南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....1
1.1 重要提示.....1
1.2 目录.....2
§2 基金简介.....4
2.1 基金基本情况.....4
2.2 基金产品说明.....4
2.3 基金管理人和基金托管人.....5
2.4 信息披露方式.....5
2.5 其他相关资料.....5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....6
3.1 主要会计数据和财务指标.....6
3.2 基金净值表现.....7
§4 管理人报告.....10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....11
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.....12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....13
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....14
§5 托管人报告.....14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....14
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....14
6.1 资产负债表.....14
6.2 利润表.....16
6.3 净资产（基金净值）变动表.....17
6.4 报表附注.....19
§7 投资组合报告.....47
7.1 期末基金资产组合情况.....47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....53
7.10 本报告期投资基金情况.....53
7.11 本基金投资股指期货的投资政策.....54

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....54
7.13 投资组合报告附注.....54
§8 基金份额持有人信息.....55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....56
§9 开放式基金份额变动.....56
§10 重大事件揭示.....57
10.1 基金份额持有人大会决议.....57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....57
10.4 基金投资策略的改变.....57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....57
10.8 其他重大事件.....59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....60
§12 备查文件目录.....60
12.1 备查文件目录.....60
12.2 存放地点.....61
12.3 查阅方式.....61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金		
基金简称	南方创业板 ETF 联接		
基金主代码	002656		
交易代码	002656		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016 年 5 月 20 日		
基金管理人	南方基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,692,747,169.57 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	南方创业板 ETF 联接 A	南方创业板 ETF 联接 C	南方创业板 ETF 联接 E
下属分级基金的交易代码	002656	004343	010183
报告期末下属分级基金的份额总额	1,076,712,138.42 份	604,032,379.31 份	12,002,651.84 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	南方创业板交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159948
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2016 年 5 月 13 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2016 年 5 月 31 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	中国银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，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	创业板指数收益率×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	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为创业板指数。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其长期平均风险与预期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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川	许俊
	联系电话	0755-82763888	010-66596688
	电子邮箱	manager@southernfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95566
传真		0755-82763889	010-66594942
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	北京西城区复兴门内大街 1 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	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518017	100818
法定代表人		周易	刘连舸

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、南方创业板 ETF 联接 A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-17,312,560.79
本期利润	-255,725,355.95
加权平均基金份额本期利润	-0.2332
本期加权平均净值利润率	-17.74%
本期基金份额净值增长率	-14.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	417,588,574.57
期末可供分配基金份额利润	0.3878
期末基金资产净值	1,494,300,712.99
期末基金份额净值	1.3878
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	38.78%

2、南方创业板 ETF 联接 C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-8,264,167.17
本期利润	-38,150,374.94
加权平均基金份额本期利润	-0.0671
本期加权平均净值利润率	-5.22%
本期基金份额净值增长率	-14.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	233,615,682.40
期末可供分配基金份额利润	0.3867
期末基金资产净值	837,648,061.71
期末基金份额净值	1.3868
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	52.16%

3、南方创业板 ETF 联接 E

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-289,938.90
本期利润	-2,954,499.78

加权平均基金份额本期利润	-0.2128
本期加权平均净值利润率	-16.48%
本期基金份额净值增长率	-14.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	4,539,862.13
期末可供分配基金份额利润	0.3782
期末基金资产净值	16,542,513.97
期末基金份额净值	1.3782
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	10.75%

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

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

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

4、本基金从 2017 年 2 月 23 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2017 年 2 月 27 日起存续；

5、本基金从 2020 年 9 月 16 日起新增 E 类份额，E 类份额自 2020 年 9 月 17 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

南方创业板 ETF 联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	16.13%	1.61%	15.97%	1.62%	0.16%	-0.01%
过去三个月	5.59%	1.99%	5.46%	2.00%	0.13%	-0.01%
过去六个月	-14.47%	1.94%	-14.59%	1.95%	0.12%	-0.01%
过去一年	-17.95%	1.71%	-18.14%	1.71%	0.19%	0.00%
过去三年	86.11%	1.70%	81.38%	1.71%	4.73%	-0.01%
自基金合同生效起至今	38.78%	1.57%	37.24%	1.58%	1.54%	-0.01%

南方创业板 ETF 联接 C

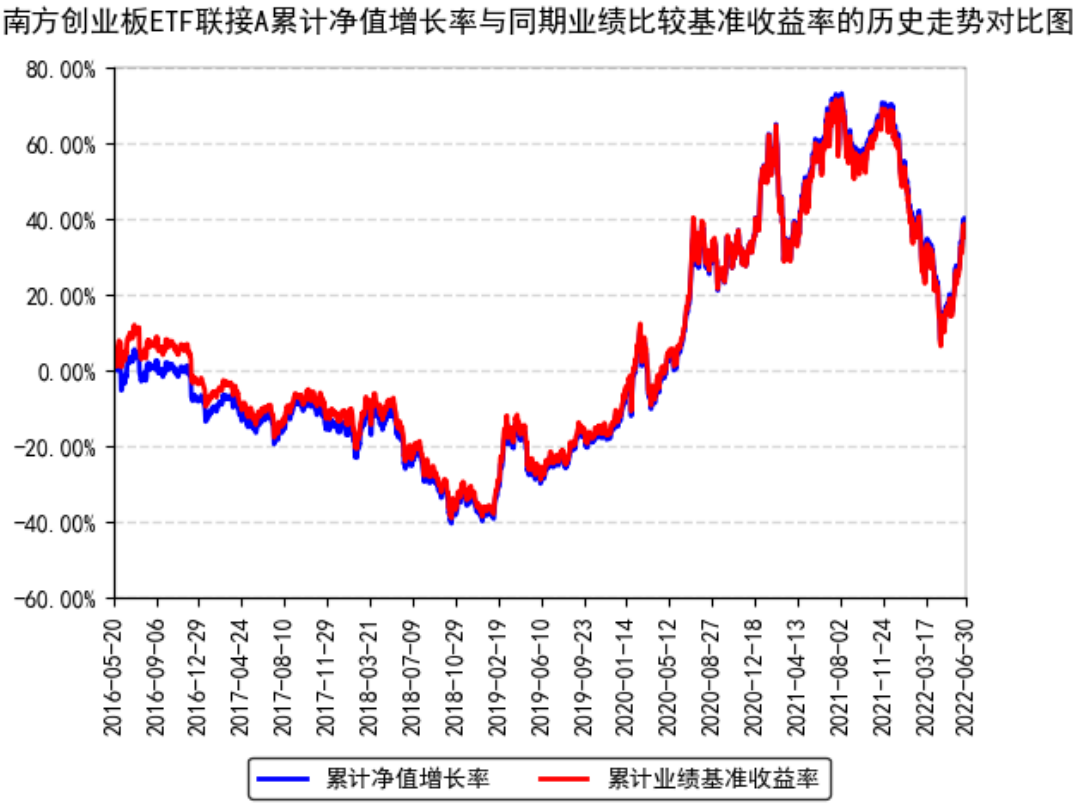
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

