

# 南方恒生交易型开放式指数证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	5
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	34
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	34
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细.....	34
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	41
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	44
7.8 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.....	45

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	45
7.10 投资组合报告附注	45
§8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末上市基金前十名持有人	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	47
§9 开放式基金份额变动	47
§10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息	50
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方恒生交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方恒指 ETF
场内简称	恒指 ETF（恒生指数 ETF）
基金主代码	513600
交易代码	513600
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014 年 12 月 23 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	124,829,500.00 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	2015 年 1 月 26 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“恒指 ETF”或“恒生指数 ETF”。

### 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	<p>本基金为被动式指数基金，采用指数复制法。本基金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，在保持基金资产的流动性前提下，达到有效复制标的指数的目的。</p> <p>本基金采用的主要投资步骤及策略包括：（1）股票投资组合的构建、（2）股票投资组合的调整、（3）债券和货币市场工具的配置策略、（4）金融衍生产品投资策略。</p>
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数（使用估值汇率调整），本基金标的指数为恒生指数。
风险收益特征	本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资香港证券市场上市的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

### 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	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	常克川	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码		518017	100140
法定代表人		杨小松（代为履行法定代表人职责）	陈四清

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

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

无。

## 2.5 信息披露方式

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

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	10,364,755.74
本期利润	12,488,864.96
加权平均基金份额本期利润	0.0996
本期加权平均净值利润率	3.69%
本期基金份额净值增长率	5.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	52,153,117.93
期末可供分配基金份额利润	0.4177
期末基金资产净值	337,101,827.95
期末基金份额净值	2.7005
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	40.06%

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
过去一个月	0.18%	0.78%	0.29%	0.78%	-0.11%	0.00%
过去三个月	0.71%	0.89%	0.01%	0.88%	0.70%	0.01%
过去六个月	5.90%	1.23%	4.66%	1.19%	1.24%	0.04%
过去一年	10.74%	1.17%	7.50%	1.16%	3.24%	0.01%
过去三年	5.38%	1.25%	-1.73%	1.26%	7.11%	-0.01%
自基金合	40.06%	1.18%	29.80%	1.22%	10.26%	-0.04%

同生效起 至今						
------------	--	--	--	--	--	--

### 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

南方恒指ETF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



## § 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



有限合伙) 2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙) 2.20%。目前, 公司总部设在深圳, 在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司, 在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中, 南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至本报告期末, 南方基金管理股份有限公司(不含子公司)管理资产规模超过 1.4 万亿元, 旗下管理 245 只开放式基金, 多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗文杰	本基金基金经理	2015年2月16日	-	16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。
--	--	--	--	--	--

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 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	12	54,794,261,094.86	2013 年 4 月 22 日
	私募资产管理计划	8	3,072,317,026.41	2020 年 8 月 7 日
	其他组合	-	-	-
	合计	20	57,866,578,121.27	-

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

#### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

#### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，恒生指数涨 5.86%。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) 港股通的交易风控资金的安排，导致基金实际仓位和基准的偏离。

##### 4.5.2 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 2.7005 元，报告期内，份额净值增长率为 5.90%，同期业绩基准增长率为 4.66%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年疫情影响逐渐消退，全球经济继续恢复，上市公司企业盈利高速增长。展望下半年，通胀预期或减弱，流动性将继续相对宽松，中国经济增速在强势反弹后，预期仍增长，大中华地区权益市场仍具长期配置价值。

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

#### 4.7 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。基金管理人根据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，本基金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；在符合有关基金分红条件的前提下，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，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配采取现金分红的方式；同一类别内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

本报告期内，本基金托管人在对南方恒生交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，南方恒生交易型开放式指数证券投资基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方恒生交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方恒生交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 中期财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：南方恒生交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.4.1	8,241,861.64	5,872,769.02
结算备付金		-	-
存出保证金		-	2,453.91
交易性金融资产	6.4.4.2	327,671,566.14	246,993,072.31
其中：股票投资		327,671,566.14	246,993,072.31
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		-	6,712,165.10
应收利息	6.4.4.5	788.96	624.36
应收股利		1,513,425.82	4,468.82

