	32,291.00	0.02
6	601838	成都银行	1,800	29,844.00	0.02
7	600795	国电电力	7,400	28,934.00	0.02
8	600885	宏发股份	672	28,123.20	0.02
9	600486	扬农化工	200	26,656.00	0.02
10	600015	华夏银行	5,100	26,571.00	0.02
11	600392	盛和资源	1,150	25,990.00	0.02
12	600754	锦江酒店	400	25,160.00	0.02
13	600765	中航重机	760	24,456.80	0.01
14	603613	国联股份	271	24,010.60	0.01
15	603816	顾家家居	416	23,558.08	0.01
16	600487	亨通光电	1,600	23,264.00	0.01
17	605358	立昂微	344	23,178.72	0.01
18	603605	珀莱雅	140	23,125.20	0.01

19	603606	东方电缆	300	22,980.00	0.01
20	601058	赛轮轮胎	2,024	22,810.48	0.01
21	688008	澜起科技	375	22,717.50	0.01
22	600499	科达制造	1,100	22,704.00	0.01
23	600233	圆通速递	1,100	22,429.00	0.01
24	688777	中控技术	300	21,828.00	0.01
25	603077	和邦生物	5,120	21,811.20	0.01
26	600845	宝信软件	392	21,403.20	0.01
27	603456	九洲药业	400	20,680.00	0.01
28	600563	法拉电子	100	20,516.00	0.01
29	688099	晶晨股份	200	20,200.00	0.01
30	603127	昭衍新药	176	20,028.80	0.01
31	688122	西部超导	217	20,007.40	0.01
32	601677	明泰铝业	800	19,040.00	0.01
33	600332	白云山	600	18,954.00	0.01
34	601168	西部矿业	1,600	18,928.00	0.01
35	603005	晶方科技	640	18,169.60	0.01
36	600674	川投能源	1,500	17,880.00	0.01
37	605111	新洁能	140	17,613.40	0.01
38	601128	常熟银行	2,300	17,572.00	0.01
39	600988	赤峰黄金	1,100	17,545.00	0.01
40	603236	移远通信	130	17,375.80	0.01
41	600559	老白干酒	602	17,271.38	0.01
42	601799	星宇股份	100	17,100.00	0.01
43	688388	嘉元科技	200	16,974.00	0.01
44	600039	四川路桥	1,600	16,848.00	0.01
45	603899	晨光股份	300	16,824.00	0.01
46	600596	新安股份	748	16,194.20	0.01
47	603737	三棵树	125	16,178.75	0.01
48	688556	高测股份	200	16,140.00	0.01
49	603596	伯特利	200	16,036.00	0.01
50	600018	上港集团	2,700	15,741.00	0.01
51	600153	建发股份	1,200	15,684.00	0.01
52	601898	中煤能源	1,500	15,570.00	0.01
53	601872	招商轮船	2,700	15,552.00	0.01
54	600348	华阳股份	1,000	15,460.00	0.01
55	600177	雅戈尔	2,300	15,249.00	0.01
56	600705	中航产融	4,400	15,224.00	0.01
57	600549	厦门钨业	700	15,134.00	0.01
58	603939	益丰药房	284	15,003.72	0.01
59	600711	盛屯矿业	1,900	14,744.00	0.01
60	601699	潞安环能	1,000	14,620.00	0.01
61	600536	中国软件	360	14,612.40	0.01