过去一个月	16.10%	1.61%	15.97%	1.62%	0.13%	-0.01%
过去三个月	5.49%	1.99%	5.46%	2.00%	0.03%	-0.01%
过去六个月	-14.64%	1.94%	-14.59%	1.95%	-0.05%	-0.01%
过去一年	-18.28%	1.71%	-18.14%	1.71%	-0.14%	0.00%
过去三年	83.90%	1.70%	81.38%	1.71%	2.52%	-0.01%
自基金合同生效起至今	52.16%	1.62%	44.59%	1.62%	7.57%	0.00%

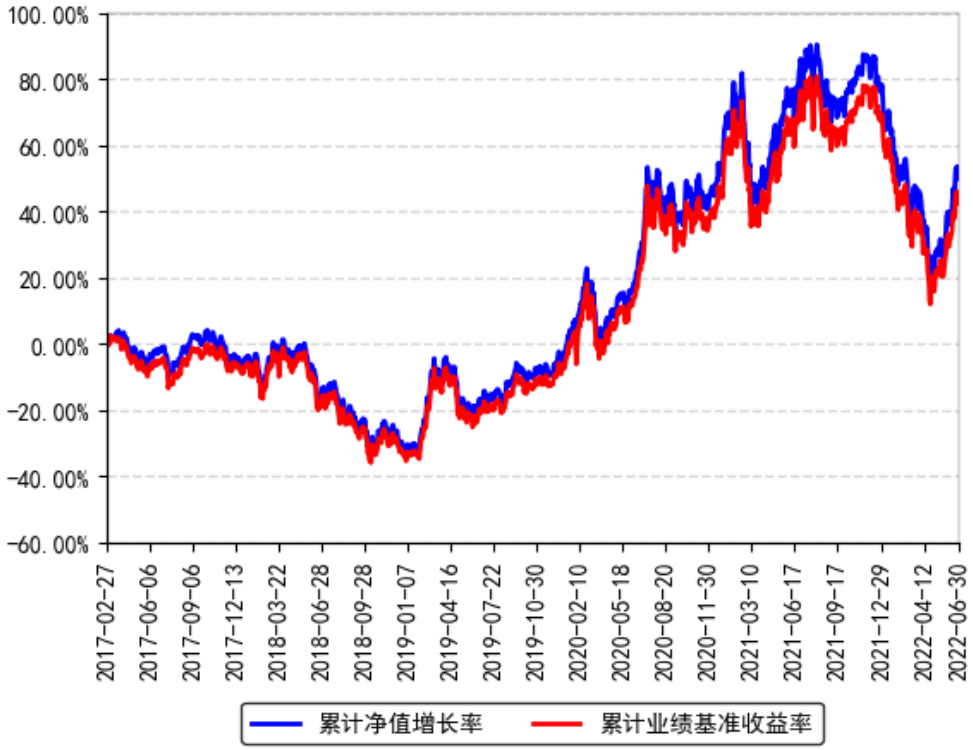
南方创业板 ETF 联接 E

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	16.10%	1.61%	15.97%	1.62%	0.13%	-0.01%
过去三个月	5.49%	1.99%	5.46%	2.00%	0.03%	-0.01%
过去六个月	-14.64%	1.94%	-14.59%	1.95%	-0.05%	-0.01%
过去一年	-18.28%	1.71%	-18.14%	1.71%	-0.14%	0.00%
自基金合同生效起至今	10.75%	1.71%	9.89%	1.72%	0.86%	-0.01%

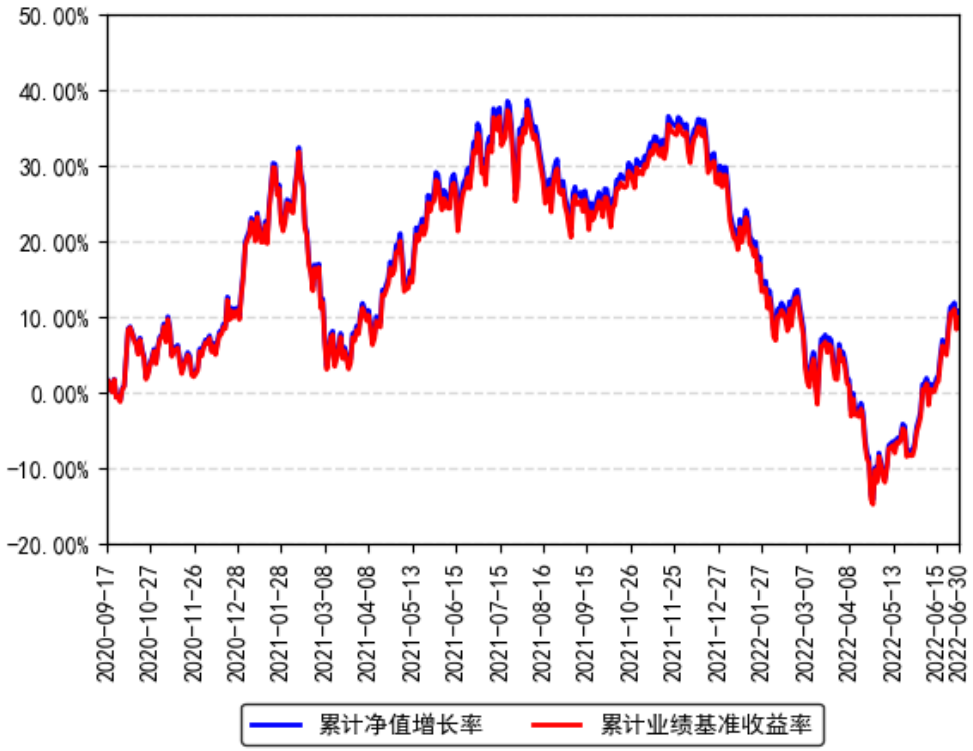
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



