

# 南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 2021 年年度报告

2021 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|                                              |    |
|----------------------------------------------|----|
| §1 重要提示及目录.....                              | 1  |
| 1.1 重要提示.....                                | 1  |
| 1.2 目录.....                                  | 2  |
| §2 基金简介.....                                 | 4  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 4  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 4  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6  |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....                 | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 12 |
| §4 管理人报告.....                                | 12 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 12 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 14 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 14 |
| 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.....             | 15 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 16 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 16 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 17 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 18 |
| 4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....               | 18 |
| §5 托管人报告.....                                | 18 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 18 |
| 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..... | 18 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....       | 18 |
| §6 审计报告.....                                 | 18 |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 18 |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 19 |
| §7 年度财务报表.....                               | 21 |
| 7.1 资产负债表.....                               | 21 |
| 7.2 利润表.....                                 | 22 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 24 |
| 7.4 报表附注.....                                | 25 |
| §8 投资组合报告.....                               | 57 |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 57 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 58 |
| 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.....       | 58 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 61 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 62 |

|                                             |    |
|---------------------------------------------|----|
| 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 .....    | 63 |
| 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 ..... | 63 |
| 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 ..... | 63 |
| 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 .....    | 63 |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 63 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 63 |
| 8.12 本报告期投资基金情况 .....                       | 64 |
| 8.13 投资组合报告附注 .....                         | 64 |
| §9 基金份额持有人信息 .....                          | 66 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 66 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 66 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....      | 67 |
| 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                   | 67 |
| §10 开放式基金份额变动 .....                         | 67 |
| §11 重大事件揭示 .....                            | 68 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 68 |
| 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 .....      | 68 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 68 |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 68 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 69 |
| 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 .....         | 69 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 69 |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 70 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息 .....                    | 73 |
| 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 .....    | 73 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 74 |
| §13 备查文件目录 .....                            | 74 |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 74 |
| 13.2 存放地点 .....                             | 74 |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 74 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                             |                  |                 |
|-----------------|-----------------------------|------------------|-----------------|
| 基金名称            | 南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 |                  |                 |
| 基金简称            | 南方中证银行 ETF 发起联接             |                  |                 |
| 基金主代码           | 004597                      |                  |                 |
| 交易代码            | 004597                      |                  |                 |
| 基金运作方式          | 普通开放式                       |                  |                 |
| 基金合同生效日         | 2017 年 6 月 29 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      | 1,450,671,670.97 份          |                  |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                         |                  |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 南方银行联接 A                    | 南方银行联接 C         | 南方银行联接 E        |
| 下属分级基金的交易代码     | 004597                      | 004598           | 012547          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 567,650,937.62 份            | 825,685,045.03 份 | 57,335,688.32 份 |

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方银行联接”。

#### 2.1.1 目标基金基本情况

|              |                      |
|--------------|----------------------|
| 基金名称         | 南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码        | 512700               |
| 基金运作方式       | 交易型开放式               |
| 基金合同生效日      | 2017 年 6 月 28 日      |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所              |
| 上市日期         | 2017 年 7 月 26 日      |
| 基金管理人名称      | 南方基金管理股份有限公司         |
| 基金托管人名称      | 中国工商银行股份有限公司         |

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“银行基金”或“银行 ETF 基金”。

### 2.2 基金产品说明

|      |                                         |
|------|-----------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。 |
|------|-----------------------------------------|

|        |                                                                                                                                                                                         |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资策略   | 本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的标的指数为中证银行指数。<br>本基金业绩比较基准为标的指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。                                                                                                                           |
| 风险收益特征 | 本基金的目标 ETF 为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。                                                                 |

### 2.2.1 目标基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      | 基金管理人                            | 基金托管人                    |
|---------|----------------------------------|--------------------------|
| 名称      | 南方基金管理股份有限公司                     | 中国工商银行股份有限公司             |
| 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                     | 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                       | 陈四清                      |

|  |        |  |
|--|--------|--|
|  | 代表人职责) |  |
|--|--------|--|

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

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                           |
|---------------------|-----------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 中国证券报                                                     |
| 登载基金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<br>(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 | 南方基金管理股份有限公司             | 深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼       |

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

##### 1、南方银行联接 A

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2021 年         | 2020 年         | 2019 年        |
|---------------|----------------|----------------|---------------|
| 本期已实现收益       | 49,631,974.54  | 16,346,382.60  | 1,481,848.85  |
| 本期利润          | 24,223,783.72  | 62,719,469.17  | 13,541,851.85 |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0500         | 0.2029         | 0.2721        |
| 本期加权平均净值利润率   | 3.74%          | 16.88%         | 24.84%        |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.22%          | 4.74%          | 32.33%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021 年末        | 2020 年末        | 2019 年末       |
| 期末可供分配利润      | 106,943,267.86 | 49,644,176.16  | -509,568.08   |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1883         | 0.0807         | -0.0075       |
| 期末基金资产净值      | 726,206,260.66 | 776,579,165.24 | 82,524,429.09 |
| 期末基金份额净值      | 1.2793         | 1.2639         | 1.2067        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2021 年末        | 2020 年末        | 2019 年末       |
| 基金份额累计净值增长率   | 27.93%         | 26.39%         | 20.67%        |

##### 2、南方银行联接 C

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2021 年           | 2020 年         | 2019 年         |
|---------------|------------------|----------------|----------------|
| 本期已实现收益       | 55,418,571.49    | 6,604,326.44   | 1,365,240.33   |
| 本期利润          | -1,707,197.36    | 20,692,894.52  | 14,497,194.36  |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0028          | 0.1292         | 0.3133         |
| 本期加权平均净值利润率   | -0.22%           | 11.08%         | 28.64%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.83%            | 4.32%          | 31.81%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021 年末          | 2020 年末        | 2019 年末        |
| 期末可供分配利润      | 136,774,070.07   | 25,884,176.82  | -1,491,207.56  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1656           | 0.0649         | -0.0178        |
| 期末基金资产净值      | 1,037,530,886.08 | 496,884,686.29 | 100,075,140.50 |
| 期末基金份额净值      | 1.2566           | 1.2463         | 1.1947         |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2021 年末          | 2020 年末        | 2019 年末        |
| 基金份额累计净值增长率   | 25.66%           | 24.63%         | 19.47%         |

##### 3、南方银行联接 E

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2021 年 6 月 15 日-2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------------------------|
| 本期已实现收益       | 320,599.69                       |
| 本期利润          | -2,929,597.90                    |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0827                          |
| 本期加权平均净值利润率   | -6.36%                           |
| 本期基金份额净值增长率   | -7.59%                           |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021 年末                          |

|              |               |
|--------------|---------------|
| 期末可供分配利润     | 10,646,670.01 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1856        |
| 期末基金资产净值     | 73,199,969.30 |
| 期末基金份额净值     | 1.2767        |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2021 年末       |
| 基金份额累计净值增长率  | -7.59%        |

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

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

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

4、本基金从 2021 年 6 月 11 日起新增 E 类份额，E 类份额自 2021 年 6 月 15 日起存续。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方银行联接 A

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -0.39%       | 0.90%               | -0.38%             | 0.85%                     | -0.01% | 0.05% |
| 过去六个月          | -7.10%       | 1.18%               | -9.43%             | 1.11%                     | 2.33%  | 0.07% |
| 过去一年           | 1.22%        | 1.24%               | -4.09%             | 1.18%                     | 5.31%  | 0.06% |
| 过去三年           | 40.29%       | 1.20%               | 12.00%             | 1.19%                     | 28.29% | 0.01% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 27.93%       | 1.17%               | 2.33%              | 1.16%                     | 25.60% | 0.01% |

南方银行联接 C

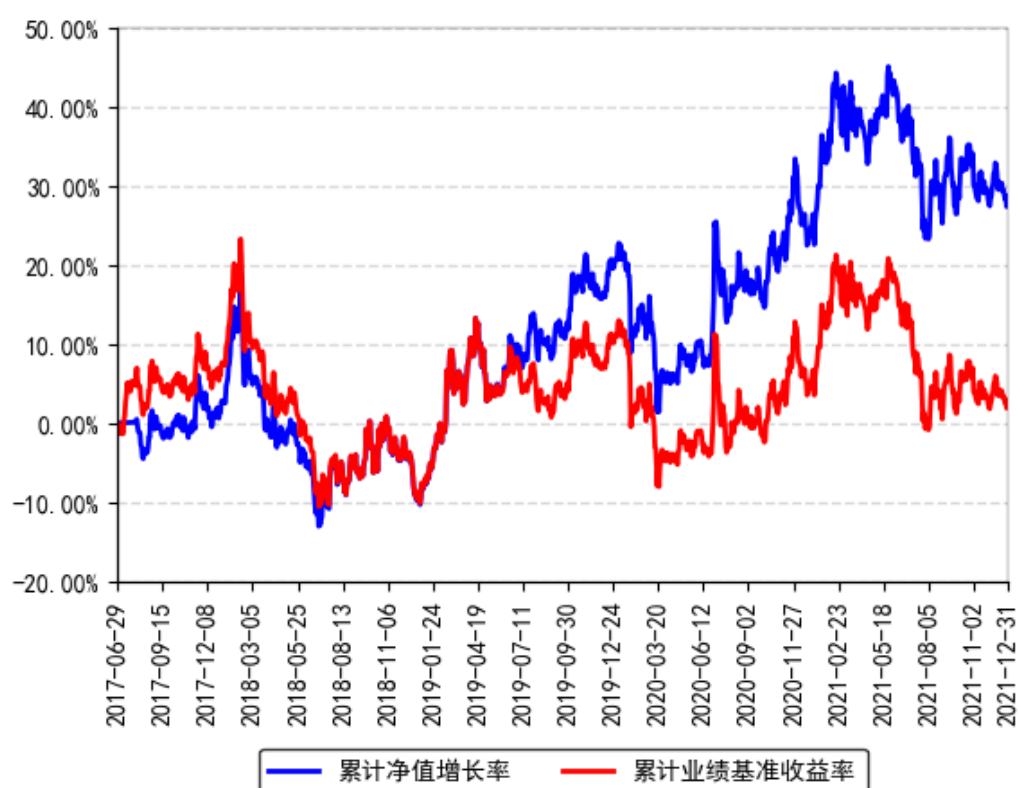
| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -0.48%       | 0.90%               | -0.38%             | 0.85%                     | -0.10% | 0.05% |
| 过去六个月          | -7.29%       | 1.18%               | -9.43%             | 1.11%                     | 2.14%  | 0.07% |
| 过去一年           | 0.83%        | 1.24%               | -4.09%             | 1.18%                     | 4.92%  | 0.06% |
| 过去三年           | 38.64%       | 1.20%               | 12.00%             | 1.19%                     | 26.64% | 0.01% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 25.66%       | 1.17%               | 2.33%              | 1.16%                     | 23.33% | 0.01% |

南方银行联接 E

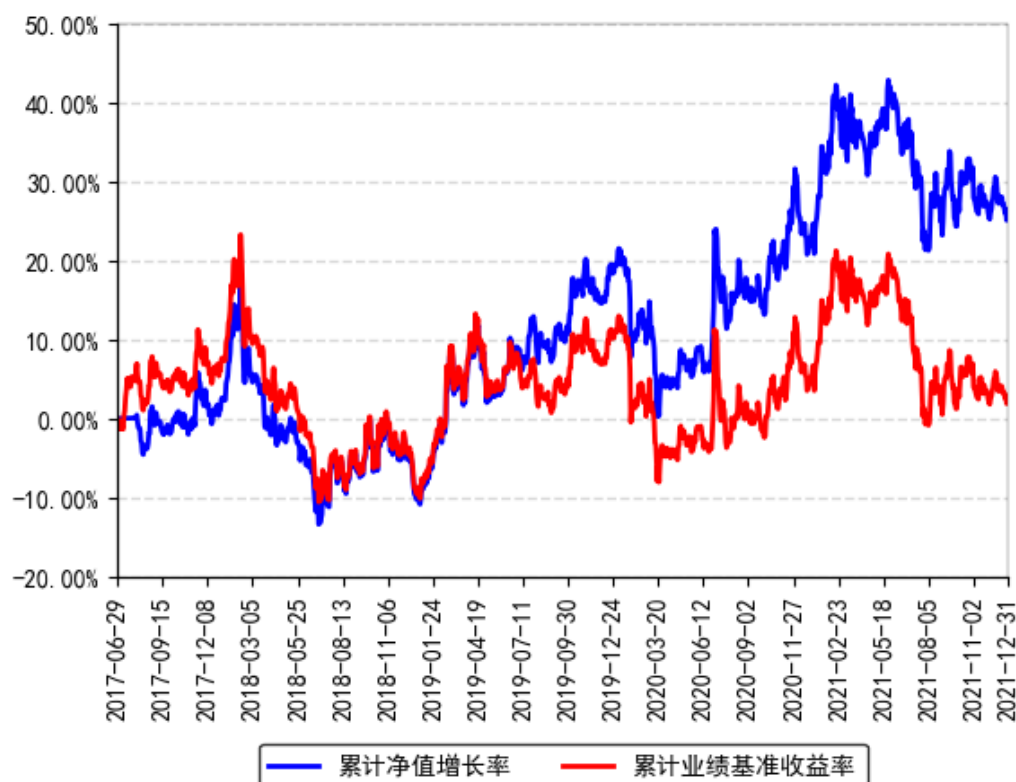
| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -0.48%       | 0.90%               | -0.38%             | 0.85%                     | -0.10% | 0.05% |
| 过去六个月          | -7.28%       | 1.18%               | -9.43%             | 1.11%                     | 2.15%  | 0.07% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -7.59%       | 1.16%               | -12.18%            | 1.10%                     | 4.59%  | 0.06% |

