

南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 中期财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	44
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	59
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.....	59
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.....	59
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.....	59
7.10 本报告期投资基金情况.....	59

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	60
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
7.13 投资组合报告附注.....	60
§8 基金份额持有人信息.....	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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.....	62
§9 开放式基金份额变动.....	62
§10 重大事件揭示.....	63
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
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.....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	68
12.2 存放地点.....	68
12.3 查阅方式.....	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	
基金简称	南方中证 500ETF 联接(LOF)	
场内简称	南方 500 (500ETF 联接 LOF)	
基金主代码	160119	
前端交易代码	160119	
后端交易代码	160120	
基金运作方式	上市型开放式(LOF)	
基金合同生效日	2009 年 9 月 25 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,761,944,968.22 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2009 年 11 月 11 日	
下属分级基金的基金简称	南方中证 500ETF 联接(LOF)A	南方中证 500ETF 联接(LOF)C
下属分级基金的场内简称	南方 500	
下属分级基金的交易代码	160119	004348
下属分级基金的前端交易代码	160119	
下属分级基金的后端交易代码	160120	
报告期末下属分级基金的份额总额	4,445,881,549.62 份	316,063,418.60 份

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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 日
基金管理人名称	南方基金管理股份有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

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

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，以中证 500ETF 作为其主要投资标的。为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	本基金的标的指数为中证 500 指数。 本基金业绩比较基准：中证 500 指数收益率 $\times$ 95% + 银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95599
传真	0755-82763889	010-68121816

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	北京东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518017	100031
法定代表人	杨小松（代为履行法定代表人职责）	谷澍

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金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 南方基金管理股份有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号 深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号 基金大厦 32-42 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、南方中证 500ETF 联接(LOF)A

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	377,761,606.24
本期利润	609,175,871.21
加权平均基金份额本期利润	0.1339
本期加权平均净值利润率	7.92%

本期基金份额净值增长率	7.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	3,499,327,836.75
期末可供分配基金份额利润	0.7870
期末基金资产净值	7,945,209,386.37
期末基金份额净值	1.7871
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	94.99%

2、南方中证 500ETF 联接(LOF)C

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	32,103,721.25
本期利润	39,543,065.10
加权平均基金份额本期利润	0.1238
本期加权平均净值利润率	7.40%
本期基金份额净值增长率	7.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	241,740,507.47
期末可供分配基金份额利润	0.7648
期末基金资产净值	557,803,926.07
期末基金份额净值	1.7648
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	12.18%

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

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

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

4、本基金从 2017 年 2 月 23 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2017 年 2 月 28 日起存续。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方中证 500ETF 联接(LOF)A

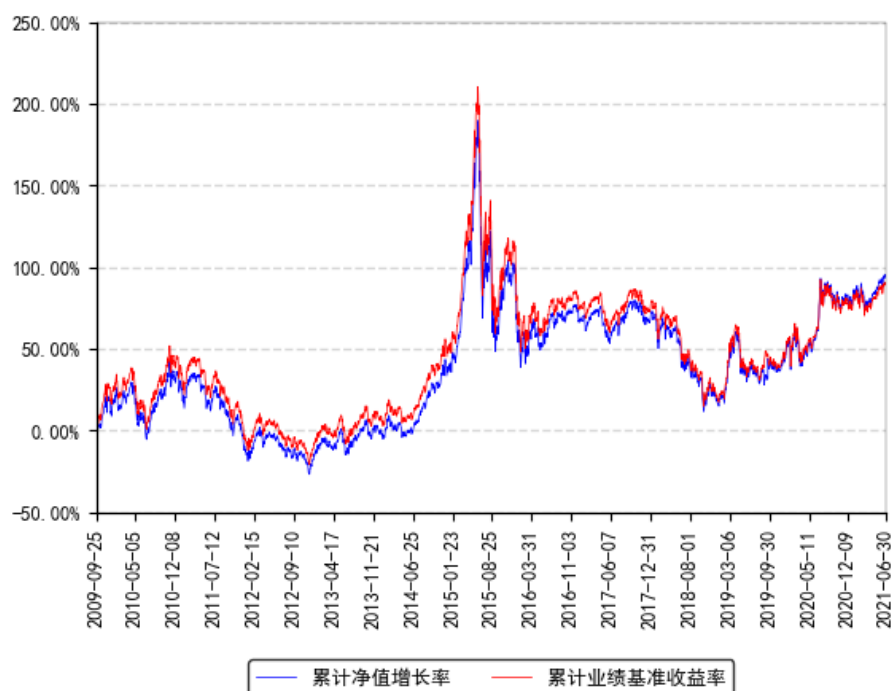
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	1.56%	0.71%	1.12%	0.69%	0.44%	0.02%
过去三个月	9.38%	0.65%	8.41%	0.65%	0.97%	0.00%
过去六个月	7.54%	0.95%	6.61%	0.94%	0.93%	0.01%
过去一年	18.94%	1.20%	15.35%	1.19%	3.59%	0.01%
过去三年	36.94%	1.41%	29.32%	1.40%	7.62%	0.01%
自基金合同 生效起至今	94.99%	1.58%	90.31%	1.58%	4.68%	0.00%