南方创业板ETF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



南方创业板ETF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 2017 年 2 月 23 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2017 年 2 月 27 日起存续；

2、本基金从 2020 年 9 月 16 日起新增 E 类份额，E 类份额自 2020 年 9 月 17 日起存续。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019 年 7 月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司13.72%、兴业证券股份有限公司9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)1.72%、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）2.24%、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）2.25%、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）2.32%。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至本报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 1.69 万亿元，旗下管理 296 只公募基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙伟	本基金基金经理	2016 年 5 月 20 日	-	12 年	北京大学工商管理硕士，特许金融分析师（CFA）、注册会计师（CPA），具有基金从业资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010 年 2 月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员、基金经理助理；2015 年 5 月 22 日至 2016 年 7 月 29 日，任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 7 月 2 日至 2020 年 12 月 1 日，任改革基金、高铁基金基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 7 日，任南方中证 500 工业

					ETF 基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 14 日，任南方中证 500 原材料 ETF 基金经理；2020 年 12 月 1 日至 2021 年 4 月 19 日，任改革基金基金经理；2015 年 7 月 10 日至今，任 500 信息基金经理；2016 年 5 月 13 日至今，任南方创业板 ETF 基金经理；2016 年 5 月 20 日至今，任南方创业板 ETF 联接基金经理；2016 年 8 月 17 日至今，任 500 信息联接基金经理；2016 年 8 月 19 日至今，任深成 ETF、南方深成基金经理；2017 年 3 月 8 日至今，任南方全指证券 ETF 联接基金经理；2017 年 3 月 10 日至今，任南方中证全指证券 ETF 基金经理；2017 年 6 月 28 日至今，任南方中证银行 ETF 基金经理；2017 年 6 月 29 日至今，任南方银行联接基金经理；2018 年 2 月 8 日至今，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至今，任南方 H 股联接基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任南方上证 380ETF、南方上证 380ETF 联接基金经理；2020 年 12 月 1 日至今，任高铁基金基金经理；2022 年 3 月 3 日至今，任南方上海金 ETF 基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易次数为2次，是由于投资组合的投资策略需要以及接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

创业板指报告期内下跌 15.41%。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

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

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

（3）报告期内指数成份股（包括调出指数成分股）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 1.3878 元，报告期内，份额净值增长率为-14.47%，同期业绩基准增长率为-14.59%；本基金 C 份额净值为 1.3868 元，报告期内，份额净值增长率为-14.64%，同期业绩基准增长率为-14.59%；本基金 E 份额净值为 1.3782 元，报告期内，份额净值增长率为-14.64%，同期业绩基准增长率为-14.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年疫情反复导致企业经营状况恶化，市场大跌。当前 A 股估值处于合理区间，产业政策、防疫政策和货币政策的转向预期推动股市触底反弹。展望下半年，经济增长恢复，流动性和信用回升，上市公司盈利改善，市场有望走强。风格方面，稳增长效果渐进性落地，利率上行空间有限，在反弹行情中，小盘和成长相对占优，但随着成长反弹进入后周期，预计成长和价值风格将更加趋于平衡。放眼未来，经济结构转型大趋势明确背景下，科技产业景气向上，资本市场创新活跃，创业板指重点行业仍具有中长期投资价值。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“ 关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.4.1	66,069,606.70	109,857,475.08
结算备付金		414,267.62	29,491.65
存出保证金		640,767.85	250,059.20
交易性金融资产	6.4.4.2	2,295,370,745.47	2,233,969,291.17
其中：股票投资		63,859,597.33	105,614,419.46

基金投资		2,171,031,572.82	2,114,852,171.71
债券投资		60,479,575.32	13,502,700.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,343,043.50	3,691,949.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.5	-	320,813.38
资产总计		2,367,838,431.14	2,348,119,079.88
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,700,713.08	3,000,000.00
应付清算款		-	-
应付赎回款		16,106,390.63	4,956,382.64
应付管理人报酬		23,698.77	29,026.99
应付托管费		7,899.58	9,675.65
应付销售服务费		268,796.51	228,262.59
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.6	239,643.90	235,783.76
负债合计		19,347,142.47	8,459,131.63
净资产：			
实收基金	6.4.4.7	1,692,747,169.57	1,441,470,111.44
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.4.8	655,744,119.10	898,189,836.81
净资产合计		2,348,491,288.67	2,339,659,948.25
负债和净资产总计		2,367,838,431.14	2,348,119,079.88

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，南方创业板 ETF 联接 A 份额净值 1.3878 元，基金份额总额 1,076,712,138.42 份；南方创业板 ETF 联接 C 份额净值 1.3868 元，基金份额总额 604,032,379.31 份；南方创业板 ETF 联接 E 份额净值 1.3782 元，基金份额总额 12,002,651.84 份；总份额合计 1,692,747,169.57 份。