### 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

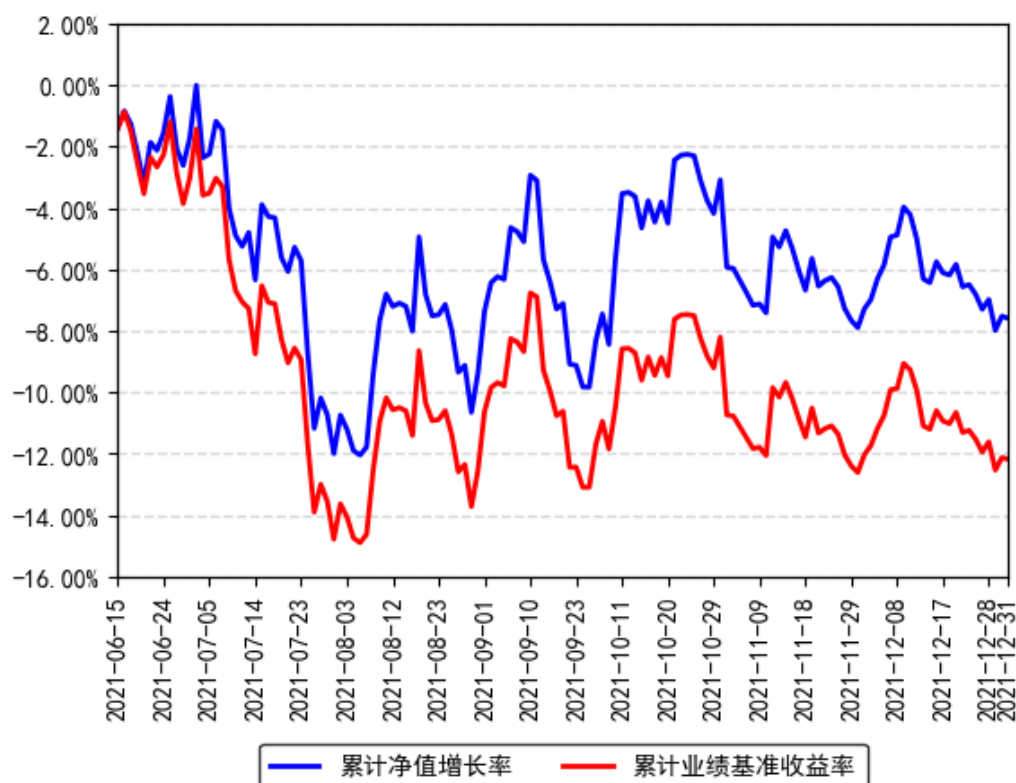
南方银行联接A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方银行联接C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



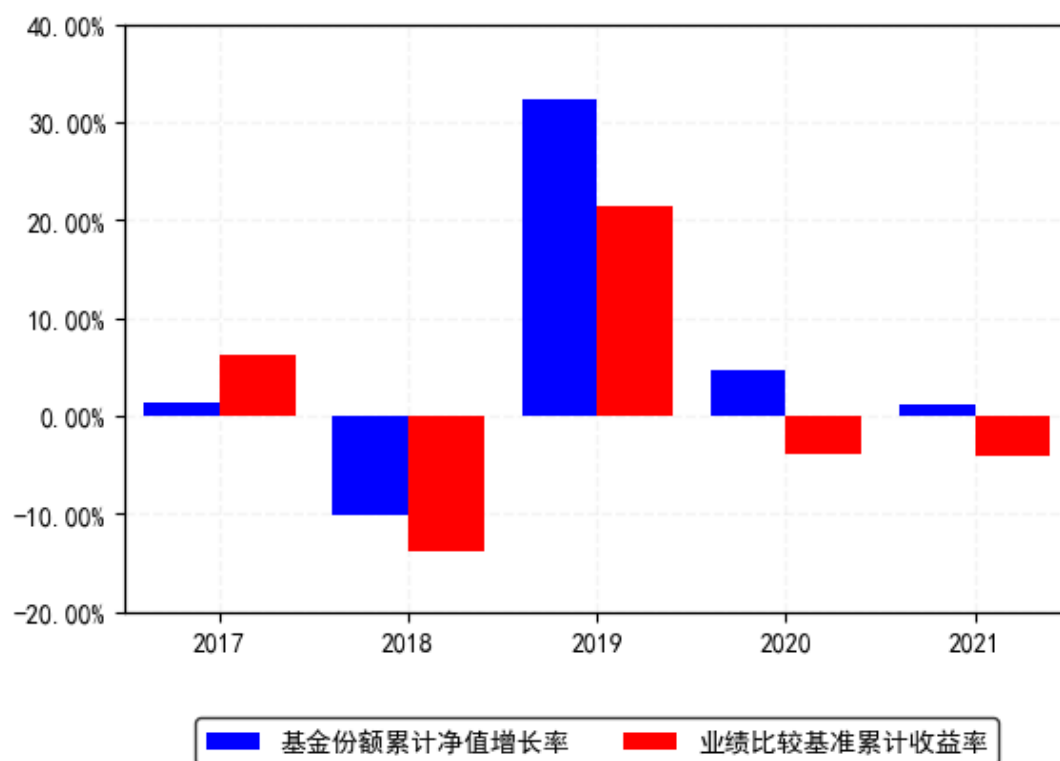
南方银行联接E累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



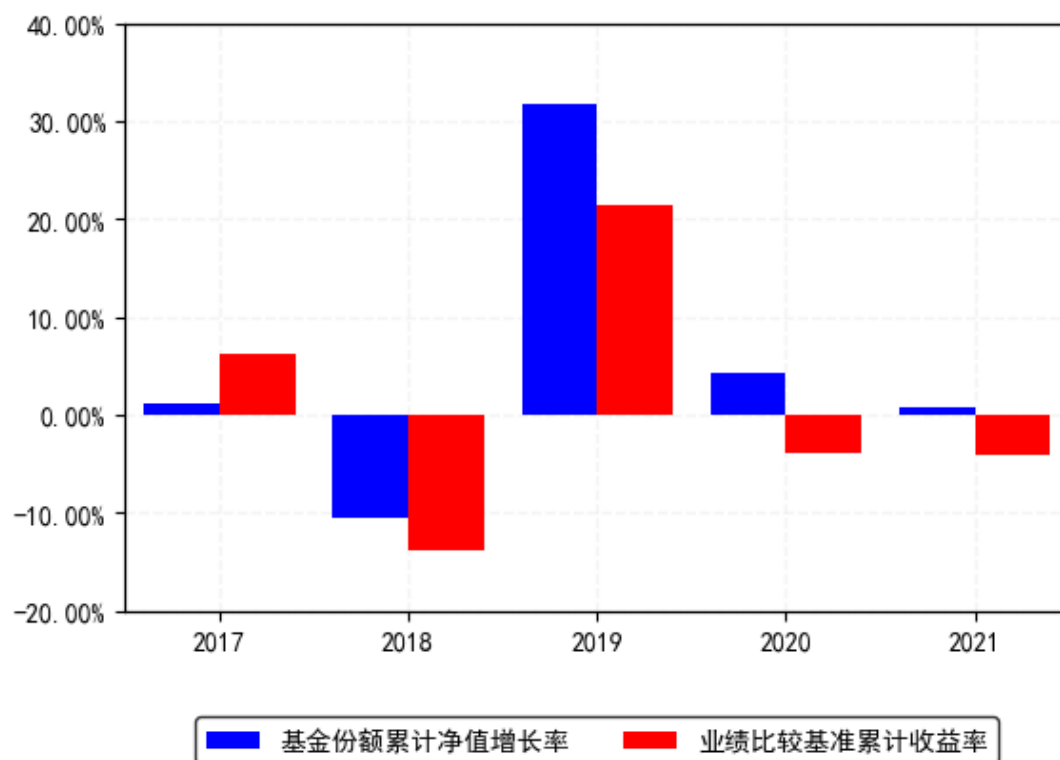
注：1、本基金从2021年6月11日起新增E类份额，E类份额自2021年6月15日起存续。

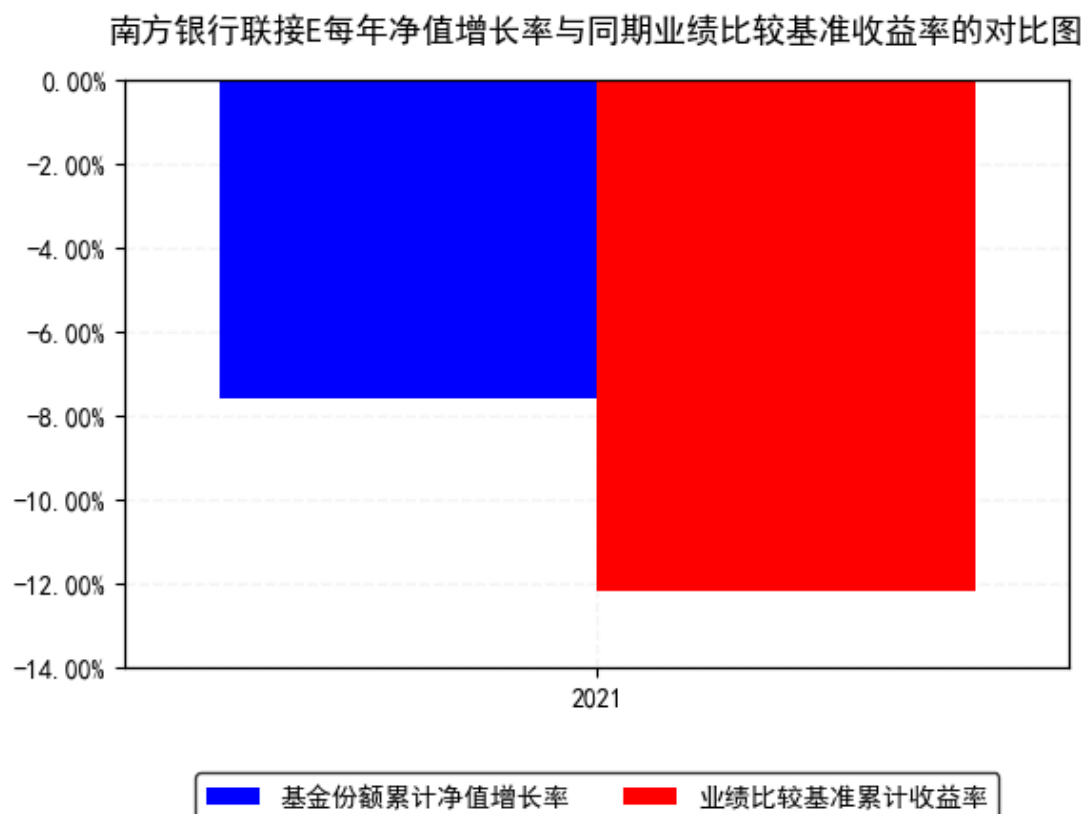
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方银行联接A每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



南方银行联接C每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图





注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019 年 7 月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)