应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		337,427,642.56	259,585,553.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		72.35	6,741.06
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		139,137.07	107,179.91
应付托管费		27,827.41	21,435.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	7,350.63	60,534.68
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	151,427.15	7,378,831.77
负债合计		325,814.61	7,574,723.40
所有者权益：			
实收基金	6.4.4.9	240,685,236.42	190,554,328.64
未分配利润	6.4.4.10	96,416,591.53	61,456,501.48
所有者权益合计		337,101,827.95	252,010,830.12
负债和所有者权益总计		337,427,642.56	259,585,553.52

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.7005 元，基金份额总额 124,829,500.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方恒生交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		14,230,823.38	-4,961,346.95
1. 利息收入		29,436.71	23,954.71
其中：存款利息收入	6.4.4.11	29,436.71	23,954.71
债券利息收入		-	-
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）		10,895,162.70	2,113,443.39
其中：股票投资收益	6.4.4.12	6,911,346.06	-43,721.97
基金投资收益	6.4.4.13	-	-
债券投资收益	6.4.4.14	-	-
资产支持证券投资	6.4.4.15	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.4.16	-	-
衍生工具收益	6.4.4.17	-	-
股利收益	6.4.4.18	3,983,816.64	2,157,165.36
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.19	2,124,109.22	-8,256,641.94
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.20	1,182,114.75	1,157,896.89
减：二、费用		1,741,958.42	808,527.26
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	839,057.52	349,762.35

2. 托管费	6. 4. 7. 2. 2	167, 811. 48	69, 952. 47
3. 销售服务费	6. 4. 7. 2. 3	-	-
4. 交易费用	6. 4. 4. 21	475, 644. 65	276, 133. 06
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6. 4. 4. 22	259, 444. 77	112, 679. 38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12, 488, 864. 96	-5, 769, 874. 21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12, 488, 864. 96	-5, 769, 874. 21

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方恒生交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	190, 554, 328. 64	61, 456, 501. 48	252, 010, 830. 12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12, 488, 864. 96	12, 488, 864. 96
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）	50, 130, 907. 78	22, 471, 225. 09	72, 602, 132. 87
其中：1. 基金申购款	111, 830, 486. 52	47, 449, 396. 33	159, 279, 882. 85
2. 基金赎回款	-61, 699, 578. 74	-24, 978, 171. 24	-86, 677, 749. 98
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）	240,685,236.42	96,416,591.53	337,101,827.95
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	76,795,730.33	31,565,185.79	108,360,916.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,769,874.21	-5,769,874.21
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）	65,555,802.40	11,890,167.59	77,445,969.99
其中：1. 基金申购款	92,549,368.05	18,835,530.86	111,384,898.91
2. 基金赎回款	-26,993,565.65	-6,945,363.27	-33,938,928.92
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）	142,351,532.73	37,685,479.17	180,037,011.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.2.1 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 6.4.3 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.3.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.3.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.3.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.4 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	8,241,861.64
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	8,241,861.64

##### 6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	315,802,821.03	327,671,566.14	11,868,745.11
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券   交易所市场	-	-	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		315,802,821.03	327,671,566.14	11,868,745.11

注:于 2021 年 06 月 30 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(2020 年 12 月 31 日: 0.00 元)。

#### 6.4.4.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.4.4 买入返售金融资产

##### 6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

##### 6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.4.5 应收利息

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	788.96
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	-
应收债券利息	-
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	-
合计	788.96

#### 6.4.4.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.4.7 应付交易费用

单位: 人民币元

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

交易所市场应付交易费用	7,350.63
银行间市场应付交易费用	-
合计	7,350.63

#### 6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应退替代款	-
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	67,124.59
可退替代款	-
其他	-
合计	151,427.15

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

#### 6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	98,829,500.00	190,554,328.64
本期申购	58,000,000.00	111,830,486.52
本期赎回（以“-”号填列）	-32,000,000.00	-61,699,578.74
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	124,829,500.00	240,685,236.42

