

# 南方中证 500 增强策略交易型开放式 指数证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2023 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	13
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告.....	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告.....	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	71

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	71
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	71
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	71
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
8.12 投资组合报告附注.....	72
§9 基金份额持有人信息.....	73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	73
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	73
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	73
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	73
§10 开放式基金份额变动.....	73
§11 重大事件揭示.....	74
11.1 基金份额持有人大会决议.....	74
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
11.4 基金投资策略的改变.....	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	75
11.8 其他重大事件.....	76
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	78
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	78
§13 备查文件目录.....	78
13.1 备查文件目录.....	79
13.2 存放地点.....	79
13.3 查阅方式.....	79

## § 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	137,580,333.00 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

### 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公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
		郭明
		010-66105799

	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798
注册地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518017	100140
法定代表人		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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所(如有)

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年 1 月 26 日-2022 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-7,926,165.23
本期利润	-12,243,202.30
加权平均基金份额本期利润	-0.0615
本期加权平均净值利润率	-6.42%
本期基金份额净值增长率	-9.76%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末
期末可供分配利润	-13,425,273.46
期末可供分配基金份额利润	-0.0976
期末基金资产净值	124,155,059.54
期末基金份额净值	0.9024
3.1.3 累计期末指标	2022 年末
基金份额累计净值增长率	-9.76%

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一年。

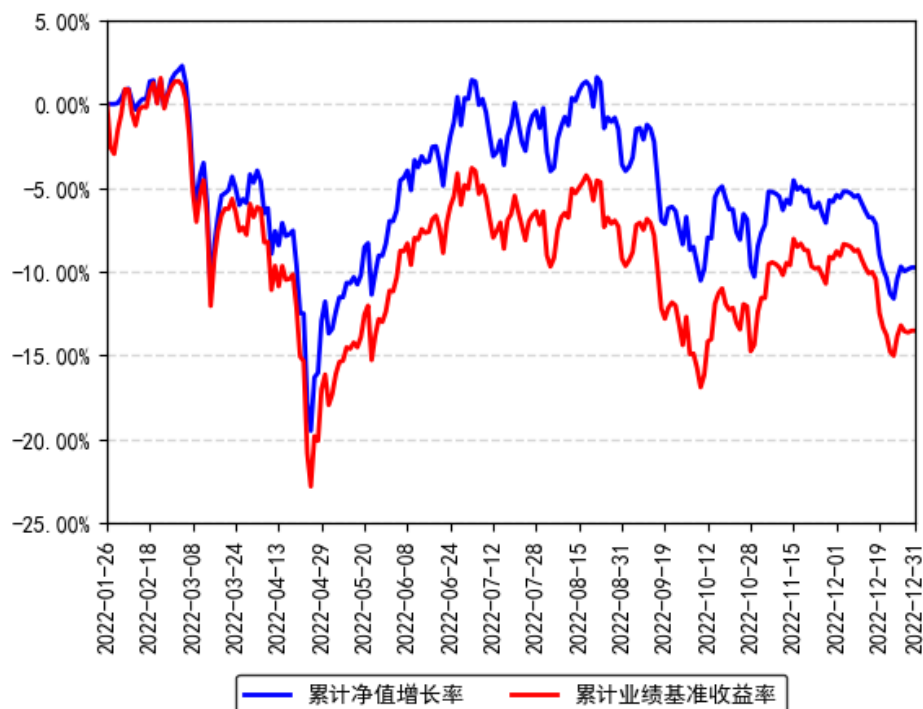
#### 3.2 基金净值表现

##### 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
过去三个月	-0.27%	0.98%	2.63%	1.03%	-2.90%	-0.05%
过去六个月	-10.07%	1.07%	-9.14%	1.10%	-0.93%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-9.76%	1.34%	-13.54%	1.39%	3.78%	-0.05%

### 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

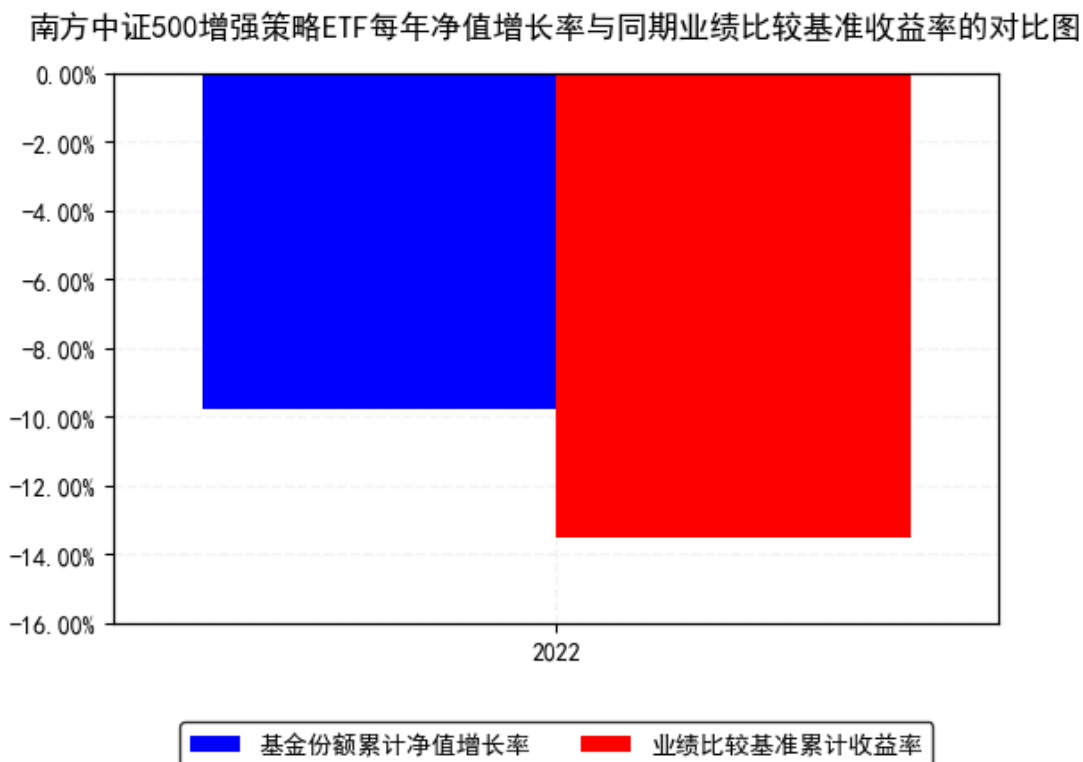
南方中证500增强策略ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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





注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2022 年 1 月 26 日成立，自基金合同生效日以来未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019 年 7 月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)1.72%、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）2.24%、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）2.25%、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）2.32%。目前，公司总部设在深圳，

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

截至本报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 1.72 万亿元，旗下管理 317 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，金融风险管理师（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；2022 年 11 月 23 日至今，任南方国证交通运输行业 ETF 基金经理；2022 年 12 月 1 日至今，任南方上证科创板 50 成份增强策略 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。

#### 4.1.3 基金经理薪酬机制

公司基金经理薪酬由工资、奖金等构成。工资由基金经理任职的职位职级决定，重点体现员工能力和职位价值导向原则；奖金由员工的绩效贡献决定，重点体现绩效导向与差异化原则。对于兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理，公司对私募资产管理计划产生的超额业绩报酬实施对应激励，并依据其管理产品的长期业绩与个人综合贡献情况实施分配。为贯彻激励约束相结合、激励与约束并重的管理理念，鼓励长期任职，防范经营风险，公司对基金经理奖金实施递延发放。同时，为加强员工利益与持有人利益相捆绑及一致性，公司对基金经理实施了跟投购基机制，有效引导基金经理为客户持续创造价值。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执

行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

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

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，建立和完善了兼任相关的制度及流程，确保兼任基金经理公平对待其管理的所有投资组合。通过对基金经理的投资交易行为进行监控和分析，本报告期内，两两组合间各项操作、流程及事后分析均正常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 12 次，是由于投资组合的投资策略导致。

### 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-13.25%，产品净值涨跌幅-9.85%，超额收益 3.4%（上市以来）。2022 年受地缘冲突、疫情反复等多因素影响，A 股市场波动较大，且各类风格轮动较快，获取超额收益的难度继续增加。

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 0.9024 元，报告期内，份额净值增长率为-9.76%，同期业绩基准增长率为-13.54%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年上半年，A 股市场大概率呈现强预期弱复苏的现象。在这转折之年里，经济建设将成为核心要务。从信用上看，“三支箭”融资政策有望带动地产销售企稳，国内信用逐渐恢复；从盈利上看，在 2022 年低基数的基础上，上市公司可能在 2023 年初确认盈利底；从估值上看，当前中证 500 为代表的中盘指数市盈率分位数在 P20 以下，安全边际较高。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求、自律规则和业务发展情况，严格遵循包括《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》在内的公募基金行业各项法律法规及其他规范要求，有效落实了 2022 年度发布的《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《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》和《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定》等公募基金相关新法律法规。

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

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程，制订和修订了包括《合规手册制度》《防控内幕信息及交易管理制度》《合规绩效管理制度》《责任追究管理办法》《洗钱及制裁风险名单管理规定》和《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理规则》等一系列与监察稽核和合规内控相关的管理制度。

在进一步优化制度体系的基础上，本基金管理人贯彻“合规为先，行稳致远”的合规理念，提升合规文化建设效果，着力增强合规培训实效性，提升合规宣导影响力；根据《基金从业人员管理规则》等监管办法要求，认真梳理并优化了员工行为检查工作方案，加强员工行为规范检查、严格进行合规问责，强化全员合规、主动合规理念；对投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务和相关部门开展了定期稽核、专项稽核及多项自查，通过专项稽核和合规检查工作识别问题、防范风险、推动解决，促进公司业务合规运作、稳健经营；结合内部风控系统大数据分析结果对各类合规指标采取差异化管控措施，采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，持续完善投资合规风控制度流程和系统，加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控，有效确保投研交易业务合规运作；全面履行新产品、新业务合规评估程序，保障新产品、新业务合规开展；严格审查基金宣传推介材料以及包括网络直播脚本在内的其他宣传材料合规性，不断强化销售合规风险管控，督促落实投资者适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；开展各类监管组织的投教活动，提升投教质效；监督和落实客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人高度重视反洗钱相关工作，贯彻风险为本，自评估驱动，反洗钱重点问题解决方案实现落地推进。从制度建设、系统功能建设、业务流程规范、宣传培训、监督检查等方面入手，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程，有效提升了公司反洗钱工作的合规水平。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全管理制度，不断提高监察稽核及合规管理工作的科学性和有效性，持续全面推进合规数智化工作在更广范围应用并与合规管理工作深度融合，努力防范和管理各类风险，切实维护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对南方中证 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 27539 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“南方中证 500 增强策略 ETF 基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见