南方中证 500ETF 联接 (LOF) C

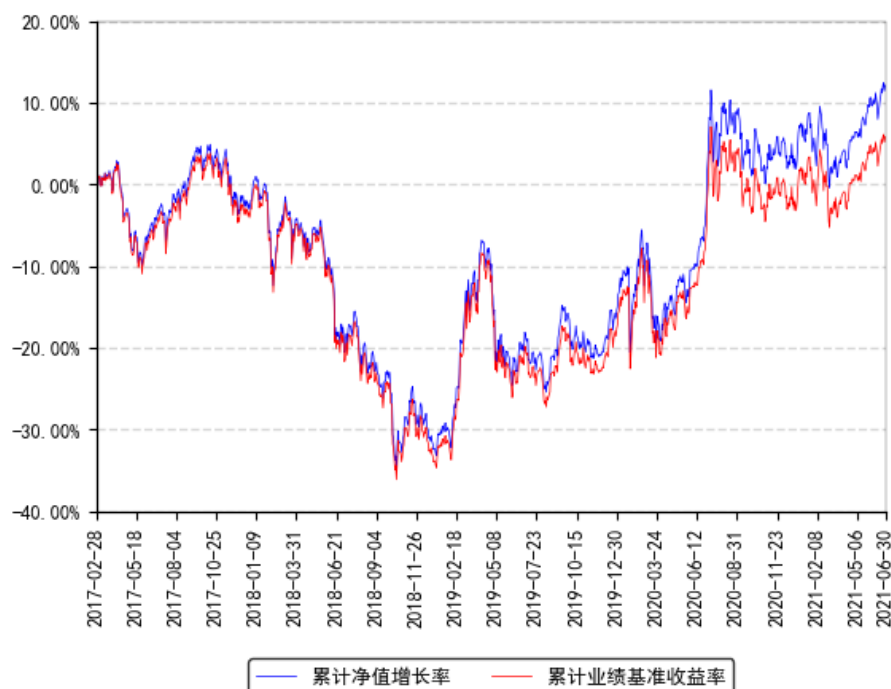
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	1.52%	0.71%	1.12%	0.69%	0.40%	0.02%
过去三个月	9.27%	0.65%	8.41%	0.65%	0.86%	0.00%
过去六个月	7.32%	0.95%	6.61%	0.94%	0.71%	0.01%
过去一年	18.47%	1.20%	15.35%	1.19%	3.12%	0.01%
过去三年	35.31%	1.41%	29.32%	1.40%	5.99%	0.01%
自基金合同 生效起至今	12.18%	1.32%	5.85%	1.31%	6.33%	0.01%

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

南方中证500ETF联接 (LOF) A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方中证500ETF联接 (LOF) C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金从 2017 年 2 月 23 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2017 年 2 月 28 日起存续。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019 年 7 月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙) 2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙) 2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙) 2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙) 2.20%。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

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

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理)期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗文杰	本基金 基金经 理	2013 年 4 月 22 日	-	16 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月 17 日至 2015 年 6 月 16 日，任南方策略基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月 30 日至 2019 年 4 月 18 日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018 年 2 月 8 日至 2020 年 3 月 27 日，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至 2020 年 3 月 27 日，任南方 H 股联接基金经理；2014 年 10 月 30 日至 2020 年 12 月 23 日，任 500 医药基金经理；2013 年 4 月 22 日至今，任南方 500、

					南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月 17 日至今，任南方 300、南方 300 联接基金经理；2015 年 2 月 16 日至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2017 年 7 月 21 日至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月 24 日至今，任南方房地产联接基金经理；2017 年 8 月 25 日至今，任南方房地产 ETF 基金经理；2018 年 4 月 3 日至今，任 MSCI 基金基金经理；2018 年 6 月 8 日至今，任 MSCI 联接基金经理；2020 年 7 月 24 日至今，兼任投资经理；2020 年 12 月 25 日至今，任南方策略基金经理；2021 年 3 月 12 日至今，任南方中证创新药产业 ETF 基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
罗文杰	公募基金	12	54,794,261,094.86	2013 年 4 月 22 日
	私募资产管理计划	8	3,072,317,026.41	2020 年 8 月 7 日
	其他组合	-	-	-
	合计	20	57,866,578,121.27	-

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，中证 500 指数涨 6.93%。期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

(1) 大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

(2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

(3) 报告期内，我们根据指数定期的成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.7871 元，报告期内，份额净值增长率为 7.54%，同期业绩基准增长率为 6.61%；本基金 C 份额净值为 1.7648 元，报告期内，份额净值增长率为 7.32%，同期业绩基准增长率为 6.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

4.6 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、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

本基金基金合同约定，由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。同一类别每一基金份额享有同等分配权；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多 6 次，每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循

深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，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真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.4.1	97,113,264.62	29,201,924.14
结算备付金		3,253,332.17	4,071,384.33
存出保证金		499,324.16	910,857.86
交易性金融资产	6.4.4.2	8,463,244,031.39	9,218,216,271.21
其中：股票投资		138,672,922.47	130,558,239.32
基金投资		7,982,116,006.62	8,623,537,634.99
债券投资		342,455,102.30	464,120,396.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		7,995,904.01	3,997,589.04
应收利息	6.4.4.5	6,679,359.96	7,269,403.32
应收股利		-	-
应收申购款		20,108,514.74	11,651,355.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		8,598,893,731.05	9,275,318,785.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		43,000,000.00	119,000,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		52,215,607.08	47,006,416.28

