

南方中证 500 增强策略交易型开放式 指数证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 26 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 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.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	10
§5 托管人报告.....	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	54
7.11 投资组合报告附注.....	55

§8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	57
§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.....	58
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
§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	南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 500 增强策略 ETF
场内简称	增强 ETF; 中证 500 增强 ETF
基金主代码	560100
交易代码	560100
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 1 月 26 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	146,580,333.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2022 年 2 月 16 日

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“增强 ETF”或“中证 500 增强 ETF”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强策略交易型开放式指数证券投资基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.5%。
投资策略	本基金主要通过量化投资模型，在控制组合跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。主要投资策略包括：1、以增强指数投资收益为目的的股票投资策略；2、金融衍生品投资策略；3、债券投资策略；4、转融通证券出借业务投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、存托凭证投资策略
业绩比较基准	比较基准的标的指数：中证 500 指数 本基金的业绩比较基准：中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，一般而言，其风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司

	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	周易	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 26 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-8,743,145.43
本期利润	-71,260.16
加权平均基金份额本期利润	-0.0003
本期加权平均净值利润率	-0.03%
本期基金份额净值增长率	0.35%
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	-6,223,528.45
期末可供分配基金份额利润	-0.0425
期末基金资产净值	147,090,171.41

期末基金份额净值	1.0035
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	0.35%

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、本基金合同生效日为 2022 年 1 月 26 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满半年。

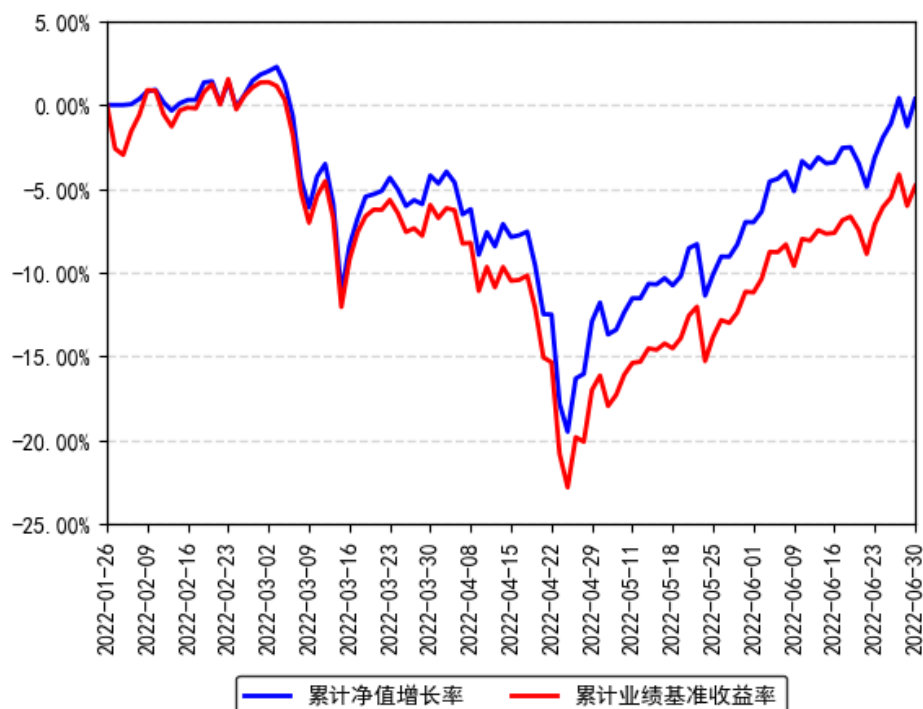
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.89%	1.11%	7.10%	1.10%	0.79%	0.01%
过去三个月	5.29%	1.68%	2.04%	1.75%	3.25%	-0.07%
自基金合同生效起至今	0.35%	1.61%	-4.84%	1.69%	5.19%	-0.08%

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

南方中证500增强策略ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2022 年 1 月 26 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末建仓期尚未结束。

§ 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		
崔蕾	本基金基金经理	2022 年 1 月 26 日	-	7 年	女，康奈尔大学金融工程硕士，金融风险经理（FRM），特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2015 年 2 月加入南方基金，历任数量化投资部助理研究员、研究员，指数投资部研究员；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 4 月 23 日，任南方小康 ETF、南方小康 ETF 联接基金经理；2019 年 6 月 28 日至 2022 年 2 月 18 日，任大数据 300 基金经理；2018 年 11 月 8 日至今，任南方中证 500 增强基金经理；2019 年 6 月 12 日至今，任南方顶峰 TOPIX ETF（QDII）基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任有色金属、南方有色金属联接、1000ETF 基金经理；2019 年 11 月 29 日至今，任南方粤港澳大湾区 ETF 基金经理；2020 年 1 月 17 日至今，任红利 50 基金经理；2020 年 1 月 21 日至今，任南方大盘红利 50 基金经理；2020 年 3 月 26 日至今，任南方粤港澳大湾区联接基金经理；2021 年 6 月 24 日至今，任南方中证科创创业 50ETF 基金经理；2021 年 8 月 19 日至今，任南方中证科创创业 50ETF 联接基金经理；2021 年 9 月 27 日至今，任南方中证 1000 联接基金经理；2021 年 12 月 29 日至今，任南方国证在线消费 ETF 基金经理；2022 年 1 月 26 日至今，任南方中证 500 增强策略 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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资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

本报告期内指数涨跌幅-4.53%，产品净值涨跌幅 0.25%，超额收益 4.78%（上市以来）。在国内疫情反复对需求端产生较大冲击、地缘政治不确定性仍存的背景下，A 股市场波动较大。同时在稳增长政策加持下，价值风格持续走好，为今年的主线之一。长期来看，继续看好景气度较高的成长板块。

在当前市场存在较大不确定性的行情下，本基金在风格和行业的配置上仍维持了均衡比例，并紧密跟踪市场动态。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0035 元，报告期内，份额净值增长率为 0.35%，同期业绩基准增长率为-4.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年受俄乌冲突、美联储快速加息、国内疫情反复等影响，A 股市场波动较大，整体呈现 V 型走势。展望下半年，国内经济弱复苏格局或将持续。在经济趋势性拐点确立前，难以见到货币政策的实质性收紧，加上海外加息预期趋缓，宏观流动性大概率仍将保持宽裕，利好长久期的成长股估值。

