

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

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 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。

本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 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。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	16
§5 托管人报告.....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告.....	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表.....	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	21
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告.....	59
8.1 期末基金资产组合情况.....	59
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	60
8.3 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.....	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	73
8.6 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.....	73

8.7	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.....	74
8.8	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.....	74
8.9	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.....	74
8.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	74
8.11	本报告期投资基金情况.....	74
8.12	投资组合报告附注.....	74
§9	基金份额持有人信息.....	75
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	75
9.2	期末上市基金前十名持有人.....	76
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	76
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	77
9.5	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	77
§10	开放式基金份额变动.....	77
§11	重大事件揭示.....	77
11.1	基金份额持有人大会决议.....	77
11.2	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.....	78
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	78
11.4	基金投资策略的改变.....	78
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	78
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	78
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	78
11.8	其他重大事件.....	80
§12	影响投资者决策的其他重要信息.....	83
12.1	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.....	83
12.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	83
§13	备查文件目录.....	83
13.1	备查文件目录.....	83
13.2	存放地点.....	84
13.3	查阅方式.....	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	
基金简称	南方中证 500ETF 联接 (LOF)	
场内简称	南方 500	
基金主代码	160119	
前端交易代码	160119	
后端交易代码	160120	
基金运作方式	上市型开放式(LOF)	
基金合同生效日	2009 年 9 月 25 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	5,611,709,723.31 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2009 年 11 月 11 日	
下属分级基金的基金简称	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C
下属分级基金的场内简称	南方 500	
下属分级基金的交易代码	160119	004348
下属分级基金的前端交易代码	160119	
下属分级基金的后端交易代码	160120	
报告期末下属分级基金的份额总额	5,192,344,063.66 份	419,365,659.65 份

2.1.1 目标基金基本情况

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

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度
------	-----------------------------------

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

2.2.1 目标基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95599
传真	0755-82763889	010-68121816
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518017	100031

法定代表人	周易	谷澍
-------	----	----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司 南方基金管理股份有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号\深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

1、南方中证 500ETF 联接（LOF）A

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	94,563,372.32	560,704,042.27	854,334,557.47
本期利润	-1,552,090,313.67	1,310,308,292.14	2,110,351,877.86
加权平均基金份额本期利润	-0.3142	0.2907	0.3606
本期加权平均净值利润率	-18.75%	16.29%	23.84%
本期基金份额净值增长率	-17.46%	16.49%	23.41%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	3,104,205,461.48	4,164,059,775.60	3,278,160,112.93
期末可供分配基金份额利润	0.5978	0.9359	0.6618
期末基金资产净值	8,296,549,525.14	8,613,169,006.79	8,231,324,590.39
期末基金份额净值	1.5978	1.9359	1.6618
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	74.33%	111.22%	81.31%

2、南方中证 500ETF 联接（LOF）C

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	4,627,830.15	44,803,045.44	144,512,145.60
本期利润	-119,757,715.39	88,112,491.49	440,381,724.80
加权平均基金份额本期利润	-0.3286	0.2780	0.4061
本期加权平均净值利润率	-19.97%	15.77%	27.60%
本期基金份额净值增长率	-17.79%	16.03%	22.92%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	238,411,396.78	247,485,615.23	343,664,233.05
期末可供分配基金份额利润	0.5685	0.9079	0.6444
期末基金资产净值	657,777,056.43	520,051,728.23	876,965,686.06
期末基金份额净值	1.5685	1.9080	1.6444
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	-0.30%	21.28%	4.53%

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

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方中证 500ETF 联接 (LOF) A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.77%	0.97%	2.52%	0.97%	0.25%	0.00%
过去六个月	-7.93%	1.04%	-8.66%	1.04%	0.73%	0.00%
过去一年	-17.46%	1.31%	-19.30%	1.31%	1.84%	0.00%
过去三年	18.65%	1.29%	11.15%	1.28%	7.50%	0.01%
过去五年	3.68%	1.34%	-5.25%	1.34%	8.93%	0.00%
自基金合同生效起至今	74.33%	1.54%	65.43%	1.54%	8.90%	0.00%

南方中证 500ETF 联接 (LOF) C

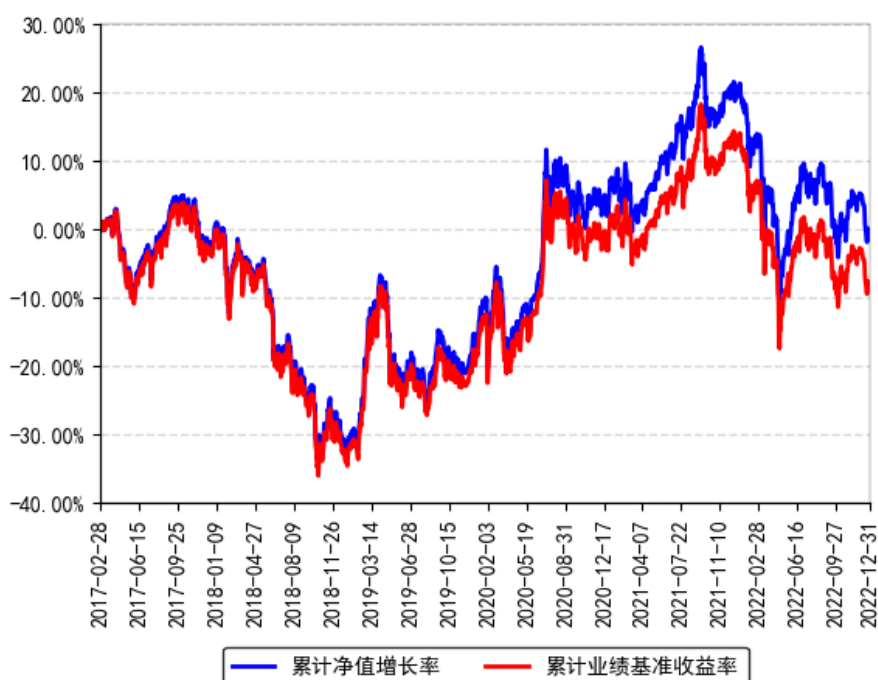
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.66%	0.97%	2.52%	0.97%	0.14%	0.00%
过去六个月	-8.11%	1.04%	-8.66%	1.04%	0.55%	0.00%
过去一年	-17.79%	1.31%	-19.30%	1.31%	1.51%	0.00%
过去三年	17.24%	1.29%	11.15%	1.28%	6.09%	0.01%
过去五年	1.63%	1.34%	-5.25%	1.34%	6.88%	0.00%
自基金合同生效起至今	-0.30%	1.28%	-7.99%	1.28%	7.69%	0.00%

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

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



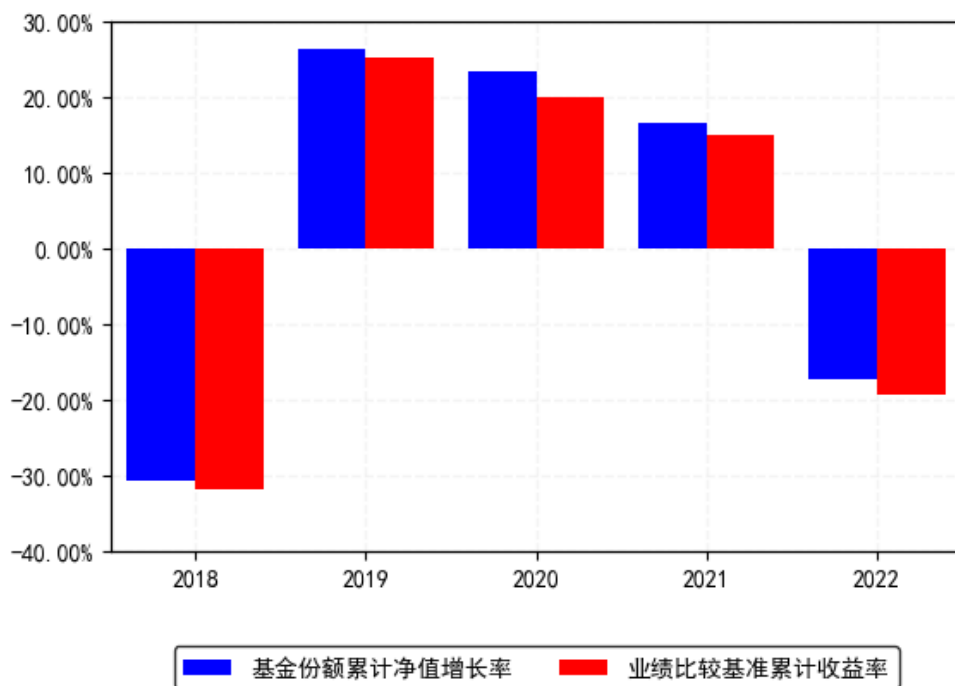
南方中证500ETF联接（LOF）C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