6.2 利润表

会计主体：南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-294,988,432.42	406,874,910.48
1.利息收入		194,788.17	306,847.72
其中：存款利息收入	6.4.4.9	194,788.17	238,565.24
债券利息收入		-	68,282.48
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-27,348,493.28	282,106,445.17
其中：股票投资收益	6.4.4.10	-16,756,794.81	21,703,085.13
基金投资收益	6.4.4.11	-11,145,330.35	259,797,152.40
债券投资收益	6.4.4.12	252,515.60	336,933.47
资产支持证券投资收益	6.4.4.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.4.14	-	-
衍生工具收益	6.4.4.15	-	-
股利收益	6.4.4.16	301,116.28	269,274.17
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.17	-270,963,563.81	121,551,202.51
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”	6.4.4.18	3,128,836.50	2,910,415.08

号填列）			
减：二、营业总支出		1,841,798.25	2,856,056.50
1.管理人报酬	6.4.7.2.1	153,578.65	164,555.34
2.托管费	6.4.7.2.2	51,192.86	54,851.88
3.销售服务费	6.4.7.2.3	1,496,930.99	1,334,331.11
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		23,331.32	6,194.97
其中：卖出回购金融资产支出		23,331.32	6,194.97
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		0.03	0.76
8.其他费用	6.4.4.20	116,764.40	1,296,122.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-296,830,230.67	404,018,853.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-296,830,230.67	404,018,853.98
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-296,830,230.67	404,018,853.98

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,441,470,111.44	-	898,189,836.81	2,339,659,948.25
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,441,470,111.44	-	898,189,836.81	2,339,659,948.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	251,277,058.13	-	-242,445,717.71	8,831,340.42
（一）、综合收益总额	-	-	-296,830,230.67	-296,830,230.67
（二）、本期基金	251,277,058.13	-	54,384,512.96	305,661,571.09

份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	1,243,085,527.36	-	293,394,321.59	1,536,479,848.95
2.基金赎回款	-991,808,469.23	-	-239,009,808.63	-1,230,818,277.86
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,692,747,169.57	-	655,744,119.10	2,348,491,288.67
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,663,857,100.21	-	739,381,283.10	2,403,238,383.31
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,663,857,100.21	-	739,381,283.10	2,403,238,383.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-279,258,246.65	-	220,075,632.05	-59,182,614.60
（一）、综合收益总额	-	-	404,018,853.98	404,018,853.98
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-279,258,246.65	-	-183,943,221.93	-463,201,468.58
其中：1.基金申购款	1,193,240,453.21	-	574,185,761.04	1,767,426,214.25
2.基金赎回款	-1,472,498,699.86	-	-758,128,982.97	-2,230,627,682.83

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,384,598,853.56	-	959,456,915.15	2,344,055,768.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____杨小松___ ____徐超_____ ____徐超____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。除下述会计政策外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2.1 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.2.2 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1)金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资

产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2)金融负债

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

(3)衍生金融工具

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

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

6.4.2.3 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性

金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移

给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.2.4 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

6.4.3 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.3.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号－套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

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

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

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为 109,857,475.08 元、29,491.65 元、250,059.20 元、320,813.38 元和 3,691,949.40 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 109,868,088.10 元、29,504.85 元、250,171.70 元、0.00 元和 3,691,949.40 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 2,233,969,291.17 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 2,234,279,365.83 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 3,000,000.00 元、4,956,382.64 元、29,026.99 元、9,675.65 元、228,262.59 元、17,554.74 元、858.22 元和 7,370.80 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销

售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 3,000,858.22 元、4,956,382.64 元、29,026.99 元、9,675.65 元、228,262.59 元、17,554.74 元、0.00 元和 7,370.80 元。

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

(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.3.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.3.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.4 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	66,069,606.70
等于：本金	66,063,747.47
加：应计利息	5,859.23
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-

其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	66,069,606.70

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		56,712,419.52	-	63,859,597.33	7,147,177.81
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	59,872,925.80	578,061.82	60,479,575.32	28,587.70
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	59,872,925.80	578,061.82	60,479,575.32	28,587.70
资产支持证券		-	-	-	-
基金		1,866,066,495.47	-	2,171,031,572.82	304,965,077.35
其他		-	-	-	-
合计		1,982,651,840.79	578,061.82	2,295,370,745.47	312,140,842.86

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

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

6.4.4.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.4.4 买入返售金融资产

6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.4.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.4.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	23,857.69
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	111,647.86
其中：交易所市场	111,647.86
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	-
预提费用	104,138.35
应付指数使用费	-
可退替代款	-
其他	-
合计	239,643.90

6.4.4.7 实收基金

金额单位：人民币元

南方创业板 ETF 联接 A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,037,445,045.03	1,037,445,045.03
本期申购	420,660,847.58	420,660,847.58
本期赎回（以“-”号填列）	-381,393,754.19	-381,393,754.19
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	1,076,712,138.42	1,076,712,138.42

南方创业板 ETF 联接 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	395,504,961.96	395,504,961.96
本期申购	790,468,168.42	790,468,168.42
本期赎回（以“-”号填列）	-581,940,751.07	-581,940,751.07
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	604,032,379.31	604,032,379.31

南方创业板 ETF 联接 E		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,520,104.45	8,520,104.45
本期申购	31,956,511.36	31,956,511.36
本期赎回（以“-”号填列）	-28,473,963.97	-28,473,963.97
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	12,002,651.84	12,002,651.84

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.4.8 未分配利润

单位：人民币元

南方创业板 ETF 联接 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	499,891,349.74	146,035,897.56	645,927,247.30
本期利润	-17,312,560.79	-238,412,795.16	-255,725,355.95
本期基金份额交易产生的变动数	19,841,011.42	7,545,671.80	27,386,683.22
其中：基金申购款	199,184,972.34	-65,348,606.06	133,836,366.28
基金赎回款	-179,343,960.92	72,894,277.86	-106,449,683.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	502,419,800.37	-84,831,225.80	417,588,574.57