1.72%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)2.24%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)2.25%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)2.32%。目前,公司总部设在深圳,在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司,在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中,南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至本报告期末,南方基金管理股份有限公司(不含子公司)管理资产规模超过 1.5 万亿元,旗下管理 274 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<br>(助理)期限 |      | 证券<br>从业<br>年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|----|---------|---------------------|------|----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |         | 任职日期                | 离任日期 |                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 孙伟 | 本基金基金经理 | 2017 年 6 月 29 日     | -    | 11 年           | 北京大学工商管理硕士,特许金融分析师(CFA)、注册会计师(CPA),具有基金从业资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010 年 2 月加入南方基金,历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员、基金经理助理;2015 年 5 月 22 日至 2016 年 7 月 29 日,任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理;2015 年 7 月 2 日至 2020 年 12 月 1 日,任改革基金、高铁基金基金经理;2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 7 日,任南方中证 500 工业 ETF 基金经理;2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 14 日,任南方中证 500 原材料 ETF 基金经理;2020 年 12 月 1 日至 2021 年 4 月 19 日,任改革基金基金经理;2015 年 7 月 10 日至今,任 500 信息基金经理;2016 年 5 月 13 日至今,任南方创业板 ETF 基金经理;2016 年 5 月 20 日至今,任南方创业板 ETF 联接基金经理;2016 年 8 月 17 日至今,任 500 信息联接基金经理;2016 年 8 月 19 日至今,任深成 ETF、南方深成基金经理;2017 年 3 月 8 日至今,任南方全指证券 ETF 联接基金经理;2017 年 3 月 10 日至今,任南方中证全指证券 ETF 基金经理;2017 年 6 月 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                      |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 28 日至今，任南方中证银行 ETF 基金经理；2017 年 6 月 29 日至今，任南方银行联接基金经理；2018 年 2 月 8 日至今，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至今，任南方 H 股联接基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任南方上证 380ETF、南方上证 380ETF 联接基金经理；2020 年 12 月 1 日至今，任高铁基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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，并依据其管理产品的长期业绩与个人综合贡献情况实施分配。

### 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，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

中证银行指数报告期内下跌 4.41%。

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

我们对本基金跟踪误差归因分析如下：

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

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

(3) 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微小偏离；

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

(5) 新股上市初期涨幅较大的影响。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.2793 元，报告期内，份额净值增长率为 1.22%，同期业绩基准增长率为-4.09%；本基金 C 份额净值为 1.2566 元，报告期内，份额净值增长率为 0.83%，同期业绩基准增长率为-4.09%；本基金 E 份额净值为 1.2767 元，报告期内，份额净值增长率为-7.59%，同期业绩基准增长率为-12.18%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

稳增长和宽信用环境下，银行业绩有望持续释放，叠加板块估值处于历史低位，存量资产风险出清后估值有望上修，板块有望实现戴维斯双击。

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 2021 年度发布的《关于依法从严打击证券违法活动的意见》《证券期货业网络安全事件报告与调查处理办法》和《个人信息保护法》等公募基金相关新法律法规。

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

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程，制订和修订了包括《合规手册》《制度管理办法》《廉洁从业内部控制制度》《内控稽核工作操作

指引》《“洗钱和恐怖融资风险”自评估制度》和《反洗钱内部控制制度》等一系列与监察稽核和合规内控相关的管理制度。

在进一步优化制度体系的基础上，本基金管理人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以及包括网络直播脚本在内的其他宣传材料合规性，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，开展洗钱风险自评估工作，参考同业先进经验，按照风险为本的工作思路，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，持续全面推进合规数字化工作在更广范围应用并与合规管理工作深度融合，努力防范和管理各类风险，切实维护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、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

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

#### 4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的托管过程中，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，南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的投资运作、基金资产净值计算、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

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 2021 年年度报告中财务指标、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 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(2022)第 22071 号 |

## 6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题          | 审计报告                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计报告收件人         | 南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接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>我们审计了南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“南方中证银行 ETF 发起式联接基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 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,公允反映了南方中证银行 ETF 发起式联接基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 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,我们独立于南方中证银行 ETF 发起式联接基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>                                                                                                                                                                                        |
| 强调事项            | -                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 其他事项            | -                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 其他信息            | -                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 南方中证银行 ETF 发起式联接基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 | <p>关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估南方中证银行 ETF 发起式联接基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算南方中证银行 ETF 发起式联接基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督南方中证银行 ETF 发起式联接基金的财务报告过程。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对南方中证银行 ETF 发起式联接基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，</p> |

|           |                                                                                                                                                                                                                                                               |
|-----------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|           | <p>审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致南方中证银行 ETF 发起式联接基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）                                                                                                                                                                                                                                          |
| 注册会计师的姓名  | 张振波；曹阳                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼                                                                                                                                                                                                                        |
| 审计报告日期    | 2022 年 3 月 28 日                                                                                                                                                                                                                                               |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产       | 附注号     | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|----------------------|-----------------------|
| 资产：      |         |                      |                       |
| 银行存款     | 7.4.7.1 | 49,328,856.68        | 24,390,210.36         |
| 结算备付金    |         | 1,642,108.30         | 806,112.49            |
| 存出保证金    |         | 118,049.10           | 168,057.37            |
| 交易性金融资产  | 7.4.7.2 | 1,858,070,742.78     | 1,299,391,480.21      |
| 其中：股票投资  |         | 125,483,778.90       | 92,211,018.61         |
| 基金投资     |         | 1,661,268,177.18     | 1,151,206,312.00      |
| 债券投资     |         | 71,318,786.70        | 55,974,149.60         |
| 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  |         | -                    | -                     |
| 应收利息     | 7.4.7.5 | 1,294,366.14         | 1,017,570.23          |

|            |          |                      |                       |
|------------|----------|----------------------|-----------------------|
| 应收股利       |          | -                    | -                     |
| 应收申购款      |          | 6,216,155.84         | 16,645,390.33         |
| 递延所得税资产    |          | -                    | -                     |
| 其他资产       | 7.4.7.6  | 205,746.00           | -                     |
| 资产总计       |          | 1,916,876,024.84     | 1,342,418,820.99      |
| 负债和所有者权益   | 附注号      | 本期末 2021 年 12 月 31 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     | 7.4.7.3  | -                    | -                     |
| 卖出回购金融资产款  |          | 50,000,000.00        | 44,000,000.00         |
| 应付证券清算款    |          | 22,140,319.83        | 12,404,696.31         |
| 应付赎回款      |          | 7,197,469.29         | 12,159,260.22         |
| 应付管理人报酬    |          | 70,007.42            | 50,225.81             |
| 应付托管费      |          | 14,001.49            | 10,045.17             |
| 应付销售服务费    |          | 315,950.90           | 123,234.03            |
| 应付交易费用     | 7.4.7.7  | 12,831.13            | 10,821.26             |
| 应交税费       |          | -                    | 2.03                  |
| 应付利息       |          | -27,098.62           | 15,079.44             |
| 应付利润       |          | -                    | -                     |
| 递延所得税负债    |          | -                    | -                     |
| 其他负债       | 7.4.7.8  | 215,427.36           | 181,605.19            |
| 负债合计       |          | 79,938,908.80        | 68,954,969.46         |
| 所有者权益：     |          |                      |                       |
| 实收基金       | 7.4.7.9  | 1,450,671,670.97     | 1,013,113,329.73      |
| 未分配利润      | 7.4.7.10 | 386,265,445.07       | 260,350,521.80        |
| 所有者权益合计    |          | 1,836,937,116.04     | 1,273,463,851.53      |
| 负债和所有者权益总计 |          | 1,916,876,024.84     | 1,342,418,820.99      |

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，南方银行联接 A 份额净值 1.2793 元，基金份额总额 567,650,937.62 份；南方银行联接 C 份额净值 1.2566 元，基金份额总额 825,685,045.03 份；南方银行联接 E 份额净值 1.2767 元，基金份额总额 57,335,688.32 份；总份额合计 1,450,671,670.97 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2020 年<br>1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|----|-----|----------------------------------------|---------------------------------------------|
|----|-----|----------------------------------------|---------------------------------------------|

|                       |            |                | 月 31 日        |
|-----------------------|------------|----------------|---------------|
| 一、收入                  |            | 26,341,889.77  | 85,654,047.02 |
| 1.利息收入                |            | 1,773,464.31   | 640,736.60    |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.11   | 129,590.78     | 75,561.58     |
| 债券利息收入                |            | 1,643,873.53   | 565,175.02    |
| 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）      |            | 106,144,094.70 | 22,527,477.89 |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.12   | 24,845,363.16  | -3,737,602.98 |
| 基金投资收益                | 7.4.7.13   | 78,353,731.83  | 9,620,398.12  |
| 债券投资收益                | 7.4.7.14   | 137,494.09     | -10,869.58    |
| 资产支持证券投资              | 7.4.7.14.5 | -              | -             |
| 收益                    |            |                |               |
| 贵金属投资收益               | 7.4.7.15   | -              | -             |
| 衍生工具收益                | 7.4.7.16   | -              | -             |
| 股利收益                  | 7.4.7.17   | 2,807,505.62   | 16,655,552.33 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18   | -85,784,157.26 | 60,461,654.65 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -              | -             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.19   | 4,208,488.02   | 2,024,177.88  |
| 减：二、费用                |            | 6,754,901.31   | 2,241,683.33  |
| 1.管理人报酬               | 7.4.10.3.1 | 793,046.84     | 290,781.54    |
| 2.托管费                 | 7.4.10.3.2 | 158,609.37     | 58,156.38     |
| 3.销售服务费               | 7.4.10.3.3 | 3,267,570.66   | 736,536.67    |
| 4.交易费用                | 7.4.7.20   | 1,033,400.58   | 562,845.91    |
| 5.利息支出                |            | 1,291,844.62   | 433,060.60    |
| 其中：卖出回购金融资产支出         |            | 1,291,844.62   | 433,060.60    |
| 6.税金及附加               |            | 0.24           | 0.23          |
| 7.其他费用                | 7.4.7.21   | 210,429.00     | 160,302.00    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）   |            | 19,586,988.46  | 83,412,363.69 |
| 减：所得税费用               |            | -              | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）     |            | 19,586,988.46  | 83,412,363.69 |

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）                        | 1,013,113,329.73                         | 260,350,521.80  | 1,273,463,851.53  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                        | 19,586,988.46   | 19,586,988.46     |
| 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）      | 437,558,341.24                           | 106,327,934.81  | 543,886,276.05    |
| 其中：1.基金申购款                             | 2,495,003,195.61                         | 800,581,820.48  | 3,295,585,016.09  |
| 2.基金赎回款                                | -2,057,444,854.37                        | -694,253,885.67 | -2,751,698,740.04 |
| 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）                        | 1,450,671,670.97                         | 386,265,445.07  | 1,836,937,116.04  |
| 项目                                     | 上年度可比期间 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）                        | 152,150,777.56                           | 30,448,792.03   | 182,599,569.59    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                        | 83,412,363.69   | 83,412,363.69     |
| 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）      | 860,962,552.17                           | 146,489,366.08  | 1,007,451,918.25  |
| 其中：1.基金申购款                             | 1,789,894,335.82                         | 316,607,221.39  | 2,106,501,557.21  |
| 2.基金赎回款                                | -928,931,783.65                          | -170,117,855.31 | -1,099,049,638.96 |
| 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）                        | 1,013,113,329.73                         | 260,350,521.80  | 1,273,463,851.53  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

|               |              |              |
|---------------|--------------|--------------|
| ____ 杨小松 ____ | ____ 徐超 ____ | ____ 徐超 ____ |
| 基金管理人负责人      | 主管会计工作负责人    | 会计机构负责人      |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(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[2016]2985 号《关于准予南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的批复》注册,由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司,已于2018年1月4日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 15,867,926.03 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 589 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》于2017年6月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 15,869,064.50 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,138.47 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于2021年6月8日发布的《关于南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金增加 E 类份额并修改基金合同的公告》,自2021年6月11日起,本基金增加收取销售服务费的 E 类基金份额。根据更新后的《南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》的有关规定,本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用、不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类或 E 类基金份额。本基金 A 类、C 类和 E 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 E 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

本基金为南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对中证银行指数紧密跟踪的被动指数基金,本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为目标 ETF 基金份额、中证

银行指数成份股、备选成份股。此外，本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票以及存托凭证)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为中证银行指数收益率 $\times 95\%$ +银行人民币活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

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2022年3月28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》、《南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》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2021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2021年12月31日的财务状况以及2021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、基金投资和债券投资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。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、基金投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格

确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占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。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。债券投资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、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 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）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金

金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号—收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策