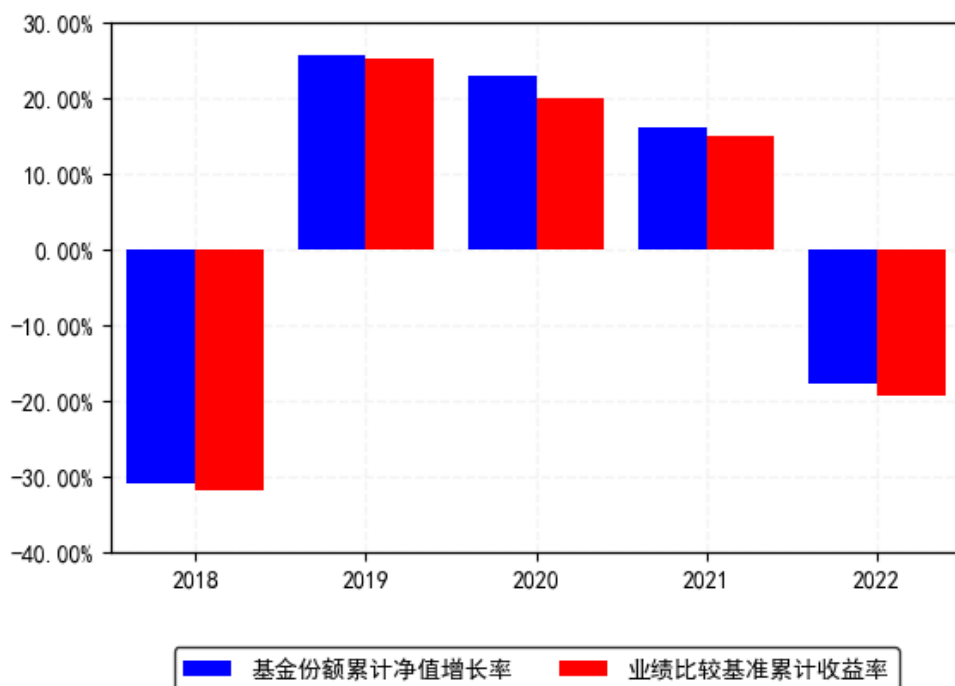
注：本基金从2017年2月23日起新增C类份额，C类份额自2017年2月28日起存续。

3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方中证500ETF联接（LOF）A每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



南方中证500ETF联接（LOF）C每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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 1.72 万亿元，旗下管理 317 只公募基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日	-	17 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月 17 日至 2015 年 6 月 16 日，任南方策略基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2019 年 4 月 18 日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 3 月 27 日，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至 2020 年 3 月 27 日，任南方 H 股联接基金经理；2014 年 10 月 30 日至

				2020 年 12 月 23 日，任 500 医药基金经理；2013 年 4 月 22 日至今，任南方 500、南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月 17 日至今，任南方 300、南方 300 联接基金经理；2015 年 2 月 16 日至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2017 年 7 月 21 日至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月 24 日至今，任南方房地产联接基金经理；2017 年 8 月 25 日至今，任南方房地产 ETF 基金经理；2018 年 4 月 3 日至今，任 MSCI 基金基金经理；2018 年 6 月 8 日至今，任 MSCI 联接基金经理；2020 年 7 月 24 日至今，兼任投资经理；2020 年 12 月 25 日至今，任南方策略基金经理；2021 年 3 月 12 日至今，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理；2021 年 7 月 2 日至今，任南方中证香港科技 ETF（QDII）基金经理；2021 年 10 月 22 日至今，任南方中证全指医疗保健 ETF 基金经理；2022 年 6 月 17 日至今，任南方恒生香港上市生物科技 ETF（QDII）基金经理。
--	--	--	--	--

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
罗文杰	公募基金	15	79,109,839,245.40	2013 年 04 月 22 日
	私募资产管理计划	8	2,741,258,733.15	2020 年 08 月 07 日
	其他组合	-	-	-
	合计	23	81,851,097,978.55	-

4.1.4 基金经理薪酬机制

公司基金经理薪酬由工资、奖金等构成。工资由基金经理任职的职位职级决定，重点体现员工能力和职位价值导向原则；奖金由员工的绩效贡献决定，重点体现绩效导向与差异化原则。对于兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理，公司对私募资产管理计划产生的超额业绩报酬实施对应激励，并依据其管理产品的长期业绩与个人综合贡献情况实施分配。为

贯彻激励约束相结合、激励与约束并重的管理理念，鼓励长期任职，防范经营风险，公司对基金经理奖金实施递延发放；同时，为加强员工利益与持有人利益相捆绑及一致性，公司对基金经理实施了跟投购基机制，有效引导基金经理为客户持续创造价值。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，建立和完善了兼任相关的制度及流程，确保兼任基金经理公平对待其管理的所有投资组合。通过对基金经理的投资交易行为进行监控和分析，本报告期内，两两组合间各项操作、流程及事后分析均正常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.3 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 12 次，是由于投资组合的投资策略导致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，中证 500 指数下跌 20.31%。期间我们通过自建的指数化交易系统、日内择时交易模型、跟踪误差归因分析系统、ETF 现金流精算系统等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

(1) 大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.5978 元，报告期内，份额净值增长率为 -17.46%，同期业绩基准增长率为 -19.30%；本基金 C 份额净值为 1.5685 元，报告期内，份额净值增长率为 -17.79%，同期业绩基准增长率为 -19.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年海内外宏观环境较为复杂，俄乌冲突、美元紧缩，以及本土疫情等，A 股和港股市场有较大幅度调整。现阶段，大中华权益市场估值已处于历史底部区域，下行空间收窄，具长期配置价值。中证 500 作为 A 股核心宽基指数，是配置 A 股市场的重要标的。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人根据法律法规、监管要求、自律规则和业务发展情况,严格遵循包括《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》在内的公募基金行业各项法律法规及其他规范要求,有效落实了 2022 年度发布的《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《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》和《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定》等公募基金相关新法律法规。

本基金管理人坚持从保护基金份额持有人利益出发,树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础、合规为先、行稳致远”的合规理念,继续致力于合规与内控机制的完善,严守底线,通过有效过程管控,将合规管理全面深度嵌入流程与业务,积极推动主动合规风控管理,持续加强业务风险的控制与防范,确保各项法规和管理制度的落实,有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内,本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况,积极推动监管新规落实,持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程,制订和修订了包括《合规手册制度》《防控内幕信息及交易管理制度》《合规绩效管理制度》《责任追究管理办法》《洗钱及制裁风险名单管理规定》和《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理规则》等一系列与监察稽核和合规内控相关的管理制度。

在进一步优化制度体系的基础上,本基金管理人贯彻“合规为先,行稳致远”的合规理念,提升合规文化建设效果,着力增强合规培训实效性,提升合规宣导影响力;根据《基金从业人员管理规则》等监管办法要求,认真梳理并优化了员工行为检查工作方案,加强员工行为规范检查、严格进行合规问责,强化全员合规、主动合规理念;对投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务和相关部门开展了定期稽核、专项稽核及多项自查,通过专项稽核和合规检查工作识别问题、防范风险、推动解决,促进公司业务合规运作、稳健经营;结合内部风控系统大数据分析结果对各类合规指标采取差异化管控措施,采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作,持续完善投资合规风控制度流程和系统,加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控,有效确保投研交易业务合规运作;全面履行新产品、新业务合规评估程序,保障新产品、新业务合规开展;严格审查基金宣传推介材料以及包括网络直播脚本在内的其他宣传材料合规性,不断强化销售合规风险管控,督促落实投资者适当性管理制度;完成各项信息披露工作,保障所披露信息的真实性、准确性和完整性;开展各类监管组织的投教活动,提升投教质效;监督和落实客户投诉处理,重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人高度重视反洗钱相关工作,贯彻风险为本,自评估驱动,反洗钱重点问题解决方案实现落地推进。从制度建设、系统功能建设、业务流程规范、宣传培训、监督检查等方面入手,将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程,有效提升了公司反洗钱工作的合规水平。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全管理制度，不断提高监察稽核及合规管理工作的科学性和有效性，持续全面推进合规数智化工作在更广范围应用并与合规管理工作深度融合，努力防范和管理各类风险，切实维护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 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。

4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、

独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 27536 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)(以下简称“南方中证 500ETF 联接基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会</p>

	<p>员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了南方中证 500ETF 联接基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于南方中证 500ETF 联接基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>南方中证 500ETF 联接基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估南方中证 500ETF 联接基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算南方中证 500ETF 联接基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督南方中证 500ETF 联接基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内</p>

	<p>部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对南方中证 500ETF 联接基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致南方中证 500ETF 联接基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波 陈薇瑶
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2023 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

报告截止日:2022 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	28,605,316.89	195,118,357.01
结算备付金		3,072,144.06	2,533,514.84
存出保证金		207,865.99	233,308.18
交易性金融资产	7.4.7.2	8,942,443,415.82	8,946,786,998.91
其中:股票投资		153,212,293.20	136,753,426.98

基金投资		8,358,947,235.53	8,539,797,205.73
债券投资		430,283,887.09	270,236,366.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		138,311.47	2,067,599.05
应收股利		-	-
应收申购款		13,311,202.94	14,621,703.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	4,505,700.12
资产总计		8,987,778,257.17	9,165,867,181.56
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,000,271.24	7,000,000.00
应付清算款		-	-
应付赎回款		31,322,674.68	24,897,666.78
应付管理人报酬		261,014.47	238,582.86
应付托管费		52,202.90	47,716.57
应付销售服务费		232,907.76	178,214.81
应付投资顾问费		-	-
应交税费		318,504.67	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	264,099.88	284,265.52
负债合计		33,451,675.60	32,646,446.54
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	5,611,709,723.31	4,721,675,344.19
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	3,342,616,858.26	4,411,545,390.83
净资产合计		8,954,326,581.57	9,133,220,735.02
负债和净资产总计		8,987,778,257.17	9,165,867,181.56

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，南方中证 500ETF 联接（LOF）A 份额净值 1.5978 元，基金份额总额 5,192,344,063.66 份；南方中证 500ETF 联接（LOF）C 份额净值 1.5685 元，基金份额总额 419,365,659.65 份；总份额合计 5,611,709,723.31 份。

7.2 利润表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-1,664,947,942.38	1,407,157,338.21
1.利息收入		2,967,409.50	10,229,659.57
其中：存款利息收入	7.4.7.9	2,967,409.50	2,801,301.92
债券利息收入		-	7,428,357.65
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		102,365,742.57	601,514,780.89
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-11,279,732.67	50,098,951.73
基金投资收益	7.4.7.11	104,303,386.89	550,867,505.22
债券投资收益	7.4.7.12	6,181,003.64	-1,327,924.69
资产支持证券投资		-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	3,161,084.71	1,876,248.63
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）	7.4.7.16	-1,771,039,231.53	792,913,695.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	758,137.08	2,499,201.83