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

#### 6.4.4.10 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	32,807,077.30	28,649,424.18	61,456,501.48
本期利润	10,364,755.74	2,124,109.22	12,488,864.96
本期基金份额交易产生的变动数	8,981,284.89	13,489,940.20	22,471,225.09
其中：基金申购款	20,671,253.35	26,778,142.98	47,449,396.33
基金赎回款	-11,689,968.46	-13,288,202.78	-24,978,171.24

本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,153,117.93	44,263,473.60	96,416,591.53

#### 6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
活期存款利息收入			16,155.20
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			12,918.45
其他			363.06
合计			29,436.71

#### 6.4.4.12 股票投资收益

##### 6.4.4.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		6,911,346.06
股票投资收益——赎回差价收入		-
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		6,911,346.06

##### 6.4.4.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额		111,660,417.20
减：卖出股票成本总额		104,749,071.14
买卖股票差价收入		6,911,346.06

##### 6.4.4.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
赎回基金份额对价总额		86,677,749.98
减：现金支付赎回款总额		86,677,749.98
减：赎回股票成本总额		-
赎回差价收入		-

##### 6.4.4.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

##### 6.4.4.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

**6.4.4.13 基金投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	-
减：卖出/赎回基金成本总额	-
基金投资收益	-

**6.4.4.14 债券投资收益**

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

**6.4.4.15 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.4.16 贵金属投资收益****6.4.4.16.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.4.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

**6.4.4.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

**6.4.4.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

**6.4.4.17 衍生工具收益****6.4.4.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

**6.4.4.17.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

**6.4.4.18 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,983,816.64
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	3,983,816.64

**6.4.4.19 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	2,124,109.22
——股票投资	2,124,109.22
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	2,124,109.22

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(2020 上半年度：0.00 元)。

**6.4.4.20 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,182,114.75
合计	1,182,114.75

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。

**6.4.4.21 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	475,644.65
银行间市场交易费用	-
合计	475,644.65

**6.4.4.22 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	67,124.59
银行费用	255.00
其他	107,762.62
合计	259,444.77

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 0.04% 的年费率计提，逐日累计，按季支付标的指数许可使用费的收取下限为每季度港币 25,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

## 6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.5.1 或有事项

无。

### 6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.6 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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
南方恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“南方恒生 ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	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	294,963,872.95	100.00%	140,376,588.71	100.00%



### 6.4.7.1.2 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

### 6.4.7.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 6.4.7.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	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	131,216.57	100.00%	7,350.63	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日			
	当期佣金	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	112,301.14	100.00%	29,891.43	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。

### 6.4.7.2 关联方报酬

#### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	839,057.52	349,762.35
其中：支付销售机构的客户维护费	-	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。

#### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	167,811.48	69,952.47

注：支付基金托管人中国工商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：

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

#### 6.4.7.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

#### 6.4.7.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.7.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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
华泰证券股份有限公司	400,000.00	0.32%	190,200.00	0.19%
南方恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金	39,543,476.00	31.68%	44,453,476.00	44.98%

注：南方恒生 ETF 联接基金、华泰证券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。

#### 6.4.7.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	8,241,861.64	16,155.20	4,801,648.26	11,341.19

注：本基金由基金托管人中国工商银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

#### 6.4.7.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.7.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.8 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

###### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.9.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.10 金融工具风险及管理

##### 6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资香港证券市场上市股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。本

基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金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，在保持基金资产的流动性前提下，达到有效复制标的指数的目的，本基金力争将年化跟踪误差最小化。本基金优先通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股，如果未来出现由于港股通额度受限、业务规则发生重大变更等影响投资运作的情形时，为了更好的保护投资人的利益，实现投资目标，本基金将可以直接委托香港的经纪商投资标的指数的成份股、备选成份股。

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，将风险控制可在承受的范围之内。

#### 6.4.10.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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，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 2021 年 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.10.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金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。