应付管理人报酬		208,726.23	216,783.85
应付托管费		41,745.27	43,356.75
应付销售服务费		175,751.03	343,949.32
应付交易费用	6.4.4.7	26,620.43	19,020.79
应交税费		0.01	79,011.98
应付利息		-	25,171.88
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	211,968.56	294,798.30
负债合计		95,880,418.61	167,028,509.15
所有者权益：			
实收基金	6.4.4.9	4,761,944,968.22	5,486,465,930.47
未分配利润	6.4.4.10	3,741,068,344.22	3,621,824,345.98
所有者权益合计		8,503,013,312.44	9,108,290,276.45
负债和所有者权益总计		8,598,893,731.05	9,275,318,785.60

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，南方中证 500ETF 联接 (LOF)A 份额净值 1.7871 元，基金份额总额 4,445,881,549.62 份；南方中证 500ETF 联接 (LOF)C 份额净值 1.7648 元，基金份额总额 316,063,418.60 份；总份额合计 4,761,944,968.22 份。

6.2 利润表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		653,367,204.41	1,404,808,004.16
1. 利息收入		5,018,374.75	7,589,442.86
其中：存款利息收入	6.4.4.11	1,258,795.34	3,555,328.71
债券利息收入		3,759,579.41	4,034,114.15
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产		-	-

收入			
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		408,074,315.58	297,652,585.17
其中：股票投资收益	6.4.4.12	19,696,350.59	45,624,181.03
基金投资收益	6.4.4.13	387,794,336.88	251,242,096.11
债券投资收益	6.4.4.14	-626,715.66	-226,992.17
资产支持证券投资 收益	6.4.4.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.4.16	-	-
衍生工具收益	6.4.4.17	-	-
股利收益	6.4.4.18	1,210,343.77	1,013,300.20
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.19	238,853,608.82	1,089,630,076.43
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.20	1,420,905.26	9,935,899.70
减：二、费用		4,648,268.10	10,142,453.32
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	1,264,203.98	1,627,440.73
2. 托管费	6.4.7.2.2	252,840.84	325,488.22
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	1,057,109.55	4,001,630.16
4. 交易费用	6.4.4.21	1,119,423.13	2,750,560.19
5. 利息支出		788,728.97	1,173,095.78
其中：卖出回购金融资产 支出		788,728.97	1,173,095.78
6. 税金及附加		0.59	0.30
7. 其他费用	6.4.4.22	165,961.04	264,237.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		648,718,936.31	1,394,665,550.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以		648,718,936.31	1,394,665,550.84

“—”号填列)			
---------	--	--	--

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,486,465,930.47	3,621,824,345.98	9,108,290,276.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	648,718,936.31	648,718,936.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“—”号填列）	-724,520,962.25	-529,474,938.07	-1,253,995,900.32
其中：1. 基金申购款	1,965,645,025.58	1,346,296,546.16	3,311,941,571.74
2. 基金赎回款	-2,690,165,987.83	-1,875,771,484.23	-4,565,937,472.06
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“—”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4,761,944,968.22	3,741,068,344.22	8,503,013,312.44
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	8,486,018,807.14	2,927,121,787.50	11,413,140,594.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,394,665,550.84	1,394,665,550.84

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“—”号填列）	-1,280,184,528.84	-717,236,784.67	-1,997,421,313.51
其中：1. 基金申购款	4,720,081,827.76	1,642,594,407.33	6,362,676,235.09
2. 基金赎回款	-6,000,266,356.60	-2,359,831,192.00	-8,360,097,548.60
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“—”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	7,205,834,278.30	3,604,550,553.67	10,810,384,831.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2.1 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.3 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.3.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.3.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.3.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.4 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	97,113,264.62
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	97,113,264.62

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	126,829,369.57	138,672,922.47	11,843,552.90
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	343,045,913.75	342,455,102.30
	银行间市场	-	-
	合计	343,045,913.75	342,455,102.30
资产支持证券	-	-	-
基金	6,054,553,627.06	7,982,116,006.62	1,927,562,379.56
其他	-	-	-
合计	6,524,428,910.38	8,463,244,031.39	1,938,815,121.01

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

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.4.4 买入返售金融资产

6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	38,227.81
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,317.60
应收债券利息	6,639,612.32
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	202.23
合计	6,679,359.96

6.4.4.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	26,620.43
银行间市场应付交易费用	-
合计	26,620.43

6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	63,201.04
应付证券出借违约金	-
应退替代款	-
预提费用	148,767.52
应付指数使用费	-
可退替代款	-
其他	-
合计	211,968.56

注:1. 可退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时, 替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

2. 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。

6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

南方中证 500ETF 联接(LOF)A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,953,164,477.46	4,953,164,477.46
本期申购	1,773,691,802.74	1,773,691,802.74
本期赎回（以“-”号填列）	-2,280,974,730.58	-2,280,974,730.58
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	4,445,881,549.62	4,445,881,549.62

南方中证 500ETF 联接(LOF)C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	533,301,453.01	533,301,453.01
本期申购	191,953,222.84	191,953,222.84
本期赎回（以“-”号填列）	-409,191,257.25	-409,191,257.25
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	316,063,418.60	316,063,418.60

注：

1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

南方中证 500ETF 联接(LOF)A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,939,143,547.98	-1,660,983,435.05	3,278,160,112.93
本期利润	377,761,606.24	231,414,264.97	609,175,871.21
本期基金份额交易产生的变动数	-516,094,390.29	128,086,242.90	-388,008,147.39
其中：基金申购款	1,869,712,701.24	-653,316,788.55	1,216,395,912.69
基金赎回款	-2,385,807,091.53	781,403,031.45	-1,604,404,060.08
本期已分配利润	-	-	-

本期末	4,800,810,763.93	-1,301,482,927.18	3,499,327,836.75
-----	------------------	-------------------	------------------