减：二、营业总支出		6,900,086.68	8,736,554.58
1.管理人报酬	7.4.10.3.1	3,025,148.38	2,670,700.37
2.托管费	7.4.10.3.2	605,029.65	534,140.13
3.销售服务费	7.4.10.3.3	2,390,718.54	2,232,429.41
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		520,480.39	1,310,865.79
其中：卖出回购金融资产支出		520,480.39	1,310,865.79
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		88,438.33	0.62
8.其他费用	7.4.7.18	270,271.39	1,988,418.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,671,848,029.06	1,398,420,783.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,671,848,029.06	1,398,420,783.63
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,671,848,029.06	1,398,420,783.63

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	4,721,675,344.19	-	4,411,545,390.83	9,133,220,735.02
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	4,721,675,344.19	-	4,411,545,390.83	9,133,220,735.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	890,034,379.12	-	-1,068,928,532.57	-178,894,153.45
（一）、综合收益总额	-	-	-1,671,848,029.06	-1,671,848,029.06
（二）、本期基金份额交易产生的	890,034,379.12	-	602,919,496.49	1,492,953,875.61

基金净值变动数 (净值减少以“-” 号填列)				
其中: 1.基金申购 款	3,008,678,608.20	-	2,027,637,995.88	5,036,316,604.08
2.基金赎 回款	-2,118,644,229.08	-	-1,424,718,499.39	-3,543,362,728.47
(三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的基 金净值变动(净 值减少以“-”号 填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合 收益结转留存收 益	-	-	-	-
四、本期期末净 资产(基金净值)	5,611,709,723.31	-	3,342,616,858.26	8,954,326,581.57
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产(基金净值)	5,486,465,930.47	-	3,621,824,345.98	9,108,290,276.45
加: 会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净 资产(基金净值)	5,486,465,930.47	-	3,621,824,345.98	9,108,290,276.45
三、本期增减变 动额(减少以“-” 号填列)	-764,790,586.28	-	789,721,044.85	24,930,458.57
(一)、综合收益 总额	-	-	1,398,420,783.63	1,398,420,783.63
(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)	-764,790,586.28	-	-608,699,738.78	-1,373,490,325.06
其中: 1.基金申购 款	3,657,899,180.18	-	2,800,465,990.37	6,458,365,170.55
2.基金赎 回款	-4,422,689,766.46	-	-3,409,165,729.15	-7,831,855,495.61
(三)、本期向基	-	-	-	-

金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	4,721,675,344.19	-	4,411,545,390.83	9,133,220,735.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF) (以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]755 号《关于核准南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司,已于 2018 年 1 月 4 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,222,521,419.53 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 187 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2009 年 9 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,223,217,818.45 份基金份额,其中认购资金利息折合 696,398.92 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2009]147 号审核同意,本基金 581,411,748.00 份基金份额于 2009 年 11 月 11 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关约定,基金管理人经与基金托管人协商一致,将南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)更名为南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF),并对《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)的基

金合同》进行了修订,修订后的《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》于 2013 年 2 月 22 日经中国证监会备案后生效。

根据《关于南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)增加 C 类份额并修改基金合同的公告》以及更新的《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)招募说明书》的有关规定,自 2017 年 2 月 23 日起,本基金根据费率设置的不同,将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额的申购与赎回包括场外和场内两种方式,C 类基金份额在场外申购和赎回。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额之间不能互相转换。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务,本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

本基金为中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对中证 500 指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%,年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,于 2013 年 2 月 22 日前,本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证 500 指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中,中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,权证及其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》的有关规定,自 2013 年 2 月 22 日起,本基金的投资范围为目标 ETF、中证 500 指数成份股和备选成份股,本基金可少量投资于新股(一级市场初次发行或增发)、债券及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金可投资存托凭证。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%(已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内),基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 X95%+银行活期存款利率(税后)X5%。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2023 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益；

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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。债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。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。

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资,场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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，财政部于2022年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14号)，中国证监会于2022年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

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

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

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为195,118,357.01元、2,533,514.84

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

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

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

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

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》 根据《资产管理产品相关会计处理规定》，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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关

于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	28,605,316.89	195,118,357.01
等于：本金	28,581,046.39	195,118,357.01
加：应计利息	24,270.50	-

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	28,605,316.89	195,118,357.01

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	159,722,097.70	-	153,212,293.20	-6,509,804.50	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	424,643,484.58	5,911,606.29	430,283,887.09	-271,203.78
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	424,643,484.58	5,911,606.29	430,283,887.09	-271,203.78
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	7,630,330,250.67	-	8,358,947,235.53	728,616,984.86	
其他	-	-	-	-	
合计	8,214,695,832.95	5,911,606.29	8,942,443,415.82	721,835,976.58	
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	126,014,467.63	-	136,753,426.98	10,738,959.35	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	270,549,536.50	-	270,236,366.20	-313,170.30
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	270,549,536.50	-	270,236,366.20	-313,170.30

		50		20	
资产支持证券		-	-	-	-
基金	6,057,347.78		-	8,539,797.20	2,482,449.41
	6.67			5.73	9.06
其他		-	-	-	-
合计	6,453,911.79		-	8,946,786.99	2,492,875.20
	0.80			8.91	8.11

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按估值日目标 ETF 的份额净值确定公允价值。本基金可采用股票组合申赎的方式或证券二级市场买卖的方式进行目标 ETF 份额的交易。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	4,505,700.12
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	4,505,700.12

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	5,959.75	39,417.57
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	18,140.13	6,801.20
其中：交易所市场	18,140.13	6,801.20
银行间市场	-	-
应付利息	-	-1,953.25
应退退补款	-	-
预提费用	240,000.00	240,000.00

应付指数使用费	-	-
可退替代款	-	-
其他	-	-
合计	264,099.88	284,265.52

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。

7.4.7.7 实收基金

金额单位: 人民币元

南方中证 500ETF 联接 (LOF) A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	4,449,109,231.19	4,449,109,231.19
本期申购	2,305,756,906.78	2,305,756,906.78
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,562,522,074.31	-1,562,522,074.31
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	5,192,344,063.66	5,192,344,063.66

南方中证 500ETF 联接 (LOF) C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	272,566,113.00	272,566,113.00
本期申购	702,921,701.42	702,921,701.42
本期赎回 (以“-”号填列)	-556,122,154.77	-556,122,154.77
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	419,365,659.65	419,365,659.65

注:

1. 申购含转换入份额; 赎回含转换出份额。

2. 截至 2022 年 12 月 31 日止, 本基金于深交所上市的基金份额为 84,584,940.00 份, 全部为 A 类基金份额, 托管在场外未上市交易的基金份额为 5,527,124,783.31 份, 其中 A 类基金份额为 5,107,759,123.66 份, C 类基金份额为 419,365,659.65 份 (2021 年 12 月 31 日: 于深交所上市的基金份额为 77,499,395.00 份, 全部为 A 类基金份额, 托管在场外未上

市交易的基金份额为 4,644,175,949.19 份,其中 A 类基金份额为 4,371,609,836.19 份,C 类基金份额为 272,566,113.00 份)。A 类基金份额通过场外和场内两种方式销售,并在交易所上市交易。A 类基金份额持有人可进行跨系统转登记;C 类基金份额通过场外方式销售,不在交易所上市交易,C 类基金份额持有人不能进行跨系统转登记。上市的基金份额登记在证券登记结算系统,可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回;未上市的基金份额登记在注册登记系统,按基金份额净值申购或赎回。

7.4.7.8 未分配利润

单位:人民币元

南方中证 500ETF 联接 (LOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	4,988,143,070.83	-824,083,295.23	4,164,059,775.60
本期利润	94,563,372.32	-1,646,653,685.99	-1,552,090,313.67
本期基金份额交易产生的变动数	836,563,403.08	-344,327,403.53	492,235,999.55
其中:基金申购款	2,601,916,753.69	-1,030,972,976.32	1,570,943,777.37
基金赎回款	-1,765,353,350.61	686,645,572.79	-1,078,707,777.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,919,269,846.23	-2,815,064,384.75	3,104,205,461.48

南方中证 500ETF 联接 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	299,070,898.75	-51,585,283.52	247,485,615.23
本期利润	4,627,830.15	-124,385,545.54	-119,757,715.39
本期基金份额交易产生的变动数	161,461,690.56	-50,778,193.62	110,683,496.94
其中:基金申购款	773,505,717.99	-316,811,499.48	456,694,218.51
基金赎回款	-612,044,027.43	266,033,305.86	-346,010,721.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	465,160,419.46	-226,749,022.68	238,411,396.78

7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	2,897,659.47	2,690,139.71
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	59,451.73	74,206.85
其他	10,298.30	36,955.36
合计	2,967,409.50	2,801,301.92

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,836,508.80	47,374,558.55
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-9,443,223.87	2,724,393.18
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-11,279,732.67	50,098,951.73

7.4.7.10.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	370,402,421.12	1,238,412,326.04
减：卖出股票成本总额	371,666,627.71	1,191,037,767.49
减：交易费用	572,302.21	-
买卖股票差价收入	-1,836,508.80	47,374,558.55

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票赎回差价收入。

7.4.7.10.4 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
申购基金份额总额	677,510,190.00	393,227,000.00
减：现金支付申购款总额	329,062,456.88	205,029,074.69
减：申购股票成本总额	357,890,956.99	185,473,532.13
减：交易费用	-	-
申购差价收入	-9,443,223.87	2,724,393.18

7.4.7.10.5 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。

7.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022	上年度可比期间 2021 年 1 月
----	-------------------------	--------------------

	年 12 月 31 日	1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	788,644,824.23	2,402,658,863.55
减：卖出/赎回基金成本总额	683,514,895.73	1,851,791,358.33
减：买卖基金差价收入应缴 纳增值税额	736,984.13	-
减：交易费用	89,557.48	-
基金投资收益	104,303,386.89	550,867,505.22

注：上述交易费用（如有）包含基金买卖或申赎产生的交易费用。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	6,711,957.67	-
债券投资收益——买卖债券（、 债转股及债券到期兑付）差价收 入	-530,954.03	-1,327,924.69
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	6,181,003.64	-1,327,924.69