的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金，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基金份额净值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 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------|-----------------------|
| 活期存款           | 49,328,856.68        | 24,390,210.36         |
| 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          | 49,328,856.68 | 24,390,210.36 |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末 2021 年 12 月 31 日  |                  |               |
|---------------|-------|-----------------------|------------------|---------------|
|               |       | 成本                    | 公允价值             | 公允价值变动        |
| 股票            |       | 132,071,974.62        | 125,483,778.90   | -6,588,195.72 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                     | -                | -             |
| 债券            | 交易所市场 | 71,504,516.10         | 71,318,786.70    | -185,729.40   |
|               | 银行间市场 | -                     | -                | -             |
|               | 合计    | 71,504,516.10         | 71,318,786.70    | -185,729.40   |
| 资产支持证券        |       | -                     | -                | -             |
| 基金            |       | 1,664,422,737.28      | 1,661,268,177.18 | -3,154,560.10 |
| 其他            |       | -                     | -                | -             |
| 合计            |       | 1,867,999,228.00      | 1,858,070,742.78 | -9,928,485.22 |
| 项目            |       | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |                  |               |
|               |       | 成本                    | 公允价值             | 公允价值变动        |
| 股票            |       | 88,451,828.63         | 92,211,018.61    | 3,759,189.98  |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                     | -                | -             |
| 债券            | 交易所市场 | 56,044,741.70         | 55,974,149.60    | -70,592.10    |
|               | 银行间市场 | -                     | -                | -             |
|               | 合计    | 56,044,741.70         | 55,974,149.60    | -70,592.10    |
| 资产支持证券        |       | -                     | -                | -             |
| 基金            |       | 1,079,039,237.84      | 1,151,206,312.00 | 72,167,074.16 |
| 其他            |       | -                     | -                | -             |
| 合计            |       | 1,223,535,808.17      | 1,299,391,480.21 | 75,855,672.04 |

注：基金投资均为本基金持有的目标ETF的份额，按估值日目标ETF的份额净值确定公允价值。本基金可采用全现金替代申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF份额的买卖。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|------------|----------------------|-----------------------|
| 应收活期存款利息   | 4,442.07             | 2,892.02              |
| 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  | 739.00               | 362.80                |
| 应收债券利息     | 1,289,131.97         | 1,014,239.71          |
| 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         | 53.10                | 75.70                 |
| 合计         | 1,294,366.14         | 1,017,570.23          |

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-------|----------------------|-----------------------|
| 其他应收款 | -                    | -                     |
| 待摊费用  | -                    | -                     |
| 可收退补款 | 205,746.00           | -                     |
| 应收退补款 | -                    | -                     |
| 合计    | 205,746.00           | -                     |

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|----------------------|-----------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 12,831.13            | 10,821.26             |
| 银行间市场应付交易费用 | -                    | -                     |
| 合计          | 12,831.13            | 10,821.26             |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|----------------------|-----------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                    | -                     |
| 应付赎回费       | 5,427.36             | 21,605.19             |
| 应付证券出借违约金   | -                    | -                     |
| 应退退补款       | -                    | -                     |
| 预提费用        | 210,000.00           | 160,000.00            |
| 应付指数使用费     | -                    | -                     |

|       |            |            |
|-------|------------|------------|
| 可退替代款 | -          | -          |
| 其他    | -          | -          |
| 合计    | 215,427.36 | 181,605.19 |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 南方银行联接 A      |                                     |                 |
|---------------|-------------------------------------|-----------------|
| 项目            | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |                 |
|               | 基金份额（份）                             | 账面金额            |
| 上年度末          | 614,441,313.23                      | 614,441,313.23  |
| 本期申购          | 637,293,786.78                      | 637,293,786.78  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -684,084,162.39                     | -684,084,162.39 |
| 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           | 567,650,937.62                      | 567,650,937.62  |

| 南方银行联接 C      |                                     |                   |
|---------------|-------------------------------------|-------------------|
| 项目            | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |                   |
|               | 基金份额（份）                             | 账面金额              |
| 上年度末          | 398,672,016.50                      | 398,672,016.50    |
| 本期申购          | 1,724,375,327.76                    | 1,724,375,327.76  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,297,362,299.23                   | -1,297,362,299.23 |
| 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           | 825,685,045.03                      | 825,685,045.03    |

| 南方银行联接 E      |                                     |                |
|---------------|-------------------------------------|----------------|
| 项目            | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |                |
|               | 基金份额（份）                             | 账面金额           |
| 上年度末          | -                                   | -              |
| 本期申购          | 133,334,081.07                      | 133,334,081.07 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -75,998,392.75                      | -75,998,392.75 |
| 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           | 57,335,688.32                       | 57,335,688.32  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 南方银行联接 A       |                |                 |                 |
|----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
| 上年度末           | 49,644,176.16  | 112,493,675.85  | 162,137,852.01  |
| 本期利润           | 49,631,974.54  | -25,408,190.82  | 24,223,783.72   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 7,667,117.16   | -35,473,429.85  | -27,806,312.69  |
| 其中：基金申购款       | 95,784,411.74  | 121,345,261.99  | 217,129,673.73  |
| 基金赎回款          | -88,117,294.58 | -156,818,691.84 | -244,935,986.42 |
| 本期已分配利润        | -              | -               | -               |
| 本期末            | 106,943,267.86 | 51,612,055.18   | 158,555,323.04  |

| 南方银行联接 C       |                 |                 |                 |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
| 上年度末           | 25,884,176.82   | 72,328,492.97   | 98,212,669.79   |
| 本期利润           | 55,418,571.49   | -57,125,768.85  | -1,707,197.36   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 55,471,321.76   | 59,869,046.86   | 115,340,368.62  |
| 其中：基金申购款       | 214,051,593.66  | 328,541,630.96  | 542,593,224.62  |
| 基金赎回款          | -158,580,271.90 | -268,672,584.10 | -427,252,856.00 |
| 本期已分配利润        | -               | -               | -               |
| 本期末            | 136,774,070.07  | 75,071,770.98   | 211,845,841.05  |

| 南方银行联接 E       |                |               |                |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | -              | -             | -              |
| 本期利润           | 320,599.69     | -3,250,197.59 | -2,929,597.90  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 10,326,070.32  | 8,467,808.56  | 18,793,878.88  |
| 其中：基金申购款       | 24,196,151.36  | 16,662,770.77 | 40,858,922.13  |
| 基金赎回款          | -13,870,081.04 | -8,194,962.21 | -22,065,043.25 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 10,646,670.01  | 5,217,610.97  | 15,864,280.98  |

## 7.4.7.11 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 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------|-------------------------------------|------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 94,033.12                           | 52,547.78                                |
| 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 | 33,071.69                           | 21,679.62                                |

|    |            |           |
|----|------------|-----------|
| 其他 | 2,485.97   | 1,334.18  |
| 合计 | 129,590.78 | 75,561.58 |

#### 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 2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月<br>1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|------------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 30,159,201.13                          | 3,471,484.61                                |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -                                      | -                                           |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -5,313,837.97                          | -7,209,087.59                               |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | -                                      | -                                           |
| 合计               | 24,845,363.16                          | -3,737,602.98                               |

##### 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 2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月<br>1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 648,047,833.11                         | 252,855,051.02                              |
| 减：卖出股票成本总额 | 617,888,631.98                         | 249,383,566.41                              |
| 买卖股票差价收入   | 30,159,201.13                          | 3,471,484.61                                |

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票赎回差价收入。

##### 7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

| 项目          | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月<br>1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 申购基金份额总额    | 835,758,950.00                         | 1,117,781,020.00                            |
| 减：现金支付申购款总额 | 134,213,115.06                         | 150,796,684.60                              |
| 减：申购股票成本总额  | 706,859,672.91                         | 974,193,422.99                              |
| 申购差价收入      | -5,313,837.97                          | -7,209,087.59                               |

##### 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 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 |
|----|-------------------------|--------------------|
|----|-------------------------|--------------------|

|               | 年 12 月 31 日    | 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------|-----------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额   | 852,152,977.23 | 370,609,983.97        |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 773,799,245.40 | 360,989,585.85        |
| 基金投资收益        | 78,353,731.83  | 9,620,398.12          |

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                                | 本期 2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月<br>1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------------------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、<br>债转股及债券到期兑付）差价收入 | 137,494.09                             | -10,869.58                                  |
| 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                                | 137,494.09                             | -10,869.58                                  |

##### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                          | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月<br>1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券<br>到期兑付）成交总额   | 108,916,691.38                         | 11,048,296.71                               |
| 减：卖出债券（、债转股及<br>债券到期兑付）成本总额 | 106,476,013.56                         | 10,661,164.17                               |
| 减：应收利息总额                    | 2,303,183.73                           | 398,002.12                                  |
| 买卖债券差价收入                    | 137,494.09                             | -10,869.58                                  |

##### 7.4.7.14.3 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。

##### 7.4.7.14.4 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。

##### 7.4.7.14.5 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。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

##### 7.4.7.15.1 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。

**7.4.7.15.2 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。

**7.4.7.15.3 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。

**7.4.7.15.4 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。

**7.4.7.16 衍生工具收益****7.4.7.16.1 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。

**7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具其他投资收益。

**7.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期 2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月<br>1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 2,807,505.62                           | 3,109,832.33                                |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                                      | -                                           |
| 基金投资产生的股利收益   | -                                      | 13,545,720.00                               |
| 合计            | 2,807,505.62                           | 16,655,552.33                               |

**7.4.7.18 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<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月<br>1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|--------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 1.交易性金融资产    | -85,784,157.26                         | 60,461,654.65                               |
| ——股票投资       | -10,347,385.70                         | 3,758,972.09                                |
| ——债券投资       | -115,137.30                            | -65,178.75                                  |
| ——资产支持证券投资   | -                                      | -                                           |
| ——基金投资       | -75,321,634.26                         | 56,767,861.31                               |
| ——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         | -85,784,157.26 | 60,461,654.65 |

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月<br>1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 3,993,707.21                           | 1,647,316.25                                |
| 基金转换费收入 | 214,780.81                             | 376,861.63                                  |
| 合计      | 4,208,488.02                           | 2,024,177.88                                |

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，其中 A 类基金份额不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产；C 类基金份额不低于赎回费总额的 75% 归入基金资产，E 类基金份额将赎回费收入全额归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中，A 类基金份额不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产；C 类基金份额不低于赎回费部分的 75% 归入转出基金的基金资产，E 类基金份额将转出基金的赎回费全额归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月<br>1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 962,815.06                             | 509,617.19                                  |
| 银行间市场交易费用 | -                                      | -                                           |
| 交易基金产生的费用 | 70,585.52                              | 53,228.72                                   |
| 其中：申购费    | -                                      | -                                           |
| 赎回费       | -                                      | -                                           |
| 场内交易费     | 21,739.93                              | 7,417.17                                    |
| 其他        | 48,845.59                              | 45,811.55                                   |
| 合计        | 1,033,400.58                           | 562,845.91                                  |

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月<br>1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|---------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 审计费用    | 90,000.00                              | 40,000.00                                   |
| 信息披露费   | 120,000.00                             | 120,000.00                                  |
| 证券出借违约金 | -                                      | -                                           |
| 银行费用    | 429.00                                 | 302.00                                      |
| 合计      | 210,429.00                             | 160,302.00                                  |

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

无。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |              | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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  | 134,625,245.72                      | 10.52%       | 112,730,741.16                           | 9.11%        |
| 兴业证券  | 1,144,533,621.93                    | 89.48%       | 1,125,126,788.25                         | 90.89%       |

#### 7.4.10.1.2 基金交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |              | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |              |
|-------|-------------------------------------|--------------|------------------------------------------|--------------|
|       | 成交金额                                | 占当期基金成交总额的比例 | 成交金额                                     | 占当期基金成交总额的比例 |
| 兴业证券  | 2,210,379,533.83                    | 100.00%      | 1,652,820,462.67                         | 100.00%      |

注：2021 年度基金成交金额中，包括基金申购赎回 1,687,911,927.23 元，基金二级市场买卖 522,467,606.60 元(2020 年度基金成交金额中包括基金申购赎回 1,487,997,003.97 元，基金二级市场买卖 164,823,458.70 元)。

#### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.2 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 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  | 13,462.21                                | 10.52%     | 954.69    | 7.44%        |
| 兴业证券  | 114,453.67                               | 89.48%     | 11,876.44 | 92.56%       |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 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  | 11,273.22                                | 9.11%      | 1,148.67  | 10.61%       |
| 兴业证券  | 112,513.04                               | 90.89%     | 9,672.59  | 89.39%       |