本基金为增强策略交易型开放式指数证券投资基金，作为基金管理人，我们将在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

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。

4.8 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,本基金托管人在对南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方新兴消费增长股票型证券投资基金 (LOF) 的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

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
资产:		
银行存款	6.4.7.1	2,807,388.96
结算备付金		7,686,144.20
存出保证金		1,838,398.17
交易性金融资产	6.4.7.2	135,212,266.42
其中:股票投资		135,175,159.43
基金投资		-
债券投资		37,106.99
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-

债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		501,669.49
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		148,045,867.24
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		1,290.97
应付赎回款		-
应付管理人报酬		64,939.88
应付托管费		6,493.99
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		0.17
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	882,970.82
负债合计		955,695.83
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	146,580,333.00
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	509,838.41
净资产合计		147,090,171.41
负债和净资产总计		148,045,867.24

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0035 元，基金份额总额 146,580,333.00 份。

6.2 利润表

会计主体：南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		584,496.86
1.利息收入		668,086.82
其中：存款利息收入	6.4.7.9	297,513.15
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		370,573.67
其他利息收入		-
证券出借利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-10,167,317.05
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-11,613,119.42
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	39,841.45
资产支持证券投资	6.4.7.12	-
收益		
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-992,781.54
股利收益	6.4.7.15	2,398,742.46
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)	6.4.7.16	8,671,885.27
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	1,411,841.82
减：二、营业总支出		655,757.02
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	566,060.58
2.托管费	6.4.10.2.2	56,606.03
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失		-
7.税金及附加		0.13
8.其他费用	6.4.7.18	33,090.28
三、利润总额(亏损总额以		-71,260.16

“-”号填列)		
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		-71,260.16
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-71,260.16

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）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)	-	-	-	-
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)	746,580,333.00	-	-	746,580,333.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列)	-600,000,000.00	-	509,838.41	-599,490,161.59
（一）、综合收益总额	-	-	-71,260.16	-71,260.16
（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)	-600,000,000.00	-	581,098.57	-599,418,901.43
其中：1.基金申购款	247,500,000.00	-	-12,606,489.51	234,893,510.49
2.基金赎回款	-847,500,000.00	-	13,187,588.08	-834,312,411.92
（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)	146,580,333.00	-	509,838.41	147,090,171.41

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 基金基本情况

南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]3580 号《关于准予南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 746,577,500.00 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(2022)第 0042 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2022 年 1 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 746,580,333.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 2,833.00 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2022]38 号审核同意,本基金 746,580,333.00 份基金份额于 2022 年 2 月 16 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上,力争实现超越目标指数的投资收益;主要投资于标的指数成份股、备选成份股。此外,本基金可少量投资于非成份股(包含主板、创业板及其他经中国证监会核准/注册发行的股票)、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可投资存托凭证。本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%,投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产净值的 80%。

每个交易日日终，在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 6.5%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率。

6.4.2 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其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

产的分类取决于本基金管理金融资产的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和资产支持证券投资，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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资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。

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，基金管理人可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	2,807,388.96
等于：本金	2,807,138.51
加：应计利息	250.45
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	2,807,388.96

6.4.7.2 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	126,914,514.16	-	135,175,159.43	8,260,645.27
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	37,100.00	37,106.99	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	37,100.00	37,106.99	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	126,951,614.16	6.99	135,212,266.42	8,260,645.27

注：于 2022 年 06 月 30 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为 0.00 元。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	11,086,320.00	-	-	-
一指期货	11,086,320.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,086,320.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2207	IC2207	3.00	3,860,760.00	157,200.00
IC2209	IC2209	6.00	7,636,800.00	254,040.00
合计				411,240.00

减：可抵销期货暂收款	411,240.00
净额	-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	33,968.56
其中：交易所市场	33,968.56
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	766,868.98
预提费用	32,117.28
应付指数使用费	-
可退替代款	50,016.00
其他	-
合计	882,970.82

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	746,580,333.00	746,580,333.00
本期申购	247,500,000.00	247,500,000.00

本期赎回（以“-”号填列）	-847,500,000.00	-847,500,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	146,580,333.00	146,580,333.00

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-8,743,145.43	8,671,885.27	-71,260.16
本期基金份额交易产生的变动数	2,519,616.98	-1,938,518.41	581,098.57
其中：基金申购款	-6,975,871.79	-5,630,617.72	-12,606,489.51
基金赎回款	9,495,488.77	3,692,099.31	13,187,588.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,223,528.45	6,733,366.86	509,838.41

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	38,399.22
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	257,986.52
其他	1,127.41
合计	297,513.15

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-13,108,294.57
股票投资收益——赎回差价收入	1,495,175.15
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-11,613,119.42

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日） 至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	675,612,808.95
减：卖出股票成本总额	687,702,157.69
减：交易费用	1,018,945.83
买卖股票差价收入	-13,108,294.57

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日） 至 2022 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	834,312,411.92
减：现金支付赎回款总额	390,323,814.92
减：赎回股票成本总额	442,493,421.85
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,495,175.15

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日） 至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	37.40
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	39,804.05
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	39,841.45

6.4.7.11.2 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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑	293,538.88

付)成交总额	
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	253,700.00
减:应计利息总额	31.64
减:交易费用	3.19
买卖债券差价收入	39,804.05

注:上述交易费用(如有)包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.7.11.3 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。

6.4.7.11.4 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。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位:人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	-992,781.54
合计	-992,781.54

6.4.7.15 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日
----	--

股票投资产生的股利收益	2,398,742.46
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	2,398,742.46

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	8,260,645.27
——股票投资	8,260,645.27
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	411,240.00
——权证投资	-
——期货投资	411,240.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	8,671,885.27

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

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,223,137.83
其他	188,703.99
合计	1,411,841.82

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	32,117.28
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	573.00
其他	400.00

合计	33,090.28
----	-----------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公司

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	698,745,739.68	38.67%
兴业证券	316,225,039.21	17.50%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)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	69,875.22	38.67%	10,247.85	30.17%
兴业证券	31,622.90	17.50%	11,271.46	33.18%

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	566,060.58
其中：支付销售机构的客户维护费	8,768.79

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

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	56,606.03

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内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。

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

本基金本报告期内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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券股份有限公司	500,000.00	0.34%