7.4.7.12.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	321,251,873.98	509,518,393.15
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	313,979,265.50	499,344,865.35
减：应计利息总额	7,803,325.98	11,501,452.49
减：交易费用	236.53	-
买卖债券差价收入	-530,954.03	-1,327,924.69

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

7.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券申购差价收入。

7.4.7.12.5 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益**7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

7.4.7.14 衍生工具收益**7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具其他投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,161,084.71	1,876,248.63
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	3,161,084.71	1,876,248.63

7.4.7.16 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-1,771,039,231.53	792,913,695.92
——股票投资	-17,248,763.85	3,532,911.91
——债券投资	41,966.52	867,437.35
——资产支持证券投资	-	-

——基金投资	-1,753,832,434.20	788,513,346.66
——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	-1,771,039,231.53	792,913,695.92

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	756,583.77	2,496,867.00
基金转换费收入	1,553.31	2,334.83
合计	758,137.08	2,499,201.83

注：

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

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

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	120,000.00	120,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	30,246.04	36,973.55
其他	25.35	-
上市费	-	60,000.00
交易费用	-	1,651,444.71
合计	270,271.39	1,988,418.26

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司("南方基金")	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
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
厦门国际信托有限公司("厦门国际信托")	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司("深圳投资控股")	基金管理人的股东
厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
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
南方资本管理有限公司("南方资本")	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司("南方东英")	基金管理人的子公司
中证 500 交易型开放式指数证券投资基金("目标 ETF")	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	124,802,477.51	15.71%	91,458,118.09	6.26%

7.4.10.2 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。

7.4.10.2.1 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	194,685.39	0.04%	60,540,173.15	14.26%

7.4.10.2.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华泰证券	-	-	954,800,000.00	11.10%

7.4.10.2.3 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。

7.4.10.2.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	12,484.15	15.71%	1,998.15	11.02%
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	9,146.52	6.26%	1,400.93	20.60%

注：

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

7.4.10.3 关联方报酬

7.4.10.3.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,025,148.38	2,670,700.37
其中：支付销售机构的客户维护费	13,642,785.17	11,495,370.69

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。

7.4.10.3.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	605,029.65	534,140.13

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

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

7.4.10.3.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	合计
华泰证券	-	15,017.27	15,017.27
南方基金	-	602,682.18	602,682.18
农业银行	-	424.54	424.54
合计	-	618,123.99	618,123.99
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	合计
华泰证券	-	11,955.12	11,955.12
南方基金	-	1,068,314.96	1,068,314.96
农业银行	-	10.30	10.30
合计	-	1,080,280.38	1,080,280.38

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：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

7.4.10.4 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。

7.4.10.5 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

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.6.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.6.2 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。

7.4.10.7 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	28,605,316.89	2,897,659.47	195,118,357.01	2,690,139.71

注：本基金由基金托管人中国农业银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

7.4.10.8 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 12 月 31 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	301327	华宝新能	网下申购	2,417	574,037.50
华泰联合	688048	长光华芯	网下申购	6,790	548,632.00
华泰联合	301207	华兰疫苗	网下申购	5,687	323,476.56
华泰联合	688046	药康生物	网下申购	12,070	271,937.10

华泰联合	301195	北路智控	网下申购	3,300	234,861.00
华泰联合	113062	常银转债	配债	1,690	169,000.00
华泰联合	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64
华泰联合	301277	新 天 地	网下申购	4,384	118,368.00
华泰联合	688420	美腾科技	网下申购	2,408	117,895.68
华泰联合	001258	立新能源	网下申购	3,188	10,775.44
华泰联合	113659	莱克转债	配债	90	9,000.00
兴业证券	301165	锐捷网络	网下申购	10,769	348,700.22
兴业证券	603280	南方路机	网下申购	363	8,621.25

上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	601728	中国电信	网下申购	562,873	2,549,814.69
华泰联合	688192	迪哲医药	网下申购	8,926	469,329.08
华泰联合	688105	诺 唯 赞	网下申购	6,180	339,900.00
华泰联合	688246	嘉和美康	网下申购	7,719	304,900.50
华泰联合	688083	中望软件	网下申购	1,837	276,468.50
华泰联合	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
华泰联合	600909	华安证券	配股	15,182	55,869.76
华泰联合	688633	星球石墨	网下申购	1,558	52,379.96
华泰联合	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合	301078	孩 子 王	网下申购	7,551	43,569.27
华泰联合	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合	688260	昀冢科技	网下申购	2,990	28,793.70
华泰联合	300975	商络电子	网下申购	4,917	26,945.16
华泰联合	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合	301033	迈普医学	网下申购	1,076	16,290.64
华泰联合	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合	605208	永 茂 泰	网下申购	801	10,733.40
华泰联合	001234	泰 慕 士	网下申购	333	5,504.49
兴业证券	300979	华利集团	网下申购	9,246	307,152.12
兴业证券	300941	创识科技	网下申购	3,989	85,005.59
兴业证券	688639	华恒生物	网下申购	2,302	53,314.32
兴业证券	688195	腾景科技	网下申购	2,693	36,624.80
兴业证券	688597	煜邦电力	网下申购	3,907	22,973.16
兴业证券	605298	必得科技	网下申购	391	6,252.09
兴业证券	605086	龙高股份	网下申购	443	5,696.98

7.4.10.9 其他关联交易事项的说明

7.4.10.9.1 其他关联交易事项的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有目标 ETF 基金份额，成本总额为人民币 7,630,330,250.67 元，估值总额为人民币 8,358,947,235.53 元，占本基金基金资产净值的比例为 93.35%(2021 年 12 月 31 日：成本总额为人民币 6,057,347,786.67 元，估值总额为人民币 8,539,797,205.73 元，占本基金基金资产净值的比例为 93.50%)

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301095	广立微	2022 年 7 月 28 日	6 个月	新股锁定期	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301165	锐捷网络	2022 年 11 月 14 日	6 个月	新股锁定期	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	-
301195	北路智控	2022 年 7 月 25 日	6 个月	新股锁定期	71.17	73.04	330	23,486.10	24,103.20	-
301267	华夏眼科	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股锁定期	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	-
301270	汉仪股份	2022 年 8 月 19 日	6 个月	新股锁定期	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301277	新天地	2022 年 11 月 9 日	6 个月	新股锁定期	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301280	珠城科技	2022 年 12 月 19 日	6 个月	新股锁定期	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-
301283	聚胶股份	2022 年 8 月 26 日	6 个月	新股锁定期	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301297	富乐德	2022	6 个月	新股锁	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85	-

		年 12 月 23 日		定期							
301306	西测测试	2022 年 7 月 19 日	6 个月	新股锁定期	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-	
301309	万得凯	2022 年 9 月 8 日	6 个月	新股锁定期	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-	
301318	维海德	2022 年 8 月 3 日	6 个月	新股锁定期	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44	-	
301319	唯特偶	2022 年 9 月 22 日	6 个月	新股锁定期	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-	
301327	华宝新能	2022 年 9 月 8 日	6 个月	新股锁定期	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-	
301356	天振股份	2022 年 11 月 3 日	6 个月	新股锁定期	63.00	43.33	614	38,682.00	26,604.62	-	
301366	一博科技	2022 年 9 月 19 日	6 个月	新股锁定期	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12	-	
301367	怡和嘉业	2022 年 10 月 21 日	6 个月	新股锁定期	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94	-	
301377	鼎泰高科	2022 年 11 月 11 日	6 个月	新股锁定期	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-	
301388	欣灵电气	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股锁定期	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-	
301391	卡莱特	2022 年 11 月 24 日	6 个月	新股锁定期	96.00	80.97	247	23,712.00	19,999.59	-	
688143	长盈通	2022 年 12 月 1 日	6 个月	新股锁定期	35.67	42.66	1,938	69,128.46	82,675.08	-	
688392	骄成超声	2022 年 9 月 19 日	6 个月	新股锁定期	71.18	134.27	2,745	195,389.10	368,571.15	-	
688439	振华风光	2022 年 8 月 19 日	6 个月	新股锁定期	66.99	114.86	7,096	475,361.04	815,046.56	-	

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：

1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

7.4.12.2 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
600038	中直股份	2022 年 12 月 26 日	重大事项停牌	46.41	2023 年 1 月 10 日	51.05	7,300	336,839.17	338,793.00	-

本基金截至 2022 年 12 月 31 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 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 1,000,271.24 元，截至 2023 年 1 月 3 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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，将风险控制可在可承受的范围内。

7.4.13.2 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工商银行，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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行

了必要的尽职调查与严格的准入管理,对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整,且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类,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。

于本年度末,本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(上年度末:本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.0002%)。

7.4.13.3 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。

于本年度末,除卖出回购金融资产款余额中有 1,000,271.24 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外,本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息,因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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%。于本年度末,本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.02%。

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。于本年度末,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、债券投资和应收申购款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2022 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	28,605,316.8	-	-	-	28,605,316.8

	9				9
结算备付金	3,072,144.06	-	-	-	3,072,144.06
存出保证金	207,865.99	-	-	-	207,865.99
交易性金融资产	430,283,887.09	-	-	8,512,159,528.73	8,942,443,415.82
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	-	-	-	138,311.47	138,311.47
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	425,276.19	-	-	12,885,926.75	13,311,202.94
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	462,594,490.22	-	-	8,525,183,766.95	8,987,778,257.17
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	1,000,271.24	-	-	-	1,000,271.24
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	31,322,674.68	31,322,674.68
应付管理人报酬	-	-	-	261,014.47	261,014.47
应付托管费	-	-	-	52,202.90	52,202.90
应付销售服务费	-	-	-	232,907.76	232,907.76
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	318,504.67	318,504.67
应付利润	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	264,099.88	264,099.88
负债总计	1,000,271.24	-	-	32,451,404.36	33,451,675.60
利率敏感度缺口	461,594,218.98	-	-	8,492,732,362.59	8,954,326,581.57
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	195,118,357.01	-	-	-	195,118,357.01
结算备付金	2,533,514.84	-	-	-	2,533,514.84
存出保证金	233,308.18	-	-	-	233,308.18
交易性金融资产	270,220,366.20	-	16,000.00	8,676,550,632.71	8,946,786,998.91
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,067,599.05	2,067,599.05
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	788,565.54	-	-	13,833,137.91	14,621,703.45
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	4,505,700.12	4,505,700.12
资产总计	468,894,111.77	-	16,000.00	8,696,957,069.79	9,165,867,181.56
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	7,000,000.00	-	-	-	7,000,000.00