南方创业板 ETF 联接 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	191,236,966.21	55,789,541.88	247,026,508.09
本期利润	-8,264,167.17	-29,886,207.77	-38,150,374.94
本期基金份额交易产生的变动数	98,306,420.86	-73,566,871.61	24,739,549.25
其中：基金申购款	367,323,747.79	-217,774,970.13	149,548,777.66
基金赎回款	-269,017,326.93	144,208,098.52	-124,809,228.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	281,279,219.90	-47,663,537.50	233,615,682.40

南方创业板 ETF 联接 E			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	4,035,043.34	1,201,038.08	5,236,081.42
本期利润	-289,938.90	-2,664,560.88	-2,954,499.78

本期基金份额交易产生的变动数	1,726,722.60	531,557.89	2,258,280.49
其中：基金申购款	14,845,020.77	-4,835,843.12	10,009,177.65
基金赎回款	-13,118,298.17	5,367,401.01	-7,750,897.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,471,827.04	-931,964.91	4,539,862.13

6.4.4.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	180,552.40
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	11,805.16
其他	2,430.61
合计	194,788.17

6.4.4.10 股票投资收益

6.4.4.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-15,346,182.23
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-1,410,612.58
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-16,756,794.81

6.4.4.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	706,677,794.83
减：卖出股票成本总额	721,070,865.90
减：交易费用	953,111.16
买卖股票差价收入	-15,346,182.23

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.4.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

6.4.4.10.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

申购基金份额总额	490,036,400.00
减：现金支付申购款总额	3,437,156.38
减：申购股票成本总额	488,009,856.20
减：交易费用	-
申购差价收入	-1,410,612.58

6.4.4.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

6.4.4.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	524,126,569.99
减：卖出/赎回基金成本总额	535,249,835.02
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	22,065.32
基金投资收益	-11,145,330.35

6.4.4.12 债券投资收益

6.4.4.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	240,366.78
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	12,148.82
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	252,515.60

6.4.4.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	13,879,418.65
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	13,539,150.00
减：应计利息总额	328,057.59
减：交易费用	62.24
买卖债券差价收入	12,148.82

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.4.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.4.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.4.13 资产支持证券投资收益

6.4.4.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.4.14 贵金属投资收益

6.4.4.14.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.4.14.2 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.4.15 衍生工具收益

6.4.4.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.4.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.4.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	301,116.28
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	301,116.28

6.4.4.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-270,963,563.81
——股票投资	10,224,157.38
——债券投资	24,337.70
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-281,212,058.89
——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	-270,963,563.81

6.4.4.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,941,403.94
基金转换费收入	187,432.56
合计	3,128,836.50

注：

1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

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，其中不低于转出基金的赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

6.4.4.19 交易费用

本基金本报告期内无交易费用。

6.4.4.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	12,626.05
合计	116,764.40

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 或有事项

无。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.6 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司("南方基金")	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	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
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
南方创业板交易型开放式指数证券投资基金("目标ETF")	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	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	5,092.00	0.00%	-	-

6.4.7.1.2 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.7.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.7.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	2.42	0.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	-	-	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	153,578.65	164,555.34
其中：支付销售机构的客户维护费	559,104.52	532,068.89

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。

于 2020 年 4 月 27 日前，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%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。

根据《关于调整南方创业板交易型开放式指数证券投资基金及联接基金相关基金费率并修订基金合同及托管协议的公告》，自 2020 年 4 月 27 日起，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 0.15%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) × 0.15% / 当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	51,192.86	54,851.88

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。

于 2020 年 4 月 27 日前，支付基金托管人中国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%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。

根据《关于调整南方创业板交易型开放式指数证券投资基金及联接基金相关基金费率并修订基金合同及托管协议的公告》，自 2020 年 4 月 27 日起，支付基金托管人中国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 0.05%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) × 0.05% / 当年天数。

6.4.7.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	南方创业板 ETF 联接 A	南方创业板 ETF 联接 C	南方创业板 ETF 联接 E	合计
华泰证券	-	10,161.58	-	10,161.58
南方基金	-	56,932.35	9,104.79	66,037.14
中国银行	-	417,377.65	-	417,377.65
合计	-	484,471.58	9,104.79	493,576.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	南方创业板 ETF 联接 A	南方创业板 ETF 联接 C	南方创业板 ETF 联接 E	合计
华泰证券	-	10,878.54	-	10,878.54
南方基金	-	188,497.09	2,329.80	190,826.89
中国银行	-	365,305.32	-	365,305.32
合计	-	564,680.95	2,329.80	567,010.75

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额和 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/E 类基金份额的基金资产净值 X 0.40%/ 当年天数。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.7.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.7.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.7.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.7.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	66,069,606.70	180,552.40	136,148,294.94	226,510.21

注：本基金由基金托管人中国银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.7.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	301207	华兰疫苗	网下申购	5,687	323,476.56
华泰联合	123145	药石转债	配债	294	29,400.00

上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	300975	商络电子	网下申购	4,917	26,945.16
兴业证券	300979	华利集团	网下申购	9,246	307,152.12
兴业证券	300941	创识科技	网下申购	3,989	85,005.59

6.4.7.8 其他关联交易事项的说明

6.4.7.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2022 年 06 月 30 日，本基金持有基金管理人南方基金所管理的公开募集证券投资基金，成本总额为人民币 1,866,066,495.47 元，估值总额为人民币 2,171,031,572.82 元，占本基金基金资产净值的比例为 92.44%（于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有基金管理人南方基金所管理的公开募集证券投资基金，成本总额为人民币 1,528,675,035.47 元，估值总额为人民币 2,114,852,171.71 元，占本基金基金资产净值的比例为 90.39%）。

6.4.8 利润分配情况

6.4.8.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.9 期末（2022 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股锁定期	34.81	16.14	1,225	42,642.25	19,771.50	-
301109	军信股份	2022 年 6 月 17 日	1-6 个月（含）	锁定期转增	-	16.14	613	-	9,893.82	-
301150	中一科技	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定期	163.56	82.76	269	43,997.64	22,262.44	-
301150	中一科技	2022 年 6 月 10 日	1-6 个月（含）	锁定期转增	-	82.76	135	-	11,172.60	-
301158	德石股份	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股锁定期	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301181	标榜股份	2022 年 2 月 11 日	6 个月	新股锁定期	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定期	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新股锁定期	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-