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,807,388.96	38,399.22

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国工商银行股份有限公司 保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）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	688046	药康生物	网下申购	6,035	135,968.55
华泰联合	688048	长光华芯	网下申购	1,417	114,493.60

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 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。

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

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301109	军信股份	2022年4月6日	6个月	新股锁定期	34.81	16.14	319	11,104.39	5,148.66	-
301109	军信股份	2022年6月17日	1-6个月（含）	锁定期转增	-	16.14	159	-	2,566.26	-
301150	中一科技	2022年4月14日	6个月	新股锁定期	163.56	82.76	63	10,304.28	5,213.88	-
301150	中一科技	2022年6月10日	1-6个月（含）	锁定期转增	-	82.76	31	-	2,565.56	-
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	新股锁定期	19.18	32.07	498	9,551.64	15,970.86	-
301248	杰创智能	2022年4月13日	6个月	新股锁定期	39.07	29.87	289	11,291.23	8,632.43	-
688046	药康生物	2022年4月14日	6个月	新股锁定期	22.53	26.24	6,035	135,968.55	158,358.40	-
688170	德龙激光	2022年4月22日	6个月	新股锁定期	30.18	47.04	3,540	106,837.20	166,521.60	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
127064	杭氧转债	2022年5月19日	1-6个月（含）	配债未上市	300.00	100.06	371	37,120.97	37,120.97	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

002670	国盛金控	2022 年 6 月 1 日	重大事项停牌	9.60	2022 年 7 月 14 日	9.99	83,300	751,574.82	799,680.00	-
--------	------	----------------	--------	------	-----------------	------	--------	------------	------------	---

本基金截至 2022 年 06 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证 500 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益。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“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资

产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无债券投资。

6.4.13.3 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来自调整基金投资组合时，由于部分组合资产流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.13.3.1 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%。

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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 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	2,807,388.96	-	-	-	2,807,388.96
结算备付金	7,686,144.20	-	-	-	7,686,144.20
存出保证金	1,838,398.17	-	-	-	1,838,398.17
交易性金融资产	-	-	37,106.99	135,175,159.43	135,212,266.42
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	-	-	-	501,669.49	501,669.49
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,331,931.33	-	37,106.99	135,676,828.92	148,045,867.24
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	1,290.97	1,290.97
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	64,939.88	64,939.88
应付托管费	-	-	-	6,493.99	6,493.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.17	0.17
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税	-	-	-	-	-

负债					
其他负债	-	-	-	882,970.82	882,970.82
负债总计	-	-	-	955,695.83	955,695.83
利率敏感度 缺口	12,331,931.3 3	-	37,106.99	134,721,133. 09	147,090,171. 41

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)
		本期末(2022年6月30日)
	1.市场利率平行上升 25 个基点	-523.18
	2.市场利率平行下降 25 个基点	532.03

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金原则上采用指数复制法,跟踪中证 500 指数,根据标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合,并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整,通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%,投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产净值的 80%。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,来测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位:人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

交易性金融资产-股票投资	135,175,159.43	91.90
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	135,175,159.43	91.90

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2022年6月30日）
	1.组合自身基准上升 5%	6,976,112.84
	2.组合自身基准下降 5%	-6,976,112.84

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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	134,010,501.78
第二层次	836,786.99
第三层次	364,977.65
合计	135,212,266.42

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	135,175,159.43	91.31
	其中：股票	135,175,159.43	91.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	37,106.99	0.03
	其中：债券	37,106.99	0.03
	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	10,493,533.16	7.09
8	其他资产	2,340,067.66	1.58
9	合计	148,045,867.24	100.00

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

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	662,724.00	0.45
B	采矿业	8,035,111.00	5.46
C	制造业	78,720,955.53	53.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,211,535.00	1.50
E	建筑业	1,420,483.00	0.97

F	批发和零售业	5,059,720.20	3.44
G	交通运输、仓储和邮政业	7,273,665.25	4.95
H	住宿和餐饮业	865,520.00	0.59
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,443,821.18	5.74
J	金融业	6,714,695.05	4.57
K	房地产业	1,881,269.00	1.28
L	租赁和商务服务业	1,313,963.00	0.89
M	科学研究和技术服务业	1,257,982.00	0.86
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,256,440.00	0.85
R	文化、体育和娱乐业	2,734,018.00	1.86
S	综合	1,475,310.00	1.00
	合计	129,327,212.21	87.92

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	328,429.00	0.22
C	制造业	3,094,498.77	2.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	184,552.00	0.13
E	建筑业	143,538.00	0.10
F	批发和零售业	232,657.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	71,391.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	557,512.43	0.38
J	金融业	571,262.70	0.39
K	房地产业	245,815.00	0.17
L	租赁和商务服务业	93,372.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	158,358.40	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	137,203.92	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	29,357.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	5,847,947.22	3.98

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

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

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	601615	明阳智能	68,400	2,311,920.00	1.57
2	600256	广汇能源	166,600	1,755,964.00	1.19
3	000970	中科三环	91,635	1,720,905.30	1.17
4	002180	纳思达	33,400	1,690,708.00	1.15
5	600392	盛和资源	74,600	1,685,960.00	1.15
6	300037	新宙邦	31,240	1,641,974.40	1.12
7	603613	国联股份	17,975	1,592,585.00	1.08
8	600141	兴发集团	35,900	1,579,241.00	1.07
9	000519	中兵红箭	52,300	1,524,545.00	1.04
10	300363	博腾股份	17,900	1,396,021.00	0.95
11	002422	科伦药业	72,200	1,350,140.00	0.92
12	600673	东阳光	148,800	1,337,712.00	0.91
13	688099	晶晨股份	13,074	1,320,474.00	0.90
14	600415	小商品城	235,900	1,313,963.00	0.89
15	000629	攀钢钒钛	345,700	1,313,660.00	0.89
16	600867	通化东宝	123,800	1,280,092.00	0.87
17	300012	华测检测	54,200	1,257,982.00	0.86
18	300244	迪安诊断	40,400	1,256,440.00	0.85
19	601872	招商轮船	216,100	1,244,736.00	0.85
20	000983	山西焦煤	92,600	1,239,914.00	0.84
21	002384	东山精密	53,400	1,224,462.00	0.83
22	600885	宏发股份	29,000	1,213,650.00	0.83
23	000960	锡业股份	71,100	1,192,347.00	0.81
24	300390	天华超净	13,100	1,144,940.00	0.78
25	300073	当升科技	12,600	1,138,284.00	0.77
26	000807	云铝股份	111,400	1,100,632.00	0.75
27	002756	永兴材料	7,200	1,095,912.00	0.75
28	600499	科达制造	52,200	1,077,408.00	0.73
29	300257	开山股份	71,800	1,074,128.00	0.73
30	600582	天地科技	223,700	1,069,286.00	0.73
31	300285	国瓷材料	28,700	1,030,904.00	0.70
32	002572	索菲亚	37,400	1,028,500.00	0.70
33	600298	安琪酵母	20,700	1,009,125.00	0.69
34	600563	法拉电子	4,700	964,252.00	0.66
35	002507	涪陵榨菜	27,800	959,656.00	0.65