应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	24,897,666.78	24,897,666.78
应付管理人报酬	-	-	-	238,582.86	238,582.86
应付托管费	-	-	-	47,716.57	47,716.57
应付销售服务费	-	-	-	178,214.81	178,214.81
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	284,265.52	284,265.52
负债总计	7,000,000.00	-	-	25,646,446.54	32,646,446.54
利率敏感度缺口	461,894,111.77	-	16,000.00	8,671,310.623.25	9,133,220.735.02

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 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12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	-356,709.35	-233,775.10
	2.市场利率平行下降25个基点	358,027.52	234,605.24

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	153,212,293.20	1.71	136,753,426.98	1.50
交易性金融资产-基金投资	8,358,947,235.53	93.35	8,539,797,205.73	93.50
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	8,512,159,528.73	95.06	8,676,550,632.71	95.00

注：交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标 ETF 份额。

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	423,759,242.41	433,122,344.25
	2.组合自身基准下降 5%	-423,759,242.41	-433,122,344.25

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	8,510,118,973.82	8,673,351,622.97
第二层次	430,622,680.09	270,557,054.69
第三层次	1,701,761.91	2,878,321.25
合计	8,942,443,415.82	8,946,786,998.91

7.4.14.2.2 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、债券和基金，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、债券和基金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、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票	
期初余额	-	2,878,321.25	2,878,321.25
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	3,451,128.03	3,451,128.03
转出第三层次	-	7,333,539.54	7,333,539.54
当期利得或损失总额	-	2,705,852.17	2,705,852.17
其中：计入损益的利得或损失	-	2,705,852.17	2,705,852.17
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,701,761.91	1,701,761.91
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或	-	524,357.34	524,357.34

损失的变动——公允价值变动损益			
项目	上年度可比同期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	2,360,271.39	2,360,271.39
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	518,049.86	518,049.86
其中：计入损益的利得或损失	-	518,049.86	518,049.86
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,878,321.25	2,878,321.25
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	518,049.86	518,049.86

于本年度末，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于本年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,701,761.91	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2127~1.65	负相关

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	2,878,321.25	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1717~2.7417	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本年度末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	153,212,293.20	1.70
	其中:股票	153,212,293.20	1.70
2	基金投资	8,358,947,235.53	93.00
3	固定收益投资	430,283,887.09	4.79
	其中:债券	430,283,887.09	4.79
	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	31,677,460.95	0.35
8	其他资产	13,657,380.40	0.15
9	合计	8,987,778,257.17	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,561,884.00	0.02
B	采矿业	5,997,016.56	0.07
C	制造业	89,003,949.05	0.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,333,476.29	0.05
E	建筑业	1,283,066.08	0.01
F	批发和零售业	7,213,517.81	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	3,608,140.00	0.04
H	住宿和餐饮业	378,299.20	0.00

I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,396,184.55	0.15
J	金融业	13,942,360.65	0.16
K	房地产业	3,890,707.66	0.04
L	租赁和商务服务业	2,084,350.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	1,954,127.80	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	892,190.80	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	377,631.21	0.00
R	文化、体育和娱乐业	2,103,559.70	0.02
S	综合	1,191,831.84	0.01
	合计	153,212,293.20	1.71

8.2.2 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。

8.3 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	688777	中控技术	13,603	1,235,560.49	0.01
2	300012	华测检测	47,200	1,052,560.00	0.01
3	688122	西部超导	11,044	1,045,756.36	0.01
4	600157	ST 永泰	656,300	1,004,139.00	0.01
5	688099	晶晨股份	14,000	987,140.00	0.01
6	002384	东山精密	38,400	949,632.00	0.01
7	603613	国联股份	10,350	915,354.00	0.01
8	002028	思源电气	23,518	898,857.96	0.01
9	000009	中国宝安	72,469	876,150.21	0.01
10	000519	中兵红箭	42,700	838,628.00	0.01
11	600487	亨通光电	55,300	832,818.00	0.01
12	002385	大北农	93,100	828,590.00	0.01
13	688439	振华风光	7,096	815,046.56	0.01
14	600885	宏发股份	24,303	811,963.23	0.01
15	600563	法拉电子	5,023	803,077.24	0.01
16	600096	云天化	37,900	797,416.00	0.01
17	603345	安井食品	4,900	793,212.00	0.01
18	600765	中航重机	25,486	792,359.74	0.01
19	600026	中远海能	65,400	788,070.00	0.01
20	603605	珀莱雅	4,700	787,156.00	0.01
21	300724	捷佳伟创	6,800	775,336.00	0.01

22	601555	东吴证券	118,700	775,111.00	0.01
23	002497	雅化集团	32,400	753,300.00	0.01
24	600536	中国软件	12,574	733,441.42	0.01
25	601058	赛轮轮胎	72,900	730,458.00	0.01
26	002422	科伦药业	27,400	729,114.00	0.01
27	688390	固德威	2,180	704,336.20	0.01
28	600988	赤峰黄金	39,000	703,950.00	0.01
29	600079	人福医药	29,200	697,588.00	0.01
30	600298	安琪酵母	15,300	691,866.00	0.01
31	600415	小商品城	132,000	691,680.00	0.01
32	601108	财通证券	96,400	686,368.00	0.01
33	600418	江淮汽车	51,868	681,026.84	0.01
34	600372	中航电子	42,300	675,531.00	0.01
35	688521	芯原股份	15,300	674,271.00	0.01
36	002407	多氟多	20,000	666,400.00	0.01
37	601077	渝农商行	188,400	665,052.00	0.01
38	600399	抚顺特钢	46,400	663,984.00	0.01
39	603939	益丰药房	10,400	663,936.00	0.01
40	600141	兴发集团	22,884	663,636.00	0.01
41	300146	汤臣倍健	28,700	654,934.00	0.01
42	002603	以岭药业	21,860	654,925.60	0.01
43	600486	扬农化工	6,300	654,570.00	0.01
44	300144	宋城演艺	44,600	651,160.00	0.01
45	300390	天华超净	11,600	648,208.00	0.01
46	601128	常熟银行	83,924	633,626.20	0.01
47	600160	巨化股份	40,800	632,808.00	0.01
48	300699	光威复材	8,700	628,575.00	0.01
49	603456	九洲药业	14,800	627,964.00	0.01
50	300285	国瓷材料	22,600	623,082.00	0.01
51	002625	光启技术	36,300	617,826.00	0.01
52	601162	天风证券	211,100	605,857.00	0.01
53	600153	建发股份	44,200	603,330.00	0.01
54	601699	潞安环能	35,800	603,230.00	0.01
55	600859	王府井	21,190	596,286.60	0.01
56	601607	上海医药	33,400	595,522.00	0.01
57	600109	国金证券	68,400	595,080.00	0.01
58	600521	华海药业	27,100	592,406.00	0.01
59	600392	盛和资源	42,110	589,540.00	0.01
60	601168	西部矿业	57,500	586,500.00	0.01
61	600027	华电国际	99,700	586,236.00	0.01
62	000738	航发控制	22,800	584,592.00	0.01
63	603517	绝味食品	9,400	574,246.00	0.01
64	603077	和邦生物	188,120	571,884.80	0.01

65	000629	钒钛股份	120,800	571,384.00	0.01
66	000630	铜陵有色	182,600	569,712.00	0.01
67	300073	当升科技	10,000	564,000.00	0.01
68	300037	新宙邦	12,960	563,371.20	0.01
69	600862	中航高科	25,100	559,479.00	0.01
70	002223	鱼跃医疗	17,316	551,687.76	0.01
71	600499	科达制造	38,800	551,348.00	0.01
72	600497	驰宏锌锗	108,700	550,022.00	0.01
73	000932	华菱钢铁	116,420	547,174.00	0.01
74	601696	中银证券	51,400	543,298.00	0.01
75	000807	云铝股份	48,700	541,544.00	0.01
76	000783	长江证券	101,300	539,929.00	0.01
77	601872	招商轮船	96,200	537,758.00	0.01
78	601990	南京证券	67,800	537,654.00	0.01
79	600177	雅戈尔	84,800	536,784.00	0.01
80	600705	中航产融	163,200	535,296.00	0.01
81	600143	金发科技	54,800	531,012.00	0.01
82	600348	华阳股份	37,000	527,250.00	0.01
83	002185	华天科技	63,000	522,270.00	0.01
84	000999	华润三九	11,075	518,420.75	0.01
85	000975	银泰黄金	46,824	516,936.96	0.01
86	603589	口子窖	8,800	507,496.00	0.01
87	000831	中国稀土	15,200	499,776.00	0.01
88	600482	中国动力	32,600	498,454.00	0.01
89	002030	达安基因	31,845	495,508.20	0.01
90	002152	广电运通	48,900	486,066.00	0.01
91	300357	我武生物	8,800	484,880.00	0.01
92	600549	厦门钨业	24,740	483,667.00	0.01
93	002797	第一创业	84,300	474,609.00	0.01
94	600325	华发股份	52,109	472,107.54	0.01
95	002439	启明星辰	18,100	472,048.00	0.01
96	002268	电科网安	15,394	469,978.82	0.01
97	603444	吉比特	1,500	469,260.00	0.01
98	000960	锡业股份	33,000	465,300.00	0.01
99	002078	太阳纸业	40,300	464,256.00	0.01
100	002294	信立泰	14,100	463,185.00	0.01
101	000970	中科三环	33,520	457,212.80	0.01
102	600879	航天电子	66,920	455,056.00	0.01
103	603658	安图生物	7,300	451,505.00	0.01
104	601636	旗滨集团	39,300	447,627.00	0.00
105	000537	广宇发展	33,800	447,174.00	0.00
106	603267	鸿远电子	4,400	445,104.00	0.00
107	603026	胜华新材	4,800	443,040.00	0.00