301217	铜冠铜箔	2022 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定期	17.27	14.83	4,284	73,984.68	63,531.72	-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定期	173.98	87.82	321	55,847.58	28,190.22	-
301219	腾远钴业	2022 年 5 月 24 日	1-6 个月（含）	锁定期转增	-	87.82	257	-	22,569.74	-
301248	杰创智能	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定期	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
6.4.9.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113060	浙 22 转债	2022 年 6 月 17 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	10	1,000.07	1,000.07	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,700,713.08 元，截至 2022 年 7 月 1 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.9.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金紧密跟踪标的指数，具有和标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资

的金融工具主要包括基金投资和股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”的风险收益目标。

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

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

6.4.10.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2021 年 12 月 31 日：无)。

6.4.10.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金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 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 2,700,713.08 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。

6.4.10.3.1 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、流通受限制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%。

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。

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

6.4.10.4 市场风险

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

6.4.10.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	66,069,606.70	-	-	-	66,069,606.70
结算备付金	414,267.62	-	-	-	414,267.62
存出保证金	640,767.85	-	-	-	640,767.85
交易性金融资产	60,478,575.25	-	1,000.07	2,234,891,170.15	2,295,370,745.47
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,343,043.50	5,343,043.50
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	127,603,217.42	-	1,000.07	2,240,234,213.65	2,367,838,431.14
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	2,700,713.08	-	-	-	2,700,713.08
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	16,106,390.63	16,106,390.63
应付管理人报酬	-	-	-	23,698.77	23,698.77
应付托管费	-	-	-	7,899.58	7,899.58
应付销售服务费	-	-	-	268,796.51	268,796.51
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	239,643.90	239,643.90
负债总计	2,700,713.08	-	-	16,646,429.39	19,347,142.47
利率敏感度缺口	124,902,504.34	-	1,000.07	2,223,587,784.26	2,348,491,288.67
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	109,857,475.08	-	-	-	109,857,475.08
结算备付金	29,491.65	-	-	-	29,491.65
存出保证金	250,059.20	-	-	-	250,059.20
交易性金融资产	13,502,700.00	-	-	2,220,466,591.17	2,233,969,291.17
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,691,949.40	3,691,949.40
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	320,813.38	320,813.38
资产总计	123,639,725.93	-	-	2,224,479,353.95	2,348,119,079.88
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	3,000,000.00	-	-	-	3,000,000.00
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	4,956,382.64	4,956,382.64
应付管理人报酬	-	-	-	29,026.99	29,026.99
应付托管费	-	-	-	9,675.65	9,675.65
应付销售服务费	-	-	-	228,262.59	228,262.59
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	235,783.76	235,783.76
负债总计	3,000,000.00	-	-	5,459,131.63	8,459,131.63
利率敏感度缺口	120,639,725.93	-	-	2,219,020,222.32	2,339,659,948.25

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

6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2022 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2021 年 12 月 31 日 ）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	-81,460.86	-1,956.53
	2.市场利率平行下降 25 个基点	81,777.92	1,961.64

6.4.10.4.2 外汇风险

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

6.4.10.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	63,859,597.33	2.72	105,614,419.46	4.51
交易性金融资产-基金投资	2,171,031,572.82	92.44	2,114,852,171.71	90.39
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	2,234,891,170.15	95.16	2,220,466,591.17	94.90

注：交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标 ETF 份额。

6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2022 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2021 年 12 月 31 日 ）
	1.组合自身基准上升 5%	110,632,150.26	110,523,503.84
	2.组合自身基准下降 5%	-110,632,150.26	-110,523,503.84

6.4.11 公允价值

6.4.11.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.11.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.11.2.1 各层次金融工具的公允价值

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	2,234,641,822.92
第二层次	60,479,575.32
第三层次	249,347.23
合计	2,295,370,745.47

6.4.11.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.11.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.11.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.12 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	63,859,597.33	2.70
	其中：股票	63,859,597.33	2.70
2	基金投资	2,171,031,572.82	91.69
3	固定收益投资	60,479,575.32	2.55
	其中：债券	60,479,575.32	2.55
	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	66,483,874.32	2.81
8	其他资产	5,983,811.35	0.25
9	合计	2,367,838,431.14	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,842,862.40	0.08
B	采矿业	-	-
C	制造业	48,209,167.45	2.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,346,289.94	0.10
J	金融业	5,116,108.85	0.22
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	260,305.39	0.01
M	科学研究和技术服务业	2,780,725.90	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	226,043.90	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,113,540.31	0.09
R	文化、体育和娱乐业	964,553.19	0.04
S	综合	-	-
	合计	63,859,597.33	2.72

7.2.2 期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	22,223	11,867,082.00	0.51
2	300059	东方财富	187,495	4,762,373.00	0.20
3	300760	迈瑞医疗	8,006	2,507,479.20	0.11
4	300124	汇川技术	33,492	2,206,118.04	0.09
5	300014	亿纬锂能	22,533	2,196,967.50	0.09
6	300015	爱尔眼科	41,373	1,852,269.21	0.08
7	300498	温氏股份	86,560	1,842,862.40	0.08
8	300274	阳光电源	18,021	1,770,563.25	0.08
9	300122	智飞生物	13,600	1,509,736.00	0.06
10	300142	沃森生物	29,133	1,409,745.87	0.06
11	300450	先导智能	17,898	1,130,795.64	0.05
12	300347	泰格医药	9,482	1,085,214.90	0.05
13	300896	爱 美 客	1,600	960,016.00	0.04
14	300782	卓 胜 微	5,946	802,710.00	0.03
15	300751	迈为股份	1,600	785,440.00	0.03
16	300769	德方纳米	1,880	768,318.40	0.03
17	300759	康龙化成	7,650	728,433.00	0.03
18	300316	晶盛机电	10,713	724,091.67	0.03
19	300661	圣邦股份	3,977	723,893.54	0.03
20	300496	中科创达	5,500	717,640.00	0.03