于 2021 年 6 月 30 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。

##### 6.4.10.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本基金本报告期末及上年度末无金融资产和金融负债的到期期限分析。

##### 6.4.10.3.2 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 2021 年 6 月 30 日，本基金无流动性受限资产。

同时，基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.10.4 市场风险

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

#### 6.4.10.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,241,861.64	-	-	-	8,241,861.64
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	327,671,566.14	327,671,566.14
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	788.96	788.96
应收股利	-	-	-	1,513,425.82	1,513,425.82
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,241,861.64	-	-	329,185,780.92	337,427,642.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	139,137.07	139,137.07
应付托管费	-	-	-	27,827.41	27,827.41
应付证券清	-	-	-	72.35	72.35

算款					
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服 务费	-	-	-	-	-
应付交易费 用	-	-	-	7,350.63	7,350.63
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	151,427.15	151,427.15
负债总计	-	-	-	325,814.61	325,814.61
利率敏感度 缺口	8,241,861.64	-	-	328,859,966. 31	337,101,827. 95
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,872,769.02	-	-	-	5,872,769.02
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	2,453.91	-	-	-	2,453.91
交易性金融 资产	-	-	-	246,993,072. 31	246,993,072. 31
买入返售金 融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	624.36	624.36
应收股利	-	-	-	4,468.82	4,468.82
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清 算款	-	-	-	6,712,165.10	6,712,165.10
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,875,222.93	-	-	253,710,330. 59	259,585,553. 52
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	107,179.91	107,179.91
应付托管费	-	-	-	21,435.98	21,435.98
应付证券清 算款	-	-	-	6,741.06	6,741.06
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服	-	-	-	-	-

务费					
应付交易费用	-	-	-	60,534.68	60,534.68
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	7,378,831.77	7,378,831.77
负债总计	-	-	-	7,574,723.40	7,574,723.40
利率敏感度缺口	5,875,222.93	-	-	246,135,607.19	252,010,830.12

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

#### 6.4.10.4.2 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.10.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	327,671,566.14	-	-	-	327,671,566.14
资产合计	-	327,671,566.14	-	-	-	327,671,566.14
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	327,671,566.14	-	-	-	327,671,566.14

项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计



以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	246,993,072.31	-	-	-	246,993,072.31
资产合计	-	246,993,072.31	-	-	-	246,993,072.31
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	246,993,072.31	-	-	-	246,993,072.31

#### 6.4.10.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	16,383,578.31	12,349,653.62
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-16,383,578.31	-12,349,653.62	

#### 6.4.10.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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，跟踪恒生指数，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，恒生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 80%，公募基金、依法发行上市的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、股指期货等金融衍生品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。

#### 6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产	公允价值	占基金资产

		净值比例 (%)		净值比例 (%)
交易性金融资产- 股票投资	327,671,566.14	97.20	246,993,072.31	98.01
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	327,671,566.14	97.20	246,993,072.31	98.01

#### 6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1.组合自身基准上升 5%	16,419,384.72	12,012,331.12
	2.组合自身基准下降 5%	-16,419,384.72	-12,012,331.12

#### 6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	327,671,566.14	97.11
	其中：普通股	327,671,566.14	97.11
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-

	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付 金合计	8,241,861.64	2.44
8	其他资产	1,514,214.78	0.45
9	合计	337,427,642.56	100.00

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项中不含可退替代款估值增值；2、本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股市值为人民币 327,671,566.14 元，占基金资产净值比例 97.20%。

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	327,671,566.14	97.20
合计	327,671,566.14	97.20

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

### 7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	10,853,160.59	3.22
材料	-	-
工业	8,443,698.21	2.50
非必需消费品	25,148,311.63	7.46
必需消费品	13,700,253.78	4.06
医疗保健	17,151,959.27	5.09
金融	120,377,933.05	35.71
科技	18,014,731.70	5.34
通讯	79,682,460.40	23.64
公用事业	9,670,656.33	2.87
房地产	24,628,401.18	7.31
政府	-	-
合计	327,671,566.14	97.20