108	600546	山煤国际	30,400	440,496.00	0.00
109	300253	卫宁健康	42,492	436,817.76	0.00
110	002624	完美世界	34,100	433,752.00	0.00
111	002430	杭氧股份	11,000	432,960.00	0.00
112	002505	鹏都农牧	166,500	429,570.00	0.00
113	002299	圣农发展	18,100	428,789.00	0.00
114	002138	顺络电子	16,300	426,734.00	0.00
115	002557	洽洽食品	8,500	425,000.00	0.00
116	002507	涪陵榨菜	16,400	422,628.00	0.00
117	002465	海格通信	51,800	420,616.00	0.00
118	000998	隆平高科	26,000	417,820.00	0.00
119	600529	山东药玻	14,700	417,480.00	0.00
120	300832	新产业	8,300	416,162.00	0.00
121	002183	怡亚通	64,700	416,021.00	0.00
122	002249	大洋电机	81,100	415,232.00	0.00
123	600637	东方明珠	62,400	414,960.00	0.00
124	002273	水晶光电	35,188	414,866.52	0.00
125	600699	均胜电子	29,466	413,997.30	0.00
126	300088	长信科技	69,000	411,930.00	0.00
127	000937	冀中能源	64,700	411,492.00	0.00
128	600170	上海建工	157,900	410,540.00	0.00
129	000728	国元证券	64,700	409,551.00	0.00
130	000988	华工科技	24,700	405,327.00	0.00
131	603127	昭衍新药	6,900	403,029.00	0.00
132	601577	长沙银行	59,600	402,896.00	0.00
133	002353	杰瑞股份	14,400	401,904.00	0.00
134	002056	横店东磁	21,300	399,162.00	0.00
135	002683	广东宏大	14,700	396,312.00	0.00
136	002739	万达电影	28,300	396,200.00	0.00
137	002572	索菲亚	21,800	395,888.00	0.00
138	000400	许继电气	19,800	395,406.00	0.00
139	000878	云南铜业	33,400	392,450.00	0.00
140	000623	吉林敖东	26,100	391,239.00	0.00
141	002092	中泰化学	52,400	390,904.00	0.00
142	002673	西部证券	64,100	390,369.00	0.00
143	601997	贵阳银行	71,100	390,339.00	0.00
144	300376	易事特	57,100	389,993.00	0.00
145	600380	健康元	34,413	388,522.77	0.00
146	300418	昆仑万维	26,900	387,629.00	0.00
147	688256	寒武纪	7,093	386,994.08	0.00
148	000729	燕京啤酒	36,300	385,506.00	0.00
149	300017	网宿科技	68,700	383,346.00	0.00
150	689009	九号公司	12,539	382,314.11	0.00

151	300136	信维通信	23,000	379,730.00	0.00
152	600258	首旅酒店	15,254	378,299.20	0.00
153	688009	中国通号	78,654	376,752.66	0.00
154	603233	大参林	9,420	373,032.00	0.00
155	300308	中际旭创	13,700	370,311.00	0.00
156	688392	骄成超声	2,745	368,571.15	0.00
157	002409	雅克科技	7,300	367,701.00	0.00
158	000830	鲁西化工	29,610	366,867.90	0.00
159	002444	巨星科技	19,318	366,655.64	0.00
160	002966	苏州银行	46,800	364,104.00	0.00
161	600663	陆家嘴	37,300	363,302.00	0.00
162	000039	中集集团	51,600	363,264.00	0.00
163	600704	物产中大	75,500	363,155.00	0.00
164	002372	伟星新材	16,880	360,219.20	0.00
165	300363	博腾股份	8,800	359,480.00	0.00
166	002156	通富微电	21,700	357,616.00	0.00
167	000739	普洛药业	16,600	357,564.00	0.00
168	002065	东华软件	63,000	356,580.00	0.00
169	000750	国海证券	107,010	356,343.30	0.00
170	688185	康希诺	2,437	355,850.74	0.00
171	002326	永太科技	16,100	351,463.00	0.00
172	000959	首钢股份	93,100	350,987.00	0.00
173	600271	航天信息	33,400	347,694.00	0.00
174	000513	丽珠集团	10,552	342,728.96	0.00
175	000060	中金岭南	83,300	341,530.00	0.00
176	600848	上海临港	28,600	340,912.00	0.00
177	000027	深圳能源	53,420	339,751.20	0.00
178	002936	郑州银行	144,449	339,455.15	0.00
179	600038	中直股份	7,300	338,793.00	0.00
180	600516	方大炭素	55,100	337,212.00	0.00
181	002408	齐翔腾达	47,888	337,131.52	0.00
182	000636	风华高科	22,700	336,641.00	0.00
183	002131	利欧股份	189,677	335,728.29	0.00
184	688188	柏楚电子	1,546	335,605.68	0.00
185	603885	吉祥航空	20,726	335,346.68	0.00
186	000581	威孚高科	18,800	333,324.00	0.00
187	002926	华西证券	44,200	332,826.00	0.00
188	600316	洪都航空	13,085	329,611.15	0.00
189	600739	辽宁成大	26,101	328,611.59	0.00
190	000778	新兴铸管	89,300	325,945.00	0.00
191	600166	福田汽车	115,800	325,398.00	0.00
192	600642	申能股份	58,899	323,355.51	0.00
193	002195	二三四五	160,758	323,123.58	0.00

194	300257	开山股份	21,500	322,500.00	0.00
195	002250	联化科技	20,727	321,268.50	0.00
196	000930	中粮科技	37,800	316,008.00	0.00
197	600673	东阳光	36,327	315,681.63	0.00
198	002958	青农商行	109,200	315,588.00	0.00
199	600315	上海家化	9,905	315,474.25	0.00
200	600118	中国卫星	14,600	314,630.00	0.00
201	600909	华安证券	68,088	312,523.92	0.00
202	300024	机器人	34,800	312,504.00	0.00
203	300001	特锐德	20,488	311,622.48	0.00
204	300474	景嘉微	5,700	311,049.00	0.00
205	300244	迪安诊断	12,377	311,034.01	0.00
206	002508	老板电器	11,200	310,912.00	0.00
207	600511	国药股份	11,118	310,192.20	0.00
208	300676	华大基因	6,000	310,140.00	0.00
209	600056	中国医药	17,995	310,053.85	0.00
210	002002	鸿达兴业	95,000	307,800.00	0.00
211	600867	通化东宝	33,400	306,612.00	0.00
212	002203	海亮股份	27,100	306,230.00	0.00
213	300026	红日药业	53,700	305,016.00	0.00
214	600801	华新水泥	20,580	304,995.60	0.00
215	688002	睿创微纳	8,200	304,958.00	0.00
216	600985	淮北矿业	23,800	304,640.00	0.00
217	601198	东兴证券	39,400	304,168.00	0.00
218	300058	蓝色光标	60,200	304,010.00	0.00
219	000997	新大陆	23,240	302,352.40	0.00
220	600066	宇通客车	40,200	301,902.00	0.00
221	000402	金融街	57,500	301,875.00	0.00
222	600008	首创环保	106,620	301,734.60	0.00
223	600369	西南证券	80,300	301,125.00	0.00
224	000547	航天发展	31,861	299,174.79	0.00
225	002831	裕同科技	8,966	296,505.62	0.00
226	300558	贝达药业	6,000	295,620.00	0.00
227	600282	南钢股份	93,800	295,470.00	0.00
228	603858	步长制药	14,000	294,140.00	0.00
229	600535	天士力	27,240	293,102.40	0.00
230	002506	协鑫集成	100,100	291,291.00	0.00
231	600998	九州通	22,300	290,792.00	0.00
232	002212	天融信	29,100	290,709.00	0.00
233	300070	碧水源	61,100	289,003.00	0.00
234	002155	湖南黄金	22,100	286,195.00	0.00
235	002500	山西证券	53,814	285,214.20	0.00
236	300009	安科生物	30,360	284,169.60	0.00

237	300296	利亚德	50,000	283,000.00	0.00
238	601016	节能风电	73,840	281,330.40	0.00
239	000021	深科技	26,300	281,147.00	0.00
240	002368	太极股份	9,986	280,906.18	0.00
241	600820	隧道股份	52,700	277,729.00	0.00
242	002373	千方科技	31,100	277,412.00	0.00
243	000869	张裕 A	9,100	275,184.00	0.00
244	600390	五矿资本	54,100	274,828.00	0.00
245	600863	内蒙华电	78,600	274,314.00	0.00
246	002532	天山铝业	35,400	273,288.00	0.00
247	300182	捷成股份	61,100	273,117.00	0.00
248	600580	卧龙电驱	21,811	271,765.06	0.00
249	603156	养元饮品	12,200	271,694.00	0.00
250	002690	美亚光电	11,330	270,787.00	0.00
251	601958	金铂股份	23,100	266,805.00	0.00
252	002128	电投能源	21,600	266,544.00	0.00
253	603927	中科软	9,000	266,490.00	0.00
254	600208	新湖中宝	103,700	263,398.00	0.00
255	000050	深天马 A	30,300	262,398.00	0.00
256	600297	广汇汽车	123,800	259,980.00	0.00
257	002244	滨江集团	29,400	259,602.00	0.00
258	002595	豪迈科技	11,200	259,280.00	0.00
259	688208	道通科技	8,200	258,710.00	0.00
260	002416	爱施德	27,270	258,519.60	0.00
261	300888	稳健医疗	3,600	257,400.00	0.00
262	600060	海信视像	19,000	257,260.00	0.00
263	601992	金隅集团	101,100	256,794.00	0.00
264	601005	重庆钢铁	162,200	256,276.00	0.00
265	002434	万里扬	31,700	255,185.00	0.00
266	002019	亿帆医药	20,800	254,800.00	0.00
267	603225	新风鸣	23,300	253,504.00	0.00
268	002985	北摩高科	5,620	253,462.00	0.00
269	603883	老百姓	6,243	252,654.21	0.00
270	002124	天邦食品	41,300	252,343.00	0.00
271	000887	中鼎股份	17,400	251,778.00	0.00
272	600409	三友化工	37,978	251,034.58	0.00
273	002396	星网锐捷	13,100	250,996.00	0.00
274	002153	石基信息	16,740	250,932.60	0.00
275	300251	光线传媒	28,800	249,408.00	0.00
276	601000	唐山港	90,819	248,844.06	0.00
277	601456	国联证券	22,100	248,625.00	0.00
278	600528	中铁工业	32,460	247,669.80	0.00
279	002221	东华能源	32,400	247,212.00	0.00