注：

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

#### 7.4.10.3 关联方报酬

##### 7.4.10.3.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------|-------------------------------------|------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 793,046.84                          | 290,781.54                               |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,164,729.60                        | 701,724.41                               |

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额

(若为负数, 则取零)的 0.50%的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=(前一日基金资产净值-前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产)×0.50%/当年天数。

#### 7.4.10.3.2 基金托管费

单位: 人民币元

| 项目             | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------------------|------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 158,609.37                          | 58,156.38                                |

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

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

#### 7.4.10.3.3 销售服务费

单位: 人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日      |            |           |            |
|----------------|------------------------------------------|------------|-----------|------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                         |            |           |            |
|                | 南方银行联接 A                                 | 南方银行联接 C   | 南方银行联接 E  | 合计         |
| 工商银行           | -                                        | 151,173.56 | -         | 151,173.56 |
| 华泰证券           | -                                        | 19,859.22  | 54.84     | 19,914.06  |
| 南方基金           | -                                        | 303,466.99 | 75,620.44 | 379,087.43 |
| 兴业证券           | -                                        | 679.96     | -         | 679.96     |
| 合计             | -                                        | 475,179.73 | 75,675.28 | 550,855.01 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |            |           |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                         |            |           |            |
|                | 南方银行联接 A                                 | 南方银行联接 C   | 南方银行联接 E  | 合计         |
| 工商银行           | -                                        | 58,240.78  | -         | 58,240.78  |
| 华泰证券           | -                                        | 7,690.99   | -         | 7,690.99   |
| 南方基金           | -                                        | 205,000.67 | -         | 205,000.67 |
| 兴业证券           | -                                        | 44.43      | -         | 44.43      |
| 合计             | -                                        | 270,976.87 | -         | 270,976.87 |

注: 支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类和 E 类基金份额的基金资产净值 0.40%的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付给南方基金, 再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

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

**7.4.10.4 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易**

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

**7.4.10.5 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****7.4.10.5.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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

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

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

**7.4.10.6 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.6.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

| 项目                  | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |          |          |
|---------------------|-------------------------------------|----------|----------|
|                     | 南方银行联接 A                            | 南方银行联接 C | 南方银行联接 E |
| 报告期初持有的基金份额         | -                                   | -        | -        |
| 报告期间申购/买入总份额        | -                                   | -        | -        |
| 报告期间因拆分变动份额         | -                                   | -        | -        |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | -                                   | -        | -        |
| 报告期末持有的基金份额         | -                                   | -        | -        |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | -                                   | -        | -        |

| 项目           | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |          |          |
|--------------|------------------------------------------|----------|----------|
|              | 南方银行联接 A                                 | 南方银行联接 C | 南方银行联接 E |
| 报告期初持有的基金份额  | 10,001,055.66                            | -        | -        |
| 报告期间申购/买入总份额 | -                                        | -        | -        |

|                     |               |   |   |
|---------------------|---------------|---|---|
| 报告期间因拆分变动份额         | -             | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | 10,001,055.66 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额         | -             | - | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | -             | - | - |

注：基金管理人南方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。

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

无。

#### 7.4.10.7 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |           | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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    |
| 工商银行  | 49,328,856.68                       | 94,033.12 | 24,390,210.36                            | 52,547.78 |

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。

#### 7.4.10.8 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

| 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |        |      |      |            |              |
|-------------------------------------|--------|------|------|------------|--------------|
| 关联方名称                               | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入  |              |
|                                     |        |      |      | 数量（单位：股/张） | 总金额          |
| 华泰联合                                | 002142 | 宁波银行 | 配股   | 79,789     | 1,593,386.33 |
| 华泰联合                                | 688192 | 迪哲医药 | 网下申购 | 8,926      | 469,329.08   |
| 华泰联合                                | 688246 | 嘉和美康 | 网下申购 | 7,719      | 304,900.50   |
| 华泰联合                                | 688083 | 中望软件 | 网下申购 | 1,837      | 276,468.50   |
| 华泰联合                                | 113050 | 南银转债 | 配债   | 1,650      | 165,000.00   |
| 华泰联合                                | 688161 | 威高骨科 | 网下申购 | 3,069      | 111,159.18   |
| 华泰联合                                | 688633 | 星球石墨 | 网下申购 | 1,558      | 52,379.96    |
| 华泰联合                                | 688097 | 博众精工 | 网下申购 | 3,983      | 44,888.41    |
| 华泰联合                                | 301078 | 孩子王  | 网下申购 | 7,551      | 43,569.27    |
| 华泰联合                                | 688613 | 奥精医疗 | 网下申购 | 2,617      | 42,997.31    |
| 华泰联合                                | 688350 | 富淼科技 | 网下申购 | 2,552      | 34,656.16    |
| 华泰联合                                | 605499 | 东鹏饮料 | 网下申购 | 632        | 29,242.64    |
| 华泰联合                                | 688260 | 昀冢科技 | 网下申购 | 2,990      | 28,793.70    |

|            |        |      |      |        |              |
|------------|--------|------|------|--------|--------------|
| 华泰联合       | 300975 | 商络电子 | 网下申购 | 4,917  | 26,945.16    |
| 华泰联合       | 688314 | 康拓医疗 | 网下申购 | 1,085  | 18,813.90    |
| 华泰联合       | 301033 | 迈普医学 | 网下申购 | 1,076  | 16,290.64    |
| 华泰联合       | 605389 | 长龄液压 | 网下申购 | 356    | 14,026.40    |
| 华泰联合       | 605208 | 永茂泰  | 网下申购 | 801    | 10,733.40    |
| 华泰联合       | 001234 | 泰慕士  | 网下申购 | 333    | 5,504.49     |
| 兴业证券       | 300979 | 华利集团 | 网下申购 | 9,246  | 307,152.12   |
| 兴业证券       | 688778 | 厦钨新能 | 网下申购 | 5,075  | 124,337.50   |
| 兴业证券       | 688639 | 华恒生物 | 网下申购 | 2,302  | 53,314.32    |
| 兴业证券       | 688195 | 腾景科技 | 网下申购 | 2,693  | 36,624.80    |
| 兴业证券       | 688597 | 煜邦电力 | 网下申购 | 3,907  | 22,973.16    |
| 兴业证券       | 605298 | 必得科技 | 网下申购 | 391    | 6,252.09     |
| 兴业证券       | 605086 | 龙高股份 | 网下申购 | 443    | 5,696.98     |
| 兴业证券, 华泰联合 | 113052 | 兴业转债 | 配债   | 18,920 | 1,892,000.00 |

| 上年度可比期间 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 | 5,991      | 48,946.47 |

#### 7.4.10.9 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.9.1 其他关联交易事项的说明

1. 于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有目标 ETF 基金份额, 成本总额为人民币 1,664,422,737.28 元, 估值总额为人民币 1,661,268,177.18 元, 占本基金基金资产净值的比例为 90.44%(2020 年 12 月 31 日: 成本总额为人民币 1,079,039,237.84 元, 估值总额为人民币 1,151,206,312.00 元, 占本基金基金资产净值的比例为 90.40%)。

2. 于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有关联方中国工商银行发行的普通股, 成本总额为人民币 5,267,338.20 元, 估值总额为人民币 5,228,659.00 元, 占本基金基金资产净值的比例为 0.28%(2020 年 12 月 31 日: 成本总额为人民币 6,112,696.77 元, 估值总额为人民币 6,076,822.00 元, 占本基金基金资产净值的比例为 0.48%)。

#### 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(2021 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 |
|--------|------|------------------|-----------------|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 001234 | 泰慕士  | 2021 年 12 月 31 日 | 2022 年 1 月 11 日 | 新股未上市  | 16.53 | 16.53  | 333      | 5,504.49  | 5,504.49  | -  |
| 300814 | 中富电路 | 2021 年 8 月 4 日   | 2022 年 2 月 14 日 | 新股锁定期  | 8.40  | 23.88  | 328      | 2,755.20  | 7,832.64  | -  |
| 300854 | 中兰环保 | 2021 年 9 月 8 日   | 2022 年 3 月 16 日 | 新股锁定期  | 9.96  | 27.29  | 203      | 2,021.88  | 5,539.87  | -  |
| 300994 | 久祺股份 | 2021 年 8 月 2 日   | 2022 年 2 月 14 日 | 新股锁定期  | 11.90 | 45.45  | 420      | 4,998.00  | 19,089.00 | -  |
| 301020 | 密封科技 | 2021 年 6 月 28 日  | 2022 年 1 月 6 日  | 新股锁定期  | 10.64 | 30.44  | 421      | 4,479.44  | 12,815.24 | -  |
| 301021 | 英诺激光 | 2021 年 6 月 28 日  | 2022 年 1 月 6 日  | 新股锁定期  | 9.46  | 41.43  | 290      | 2,743.40  | 12,014.70 | -  |
| 301025 | 读客文化 | 2021 年 7 月 6 日   | 2022 年 1 月 24 日 | 新股锁定期  | 1.55  | 20.88  | 403      | 624.65    | 8,414.64  | -  |
| 301026 | 浩通科技 | 2021 年 7 月 8 日   | 2022 年 1 月 17 日 | 新股锁定期  | 18.03 | 62.73  | 203      | 3,660.09  | 12,734.19 | -  |
| 301027 | 华蓝集团 | 2021 年 7 月 8 日   | 2022 年 1 月 19 日 | 新股锁定期  | 11.45 | 16.65  | 286      | 3,274.70  | 4,761.90  | -  |
| 301028 | 东亚机械 | 2021 年 7 月 12 日  | 2022 年 1 月 20 日 | 新股锁定期  | 5.31  | 13.50  | 733      | 3,892.23  | 9,895.50  | -  |
| 301030 | 仕净科技 | 2021 年 7 月 15 日  | 2022 年 1 月 24 日 | 新股锁定期  | 6.10  | 31.52  | 242      | 1,476.20  | 7,627.84  | -  |
| 301032 | 新柴股份 | 2021 年 7 月 15 日  | 2022 年 1 月 24 日 | 新股锁定期  | 4.97  | 12.51  | 513      | 2,549.61  | 6,417.63  | -  |
| 301033 | 迈普医学 | 2021 年 7 月 15 日  | 2022 年 1 月 26 日 | 新股锁定期  | 15.14 | 59.97  | 108      | 1,635.12  | 6,476.76  | -  |
| 301035 | 润丰股份 | 2021 年 7 月 21 日  | 2022 年 1 月 28 日 | 新股锁定期  | 22.04 | 56.28  | 644      | 14,193.76 | 36,244.32 | -  |

|        |       |                       |                       |           |       |            |       |           |           |   |
|--------|-------|-----------------------|-----------------------|-----------|-------|------------|-------|-----------|-----------|---|
|        |       | 日                     | 日                     |           |       |            |       |           |           |   |
| 301037 | 保 立 佳 | 2021 年<br>7 月 21<br>日 | 2022 年<br>2 月 7<br>日  | 新股锁<br>定期 | 14.82 | 24.26      | 193   | 2,860.26  | 4,682.18  | - |
| 301039 | 中集车辆  | 2021 年<br>7 月 1<br>日  | 2022 年<br>1 月 10<br>日 | 新股锁<br>定期 | 6.96  | 12.51      | 2,064 | 14,365.44 | 25,820.64 | - |
| 301041 | 金 百 泽 | 2021 年<br>8 月 2<br>日  | 2022 年<br>2 月 11<br>日 | 新股锁<br>定期 | 7.31  | 28.21      | 215   | 1,571.65  | 6,065.15  | - |
| 301045 | 天禄科技  | 2021 年<br>8 月 6<br>日  | 2022 年<br>2 月 17<br>日 | 新股锁<br>定期 | 15.81 | 28.37      | 335   | 5,296.35  | 9,503.95  | - |
| 301046 | 能辉科技  | 2021 年<br>8 月 10<br>日 | 2022 年<br>2 月 17<br>日 | 新股锁<br>定期 | 8.34  | 48.99      | 290   | 2,418.60  | 14,207.10 | - |
| 301050 | 雷电微力  | 2021 年<br>8 月 17<br>日 | 2022 年<br>2 月 24<br>日 | 新股锁<br>定期 | 60.64 | 234.7<br>4 | 233   | 14,129.12 | 54,694.42 | - |
| 301053 | 远信工业  | 2021 年<br>8 月 25<br>日 | 2022 年<br>3 月 1<br>日  | 新股锁<br>定期 | 11.87 | 28.78      | 155   | 1,839.85  | 4,460.90  | - |
| 301056 | 森赫股份  | 2021 年<br>8 月 27<br>日 | 2022 年<br>3 月 7<br>日  | 新股锁<br>定期 | 3.93  | 11.09      | 572   | 2,247.96  | 6,343.48  | - |
| 301057 | 汇隆新材  | 2021 年<br>8 月 31<br>日 | 2022 年<br>3 月 9<br>日  | 新股锁<br>定期 | 8.03  | 19.02      | 218   | 1,750.54  | 4,146.36  | - |
| 301059 | 金 三 江 | 2021 年<br>9 月 3<br>日  | 2022 年<br>3 月 14<br>日 | 新股锁<br>定期 | 8.09  | 19.30      | 259   | 2,095.31  | 4,998.70  | - |
| 301060 | 兰卫医学  | 2021 年<br>9 月 6<br>日  | 2022 年<br>3 月 14<br>日 | 新股锁<br>定期 | 4.17  | 30.94      | 587   | 2,447.79  | 18,161.78 | - |
| 301062 | 上海艾录  | 2021 年<br>9 月 7<br>日  | 2022 年<br>3 月 14<br>日 | 新股锁<br>定期 | 3.31  | 17.01      | 523   | 1,731.13  | 8,896.23  | - |
| 301063 | 海锅股份  | 2021 年<br>9 月 9<br>日  | 2022 年<br>3 月 24<br>日 | 新股锁<br>定期 | 17.40 | 36.11      | 153   | 2,662.20  | 5,524.83  | - |
| 301069 | 凯盛新材  | 2021 年<br>9 月 16<br>日 | 2022 年<br>3 月 28<br>日 | 新股锁<br>定期 | 5.17  | 44.21      | 539   | 2,786.63  | 23,829.19 | - |
| 301072 | 中捷精工  | 2021 年                | 2022 年                | 新股锁       | 7.46  | 33.41      | 181   | 1,350.26  | 6,047.21  | - |