	<p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了南方中证 500 增强策略 ETF 基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于南方中证 500 增强策略 ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>南方中证 500 增强策略 ETF 基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估南方中证 500 增强策略 ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算南方中证 500 增强策略 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督南方中证 500 增强策略 ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p>



	<p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险; 设计和实施审计程序以应对这些风险, 并获取充分、适当的审计证据, 作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上, 未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能对南方中证 500 增强策略 ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致南方中证 500 增强策略 ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波 陈薇瑶
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2023 年 3 月 29 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日
资产:		
银行存款	7.4.7.1	1,219,561.60

结算备付金		9,440,791.44
存出保证金		1,694,117.05
交易性金融资产	7.4.7.2	111,955,770.82
其中：股票投资		111,955,770.82
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
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		112,894.98
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		124,423,135.89
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		15,476.51
应付赎回款		-
应付管理人报酬		55,147.22
应付托管费		5,514.74
应付销售服务费		-
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	7.4.7.6	191,937.88
负债合计		268,076.35
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	137,580,333.00
其他综合收益		-

未分配利润	7.4.7.8	-13,425,273.46
净资产合计		124,155,059.54
负债和净资产总计		124,423,135.89

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9024 元，基金份额总额 137,580,333.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日
一、营业总收入		-11,197,918.33
1.利息收入		726,024.41
其中：存款利息收入	7.4.7.9	355,450.74
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
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-9,296,814.30
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-11,834,127.33
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	162,394.62
资产支持证券投资		-
收益		-
贵金属投资收益	7.4.7.12	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-623,980.77
股利收益	7.4.7.14	2,998,899.18
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)	7.4.7.15	-4,317,037.07
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	1,689,908.63

减：二、营业总支出		1,045,283.97
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	921,891.19
2.托管费	7.4.10.2.2	92,189.11
3.销售服务费	7.4.10.2.3	-
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		0.33
8.其他费用	7.4.7.17	31,203.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-12,243,202.30
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,243,202.30
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-12,243,202.30

### 7.3 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 12 月 31 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 12 月 31 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）	-609,000,000.00	-	-13,425,273.46	-622,425,273.46
（一）、综合收益总额	-	-	-12,243,202.30	-12,243,202.30
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”	-609,000,000.00	-	-1,182,071.16	-610,182,071.16

号填列)				
其中: 1.基金申购款	445,500,000.00	-	-22,984,870.64	422,515,129.36
2.基金赎回款	-1,054,500,000.00	-	21,802,799.48	-1,032,697,200.52
(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)	137,580,333.00	-	-13,425,273.46	124,155,059.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

南方中证 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。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2023 年 3 月 29 日批准报出。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》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 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 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 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期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 12 月 31 日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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商业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商业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。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债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。

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、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。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占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)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，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。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用 (2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩 (3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证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。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关

于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	1,219,561.60
等于：本金	1,219,321.10
加：应计利息	240.50
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	1,219,561.60

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	115,812,371.53	-	111,955,770.82	-3,856,600.71
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	115,812,371.53	-	111,955,770.82	-3,856,600.71

注：于 2022 年 12 月 31 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为 0.00 元。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 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 12 月 31 日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	12,209,236.36	-	-	-
一股指期货	12,209,236.36	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	12,209,236.36	-	-	-

#### 7.4.7.3.2 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
IC2303	IC2303	10.00	11,748,800.00	-460,436.36
合计				-460,436.36
减：可抵销期货暂收款				-460,436.36
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指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	43,996.96
其中：交易所市场	43,996.96
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	117,940.92
预提费用	30,000.00
应付指数使用费	-
可退替代款	-
其他	-
合计	191,937.88

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

#### 7.4.7.7 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 12 月 31 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	445,500,000.00	445,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,054,500,000.00	-1,054,500,000.00
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	137,580,333.00	137,580,333.00

注：

1. 本基金自 2022 年 1 月 7 日至 2022 年 1 月 19 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 746,577,500.00 元，折合为 746,577,500.00 份基金份额。根据《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 2,833.00 元在本基金成立后，折合为 2,833.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《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》、《南方中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及《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》的相关规定，本基金于 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 2 月 15 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务和赎回业务自 2022 年 2 月 16 日起开始办理。

#### 7.4.7.8 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	-7,926,165.23	-4,317,037.07	-12,243,202.30
本期基金份额交易产生的变动数	2,961,910.03	-4,143,981.19	-1,182,071.16
其中：基金申购款	-12,430,790.13	-10,554,080.51	-22,984,870.64
基金赎回款	15,392,700.16	6,410,099.32	21,802,799.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,964,255.20	-8,461,018.26	-13,425,273.46

### 7.4.7.9 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 12 月 31 日
活期存款利息收入	43,383.87
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	309,984.26
其他	2,082.61
合计	355,450.74

### 7.4.7.10 股票投资收益

#### 7.4.7.10.1 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 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-14,793,023.58
股票投资收益——赎回差价收入	2,958,896.25
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	-11,834,127.33

#### 7.4.7.10.2 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 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,072,467,074.46
减：卖出股票成本总额	1,085,699,840.68
减：交易费用	1,560,257.36
买卖股票差价收入	-14,793,023.58

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

#### 7.4.7.10.3 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 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	1,032,697,200.52
减：现金支付赎回款总额	486,200,442.52
减：赎回股票成本总额	543,537,861.75
减：交易费用	-
赎回差价收入	2,958,896.25

#### 7.4.7.10.4 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。

#### 7.4.7.10.5 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。

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 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 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	139.26
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	162,255.36
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	162,394.62

##### 7.4.7.11.2 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 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,124,518.14
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	962,100.00
减：应计利息总额	142.21
减：交易费用	20.57
买卖债券差价收入	162,255.36

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

##### 7.4.7.11.3 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。

##### 7.4.7.11.4 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。

##### 7.4.7.11.5 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。

#### 7.4.7.12 贵金属投资收益

##### 7.4.7.12.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.12.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

#### 7.4.7.12.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

#### 7.4.7.12.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

##### 7.4.7.13.1 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。

##### 7.4.7.13.2 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 12 月 31 日
股指期货-投资收益	-623,980.77

#### 7.4.7.14 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 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,998,899.18
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	2,998,899.18

#### 7.4.7.15 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 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-3,856,600.71
——股票投资	-3,856,600.71
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-460,436.36
——权证投资	-

——期货投资	-460,436.36
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	-4,317,037.07

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。

#### 7.4.7.16 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 12 月 31 日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,501,204.64
其他	188,703.99
合计	1,689,908.63

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

#### 7.4.7.17 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 12 月 31 日
审计费用	30,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	803.00
其他	400.34
合计	31,203.34

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

无。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司("南方基金")	基金管理人

中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司("兴业证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司("厦门国际信托")	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司("深圳投资控股")	基金管理人的股东
厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司("华泰联合")	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
南方资本管理有限公司("南方资本")	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司("南方东英")	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	998,751,727.70	38.53%
兴业证券	615,170,300.34	23.73%

###### 7.4.10.1.2 债券交易

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 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	331,397.98	29.47%
兴业证券	139,533.82	12.41%

###### 7.4.10.1.3 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。

###### 7.4.10.1.4 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 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	99,862.64	38.52%	18,535.92	42.13%

兴业证券	61,513.47	23.73%	17,890.38	40.66%
------	-----------	--------	-----------	--------

注：

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	921,891.19
其中：支付销售机构的客户维护费	15,741.74

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：

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

##### 7.4.10.2.2 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 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	92,189.11

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：

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

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

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

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

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

## 业务的情况

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

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券股份有限公司	2,283,600.00	1.66%

注：华泰证券投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,219,561.60	43,383.87

注：本基金由基金托管人中国工商银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

#### 7.4.10.7 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 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	113062	常银转债	配债	2,390	239,000.00
华泰联合	688046	药康生物	网下申购	6,035	135,968.55
华泰联合	301327	华宝新能	网下申购	483	114,712.50
华泰联合	688048	长光华芯	网下申购	1,417	114,493.60
华泰联合	301195	北路智控	网下申购	950	67,611.50
华泰联合	113659	莱克转债	配债	590	59,000.00
华泰联合	688420	美腾科技	网下申购	860	42,105.60
华泰联合	001258	立新能源	网下申购	3,188	10,775.44
兴业证券	301165	锐捷网络	网下申购	1,766	57,183.08
兴业证券	603280	南方路机	网下申购	363	8,621.25

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况——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。

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
301095	广立微	2022 年 7 月 28 日	6 个月	新股锁定期	58.00	86.49	127	7,366.00	10,984.23	-
301165	锐捷网络	2022 年 11 月 14 日	6 个月	新股锁定期	32.38	31.61	177	5,731.26	5,594.97	-
301195	北路智控	2022 年 7 月 25 日	6 个月	新股锁定期	71.17	73.04	95	6,761.15	6,938.80	-
301270	汉仪股份	2022 年 8 月 19 日	6 个月	新股锁定期	25.68	28.37	168	4,314.24	4,766.16	-
301283	聚胶股份	2022 年 8 月 26 日	6 个月	新股锁定期	52.69	51.41	88	4,636.72	4,524.08	-
301306	西测测试	2022 年 7 月 19 日	6 个月	新股锁定期	43.23	42.29	109	4,712.07	4,609.61	-
301309	万得凯	2022 年 9 月 8 日	6 个月	新股锁定期	39.00	24.46	83	3,237.00	2,030.18	-
301318	维海德	2022 年 8 月 3 日	6 个月	新股锁定期	64.68	41.74	72	4,656.96	3,005.28	-
301319	唯特偶	2022 年 9 月 22 日	6 个月	新股锁定期	47.75	53.27	61	2,912.75	3,249.47	-
301327	华宝新能	2022 年 9 月 8 日	6 个月	新股锁定期	237.50	176.97	49	11,637.50	8,671.53	-
301366	一博科技	2022	6 个月	新股锁	65.35	45.09	84	5,489.40	3,787.56	-