36	600315	上海家化	22,200	949,050.00	0.65
37	600233	圆通速递	46,200	942,018.00	0.64
38	002028	思源电气	26,100	930,726.00	0.63
39	300357	我武生物	17,700	920,931.00	0.63
40	603444	吉比特	2,370	919,560.00	0.63
41	603605	珀莱雅	5,560	918,400.80	0.62
42	000729	燕京啤酒	95,000	917,700.00	0.62
43	002326	永太科技	27,300	898,989.00	0.61
44	603589	口子窖	15,200	890,872.00	0.61
45	002056	横店东磁	33,300	886,446.00	0.60
46	002294	信立泰	31,200	876,720.00	0.60
47	600348	华阳股份	56,500	873,490.00	0.59
48	002372	伟星新材	36,300	872,652.00	0.59
49	601077	渝农商行	234,000	865,800.00	0.59
50	600258	首旅酒店	34,900	865,520.00	0.59
51	002557	洽洽食品	15,200	865,336.00	0.59
52	600705	中航产融	249,900	864,654.00	0.59
53	601997	贵阳银行	145,700	846,517.00	0.58
54	000887	中鼎股份	46,300	844,512.00	0.57
55	600486	扬农化工	6,300	839,664.00	0.57
56	002273	水晶光电	69,300	839,223.00	0.57
57	002223	鱼跃医疗	32,600	836,516.00	0.57
58	002624	完美世界	58,100	834,897.00	0.57
59	600177	雅戈尔	123,500	818,805.00	0.56
60	600529	山东药玻	29,200	816,140.00	0.55
61	600536	中国软件	19,810	804,087.90	0.55
62	002505	鹏都农牧	236,000	800,040.00	0.54
63	002670	国盛金控	83,300	799,680.00	0.54
64	300832	新产业	17,700	798,447.00	0.54
65	603198	迎驾贡酒	12,200	794,708.00	0.54
66	688188	柏楚电子	3,607	793,684.28	0.54
67	600970	中材国际	81,900	793,611.00	0.54
68	300418	昆仑万维	49,300	788,800.00	0.54
69	601699	潞安环能	53,300	779,246.00	0.53
70	600985	淮北矿业	53,100	773,136.00	0.53
71	002831	裕同科技	25,800	762,390.00	0.52
72	002690	美亚光电	34,970	758,149.60	0.52
73	600380	健康元	61,300	757,055.00	0.51
74	002430	杭氧股份	24,200	756,492.00	0.51
75	603866	桃李面包	45,660	755,673.00	0.51
76	000401	冀东水泥	71,800	755,336.00	0.51
77	000987	越秀金控	106,935	751,753.05	0.51
78	603883	老百姓	21,990	745,021.20	0.51

79	600704	物产中大	144,800	742,824.00	0.51
80	002249	大洋电机	119,400	733,116.00	0.50
81	002439	启明星辰	36,500	727,445.00	0.49
82	600566	济川药业	26,700	725,172.00	0.49
83	002048	宁波华翔	45,000	720,900.00	0.49
84	000598	兴蓉环境	140,100	715,911.00	0.49
85	600282	南钢股份	225,600	710,640.00	0.48
86	300482	万孚生物	17,400	708,354.00	0.48
87	002867	周大生	45,500	706,615.00	0.48
88	002966	苏州银行	114,720	699,792.00	0.48
89	000027	深圳能源	108,900	698,049.00	0.47
90	002985	北摩高科	11,910	697,687.80	0.47
91	002242	九阳股份	37,800	694,008.00	0.47
92	002595	豪迈科技	30,900	690,306.00	0.47
93	000156	华数传媒	86,500	689,405.00	0.47
94	002815	崇达技术	53,600	686,616.00	0.47
95	002128	电投能源	47,600	681,632.00	0.46
96	600064	南京高科	61,800	679,800.00	0.46
97	688009	中国通号	149,719	678,227.07	0.46
98	002416	爱施德	72,500	674,250.00	0.46
99	600511	国药股份	25,100	672,178.00	0.46
100	002468	申通快递	56,000	667,520.00	0.45
101	600755	厦门国贸	89,000	667,500.00	0.45
102	600598	北大荒	44,900	662,724.00	0.45
103	603927	中科软	28,400	662,288.00	0.45
104	000581	威孚高科	34,300	660,275.00	0.45
105	603712	七一二	20,800	655,200.00	0.45
106	600967	内蒙一机	71,800	654,816.00	0.45
107	002563	森马服饰	109,800	650,016.00	0.44
108	688005	容百科技	5,017	649,400.48	0.44
109	600373	中文传媒	64,500	644,355.00	0.44
110	600167	联美控股	86,000	644,140.00	0.44
111	002399	海普瑞	36,300	638,154.00	0.43
112	600901	江苏租赁	124,200	637,146.00	0.43
113	601456	国联证券	51,500	631,905.00	0.43
114	000869	张裕 A	21,200	630,488.00	0.43
115	002191	劲嘉股份	58,600	628,192.00	0.43
116	002081	金螳螂	123,400	626,872.00	0.43
117	600835	上海机电	45,400	623,342.00	0.42
118	603355	莱克电气	24,700	623,181.00	0.42
119	601568	北元集团	98,000	621,320.00	0.42
120	000402	金融街	104,000	618,800.00	0.42
121	000563	陕国投 A	197,900	617,448.00	0.42

