

# 上证 380 交易型开放式指数证券投资 基金 2020 年年度报告

2020 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 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，并由总经理（代为履行董事长职务）签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 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 2020 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.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
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.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 审计报告.....	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告.....	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59

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 .....	60
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 .....	60
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 .....	60
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 .....	60
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	60
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
8.12	投资组合报告附注 .....	61
§9	基金份额持有人信息 .....	62
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	62
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
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 .....	63
§10	开放式基金份额变动 .....	63
§11	重大事件揭示 .....	63
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	63
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 .....	63
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
11.4	基金投资策略的改变 .....	64
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
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 .....	64
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
11.8	其他重大事件 .....	66
§12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
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 .....	66
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
§13	备查文件目录 .....	67
13.1	备查文件目录 .....	67
13.2	存放地点 .....	67
13.3	查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方上证 380ETF
场内简称	380ETF 或 上证 380ETF
基金主代码	510290
交易代码	510290
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 16 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	80,448,915.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 11 月 8 日

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	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	上证 380 指数，简称 380 指数
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	021-60637111
传真	0755-82763889	021-60635778
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518017	100033
法定代表人	张海波	田国立

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

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金年度报告备置地点	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	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	27,050,205.78	-11,863,424.19	-5,968,344.91
本期利润	42,938,322.80	50,725,173.34	-65,063,327.24
加权平均基金份额本期利润	0.4063	0.3403	-0.4648
本期加权平均净值利润率	24.27%	24.53%	-33.14%
本期基金份额净值增长率	26.02%	31.26%	-29.18%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	48,947,510.37	48,261,550.99	20,691,579.74
期末可供分配基金份额利润	0.6084	0.3436	0.1394
期末基金资产净值	151,624,654.41	210,060,594.17	169,140,494.74
期末基金份额净值	1.8847	1.4956	1.1394
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	88.47%	49.56%	13.94%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

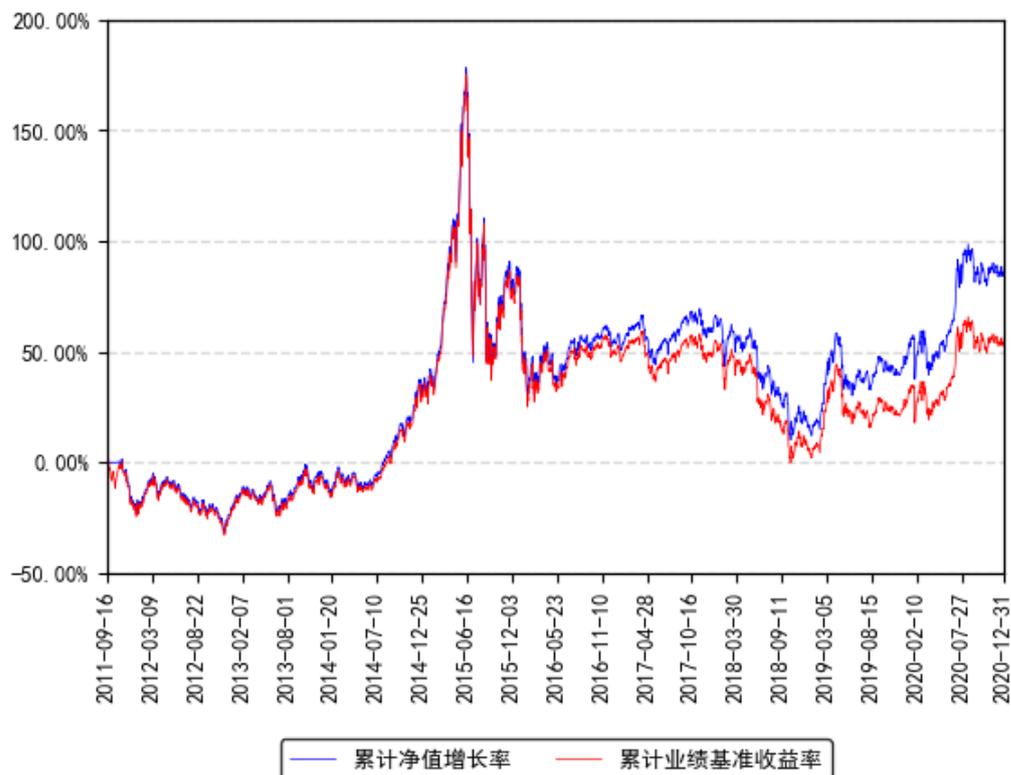
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.15%	0.96%	3.79%	0.96%	0.36%	0.00%
过去六个月	13.00%	1.30%	10.92%	1.30%	2.08%	0.00%
过去一年	26.02%	1.44%	20.74%	1.44%	5.28%	0.00%
过去三年	17.14%	1.42%	4.35%	1.43%	12.79%	-0.01%
过去五年	2.36%	1.43%	-13.36%	1.44%	15.72%	-0.01%
自基金合同生效起至今	88.47%	1.66%	56.29%	1.66%	32.18%	0.00%

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

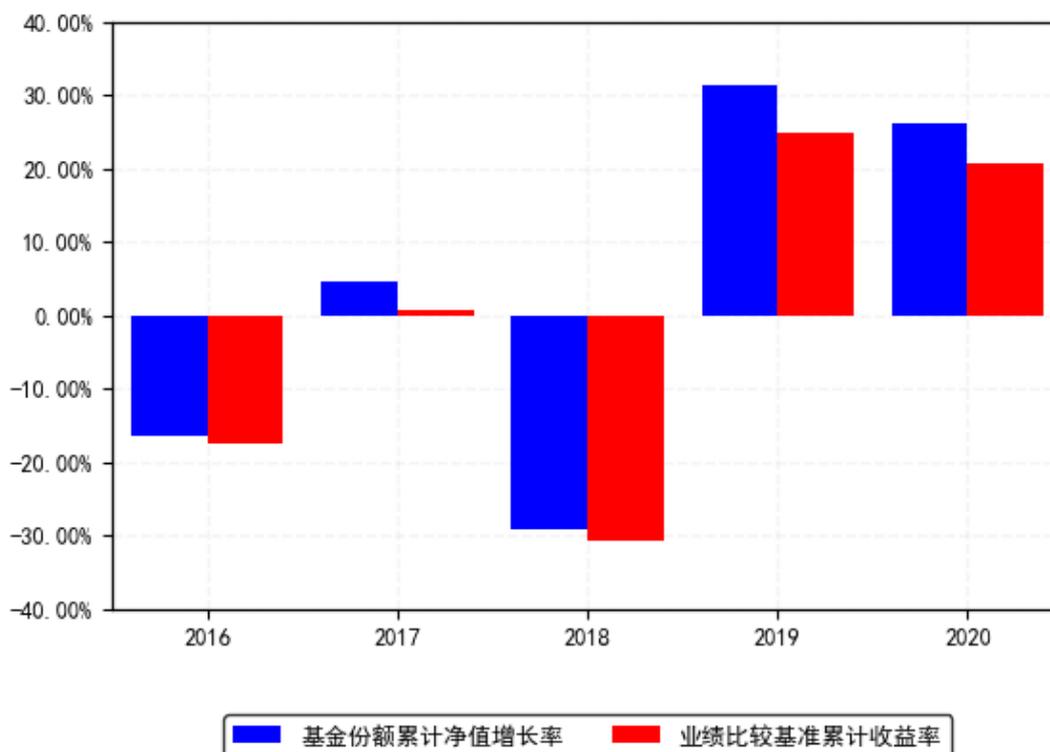
## 准收益率变动的比较

南方上证380ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 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