21	300207	欣 旺 达	21,900	692,040.00	0.03
22	300763	锦浪科技	3,190	679,470.00	0.03
23	300073	当升科技	7,278	657,494.52	0.03
24	300390	天华超净	7,100	620,540.00	0.03
25	300408	三环集团	20,462	615,906.20	0.03
26	300012	华测检测	25,400	589,534.00	0.03
27	300999	金 龙 鱼	10,162	548,951.24	0.02
28	300568	星源材质	17,964	521,674.56	0.02
29	300285	国瓷材料	13,743	493,648.56	0.02
30	300601	康泰生物	10,331	466,754.58	0.02
31	300595	欧普康视	8,051	460,436.69	0.02
32	300037	新 宙 邦	8,511	447,338.16	0.02
33	300363	博腾股份	5,700	444,543.00	0.02
34	300919	中伟股份	3,500	433,650.00	0.02
35	300454	深 信 服	4,171	432,866.38	0.02
36	300628	亿联网络	5,676	432,227.40	0.02
37	300223	北京君正	3,900	414,375.00	0.02
38	300957	贝 泰 妮	1,900	413,307.00	0.02
39	300144	宋城演艺	26,617	408,570.95	0.02
40	300529	健帆生物	7,691	391,394.99	0.02
41	300433	蓝思科技	35,033	387,815.31	0.02
42	300003	乐普医疗	20,729	384,937.53	0.02
43	300413	芒果超媒	11,159	372,264.24	0.02
44	300724	捷佳伟创	4,100	366,335.00	0.02
45	300033	同 花 顺	3,679	353,735.85	0.02
46	300146	汤臣倍健	15,663	339,103.95	0.01
47	300373	扬杰科技	4,600	327,750.00	0.01
48	300308	中际旭创	10,220	317,331.00	0.01
49	300699	光威复材	5,097	300,060.39	0.01
50	300676	华大基因	4,180	299,706.00	0.01
51	300253	卫宁健康	31,672	278,080.16	0.01
52	300604	长川科技	6,100	275,415.00	0.01
53	300088	长信科技	36,899	273,790.58	0.01
54	300558	贝达药业	4,417	268,553.60	0.01
55	300474	景 嘉 微	3,920	268,088.80	0.01
56	300725	药石科技	2,700	267,273.00	0.01
57	300296	利 亚 德	36,400	265,720.00	0.01
58	300777	中简科技	5,500	265,100.00	0.01
59	300244	迪安诊断	8,401	261,271.10	0.01
60	300058	蓝色光标	39,863	260,305.39	0.01
61	300136	信维通信	14,600	246,010.00	0.01
62	300357	我武生物	4,708	244,957.24	0.01
63	300776	帝尔激光	1,400	241,920.00	0.01

64	300775	三角防务	5,000	240,750.00	0.01
65	300850	新 强 联	2,700	240,381.00	0.01
66	300832	新 产 业	5,230	235,925.30	0.01
67	300618	寒锐钴业	3,880	224,729.60	0.01
68	300748	金力永磁	6,020	221,536.00	0.01
69	300418	昆仑万维	13,729	219,664.00	0.01
70	300383	光环新网	20,348	212,026.16	0.01
71	300502	新 易 盛	7,642	200,220.40	0.01
72	300677	英科医疗	7,880	199,836.80	0.01
73	300979	华利集团	2,700	197,316.00	0.01
74	300009	安科生物	19,412	196,255.32	0.01
75	300861	美畅股份	2,100	194,649.00	0.01
76	300001	特 锐 德	11,222	194,252.82	0.01
77	300476	胜宏科技	10,500	192,780.00	0.01
78	300251	光线传媒	19,400	183,718.00	0.01
79	300457	赢合科技	6,391	181,568.31	0.01
80	300482	万孚生物	4,428	180,263.88	0.01
81	300294	博雅生物	5,000	179,750.00	0.01
82	300070	碧 水 源	34,093	177,624.53	0.01
83	300773	拉 卡 拉	9,100	173,446.00	0.01
84	300682	朗新科技	6,800	171,292.00	0.01
85	300630	普利制药	4,728	166,189.20	0.01
86	300866	安克创新	2,400	159,168.00	0.01
87	300747	锐科激光	4,061	157,972.90	0.01
88	300171	东 富 龙	4,500	152,595.00	0.01
89	300376	易 事 特	18,600	151,032.00	0.01
90	300115	长盈精密	14,132	145,700.92	0.01
91	300672	国 科 微	1,700	138,992.00	0.01
92	300726	宏达电子	2,100	128,457.00	0.01
93	300212	易 华 录	7,309	127,176.60	0.01
94	300888	稳健医疗	1,900	126,350.00	0.01
95	300841	康华生物	1,000	115,440.00	0.00
96	300821	东岳硅材	6,100	112,118.00	0.00
97	300973	立高食品	1,000	103,950.00	0.00
98	301047	义翘神州	600	77,838.00	0.00
99	301217	铜冠铜箔	4,284	63,531.72	0.00
100	300741	华宝股份	2,162	60,146.84	0.00
101	301029	怡 合 达	700	57,050.00	0.00
102	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
103	301150	中一科技	404	33,435.04	0.00
104	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
105	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
106	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00