		年 9 月 19 日		定期						
301377	鼎泰高科	2022 年 11 月 11 日	6 个月	新股锁定期	22.88	17.63	289	6,612.32	5,095.07	-
301388	欣灵电气	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股锁定期	25.88	21.60	162	4,192.56	3,499.20	-
301391	卡莱特	2022 年 11 月 24 日	6 个月	新股锁定期	96.00	80.97	60	5,760.00	4,858.20	-
688293	奥浦迈	2022 年 8 月 26 日	6 个月	新股锁定期	80.20	99.12	603	48,360.60	59,769.36	-

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：

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

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

## 7.4.12.2 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
300850	新强联	2022 年 12 月 30 日	重大事项停牌	53.28	2023 年 1 月 10 日	56.88	300	17,967.00	15,984.00	-
600038	中直股份	2022 年 12 月 26 日	重大事项	46.41	2023 年 1	51.05	500	23,456.89	23,205.00	-



			停牌		月 10 日				
--	--	--	----	--	--------------	--	--	--	--

本基金截至 2022 年 12 月 31 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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，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之内。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为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出借证券，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。

于本年度末，本基金无债券投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，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。

于本年度末，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。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外,如根据基金合同的规定,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本年度末,本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.14%。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2022	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
----------	-------	-------	-------	-----	----

年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	1,219,561.60	-	-	-	1,219,561.60
结算备付金	9,440,791.44	-	-	-	9,440,791.44
存出保证金	49,285.05	-	-	1,644,832.00	1,694,117.05
交易性金融资产	-	-	-	111,955,770.82	111,955,770.82
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	-	-	-	112,894.98	112,894.98
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,709,638.09	-	-	113,713,497.80	124,423,135.89
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	-	-	-	15,476.51	15,476.51
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	55,147.22	55,147.22
应付托管费	-	-	-	5,514.74	5,514.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-
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	-	-	-	191,937.88	191,937.88
负债总计	-	-	-	268,076.35	268,076.35
利率敏感度缺口	10,709,638.09	-	-	113,445,421.45	124,155,059.54

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2022年12月31日）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	0.00
	2.市场利率平行下降 25 个基点	0.00

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	111,955,770.82	90.17
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	111,955,770.82	90.17

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

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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12月31日)
	1.组合自身基准上升 5%	5,925,077.64
	2.组合自身基准下降 5%	-5,925,077.64

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	111,785,198.12
第二层次	39,189.00
第三层次	131,383.70
合计	111,955,770.82

###### 7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

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 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	411,437.82	411,437.82
转出第三层次	-	378,790.59	378,790.59
当期利得或损失总额	-	98,736.47	98,736.47
其中：计入损益的利得或损失	-	98,736.47	98,736.47
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	131,383.70	131,383.70
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	5,003.17	5,003.17

于本年度末，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于本年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

##### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	131,383.70	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2127~0.7544	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本年度末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于本期内，本基金申购基金份额的对价总额为 422,515,129.36 元，其中包括以股票支付的申购款 221,503,092.44 元和以现金支付的申购款 201,012,036.92 元。

##### (2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	111,955,770.82	89.98
	其中：股票	111,955,770.82	89.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	10,660,353.04	8.57
8	其他资产	1,807,012.03	1.45
9	合计	124,423,135.89	100.00

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

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,023,785.00	0.82
B	采矿业	5,657,162.00	4.56



C	制造业	62,590,134.98	50.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,244,484.00	2.61
E	建筑业	841,741.00	0.68
F	批发和零售业	4,549,996.30	3.66
G	交通运输、仓储和邮政业	3,315,060.73	2.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,229,912.86	5.02
J	金融业	6,660,112.60	5.36
K	房地产业	2,956,752.60	2.38
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,328,565.60	1.07
N	水利、环境和公共设施管理业	464,003.00	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	495,061.00	0.40
R	文化、体育和娱乐业	2,487,885.00	2.00
S	综合	463,847.00	0.37
	合计	102,308,503.67	82.40

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	115,435.00	0.09
B	采矿业	357,592.00	0.29
C	制造业	6,108,719.68	4.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	158,875.00	0.13
E	建筑业	39,438.00	0.03
F	批发和零售业	550,478.00	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	274,218.00	0.22
H	住宿和餐饮业	27,280.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	579,172.50	0.47
J	金融业	744,255.00	0.60
K	房地产业	98,048.00	0.08
L	租赁和商务服务业	124,412.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	164,179.97	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	89,402.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	158,910.00	0.13
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	56,852.00	0.05

S	综合	-	-
	合计	9,647,267.15	7.77

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	002422	科伦药业	45,200	1,202,772.00	0.97
2	300012	华测检测	51,300	1,143,990.00	0.92
3	600885	宏发股份	27,900	932,139.00	0.75
4	601699	潞安环能	52,400	882,940.00	0.71
5	603444	吉比特	2,770	866,566.80	0.70
6	600873	梅花生物	82,500	839,850.00	0.68
7	600398	海澜之家	155,700	825,210.00	0.66
8	600160	巨化股份	51,800	803,418.00	0.65
9	600563	法拉电子	5,000	799,400.00	0.64
10	002384	东山精密	32,200	796,306.00	0.64
11	600380	健康元	69,500	784,655.00	0.63
12	000932	华菱钢铁	165,000	775,500.00	0.62
13	002557	洽洽食品	15,500	775,000.00	0.62
14	300136	信维通信	45,300	747,903.00	0.60
15	000598	兴蓉环境	152,200	744,258.00	0.60
16	600582	天地科技	142,000	738,400.00	0.59
17	300390	天华超净	13,100	732,028.00	0.59
18	002966	苏州银行	93,920	730,697.60	0.59
19	300724	捷佳伟创	6,300	718,326.00	0.58
20	603737	三棵树	6,300	717,129.00	0.58
21	603345	安井食品	4,400	712,272.00	0.57
22	603228	景旺电子	35,108	710,585.92	0.57
23	601717	郑煤机	62,900	701,964.00	0.57
24	600008	首创环保	245,300	694,199.00	0.56
25	601666	平煤股份	63,200	683,192.00	0.55
26	300866	安克创新	11,500	681,605.00	0.55
27	002030	达安基因	43,800	681,528.00	0.55
28	688122	西部超导	7,192	681,010.48	0.55
29	600566	济川药业	25,000	680,500.00	0.55

30	600298	安琪酵母	15,000	678,300.00	0.55
31	300363	博腾股份	16,600	678,110.00	0.55
32	600390	五矿资本	132,500	673,100.00	0.54
33	688390	固德威	2,073	669,765.57	0.54
34	300888	稳健医疗	9,300	664,950.00	0.54
35	603456	九洲药业	15,600	661,908.00	0.53
36	300699	光威复材	9,100	657,475.00	0.53
37	002497	雅化集团	28,100	653,325.00	0.53
38	600985	淮北矿业	50,900	651,520.00	0.52
39	603688	石英股份	4,898	643,205.36	0.52
40	601128	常熟银行	83,800	632,690.00	0.51
41	601231	环旭电子	38,900	631,347.00	0.51
42	002850	科达利	5,300	629,693.00	0.51
43	000581	威孚高科	35,200	624,096.00	0.50
44	002690	美亚光电	25,870	618,293.00	0.50
45	300073	当升科技	10,900	614,760.00	0.50
46	603355	莱克电气	21,900	614,076.00	0.49
47	000987	越秀资本	102,500	613,975.00	0.49
48	603605	珀莱雅	3,660	612,976.80	0.49
49	300037	新宙邦	14,000	608,580.00	0.49
50	601098	中南传媒	60,900	607,782.00	0.49
51	300682	朗新科技	27,600	606,648.00	0.49
52	600895	张江高科	53,200	603,288.00	0.49
53	600782	新钢股份	147,200	602,048.00	0.48
54	601000	唐山港	219,100	600,334.00	0.48
55	600329	达仁堂	20,600	599,460.00	0.48
56	600373	中文传媒	62,600	599,082.00	0.48
57	300357	我武生物	10,800	595,080.00	0.48
58	600704	物产中大	121,900	586,339.00	0.47
59	688777	中控技术	6,438	584,763.54	0.47
60	600486	扬农化工	5,600	581,840.00	0.47
61	002595	豪迈科技	25,100	581,065.00	0.47
62	600901	江苏金租	106,000	580,880.00	0.47
63	601958	金钼股份	50,200	579,810.00	0.47
64	600064	南京高科	87,560	578,771.60	0.47
65	600499	科达制造	40,700	578,347.00	0.47
66	601598	中国外运	150,300	577,152.00	0.46
67	002439	启明星辰	22,100	576,368.00	0.46
68	002299	圣农发展	24,300	575,667.00	0.46
69	002416	爱施德	60,700	575,436.00	0.46
70	300861	美畅股份	11,700	575,172.00	0.46
71	002273	水晶光电	48,400	570,636.00	0.46
72	002048	宁波华翔	41,000	569,900.00	0.46