122	000553	安道麦 A	50,900	616,399.00	0.42
123	601000	唐山港	238,250	614,685.00	0.42
124	002110	三钢闽光	100,100	609,609.00	0.41
125	603868	飞科电器	8,000	606,000.00	0.41
126	600782	新钢股份	119,600	602,784.00	0.41
127	601098	中南传媒	63,700	601,328.00	0.41
128	601598	中国外运	154,700	600,236.00	0.41
129	600648	外高桥	44,100	599,760.00	0.41
130	600884	杉杉股份	20,100	597,372.00	0.41
131	601298	青岛港	108,100	591,307.00	0.40
132	001872	招商港口	37,900	591,240.00	0.40
133	000988	华工科技	25,300	586,201.00	0.40
134	002146	荣盛发展	192,300	582,669.00	0.40
135	600968	海油发展	218,700	564,246.00	0.38
136	600507	方大特钢	80,300	561,297.00	0.38
137	600350	山东高速	106,417	558,689.25	0.38
138	600259	广晟有色	10,700	541,955.00	0.37
139	600572	康恩贝	120,300	532,929.00	0.36
140	000039	中集集团	38,400	531,840.00	0.36
141	603077	和邦生物	122,800	523,128.00	0.36
142	601156	东航物流	26,000	514,800.00	0.35
143	605358	立昂微	7,516	506,428.08	0.34
144	300182	捷成股份	90,400	497,200.00	0.34
145	001965	招商公路	63,600	485,268.00	0.33
146	000559	万向钱潮	79,800	474,012.00	0.32
147	002396	星网锐捷	20,600	466,384.00	0.32
148	600787	中储股份	81,400	463,166.00	0.31
149	000733	振华科技	3,400	462,298.00	0.31
150	600188	兖矿能源	11,500	454,020.00	0.31
151	000878	云南铜业	38,200	435,098.00	0.30
152	000630	铜陵有色	126,300	411,738.00	0.28
153	000937	冀中能源	49,800	371,508.00	0.25
154	601928	凤凰传媒	42,200	301,730.00	0.21
155	601717	郑煤机	20,600	296,846.00	0.20
156	600153	建发股份	12,100	158,147.00	0.11
157	600157	ST 永泰	96,500	153,435.00	0.10
158	000009	中国宝安	10,200	137,598.00	0.09
159	000999	华润三九	2,900	130,500.00	0.09
160	002497	雅化集团	3,200	104,480.00	0.07

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

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

					比例 (%)
1	688170	德龙激光	3,540	166,521.60	0.11
2	688046	药康生物	6,035	158,358.40	0.11
3	002268	卫 士 通	2,100	90,111.00	0.06
4	600487	亨通光电	5,800	84,332.00	0.06
5	600862	中航高科	2,900	81,490.00	0.06
6	600765	中航重机	2,520	81,093.60	0.06
7	601058	赛轮轮胎	7,100	80,017.00	0.05
8	002373	千方科技	6,700	74,504.00	0.05
9	300296	利 亚 德	10,200	74,460.00	0.05
10	600160	巨化股份	5,600	73,640.00	0.05
11	000738	航发控制	2,600	73,060.00	0.05
12	300136	信维通信	4,300	72,455.00	0.05
13	600875	东方电气	4,400	72,380.00	0.05
14	002683	广东宏大	2,600	72,358.00	0.05
15	002409	雅克科技	1,300	72,163.00	0.05
16	002465	海格通信	7,900	71,811.00	0.05
17	600549	厦门钨业	3,300	71,346.00	0.05
18	002673	西部证券	10,900	71,286.00	0.05
19	601555	东吴证券	10,190	70,616.70	0.05
20	600667	太极实业	9,500	70,110.00	0.05
21	002244	滨江集团	8,100	70,065.00	0.05
22	000728	国元证券	11,200	69,664.00	0.05
23	600482	中国动力	4,400	69,124.00	0.05
24	600739	辽宁成大	4,700	68,526.00	0.05
25	600839	四川长虹	23,400	67,392.00	0.05
26	600637	东方明珠	9,400	67,210.00	0.05
27	603568	伟明环保	2,000	66,740.00	0.05
28	000623	吉林敖东	4,500	66,420.00	0.05
29	600642	申能股份	11,600	65,888.00	0.04
30	600369	西南证券	16,500	65,505.00	0.04
31	601005	重庆钢铁	34,000	64,940.00	0.04
32	000975	银泰黄金	6,600	64,284.00	0.04
33	002250	联化科技	3,900	63,843.00	0.04
34	000060	中金岭南	14,200	63,332.00	0.04
35	600201	生物股份	6,900	63,204.00	0.04
36	002155	湖南黄金	5,200	63,128.00	0.04
37	600998	九 州 通	5,300	63,123.00	0.04
38	600170	上海建工	20,800	63,024.00	0.04
39	002266	浙富控股	13,100	62,749.00	0.04
40	600066	宇通客车	7,200	62,280.00	0.04
41	002390	信邦制药	9,000	62,190.00	0.04
42	002019	亿帆医药	4,400	61,512.00	0.04

43	600022	山东钢铁	35,100	61,074.00	0.04
44	600718	东软集团	5,300	61,003.00	0.04
45	600535	天士力	5,800	60,958.00	0.04
46	002004	华邦健康	10,900	60,822.00	0.04
47	002010	传化智联	9,400	60,442.00	0.04
48	601179	中国西电	12,700	59,436.00	0.04
49	000883	湖北能源	11,600	59,276.00	0.04
50	600329	达仁堂	2,400	58,992.00	0.04
51	002701	奥瑞金	11,300	58,760.00	0.04
52	601958	金钼股份	6,600	58,344.00	0.04
53	601860	紫金银行	20,300	58,261.00	0.04
54	002925	盈趣科技	2,700	58,104.00	0.04
55	600376	首开股份	11,700	57,447.00	0.04
56	300212	易华录	3,300	57,420.00	0.04
57	000898	鞍钢股份	17,600	56,672.00	0.04
58	002948	青岛银行	15,500	56,110.00	0.04
59	000528	柳工	8,600	55,986.00	0.04
60	600728	佳都科技	8,600	55,556.00	0.04
61	600126	杭钢股份	10,700	54,784.00	0.04
62	002926	华西证券	6,900	54,096.00	0.04
63	600377	宁沪高速	6,300	53,991.00	0.04
64	600623	华谊集团	6,500	53,950.00	0.04
65	600195	中牧股份	4,400	53,944.00	0.04
66	000028	国药一致	1,800	53,622.00	0.04
67	600895	张江高科	4,300	53,535.00	0.04
68	300699	光威复材	900	52,983.00	0.04
69	603228	景旺电子	2,200	51,326.00	0.03
70	688819	天能股份	1,479	51,143.82	0.03
71	600131	国网信通	3,800	51,110.00	0.03
72	600299	安迪苏	5,300	50,774.00	0.03
73	600498	烽火通信	3,300	47,784.00	0.03
74	600216	浙江医药	3,400	46,410.00	0.03
75	600988	赤峰黄金	2,800	44,660.00	0.03
76	000537	广宇发展	3,200	41,568.00	0.03
77	601990	南京证券	4,900	40,866.00	0.03
78	002233	塔牌集团	4,600	40,710.00	0.03
79	000990	诚志股份	3,700	40,515.00	0.03
80	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.03
81	000930	中粮科技	4,000	36,160.00	0.02
82	601108	财通证券	4,500	35,415.00	0.02
83	601607	上海医药	1,900	34,352.00	0.02
84	300017	网宿科技	6,300	33,768.00	0.02
85	600316	洪都航空	1,100	33,264.00	0.02