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

### 7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

## 7.4.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

## 7.4.1.1 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权益投资明细

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	Meituan	美团	3690 HK	中国香港交易所	中国香港	137,800	36,737,263.93	10.90
2	Tencent Holding s Ltd	腾讯控股有限公司	0700 HK	中国香港交易所	中国香港	71,100	34,549,958.59	10.25
3	AIA Group Limited	友邦保险控股有限公司	1299 HK	中国香港交易所	中国香港	331,000	26,577,883.32	7.88
4	HSBC Holding s PLC	汇丰控股有限公司	0005 HK	中国香港交易所	中国香港	644,800	24,063,154.50	7.14
5	China Constru ction Bank Corpora tion	中国建设银行股份有限公司	0939 HK	中国香港交易所	中国香港	3,348,000	17,021,261.46	5.05
6	Hong Kong Exchan ges and Clearing Ltd.	香港交易及结算有限公司	0388 HK	中国香港交易所	中国香港	37,300	14,363,731.08	4.26
7	Ping An Insuranc e (Group) Compan y of China, Ltd.	中国平安保险 (集团) 股份有限公司	2318 HK	中国香港交易所	中国香港	196,000	12,402,818.06	3.68
8	Wuxi Biologic s	药明生物技术有限公	2269 HK	中国香港交易所	中国香港	104,000	12,314,118.34	3.65

	(Cayman) Inc	司						
9	Xiaomi Corporation	小米集团	1810 HK	中国香港交易所	中国香港	547,200	12,293,482.75	3.65
10	Industrial and Commercial Bank of China Limited	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	中国香港交易所	中国香港	2,283,000	8,662,352.20	2.57
11	China Mobile Limited	中国移动有限公司	0941 HK	中国香港交易所	中国香港	190,000	7,675,521.96	2.28
12	Bank of China Limited	中国银行股份有限公司	3988 HK	中国香港交易所	中国香港	2,459,000	5,708,576.37	1.69
13	ANTA Sports Products Limited	安踏体育用品有限公司	2020 HK	中国香港交易所	中国香港	34,000	5,171,543.62	1.53
14	Techtron Industries Co. Ltd.	创科实业有限公司	0669 HK	中国香港交易所	中国香港	45,500	5,133,767.18	1.52
15	BYD Company Limited	比亚迪股份有限公司	1211 HK	中国香港交易所	中国香港	26,000	5,023,433.38	1.49
16	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	舜宇光学科技(集团)有限公司	2382 HK	中国香港交易所	中国香港	22,100	4,512,652.75	1.34
17	CK Hutchison	长江和记实业有限公司	0001 HK	中国香港交易所	中国香港	83,776	4,217,354.21	1.25

	Holdings Limited	司						
18	Shenzhou International Group Holdings Ltd.	申洲国际集团控股有限公司	2313 HK	中国香港交易所	中国香港	25,600	4,177,174.73	1.24
19	CNOOC Limited	中国海洋石油有限公司	0883 HK	中国香港交易所	中国香港	553,000	4,063,038.32	1.21
20	CLP Holdings Ltd.	中电控股有限公司	0002 HK	中国香港交易所	中国香港	63,500	4,057,887.74	1.20
21	The Hong Kong and China Gas Co. Ltd.	香港中华煤气有限公司	0003 HK	中国香港交易所	中国香港	373,625	3,749,283.83	1.11
22	Geely Automobile Holdings Limited	吉利汽车控股有限公司	0175 HK	中国香港交易所	中国香港	182,000	3,702,672.79	1.10
23	Country Garden Services Holdings Company Limited	碧桂园服务控股有限公司	6098 HK	中国香港交易所	中国香港	51,000	3,560,387.11	1.06
24	Sun Hung Kai Properties Ltd.	新鸿基地产发展有限公司	0016 HK	中国香港交易所	中国香港	36,000	3,465,779.62	1.03
25	Galaxy	银河娱	0027	中国香	中国香	67,000	3,464,8	1.03