南方中证 500ETF 联接(LOF)C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	523,578,800.33	-179,914,567.28	343,664,233.05
本期利润	32,103,721.25	7,439,343.85	39,543,065.10
本期基金份额交易产生的变动数	-220,592,013.51	79,125,222.83	-141,466,790.68
其中：基金申购款	199,765,895.44	-69,865,261.97	129,900,633.47
基金赎回款	-420,357,908.95	148,990,484.80	-271,367,424.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	335,090,508.07	-93,350,000.60	241,740,507.47

6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,194,062.72
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	37,326.72
其他	27,405.90
合计	1,258,795.34

6.4.4.12 股票投资收益

6.4.4.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	19,697,808.08
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-1,457.49
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	19,696,350.59

6.4.4.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	874,103,513.68
减：卖出股票成本总额	854,405,705.60
买卖股票差价收入	19,697,808.08

6.4.4.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

6.4.4.12.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	173,388,480.00
减：现金支付申购款总额	91,518,533.61
减：申购股票成本总额	81,871,403.88
申购差价收入	-1,457.49

6.4.4.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

6.4.4.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	1,851,861,920.32
减：卖出/赎回基金成本总额	1,464,067,583.44
基金投资收益	387,794,336.88

6.4.4.14 债券投资收益**6.4.4.14.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-626,715.66
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	-626,715.66

6.4.4.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	260,708,647.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	256,387,683.20
减：应收利息总额	4,947,679.46
买卖债券差价收入	-626,715.66

6.4.4.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.4.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.4.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.4.16 贵金属投资收益

6.4.4.16.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.4.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.4.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.4.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.4.17 衍生工具收益

6.4.4.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.4.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.4.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,210,343.77
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	1,210,343.77

6.4.4.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	238,853,608.82
——股票投资	4,637,505.46
——债券投资	589,796.20
——资产支持证券投资	-

——基金投资	233,626,307.16
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	238,853,608.82

6.4.4.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,420,271.19
基金转换费收入	634.07
合计	1,420,905.26

注：

1 本基金的 A 类基金份额的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产；C 类基金份额的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入基金资产。

2 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中，A 类基金份额场内部分的赎回费率为 0.5%，场外部分的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产；C 类基金份额的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入转出基金的基金资产。

6.4.4.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,074,989.38
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	44,433.75
其中：申购费	-
赎回费	-
场内交易费	18,635.48
其他	25,798.27
合计	1,119,423.13

6.4.4.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	59,507.37

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	17,193.52
上市费	29,752.78
合计	165,961.04

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 或有事项

无。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.6 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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
中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(“目标 ETF”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	36,857,848.86	3.90%	388,630,833.64	12.98%

6.4.7.1.2 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.7.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.7.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	3,686.06	3.90%	1,520.89	5.71%
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	38,866.27	12.99%	11,866.12	16.47%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,264,203.98	1,627,440.73
其中：支付销售机构的客户维护费	5,167,083.08	2,846,249.32

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	252,840.84	325,488.22

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

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

6.4.7.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方中证 500ETF 联接 (LOF)A	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C	合计
华泰证券	-	5,398.50	5,398.50
南方基金	-	603,433.47	603,433.47
合计	-	608,831.97	608,831.97
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方中证 500ETF 联接 (LOF)A	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C	合计
华泰证券	-	4,723.68	4,723.68
南方基金	-	3,387,980.12	3,387,980.12
合计	-	3,392,703.80	3,392,703.80

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

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.7.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

务的情况

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

6.4.7.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	南方中证 500ETF 联接 (LOF)A	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C
基金合同生效日（2009 年 9 月 25 日）持有的基金份额	49,996,750.00	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

项目	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	南方中证 500ETF 联接 (LOF)A	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C
基金合同生效日（2009 年 9 月 25 日）持有的基金份额	49,996,750.00	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

6.4.7.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.7.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
-------	------------------------------------	---

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	97,113,264.62	1,194,062.72	162,533,826.88	3,434,248.47

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.7.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券	605208	永茂泰	网下申购	801	10,733.40
华泰联合证券	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合证券	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合证券	688083	中望软件	网下申购	1,837	276,468.50
华泰联合证券	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合证券	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
华泰联合证券	688260	昀冢科技	网下申购	2,990	28,793.70
华泰联合证券	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合证券	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合证券	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合证券	688633	星球石墨	网下申购	1,558	52,379.96
华泰联合证券	300975	商络电子	网下申购	4,917	26,945.16
兴业证券	605086	龙高股份	网下申购	443	5,696.98
兴业证券	605298	必得科技	网下申购	391	6,252.09
兴业证券	688195	腾景科技	网下申购	2,693	36,624.80
兴业证券	688597	煜邦电力	网下申购	3,907	22,973.16
兴业证券	688639	华恒生物	网下申购	2,302	53,314.32
兴业证券	300941	创识科技	网下申购	3,989	85,005.59
兴业证券	300979	华利集团	网下申购	9,246	307,152.12
兴业证券股	-	-	-	-	-

份有限公司					
-------	--	--	--	--	--

上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
兴业证券股份有限公司	000750	国海证券	网上申购	32,310	105,007.50

6.4.7.8 其他关联交易事项的说明

6.4.7.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2021 年 06 月 30 日，本基金持有基金管理人南方基金所管理的公开募集证券投资基金，成本总额为人民币 6,054,553,627.06 元，估值总额为人民币 7,982,116,006.62 元，占本基金基金资产净值的比例为 93.87%（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有基金管理人南方基金所管理的公开募集证券投资基金，成本总额为人民币 6,929,601,562.59 元，估值总额为人民币 8,623,537,634.99 元，占本基金基金资产净值的比例为 94.68%）。