86	000785	居然之家	7,400	32,930.00	0.02
87	600917	重庆燃气	4,200	30,324.00	0.02
88	002281	光迅科技	1,700	29,886.00	0.02
89	300251	光线传媒	3,100	29,357.00	0.02
90	600399	抚顺特钢	1,600	28,640.00	0.02
91	600037	歌华有线	3,000	28,170.00	0.02
92	600737	中粮糖业	3,400	25,568.00	0.02
93	000031	大悦城	5,800	23,200.00	0.02
94	600339	中油工程	7,700	22,253.00	0.02
95	000685	中山公用	2,700	20,736.00	0.01
96	600120	浙江东方	4,900	19,649.00	0.01
97	600567	山鹰国际	6,300	17,451.00	0.01
98	601866	中远海发	5,800	17,400.00	0.01
99	600118	中国卫星	800	16,064.00	0.01
100	301238	瑞泰新材	498	15,970.86	0.01
101	600928	西安银行	4,300	15,781.00	0.01
102	600517	国网英大	2,700	14,013.00	0.01
103	002221	东华能源	1,400	13,034.00	0.01
104	603000	人民网	1,100	12,320.00	0.01
105	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
106	300253	卫宁健康	1,200	10,536.00	0.01
107	600820	隧道股份	1,700	10,404.00	0.01
108	301248	杰创智能	289	8,632.43	0.01
109	601139	深圳燃气	1,200	8,328.00	0.01
110	301150	中一科技	94	7,779.44	0.01
111	301109	军信股份	478	7,714.92	0.01
112	600959	江苏有线	2,200	7,172.00	0.00
113	601992	金隅集团	2,500	6,925.00	0.00
114	600418	江淮汽车	400	6,864.00	0.00
115	688002	睿创微纳	166	6,593.52	0.00
116	300618	寒锐钴业	100	5,792.00	0.00
117	603218	日月股份	200	5,080.00	0.00
118	600871	石化油服	1,800	3,402.00	0.00
119	603156	养元饮品	100	2,272.00	0.00
120	000012	南玻 A	300	2,226.00	0.00
121	002705	新宝股份	100	2,199.00	0.00
122	603638	艾迪精密	100	2,050.00	0.00
123	600398	海澜之家	200	950.00	0.00
124	000959	首钢股份	100	476.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000629	攀钢钒钛	12,955,502.50	8.81
2	688099	晶晨股份	12,433,150.45	8.45
3	600256	广汇能源	12,300,670.94	8.36
4	000090	天健集团	11,723,177.02	7.97
5	600141	兴发集团	11,654,052.17	7.92
6	000630	铜陵有色	11,475,048.00	7.80
7	000830	鲁西化工	11,279,415.00	7.67
8	600233	圆通速递	10,426,790.03	7.09
9	002180	纳思达	9,767,516.10	6.64
10	000733	振华科技	9,717,031.88	6.61
11	600315	上海家化	9,612,678.86	6.54
12	300363	博腾股份	9,546,457.00	6.49
13	002353	杰瑞股份	9,146,282.38	6.22
14	002384	东山精密	9,109,398.54	6.19
15	000970	中科三环	8,813,309.75	5.99
16	002080	中材科技	8,715,348.70	5.93
17	002557	洽洽食品	8,679,931.00	5.90
18	002028	思源电气	8,555,942.80	5.82
19	002183	怡亚通	8,423,294.00	5.73
20	300285	国瓷材料	8,345,766.50	5.67
21	000723	美锦能源	8,333,425.99	5.67
22	000039	中集集团	8,299,489.99	5.64
23	300763	锦浪科技	8,290,241.00	5.64
24	300037	新宙邦	8,289,944.05	5.64
25	000988	华工科技	8,275,107.85	5.63
26	002223	鱼跃医疗	8,181,248.96	5.56
27	002572	索菲亚	7,833,129.00	5.33
28	600563	法拉电子	7,817,765.00	5.31
29	000932	华菱钢铁	7,773,404.00	5.28
30	601615	明阳智能	7,589,855.00	5.16
31	600298	安琪酵母	7,565,119.00	5.14
32	603589	口子窖	7,555,036.60	5.14
33	600188	兖矿能源	7,527,855.96	5.12
34	002372	伟星新材	7,499,407.06	5.10
35	603613	国联股份	7,188,489.00	4.89
36	000623	吉林敖东	7,179,374.03	4.88
37	002266	浙富控股	7,092,263.00	4.82
38	300244	迪安诊断	6,925,899.00	4.71
39	600885	宏发股份	6,853,496.68	4.66
40	002831	裕同科技	6,835,431.96	4.65