62	600160	巨化股份	1,100	14,465.00	0.01
63	601717	郑煤机	1,000	14,410.00	0.01
64	600110	诺德股份	1,200	13,944.00	0.01
65	601997	贵阳银行	2,400	13,944.00	0.01
66	600803	新奥股份	750	13,942.50	0.01
67	603713	密尔克卫	100	13,670.00	0.01
68	601216	君正集团	2,800	13,664.00	0.01
69	601577	长沙银行	1,700	13,481.00	0.01
70	603267	鸿远电子	100	13,433.00	0.01
71	600704	物产中大	2,600	13,338.00	0.01
72	600170	上海建工	4,400	13,332.00	0.01
73	600338	西藏珠峰	460	13,202.00	0.01
74	603198	迎驾贡酒	200	13,028.00	0.01
75	600415	小商品城	2,300	12,811.00	0.01
76	600079	人福医药	800	12,800.00	0.01
77	600171	上海贝岭	500	12,515.00	0.01
78	601666	平煤股份	918	12,475.62	0.01
79	600026	中远海能	1,200	12,396.00	0.01
80	600655	豫园股份	1,300	12,272.00	0.01
81	600316	洪都航空	400	12,096.00	0.01
82	600380	健康元	971	11,991.85	0.01
83	600236	桂冠电力	1,960	11,936.40	0.01
84	601998	中信银行	2,500	11,875.00	0.01
85	600801	华新水泥	600	11,706.00	0.01
86	600879	航天电子	1,800	11,682.00	0.01
87	600985	淮北矿业	800	11,648.00	0.01
88	600372	中航电子	600	11,634.00	0.01
89	601198	东兴证券	1,300	11,570.00	0.01
90	600673	东阳光	1,280	11,507.20	0.01
91	603129	春风动力	100	11,372.00	0.01
92	600580	卧龙电驱	788	11,362.96	0.01
93	600529	山东药玻	400	11,180.00	0.01
94	600820	隧道股份	1,800	11,016.00	0.01
95	600258	首旅酒店	440	10,912.00	0.01
96	603233	大参林	347	10,861.10	0.01
97	600848	上海临港	800	10,848.00	0.01
98	600369	西南证券	2,700	10,719.00	0.01
99	600027	华电国际	2,700	10,611.00	0.01
100	600325	华发股份	1,400	10,598.00	0.01
101	600008	首创环保	3,600	10,440.00	0.01
102	603568	伟明环保	311	10,378.07	0.01
103	603218	日月股份	400	10,160.00	0.01
104	601222	林洋能源	1,200	10,020.00	0.01

105	601866	中远海发	3,300	9,900.00	0.01
106	603858	步长制药	500	9,855.00	0.01
107	601992	金隅集团	3,500	9,695.00	0.01
108	600206	有研新材	500	9,670.00	0.01
109	600062	华润双鹤	376	9,648.16	0.01
110	601908	京运通	1,200	9,624.00	0.01
111	603599	广信股份	340	9,571.00	0.01
112	600998	九州通	800	9,528.00	0.01
113	600056	中国医药	640	9,484.80	0.01
114	603712	七一二	300	9,450.00	0.01
115	600328	中盐化工	400	9,420.00	0.01
116	603678	火炬电子	200	9,362.00	0.01
117	600021	上海电力	900	9,225.00	0.01
118	603893	瑞芯微	100	9,094.00	0.01
119	600667	太极实业	1,200	8,856.00	0.01
120	603707	健友股份	312	8,798.40	0.01
121	600970	中材国际	900	8,721.00	0.01
122	600273	嘉化能源	800	8,688.00	0.01
123	600498	烽火通信	600	8,688.00	0.01
124	600641	万业企业	440	8,580.00	0.01
125	600483	福能股份	600	8,442.00	0.01
126	600755	厦门国贸	1,100	8,250.00	0.00
127	600323	瀚蓝环境	400	8,200.00	0.00
128	600409	三友化工	1,000	8,190.00	0.00
129	600216	浙江医药	600	8,190.00	0.00
130	600282	南钢股份	2,600	8,190.00	0.00
131	600566	济川药业	300	8,148.00	0.00
132	603588	高能环境	704	8,117.12	0.00
133	600782	新钢股份	1,600	8,064.00	0.00
134	603690	至纯科技	200	8,060.00	0.00
135	601567	三星医疗	600	7,968.00	0.00
136	688002	睿创微纳	200	7,944.00	0.00
137	603885	吉祥航空	440	7,915.60	0.00
138	600057	厦门象屿	900	7,911.00	0.00
139	603225	新凤鸣	676	7,801.04	0.00
140	601018	宁波港	2,000	7,800.00	0.00
141	603027	千禾味业	449	7,767.70	0.00
142	600728	佳都科技	1,200	7,752.00	0.00
143	600378	昊华科技	200	7,704.00	0.00
144	600064	南京高科	700	7,700.00	0.00
145	600663	陆家嘴	740	7,666.40	0.00
146	600808	马钢股份	2,000	7,580.00	0.00
147	600597	光明乳业	600	7,578.00	0.00