6.4.8 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	创业板新股锁定期	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	创业板新股锁定期	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	创业板新股锁定期	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	创业板新股锁定期	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	创业板新股锁定期	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-

		日	日	定期						
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	创业板 新股锁 定期	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	创业板 新股锁 定期	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼 卡 龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	创业板 新股锁 定期	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021 年 6 月 4 日	2021 年 8 月 25 日	锁定期 转增	-	27.42	108	-	2,961.36	-
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	创业板 新股锁 定期	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	创业板 新股锁 定期	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	创业板 新股锁 定期	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	创业板 新股锁 定期	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	创业板 新股锁 定期	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	创业板 新股锁 定期	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	创业板 新股锁 定期	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	创业板 新股锁 定期	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	创业板 新股锁 定期	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	创业板 新股锁 定期	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300992	泰福泵业	2021 年	2021 年	创业板	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-

		5 月 17 日	11 月 25 日	新股锁定期						
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	创业板新股锁定期	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	创业板新股锁定期	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	创业板新股锁定期	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	创业板新股锁定期	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	创业板新股锁定期	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	创业板新股锁定期	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	创业板新股锁定期	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	创业板新股锁定期	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	创业板新股锁定期	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	创业板新股锁定期	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	创业板新股锁定期	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	创业板新股锁定期	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	创业板新股锁定期	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-

301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
605162	新 中 港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未 上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未 上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未 上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688092	爱科科技	2021 年 3 月 12 日	2021 年 9 月 22 日	科创板 新股锁 定期	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未 上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新股未 上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688367	工大高科	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 28 日	科创板 新股锁 定期	11.53	17.94	1,717	19,797.01	30,802.98	-
688597	煜邦电力	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	科创板 新股锁 定期	5.88	10.16	3,907	22,973.16	39,695.12	-
688611	杭州柯林	2021 年 4 月 1 日	2021 年 10 月 12 日	科创板 新股锁 定期	33.44	42.34	1,400	46,816.00	59,276.00	-
688636	智 明 达	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 8 日	科创板 新股锁 定期	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96	-
688685	迈 信 林	2021 年 4 月 30 日	2021 年 11 月 15 日	科创板 新股锁 定期	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	-
688696	极米科技	2021 年 2 月 23 日	2021 年 9 月 3 日	科创板 新股锁 定期	133.7 3	780.2 4	1,252	167,429.96	976,860.48	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 7 月 2 日	创业板 新股锁 定期	24.60	163.0 0	610	15,006.00	99,430.00	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认	可流通	流通受	认购	期末	数量(单)	期末成本	期末估值	备注
------	------	-----	-----	-----	----	----	-------	------	------	----

		购日	日	限类型	价格	估值 单价	位：张)	总额	总额	
113051	节能转债	2021 年 6 月 22 日	2021 年 7 月 22 日	配债未 上市	100.0 0	100.0 0	310	31,000.00	31,000.00	-
113051	节能转债	2021 年 6 月 24 日	2021 年 7 月 22 日	新债未 上市	100.0 0	100.0 0	10	1,000.00	1,000.00	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、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。

3、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。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.9.2 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
600460	士兰微	2021 年 6 月 30 日	重大事项停牌	56.35	2021 年 7 月 1 日	59.49	20,400	726,937.44	1,149,540.00	-
600811	东方集团	2021 年 6 月 30 日	重大事项停牌	3.05	2021 年 7 月 14 日	3.36	76,586	246,660.18	233,587.30	-

本基金截至 2021 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 43,000,000.00 元，截至 2021 年 7 月 1 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.9.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.10 金融工具风险及管理**6.4.10.1 风险管理政策和组织架构**

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金紧密跟踪标的指数，具有和标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资的金融工具主要包括基金投资和股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益

之间取得最佳的平衡以实现“紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”的风险收益目标。

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

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

6.4.10.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.10.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来

自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

6.4.10.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

6.4.10.4 市场风险

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

6.4.10.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	97,113,264.62	-	-	-	97,113,264.62
结算备付金	3,253,332.17	-	-	-	3,253,332.17
存出保证金	499,324.16	-	-	-	499,324.16
交易性金融资产	342,423,102.30	-	32,000.00	8,120,788,929.09	8,463,244,031.39
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	6,679,359.96	6,679,359.96
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	653,670.10	-	-	19,454,844.64	20,108,514.74
应收证券清算款	-	-	-	7,995,904.01	7,995,904.01
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	443,942,693.35	-	32,000.00	8,154,919,037.70	8,598,893,731.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	52,215,607.08	52,215,607.08
应付管理人报酬	-	-	-	208,726.23	208,726.23
应付托管费	-	-	-	41,745.27	41,745.27
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	43,000,000.00	-	-	-	43,000,000.00