41	000598	兴蓉环境	6,822,445.00	4.64
42	002110	三钢闽光	6,817,034.00	4.63
43	600705	中航产融	6,810,778.00	4.63
44	002294	信立泰	6,756,642.73	4.59
45	002138	顺络电子	6,746,296.75	4.59
46	300418	昆仑万维	6,701,559.99	4.56
47	002439	启明星辰	6,586,911.00	4.48
48	002508	老板电器	6,581,125.20	4.47
49	002985	北摩高科	6,543,140.00	4.45
50	002966	苏州银行	6,492,082.41	4.41
51	603893	瑞芯微	6,471,449.00	4.40
52	002416	爱施德	6,445,103.60	4.38
53	600529	山东药玻	6,441,998.00	4.38
54	601872	招商轮船	6,380,567.00	4.34
55	002430	杭氧股份	6,373,306.11	4.33
56	603267	鸿远电子	6,372,667.14	4.33
57	002128	电投能源	6,358,636.00	4.32
58	002563	森马服饰	6,353,142.00	4.32
59	002815	崇达技术	6,348,244.54	4.32
60	688208	道通科技	6,303,610.45	4.29
61	600754	锦江酒店	6,234,258.00	4.24
62	002440	闰土股份	6,160,281.10	4.19
63	600867	通化东宝	6,104,535.00	4.15
64	002595	豪迈科技	6,028,121.79	4.10
65	601717	郑煤机	5,991,640.42	4.07
66	002146	荣盛发展	5,914,724.00	4.02
67	600884	杉杉股份	5,891,201.87	4.01
68	000581	威孚高科	5,891,117.66	4.01
69	002690	美亚光电	5,839,023.31	3.97
70	000997	新大陆	5,833,661.00	3.97
71	000559	万向钱潮	5,781,662.23	3.93
72	603927	中科软	5,761,227.67	3.92
73	600170	上海建工	5,757,930.00	3.91
74	002867	周大生	5,719,923.75	3.89
75	000987	越秀金控	5,690,664.70	3.87
76	600372	中航电子	5,684,564.50	3.86
77	002048	宁波华翔	5,644,578.00	3.84
78	603444	吉比特	5,640,147.20	3.83
79	603605	珀莱雅	5,634,015.00	3.83
80	002233	塔牌集团	5,633,358.11	3.83
81	000877	天山股份	5,604,659.00	3.81
82	601077	渝农商行	5,589,647.00	3.80
83	000062	深圳华强	5,529,652.82	3.76

84	601456	国联证券	5,477,137.24	3.72
85	000031	大悦城	5,475,525.00	3.72
86	600535	天士力	5,421,772.00	3.69
87	600803	新奥股份	5,368,453.00	3.65
88	601866	中远海发	5,355,480.00	3.64
89	600673	东阳光	5,293,226.00	3.60
90	002532	天山铝业	5,292,333.03	3.60
91	300751	迈为股份	5,258,167.70	3.57
92	002242	九阳股份	5,221,368.98	3.55
93	600177	雅戈尔	5,182,551.91	3.52
94	600642	申能股份	5,163,947.50	3.51
95	605358	立昂微	5,159,394.00	3.51
96	603568	伟明环保	5,116,207.00	3.48
97	600446	金证股份	5,060,469.46	3.44
98	000959	首钢股份	5,056,802.00	3.44
99	600507	方大特钢	5,056,683.00	3.44
100	600153	建发股份	4,975,705.00	3.38
101	600764	中国海防	4,974,950.76	3.38
102	600808	马钢股份	4,974,070.42	3.38
103	601928	凤凰传媒	4,957,027.00	3.37
104	601699	潞安环能	4,943,714.00	3.36
105	000960	锡业股份	4,940,145.08	3.36
106	688005	容百科技	4,915,398.30	3.34
107	601000	唐山港	4,883,120.00	3.32
108	603883	老百姓	4,882,018.00	3.32
109	600348	华阳股份	4,878,705.00	3.32
110	600201	生物股份	4,863,240.00	3.31
111	000415	渤海租赁	4,855,850.00	3.30
112	600064	南京高科	4,827,172.00	3.28
113	600271	航天信息	4,827,167.00	3.28
114	600985	淮北矿业	4,810,206.00	3.27
115	000883	湖北能源	4,788,731.00	3.26
116	603077	和邦生物	4,778,658.00	3.25
117	000028	国药一致	4,772,139.00	3.24
118	601975	招商南油	4,748,459.00	3.23
119	600968	海油发展	4,738,439.00	3.22
120	601598	中国外运	4,712,338.68	3.20
121	600282	南钢股份	4,711,213.00	3.20
122	600582	天地科技	4,672,439.00	3.18
123	600350	山东高速	4,662,290.75	3.17
124	000807	云铝股份	4,639,962.00	3.15
125	603290	斯达半导	4,625,380.00	3.14
126	600782	新钢股份	4,623,295.00	3.14

127	002701	奥瑞金	4,486,430.00	3.05
128	600643	爱建集团	4,455,914.54	3.03
129	600380	健康元	4,446,060.00	3.02
130	000685	中山公用	4,435,537.00	3.02
131	600511	国药股份	4,415,529.00	3.00
132	603866	桃李面包	4,367,552.82	2.97
133	600787	中储股份	4,350,977.00	2.96
134	600835	上海机电	4,260,317.00	2.90
135	603719	良品铺子	4,219,088.00	2.87
136	603156	养元饮品	4,214,799.25	2.87
137	000983	山西焦煤	4,155,402.00	2.83
138	600377	宁沪高速	4,149,733.00	2.82
139	601098	中南传媒	4,139,140.50	2.81
140	600597	光明乳业	4,110,706.61	2.79
141	000729	燕京啤酒	4,107,537.66	2.79
142	600373	中文传媒	4,093,193.76	2.78
143	600062	华润双鹤	3,993,294.66	2.71
144	600329	达仁堂	3,986,289.00	2.71
145	002946	新乳业	3,951,676.25	2.69
146	600901	江苏租赁	3,950,002.00	2.69
147	603228	景旺电子	3,936,468.74	2.68
148	600729	重庆百货	3,901,034.00	2.65
149	600623	华谊集团	3,899,875.29	2.65
150	688188	柏楚电子	3,877,509.79	2.64
151	600299	安迪苏	3,825,952.12	2.60
152	600917	重庆燃气	3,666,916.00	2.49
153	603786	科博达	3,477,556.00	2.36
154	603868	飞科电器	3,411,537.65	2.32
155	002191	劲嘉股份	3,167,977.36	2.15
156	002507	涪陵榨菜	2,990,647.00	2.03
157	000887	中鼎股份	2,955,950.00	2.01

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000629	攀钢钒钛	11,756,518.00	7.99
2	000830	鲁西化工	11,748,053.00	7.99
3	000090	天健集团	11,707,127.89	7.96
4	000630	铜陵有色	10,893,559.00	7.41