南方上证380ETF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)2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)2.20%。目前，公司总部设在深

圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模近 12000 亿元，旗下管理 233 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙伟	本基金基金经理	2019 年 7 月 12 日	-	10 年	管理学学士，特许金融分析师（CFA）、注册会计师（CPA），具有基金从业资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010 年 2 月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、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；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，任南方中证 500 工业 ETF、南方中证 500 原材料 ETF、南方上证 380ETF、南方上证 380ETF 联接基金经理；2020 年 12 月 1 日至今，任改革基金、高铁基金基金经

					理。
--	--	--	--	--	----

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

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

#### 4.1.3 基金经理薪酬机制

公司基金经理薪酬由工资、奖金等部分构成。工资由基金经理的 MD 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，按超出基础创收以上部分的一定比例计提激励奖金，并依据管理产品的实际业绩贡献实施分配。

### 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 3 次，是由于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 指数上涨 20.74%。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

- （1）新股上市初期涨幅较大的影响；
- （2）申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- （3）报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离；
- （4）根据指数成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.8847 元，报告期内，份额净值增长率为 26.02%，同期业绩基准增长率为 20.74%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

疫情影响消退，经济生活回暖，我国货币政策和财政政策预计将回归常态。科技产业景气向上，资本市场创新活跃，相关行业仍具有中长期投资价值；另一方面，随着估值分化达到历史较高水平，低估值行业或将迎来估值修复机会。

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 2020 年度发布的《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金宣传推介材料管理暂行规定》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，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》、《防控内幕信息及交易管理制度》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理管理办法（试行）》、《内控稽核工作操作指引》、《异常交易管理制度》、《员工证券投资管理辦法》、《离任审计及审查制度》等一系列与监察稽核和合规内控相关的管理制度。

在遵循和完善制度机制建设的基础上，本基金管理人积极开展形式丰富的合规培训与考试，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，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，排查业务中的风险点并完善内控措施，促进公司业务合规运作、稳健经营；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，及时检查基金销售业务的合法合规情况，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；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，通过研究监管形势，参考同业先进经验，按照风险为本的工作方法，积极主动的采取有效措施防控洗钱风险。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，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核及合规管理工作的科学性和有效性，强化信息技术在监察稽核及合规管理工作中的运用，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、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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同约定，当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。基金管理人对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；本基金每年收益分配次数最多为 12 次，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定。基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；本基金收益分配采取现金分红方式；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

#### 4.9 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

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本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 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(2021)第 24319 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	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了上证 380 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“南方上证 380ETF 基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(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(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,公允反映了南方上证 380ETF 基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</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,我们独立于南方上证 380ETF 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>南方上证 380ETF 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上证 380ETF 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上证 380ETF 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上证 380ETF 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</p>



单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	729,953.86	1,010,339.08
结算备付金		647,077.39	319,368.87
存出保证金		176,981.52	132,443.51
交易性金融资产	7.4.7.2	150,347,492.72	208,919,874.35
其中：股票投资		150,250,492.72	208,731,874.35
基金投资		-	-
债券投资		97,000.00	188,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		735.52	51,253.00
应收利息	7.4.7.5	325.52	415.36
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		151,902,566.53	210,433,694.17
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 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		-	-
应付证券清算款		-	30,493.75
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		64,563.25	88,197.73
应付托管费		12,912.66	17,639.57

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,436.01	5,550.21
应交税费		0.20	7,218.74
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	195,000.00	224,000.00
负债合计		277,912.12	373,100.00
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	80,448,915.00	140,448,915.00
未分配利润	7.4.7.10	71,175,739.41	69,611,679.17
所有者权益合计		151,624,654.41	210,060,594.17
负债和所有者权益总计		151,902,566.53	210,433,694.17

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.8847 元，基金份额总额 80,448,915.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：上证 380 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		44,410,811.13	52,549,224.60
1. 利息收入		13,251.47	13,415.40
其中：存款利息收入	7.4.7.11	13,091.74	13,139.50
债券利息收入		159.73	275.90
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)		28,527,886.90	-10,035,234.74
其中: 股票投资收益	7.4.7.12	25,018,057.45	-14,207,597.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	198,747.75	107,547.60
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	298,097.09	214,796.12
股利收益	7.4.7.16	3,012,984.61	3,850,018.56
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	15,888,117.02	62,588,597.53
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	-18,444.26	-17,553.59
减: 二、费用		1,472,488.33	1,824,051.26
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	884,985.63	1,031,520.08
2. 托管费	7.4.10.2.2	176,997.08	206,304.04
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	106,079.12	148,761.83
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		1,073.69	774.20
7. 其他费用	7.4.7.20	303,352.81	436,691.11
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		42,938,322.80	50,725,173.34
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		42,938,322.80	50,725,173.34

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：上证 380 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	140,448,915.00	69,611,679.17	210,060,594.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	42,938,322.80	42,938,322.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-60,000,000.00	-41,374,262.56	-101,374,262.56
其中：1. 基金申购款	38,000,000.00	20,591,375.69	58,591,375.69
2. 基金赎回款	-98,000,000.00	-61,965,638.25	-159,965,638.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	80,448,915.00	71,175,739.41	151,624,654.41
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	148,448,915.00	20,691,579.74	169,140,494.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	50,725,173.34	50,725,173.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-8,000,000.00	-1,805,073.91	-9,805,073.91

其中：1. 基金申购款	94,000,000.00	38,176,740.63	132,176,740.63
2. 基金赎回款	-102,000,000.00	-39,981,814.54	-141,981,814.54
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“—”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	140,448,915.00	69,611,679.17	210,060,594.17

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

上证 380 交易型开放式指数证券投资基金(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[2011]1096 号《关于核准上证 380 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》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《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 330,429,892.00 元(含募集股票市值)，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(2011)第 381 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 330,448,915.00 份基金份额，其中通过直销机构网下现金认购部分的认购资金利息折合 19,023.00 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数上证 380 指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。本基金主要投资于标的指数的成份股和备选成份股；本基金也可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票以及存托凭证)、新股、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，权证、股指