148	600567	山鹰国际	2,700	7,479.00	0.00
149	688317	之江生物	200	7,478.00	0.00
150	600583	海油工程	1,800	7,470.00	0.00
151	600895	张江高科	600	7,470.00	0.00
152	603927	中科软	320	7,462.40	0.00
153	603279	景津装备	240	7,442.40	0.00
154	603906	龙蟠科技	200	7,388.00	0.00
155	603008	喜临门	200	7,340.00	0.00
156	688166	博瑞医药	300	7,245.00	0.00
157	600577	精达股份	1,300	7,215.00	0.00
158	601231	环旭电子	500	7,180.00	0.00
159	600502	安徽建工	992	7,142.40	0.00
160	603565	中谷物流	444	7,046.28	0.00
161	600916	中国黄金	600	7,020.00	0.00
162	601952	苏垦农发	500	6,995.00	0.00
163	601808	中海油服	500	6,975.00	0.00
164	600507	方大特钢	990	6,920.10	0.00
165	603666	亿嘉和	100	6,860.00	0.00
166	600295	鄂尔多斯	380	6,859.00	0.00
167	603919	金徽酒	200	6,798.00	0.00
168	603338	浙江鼎力	134	6,793.80	0.00
169	600363	联创光电	300	6,738.00	0.00
170	600582	天地科技	1,398	6,682.44	0.00
171	601311	骆驼股份	600	6,678.00	0.00
172	603128	华贸物流	660	6,619.80	0.00
173	688208	道通科技	200	6,584.00	0.00
174	603866	桃李面包	392	6,487.60	0.00
175	601000	唐山港	2,498	6,444.84	0.00
176	600210	紫江企业	1,000	6,390.00	0.00
177	600967	内蒙一机	700	6,384.00	0.00
178	688088	虹软科技	200	6,318.00	0.00
179	603738	泰晶科技	200	6,282.00	0.00
180	600720	祁连山	500	6,200.00	0.00
181	600850	电科数字	330	6,157.80	0.00
182	600740	山西焦化	1,050	6,111.00	0.00
183	600586	金晶科技	800	6,040.00	0.00
184	600435	北方导航	700	6,034.00	0.00
185	600116	三峡水利	600	6,024.00	0.00
186	600197	伊力特	200	6,020.00	0.00
187	688289	圣湘生物	203	6,010.83	0.00
188	600373	中文传媒	600	5,994.00	0.00
189	600811	东方集团	2,100	5,943.00	0.00
190	600562	国睿科技	400	5,940.00	0.00