|        |      |             |            |       |        |        |       |            |            |   |
|--------|------|-------------|------------|-------|--------|--------|-------|------------|------------|---|
|        |      | 9月22日       | 3月29日      | 定期    |        |        |       |            |            |   |
| 301073 | 君亭酒店 | 2021年9月22日  | 2022年3月30日 | 新股锁定期 | 12.24  | 32.00  | 144   | 1,762.56   | 4,608.00   | - |
| 301078 | 孩子王  | 2021年9月30日  | 2022年4月14日 | 新股锁定期 | 5.77   | 12.14  | 756   | 4,362.12   | 9,177.84   | - |
| 301079 | 邵阳液压 | 2021年10月11日 | 2022年4月19日 | 新股锁定期 | 11.92  | 24.82  | 140   | 1,668.80   | 3,474.80   | - |
| 301083 | 百胜智能 | 2021年10月13日 | 2022年4月21日 | 新股锁定期 | 9.08   | 14.21  | 416   | 3,777.28   | 5,911.36   | - |
| 301089 | 拓新药业 | 2021年10月20日 | 2022年4月27日 | 新股锁定期 | 19.11  | 67.93  | 220   | 4,204.20   | 14,944.60  | - |
| 301127 | 天源环保 | 2021年12月23日 | 2022年6月30日 | 新股锁定期 | 12.03  | 17.12  | 1,685 | 20,270.55  | 28,847.20  | - |
| 301138 | 华研精机 | 2021年12月8日  | 2022年6月15日 | 新股锁定期 | 26.17  | 44.86  | 285   | 7,458.45   | 12,785.10  | - |
| 301166 | 优宁维  | 2021年12月21日 | 2022年6月28日 | 新股锁定期 | 86.06  | 94.50  | 253   | 21,773.18  | 23,908.50  | - |
| 301168 | 通灵股份 | 2021年12月2日  | 2022年6月10日 | 新股锁定期 | 39.08  | 52.13  | 329   | 12,857.32  | 17,150.77  | - |
| 301177 | 迪阿股份 | 2021年12月8日  | 2022年6月15日 | 新股锁定期 | 116.88 | 116.08 | 740   | 86,491.20  | 85,899.20  | - |
| 301193 | 家联科技 | 2021年12月2日  | 2022年6月9日  | 新股锁定期 | 30.73  | 29.14  | 297   | 9,126.81   | 8,654.58   | - |
| 688032 | 禾迈股份 | 2021年12月13日 | 2022年6月20日 | 新股锁定期 | 557.80 | 650.66 | 1,146 | 639,238.80 | 745,656.36 | - |
| 688192 | 迪哲医药 | 2021年12月3日  | 2022年6月10日 | 新股锁定期 | 52.58  | 34.56  | 8,926 | 469,329.08 | 308,482.56 | - |
| 688262 | 国芯科技 | 2021年12月28日 | 2022年1月6日  | 新股未上市 | 41.98  | 41.98  | 7,129 | 299,275.42 | 299,275.42 | - |

| 688799               | 华纳药厂 | 2021 年<br>7 月 5<br>日   | 2022 年<br>1 月 13<br>日 | 新股锁<br>定期  | 30.82      | 40.73          | 1,917        | 59,081.94        | 78,079.41        | -  |
|----------------------|------|------------------------|-----------------------|------------|------------|----------------|--------------|------------------|------------------|----|
| 871245               | 威博液压 | 2021 年<br>12 月 24<br>日 | 2022 年<br>1 月 6<br>日  | 新股未<br>上市  | 9.68       | 9.68           | 200          | 1,936.00         | 1,936.00         | -  |
| 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券 |      |                        |                       |            |            |                |              |                  |                  |    |
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认<br>购日              | 可流通<br>日              | 流通受<br>限类型 | 认购<br>价格   | 期末<br>估值<br>单价 | 数量（单<br>位：张） | 期末成本<br>总额       | 期末估值<br>总额       | 备注 |
| 113052               | 兴业转债 | 2021 年<br>12 月 28<br>日 | 2022 年<br>1 月 14<br>日 | 配债未<br>上市  | 100.0<br>0 | 100.0<br>0     | 18,920       | 1,892,000.0<br>0 | 1,892,000.0<br>0 | -  |

注：

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

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

3、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

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 50,000,000.00 元，截至 2022 年 1 月 7 日先后到期。该类交易要求本

基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金紧密跟踪中证银行指数，具有和中证银行指数以及中证银行指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资的金融工具主要包括基金投资和股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”的风险收益目标。

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本

基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，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 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 0.10% (2020 年 12 月 31 日：0.05%)。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 50,000,000.00 元将在一个月以内到期且计息 (该利息金额不重大) 外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值 (所有者权益) 无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，如根据基金合同的规定，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流

动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 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 0.21%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2021<br>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                    | 49,328,856.6 | -     | -     | -   | 49,328,856.6 |

|                          |                |       |              |                  |                  |
|--------------------------|----------------|-------|--------------|------------------|------------------|
|                          | 8              |       |              |                  | 8                |
| 结算备付金                    | 1,642,108.30   | -     | -            | -                | 1,642,108.30     |
| 存出保证金                    | 118,049.10     | -     | -            | -                | 118,049.10       |
| 交易性金融资产                  | 69,426,786.70  | -     | 1,892,000.00 | 1,786,751,956.08 | 1,858,070,742.78 |
| 买入返售金融资产                 | -              | -     | -            | -                | -                |
| 应收利息                     | -              | -     | -            | 1,294,366.14     | 1,294,366.14     |
| 应收股利                     | -              | -     | -            | -                | -                |
| 应收申购款                    | -              | -     | -            | 6,216,155.84     | 6,216,155.84     |
| 应收证券清算款                  | -              | -     | -            | -                | -                |
| 其他资产                     | -              | -     | -            | 205,746.00       | 205,746.00       |
| 资产总计                     | 120,515,800.78 | -     | 1,892,000.00 | 1,794,468,224.06 | 1,916,876,024.84 |
| 负债                       |                |       |              |                  |                  |
| 应付赎回款                    | -              | -     | -            | 7,197,469.29     | 7,197,469.29     |
| 应付管理人报酬                  | -              | -     | -            | 70,007.42        | 70,007.42        |
| 应付托管费                    | -              | -     | -            | 14,001.49        | 14,001.49        |
| 应付证券清算款                  | -              | -     | -            | 22,140,319.83    | 22,140,319.83    |
| 卖出回购金融资产款                | 50,000,000.00  | -     | -            | -                | 50,000,000.00    |
| 应付销售服务费                  | -              | -     | -            | 315,950.90       | 315,950.90       |
| 应付交易费用                   | -              | -     | -            | 12,831.13        | 12,831.13        |
| 应付利息                     | -              | -     | -            | -27,098.62       | -27,098.62       |
| 应付利润                     | -              | -     | -            | -                | -                |
| 应交税费                     | -              | -     | -            | -                | -                |
| 其他负债                     | -              | -     | -            | 215,427.36       | 215,427.36       |
| 负债总计                     | 50,000,000.00  | -     | -            | 29,938,908.80    | 79,938,908.80    |
| 利率敏感度缺口                  | 70,515,800.78  | -     | 1,892,000.00 | 1,764,529,315.26 | 1,836,937,116.04 |
| 上年度末<br>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                     | 24,390,210.36  | -     | -            | -                | 24,390,210.36    |
| 结算备付金                    | 806,112.49     | -     | -            | -                | 806,112.49       |

|           |               |   |            |                  |                  |
|-----------|---------------|---|------------|------------------|------------------|
| 存出保证金     | 168,057.37    | - | -          | -                | 168,057.37       |
| 交易性金融资产   | 55,306,149.60 | - | 668,000.00 | 1,243,417.330.61 | 1,299,391,480.21 |
| 买入返售金融资产  | -             | - | -          | -                | -                |
| 应收利息      | -             | - | -          | 1,017,570.23     | 1,017,570.23     |
| 应收股利      | -             | - | -          | -                | -                |
| 应收申购款     | -             | - | -          | 16,645,390.33    | 16,645,390.33    |
| 应收证券清算款   | -             | - | -          | -                | -                |
| 其他资产      | -             | - | -          | -                | -                |
| 资产总计      | 80,670,529.82 | - | 668,000.00 | 1,261,080,291.17 | 1,342,418,820.99 |
| 负债        |               |   |            |                  |                  |
| 应付赎回款     | -             | - | -          | 12,159,260.22    | 12,159,260.22    |
| 应付管理人报酬   | -             | - | -          | 50,225.81        | 50,225.81        |
| 应付托管费     | -             | - | -          | 10,045.17        | 10,045.17        |
| 应付证券清算款   | -             | - | -          | 12,404,696.31    | 12,404,696.31    |
| 卖出回购金融资产款 | 44,000,000.00 | - | -          | -                | 44,000,000.00    |
| 应付销售服务费   | -             | - | -          | 123,234.03       | 123,234.03       |
| 应付交易费用    | -             | - | -          | 10,821.26        | 10,821.26        |
| 应付利息      | -             | - | -          | 15,079.44        | 15,079.44        |
| 应付利润      | -             | - | -          | -                | -                |
| 应交税费      | -             | - | -          | 2.03             | 2.03             |
| 其他负债      | -             | - | -          | 181,605.19       | 181,605.19       |
| 负债总计      | 44,000,000.00 | - | -          | 24,954,969.46    | 68,954,969.46    |
| 利率敏感度缺口   | 36,670,529.82 | - | 668,000.00 | 1,236,125,321.71 | 1,273,463,851.53 |

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                    |                             |
|----|--------------------|-----------------------------|
| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |

|                   | 本期末（2021 年 12 月 31 日） | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
|-------------------|-----------------------|------------------------|
| 1.市场利率平行上升 25 个基点 | -75,989.42            | -33,464.42             |
| 2.市场利率平行下降 25 个基点 | 76,607.11             | 33,711.39              |

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

| 项目            | 本期末 2021 年 12 月 31 日 |               | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|----------------------|---------------|-----------------------|---------------|
|               | 公允价值                 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值                  | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 125,483,778.90       | 6.83          | 92,211,018.61         | 7.24          |
| 交易性金融资产-基金投资  | 1,661,268,177.18     | 90.44         | 1,151,206,312.00      | 90.40         |
| 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 | 1,786,751,956.08 | 97.27 | 1,243,417,330.61 | 97.64 |
|----|------------------|-------|------------------|-------|

注：交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标 ETF 份额。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----|--------------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动                      | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                                | 本期末（2021 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
|    | 1.组合自身基准上升 5%                  | 91,149,391.30               | 59,427,981.71          |
|    | 2.组合自身基准下降 5%                  | -91,149,391.30              | -59,427,981.71         |