73	601928	凤凰传媒	71,300	564,696.00	0.45
74	002430	杭氧股份	14,300	562,848.00	0.45
75	600377	宁沪高速	68,100	559,782.00	0.45
76	601298	青岛港	99,100	555,951.00	0.45
77	600350	山东高速	97,517	554,871.73	0.45
78	300017	网宿科技	99,100	552,978.00	0.45
79	688385	复旦微电	7,800	544,518.00	0.44
80	601198	东兴证券	70,200	541,944.00	0.44
81	002281	光迅科技	34,400	540,768.00	0.44
82	002372	伟星新材	25,200	537,768.00	0.43
83	603613	国联股份	6,075	537,273.00	0.43
84	603589	口子窖	9,200	530,564.00	0.43
85	002831	裕同科技	15,900	525,813.00	0.42
86	600378	昊华科技	12,200	523,502.00	0.42
87	002192	融捷股份	5,300	518,870.00	0.42
88	600648	外高桥	43,400	518,630.00	0.42
89	600998	九州通	39,600	516,384.00	0.42
90	300373	扬杰科技	9,800	515,480.00	0.42
91	603267	鸿远电子	5,000	505,800.00	0.41
92	603883	老百姓	12,490	505,470.30	0.41
93	600820	隧道股份	95,900	505,393.00	0.41
94	000997	新大陆	38,400	499,584.00	0.40
95	300244	迪安诊断	19,700	495,061.00	0.40
96	603868	飞科电器	7,200	484,776.00	0.39
97	601058	赛轮轮胎	48,200	482,964.00	0.39
98	600282	南钢股份	151,100	475,965.00	0.38
99	002250	联化科技	30,700	475,850.00	0.38
100	688188	柏楚电子	2,185	474,319.80	0.38
101	600498	烽火通信	36,000	473,040.00	0.38
102	002985	北摩高科	10,400	469,040.00	0.38
103	000156	华数传媒	62,500	468,125.00	0.38
104	000807	云铝股份	42,000	467,040.00	0.38
105	002028	思源电气	11,700	447,174.00	0.36
106	600126	杭钢股份	108,100	446,453.00	0.36
107	002138	顺络电子	17,000	445,060.00	0.36
108	601077	渝农商行	125,200	441,956.00	0.36
109	000062	深圳华强	35,900	438,339.00	0.35
110	002653	海思科	19,700	438,325.00	0.35
111	002705	新宝股份	25,900	431,235.00	0.35
112	002244	滨江集团	48,600	429,138.00	0.35
113	000513	丽珠集团	13,200	428,736.00	0.35
114	600764	中国海防	18,600	427,056.00	0.34
115	002128	电投能源	34,500	425,730.00	0.34

116	603026	胜华新材	4,600	424,580.00	0.34
117	600623	华谊集团	67,100	424,072.00	0.34
118	600131	国网信通	28,000	418,880.00	0.34
119	600376	首开股份	72,200	410,818.00	0.33
120	000937	冀中能源	64,400	409,584.00	0.33
121	600177	雅戈尔	63,600	402,588.00	0.32
122	603596	伯特利	5,000	399,000.00	0.32
123	601158	重庆水务	77,500	397,575.00	0.32
124	600705	中航产融	121,100	397,208.00	0.32
125	688819	天能股份	10,786	396,277.64	0.32
126	688301	奕瑞科技	857	392,403.16	0.32
127	601869	长飞光纤	12,000	391,560.00	0.32
128	603786	科博达	5,600	368,648.00	0.30
129	000999	华润三九	7,600	355,756.00	0.29
130	002683	广东宏大	12,900	347,784.00	0.28
131	603866	桃李面包	22,300	343,420.00	0.28
132	300776	帝尔激光	2,700	340,200.00	0.27
133	600325	华发股份	37,300	337,938.00	0.27
134	688116	天奈科技	4,378	337,718.92	0.27
135	600755	厦门国贸	46,300	330,582.00	0.27
136	002508	老板电器	11,700	324,792.00	0.26
137	002155	湖南黄金	25,000	323,750.00	0.26
138	600060	海信视像	23,800	322,252.00	0.26
139	002242	九阳股份	19,500	321,360.00	0.26
140	600409	三友化工	48,300	319,263.00	0.26
141	601555	东吴证券	48,800	318,664.00	0.26
142	002867	周大生	22,500	315,675.00	0.25
143	600718	东软集团	30,700	305,465.00	0.25
144	000563	陕国投 A	100,300	303,909.00	0.24
145	600348	华阳股份	21,100	300,675.00	0.24
146	600967	内蒙一机	36,200	299,012.00	0.24
147	601156	东航物流	19,500	297,570.00	0.24
148	001914	招商积余	19,100	293,758.00	0.24
149	600928	西安银行	82,200	289,344.00	0.23
150	002353	杰瑞股份	10,300	287,473.00	0.23
151	300003	乐普医疗	12,500	287,125.00	0.23
152	600155	华创阳安	44,000	286,000.00	0.23
153	000869	张裕 A	9,400	284,256.00	0.23
154	300630	普利制药	11,500	283,590.00	0.23
155	301029	怡合达	4,300	282,682.00	0.23
156	600598	北大荒	20,400	280,704.00	0.23
157	000009	中国宝安	23,200	280,488.00	0.23
158	000012	南玻 A	41,500	278,465.00	0.22

159	603719	良品铺子	7,500	276,525.00	0.22
160	002399	海普瑞	21,300	273,705.00	0.22
161	300308	中际旭创	10,100	273,003.00	0.22
162	600079	人福医药	11,400	272,346.00	0.22
163	601139	深圳燃气	41,600	272,064.00	0.22
164	600195	中牧股份	23,400	271,908.00	0.22
165	600352	浙江龙盛	26,500	262,350.00	0.21
166	000878	云南铜业	22,100	259,675.00	0.21
167	000630	铜陵有色	83,100	259,272.00	0.21
168	600141	兴发集团	8,900	258,100.00	0.21
169	600917	重庆燃气	31,800	253,128.00	0.20
170	600489	中金黄金	30,900	253,071.00	0.20
171	300144	宋城演艺	17,000	248,200.00	0.20
172	603858	步长制药	11,700	245,817.00	0.20
173	601108	财通证券	33,600	239,232.00	0.19
174	600521	华海药业	10,700	233,902.00	0.19
175	688099	晶晨股份	3,272	230,708.72	0.19
176	603939	益丰药房	3,600	229,824.00	0.19
177	300568	星源材质	10,800	229,608.00	0.18
178	000783	长江证券	42,800	228,124.00	0.18
179	600027	华电国际	38,300	225,204.00	0.18
180	603927	中科软	7,300	216,153.00	0.17
181	601607	上海医药	12,100	215,743.00	0.17
182	000729	燕京啤酒	19,600	208,152.00	0.17
183	002507	涪陵榨菜	8,000	206,160.00	0.17
184	002294	信立泰	6,200	203,670.00	0.16
185	000728	国元证券	31,800	201,294.00	0.16
186	600549	厦门钨业	10,200	199,410.00	0.16
187	000402	金融街	37,500	196,875.00	0.16
188	002465	海格通信	24,100	195,692.00	0.16
189	300832	新产业	3,900	195,546.00	0.16
190	688009	中国通号	40,687	194,890.73	0.16
191	600637	东方明珠	29,300	194,845.00	0.16
192	603156	养元饮品	8,700	193,749.00	0.16
193	600529	山东药玻	6,800	193,120.00	0.16
194	000970	中科三环	14,135	192,801.40	0.16
195	000027	深圳能源	30,200	192,072.00	0.15
196	002572	索菲亚	10,500	190,680.00	0.15
197	600170	上海建工	73,200	190,320.00	0.15
198	600867	通化东宝	20,700	190,026.00	0.15
199	600642	申能股份	34,600	189,954.00	0.15
200	000830	鲁西化工	15,300	189,567.00	0.15
201	000623	吉林敖东	12,500	187,375.00	0.15

202	002080	中材科技	8,700	186,441.00	0.15
203	002152	广电运通	18,700	185,878.00	0.15
204	000039	中集集团	26,400	185,856.00	0.15
205	603712	七一二	5,300	185,076.00	0.15
206	603127	昭衍新药	3,160	184,575.60	0.15
207	600699	均胜电子	13,100	184,055.00	0.15
208	603233	大参林	4,640	183,744.00	0.15
209	600673	东阳光	21,100	183,359.00	0.15
210	002340	格林美	24,300	180,549.00	0.15
211	002444	巨星科技	9,500	180,310.00	0.15
212	600271	航天信息	17,000	176,970.00	0.14
213	601992	金隅集团	68,700	174,498.00	0.14
214	600511	国药股份	6,200	172,980.00	0.14
215	000050	深天马 A	19,700	170,602.00	0.14
216	600066	宇通客车	22,600	169,726.00	0.14
217	601866	中远海发	70,000	169,400.00	0.14
218	600801	华新水泥	11,400	168,948.00	0.14
219	002408	齐翔腾达	23,800	167,552.00	0.13
220	002124	天邦食品	27,400	167,414.00	0.13
221	600507	方大特钢	27,600	166,152.00	0.13
222	600871	石化油服	83,900	166,122.00	0.13
223	601179	中国西电	35,900	165,499.00	0.13
224	002624	完美世界	13,000	165,360.00	0.13
225	000021	深科技	15,400	164,626.00	0.13
226	000401	冀东水泥	19,600	161,308.00	0.13
227	000883	湖北能源	38,400	161,280.00	0.13
228	002266	浙富控股	41,000	160,310.00	0.13
229	002249	大洋电机	31,300	160,256.00	0.13
230	600517	国网英大	33,000	159,720.00	0.13
231	603568	伟明环保	8,500	157,505.00	0.13
232	600808	马钢股份	55,900	157,079.00	0.13
233	601568	北元集团	27,700	157,059.00	0.13
234	000898	鞍钢股份	57,500	153,525.00	0.12
235	300677	英科医疗	7,300	153,519.00	0.12
236	000559	万向钱潮	30,600	149,022.00	0.12
237	000959	首钢股份	39,100	147,407.00	0.12
238	000967	盈峰环境	32,200	146,188.00	0.12
239	002110	三钢闽光	31,100	146,170.00	0.12
240	600667	太极实业	28,300	146,028.00	0.12
241	000060	中金岭南	34,900	143,090.00	0.12
242	002925	盈趣科技	8,500	140,420.00	0.11
243	600299	安迪苏	15,800	130,508.00	0.11
244	600157	ST 永泰	75,000	114,750.00	0.09