280	600216	浙江医药	21,094	246,588.86	0.00
281	300168	万达信息	29,200	246,156.00	0.00
282	600022	山东钢铁	166,260	246,064.80	0.00
283	000401	冀东水泥	29,831	245,509.13	0.00
284	600567	山鹰国际	98,900	245,272.00	0.00
285	300072	海新能科	56,200	245,032.00	0.00
286	600171	上海贝岭	14,000	244,020.00	0.00
287	300115	长盈精密	23,620	243,994.60	0.00
288	600021	上海电力	24,298	243,222.98	0.00
289	601717	郑煤机	21,792	243,198.72	0.00
290	002670	国盛金控	32,563	241,291.83	0.00
291	000062	深圳华强	19,648	239,902.08	0.00
292	000825	太钢不锈	55,500	239,760.00	0.00
293	300482	万孚生物	7,510	239,343.70	0.00
294	002939	长城证券	28,800	238,464.00	0.00
295	000709	河钢股份	105,400	238,204.00	0.00
296	603866	桃李面包	15,411	237,329.40	0.00
297	600839	四川长虹	89,836	237,167.04	0.00
298	600827	百联股份	19,483	236,133.96	0.00
299	603218	日月股份	11,600	235,480.00	0.00
300	600062	华润双鹤	13,157	235,378.73	0.00
301	600598	北大荒	16,900	232,544.00	0.00
302	002127	南极电商	48,100	231,361.00	0.00
303	603568	伟明环保	12,460	230,883.80	0.00
304	601118	海南橡胶	52,600	230,388.00	0.00
305	601866	中远海发	95,200	230,384.00	0.00
306	600728	佳都科技	43,500	229,680.00	0.00
307	601778	晶科科技	41,700	229,350.00	0.00
308	600131	国网信通	15,300	228,888.00	0.00
309	601179	中国西电	49,600	228,656.00	0.00
310	601869	长飞光纤	7,000	228,410.00	0.00
311	603712	七一二	6,500	226,980.00	0.00
312	603707	健友股份	12,478	225,103.12	0.00
313	300677	英科医疗	10,700	225,021.00	0.00
314	600435	北方导航	19,298	223,856.80	0.00
315	600498	烽火通信	17,000	223,380.00	0.00
316	600376	首开股份	39,240	223,275.60	0.00
317	002429	兆驰股份	63,600	221,964.00	0.00
318	300383	光环新网	27,200	221,952.00	0.00
319	601880	辽港股份	136,560	221,227.20	0.00
320	688289	圣湘生物	10,069	221,014.55	0.00
321	300618	寒锐钴业	5,500	220,275.00	0.00
322	600398	海澜之家	41,500	219,950.00	0.00

323	000012	南玻 A	32,665	219,182.15	0.00
324	000987	越秀资本	36,425	218,185.75	0.00
325	688029	南微医学	2,651	217,726.63	0.00
326	600895	张江高科	18,700	212,058.00	0.00
327	002867	周大生	15,050	211,151.50	0.00
328	600201	生物股份	23,410	210,924.10	0.00
329	600566	济川药业	7,714	209,975.08	0.00
330	000089	深圳机场	26,600	209,076.00	0.00
331	000883	湖北能源	49,000	205,800.00	0.00
332	600329	达仁堂	7,018	204,223.80	0.00
333	000967	盈峰环境	44,800	203,392.00	0.00
334	600970	中材国际	23,454	199,828.08	0.00
335	000598	兴蓉环境	40,800	199,512.00	0.00
336	600517	国网英大	41,100	198,924.00	0.00
337	600755	厦门国贸	27,548	196,692.72	0.00
338	000156	华数传媒	26,054	195,144.46	0.00
339	601106	中国一重	66,000	193,380.00	0.00
340	002468	申通快递	18,700	193,171.00	0.00
341	600718	东软集团	19,382	192,850.90	0.00
342	002653	海思科	8,665	192,796.25	0.00
343	002191	劲嘉股份	26,600	192,318.00	0.00
344	000785	居然之家	46,900	191,821.00	0.00
345	600155	华创阳安	29,200	189,800.00	0.00
346	000553	安道麦 A	20,800	188,240.00	0.00
347	688006	杭可科技	4,297	188,079.69	0.00
348	002701	奥瑞金	37,200	187,860.00	0.00
349	002281	光迅科技	11,800	185,496.00	0.00
350	002423	中粮资本	25,900	185,444.00	0.00
351	002399	海普瑞	14,300	183,755.00	0.00
352	001914	招商积余	11,900	183,022.00	0.00
353	600667	太极实业	35,400	182,664.00	0.00
354	600500	中化国际	27,581	182,310.41	0.00
355	600959	江苏有线	61,150	181,615.50	0.00
356	600737	中粮糖业	26,017	180,557.98	0.00
357	600195	中牧股份	15,255	177,263.10	0.00
358	000656	金科股份	90,300	172,473.00	0.00
359	002745	木林森	21,241	172,264.51	0.00
360	600582	天地科技	32,934	171,256.80	0.00
361	002266	浙富控股	43,200	168,912.00	0.00
362	002110	三钢闽光	35,900	168,730.00	0.00
363	600259	广晟有色	4,183	168,156.60	0.00
364	300463	迈克生物	9,700	167,810.00	0.00
365	000559	万向钱潮	34,400	167,528.00	0.00

366	002948	青岛银行	49,570	166,555.20	0.00
367	003035	南网能源	29,000	164,430.00	0.00
368	688819	天能股份	4,473	164,338.02	0.00
369	600064	南京高科	24,832	164,139.52	0.00
370	600871	石化油服	81,700	161,766.00	0.00
371	688088	虹软科技	7,185	161,734.35	0.00
372	600764	中国海防	7,000	160,720.00	0.00
373	600967	内蒙一机	19,332	159,682.32	0.00
374	600095	湘财股份	21,100	159,516.00	0.00
375	300212	易华录	7,800	159,198.00	0.00
376	000540	中天金融	104,000	157,040.00	0.00
377	002705	新宝股份	8,900	148,185.00	0.00
378	002242	九阳股份	8,900	146,672.00	0.00
379	300869	康泰医学	4,500	146,565.00	0.00
380	600782	新钢股份	35,600	145,604.00	0.00
381	600707	彩虹股份	34,300	142,002.00	0.00
382	601718	际华集团	48,000	139,680.00	0.00
383	603000	人民网	8,200	138,334.00	0.00
384	000563	陕国投 A	45,570	138,077.10	0.00
385	601333	广深铁路	60,300	136,881.00	0.00
386	601568	北元集团	24,000	136,080.00	0.00
387	600597	光明乳业	12,382	133,230.32	0.00
388	600648	外高桥	11,100	132,645.00	0.00
389	002511	中顺洁柔	9,600	131,904.00	0.00
390	603650	彤程新材	4,195	129,331.85	0.00
391	601598	中国外运	33,600	129,024.00	0.00
392	601187	厦门银行	21,800	124,914.00	0.00
393	300630	普利制药	5,063	124,853.58	0.00
394	600507	方大特钢	20,585	123,921.70	0.00
395	002048	宁波华翔	8,900	123,710.00	0.00
396	601098	中南传媒	12,314	122,893.72	0.00
397	002010	传化智联	23,000	122,820.00	0.00
398	600556	天下秀	18,000	121,320.00	0.00
399	002081	金螳螂	24,500	118,825.00	0.00
400	600373	中文传媒	12,340	118,093.80	0.00
401	603379	三美股份	4,100	116,686.00	0.00
402	600808	马钢股份	41,201	115,774.81	0.00
403	002146	荣盛发展	53,300	115,661.00	0.00
404	603317	天味食品	4,193	115,223.64	0.00
405	600623	华谊集团	18,215	115,118.80	0.00
406	603355	莱克电气	4,100	114,964.00	0.00
407	601991	大唐发电	41,000	114,390.00	0.00
408	000031	大悦城	30,300	113,928.00	0.00