期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为上证 380 指数。

本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司以本基金为目标 ETF，于 2011 年 9 月 20 日募集成立了上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“上证 380ETF 联接基金”)。上证 380ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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 2021 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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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 2020 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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值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

#### (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、债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。

#### 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。

#### 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、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。

#### 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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或者发行价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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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

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。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 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。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)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(可转换债券和私募债券除外),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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	729,953.86	1,010,339.08
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	729,953.86	1,010,339.08

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	131,462,035.30	150,250,492.72	18,788,457.42
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	97,000.00	97,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	97,000.00	97,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	131,559,035.30	150,347,492.72	18,788,457.42
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	205,758,613.95	208,731,874.35	2,973,260.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	188,000.00	188,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	188,000.00	188,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	205,946,613.95	208,919,874.35	2,973,260.40

注：于 2020 年 12 月 31 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为 0.00 元(2019 年 12 月 31 日：0.00 元)。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,173,960.00	-	-	-
一指期货	1,173,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,173,960.00	-	-	-
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,042,920.00	-	-	-
一指期货	1,042,920.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,042,920.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资/国债期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2103	IC2103	1	1,250,280.00	76,320.00
	减：可抵销期货暂收款			76,320.00
	股指期货投资净额		-	

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	80.29	211.17
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	236.37	181.82
应收债券利息	7.87	18.96
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	0.99	3.41
合计	325.52	415.36

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
可收退补款	-	-
应收退补款	-	-

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	5,436.01	5,550.21
银行间市场应付交易费用	-	-

合计	5,436.01	5,550.21
----	----------	----------

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应退退补款	-	-
预提费用	160,000.00	174,000.00
应付指数使用费	35,000.00	50,000.00
可退退补款	-	-
其他	-	-
合计	195,000.00	224,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	140,448,915.00	140,448,915.00
本期申购	38,000,000.00	38,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-98,000,000.00	-98,000,000.00
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	80,448,915.00	80,448,915.00

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	48,261,550.99	21,350,128.18	69,611,679.17
本期利润	27,050,205.78	15,888,117.02	42,938,322.80
本期基金份额交易产生的变动数	-26,364,246.40	-15,010,016.16	-41,374,262.56
其中：基金申购款	15,074,881.47	5,516,494.22	20,591,375.69
基金赎回款	-41,439,127.87	-20,526,510.38	-61,965,638.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,947,510.37	22,228,229.04	71,175,739.41

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020	上年度可比期间 2019 年 1 月
----	-------------------------	--------------------

	年 12 月 31 日	1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	5,374.30	8,916.47
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	7,651.24	4,164.04
其他	66.20	58.99
合计	13,091.74	13,139.50

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	15,828,393.65	-3,210,256.21
股票投资收益——赎回差价收入	9,189,663.80	-10,997,340.81
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	25,018,057.45	-14,207,597.02

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	69,879,782.11	87,779,936.48
减：卖出股票成本总额	54,051,388.46	90,990,192.69
买卖股票差价收入	15,828,393.65	-3,210,256.21

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	159,965,638.25	141,981,814.54
减：现金支付赎回款总额	-413,565.75	-627,445.46
减：赎回股票成本总额	151,189,540.20	153,606,600.81
赎回差价收入	9,189,663.80	-10,997,340.81

##### 7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票申购差价收入。

##### 7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
债券投资收益——买卖债券（、 债转股及债券到期兑付）差价收 入	198,747.75	107,547.60
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	198,747.75	107,547.60

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	1,181,923.00	805,812.40
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	983,000.00	698,000.00
减：应收利息总额	175.25	264.80
买卖债券差价收入	198,747.75	107,547.60

#### 7.4.7.13.3 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。

#### 7.4.7.13.4 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。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

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。

### 7.4.7.14 贵金属投资收益

#### 7.4.7.14.1 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。

#### 7.4.7.14.2 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。

#### 7.4.7.14.3 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。

#### 7.4.7.14.4 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。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 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。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间收益金额 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股指期货-投资收益	298,097.09	214,796.12

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,012,984.61	3,850,018.56
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	3,012,984.61	3,850,018.56

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	15,815,197.02	62,585,197.53
——股票投资	15,815,197.02	62,585,197.53
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	72,920.00	3,400.00
——权证投资	-	-
——期货投资	72,920.00	3,400.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-

合计	15,888,117.02	62,588,597.53
----	---------------	---------------

注：本基金本期公允价值变动损益-股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益为 0.00 元(2019 年度：0.00 元)。

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-18,444.26	-17,553.59
合计	-18,444.26	-17,553.59

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	106,079.12	148,761.83
银行间市场交易费用	-	-
合计	106,079.12	148,761.83

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	54,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	140,000.00	200,000.00
账户维护费	-	360.00
银行费用	3,352.81	2,331.11
上市费	-	60,000.00
合计	303,352.81	436,691.11

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的费率计提，逐日累计，按季支付。于 2019 年度，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 50,000 元；自 2020 年度起，当本基金的季度日均基金资产净值大于人民币 5,000 万元时，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 35,000 元，当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5,000 万元时，无标的指数许可使用费的收取下限。

## 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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
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
南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“南方上证 380ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理股份有限公司关于公司股东及股东出资比例变更的公告》，经南方基金管理股份有限公司(以下简称“南方基金”)股东大会决议，并经中国证监会证监许可[2019]1361 号《关于核准南方基金管理股份有限公司变更股权的批复》核准，新增厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)和厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)为南方基金的股东，并于 2019 年 7 月 31 日完成了工商变更登记手续。

## 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	144,702,204.19	100.00%	168,174,671.71	100.00%

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	14,469.89	100.00%	5,436.01	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	16,817.37	100.00%	5,550.21	100.00%

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	884,985.63	1,031,520.08
其中：支付销售机构的客户 维护费	0.00	0.00

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托 管费	176,997.08	206,304.04

注：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 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	68,399,941.00	85.02%	114,399,941.00	81.45%

注：南方上证 380ETF 联接基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 7.4.10.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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
建设银行	729,953.86	5,374.30	1,010,339.08	8,916.47

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

#### 7.4.10.7 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	688510	航亚科技	网下申购	1,863	15,220.71

上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	-	-	-	-	-

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2020 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	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
605277	新亚电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688215	瑞晟智能	2020 年 8 月 20 日	2021 年 3 月 1 日	科创板新股锁定期	34.73	46.12	615	21,358.95	28,363.80	-
688221	前沿生物	2020 年	2021 年	科创板	20.50	17.15	713	14,616.50	12,227.95	-

		10月20日	4月28日	新股锁定期						
688338	赛科希德	2020年7月27日	2021年2月8日	科创板新股锁定期	50.35	54.59	421	21,197.35	22,982.39	-
688590	新致软件	2020年11月27日	2021年6月7日	科创板新股锁定期	10.73	15.79	1,122	12,039.06	17,716.38	-