#### 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) 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 2021 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 1,784,750,413.54 元，属于第二层次的余额为 71,625,502.61 元，属于第三层次的余额为 1,694,826.63 元（2020 年 12 月 31 日：第一层次 1,242,736,317.53 元，第二层次 56,655,162.68 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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具 1,694,826.63 元（2020 年 12 月 31 日：未持有公允价值归属于第三层次的金融工具）。其中，于本会计期间购买第三层次金融工具的金额为 1,449,259.66 元，计入损益的利得或损失金额为

245,566.97 元，均为 2021 年 12 月 31 日仍持有的资产计入未实现利得或损失的变动(公允价值变动损益)(2020 年度：无)。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次交易性金融资产均为股票投资，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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(2020 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。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，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

| 序号 | 项目      | 金额(元)            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|---------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资    | 125,483,778.90   | 6.55         |
|    | 其中：股票   | 125,483,778.90   | 6.55         |
| 2  | 基金投资    | 1,661,268,177.18 | 86.67        |
| 3  | 固定收益投资  | 71,318,786.70    | 3.72         |
|    | 其中：债券   | 71,318,786.70    | 3.72         |
|    | 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      | 50,970,964.98    | 2.66   |
| 8 | 其他资产              | 7,834,317.08     | 0.41   |
| 9 | 合计                | 1,916,876,024.84 | 100.00 |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 1,517,117.89   | 0.08         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -            |
| E  | 建筑业              | 4,713.80       | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 118,985.54     | 0.01         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | 4,608.00       | 0.00         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 299,275.42     | 0.02         |
| J  | 金融业              | 123,429,653.96 | 6.72         |
| 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       | 18,969.00      | 0.00         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 34,387.07      | 0.00         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 18,161.78      | 0.00         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 37,906.44      | 0.00         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 125,483,778.90 | 6.83         |

### 8.2.2 期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|-------|---------|--------------|
|----|------|------|-------|---------|--------------|

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 1  | 002142 | 宁波银行 | 877,681   | 33,597,628.68 | 1.83 |
| 2  | 000001 | 平安银行 | 1,706,200 | 28,118,176.00 | 1.53 |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 312,752   | 15,234,149.92 | 0.83 |
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 786,264   | 14,970,466.56 | 0.81 |
| 5  | 601398 | 工商银行 | 1,129,300 | 5,228,659.00  | 0.28 |
| 6  | 601328 | 交通银行 | 916,910   | 4,226,955.10  | 0.23 |
| 7  | 601288 | 农业银行 | 1,091,200 | 3,208,128.00  | 0.17 |
| 8  | 601988 | 中国银行 | 884,200   | 2,696,810.00  | 0.15 |
| 9  | 600000 | 浦发银行 | 309,794   | 2,642,542.82  | 0.14 |
| 10 | 600016 | 民生银行 | 566,580   | 2,209,662.00  | 0.12 |
| 11 | 601939 | 建设银行 | 323,504   | 1,895,733.44  | 0.10 |
| 12 | 601229 | 上海银行 | 139,300   | 993,209.00    | 0.05 |
| 13 | 600919 | 江苏银行 | 150,400   | 876,832.00    | 0.05 |
| 14 | 601169 | 北京银行 | 194,273   | 862,572.12    | 0.05 |
| 15 | 601009 | 南京银行 | 85,200    | 763,392.00    | 0.04 |
| 16 | 688032 | 禾迈股份 | 1,146     | 745,656.36    | 0.04 |
| 17 | 601658 | 邮储银行 | 136,300   | 695,130.00    | 0.04 |
| 18 | 601818 | 光大银行 | 206,800   | 686,576.00    | 0.04 |
| 19 | 600926 | 杭州银行 | 42,220    | 541,260.40    | 0.03 |
| 20 | 600015 | 华夏银行 | 82,486    | 461,921.60    | 0.03 |
| 21 | 601916 | 浙商银行 | 103,400   | 361,900.00    | 0.02 |
| 22 | 601838 | 成都银行 | 28,126    | 337,512.00    | 0.02 |
| 23 | 002966 | 苏州银行 | 47,100    | 318,867.00    | 0.02 |
| 24 | 688192 | 迪哲医药 | 8,926     | 308,482.56    | 0.02 |
| 25 | 601077 | 渝农商行 | 79,900    | 307,615.00    | 0.02 |
| 26 | 002958 | 青农商行 | 78,400    | 302,624.00    | 0.02 |
| 27 | 688262 | 国芯科技 | 7,129     | 299,275.42    | 0.02 |
| 28 | 601128 | 常熟银行 | 39,526    | 261,266.86    | 0.01 |
| 29 | 601997 | 贵阳银行 | 36,390    | 236,898.90    | 0.01 |
| 30 | 002807 | 江阴银行 | 60,660    | 233,541.00    | 0.01 |
| 31 | 002839 | 张家港行 | 36,000    | 207,360.00    | 0.01 |
| 32 | 601998 | 中信银行 | 37,600    | 173,712.00    | 0.01 |
| 33 | 002936 | 郑州银行 | 53,691    | 169,663.56    | 0.01 |
| 34 | 601577 | 长沙银行 | 14,100    | 110,121.00    | 0.01 |
| 35 | 002948 | 青岛银行 | 23,400    | 108,342.00    | 0.01 |
| 36 | 600908 | 无锡银行 | 18,800    | 106,596.00    | 0.01 |
| 37 | 301177 | 迪阿股份 | 740       | 85,899.20     | 0.00 |
| 38 | 600928 | 西安银行 | 18,800    | 80,840.00     | 0.00 |
| 39 | 601860 | 紫金银行 | 23,500    | 78,725.00     | 0.00 |
| 40 | 688799 | 华纳药厂 | 1,917     | 78,079.41     | 0.00 |

|    |        |       |        |           |      |
|----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 41 | 603323 | 苏农银行  | 14,100 | 68,667.00 | 0.00 |
| 42 | 301050 | 雷电微力  | 233    | 54,694.42 | 0.00 |
| 43 | 301035 | 润丰股份  | 644    | 36,244.32 | 0.00 |
| 44 | 601187 | 厦门银行  | 4,700  | 32,430.00 | 0.00 |
| 45 | 603230 | 内蒙新华  | 1,140  | 29,491.80 | 0.00 |
| 46 | 301127 | 天源环保  | 1,685  | 28,847.20 | 0.00 |
| 47 | 301039 | 中集车辆  | 2,064  | 25,820.64 | 0.00 |
| 48 | 301166 | 优 宁 维 | 253    | 23,908.50 | 0.00 |
| 49 | 301069 | 凯盛新材  | 539    | 23,829.19 | 0.00 |
| 50 | 300994 | 久祺股份  | 420    | 19,089.00 | 0.00 |
| 51 | 001296 | 长江材料  | 310    | 18,376.80 | 0.00 |
| 52 | 301060 | 兰卫医学  | 587    | 18,161.78 | 0.00 |
| 53 | 301168 | 通灵股份  | 329    | 17,150.77 | 0.00 |
| 54 | 301089 | 拓新药业  | 220    | 14,944.60 | 0.00 |
| 55 | 601963 | 重庆银行  | 1,600  | 14,240.00 | 0.00 |
| 56 | 301046 | 能辉科技  | 290    | 14,207.10 | 0.00 |
| 57 | 301020 | 密封科技  | 421    | 12,815.24 | 0.00 |
| 58 | 301138 | 华研精机  | 285    | 12,785.10 | 0.00 |
| 59 | 301026 | 浩通科技  | 203    | 12,734.19 | 0.00 |
| 60 | 301021 | 英诺激光  | 290    | 12,014.70 | 0.00 |
| 61 | 301028 | 东亚机械  | 733    | 9,895.50  | 0.00 |
| 62 | 301045 | 天禄科技  | 335    | 9,503.95  | 0.00 |
| 63 | 301078 | 孩 子 王 | 756    | 9,177.84  | 0.00 |
| 64 | 601665 | 齐鲁银行  | 1,600  | 8,928.00  | 0.00 |
| 65 | 301062 | 上海艾录  | 523    | 8,896.23  | 0.00 |
| 66 | 301193 | 家联科技  | 297    | 8,654.58  | 0.00 |
| 67 | 301025 | 读客文化  | 403    | 8,414.64  | 0.00 |
| 68 | 300814 | 中富电路  | 328    | 7,832.64  | 0.00 |
| 69 | 301030 | 仕净科技  | 242    | 7,627.84  | 0.00 |
| 70 | 301033 | 迈普医学  | 108    | 6,476.76  | 0.00 |
| 71 | 301032 | 新柴股份  | 513    | 6,417.63  | 0.00 |
| 72 | 301056 | 森赫股份  | 572    | 6,343.48  | 0.00 |
| 73 | 301041 | 金 百 泽 | 215    | 6,065.15  | 0.00 |
| 74 | 301072 | 中捷精工  | 181    | 6,047.21  | 0.00 |
| 75 | 301083 | 百胜智能  | 416    | 5,911.36  | 0.00 |
| 76 | 300854 | 中兰环保  | 203    | 5,539.87  | 0.00 |
| 77 | 301063 | 海锅股份  | 153    | 5,524.83  | 0.00 |
| 78 | 001234 | 泰 慕 士 | 333    | 5,504.49  | 0.00 |
| 79 | 301059 | 金 三 江 | 259    | 4,998.70  | 0.00 |
| 80 | 301027 | 华蓝集团  | 286    | 4,761.90  | 0.00 |
| 81 | 603176 | 汇通集团  | 1,924  | 4,713.80  | 0.00 |
| 82 | 301037 | 保 立 佳 | 193    | 4,682.18  | 0.00 |
| 83 | 301073 | 君亭酒店  | 144    | 4,608.00  | 0.00 |

|    |        |      |     |          |      |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 84 | 301053 | 远信工业 | 155 | 4,460.90 | 0.00 |
| 85 | 301057 | 汇隆新材 | 218 | 4,146.36 | 0.00 |
| 86 | 301079 | 邵阳液压 | 140 | 3,474.80 | 0.00 |
| 87 | 871245 | 威博液压 | 200 | 1,936.00 | 0.00 |

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

## 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  | 600036 | 招商银行 | 102,430,189.38 | 8.04           |
| 2  | 601166 | 兴业银行 | 91,190,302.72  | 7.16           |
| 3  | 601398 | 工商银行 | 47,007,674.57  | 3.69           |
| 4  | 000001 | 平安银行 | 42,621,535.04  | 3.35           |
| 5  | 002142 | 宁波银行 | 40,169,221.69  | 3.15           |
| 6  | 601328 | 交通银行 | 35,176,044.40  | 2.76           |
| 7  | 600000 | 浦发银行 | 31,043,235.07  | 2.44           |
| 8  | 600016 | 民生银行 | 25,062,235.59  | 1.97           |
| 9  | 601288 | 农业银行 | 24,687,514.01  | 1.94           |
| 10 | 600919 | 江苏银行 | 20,070,036.27  | 1.58           |
| 11 | 601229 | 上海银行 | 19,867,685.92  | 1.56           |
| 12 | 601988 | 中国银行 | 18,598,926.00  | 1.46           |
| 13 | 601169 | 北京银行 | 17,598,029.00  | 1.38           |
| 14 | 601818 | 光大银行 | 15,290,004.00  | 1.20           |
| 15 | 601009 | 南京银行 | 12,686,870.00  | 1.00           |
| 16 | 601939 | 建设银行 | 12,466,330.00  | 0.98           |
| 17 | 601658 | 邮储银行 | 12,433,891.83  | 0.98           |
| 18 | 600926 | 杭州银行 | 11,288,057.20  | 0.89           |
| 19 | 600015 | 华夏银行 | 9,404,199.31   | 0.74           |
| 20 | 601916 | 浙商银行 | 7,142,084.00   | 0.56           |