245	601969	海南矿业	15,400	114,114.00	0.09
246	600663	陆家嘴	10,900	106,166.00	0.09
247	000738	航发控制	3,800	97,432.00	0.08
248	300741	华宝股份	4,100	96,473.00	0.08
249	002603	以岭药业	2,900	86,884.00	0.07
250	000887	中鼎股份	5,400	78,138.00	0.06
251	600487	亨通光电	5,100	76,806.00	0.06
252	300146	汤臣倍健	2,100	47,922.00	0.04
253	600369	西南证券	5,700	21,375.00	0.02

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600927	永安期货	15,500	249,860.00	0.20
2	601872	招商轮船	24,800	138,632.00	0.11
3	600580	卧龙电驱	11,000	137,060.00	0.11
4	600546	山煤国际	9,200	133,308.00	0.11
5	603379	三美股份	4,600	130,916.00	0.11
6	603515	欧普照明	7,600	117,648.00	0.09
7	000983	山西焦煤	9,500	110,675.00	0.09
8	605258	协和电子	3,400	85,442.00	0.07
9	300605	恒锋信息	5,900	81,125.00	0.07
10	300242	佳云科技	23,800	80,920.00	0.07
11	600455	博通股份	3,600	79,632.00	0.06
12	600661	昂立教育	7,300	79,278.00	0.06
13	002956	西麦食品	5,300	78,811.00	0.06
14	002404	嘉欣丝绸	12,300	78,351.00	0.06
15	600250	南纺股份	13,200	76,956.00	0.06
16	300972	万辰生物	6,300	75,852.00	0.06
17	002278	神开股份	14,400	75,312.00	0.06
18	603090	宏盛股份	2,700	74,898.00	0.06
19	688215	瑞晟智能	2,429	74,691.75	0.06
20	600319	亚星化学	13,500	74,385.00	0.06
21	000691	亚太实业	16,300	74,002.00	0.06
22	603037	凯众股份	4,600	73,968.00	0.06
23	002836	新宏泽	7,800	73,788.00	0.06
24	002802	洪汇新材	5,100	73,746.00	0.06
25	300743	天地数码	6,300	72,891.00	0.06
26	002360	同德化工	10,300	72,409.00	0.06
27	600883	博闻科技	10,000	72,300.00	0.06
28	603488	展鹏科技	11,000	72,160.00	0.06



29	300272	开能健康	13,800	71,898.00	0.06
30	002774	快意电梯	11,200	71,680.00	0.06
31	603988	中电电机	7,700	71,533.00	0.06
32	002629	仁智股份	17,600	71,456.00	0.06
33	600538	国发股份	15,800	71,416.00	0.06
34	600202	哈空调	14,100	70,923.00	0.06
35	688096	京源环保	5,862	70,754.34	0.06
36	688092	爱科科技	3,046	70,728.12	0.06
37	002136	安纳达	5,200	70,668.00	0.06
38	603059	倍加洁	3,700	70,559.00	0.06
39	603269	海鸥股份	5,700	70,395.00	0.06
40	003019	宸展光电	3,300	70,323.00	0.06
41	603040	新坐标	4,100	70,028.00	0.06
42	300717	华信新材	5,000	70,000.00	0.06
43	300907	康平科技	3,900	69,732.00	0.06
44	600083	博信股份	9,600	69,696.00	0.06
45	002887	绿茵生态	8,200	69,536.00	0.06
46	300807	天迈科技	3,400	69,496.00	0.06
47	688616	西力科技	6,640	69,454.40	0.06
48	603600	永艺股份	7,100	69,225.00	0.06
49	300882	万胜智能	4,600	69,184.00	0.06
50	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.06
51	300514	友讯达	6,700	68,675.00	0.06
52	603006	黎明股份	7,800	68,640.00	0.06
53	300689	澄天伟业	4,200	68,418.00	0.06
54	300675	建科院	4,800	68,352.00	0.06
55	603022	新通联	7,600	67,716.00	0.05
56	300547	川环科技	4,600	66,424.00	0.05
57	603311	金海高科	5,400	65,988.00	0.05
58	002871	伟隆股份	5,000	65,650.00	0.05
59	688063	派能科技	200	63,130.00	0.05
60	688293	奥浦迈	603	59,769.36	0.05
61	002385	大北农	5,600	49,840.00	0.04
62	603606	东方电缆	700	47,481.00	0.04
63	600765	中航重机	1,500	46,635.00	0.04
64	600096	云天化	2,200	46,288.00	0.04
65	002407	多氟多	1,300	43,316.00	0.03
66	002625	光启技术	2,500	42,550.00	0.03
67	600988	赤峰黄金	2,300	41,515.00	0.03
68	600536	中国软件	700	40,831.00	0.03
69	601233	桐昆股份	2,800	40,460.00	0.03
70	002738	中矿资源	600	39,996.00	0.03
71	600859	王府井	1,400	39,396.00	0.03

72	300285	国瓷材料	1,400	38,598.00	0.03
73	600418	江淮汽车	2,900	38,077.00	0.03
74	600399	抚顺特钢	2,600	37,206.00	0.03
75	603517	绝味食品	600	36,654.00	0.03
76	002185	华天科技	4,300	35,647.00	0.03
77	688567	孚能科技	1,269	34,301.07	0.03
78	603816	顾家家居	800	34,168.00	0.03
79	600153	建发股份	2,500	34,125.00	0.03
80	605358	立昂微	800	34,080.00	0.03
81	002568	百润股份	900	33,624.00	0.03
82	600392	盛和资源	2,400	33,600.00	0.03
83	000629	钒钛股份	7,100	33,583.00	0.03
84	601162	天风证券	11,600	33,292.00	0.03
85	600161	天坛生物	1,400	33,222.00	0.03
86	002025	航天电器	500	33,125.00	0.03
87	000683	远兴能源	4,200	32,928.00	0.03
88	000831	中国稀土	1,000	32,880.00	0.03
89	601168	西部矿业	3,200	32,640.00	0.03
90	600109	国金证券	3,700	32,190.00	0.03
91	002223	鱼跃医疗	1,000	31,860.00	0.03
92	002797	第一创业	5,600	31,528.00	0.03
93	603077	和邦生物	10,300	31,312.00	0.03
94	600862	中航高科	1,400	31,206.00	0.03
95	002078	太阳纸业	2,700	31,104.00	0.03
96	000975	银泰黄金	2,800	30,912.00	0.02
97	601636	旗滨集团	2,700	30,753.00	0.02
98	002268	电科网安	1,000	30,530.00	0.02
99	002532	天山铝业	3,900	30,108.00	0.02
100	600143	金发科技	3,100	30,039.00	0.02
101	600497	驰宏锌锗	5,900	29,854.00	0.02
102	601696	中银证券	2,800	29,596.00	0.02
103	601990	南京证券	3,700	29,341.00	0.02
104	000591	太阳能	4,000	29,320.00	0.02
105	688185	康希诺	200	29,204.00	0.02
106	300253	卫宁健康	2,800	28,784.00	0.02
107	000988	华工科技	1,700	27,897.00	0.02
108	600026	中远海能	2,300	27,715.00	0.02
109	600482	中国动力	1,800	27,522.00	0.02
110	000519	中兵红箭	1,400	27,496.00	0.02
111	000998	隆平高科	1,700	27,319.00	0.02
112	600258	首旅酒店	1,100	27,280.00	0.02
113	601997	贵阳银行	4,900	26,901.00	0.02
114	002673	西部证券	4,400	26,796.00	0.02

115	300604	长川科技	600	26,748.00	0.02
116	002056	横店东磁	1,400	26,236.00	0.02
117	002092	中泰化学	3,500	26,110.00	0.02
118	000703	恒逸石化	3,600	25,308.00	0.02
119	002739	万达电影	1,800	25,200.00	0.02
120	002409	雅克科技	500	25,185.00	0.02
121	601016	节能风电	6,600	25,146.00	0.02
122	600655	豫园股份	3,300	25,113.00	0.02
123	603160	汇顶科技	500	25,100.00	0.02
124	002156	通富微电	1,500	24,720.00	0.02
125	600879	航天电子	3,600	24,480.00	0.02
126	300088	长信科技	4,100	24,477.00	0.02
127	000960	锡业股份	1,700	23,970.00	0.02
128	600415	小商品城	4,500	23,580.00	0.02
129	600516	方大炭素	3,800	23,256.00	0.02
130	600038	中直股份	500	23,205.00	0.02
131	300418	昆仑万维	1,600	23,056.00	0.02
132	601577	长沙银行	3,400	22,984.00	0.02
133	002531	天顺风能	1,500	22,695.00	0.02
134	600739	辽宁成大	1,800	22,662.00	0.02
135	601456	国联证券	2,000	22,500.00	0.02
136	600166	福田汽车	8,000	22,480.00	0.02
137	000400	许继电气	1,100	21,967.00	0.02
138	002326	永太科技	1,000	21,830.00	0.02
139	600909	华安证券	4,700	21,573.00	0.02
140	600118	中国卫星	1,000	21,550.00	0.02
141	000739	普洛药业	1,000	21,540.00	0.02
142	002203	海亮股份	1,900	21,470.00	0.02
143	000155	川能动力	1,200	21,408.00	0.02
144	300058	蓝色光标	4,200	21,210.00	0.02
145	000750	国海证券	6,300	20,979.00	0.02
146	002065	东华软件	3,700	20,942.00	0.02
147	000636	风华高科	1,400	20,762.00	0.02
148	600372	中航电子	1,300	20,761.00	0.02
149	600056	中国医药	1,200	20,676.00	0.02
150	300676	华大基因	400	20,676.00	0.02
151	000547	航天发展	2,200	20,658.00	0.02
152	601880	辽港股份	12,600	20,412.00	0.02
153	002936	郑州银行	8,600	20,210.00	0.02
154	002183	怡亚通	3,100	19,933.00	0.02
155	300026	红日药业	3,500	19,880.00	0.02
156	300070	碧水源	4,200	19,866.00	0.02
157	002131	利欧股份	11,200	19,824.00	0.02