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	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113044	大秦转债	2020年12月16日	2021年1月15日	新债未上市	100.00	100.00	850	85,000.00	85,000.00	-
113044	大秦转债	2020年12月17日	2021年1月15日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-
113614	健20转债	2020年12月18日	2021年1月18日	配债未上市	100.00	100.00	110	11,000.00	11,000.00	-

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、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

**7.4.12.2 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。

**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**

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 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

本基金是指数型基金，紧密跟踪上证 380 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪上证 380 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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

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

#### 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级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 2020 年 12 月 31 日，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占基金资产净值的比例为 0.06% (2019 年 12 月 31 日：0.09%)。

### 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。本基金为履行与金融负债有关的义务而调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，可能产生基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的投资股指期货，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，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。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

#### 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 2020 年 12 月 31 日，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 0.12%。

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、存出保证金和债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	729,953.86	-	-	-	729,953.86
结算备付金	647,077.39	-	-	-	647,077.39
存出保证金	1,942.32	-	-	175,039.20	176,981.52
交易性金融资产	-	-	97,000.00	150,250,492.72	150,347,492.72
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	325.52	325.52
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	735.52	735.52
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,378,973.57	-	97,000.00	150,426,592.96	151,902,566.53
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	64,563.25	64,563.25
应付托管费	-	-	-	12,912.66	12,912.66
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	5,436.01	5,436.01
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.20	0.20
其他负债	-	-	-	195,000.00	195,000.00
负债总计	-	-	-	277,912.12	277,912.12
利率敏感度缺口	1,378,973.57	-	97,000.00	150,148,680.84	151,624,654.41
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,010,339.08	-	-	-	1,010,339.08
结算备付金	319,368.87	-	-	-	319,368.87
存出保证金	6,885.11	-	-	125,558.40	132,443.51
交易性金融资产	-	-	188,000.00	208,731,874.35	208,919,874.35
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	415.36	415.36
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	51,253.00	51,253.00
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,336,593.06	-	188,000.00	208,909,101.1	210,433,694.

				1	17
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	88,197.73	88,197.73
应付托管费	-	-	-	17,639.57	17,639.57
应付证券清算款	-	-	-	30,493.75	30,493.75
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	5,550.21	5,550.21
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	7,218.74	7,218.74
其他负债	-	-	-	224,000.00	224,000.00
负债总计	-	-	-	373,100.00	373,100.00
利率敏感度缺口	1,336,593.06	-	188,000.00	208,536,001.11	210,060,594.17

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

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.06% (2019 年 12 月 31 日：0.09%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2019 年 12 月 31 日：同)。

#### 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

不适用。

##### 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。本基金主要投资于证券交易所上市交易

的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，跟踪上证 380 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，上证 380 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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	150,250,492.72	99.09	208,731,874.35	99.37
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	150,250,492.72	99.09	208,731,874.35	99.37

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

#### 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(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2020 年 12 月 31 日)	上年度末(2019 年 12 月 31 日)
	1.组合自身基准上升 5%	7,554,295.16	10,302,421.84
	2.组合自身基准下降 5%	-7,554,295.16	-10,302,421.84

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

- (1) 基金申购款

于 2020 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 58,591,375.69 元(2019 年度：132,176,740.63 元)，其中包括以股票支付的申购款 52,943,602.94 元和以现金支付的申购款 5,647,772.75 元(2019 年度：其中包括以股票支付的申购款 131,076,355.54 元和以现金支付的申购款 1,100,385.09 元)。

(2) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为 150,160,608.55 元，属于第二层次的余额为 186,884.17 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 206,422,195.64 元，第二层次 2,497,678.71 元，无第三层次)。

(ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(3) 除基金申购款和公允价值外，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

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	150,250,492.72	98.91
	其中：股票	150,250,492.72	98.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	97,000.00	0.06
	其中：债券	97,000.00	0.06
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,377,031.25	0.91
8	其他资产	178,042.56	0.12
9	合计	151,902,566.53	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而下表中的合计项中不含可退替代款估值增值；

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	173,664.00	0.11
B	采矿业	6,292,886.83	4.15
C	制造业	88,662,514.24	58.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,039,795.76	3.98
E	建筑业	3,769,681.26	2.49
F	批发和零售业	8,784,906.09	5.79
G	交通运输、仓储和邮政业	6,468,399.19	4.27
H	住宿和餐饮业	1,338,517.96	0.88
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,201,943.93	4.75
J	金融业	7,487,962.96	4.94
K	房地产业	5,614,943.95	3.70
L	租赁和商务服务业	1,865,655.48	1.23

M	科学研究和技术服务业	1,102,092.00	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	1,913,267.40	1.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,665,560.00	1.10
R	文化、体育和娱乐业	1,393,974.00	0.92
S	综合	357,592.76	0.24
	合计	150,133,357.81	99.02

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	99,418.53	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,716.38	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	117,134.91	0.08

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 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

### 8.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产
----	------	------	-------	------	-------

				(元)	净值比例 (%)
1	600426	华鲁恒升	53,800	2,006,740.00	1.32
2	600015	华夏银行	290,500	1,815,625.00	1.20
3	688008	澜起科技	21,400	1,773,632.00	1.17
4	600079	人福医药	51,000	1,727,880.00	1.14
5	603882	金域医学	13,000	1,665,560.00	1.10
6	603899	晨光文具	17,542	1,553,519.52	1.02
7	601233	桐昆股份	70,500	1,451,595.00	0.96
8	600132	重庆啤酒	11,400	1,356,486.00	0.89
9	600885	宏发股份	24,604	1,334,028.88	0.88
10	601799	星宇股份	6,500	1,303,250.00	0.86
11	603806	福斯特	14,558	1,243,253.20	0.82
12	688002	睿创微纳	10,500	1,165,500.00	0.77
13	600486	扬农化工	8,767	1,157,244.00	0.76
14	601966	玲珑轮胎	32,427	1,140,457.59	0.75
15	600529	山东药玻	22,500	1,128,375.00	0.74
16	601838	成都银行	102,300	1,091,541.00	0.72
17	603345	安井食品	5,600	1,080,072.00	0.71
18	600219	南山铝业	338,500	1,069,660.00	0.71
19	603816	顾家家居	14,920	1,052,009.20	0.69
20	600862	中航高科	32,900	990,290.00	0.65
21	601636	旗滨集团	76,103	974,118.40	0.64
22	601997	贵阳银行	121,500	965,925.00	0.64
23	601128	常熟银行	129,419	955,112.22	0.63
24	603486	科沃斯	10,700	946,843.00	0.62
25	600177	雅戈尔	131,100	942,609.00	0.62
26	600559	老白干酒	29,659	933,665.32	0.62
27	601727	上海电气	172,500	931,500.00	0.61
28	603658	安图生物	6,400	929,152.00	0.61
29	603338	浙江鼎力	9,178	928,721.82	0.61
30	600460	士兰微	37,145	928,625.00	0.61
31	603678	火炬电子	12,800	925,440.00	0.61
32	603939	益丰药房	10,040	905,507.60	0.60
33	600711	盛屯矿业	96,800	886,688.00	0.58
34	600511	国药股份	17,825	878,950.75	0.58
35	603613	国联股份	6,740	863,259.20	0.57
36	603444	吉比特	2,000	852,000.00	0.56
37	600369	西南证券	156,800	843,584.00	0.56
38	600988	赤峰黄金	47,100	843,561.00	0.56
39	603267	鸿远电子	6,540	842,090.40	0.56
40	600845	宝信软件	12,140	837,417.20	0.55
41	600498	烽火通信	33,100	797,048.00	0.53