107	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
108	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
109	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
110	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
111	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	106,852,821.85	4.57
2	300059	东方财富	50,494,099.50	2.16
3	300760	迈瑞医疗	31,733,861.00	1.36
4	300498	温氏股份	22,521,660.14	0.96
5	300124	汇川技术	21,538,404.20	0.92
6	300015	爱尔眼科	18,365,893.09	0.78
7	300122	智飞生物	18,250,124.13	0.78
8	300142	沃森生物	17,891,707.00	0.76
9	300014	亿纬锂能	17,695,558.50	0.76
10	300274	阳光电源	16,144,923.65	0.69
11	300896	爱 美 客	12,102,364.70	0.52
12	300347	泰格医药	11,352,578.64	0.49
13	300450	先导智能	10,101,564.00	0.43
14	300782	卓 胜 微	9,208,857.00	0.39
15	300661	圣邦股份	7,657,172.44	0.33
16	300012	华测检测	7,053,126.90	0.30
17	300751	迈为股份	6,634,633.24	0.28
18	300408	三环集团	6,579,073.00	0.28
19	300496	中科创达	6,446,004.00	0.28
20	300759	康龙化成	6,317,014.66	0.27

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	117,997,168.12	5.04
2	300059	东方财富	55,695,889.64	2.38
3	300760	迈瑞医疗	32,247,082.29	1.38
4	300124	汇川技术	24,901,157.00	1.06

5	300014	亿纬锂能	23,195,133.50	0.99
6	300498	温氏股份	21,991,448.69	0.94
7	300274	阳光电源	19,653,003.10	0.84
8	300015	爱尔眼科	19,398,468.54	0.83
9	300122	智飞生物	18,898,153.42	0.81
10	300142	沃森生物	18,895,631.36	0.81
11	300896	爱 美 客	12,486,149.00	0.53
12	300450	先导智能	11,993,968.00	0.51
13	300347	泰格医药	11,936,444.52	0.51
14	300782	卓 胜 微	10,584,960.97	0.45
15	300769	德方纳米	9,091,318.80	0.39
16	300661	圣邦股份	8,643,207.22	0.37
17	300751	迈为股份	8,395,566.80	0.36
18	300496	中科创达	8,356,725.00	0.36
19	300408	三环集团	7,859,044.00	0.34
20	300316	晶盛机电	7,496,741.00	0.32

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	634,370,487.59
卖出股票收入（成交）总额	706,677,794.83

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	60,478,575.25	2.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,000.07	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	60,479,575.32	2.58

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019666	22 国债 01	468,960	47,422,327.30	2.02
2	019664	21 国债 16	69,930	7,108,120.11	0.30
3	019656	21 国债 08	59,000	5,948,127.84	0.25
4	113060	浙 22 转债	10	1,000.07	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本报告期投资基金情况

7.10.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	南方创业板 ETF	股票型	交易型开放式（ETF）	南方基金管理股份有限公司	2,171,031,572.82	92.44

7.11 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；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

无。

7.12.2 本期国债期货投资评价

无。

7.13 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名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。

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

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

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	640,767.85
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,343,043.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,983,811.35

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
南方创业板 ETF 联接 A	114,569	9,397.94	30,474,212.10	2.83%	1,046,237,926.32	97.17%
南方创业板 ETF 联接 C	68,450	8,824.43	153,999,282.90	25.50%	450,033,096.41	74.50%
南方创业板 ETF 联接 E	2,981	4,026.38	-	-	12,002,651.84	100.00%
合计	186,000	9,100.79	184,473,495.00	10.90%	1,508,273,674.57	89.10%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方创业板 ETF 联接 A	2,783,287.52	0.2585%
	南方创业板 ETF 联接 C	124,569.02	0.0206%
	南方创业板 ETF 联接 E	7.07	0.0001%
	合计	2,907,863.61	0.1718%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	南方创业板 ETF 联接 A	>100
	南方创业板 ETF 联接 C	0
	南方创业板 ETF 联接 E	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	南方创业板 ETF 联接 A	0~10
	南方创业板 ETF 联接 C	0~10
	南方创业板 ETF 联接 E	0~10
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方创业板 ETF 联接 A	南方创业板 ETF 联接 C	南方创业板 ETF 联接 E
基金合同生效日(2016 年 5 月 20 日)基金份额总额	292,580,784.97	-	-
本报告期期初基金份额总额	1,037,445,045.03	395,504,961.96	8,520,104.45
本报告期基金总申购份额	420,660,847.58	790,468,168.42	31,956,511.36
减：报告期基金总赎回份额	381,393,754.19	581,940,751.07	28,473,963.97
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,076,712,138.42	604,032,379.31	12,002,651.84

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金管理人收到中国证券监督管理委员会深圳监管局对公司的监管措施。基金管理人已及时按要求改正并报告。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
新时代证券	1	1,337,923,572.66	100.00%	133,799.52	100.00%	-
华泰证券	3	5,092.00	0.00%	2.42	0.00%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；

2、公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；

3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；

4、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

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

1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；

2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；

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

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

无

退租交易单元：

无

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
新时代证券	50,112.35	0.08%	-	-	-	-	1,396,748,709.99	100.00%
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	59,873,182.10	99.92%	120,700,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	南方基金关于旗下部分基金增加苏宁基金为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-13
3	南方基金关于旗下部分基金增加利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	2022-01-18

		会基金电子披露网站	
4	南方基金关于旗下部分基金增加万联证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-18
5	南方基金关于调整中国银行各交易渠道基金申购费率优惠标准的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-18
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关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-12
7	南方基金关于旗下部分基金增加长量基金为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-07
8	南方基金关于旗下部分基金增加海通证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-11
9	南方基金关于旗下部分基金增加招商银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-19
10	南方基金关于旗下部分基金增加宁波银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-22
11	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-22
12	南方基金关于旗下部分基金增加华夏财富为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-29
13	南方基金关于旗下部分基金增加日照银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-11
14	南方基金管理股份有限公司关于修订公司旗下部分公开募集证券投资基金基金合同有关条款的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-17
15	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金增加侧袋机制并相应修订基金合同有关条款的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-17
16	南方基金关于旗下部分基金增加联泰基金为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-31
17	南方基金关于旗下部分基金增加江苏银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-01
18	南方基金关于旗下部分基金增加鼎信汇金为销	中国证券报、基金管	2022-06-16

	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	

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件；

2、《南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；

3、《南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；

6、《南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2022 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：http://www.nffund.com