	Entertainment Group Limited	乐集团有限公司	HK	港交易所	港		22.72	
26	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	中国蒙牛乳业 有限公司	2319 HK	中国香港交易所	中国香港	86,000	3,359,689.42	1.00
27	Hang Seng Bank Ltd.	恒生银行有限公司	0011 HK	中国香港交易所	中国香港	24,100	3,110,240.15	0.92
28	China Life Insurance Company Limited	中国人寿保险股份有限公司	2628 HK	中国香港交易所	中国香港	230,000	2,947,227.36	0.87
29	CK Asset Holdings Limited	长江实业集团有限公司	1113 HK	中国香港交易所	中国香港	62,776	2,799,777.46	0.83
30	China Resources Land Limited	华润置地有限公司	1109 HK	中国香港交易所	中国香港	100,000	2,616,891.60	0.78
31	CSPC Pharmaceutical Group Limited	石药集团有限公司	1093 HK	中国香港交易所	中国香港	278,640	2,606,002.67	0.77
32	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	中银香港(控股)有限公司	2388 HK	中国香港交易所	中国香港	114,500	2,510,447.77	0.74
33	China Petroleum & Chemical	中国石油化工股份有限公司	0386 HK	中国香港交易所	中国香港	750,000	2,452,555.80	0.73

	Corporation							
34	Sands China Ltd.	金沙中国有限公司	1928 HK	中国香港交易所	中国香港	87,600	2,383,509.80	0.71
35	Petrochina Company Limited	中国石油天然气股份有限公司	0857 HK	中国香港交易所	中国香港	714,000	2,245,717.35	0.67
36	Sino Biopharmaceutical Limited	中国生物制药有限公司	1177 HK	中国香港交易所	中国香港	352,000	2,231,838.26	0.66
37	MTR Corporation Ltd.	香港铁路有限公司	0066 HK	中国香港交易所	中国香港	62,000	2,231,222.52	0.66
38	Longfor Group Holdings Limited	龙湖集团控股有限公司	0960 HK	中国香港交易所	中国香港	61,000	2,207,924.28	0.65
39	Wharf Real Estate Investment Company Limited	九龙仓置业地产投资有限公司	1997 HK	中国香港交易所	中国香港	56,000	2,103,831.07	0.62
40	Alibaba Health Information Technology Limited	阿里健康信息技术有限公司	0241 HK	中国香港交易所	中国香港	146,000	2,091,948.97	0.62
41	Xinyi Solar Holdings Limited	信义光能控股有限公司	0968 HK	中国香港交易所	中国香港	150,000	2,091,849.12	0.62
42	Country	碧桂园	2007	中国香	中国香	262,000	1,896,6	0.56



	Garden Holding s Co. Ltd	控股有 限公司	HK	港交易 所	港		43.15	
43	China Oversea s Land & Investm ent Ltd.	中国海 外发展 有限公司	0688 HK	中国香 港交易 所	中国香 港	127,500	1,871,4 31.13	0.56
44	Power Assets Holding s Limited	电能实 业有限 公司	0006 HK	中国香 港交易 所	中国香 港	47,000	1,863,4 84.76	0.55
45	CITIC Limited	中国中 信股份 有限公司	0267 HK	中国香 港交易 所	中国香 港	247,000	1,720,2 33.87	0.51
46	WH Group Limited	万洲国 际有限 公司	0288 HK	中国香 港交易 所	中国香 港	275,000	1,597,1 77.56	0.47
47	New World Develop ment Co. Ltd.	新世界 发展有 限公司	0017 HK	中国香 港交易 所	中国香 港	46,750	1,569,6 04.51	0.47
48	Henders on Land Develop ment Co. Ltd.	恒基兆 业地产 有限公司	0012 HK	中国香 港交易 所	中国香 港	48,487	1,484,6 98.32	0.44
49	Budwei ser Brewing Compan y APAC Limited	百威亚 太控股 有限公司	1876 HK	中国香 港交易 所	中国香 港	67,400	1,374,0 13.70	0.41
50	Bank of Commu nication s Co.,Ltd.	交通银 行股份 有限公司	3328 HK	中国香 港交易 所	中国香 港	297,000	1,290,0 06.91	0.38
51	Haidilao	海底捞	6862	中国香	中国香	36,000	1,225,1	0.36