42	601216	君正集团	159,300	788,535.00	0.52
43	600754	锦江酒店	15,100	778,103.00	0.51
44	600380	健康元	55,286	769,028.26	0.51
45	600879	航天电子	102,700	768,196.00	0.51
46	603737	三棵树	5,060	766,590.00	0.51
47	601689	拓普集团	19,895	764,564.85	0.50
48	603866	桃李面包	12,860	760,026.00	0.50
49	600018	上港集团	164,100	749,937.00	0.49
50	603233	大参林	9,272	726,461.20	0.48
51	600372	中航电子	36,400	715,260.00	0.47
52	600415	小商品城	128,500	708,035.00	0.47
53	600233	圆通速递	59,700	686,550.00	0.45
54	601117	中国化学	116,400	683,268.00	0.45
55	600563	法拉电子	6,327	680,468.85	0.45
56	603456	九洲药业	19,000	680,200.00	0.45
57	601615	明阳智能	35,400	671,892.00	0.44
58	600549	厦门钨业	39,800	670,630.00	0.44
59	600153	建发股份	81,100	665,831.00	0.44
60	600765	中航重机	26,600	665,000.00	0.44
61	688122	西部超导	8,300	659,933.00	0.44
62	600667	太极实业	69,595	657,672.75	0.43
63	603236	移远通信	3,500	654,290.00	0.43
64	600655	豫园股份	73,300	651,637.00	0.43
65	600998	九州通	35,400	642,864.00	0.42
66	600170	上海建工	210,200	632,702.00	0.42
67	600674	川投能源	62,300	626,115.00	0.41
68	603858	步长制药	26,912	620,859.84	0.41
69	603883	老百姓	9,660	606,937.80	0.40
70	601231	环旭电子	31,326	605,844.84	0.40
71	600642	申能股份	115,944	605,227.68	0.40
72	600409	三友化工	58,461	599,225.25	0.40
73	600392	盛和资源	66,260	589,051.40	0.39
74	600008	首创股份	207,940	588,470.20	0.39
75	603027	千禾味业	15,672	585,819.36	0.39
76	601018	宁波港	149,200	584,864.00	0.39
77	601992	金隅集团	196,800	584,496.00	0.39
78	603638	艾迪精密	8,450	582,543.00	0.38
79	600580	卧龙电驱	37,082	578,479.20	0.38
80	601456	国联证券	26,700	569,511.00	0.38
81	600848	上海临港	28,300	566,566.00	0.37
82	603129	春风动力	3,200	557,408.00	0.37
83	600315	上海家化	16,000	555,680.00	0.37
84	603127	昭衍新药	5,380	554,731.80	0.37

85	600641	万业企业	27,140	547,413.80	0.36
86	600256	广汇能源	191,300	541,379.00	0.36
87	601058	赛轮轮胎	89,240	539,009.60	0.36
88	600323	瀚蓝环境	21,677	537,806.37	0.35
89	601717	郑煤机	49,200	537,756.00	0.35
90	600027	华电国际	153,800	522,920.00	0.34
91	600704	物产中大	119,500	522,215.00	0.34
92	600160	巨化股份	63,700	516,607.00	0.34
93	600260	凯乐科技	47,040	512,736.00	0.34
94	600811	东方集团	140,265	511,967.25	0.34
95	603039	泛微网络	5,002	505,001.92	0.33
96	600728	佳都科技	66,400	503,976.00	0.33
97	603605	珀莱雅	2,800	498,400.00	0.33
98	600236	桂冠电力	111,650	497,959.00	0.33
99	600325	华发股份	80,000	496,800.00	0.33
100	600258	首旅酒店	23,268	493,746.96	0.33
101	600167	联美控股	43,211	490,444.85	0.32
102	603317	天味食品	5,900	485,216.00	0.32
103	600967	内蒙一机	39,892	485,086.72	0.32
104	600820	隧道股份	89,100	482,031.00	0.32
105	603927	中科软	12,000	481,080.00	0.32
106	688006	杭可科技	5,700	473,271.00	0.31
107	600597	光明乳业	28,900	469,914.00	0.31
108	600583	海油工程	104,400	468,756.00	0.31
109	603707	健友股份	13,223	464,523.99	0.31
110	601577	长沙银行	48,500	461,720.00	0.30
111	603606	东方电缆	18,500	461,575.00	0.30
112	600446	金证股份	28,458	461,304.18	0.30
113	600567	山鹰国际	151,847	458,577.94	0.30
114	603520	司太立	6,900	454,227.00	0.30
115	603712	七一二	10,900	453,985.00	0.30
116	603185	上机数控	3,278	453,839.10	0.30
117	600282	南钢股份	145,000	452,400.00	0.30
118	600663	陆家嘴	41,540	444,478.00	0.29
119	603000	人民网	26,100	441,090.00	0.29
120	600026	中远海能	65,500	437,540.00	0.29
121	600273	嘉化能源	47,300	437,052.00	0.29
122	600216	浙江医药	31,935	434,316.00	0.29
123	600188	兖州煤业	41,900	421,933.00	0.28
124	603218	日月股份	13,700	414,425.00	0.27
125	600755	厦门国贸	61,788	412,743.84	0.27
126	600685	中船防务	15,500	411,990.00	0.27
127	600363	联创光电	16,700	411,321.00	0.27