158	002506	协鑫集成	6,800	19,788.00	0.02
159	600435	北方导航	1,700	19,720.00	0.02
160	300558	贝达药业	400	19,708.00	0.02
161	002368	太极股份	700	19,691.00	0.02
162	300383	光环新网	2,400	19,584.00	0.02
163	002926	华西证券	2,600	19,578.00	0.02
164	688002	睿创微纳	525	19,524.75	0.02
165	688779	长远锂科	1,335	19,477.65	0.02
166	300296	利亚德	3,400	19,244.00	0.02
167	002511	中顺洁柔	1,400	19,236.00	0.02
168	689009	九号公司	629	19,178.21	0.02
169	600315	上海家化	600	19,110.00	0.02
170	002195	二三四五	9,500	19,095.00	0.02
171	002500	山西证券	3,600	19,080.00	0.02
172	600848	上海临港	1,600	19,072.00	0.02
173	600021	上海电力	1,900	19,019.00	0.02
174	002212	天融信	1,900	18,981.00	0.02
175	600863	内蒙华电	5,400	18,846.00	0.02
176	002958	青农商行	6,500	18,785.00	0.02
177	688538	和辉光电	6,950	18,626.00	0.02
178	603658	安图生物	300	18,555.00	0.01
179	300001	特锐德	1,200	18,252.00	0.01
180	600208	新潮中宝	7,100	18,034.00	0.01
181	300024	机器人	2,000	17,960.00	0.01
182	603885	吉祥航空	1,100	17,798.00	0.01
183	300009	安科生物	1,900	17,784.00	0.01
184	601005	重庆钢铁	11,200	17,696.00	0.01
185	600316	洪都航空	700	17,633.00	0.01
186	600528	中铁工业	2,300	17,549.00	0.01
187	600827	百联股份	1,400	16,968.00	0.01
188	000825	太钢不锈	3,900	16,848.00	0.01
189	600906	财达证券	2,200	16,654.00	0.01
190	002939	长城证券	2,000	16,560.00	0.01
191	300251	光线传媒	1,900	16,454.00	0.01
192	688029	南微医学	200	16,426.00	0.01
193	300474	景嘉微	300	16,371.00	0.01
194	601665	齐鲁银行	3,900	16,263.00	0.01
195	603218	日月股份	800	16,240.00	0.01
196	600201	生物股份	1,800	16,218.00	0.01
197	600970	中材国际	1,900	16,188.00	0.01
198	600535	天士力	1,500	16,140.00	0.01
199	688521	芯原股份	366	16,129.62	0.01
200	600839	四川长虹	6,100	16,104.00	0.01

201	688256	寒武纪	295	16,095.20	0.01
202	002373	千方科技	1,800	16,056.00	0.01
203	300168	万达信息	1,900	16,017.00	0.01
204	300850	新强联	300	15,984.00	0.01
205	601778	晶科科技	2,900	15,950.00	0.01
206	300482	万孚生物	500	15,935.00	0.01
207	002127	南极电商	3,300	15,873.00	0.01
208	600500	中化国际	2,400	15,864.00	0.01
209	600171	上海贝岭	900	15,687.00	0.01
210	000709	河钢股份	6,900	15,594.00	0.01
211	002396	星网锐捷	800	15,328.00	0.01
212	300182	捷成股份	3,400	15,198.00	0.01
213	603000	人民网	900	15,183.00	0.01
214	002701	奥瑞金	3,000	15,150.00	0.01
215	000930	中粮科技	1,800	15,048.00	0.01
216	002153	石基信息	1,000	14,990.00	0.01
217	600959	江苏有线	5,000	14,850.00	0.01
218	002019	亿帆医药	1,200	14,700.00	0.01
219	000778	新兴铸管	4,000	14,600.00	0.01
220	300115	长盈精密	1,400	14,462.00	0.01
221	603707	健友股份	800	14,432.00	0.01
222	300212	易华录	700	14,287.00	0.01
223	600297	广汇汽车	6,800	14,280.00	0.01
224	603225	新凤鸣	1,300	14,144.00	0.01
225	002670	国盛金控	1,900	14,079.00	0.01
226	603893	瑞芯微	200	13,762.00	0.01
227	002505	鹏都农牧	5,300	13,674.00	0.01
228	600022	山东钢铁	9,200	13,616.00	0.01
229	002002	鸿达兴业	4,200	13,608.00	0.01
230	000656	金科股份	7,100	13,561.00	0.01
231	000785	居然之家	3,300	13,497.00	0.01
232	002468	申通快递	1,300	13,429.00	0.01
233	600567	山鹰国际	5,400	13,392.00	0.01
234	000089	深圳机场	1,700	13,362.00	0.01
235	601106	中国一重	4,500	13,185.00	0.01
236	300376	易事特	1,900	12,977.00	0.01
237	601333	广深铁路	5,700	12,939.00	0.01
238	002429	兆驰股份	3,700	12,913.00	0.01
239	600216	浙江医药	1,100	12,859.00	0.01
240	002010	传化智联	2,400	12,816.00	0.01
241	601718	际华集团	4,400	12,804.00	0.01
242	600728	佳都科技	2,400	12,672.00	0.01
243	002081	金螳螂	2,600	12,610.00	0.01

244	601187	厦门银行	2,200	12,606.00	0.01
245	688208	道通科技	399	12,588.45	0.01
246	600062	华润双鹤	700	12,523.00	0.01
247	603056	德邦股份	600	12,498.00	0.01
248	600737	中粮糖业	1,800	12,492.00	0.01
249	000540	中天金融	8,200	12,382.00	0.01
250	002191	劲嘉股份	1,700	12,291.00	0.01
251	688690	纳微科技	237	12,269.49	0.01
252	601118	海南橡胶	2,800	12,264.00	0.01
253	002221	东华能源	1,600	12,208.00	0.01
254	002745	木林森	1,500	12,165.00	0.01
255	300463	迈克生物	700	12,110.00	0.01
256	600259	广晟有色	300	12,060.00	0.01
257	300618	寒锐钴业	300	12,015.00	0.01
258	000537	广宇发展	900	11,907.00	0.01
259	600597	光明乳业	1,100	11,836.00	0.01
260	300072	海新能科	2,700	11,772.00	0.01
261	002423	中粮资本	1,600	11,456.00	0.01
262	601991	大唐发电	4,100	11,439.00	0.01
263	600095	湘财股份	1,500	11,340.00	0.01
264	002434	万里扬	1,400	11,270.00	0.01
265	301095	广立微	127	10,984.23	0.01
266	003035	南网能源	1,900	10,773.00	0.01
267	601611	中国核建	1,400	10,640.00	0.01
268	300257	开山股份	700	10,500.00	0.01
269	001203	大中矿业	800	10,344.00	0.01
270	601608	中信重工	2,900	10,121.00	0.01
271	600556	天下秀	1,500	10,110.00	0.01
272	600707	彩虹股份	2,400	9,936.00	0.01
273	600968	海油发展	3,400	9,792.00	0.01
274	002948	青岛银行	2,900	9,744.00	0.01
275	688289	圣湘生物	433	9,504.35	0.01
276	600167	联美控股	1,500	9,480.00	0.01
277	603650	彤程新材	300	9,249.00	0.01
278	000415	渤海租赁	4,100	9,061.00	0.01
279	603638	艾迪精密	600	8,952.00	0.01
280	000990	诚志股份	1,000	8,800.00	0.01
281	688006	杭可科技	200	8,754.00	0.01
282	301327	华宝新能	49	8,671.53	0.01
283	600307	酒钢宏兴	5,200	8,580.00	0.01
284	601828	美凯龙	1,800	8,442.00	0.01
285	600339	中油工程	2,800	8,344.00	0.01
286	000031	大悦城	2,200	8,272.00	0.01

287	603317	天味食品	300	8,244.00	0.01
288	002146	荣盛发展	3,600	7,812.00	0.01
289	600006	东风汽车	1,400	7,812.00	0.01
290	600787	中储股份	1,500	7,455.00	0.01
291	002563	森马服饰	1,400	7,336.00	0.01
292	000961	中南建设	3,200	7,008.00	0.01
293	301195	北路智控	95	6,938.80	0.01
294	688088	虹软科技	299	6,730.49	0.01
295	002945	华林证券	500	6,590.00	0.01
296	300869	康泰医学	200	6,514.00	0.01
297	000553	安道麦 A	700	6,335.00	0.01
298	601228	广州港	1,800	5,670.00	0.00
299	301165	锐捷网络	177	5,594.97	0.00
300	301377	鼎泰高科	289	5,095.07	0.00
301	301391	卡莱特	60	4,858.20	0.00
302	600956	新天绿能	500	4,820.00	0.00
303	301270	汉仪股份	168	4,766.16	0.00
304	301306	西测测试	109	4,609.61	0.00
305	301283	聚胶股份	88	4,524.08	0.00
306	001872	招商港口	300	4,308.00	0.00
307	301366	一博科技	84	3,787.56	0.00
308	001227	兰州银行	1,000	3,770.00	0.00
309	688772	珠海冠宇	200	3,728.00	0.00
310	301388	欣灵电气	162	3,499.20	0.00
311	600032	浙江新能	300	3,447.00	0.00
312	002901	大博医疗	100	3,403.00	0.00
313	301319	唯特偶	61	3,249.47	0.00
314	301318	维海德	72	3,005.28	0.00
315	301309	万得凯	83	2,030.18	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	钒钛股份	14,667,194.50	11.81
2	600256	广汇能源	13,597,628.94	10.95
3	688099	晶晨股份	13,546,957.78	10.91
4	000830	鲁西化工	13,476,251.00	10.85
5	002180	纳思达	13,358,845.10	10.76
6	600141	兴发集团	12,697,728.17	10.23
7	300363	博腾股份	12,630,996.00	10.17