191	601611	中国核建	700	5,873.00	0.00
192	605376	博迁新材	100	5,830.00	0.00
193	600556	天下秀	700	5,761.00	0.00
194	600688	上海石化	1,800	5,724.00	0.00
195	603317	天味食品	200	5,694.00	0.00
196	600167	联美控股	760	5,692.40	0.00
197	601200	上海环境	560	5,689.60	0.00
198	600185	格力地产	900	5,679.00	0.00
199	601098	中南传媒	600	5,664.00	0.00
200	600120	浙江东方	1,410	5,654.10	0.00
201	603520	司太立	200	5,624.00	0.00
202	603916	苏博特	220	5,607.80	0.00
203	600477	杭萧钢构	1,178	5,607.28	0.00
204	603000	人民网	500	5,600.00	0.00
205	603018	华设集团	580	5,539.00	0.00
206	603305	旭升股份	180	5,439.60	0.00
207	600966	博汇纸业	700	5,418.00	0.00
208	600376	首开股份	1,100	5,401.00	0.00
209	603801	志邦家居	200	5,396.00	0.00
210	600095	湘财股份	700	5,383.00	0.00
211	600131	国网信通	400	5,380.00	0.00
212	601187	厦门银行	900	5,364.00	0.00
213	603348	文灿股份	100	5,360.00	0.00
214	603733	仙鹤股份	200	5,320.00	0.00
215	600329	达仁堂	215	5,284.70	0.00
216	603529	爱玛科技	100	5,238.00	0.00
217	600452	涪陵电力	448	5,201.28	0.00
218	688526	科前生物	200	5,198.00	0.00
219	600446	金证股份	500	5,190.00	0.00
220	688139	海尔生物	71	5,170.93	0.00
221	600750	江中药业	360	5,155.20	0.00
222	600075	新疆天业	800	5,112.00	0.00
223	600764	中国海防	200	5,048.00	0.00
224	601598	中国外运	1,300	5,044.00	0.00
225	601825	沪农商行	800	5,016.00	0.00
226	603298	杭叉集团	325	5,014.75	0.00
227	600285	羚锐制药	400	5,012.00	0.00
228	603228	景旺电子	212	4,945.96	0.00
229	603638	艾迪精密	240	4,920.00	0.00
230	603197	保隆科技	100	4,919.00	0.00
231	600933	爱柯迪	300	4,914.00	0.00
232	603505	金石资源	120	4,909.20	0.00
233	600248	陕西建工	900	4,887.00	0.00

234	601965	中国汽研	300	4,863.00	0.00
235	600422	昆药集团	400	4,860.00	0.00
236	600459	贵研铂业	266	4,817.26	0.00
237	600094	大名城	1,300	4,771.00	0.00
238	600643	爱建集团	800	4,744.00	0.00
239	600993	马应龙	200	4,660.00	0.00
240	600776	东方通信	400	4,500.00	0.00
241	603113	金能科技	400	4,424.00	0.00
242	603583	捷昌驱动	132	4,407.48	0.00
243	603883	老百姓	130	4,404.40	0.00
244	603985	恒润股份	156	4,389.84	0.00
245	600968	海油发展	1,700	4,386.00	0.00
246	600395	盘江股份	500	4,385.00	0.00
247	603025	大豪科技	200	4,368.00	0.00
248	600729	重庆百货	200	4,314.00	0.00
249	600125	铁龙物流	800	4,272.00	0.00
250	603301	振德医疗	100	4,205.00	0.00
251	600223	鲁商发展	400	4,192.00	0.00
252	600612	老凤祥	100	4,178.00	0.00
253	600211	西藏药业	100	4,151.00	0.00
254	600284	浦东建设	559	4,142.19	0.00
255	603416	信捷电气	100	4,114.00	0.00
256	601015	陕西黑猫	700	4,095.00	0.00
257	600984	建设机械	630	4,082.40	0.00
258	600648	外高桥	300	4,080.00	0.00
259	600639	浦东金桥	300	4,077.00	0.00
260	603056	德邦股份	300	4,029.00	0.00
261	603068	博通集成	100	3,997.00	0.00
262	600073	上海梅林	500	3,985.00	0.00
263	600787	中储股份	700	3,983.00	0.00
264	600742	一汽富维	428	3,971.84	0.00
265	605009	豪悦护理	100	3,888.00	0.00
266	605337	李子园	140	3,875.20	0.00
267	601686	友发集团	500	3,820.00	0.00
268	603229	奥翔药业	100	3,806.00	0.00
269	603010	万盛股份	200	3,730.00	0.00
270	600531	豫光金铅	700	3,689.00	0.00
271	603187	海容冷链	100	3,655.00	0.00
272	603429	集友股份	280	3,600.80	0.00
273	603393	新天然气	168	3,588.48	0.00
274	603043	广州酒家	140	3,530.80	0.00
275	600746	江苏索普	300	3,474.00	0.00
276	603060	国检集团	288	3,470.40	0.00