128	600039	四川路桥	90,086	406,287.86	0.27
129	600989	宝丰能源	34,600	404,820.00	0.27
130	600252	中恒集团	131,200	402,784.00	0.27
131	603583	捷昌驱动	5,180	400,155.00	0.26
132	600720	祁连山	29,341	398,450.78	0.26
133	600211	西藏药业	5,900	396,952.00	0.26
134	600777	新潮能源	256,800	395,472.00	0.26
135	603198	迎驾贡酒	11,300	394,370.00	0.26
136	601222	林洋能源	49,500	392,040.00	0.26
137	603713	密尔克卫	2,900	379,871.00	0.25
138	600850	华东电脑	14,071	378,932.03	0.25
139	600185	格力地产	58,400	377,264.00	0.25
140	600120	浙江东方	63,072	376,539.84	0.25
141	603588	高能环境	26,700	374,334.00	0.25
142	600206	有研新材	28,000	374,080.00	0.25
143	600171	上海贝岭	26,620	373,212.40	0.25
144	600459	贵研铂业	14,477	372,782.75	0.25
145	601699	潞安环能	56,500	367,250.00	0.24
146	601952	苏垦农发	26,000	365,560.00	0.24
147	603228	景旺电子	12,080	364,212.00	0.24
148	600056	中国医药	25,260	361,975.80	0.24
149	600682	南京新百	31,776	357,797.76	0.24
150	600673	东阳光	71,092	357,592.76	0.24
151	600376	首开股份	60,900	357,483.00	0.24
152	600688	上海石化	103,800	357,072.00	0.24
153	601333	广深铁路	160,100	355,422.00	0.23
154	603077	和邦生物	250,114	355,161.88	0.23
155	600507	方大特钢	50,903	353,266.82	0.23
156	600021	上海电力	49,400	351,728.00	0.23
157	600197	伊力特	12,350	349,011.00	0.23
158	603960	克来机电	7,400	347,430.00	0.23
159	601200	上海环境	31,820	346,838.00	0.23
160	601000	唐山港	139,832	346,783.36	0.23
161	600782	新钢股份	75,300	345,627.00	0.23
162	603298	杭叉集团	16,400	344,564.00	0.23
163	603128	华贸物流	37,070	344,380.30	0.23
164	601865	福莱特	8,500	339,150.00	0.22
165	600984	建设机械	27,400	338,390.00	0.22
166	600970	中材国际	49,180	338,358.40	0.22
167	603301	振德医疗	5,400	337,662.00	0.22
168	603568	伟明环保	17,771	336,405.03	0.22
169	600803	新奥股份	24,550	333,634.50	0.22
170	603068	博通集成	3,900	332,592.00	0.22

171	600466	蓝光发展	71,600	331,508.00	0.22
172	603596	伯特利	9,600	328,512.00	0.22
173	601598	中国外运	74,400	327,360.00	0.22
174	601666	平煤股份	54,911	325,622.23	0.21
175	603489	八方股份	1,700	323,510.00	0.21
176	601098	中南传媒	33,900	323,067.00	0.21
177	601016	节能风电	94,159	322,965.37	0.21
178	600373	中文传媒	32,000	322,880.00	0.21
179	600348	阳泉煤业	56,800	318,648.00	0.21
180	600073	上海梅林	30,940	318,372.60	0.21
181	603885	吉祥航空	27,840	316,540.80	0.21
182	603599	广信股份	13,200	316,404.00	0.21
183	603686	龙马环卫	19,660	316,132.80	0.21
184	600388	龙净环保	35,307	313,526.16	0.21
185	603113	金能科技	19,100	312,285.00	0.21
186	600057	厦门象屿	50,900	306,418.00	0.20
187	600094	大名城	75,200	302,304.00	0.20
188	600808	马钢股份	112,700	299,782.00	0.20
189	600562	国睿科技	17,600	299,552.00	0.20
190	688019	安集科技	1,000	297,800.00	0.20
191	601311	骆驼股份	31,730	296,675.50	0.20
192	600835	上海机电	15,190	295,597.40	0.19
193	600062	华润双鹤	24,639	295,421.61	0.19
194	603368	柳药股份	13,701	295,119.54	0.19
195	603043	广州酒家	7,600	294,348.00	0.19
196	688139	海尔生物	4,500	293,805.00	0.19
197	600141	兴发集团	26,460	291,853.80	0.19
198	600675	中华企业	86,320	290,035.20	0.19
199	600643	爱建集团	38,300	288,016.00	0.19
200	603018	华设集团	26,300	287,985.00	0.19
201	600993	马应龙	14,208	286,149.12	0.19
202	600072	中船科技	20,900	285,285.00	0.19
203	601958	金钼股份	45,700	283,797.00	0.19
204	600596	新安股份	26,049	282,631.65	0.19
205	600863	内蒙华电	109,678	281,872.46	0.19
206	600138	中青旅	27,313	280,231.38	0.18
207	603601	再升科技	20,400	278,460.00	0.18
208	600729	重庆百货	9,570	276,573.00	0.18
209	600740	山西焦化	46,550	274,179.50	0.18
210	600312	平高电气	38,396	274,147.44	0.18
211	600612	老凤祥	6,033	273,475.89	0.18
212	600378	昊华科技	13,000	273,130.00	0.18
213	600776	东方通信	22,600	267,810.00	0.18

214	600337	美克家居	58,366	266,732.62	0.18
215	603429	集友股份	8,960	266,201.60	0.18
216	603881	数据港	4,400	264,484.00	0.17
217	600125	铁龙物流	43,148	259,750.96	0.17
218	603650	彤程新材	8,300	257,300.00	0.17
219	600566	济川药业	12,600	254,898.00	0.17
220	600742	一汽富维	25,280	253,811.20	0.17
221	603387	基蛋生物	7,384	252,754.32	0.17
222	603733	仙鹤股份	10,000	250,000.00	0.16
223	600210	紫江企业	57,300	249,255.00	0.16
224	603008	喜临门	12,800	247,296.00	0.16
225	600395	盘江股份	31,300	246,331.00	0.16
226	600648	外高桥	17,614	246,067.58	0.16
227	600823	世茂股份	53,160	245,067.60	0.16
228	603708	家家悦	11,460	244,098.00	0.16
229	600531	豫光金铅	41,200	243,492.00	0.16
230	600326	西藏天路	34,670	243,383.40	0.16
231	600764	中国海防	6,700	242,607.00	0.16
232	600582	天地科技	78,160	240,732.80	0.16
233	600131	国网信通	16,900	240,487.00	0.16
234	603690	至纯科技	6,100	239,852.00	0.16
235	600756	浪潮软件	15,300	238,527.00	0.16
236	600329	中新药业	13,495	236,432.40	0.16
237	600420	现代制药	24,200	230,142.00	0.15
238	600968	海油发展	96,000	229,440.00	0.15
239	600985	淮北矿业	20,500	229,395.00	0.15
240	600477	杭萧钢构	61,030	228,862.50	0.15
241	603118	共进股份	22,020	228,127.20	0.15
242	600668	尖峰集团	16,280	227,594.40	0.15
243	600338	西藏珠峰	21,620	226,577.60	0.15
244	600491	龙元建设	43,300	226,459.00	0.15
245	603260	合盛硅业	6,600	220,704.00	0.15
246	600587	新华医疗	15,306	217,651.32	0.14
247	601567	三星医疗	32,683	217,341.95	0.14
248	600422	昆药集团	25,052	216,699.80	0.14
249	600556	天下秀	17,100	216,315.00	0.14
250	603515	欧普照明	7,160	216,303.60	0.14
251	600377	宁沪高速	23,450	215,974.50	0.14
252	600502	安徽建工	56,868	214,961.04	0.14
253	600748	上实发展	43,530	213,732.30	0.14
254	601298	青岛港	33,100	212,833.00	0.14
255	600093	易见股份	26,500	212,265.00	0.14
256	603393	新天然气	8,920	210,690.40	0.14