8	002384	东山精密	12,204,302.54	9.83
9	000970	中科三环	12,111,240.65	9.75
10	000630	铜陵有色	11,874,396.00	9.56
11	000090	天健集团	11,723,177.02	9.44
12	600233	圆通速递	11,315,179.03	9.11
13	002353	杰瑞股份	11,192,808.38	9.02
14	300037	新宙邦	11,016,399.05	8.87
15	000988	华工科技	10,809,811.85	8.71
16	002557	洽洽食品	10,595,924.00	8.53
17	002028	思源电气	10,411,952.80	8.39
18	000733	振华科技	10,120,170.88	8.15
19	600315	上海家化	9,648,218.86	7.77
20	000932	华菱钢铁	9,604,787.00	7.74
21	300244	迪安诊断	9,546,353.00	7.69
22	600563	法拉电子	9,429,187.68	7.59
23	000039	中集集团	9,419,924.99	7.59
24	002138	顺络电子	9,369,716.75	7.55
25	002372	伟星新材	9,292,101.06	7.48
26	300285	国瓷材料	9,263,679.50	7.46
27	002572	索菲亚	9,161,029.63	7.38
28	002080	中材科技	8,954,870.70	7.21
29	002223	鱼跃医疗	8,871,124.96	7.15
30	603613	国联股份	8,489,475.00	6.84
31	000598	兴蓉环境	8,464,409.00	6.82
32	002183	怡亚通	8,445,258.00	6.80
33	300763	锦浪科技	8,407,886.94	6.77
34	000723	美锦能源	8,333,425.99	6.71
35	002831	裕同科技	8,283,758.96	6.67
36	603589	口子窖	8,191,723.60	6.60
37	002416	爱施德	8,160,261.60	6.57
38	002985	北摩高科	8,127,970.00	6.55
39	600298	安琪酵母	8,081,865.00	6.51
40	002966	苏州银行	8,032,968.41	6.47
41	601615	明阳智能	7,990,342.00	6.44
42	002439	启明星辰	7,817,214.00	6.30
43	002128	电投能源	7,786,563.00	6.27
44	300418	昆仑万维	7,774,095.99	6.26
45	002430	杭氧股份	7,627,663.11	6.14
46	000983	山西焦煤	7,562,488.48	6.09
47	600188	兖矿能源	7,531,585.96	6.07
48	002815	崇达技术	7,473,267.54	6.02
49	000623	吉林敖东	7,422,287.03	5.98
50	002294	信立泰	7,360,438.73	5.93



51	601872	招商轮船	7,355,878.20	5.92
52	002595	豪迈科技	7,320,474.79	5.90
53	600885	宏发股份	7,316,161.29	5.89
54	002266	浙富控股	7,293,903.00	5.87
55	000987	越秀资本	7,262,107.35	5.85
56	000581	威孚高科	7,208,317.66	5.81
57	600705	中航产融	7,180,526.00	5.78
58	002110	三钢闽光	7,175,523.00	5.78
59	002508	老板电器	7,134,128.20	5.75
60	601717	郑煤机	7,128,952.42	5.74
61	002690	美亚光电	7,110,804.81	5.73
62	000062	深圳华强	7,075,689.82	5.70
63	600529	山东药玻	7,049,000.00	5.68
64	002048	宁波华翔	6,981,316.28	5.62
65	603267	鸿远电子	6,971,951.14	5.62
66	603927	中科软	6,828,876.67	5.50
67	600867	通化东宝	6,708,990.00	5.40
68	603444	吉比特	6,606,421.20	5.32
69	000559	万向钱潮	6,599,915.23	5.32
70	002563	森马服饰	6,553,973.00	5.28
71	600372	中航电子	6,510,682.50	5.24
72	000997	新大陆	6,487,505.00	5.23
73	603893	瑞芯微	6,486,558.00	5.22
74	002867	周大生	6,483,103.75	5.22
75	002242	九阳股份	6,375,314.98	5.13
76	688208	道通科技	6,354,614.37	5.12
77	600754	锦江酒店	6,234,258.00	5.02
78	600642	申能股份	6,192,707.50	4.99
79	002440	闰土股份	6,160,281.10	4.96
80	603605	珀莱雅	6,154,406.00	4.96
81	600673	东阳光	6,101,724.00	4.91
82	002146	荣盛发展	6,080,709.00	4.90
83	601699	潞安环能	6,067,108.00	4.89
84	603568	伟明环保	6,028,629.00	4.86
85	600282	南钢股份	5,994,573.00	4.83
86	600170	上海建工	5,975,122.00	4.81
87	600884	杉杉股份	5,897,329.87	4.75
88	601077	渝农商行	5,870,208.00	4.73
89	600348	华阳股份	5,843,374.00	4.71
90	600446	金证股份	5,826,316.46	4.69
91	000028	国药一致	5,818,938.00	4.69
92	300390	天华超净	5,815,225.03	4.68
93	600177	雅戈尔	5,794,398.91	4.67

94	600153	建发股份	5,782,588.00	4.66
95	000960	锡业股份	5,780,120.08	4.66
96	601598	中国外运	5,766,852.68	4.64
97	000807	云铝股份	5,752,671.00	4.63
98	601928	凤凰传媒	5,734,574.00	4.62
99	601000	唐山港	5,722,257.00	4.61
100	002233	塔牌集团	5,646,950.11	4.55
101	000877	天山股份	5,604,659.00	4.51
102	000685	中山公用	5,590,371.00	4.50
103	601456	国联证券	5,553,749.24	4.47
104	601866	中远海发	5,549,438.00	4.47
105	000031	大悦城	5,519,962.00	4.45
106	600782	新钢股份	5,460,905.00	4.40
107	600764	中国海防	5,451,488.76	4.39
108	600535	天士力	5,445,317.00	4.39
109	600803	新奥股份	5,368,453.00	4.32
110	002532	天山铝业	5,321,266.03	4.29
111	002422	科伦药业	5,313,852.69	4.28
112	600377	宁沪高速	5,294,243.00	4.26
113	600329	达仁堂	5,292,229.00	4.26
114	300751	迈为股份	5,258,167.70	4.24
115	600507	方大特钢	5,241,473.00	4.22
116	000959	首钢股份	5,239,143.00	4.22
117	000999	华润三九	5,231,109.00	4.21
118	600271	航天信息	5,215,926.00	4.20
119	605358	立昂微	5,205,460.00	4.19
120	603077	和邦生物	5,203,020.00	4.19
121	600582	天地科技	5,202,630.00	4.19
122	600985	淮北矿业	5,147,647.00	4.15
123	600808	马钢股份	5,145,881.42	4.14
124	600064	南京高科	5,104,585.60	4.11
125	603883	老百姓	5,088,735.00	4.10
126	600380	健康元	5,078,221.00	4.09
127	600160	巨化股份	5,025,484.40	4.05
128	603228	景旺电子	5,022,263.34	4.05
129	600623	华谊集团	4,996,451.29	4.02
130	000883	湖北能源	4,987,317.00	4.02
131	600350	山东高速	4,930,884.75	3.97
132	688005	容百科技	4,915,398.30	3.96
133	600201	生物股份	4,880,816.00	3.93
134	000415	渤海租赁	4,867,355.00	3.92
135	603866	桃李面包	4,862,565.62	3.92
136	002756	永兴材料	4,830,450.20	3.89

137	600968	海油发展	4,812,645.00	3.88
138	000402	金融街	4,793,481.00	3.86
139	600062	华润双鹤	4,778,382.66	3.85
140	601975	招商南油	4,748,459.00	3.82
141	002497	雅化集团	4,669,078.00	3.76
142	603290	斯达半导	4,625,380.00	3.73
143	600511	国药股份	4,621,184.00	3.72
144	000729	燕京啤酒	4,596,818.66	3.70
145	603156	养元饮品	4,582,460.25	3.69
146	002507	涪陵榨菜	4,558,130.00	3.67
147	600835	上海机电	4,547,803.00	3.66
148	603786	科博达	4,544,716.00	3.66
149	603719	良品铺子	4,538,830.00	3.66
150	300017	网宿科技	4,537,006.00	3.65
151	002701	奥瑞金	4,506,416.00	3.63
152	600643	爱建集团	4,455,914.54	3.59
153	688188	柏楚电子	4,454,743.83	3.59
154	601098	中南传媒	4,446,661.50	3.58
155	600373	中文传媒	4,392,083.76	3.54
156	600787	中储股份	4,365,598.00	3.52
157	000513	丽珠集团	4,353,959.43	3.51
158	002946	新乳业	4,288,488.25	3.45
159	300073	当升科技	4,220,565.00	3.40
160	600901	江苏金租	4,203,433.00	3.39
161	000519	中兵红箭	4,146,082.70	3.34
162	300769	德方纳米	4,129,082.00	3.33
163	600597	光明乳业	4,121,941.61	3.32
164	601128	常熟银行	4,084,944.00	3.29
165	600299	安迪苏	3,978,953.12	3.20
166	600917	重庆燃气	3,945,184.00	3.18
167	600729	重庆百货	3,901,034.00	3.14
168	000887	中鼎股份	3,730,221.00	3.00
169	603868	飞科电器	3,714,180.65	2.99
170	300012	华测检测	3,706,524.00	2.99
171	300699	光威复材	3,704,760.00	2.98
172	600487	亨通光电	3,568,491.00	2.87
173	002191	劲嘉股份	3,564,419.36	2.87
174	600486	扬农化工	3,428,890.00	2.76
175	002273	水晶光电	3,224,858.37	2.60
176	001914	招商积余	3,156,828.00	2.54
177	000831	中国稀土	3,145,243.00	2.53
178	002396	星网锐捷	3,113,537.85	2.51
179	600967	内蒙一机	3,094,167.00	2.49

180	002056	横店东磁	3,077,491.00	2.48
181	000009	中国宝安	2,982,598.83	2.40
182	600765	中航重机	2,930,565.20	2.36
183	002030	达安基因	2,888,171.45	2.33
184	600566	济川药业	2,845,695.00	2.29
185	000937	冀中能源	2,822,469.00	2.27
186	002081	金螳螂	2,808,476.00	2.26
187	000401	冀东水泥	2,749,958.00	2.21
188	603456	九洲药业	2,686,024.40	2.16
189	300357	我武生物	2,663,524.78	2.15
190	000728	国元证券	2,661,184.40	2.14
191	600131	国网信通	2,605,896.00	2.10
192	300463	迈克生物	2,588,495.00	2.08
193	603355	莱克电气	2,574,128.70	2.07
194	000671	阳光城	2,526,465.00	2.03
195	002624	完美世界	2,522,623.00	2.03
196	002326	永太科技	2,496,271.00	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。