	International Holding Ltd.	国际控股有限公司	HK	港交易所	港		54.59	
52	AAC Technologies Holdings Inc.	瑞声科技控股有限公司	2018 HK	中国香港交易所	中国香港	25,000	1,208,596.20	0.36
53	CK Infrastructure Holdings Limited	长江基建集团有限公司	1038 HK	中国香港交易所	中国香港	28,000	1,078,708.51	0.32
54	Hengan International Group Company Limited	恒安国际集团有限公司	1044 HK	中国香港交易所	中国香港	24,500	1,060,069.92	0.31
55	Hang Lung Properties Ltd.	恒隆地产有限公司	0101 HK	中国香港交易所	中国香港	67,000	1,051,432.93	0.31
56	China Unicom (Hong Kong) Ltd.	中国联合网络通信(香港)股份有限公司	0762 HK	中国香港交易所	中国香港	204,000	719,715.92	0.21

注:基金对以上证券代码采用当地市场代码。

#### 7.4.1.2 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权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

### 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

#### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	----------	------	----------	----------------

1	Meituan	3690 HK	21,670,730.96	8.60
2	Tencent Holdings Ltd	700 HK	18,516,884.84	7.35
3	AIA Group Limited	1299 HK	16,498,265.58	6.55
4	HSBC Holdings PLC	5 HK	12,532,886.87	4.97
5	China Construction Bank Corporation	939 HK	9,227,023.07	3.66
6	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	7,794,176.67	3.09
7	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	7,791,328.38	3.09
8	Xiaomi Corporation	1810 HK	6,372,951.98	2.53
9	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	5,141,084.18	2.04
10	Wuxi Biologics (Cayman) Inc	2269 HK	4,673,948.26	1.85
11	China Mobile Limited	941 HK	4,172,874.84	1.66
12	BYD Company Limited	1211 HK	4,110,069.68	1.63
13	Alibaba Health Information Technology Limited	241 HK	3,207,437.87	1.27
14	Country Garden Services Holdings Company Limited	6098 HK	3,199,475.45	1.27
15	Bank of China Limited	3988 HK	2,978,468.57	1.18
16	Longfor Group Holdings Limited	960 HK	2,761,155.03	1.10

17	Techtronic Industries Co. Ltd.	669 HK	2,599,144.11	1.03
18	Geely Automobile Holdings Limited	175 HK	2,350,810.71	0.93
19	Sun Hung Kai Properties Ltd.	16 HK	2,282,576.43	0.91
20	ANTA Sports Products Limited	2020 HK	2,114,209.99	0.84

注:1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

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

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	AIA Group Limited	1299 HK	15,425,485.99	6.12
2	Tencent Holdings Ltd	700 HK	11,597,510.23	4.60
3	HSBC Holdings PLC	5 HK	9,722,674.36	3.86
4	China Construction Bank Corporation	939 HK	6,818,651.02	2.71
5	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	5,858,221.10	2.32
6	Meituan	3690 HK	4,641,596.74	1.84
7	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	4,599,403.20	1.83
8	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	3,772,627.80	1.50
9	Xiaomi Corporation	1810 HK	3,436,635.93	1.36
10	Wuxi Biologics	2269 HK	3,373,395.66	1.34

	(Cayman) Inc			
11	China Mobile Limited	941 HK	3,155,738.08	1.25
12	Techtronic Industries Co. Ltd.	669 HK	2,367,622.11	0.94
13	Bank of China Limited	3988 HK	2,229,964.69	0.88
14	CK Asset Holdings Limited	1113 HK	1,916,592.39	0.76
15	Sun Hung Kai Properties Ltd.	16 HK	1,877,040.56	0.74
16	ANTA Sports Products Limited	2020 HK	1,748,085.42	0.69
17	CNOOC Limited	883 HK	1,603,272.00	0.64
18	CK Hutchison Holdings Limited	1 HK	1,596,296.10	0.63
19	Geely Automobile Holdings Limited	175 HK	1,476,876.89	0.59
20	Shenzhou International Group Holdings Ltd.	2313 HK	1,446,075.46	0.57

注:1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

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

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	183,303,455.75
卖出收入（成交）总额	111,660,417.20