277	600377	宁沪高速	400	3,428.00	0.00
278	603387	基蛋生物	240	3,422.40	0.00
279	603728	鸣志电器	160	3,396.80	0.00
280	601298	青 岛 港	600	3,282.00	0.00
281	603650	彤程新材	100	3,258.00	0.00
282	601019	山东出版	500	3,245.00	0.00
283	600846	同济科技	400	3,160.00	0.00
284	601139	深圳燃气	450	3,123.00	0.00
285	603180	金牌厨柜	100	3,096.00	0.00
286	601869	长飞光纤	100	3,092.00	0.00
287	603355	莱克电气	120	3,027.60	0.00
288	600337	美克家居	980	2,998.80	0.00
289	603686	福 龙 马	300	2,976.00	0.00
290	603118	共进股份	400	2,968.00	0.00
291	603108	润达医疗	300	2,955.00	0.00
292	600007	中国国贸	200	2,950.00	0.00
293	603915	国茂股份	140	2,938.60	0.00
294	603601	再升科技	460	2,925.60	0.00
295	603609	禾丰股份	300	2,889.00	0.00
296	600955	维远股份	100	2,884.00	0.00
297	600299	安 迪 苏	300	2,874.00	0.00
298	603708	家 家 悦	200	2,848.00	0.00
299	601827	三峰环境	400	2,848.00	0.00
300	603989	艾华集团	100	2,820.00	0.00
301	601069	西部黄金	200	2,716.00	0.00
302	603881	数 据 港	100	2,685.00	0.00
303	600823	世茂股份	900	2,682.00	0.00
304	601158	重庆水务	500	2,675.00	0.00
305	600510	黑 牡 丹	300	2,649.00	0.00
306	601702	华峰铝业	200	2,640.00	0.00
307	600350	山东高速	500	2,625.00	0.00
308	603920	世运电路	150	2,595.00	0.00
309	603888	新 华 网	150	2,572.50	0.00
310	603681	永冠新材	100	2,458.00	0.00
311	603982	泉峰汽车	100	2,439.00	0.00
312	601949	中国出版	500	2,410.00	0.00
313	601330	绿色动力	300	2,349.00	0.00
314	603357	设计总院	200	2,296.00	0.00
315	605222	起帆电缆	100	2,277.00	0.00
316	603626	科森科技	300	2,229.00	0.00
317	603283	赛腾股份	100	2,135.00	0.00
318	603730	岱美股份	160	2,097.60	0.00
319	603508	思维列控	156	2,088.84	0.00

320	601882	海天精工	100	2,061.00	0.00
321	605090	九丰能源	100	2,027.00	0.00
322	603258	电魂网络	100	2,025.00	0.00
323	603877	太平鸟	100	2,024.00	0.00
324	600927	永安期货	100	2,017.00	0.00
325	601156	东航物流	100	1,980.00	0.00
326	603556	海兴电力	130	1,978.60	0.00
327	601665	齐鲁银行	400	1,952.00	0.00
328	603313	梦百合	160	1,920.00	0.00
329	600548	深高速	200	1,908.00	0.00
330	603071	物产环能	100	1,814.00	0.00
331	601512	中新集团	200	1,794.00	0.00
332	603327	福蓉科技	130	1,787.50	0.00
333	605199	葫芦娃	100	1,765.00	0.00
334	603378	亚士创能	151	1,760.66	0.00
335	603515	欧普照明	100	1,745.00	0.00
336	603466	风语筑	90	1,731.60	0.00
337	603610	麒盛科技	128	1,729.28	0.00
338	601003	柳钢股份	400	1,620.00	0.00
339	603533	掌阅科技	100	1,610.00	0.00
340	600802	福建水泥	240	1,586.40	0.00
341	603587	地素时尚	100	1,585.00	0.00
342	605136	丽人丽妆	100	1,582.00	0.00
343	603230	内蒙新华	100	1,251.00	0.00
344	600956	新天绿能	100	1,232.00	0.00
345	603956	威派格	100	1,085.00	0.00
346	688055	龙腾光电	200	1,078.00	0.00
347	601811	新华文轩	100	914.00	0.00
348	600917	重庆燃气	100	722.00	0.00
349	688006	杭可科技	7	490.42	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	601006	大秦铁路	598,806.00	0.41
2	601615	明阳智能	546,678.00	0.38
3	601233	桐昆股份	532,688.00	0.37
4	600015	华夏银行	513,819.00	0.35
5	688008	澜起科技	493,097.37	0.34
6	600219	南山铝业	487,294.00	0.34