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  | 600036 | 招商银行 | 110,727,861.48 | 8.70           |
| 2  | 601166 | 兴业银行 | 87,672,110.51  | 6.88           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 3  | 601398 | 工商银行 | 49,032,605.19 | 3.85 |
| 4  | 601328 | 交通银行 | 35,937,549.00 | 2.82 |
| 5  | 600000 | 浦发银行 | 31,971,907.72 | 2.51 |
| 6  | 600016 | 民生银行 | 27,201,065.73 | 2.14 |
| 7  | 601288 | 农业银行 | 24,989,336.00 | 1.96 |
| 8  | 601229 | 上海银行 | 21,962,604.60 | 1.72 |
| 9  | 000001 | 平安银行 | 21,236,458.00 | 1.67 |
| 10 | 600919 | 江苏银行 | 20,730,797.70 | 1.63 |
| 11 | 601169 | 北京银行 | 19,260,175.00 | 1.51 |
| 12 | 601988 | 中国银行 | 18,353,318.00 | 1.44 |
| 13 | 002142 | 宁波银行 | 17,898,418.20 | 1.41 |
| 14 | 601818 | 光大银行 | 16,845,396.00 | 1.32 |
| 15 | 601009 | 南京银行 | 14,689,259.27 | 1.15 |
| 16 | 600926 | 杭州银行 | 12,744,165.03 | 1.00 |
| 17 | 601939 | 建设银行 | 12,516,508.89 | 0.98 |
| 18 | 600015 | 华夏银行 | 10,319,942.53 | 0.81 |
| 19 | 601658 | 邮储银行 | 7,881,261.00  | 0.62 |
| 20 | 601838 | 成都银行 | 7,440,454.10  | 0.58 |

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 | 653,287,410.88 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 648,047,833.11 |

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      | 60,017,500.00 | 3.27         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 9,409,286.70  | 0.51         |
|    | 其中：政策性金融债 | 9,409,286.70  | 0.51         |
| 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） | 1,892,000.00  | 0.10         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |

|    |    |               |      |
|----|----|---------------|------|
| 10 | 合计 | 71,318,786.70 | 3.88 |
|----|----|---------------|------|

## 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  | 019654 | 21 国债 06 | 550,000 | 55,016,500.00 | 3.00         |
| 2  | 018006 | 国开 1702  | 93,690  | 9,409,286.70  | 0.51         |
| 3  | 019649 | 21 国债 01 | 50,000  | 5,001,000.00  | 0.27         |
| 4  | 113052 | 兴业转债     | 18,920  | 1,892,000.00  | 0.10         |

## 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

无。

### 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，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票和目标 ETF 仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪对标的指数的目的。

## 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**

本基金本报告期末持有国债期货合约。

**8.12 本报告期投资基金情况****8.12.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称           | 基金类型 | 运作方式       | 管理人                  | 公允价值<br>(人民币<br>元)   | 占基金资<br>产净值比<br>例(%) |
|----|----------------|------|------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| 1  | 南方中证<br>银行 ETF | 股票型  | 交易型开<br>放式 | 南方基金<br>管理股份<br>有限公司 | 1,661,268,1<br>77.18 | 90.44                |

**8.13 投资组合报告附注****8.13.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明**

报告期内基金投资的前十名证券除工商银行（证券代码 601398）、交通银行（证券代码 601328）、宁波银行（证券代码 002142）、平安银行（证券代码 000001）、兴业银行（证券代码 601166）、招商银行（证券代码 600036）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 601398）**

工商银行 2021 年 1 月 8 日公告称，因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、关键岗位未进行实质性轮岗、法人账户日间透支业务存在资金用途管理的风险漏洞等原因，中国银行保险监督管理委员会对公司处以罚款 5470 万元的处分。

**2、交通银行（证券代码 601328）**

交通银行 2021 年 6 月 18 日公告称，因未按监管要求监测贷款资金用途，贷款资金回流部分转作银行承兑汇票保证金，中国银行保险监督管理委员会临沂监管分局对公司处以罚款 20 万元的处分。交通银行 2021 年 7 月 16 日公告称，因理财业务和同业业务制度不健全、理财业务数据与事实不符等原因，中国银行保险监督管理委员会对公司处以罚款 4100 万元。

交通银行 2021 年 8 月 20 日公告称，因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，中国人民银行对公司处以罚款 62 万元的处分。

### 3、宁波银行（证券代码 002142）

宁波银行 2021 年 6 月 11 日公告称，因代理销售保险不规范，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对公司罚款人民币 25 万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

宁波银行 2021 年 7 月 21 日公告称，因违规为存款人多头开立银行结算账户等原因，中国人民银行宁波市中心支行对公司给予警告，并处罚款 286.2 万元。

宁波银行 2021 年 8 月 6 日公告称，因贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储等原因，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对公司罚款人民币 275 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。

宁波银行 2021 年 12 月 31 日公告称，因信用卡业务管理不到位，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对公司罚款人民币 30 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。

### 4、平安银行（证券代码 000001）

平安银行 2021 年 6 月 8 日公告称，因利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险；固定资产授信严重不审慎，贷款用途审查监控不到位等原因，中国银行保险监督管理委员会云南监管局对公司罚款人民币 210 万元。

### 5、兴业银行（证券代码 601166）

兴业银行 2021 年 8 月 20 日公告称，因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，中国人民银行对公司罚款 5 万元。

### 6、招商银行（证券代码 600036）

招商银行 2021 年 5 月 21 日公告称，因向同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等原因，中国银行保险监督管理委员会对公司罚款 7170 万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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

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

## 8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 118,049.10   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 1,294,366.14 |
| 5  | 应收申购款   | 6,216,155.84 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | 205,746.00   |
| 9  | 合计      | 7,834,317.08 |

#### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别     | 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构          |        |                |        |
|----------|----------|-----------|----------------|--------|----------------|--------|
|          |          |           | 机构投资者          |        | 个人投资者          |        |
|          |          |           | 持有份额           | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例 |
| 南方银行联接 A | 45,285   | 12,535.08 | 271,207,315.40 | 47.78% | 296,443,622.22 | 52.22% |
| 南方银行联接 C | 167,815  | 4,920.21  | 205,625,134.34 | 24.90% | 620,059,910.69 | 75.10% |
| 南方银行联接 E | 2,733    | 20,979.03 | 37,868,414.96  | 66.05% | 19,467,273.36  | 33.95% |
| 合计       | 215,833  | 6,721.27  | 514,700,864.70 | 35.48% | 935,970,806.27 | 64.52% |

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

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别     | 持有份额总数（份）  | 占基金总份额比例 |
|------------------|----------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 南方银行联接 A | 541,572.03 | 0.0954%  |
|                  | 南方银行联接 C | 95,278.89  | 0.0115%  |
|                  | 南方银行联接 E | 7.50       | 0.0000%  |
|                  | 合计       | 636,858.42 | 0.0439%  |

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

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例（%） | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例（%） | 发起份额承诺持有期限      |
|-------------|--------|-----------------|---------------|-----------------|-----------------|
| 基金管理人固有资金   | -      | -               | 10,000,000.00 | 0.69            | 自合同生效之日起不少于 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | -      | -               | -             | -               | -               |
| 基金经理等人员     | 27.20  | 0.00            | -             | -               | -               |
| 基金管理人股东     | -      | -               | -             | -               | -               |
| 其他          | -      | -               | -             | -               | -               |
| 合计          | 27.20  | 0.00            | 10,000,000.00 | 0.69            | -               |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                 | 南方银行联接 A       | 南方银行联接 C         | 南方银行联接 E       |
|------------------------------------|----------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日<br>(2017 年 6 月 29 日)       | 10,352,725.39  | 5,516,339.11     | -              |
| 基金份额总额                             |                |                  |                |
| 本报告期期初基金份<br>额总额                   | 614,441,313.23 | 398,672,016.50   | -              |
| 本报告期基金总申购<br>份额                    | 637,293,786.78 | 1,724,375,327.76 | 133,334,081.07 |
| 减：报告期基金总赎<br>回份额                   | 684,084,162.39 | 1,297,362,299.23 | 75,998,392.75  |
| 本报告期期间基金拆<br>分变动份额（份额减<br>少以“-”填列） | -              | -                | -              |
| 本报告期期末基金份<br>额总额                   | 567,650,937.62 | 825,685,045.03   | 57,335,688.32  |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长张海波先生病逝缺位，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先生兼任首席信息官。

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。

### 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 5 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 90,000.00 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 |    |
| 兴业证券 | 1      | 1,144,533,621.93 | 89.48%       | 114,453.67 | 89.48%     | -  |
| 华泰证券 | 3      | 134,625,245.72   | 10.52%       | 13,462.21  | 10.52%     | -  |

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

#### A：选择标准

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

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

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；

3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

华泰证券

退租交易单元：

无

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |              | 债券回购交易           |                | 权证交易 |              | 基金交易             |              |
|------|----------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|------------------|--------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期基金成交总额的比例 |
| 兴业证券 | 205,041,154.20 | 93.48%       | 2,762,600,000.00 | 100.00%        | -    | -            | 2,210,379,533.83 | 100.00%      |
| 华泰证券 | 14,292,614.27  | 6.52%        | -                | -              | -    | -            | -                | -            |

### 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  | 南方基金关于旗下部分基金增加招商银行招赢通为销售机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-15 |
| 2  | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告       | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-25 |
| 3  | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告       | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-02-23 |
| 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       | 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 | 2021-03-02 |
| 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       | 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 | 2021-03-08 |
| 6  | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告       | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-16 |

|    |                                          |                             |            |
|----|------------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 7  | 南方基金关于旗下部分基金增加汇成基金为销售机构及开通相关业务的公告        | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-17 |
| 8  | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告           | 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 | 2021-03-19 |
| 9  | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告           | 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 | 2021-03-22 |
| 10 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告           | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-29 |
| 11 | 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 |
| 12 | 南方基金关于旗下部分基金增加坤元基金为销售机构及开通相关业务的公告        | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-01 |
| 13 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告       | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-13 |
| 14 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方华泰联合证券承销证券的关联交易公告 | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-16 |
| 15 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方兴业证券承销证券的关联交易公告   | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-16 |
| 16 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告       | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-19 |
| 17 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告       | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-05-01 |
| 18 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告       | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-05-13 |
| 19 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告       | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-05-15 |
| 20 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告       | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-05-21 |
| 21 | 南方基金关于旗下部分基金增加平安银行为销售机构及开通相关业务的公告        | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会         | 2021-05-31 |

|    |                                                       |                             |            |
|----|-------------------------------------------------------|-----------------------------|------------|
|    |                                                       | 会基金电子披露网站                   |            |
| 22 | 南方基金关于旗下部分基金增加创金启富为销售机构及开通相关业务的公告                     | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-06-07 |
| 23 | 关于南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金增加 E 类份额并修改基金合同的公告       | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-06-08 |
| 24 | 南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 E 类份额开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告 | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-06-08 |
| 25 | 南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金恢复大额申购、定投和转换转入业务的公告        | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-06-09 |
| 26 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告                    | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-06-11 |
| 27 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的公告                   | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-06-18 |
| 28 | 南方基金关于旗下部分基金增加华泰证券为销售机构及开通相关业务的公告                     | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-06-24 |
| 29 | 南方基金关于旗下部分基金增加交通银行作为销售机构及开通相关业务的公告                    | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-06-24 |
| 30 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告                    | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-06-25 |
| 31 | 南方基金关于旗下部分基金增加万得基金为销售机构及开通相关业务的公告                     | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-06-30 |
| 32 | 南方基金关于旗下部分基金参加交通银行 2021 年下半年基金申购及定投手续费率优惠活动的公告        | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-07-01 |
| 33 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告                    | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-07-17 |
| 34 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告                    | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-07-31 |
| 35 | 南方基金关于旗下部分基金增加普益基金为销售机构及开通相关业务的公告                     | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-08-04 |
| 36 | 南方基金关于旗下部分基金增加腾安基金为销                                  | 中国证券报、基金管                   | 2021-08-17 |

|    |                                          |                             |            |
|----|------------------------------------------|-----------------------------|------------|
|    | 售机构及开通相关业务的公告                            | 理人网站、中国证监会基金电子披露网站          |            |
| 37 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告       | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-10-01 |
| 38 | 南方基金关于旗下部分基金增加中信证券华南、中信期货为销售机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-10-13 |
| 39 | 南方基金关于旗下部分基金增加陆基金为销售机构及开通相关业务的公告         | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-11-03 |
| 40 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金参与宁波银行股份有限公司配股的关联交易公告  | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-12-04 |
| 41 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告       | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-12-04 |
| 42 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告       | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-12-09 |
| 43 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的公告      | 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 | 2021-12-29 |
| 44 | 南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行基金费率优惠活动的公告          | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-12-30 |

## § 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  |
| 机构                                                                                | 1              | 20210101-20210218       | 264,627,397.85 | -    | 180,379,887.56 | 84,247,510.29 | 5.81% |
| 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南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的文件；

2、《南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》；

3、《南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；

6、《南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 2021 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>