257	603208	江山欧派	2,000	210,500.00	0.14
258	603609	禾丰牧业	17,400	205,668.00	0.14
259	600223	鲁商发展	23,800	202,776.00	0.13
260	603920	世运电路	7,700	201,432.00	0.13
261	603989	艾华集团	7,510	201,268.00	0.13
262	600557	康缘药业	19,627	199,606.59	0.13
263	600639	浦东金桥	16,082	199,416.80	0.13
264	600565	迪马股份	72,600	198,198.00	0.13
265	600577	精达股份	63,500	197,485.00	0.13
266	600483	福能股份	24,900	197,457.00	0.13
267	601827	三峰环境	23,800	197,064.00	0.13
268	601139	深圳燃气	27,200	196,928.00	0.13
269	600846	同济科技	23,624	195,134.24	0.13
270	600284	浦东建设	32,084	195,070.72	0.13
271	603666	亿嘉和	2,000	191,780.00	0.13
272	603533	掌阅科技	5,700	191,520.00	0.13
273	600787	中储股份	41,500	191,315.00	0.13
274	603916	苏博特	8,300	190,651.00	0.13
275	600933	爱柯迪	12,200	190,320.00	0.13
276	600750	江中药业	17,846	189,346.06	0.12
277	603888	新华网	9,800	186,200.00	0.12
278	603108	润达医疗	16,460	184,022.80	0.12
279	603225	新风鸣	13,172	183,090.80	0.12
280	600350	山东高速	29,550	182,619.00	0.12
281	600611	大众交通	51,626	182,239.78	0.12
282	600285	羚锐制药	21,477	181,910.19	0.12
283	603801	志邦家居	5,260	181,522.60	0.12
284	605168	三人行	1,000	181,350.00	0.12
285	603279	景津环保	9,700	178,286.00	0.12
286	603915	国茂股份	6,700	178,086.00	0.12
287	600971	恒源煤电	28,300	178,007.00	0.12
288	601828	美凯龙	20,890	177,356.10	0.12
289	600975	新五丰	21,600	173,664.00	0.11
290	603056	德邦股份	13,600	172,584.00	0.11
291	601588	北辰实业	75,300	171,684.00	0.11
292	600452	涪陵电力	10,330	169,928.50	0.11
293	603766	隆鑫通用	48,493	169,725.50	0.11
294	600973	宝胜股份	38,830	168,910.50	0.11
295	603505	金石资源	5,700	168,150.00	0.11
296	600694	大商股份	8,273	167,941.90	0.11
297	600510	黑牡丹	24,700	167,713.00	0.11
298	601019	山东出版	29,600	167,240.00	0.11
299	603379	三美股份	8,600	164,260.00	0.11

300	600657	信达地产	40,400	163,620.00	0.11
301	601069	西部黄金	12,000	161,880.00	0.11
302	603626	科森科技	13,960	160,679.60	0.11
303	603060	国检集团	8,180	160,000.80	0.11
304	600299	安迪苏	13,900	159,989.00	0.11
305	603730	岱美股份	5,505	157,167.75	0.10
306	601869	长飞光纤	5,800	156,832.00	0.10
307	603887	城地香江	8,900	156,284.00	0.10
308	603012	创力集团	24,000	154,560.00	0.10
309	603328	依顿电子	18,900	150,255.00	0.10
310	600987	航民股份	25,525	146,258.25	0.10
311	600070	浙江富润	17,200	146,200.00	0.10
312	601949	中国出版	25,800	145,770.00	0.10
313	603258	电魂网络	4,600	144,762.00	0.10
314	600020	中原高速	42,453	143,915.67	0.09
315	600622	光大嘉宝	42,430	143,413.40	0.09
316	603786	科博达	2,100	142,002.00	0.09
317	601158	重庆水务	27,200	139,264.00	0.09
318	600874	创业环保	20,550	139,123.50	0.09
319	603220	中贝通信	9,600	138,912.00	0.09
320	600681	百川能源	27,240	138,106.80	0.09
321	600903	贵州燃气	10,700	135,890.00	0.09
322	601801	皖新传媒	28,200	133,950.00	0.09
323	603197	保隆科技	4,700	132,211.00	0.09
324	603803	瑞斯康达	11,900	131,495.00	0.09
325	603305	旭升股份	4,200	131,418.00	0.09
326	603587	地素时尚	6,840	130,438.80	0.09
327	603466	风语筑	5,500	126,940.00	0.08
328	603556	海兴电力	9,210	126,637.50	0.08
329	601003	柳钢股份	24,200	125,598.00	0.08
330	600802	福建水泥	15,100	123,216.00	0.08
331	603728	鸣志电器	7,820	121,835.60	0.08
332	601330	绿色动力	14,000	120,820.00	0.08
333	600053	九鼎投资	6,158	120,388.90	0.08
334	600548	深高速	13,500	119,880.00	0.08
335	603367	辰欣药业	8,600	119,626.00	0.08
336	600007	中国国贸	9,473	117,938.85	0.08
337	603355	莱克电气	3,900	117,897.00	0.08
338	603363	傲农生物	9,510	117,828.90	0.08
339	600626	申达股份	28,200	112,518.00	0.07
340	603590	康辰药业	3,000	110,940.00	0.07
341	601789	宁波建工	27,600	110,124.00	0.07
342	600996	贵广网络	19,900	108,654.00	0.07