5	000733	振华科技	9,759,028.75	6.63
6	300363	博腾股份	8,922,289.70	6.07
7	300763	锦浪科技	8,699,787.00	5.91
8	002080	中材科技	8,638,599.84	5.87
9	002353	杰瑞股份	8,586,451.00	5.84
10	002183	怡亚通	8,397,223.00	5.71
11	002180	纳思达	8,195,422.23	5.57
12	000723	美锦能源	8,084,951.88	5.50
13	002384	东山精密	7,906,937.68	5.38
14	000970	中科三环	7,804,905.90	5.31
15	002557	洽洽食品	7,761,155.83	5.28
16	002028	思源电气	7,699,276.00	5.23
17	000932	华菱钢铁	7,541,808.00	5.13
18	000039	中集集团	7,526,132.04	5.12
19	000988	华工科技	7,470,024.29	5.08
20	002223	鱼跃医疗	7,271,025.82	4.94
21	300285	国瓷材料	6,931,546.00	4.71
22	000623	吉林敖东	6,909,475.87	4.70
23	002572	索菲亚	6,896,930.88	4.69
24	300037	新宙邦	6,854,114.40	4.66
25	002266	浙富控股	6,725,316.00	4.57
26	002372	伟星新材	6,569,190.25	4.47
27	002138	顺络电子	6,367,987.36	4.33
28	002508	老板电器	6,303,246.54	4.29
29	002110	三钢闽光	6,100,783.24	4.15
30	000598	兴蓉环境	6,086,526.00	4.14
31	002294	信立泰	6,040,569.97	4.11
32	002440	闰土股份	6,009,247.09	4.09
33	002985	北摩高科	5,923,624.73	4.03
34	002831	裕同科技	5,914,676.22	4.02
35	300244	迪安诊断	5,842,461.08	3.97
36	002966	苏州银行	5,819,983.00	3.96
37	300418	昆仑万维	5,652,383.00	3.84
38	300751	迈为股份	5,636,815.20	3.83
39	002416	爱施德	5,618,104.99	3.82
40	000997	新大陆	5,599,944.00	3.81
41	002439	启明星辰	5,580,675.00	3.79
42	000877	天山股份	5,573,682.00	3.79
43	002128	电投能源	5,548,806.86	3.77
44	002815	崇达技术	5,522,369.74	3.75
45	002233	塔牌集团	5,519,703.00	3.75
46	002563	森马服饰	5,496,281.00	3.74
47	000031	大悦城	5,486,004.00	3.73

48	002595	豪迈科技	5,425,064.27	3.69
49	000559	万向钱潮	5,410,693.00	3.68
50	000062	深圳华强	5,277,952.75	3.59
51	002430	杭氧股份	5,277,018.00	3.59
52	000581	威孚高科	5,172,429.85	3.52
53	002146	荣盛发展	5,127,180.00	3.49
54	002532	天山铝业	5,111,736.00	3.48
55	603290	斯达半导	5,014,305.00	3.41
56	000987	越秀金控	4,987,410.95	3.39
57	002690	美亚光电	4,872,434.50	3.31
58	002867	周大生	4,755,845.00	3.23
59	000415	渤海租赁	4,752,132.00	3.23
60	000959	首钢股份	4,711,260.00	3.20
61	000028	国药一致	4,681,574.00	3.18
62	000883	湖北能源	4,611,391.00	3.14
63	002048	宁波华翔	4,589,597.00	3.12
64	000685	中山公用	4,391,091.40	2.99
65	002701	奥瑞金	4,275,382.78	2.91
66	002242	九阳股份	4,131,249.00	2.81
67	002946	新乳业	3,754,441.00	2.55
68	000729	燕京啤酒	3,429,801.00	2.33
69	000983	山西焦煤	3,284,183.00	2.23
70	000960	锡业股份	3,256,318.00	2.21
71	000807	云铝股份	3,238,878.00	2.20
72	688188	柏楚电子	3,038,584.32	2.07
73	600372	中航电子	2,966,137.00	2.02

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

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	1,132,942,226.70
卖出股票收入（成交）总额	675,612,808.95

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	-	-
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）	37,106.99	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	37,106.99	0.03

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	127064	杭氧转债	371	37,106.99	0.03

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。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。

7.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	1,838,398.17
2	应收清算款	501,669.49
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,340,067.66

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688170	德龙激光	166,521.60	0.11	新股锁定期
2	688046	药康生物	158,358.40	0.11	新股锁定期

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户	户均持有的基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

数 (户)		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,617	56,010.83	30,308,733.00	20.68%	116,271,600.00	79.32%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中信建投证券股份有限公司	6,880,000.00	4.69%
2	方正证券股份有限公司	3,797,100.00	2.59%
3	招商证券股份有限公司	3,619,933.00	2.47%
4	广东华兴玻璃股份有限公司	3,100,000.00	2.11%
5	中信证券股份有限公司	2,998,900.00	2.05%
6	任中义	2,000,000.00	1.36%
7	施养行	1,990,000.00	1.36%
8	广发证券股份有限公司	1,808,100.00	1.23%
9	富达基金(香港)有限公司-开放式基金	1,675,700.00	1.14%
10	徐红	1,500,000.00	1.02%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022年1月26日)基金份额总额	746,580,333.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	247,500,000.00
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	847,500,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	146,580,333.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	788,932,058.19	43.66%	78,894.98	43.66%	-

华泰证券	2	698,745,739.68	38.67%	69,875.22	38.67%	-
兴业证券	1	316,225,039.21	17.50%	31,622.90	17.50%	-
中信建投	1	3,028,398.40	0.17%	302.78	0.17%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	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：

招商证券

中信建投

兴业证券

华泰证券

海通证券

广发证券

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	
	成交金额	占当期债	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		券回购成 交总额的 比例		证成交总 额的比例
海通证券	76,335.64	26.01%	440,000,000.00	100.00%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	73,874.46	25.17%	-	-	-	-
中信建投	143,326.00	48.83%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金调整募集期限的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-06
2	南方基金关于南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金增加湘财证券为网下发售代理机构的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-12
3	南方基金关于南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金增加招商证券为网下发售代理机构的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-14
4	南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上网发售提示性公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-17
5	南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-11
6	南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-11
7	南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购与赎回业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-11
8	南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-02-16
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-26
10	南方基金关于旗下部分基金增加华安证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-30

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证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-16
12	南方基金管理股份有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-06-18

§ 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。

§ 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中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 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>