应付销售服务费	-	-	-	175,751.03	175,751.03
应付交易费用	-	-	-	26,620.43	26,620.43
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.01	0.01
其他负债	-	-	-	211,968.56	211,968.56
负债总计	43,000,000.00	-	-	52,880,418.61	95,880,418.61
利率敏感度缺口	400,942,693.35	-	32,000.00	8,102,038,619.09	8,503,013,312.44
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	29,201,924.14	-	-	-	29,201,924.14
结算备付金	4,071,384.33	-	-	-	4,071,384.33
存出保证金	910,857.86	-	-	-	910,857.86
交易性金融资产	462,419,496.90	-	1,700,900.00	8,754,095,874.31	9,218,216,271.21
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	7,269,403.32	7,269,403.32
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	432,737.65	-	-	11,218,618.05	11,651,355.70
应收证券清算款	-	-	-	3,997,589.04	3,997,589.04
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	497,036,400.88	-	1,700,900.00	8,776,581,484.72	9,275,318,785.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	47,006,416.28	47,006,416.28
应付管理人报酬	-	-	-	216,783.85	216,783.85
应付托管费	-	-	-	43,356.75	43,356.75
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	119,000,000.00	-	-	-	119,000,000.00
应付销售服	-	-	-	343,949.32	343,949.32

务费					
应付交易费用	-	-	-	19,020.79	19,020.79
应付利息	-	-	-	25,171.88	25,171.88
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	79,011.98	79,011.98
其他负债	-	-	-	294,798.30	294,798.30
负债总计	119,000,000.00	-	-	48,028,509.15	167,028,509.15
利率敏感度缺口	378,036,400.88	-	1,700,900.00	8,728,552.975.57	9,108,290.276.45

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

6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	-234,807.97	-346,943.99
	2.市场利率平行下降 25 个基点	235,736.64	348,548.84

6.4.10.4.2 外汇风险

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

6.4.10.4.3 其他价格风险

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

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。本基

金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	138,672,922.47	1.63	130,558,239.32	1.43
交易性金融资产-基金投资	7,982,116,006.62	93.87	8,623,537,634.99	94.68
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	8,120,788,929.09	95.50	8,754,095,874.31	96.11

注：交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标 ETF 份额。

6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	407,503,662.39	434,732,823.29
	2.组合自身基准下降 5%	-407,503,662.39	-434,732,823.29

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	138,672,922.47	1.61
	其中：股票	138,672,922.47	1.61
2	基金投资	7,982,116,006.62	92.83
3	固定收益投资	342,455,102.30	3.98

	其中：债券	342,455,102.30	3.98
	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	100,366,596.79	1.17
8	其他资产	35,283,102.87	0.41
9	合计	8,598,893,731.05	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,031,172.00	0.01
B	采矿业	5,152,436.71	0.06
C	制造业	90,363,822.83	1.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,223,793.95	0.04
E	建筑业	2,464,293.38	0.03
F	批发和零售业	6,322,734.61	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	2,825,118.85	0.03
H	住宿和餐饮业	829,593.89	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,824,419.31	0.10
J	金融业	6,536,958.39	0.08
K	房地产业	4,599,093.40	0.05
L	租赁和商务服务业	1,833,308.62	0.02
M	科学研究和技术服务业	235,444.05	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	1,396,937.38	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	67,133.20	0.00
Q	卫生和社会工作	512,339.10	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,410,129.94	0.02
S	综合	1,044,192.86	0.01
	合计	138,672,922.47	1.63

7.2.2 期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值 （元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	600392	盛和资源	147,610	2,562,509.60	0.03
2	002709	天赐材料	15,266	1,627,050.28	0.02
3	600089	特变电工	96,700	1,242,595.00	0.01
4	603737	三棵树	7,060	1,242,560.00	0.01
5	688099	晶晨股份	10,567	1,185,617.40	0.01
6	603486	科沃斯	5,181	1,181,682.48	0.01
7	600460	士兰微	20,400	1,149,540.00	0.01
8	688002	睿创微纳	10,200	1,018,266.00	0.01
9	601233	桐昆股份	40,847	984,004.23	0.01
10	600885	宏发股份	15,602	978,245.40	0.01
11	688696	极米科技	1,252	976,860.48	0.01
12	000009	中国宝安	47,169	861,777.63	0.01
13	300316	晶盛机电	16,800	848,400.00	0.01
14	600563	法拉电子	5,123	811,278.28	0.01
15	000718	苏宁环球	96,900	803,301.00	0.01
16	600862	中航高科	25,300	778,734.00	0.01
17	002030	达安基因	34,845	740,107.80	0.01
18	300285	国瓷材料	14,800	721,500.00	0.01
19	002028	思源电气	23,218	714,882.22	0.01
20	000830	鲁西化工	38,110	713,800.30	0.01
21	600884	杉杉股份	30,600	713,592.00	0.01
22	600895	张江高科	38,800	708,876.00	0.01
23	002390	信邦制药	67,500	707,400.00	0.01
24	603589	口子窖	10,200	690,438.00	0.01
25	300207	欣旺达	21,020	684,411.20	0.01
26	002152	广电运通	52,400	682,772.00	0.01
27	002340	格林美	72,894	681,558.90	0.01
28	002074	国轩高科	15,400	670,824.00	0.01
29	600219	南山铝业	183,600	660,960.00	0.01
30	000039	中集集团	36,300	659,934.00	0.01
31	600779	水井坊	5,133	648,554.55	0.01
32	600739	辽宁成大	30,401	632,644.81	0.01
33	002185	华天科技	40,700	626,373.00	0.01
34	600315	上海家化	10,205	613,728.70	0.01
35	002092	中泰化学	59,700	613,119.00	0.01
36	601168	西部矿业	50,800	606,044.00	0.01
37	601099	太平洋	173,400	587,826.00	0.01
38	600754	锦江酒店	10,271	584,933.45	0.01
39	000960	锡业股份	36,000	577,080.00	0.01