409	600126	杭钢股份	27,510	113,616.30	0.00
410	600901	江苏金租	20,500	112,340.00	0.00
411	000898	鞍钢股份	41,700	111,339.00	0.00
412	000990	诚志股份	12,100	106,480.00	0.00
413	600167	联美控股	16,450	103,964.00	0.00
414	000961	中南建设	46,000	100,740.00	0.00
415	002945	华林证券	7,600	100,168.00	0.00
416	601608	中信重工	28,700	100,163.00	0.00
417	601928	凤凰传媒	12,316	97,542.72	0.00
418	600787	中储股份	19,382	96,328.54	0.00
419	002925	盈趣科技	5,790	95,650.80	0.00
420	600968	海油发展	32,800	94,464.00	0.00
421	601611	中国核建	12,300	93,480.00	0.00
422	600906	财达证券	12,300	93,111.00	0.00
423	600307	酒钢宏兴	56,200	92,730.00	0.00
424	000415	渤海租赁	39,900	88,179.00	0.00
425	600350	山东高速	15,208	86,533.52	0.00
426	603786	科博达	1,300	85,579.00	0.00
427	600339	中油工程	28,700	85,526.00	0.00
428	603056	德邦股份	4,100	85,403.00	0.00
429	603719	良品铺子	2,300	84,801.00	0.00
430	603228	景旺电子	4,165	84,299.60	0.00
431	688143	长盈通	1,938	82,675.08	0.00
432	603868	飞科电器	1,200	80,796.00	0.00
433	601298	青岛港	12,300	69,003.00	0.00
434	600006	东风汽车	12,357	68,952.06	0.00
435	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
436	601228	广州港	21,600	68,040.00	0.00
437	600299	安迪苏	8,200	67,732.00	0.00
438	600377	宁沪高速	8,200	67,404.00	0.00
439	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00
440	600928	西安银行	18,500	65,120.00	0.00
441	002563	森马服饰	12,300	64,452.00	0.00
442	301095	广立微	740	64,002.60	0.00
443	601156	东航物流	4,100	62,566.00	0.00
444	603638	艾迪精密	4,100	61,172.00	0.00
445	601969	海南矿业	8,200	60,762.00	0.00
446	600927	永安期货	3,500	56,420.00	0.00
447	601139	深圳燃气	8,290	54,216.60	0.00
448	300741	华宝股份	2,300	54,119.00	0.00
449	001872	招商港口	3,000	43,080.00	0.00
450	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
451	600956	新天绿能	4,100	39,524.00	0.00

452	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00
453	601828	美凯龙	8,200	38,458.00	0.00
454	601665	齐鲁银行	8,200	34,194.00	0.00
455	301165	锐捷网络	1,077	34,043.97	0.00
456	600917	重庆燃气	4,100	32,636.00	0.00
457	301356	天振股份	614	26,604.62	0.00
458	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
459	301391	卡莱特	247	19,999.59	0.00
460	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
461	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
462	301280	珠城科技	279	12,499.20	0.00
463	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
464	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
465	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
466	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
467	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
468	001203	大中矿业	500	6,465.00	0.00
469	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
470	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
471	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
472	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600522	中天科技	5,944,593.00	0.07
2	688005	容百科技	5,064,487.15	0.06
3	688099	晶晨股份	4,797,936.70	0.05
4	600563	法拉电子	4,536,260.00	0.05
5	601615	明阳智能	4,121,628.00	0.05
6	600157	ST 永泰	4,010,230.00	0.04
7	600256	广汇能源	3,888,405.00	0.04
8	603267	鸿远电子	3,428,213.00	0.04
9	601555	东吴证券	3,309,096.10	0.04
10	600885	宏发股份	3,197,116.28	0.04
11	600765	中航重机	3,105,899.99	0.03
12	603613	国联股份	3,028,359.00	0.03
13	600487	亨通光电	2,967,173.00	0.03
14	600486	扬农化工	2,880,517.00	0.03
15	600399	抚顺特钢	2,717,072.00	0.03

16	601168	西部矿业	2,671,110.00	0.03
17	688002	睿创微纳	2,636,439.97	0.03
18	600298	安琪酵母	2,627,233.00	0.03
19	688521	芯原股份	2,619,314.38	0.03
20	600392	盛和资源	2,609,287.16	0.03

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。

8.4.2 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	600256	广汇能源	6,157,217.50	0.07
2	600522	中天科技	5,314,576.00	0.06
3	601615	明阳智能	4,298,740.24	0.05
4	600392	盛和资源	4,064,323.46	0.04
5	688005	容百科技	3,738,726.22	0.04
6	600563	法拉电子	3,610,772.00	0.04
7	600188	兖矿能源	3,466,326.00	0.04
8	688099	晶晨股份	3,388,966.86	0.04
9	688223	晶科能源	3,040,789.21	0.03
10	601117	中国化学	2,854,620.80	0.03
11	600233	圆通速递	2,785,982.00	0.03
12	600486	扬农化工	2,691,079.00	0.03
13	600732	爱旭股份	2,658,146.00	0.03
14	600157	ST 永泰	2,582,627.00	0.03
15	601689	拓普集团	2,523,872.36	0.03
16	600884	杉杉股份	2,422,229.17	0.03
17	600885	宏发股份	2,386,647.80	0.03
18	600765	中航重机	2,321,372.17	0.03
19	600875	东方电气	2,281,406.80	0.02
20	600039	四川路桥	2,279,508.50	0.02

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

8.4.3 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	444,567,273.77
卖出股票收入（成交）总额	370,402,421.12

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。

8.5 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	428,641,611.58	4.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,642,275.51	0.02
	其中：政策性金融债	1,642,275.51	0.02
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	430,283,887.09	4.81

8.6 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	019679	22 国债 14	1,689,000	170,058,006.17	1.90
2	019666	22 国债 01	1,537,920	156,900,073.11	1.75
3	019638	20 国债 09	859,000	87,010,887.04	0.97
4	019629	20 国债 03	144,000	14,672,645.26	0.16
5	018008	国开 1802	16,000	1,642,275.51	0.02

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.9.1 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

无。

8.10.2 本期国债期货投资评价

无。

8.11 本报告期投资基金情况

8.11.1 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 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	南方中证 500ETF	股票型	交易型开放 式	南方基金管 理股份有限 公司	8,358,947,23 5.53	93.35

8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行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。

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

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	207,865.99
2	应收清算款	138,311.47

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,311,202.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,657,380.40

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
南方中证500ETF联接（LOF）A	719,415	7,217.45	245,531,763.30	4.73%	4,946,812,300.36	95.27%
南方中证500ETF联接（LOF）C	43,039	9,743.85	172,861,599.56	41.22%	246,504,060.09	58.78%
合计	762,454	7,360.06	418,393,362.86	7.46%	5,193,316,360.45	92.54%

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。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	潘建阳	1,524,107.00	1.80%

2	于永祥	926,627.00	1.09%
3	许琛	745,600.00	0.88%
4	郭思含	660,932.00	0.78%
5	薛宜平	636,485.00	0.75%
6	杨钢	551,900.00	0.65%
7	姚红伟	529,900.00	0.63%
8	王西厂	510,100.00	0.60%
9	李鹏	471,000.00	0.56%
10	王庆飞	470,224.00	0.56%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方中证 500ETF 联接（LOF）A	3,919,304.97	0.0755%
	南方中证 500ETF 联接（LOF）C	102,900.62	0.0245%
	合计	4,022,205.59	0.0717%

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）。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	南方中证 500ETF 联接（LOF）A	>100
	南方中证 500ETF 联接（LOF）C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	南方中证 500ETF 联接（LOF）A	50~100
	南方中证 500ETF 联接（LOF）C	0
	合计	50~100

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的產品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的產品份额总量的数量区间（万份）
罗文杰	公募基金	50~100

	私募资产管理计划	0
	合计	50~100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C
基金合同生效日(2009 年 9 月 25 日)基金份额总额	3,223,217,818.45	-
本报告期期初基金份额总额	4,449,109,231.19	272,566,113.00
本报告期基金总申购份额	2,305,756,906.78	702,921,701.42
减：报告期基金总赎回份额	1,562,522,074.31	556,122,154.77
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	5,192,344,063.66	419,365,659.65

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化,目前普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已为本基金提供审计服务 14 年,本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币 120,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 1 月 29 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局
受到的具体措施类型	责令改正行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	个别基金内部控制不完善
管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见)	基金管理人已及时按要求改正并报告
其他	/

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	669,589,047.43	84.29%	66,959.21	84.29%	-
华泰证券	2	124,802,477.51	15.71%	12,484.15	15.71%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

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

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

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

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

无

退租交易单元：

无

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安	468,016,674.77	99.96%	4,417,000,000.00	100.00%	-	-	3,043,928,823.78	100.00%
华泰证券	194,685.39	0.04%	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

中天证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	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	2022-01-01
3	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
4	南方基金管理股份有限公司关于一路财富（北京）基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-25
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-12
6	南方基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金单笔赎回最低份额限制的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-22
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	2022-03-26
8	南方基金关于旗下部分基金增加海通证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-11
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-16
10	南方基金关于旗下部分基金增加西南证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-21
11	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会	2022-04-22

		会基金电子披露网站	
12	南方基金关于旗下部分基金增加华夏财富为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-29
13	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-12
14	南方基金关于旗下部分基金增加中金财富为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-13
15	南方基金关于旗下部分基金增加盛京银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-18
16	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金增加侧袋机制并相应修订基金合同有关条款的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-18
17	南方基金关于旗下部分基金增加吉林银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-27
18	南方基金管理股份有限公司关于调整旗下基金大额申购等业务安排的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-27
19	南方基金管理股份有限公司关于董事长变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-28
20	南方基金关于旗下部分基金增加江苏银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-01
21	南方基金关于旗下部分基金增加鼎信汇金为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-16
22	南方基金关于旗下部分基金增加泰信财富为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-08
23	南方基金关于旗下部分基金增加光大证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-12
24	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-16
25	关于注意防范冒用南方基金及子公司、南方基金投研人员名义从事诈骗活动的风险提示	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	2022-07-20
26	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	2022-07-27

	关联方承销证券的关联交易公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
27	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-09-09
28	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	2022-09-17
29	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	2022-10-18
30	南方基金关于旗下部分基金增加攀赢基金为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-10-21
31	南方基金关于旗下部分基金增加粤开证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-10-25
32	南方基金关于旗下部分基金增加渤海银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-10-26
33	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-02
34	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-11
35	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-16
36	南方基金关于旗下部分基金增加博时财富为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-24
37	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-03
38	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行基金费率优惠活动的公告	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	2022-12-15
39	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	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	2022-12-16
40	关于注意防范冒用南方基金及子公司、南方基金投研人员名义从事诈骗活动的风险提示	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	2022-12-16

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

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

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

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；

6、《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)2022 年年度报告》原文。

13.2 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。

13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>