343	603868	飞科电器	2,300	107,594.00	0.07
344	601858	中国科传	11,200	105,952.00	0.07
345	600180	瑞茂通	19,200	100,032.00	0.07
346	603357	设计总院	10,720	99,374.40	0.07
347	603283	赛腾股份	2,500	99,050.00	0.07
348	600295	鄂尔多斯	9,473	98,708.66	0.07
349	600387	海越能源	15,600	98,280.00	0.06
350	600368	五洲交通	26,600	97,356.00	0.06
351	603180	金牌厨柜	1,900	94,905.00	0.06
352	603600	永艺股份	7,100	94,288.00	0.06
353	600738	兰州民百	14,600	93,732.00	0.06
354	603360	百傲化学	6,120	93,391.20	0.06
355	603876	鼎胜新材	6,100	93,269.00	0.06
356	600897	厦门空港	5,599	93,055.38	0.06
357	603508	思维列控	3,820	92,864.20	0.06
358	603639	海利尔	4,456	90,857.84	0.06
359	603421	鼎信通讯	9,260	86,025.40	0.06
360	603808	歌力思	6,300	83,160.00	0.05
361	601512	中新集团	7,800	77,532.00	0.05
362	603982	泉峰汽车	3,800	76,494.00	0.05
363	603327	福蓉科技	3,800	74,062.00	0.05
364	603610	麒盛科技	2,900	70,093.00	0.05
365	603121	华培动力	6,120	68,666.40	0.05
366	601811	新华文轩	7,500	68,175.00	0.04
367	603871	嘉友国际	3,144	67,627.44	0.04
368	605108	同庆楼	2,800	66,668.00	0.04
369	600956	新天绿能	6,600	66,396.00	0.04
370	603681	永冠新材	3,100	61,690.00	0.04
371	600917	重庆燃气	8,800	60,368.00	0.04
372	603680	今创集团	4,090	58,896.00	0.04
373	603053	成都燃气	4,600	57,454.00	0.04
374	603997	继峰股份	7,250	54,665.00	0.04
375	605222	起帆电缆	2,400	51,576.00	0.03
376	603711	香飘飘	2,400	50,736.00	0.03
377	605199	葫芦娃	2,000	48,240.00	0.03
378	603956	威派格	3,000	45,540.00	0.03
379	600828	茂业商业	11,446	42,693.58	0.03
380	603687	大胜达	3,900	35,529.00	0.02

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	688215	瑞晟智能	615	28,363.80	0.02
2	688338	赛科希德	421	22,982.39	0.02
3	688590	新致软件	1,122	17,716.38	0.01
4	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.01
5	688221	前沿生物	713	12,227.95	0.01
6	605155	西大门	350	10,668.00	0.01
7	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.01

## 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	688008	澜起科技	2,032,999.50	0.97
2	600079	人福医药	2,004,848.85	0.95
3	600015	华夏银行	1,821,164.00	0.87
4	600143	金发科技	1,774,193.00	0.84
5	600529	山东药玻	1,697,917.80	0.81
6	600426	华鲁恒升	1,579,907.99	0.75
7	601233	桐昆股份	1,317,484.00	0.63
8	601727	上海电气	1,289,273.00	0.61
9	601838	成都银行	1,258,531.00	0.60
10	688002	睿创微纳	1,185,491.44	0.56
11	603345	安井食品	1,168,440.00	0.56
12	601997	贵阳银行	985,520.00	0.47
13	600177	雅戈尔	931,429.00	0.44
14	601360	三六零	886,744.00	0.42
15	600984	建设机械	836,755.00	0.40
16	603520	司太立	836,597.80	0.40
17	600862	中航高科	818,540.00	0.39
18	603000	人民网	783,075.00	0.37
19	600233	圆通速递	773,219.00	0.37
20	600988	赤峰黄金	730,938.00	0.35

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	688012	中微公司	3,540,566.95	1.69

2	600745	闻泰科技	2,786,845.00	1.33
3	603501	韦尔股份	2,511,967.00	1.20
4	600763	通策医疗	2,118,329.55	1.01
5	600739	辽宁成大	1,984,570.95	0.94
6	600536	中国软件	1,712,610.92	0.82
7	600521	华海药业	1,707,088.18	0.81
8	600143	金发科技	1,604,924.00	0.76
9	601100	恒立液压	1,488,363.00	0.71
10	603517	绝味食品	1,481,591.00	0.71
11	600161	天坛生物	1,310,698.10	0.62
12	600801	华新水泥	1,203,833.00	0.57
13	601872	招商轮船	1,123,772.00	0.53
14	600418	江淮汽车	1,067,825.00	0.51
15	601021	春秋航空	1,033,187.00	0.49
16	600221	ST 海航	951,547.00	0.45
17	601360	三六零	932,285.00	0.44
18	600779	水井坊	815,055.45	0.39
19	600305	恒顺醋业	745,418.90	0.35
20	603659	璞泰来	692,518.00	0.33

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	78,000,747.07
卖出股票收入（成交）总额	69,879,782.11

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	-	-
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）	97,000.00	0.06
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	97,000.00	0.06

### 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	113044	大秦转债	860	86,000.00	0.06
2	113614	健 20 转债	110	11,000.00	0.01

### 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2103	IC2103	1	1,250,280.00	76,320.00	-
公允价值变动总额合计（元）					76,320.00
股指期货投资本期收益（元）					298,097.09
股指期货投资本期公允价值变动（元）					72,920.00

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的的指数的目的。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 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

报告期内基金投资的前十名证券除华夏银行（证券代码600015）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2020年7月13日，华夏银行股份有限公司因“内控制度执行不到位，严重违反审慎经营规则”等4项违规行为，被中国银保监会处罚款110万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 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	176,981.52
2	应收证券清算款	735.52
3	应收股利	-
4	应收利息	325.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	178,042.56

### 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

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688215	瑞晟智能	28,363.80	0.02	科创板新股锁定期
2	688338	赛科希德	22,982.39	0.02	科创板新股锁定期
3	688590	新致软件	17,716.38	0.01	科创板新股锁定期
4	688221	前沿生物	12,227.95	0.01	科创板新股锁定期

## § 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

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
750	107,265.22	2,349,870.00	2.92%	9,699,104.00	12.06%	68,399,941.00	85.02%

### 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	方正证券股份有限公司	1,735,407.00	2.16%
2	北京无限立通通讯技术有限责任公司	609,600.00	0.76%
3	王一一	499,000.00	0.62%
4	李佳学	305,500.00	0.38%
5	王钧璧	247,000.00	0.31%

6	谢大明	222,000.00	0.28%
7	邵唯实	181,500.00	0.23%
8	樊帆	178,800.00	0.22%
9	王歌欢	172,000.00	0.21%
10	屠想裳	160,000.00	0.20%
11	中国建设银行股份有限公司-南方上证 380 交易型开放式指数证券	68,399,941.00	85.02%

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

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

### 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

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年9月16日)基金份额总额	330,448,915.00
本报告期期初基金份额总额	140,448,915.00
本报告期基金总申购份额	38,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	98,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	80,448,915.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

### 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

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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 10 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 40,000.00 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

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 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	
华泰证券	1	144,702,204.19	100.00%	14,469.89	100.00%	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

诚浩证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	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。

### 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	
	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
华泰证券	1,181,923.00	100.00%	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

中邮证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
诚浩证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-

## 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旗下全部基金 2019 年第四季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-20
2	关于南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 调整指数使用费的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-02-26
3	关于南方基金管理股份有限公司旗下部分基金新增扩位证券简称的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-16
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-11-04
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公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-12-09

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20200101-20201231	114,399,941.00	2,000,000.00	48,000,000.00	68,399,941.00	85.02%

#### 产品特有风险

本基金存在持有基金份额超过 20% 的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时

变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

## 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上证 380 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2020 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>