40	600486	扬农化工	5,100	570,027.00	0.01
41	002572	索 菲 亚	23,300	563,860.00	0.01
42	600171	上海贝岭	18,200	553,826.00	0.01
43	000959	首钢股份	98,100	551,322.00	0.01
44	002648	卫星石化	13,860	543,173.40	0.01
45	600201	生物股份	30,610	534,144.50	0.01
46	600733	北汽蓝谷	39,500	532,460.00	0.01
47	600704	物产中大	66,700	524,929.00	0.01
48	000807	云铝股份	44,100	524,790.00	0.01
49	600699	均胜电子	20,466	522,292.32	0.01
50	300009	安科生物	34,860	519,414.00	0.01
51	300244	迪安诊断	13,377	512,339.10	0.01
52	002603	以岭药业	17,400	507,384.00	0.01
53	000738	航发控制	24,300	506,169.00	0.01
54	002353	杰瑞股份	11,100	496,170.00	0.01
55	002444	巨星科技	14,418	491,365.44	0.01
56	002690	美亚光电	8,800	490,688.00	0.01
57	000983	山西焦煤	59,000	490,290.00	0.01
58	300002	神州泰岳	100,900	489,365.00	0.01
59	300376	易 事 特	59,600	479,184.00	0.01
60	601997	贵阳银行	66,300	474,708.00	0.01
61	300357	我武生物	7,400	474,488.00	0.01
62	000519	中兵红箭	44,200	473,824.00	0.01
63	000547	航天发展	24,761	467,240.07	0.01
64	000825	太钢不锈	62,000	464,380.00	0.01
65	000636	风华高科	14,800	447,256.00	0.01
66	600418	江淮汽车	35,768	444,596.24	0.01
67	601128	常熟银行	71,424	442,828.80	0.01
68	002249	大洋电机	83,300	437,325.00	0.01
69	603893	瑞 芯 微	3,100	432,326.00	0.01
70	002138	顺络电子	11,100	430,347.00	0.01
71	600867	通化东宝	35,700	426,258.00	0.01
72	600549	厦门钨业	20,440	425,765.20	0.01
73	002223	鱼跃医疗	11,116	423,853.08	0.00
74	600879	航天电子	56,120	422,022.40	0.00
75	600380	健 康 元	30,613	420,316.49	0.00
76	002507	涪陵榨菜	11,100	418,026.00	0.00
77	600516	方大炭素	56,100	417,384.00	0.00
78	002385	大 北 农	60,900	414,120.00	0.00
79	002250	联化科技	14,827	413,673.30	0.00
80	600827	百联股份	20,483	412,732.45	0.00
81	000581	威孚高科	19,800	412,434.00	0.00
82	000402	金 融 街	61,000	411,750.00	0.00

83	002382	蓝帆医疗	19,700	410,745.00	0.00
84	002183	怡 亚 通	71,500	409,695.00	0.00
85	000012	南 玻 A	39,865	408,217.60	0.00
86	600166	福田汽车	117,300	404,685.00	0.00
87	000060	中金岭南	88,000	397,760.00	0.00
88	601005	重庆钢铁	148,700	397,029.00	0.00
89	002002	鸿达兴业	101,000	396,930.00	0.00
90	002505	鹏都农牧	177,000	396,480.00	0.00
91	600316	洪都航空	10,285	395,766.80	0.00
92	002078	太阳纸业	29,600	395,160.00	0.00
93	002075	沙钢股份	36,020	392,978.20	0.00
94	603260	合盛硅业	5,100	392,241.00	0.00
95	300088	长信科技	46,900	387,394.00	0.00
96	000630	铜陵有色	141,900	385,968.00	0.00
97	601689	拓普集团	10,236	383,133.48	0.00
98	601866	中远海发	102,000	382,500.00	0.00
99	600909	华安证券	68,588	382,035.16	0.00
100	600068	葛 洲 坝	51,000	381,990.00	0.00
101	002372	伟星新材	18,380	379,914.60	0.00
102	600642	申能股份	61,299	376,375.86	0.00
103	600535	天 士 力	25,340	375,285.40	0.00
104	000513	丽珠集团	7,452	372,749.04	0.00
105	000027	深圳能源	40,620	372,485.40	0.00
106	600153	建发股份	45,900	371,790.00	0.00
107	600415	小商品城	71,400	367,710.00	0.00
108	000778	新兴铸管	98,500	366,420.00	0.00
109	300474	景 嘉 微	3,700	362,304.00	0.00
110	002936	郑州银行	98,590	361,825.30	0.00
111	601699	潞安环能	30,600	361,386.00	0.00
112	002797	第一创业	50,500	360,570.00	0.00
113	600307	酒钢宏兴	155,200	360,064.00	0.00
114	000062	深圳华强	21,148	357,612.68	0.00
115	601127	小康股份	5,357	357,151.19	0.00
116	000869	张 裕 A	9,600	356,544.00	0.00
117	000930	中粮科技	39,500	355,895.00	0.00
118	000988	华工科技	14,800	348,096.00	0.00
119	600765	中航重机	15,361	347,926.65	0.00
120	600529	山东药玻	10,200	346,290.00	0.00
121	300072	三聚环保	60,200	345,548.00	0.00
122	600060	海信视像	20,400	344,760.00	0.00
123	603858	步长制药	15,300	344,097.00	0.00
124	002156	通富微电	14,200	341,368.00	0.00
125	000967	盈峰环境	49,600	340,752.00	0.00