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 7.10 投资组合报告附注

### 7.10.1 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工商银行（证券代码 1398 HK）、建设银行（证券代码 0939 HK）、腾讯控股（证券代码 0700 HK）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。

#### 1、工商银行（证券代码 1398 HK）

2020 年 9 月 1 日，上海银保监局公布的行政处罚信息公开表显示，中国工商银行股份有限公司贵金属业务部因黄金租赁业务管理不严，违反审慎经营规则，被处以罚款 50 万元。2020 年 12 月 25 日，工商银行被开出 5470 万元巨额罚单，被罚事由为“1、未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告；2、关键岗位未进行实质性轮岗；3、法人账户日间透支业务存在资金用途管理的风险漏洞；4、为同业投资业务提供隐性担保；5、理财产品通过申购/赎回净值型理财产品调节收益；6、理财产品信息披露不到位”等 22 条。

#### 2、建设银行（证券代码 0939 HK）

2020 年 7 月 13 日，针对建设银行同业和理财（资管）业务现场检查发现的理财资金违规投资房地产、未做到理财业务与自营业务风险隔离等多项违法违规行为，中国银保监会依法对该行罚款 3920 万元，并对相关责任人员给予行政处罚，其中，禁止 1 名责任人员终身从事银行业工作。

#### 3、腾讯控股（证券代码 0700 HK）

腾讯控股有限公司在报告编制期前一年内受到处罚，于 2020 年 11 月 5 日因涉嫌发布虚假广告及使用绝对化广告用语，被深圳市南山市场监督管理局行政处罚 20 万元；2021 年 4 月 30 日市场监管总局公布腾讯控股两份未依法申报违法实施的经营者集中案行政处罚决定书。腾讯控股 2021 年 3 月 12 日公告称，因未依法申报违法实施的经营者集中，国家市场监督管理总局对公司罚款人民币 50 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。

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

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

### 7.10.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,513,425.82
4	应收利息	788.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,514,214.78

### 7.10.4 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债券。

### 7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	南方恒生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
5,473	22,808.24	50,276,583.00	40.28%	35,009,441.00	28.05%	39,543,476.00	31.68%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	招商证券股份有限公司	18,591,427.00	14.89%
2	BARCLAYS BANK PLC	13,790,200.00	11.05%
3	广发证券股份有限公司	7,663,099.00	6.14%
4	华西证券股份有限公司	3,800,000.00	3.04%
5	中信证券股份有限公司	3,126,557.00	2.50%
6	野村新加坡有限公司-自有资金	1,000,000.00	0.80%
7	谢堃	760,200.00	0.61%
8	邢晓君	576,900.00	0.46%
9	陈晴	500,000.00	0.40%
10	华泰证券股份有限公司	400,000.00	0.32%
11	中国工商银行股份有限公司-南方恒生交易型开放式指数证券投资基	39,543,476.00	31.68%

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

## 8.3 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。

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年12月23日)基金份额总额	286,959,921.00
本报告期期初基金份额总额	98,829,500.00
本报告期基金总申购份额	58,000,000.00



减：报告期基金总赎回份额	32,000,000.00
本报告期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	124,829,500.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

2021 年 5 月 19 日，公司副总经理常克川兼任首席信息官。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	294,963,872.95	100.00%	131,216.57	100.00%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

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

#### A：选择标准

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

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

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于南方恒生交易型开放式指数证券投资基金 2021 年非港股通交易日申购赎回安排的公告	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	2021-01-20
2	南方基金关于南方恒生交易型开放式指数证券投资基金增加信达证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-23
3	南方基金关于南方恒生交易型开放式指数证券投资基金增加方正证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-23
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分指数基金修订基金合同有关条款的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-31
5	南方基金关于旗下部分基金增加国泰君安为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
6	南方基金关于旗下部分基金增加海通证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-22
7	南方基金关于旗下部分基金增加平安证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-28

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20210101-20210630	44,453,476.00	4,090,000.00	9,000,000.00	39,543,476.00	31.68%
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。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方恒生交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方恒生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、《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告》原文。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

### 12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>