7	688005	容百科技	476,578.19	0.33
8	688036	传音控股	476,247.71	0.33
9	600885	宏发股份	466,059.00	0.32
10	601117	中国化学	464,661.00	0.32
11	601838	成都银行	456,475.00	0.31
12	688099	晶晨股份	452,774.59	0.31
13	605358	立昂微	449,219.00	0.31
14	600256	广汇能源	443,190.00	0.30
15	600563	法拉电子	433,913.00	0.30
16	603026	石大胜华	427,285.00	0.29
17	603613	国联股份	412,300.00	0.28
18	600141	兴发集团	400,856.00	0.28
19	601168	西部矿业	393,137.00	0.27
20	601636	旗滨集团	392,301.00	0.27

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601006	大秦铁路	296,133.00	0.20
2	600256	广汇能源	294,047.00	0.20
3	688598	金博股份	250,598.24	0.17
4	600015	华夏银行	246,440.00	0.17
5	600188	兖矿能源	243,642.00	0.17
6	601615	明阳智能	241,134.00	0.17
7	601838	成都银行	240,235.00	0.17
8	688008	澜起科技	234,900.28	0.16
9	600563	法拉电子	229,784.00	0.16
10	688298	东方生物	212,370.68	0.15
11	688005	容百科技	212,358.62	0.15
12	601117	中国化学	210,383.00	0.14
13	603444	吉比特	210,091.00	0.14
14	601233	桐昆股份	207,976.00	0.14
15	603613	国联股份	206,885.00	0.14
16	600141	兴发集团	201,843.45	0.14
17	600219	南山铝业	201,561.00	0.14
18	688099	晶晨股份	201,264.89	0.14
19	600765	中航重机	194,980.00	0.13
20	600885	宏发股份	194,478.00	0.13

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	56,220,779.55
卖出股票收入（成交）总额	28,272,569.32

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,314,590.27	0.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,314,590.27	0.80

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	13,000	1,314,590.27	0.80

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	154,282,46 9.73	93.45

7.11 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 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中,上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。除上述证券的发行主体外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

对上述证券的投资决策程序的说明:本基金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	18,067.55
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	264,537.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	105.00
9	合计	282,709.68

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

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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	15,004	4,690.23	584.31	0.00%	70,371,589.36	100.00%
南方上证 380ETF 联接 C	2,867	4,393.66	-	-	12,596,610.91	100.00%
合计	17,871	4,642.65	584.31	0.00%	82,968,200.27	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	56,811.88	0.0807%
	南方上证 380ETF 联接 C	5.30	0.0000%
	合计	56,817.18	0.0685%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	南方上证 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	62,854,960.36	4,180,235.14
本报告期基金总申购份额	18,612,317.98	31,944,660.31
减：报告期基金总赎回份额	11,095,104.67	23,528,284.54
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	70,372,173.67	12,596,610.91

§ 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

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）。

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	
海通证券	1	84,404,466.95	100.00%	8,441.59	100.00%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
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。

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

海通证券	1,336,539.70	100.00%	57,270,000.00	100.00%	-	-	89,631,450.91	100.00%
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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
2	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可转换公司债券的关联交易公告	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	2022-03-05

§ 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 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>