#### 8.4.2 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	钒钛股份	15,662,384.00	12.62
2	002180	纳思达	13,762,299.23	11.08
3	000830	鲁西化工	13,636,144.00	10.98
4	000970	中科三环	12,205,711.63	9.83
5	300363	博腾股份	11,944,238.70	9.62
6	000090	天健集团	11,707,127.89	9.43
7	002384	东山精密	11,581,724.68	9.33
8	000630	铜陵有色	11,435,288.00	9.21
9	000733	振华科技	10,585,079.75	8.53
10	300037	新宙邦	10,291,627.42	8.29
11	000988	华工科技	10,285,579.29	8.28
12	002028	思源电气	10,272,584.60	8.27
13	002353	杰瑞股份	10,193,760.00	8.21
14	002557	洽洽食品	9,550,053.83	7.69
15	300244	迪安诊断	9,063,212.08	7.30
16	000039	中集集团	8,855,765.54	7.13
17	300763	锦浪科技	8,817,111.00	7.10
18	002223	鱼跃医疗	8,786,742.82	7.08

19	002138	顺络电子	8,734,859.67	7.04
20	300285	国瓷材料	8,723,104.00	7.03
21	002572	索菲亚	8,687,443.73	7.00
22	002080	中材科技	8,670,819.84	6.98
23	002372	伟星新材	8,580,634.25	6.91
24	000932	华菱钢铁	8,505,065.00	6.85
25	002183	怡亚通	8,402,461.00	6.77
26	000723	美锦能源	8,084,951.88	6.51
27	000983	山西焦煤	7,769,213.29	6.26
28	002831	裕同科技	7,715,268.22	6.21
29	000598	兴蓉环境	7,664,128.00	6.17
30	002985	北摩高科	7,531,396.23	6.07
31	002416	爱施德	7,479,007.99	6.02
32	002966	苏州银行	7,475,950.00	6.02
33	300418	昆仑万维	7,348,550.00	5.92
34	002294	信立泰	7,261,524.97	5.85
35	002815	崇达技术	7,249,909.50	5.84
36	002128	电投能源	7,173,541.86	5.78
37	002439	启明星辰	7,035,776.00	5.67
38	000623	吉林敖东	7,019,401.87	5.65
39	002595	豪迈科技	6,869,051.27	5.53
40	002430	杭氧股份	6,866,579.00	5.53
41	002110	三钢闽光	6,856,997.24	5.52
42	002266	浙富控股	6,816,424.00	5.49
43	002508	老板电器	6,567,950.54	5.29
44	000987	越秀资本	6,539,213.75	5.27
45	000581	威孚高科	6,467,430.85	5.21
46	000559	万向钱潮	6,457,311.00	5.20
47	002690	美亚光电	6,387,476.11	5.14
48	000062	深圳华强	6,313,334.75	5.09
49	002563	森马服饰	6,283,321.00	5.06
50	002048	宁波华翔	6,045,446.00	4.87
51	002440	闰土股份	6,009,247.09	4.84
52	002867	周大生	5,843,718.89	4.71
53	000028	国药一致	5,806,539.96	4.68
54	002146	荣盛发展	5,792,125.00	4.67
55	000997	新大陆	5,717,263.00	4.60
56	300751	迈为股份	5,636,815.20	4.54
57	002242	九阳股份	5,580,165.00	4.49
58	000877	天山股份	5,573,682.00	4.49
59	002233	塔牌集团	5,571,939.00	4.49
60	000685	中山公用	5,545,477.40	4.47
61	000031	大悦城	5,541,856.00	4.46

62	000960	锡业股份	5,146,879.00	4.15
63	002532	天山铝业	5,111,736.00	4.12
64	600256	广汇能源	5,083,438.00	4.09
65	000807	云铝股份	5,043,521.00	4.06
66	603290	斯达半导	5,014,305.00	4.04
67	000999	华润三九	4,967,566.52	4.00
68	601872	招商轮船	4,855,311.00	3.91
69	002422	科伦药业	4,785,302.00	3.85
70	000415	渤海租赁	4,754,238.00	3.83
71	000959	首钢股份	4,736,051.00	3.81
72	000883	湖北能源	4,698,835.00	3.78
73	300390	天华超净	4,687,727.00	3.78
74	002756	永兴材料	4,587,225.00	3.69
75	000729	燕京啤酒	4,531,214.00	3.65
76	000402	金融街	4,451,377.94	3.59
77	002701	奥瑞金	4,338,359.78	3.49
78	002507	涪陵榨菜	4,249,238.00	3.42
79	002946	新乳业	4,099,914.00	3.30
80	000519	中兵红箭	3,999,402.00	3.22
81	688188	柏楚电子	3,883,040.20	3.13
82	603444	吉比特	3,830,004.00	3.08
83	002497	雅化集团	3,799,453.00	3.06
84	600372	中航电子	3,756,152.00	3.03
85	300017	网宿科技	3,751,754.00	3.02
86	603613	国联股份	3,729,270.95	3.00
87	601615	明阳智能	3,703,606.00	2.98
88	000513	丽珠集团	3,642,303.00	2.93
89	300769	德方纳米	3,616,344.00	2.91
90	000887	中鼎股份	3,414,517.42	2.75
91	600705	中航产融	3,360,966.00	2.71
92	603605	珀莱雅	3,282,068.00	2.64
93	600233	圆通速递	3,236,371.00	2.61
94	600188	兖矿能源	3,195,099.00	2.57
95	002056	横店东磁	3,178,630.00	2.56
96	300073	当升科技	3,155,550.06	2.54
97	300699	光威复材	3,109,189.00	2.50
98	000831	中国稀土	3,092,015.00	2.49
99	600160	巨化股份	3,057,106.00	2.46
100	603589	口子窖	3,053,991.00	2.46
101	600153	建发股份	3,049,009.00	2.46
102	002396	星网锐捷	3,021,447.00	2.43
103	600141	兴发集团	2,994,296.00	2.41
104	600298	安琪酵母	2,972,833.77	2.39

105	600673	东阳光	2,970,458.00	2.39
106	002191	劲嘉股份	2,960,929.00	2.38
107	601128	常熟银行	2,934,673.00	2.36
108	600062	华润双鹤	2,903,844.87	2.34
109	603927	中科软	2,900,940.00	2.34
110	002273	水晶光电	2,869,498.00	2.31
111	001914	招商积余	2,839,260.00	2.29
112	002081	金螳螂	2,827,388.00	2.28
113	603893	瑞芯微	2,821,050.00	2.27
114	688099	晶晨股份	2,796,369.10	2.25
115	600529	山东药玻	2,791,889.00	2.25
116	603883	老百姓	2,783,874.00	2.24
117	688005	容百科技	2,744,557.06	2.21
118	601717	郑煤机	2,733,039.00	2.20
119	688208	道通科技	2,704,011.58	2.18
120	600348	华阳股份	2,690,436.00	2.17
121	000009	中国宝安	2,688,311.00	2.17
122	600623	华谊集团	2,600,622.30	2.09
123	600487	亨通光电	2,586,073.00	2.08
124	300463	迈克生物	2,585,701.69	2.08
125	600968	海油发展	2,568,842.00	2.07
126	300012	华测检测	2,565,794.00	2.07
127	600642	申能股份	2,534,428.92	2.04

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,523,546,981.52
卖出股票收入（成交）总额	1,072,467,074.46

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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。

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

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



## 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,694,117.05
2	应收清算款	112,894.98
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	1,807,012.03

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

## 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

## 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
2,299	59,843.56	36,924,633.00	26.84%	100,655,700.00	73.16%

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中信建投证券股份有限公司	8,764,900.00	6.37%
2	中信证券股份有限公司	5,918,100.00	4.30%
3	广发证券股份有限公司	5,875,800.00	4.27%

4	富达基金(香港)有限公司-开放式基金	4,773,500.00	3.47%
5	广东华兴玻璃股份有限公司	3,100,000.00	2.25%
6	方正证券股份有限公司	3,081,700.00	2.24%
7	杜爱明	2,473,000.00	1.80%
8	华泰证券股份有限公司	2,283,600.00	1.66%
9	高璇	1,825,000.00	1.33%
10	黄时博	1,550,000.00	1.13%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(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	445,500,000.00
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,054,500,000.00
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	137,580,333.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已为本基金提供审计服务 1 年，本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币 30,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 1 月 29 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局
受到的具体措施类型	责令改正行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	个别基金内部控制不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人已及时按要求改正并报告
其他	/

#### 11.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	998,751,727.70	38.53%	99,862.64	38.52%	-
海通证券	1	973,358,222.65	37.55%	97,340.98	37.55%	-
兴业证券	1	615,170,300.34	23.73%	61,513.47	23.73%	-

中信建投	1	5,176,258.64	0.20%	517.63	0.20%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富 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

中金财富证券

退租交易单元：

中金财富证券

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	331,397.98	29.47%	-	-	-	-
海通证券	170,968.30	15.20%	440,000,000.00	100.00%	-	-
兴业证券	139,533.82	12.41%	-	-	-	-
中信建投	482,615.26	42.92%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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调整旗下基金大额申购等业务安排的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-27
13	南方基金管理股份有限公司关于董事长变更的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-28
14	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
15	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	2022-07-16
16	南方基金关于旗下部分基金增加上海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	2022-07-20
17	关于注意防范冒用南方基金及子公司、南方基金投研人员名义从事诈骗活动的风险提示	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-20
18	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-27
19	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-09-09
20	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-09-17
21	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	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-10-18
22	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	2022-11-02
23	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	2022-11-16
24	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	2022-12-03

		基金电子披露网站	
25	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-16
26	关于注意防范冒用南方基金及子公司、南方基金投研人员名义从事诈骗活动的风险提示	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-12-16

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证 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 年年度报告》原文。

### 13.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

### 13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>