126	002375	亚厦股份	43,000	340,560.00	0.00
127	000717	韶钢松山	74,100	340,119.00	0.00
128	600256	广汇能源	102,000	339,660.00	0.00
129	002465	海格通信	35,800	338,668.00	0.00
130	002242	九阳股份	10,400	337,896.00	0.00
131	600511	国药股份	10,218	337,807.08	0.00
132	600008	首创环保	112,220	337,782.20	0.00
133	600372	中航电子	20,400	337,620.00	0.00
134	600177	雅 戈 尔	51,200	337,408.00	0.00
135	300001	特 锐 德	11,188	336,870.68	0.00
136	600875	东方电气	30,620	335,901.40	0.00
137	601615	明阳智能	20,600	333,514.00	0.00
138	000878	云南铜业	25,900	332,297.00	0.00
139	002013	中航机电	32,700	329,289.00	0.00
140	600155	华创阳安	30,600	327,420.00	0.00
141	002273	水晶光电	22,288	327,410.72	0.00
142	000739	普洛药业	11,100	326,340.00	0.00
143	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.00
144	300182	捷成股份	65,200	325,348.00	0.00
145	600667	太极实业	35,700	324,870.00	0.00
146	002745	木 林 森	24,241	324,829.40	0.00
147	300257	开山股份	22,500	323,325.00	0.00
148	600988	赤峰黄金	21,500	322,285.00	0.00
149	000932	华菱钢铁	48,820	322,212.00	0.00
150	603866	桃李面包	10,308	321,609.60	0.00
151	000690	宝新能源	62,200	317,842.00	0.00
152	002867	周 大 生	16,050	317,308.50	0.00
153	002080	中材科技	12,100	316,657.00	0.00
154	002212	天 融 信	16,000	316,320.00	0.00
155	600039	四川路桥	50,440	316,258.80	0.00
156	600160	巨化股份	35,700	315,588.00	0.00
157	002191	劲嘉股份	29,600	314,944.00	0.00
158	002203	海亮股份	29,600	314,944.00	0.00
159	600188	兖州煤业	20,400	313,344.00	0.00
160	600536	中国软件	5,500	313,115.00	0.00
161	600066	宇通客车	25,000	312,250.00	0.00
162	002625	光启技术	15,000	312,150.00	0.00
163	603638	艾迪精密	7,260	311,236.20	0.00
164	300482	万孚生物	4,810	311,158.90	0.00
165	002557	洽洽食品	7,200	310,320.00	0.00
166	600409	三友化工	30,678	310,154.58	0.00
167	002926	华西证券	32,200	310,086.00	0.00
168	600170	上海建工	112,200	309,672.00	0.00

169	002056	横店东磁	23,800	309,400.00	0.00
170	000750	国海证券	72,810	308,714.40	0.00
171	002387	维 信 诺	29,500	307,685.00	0.00
172	000158	常山北明	26,760	307,472.40	0.00
173	002839	张家港行	56,500	307,360.00	0.00
174	002511	中顺洁柔	11,100	305,805.00	0.00
175	600598	北 大 荒	20,400	305,184.00	0.00
176	002670	国盛金控	26,763	304,830.57	0.00
177	002131	利欧股份	128,377	300,402.18	0.00
178	000970	中科三环	31,200	297,960.00	0.00
179	601717	郑 煤 机	25,592	297,634.96	0.00
180	600859	王 府 井	10,290	297,175.20	0.00
181	002408	齐翔腾达	23,920	297,086.40	0.00
182	000998	隆平高科	18,500	296,740.00	0.00
183	000488	晨鸣纸业	35,919	292,380.66	0.00
184	600755	厦门国贸	35,548	291,849.08	0.00
185	000729	燕京啤酒	40,300	291,772.00	0.00
186	300618	寒锐钴业	3,700	291,708.00	0.00
187	300630	普利制药	5,563	291,501.20	0.00
188	600141	兴发集团	15,384	289,680.72	0.00
189	600528	中铁工业	35,760	289,656.00	0.00
190	002416	爱 施 德	28,770	288,563.10	0.00
191	000975	银泰黄金	30,324	288,381.24	0.00
192	601992	金隅集团	107,100	288,099.00	0.00
193	600497	驰宏锌锗	66,700	287,477.00	0.00
194	600648	外 高 桥	19,400	286,732.00	0.00
195	000623	吉林敖东	18,500	286,565.00	0.00
196	603077	和邦生物	137,520	286,041.60	0.00
197	000501	鄂武商 A	24,330	284,661.00	0.00
198	000021	深 科 技	14,800	283,272.00	0.00
199	600567	山鹰国际	81,600	281,520.00	0.00
200	600839	四川长虹	96,736	281,501.76	0.00
201	600500	中化国际	35,781	281,238.66	0.00
202	300070	碧 水 源	38,200	279,242.00	0.00
203	002004	华邦健康	44,900	278,829.00	0.00
204	300115	长盈精密	13,420	276,452.00	0.00
205	600038	中直股份	5,196	274,037.04	0.00
206	600282	南钢股份	76,500	272,340.00	0.00
207	600580	卧龙电驱	20,411	271,466.30	0.00
208	603883	老 百 姓	5,133	270,406.44	0.00
209	600801	华新水泥	15,380	270,226.60	0.00
210	002434	万 里 扬	33,200	269,252.00	0.00
211	002085	万丰奥威	47,800	267,680.00	0.00

212	000937	冀中能源	67,700	266,061.00	0.00
213	600639	浦东金桥	19,485	265,970.25	0.00
214	002110	三钢闽光	39,400	265,556.00	0.00
215	600728	佳都科技	35,700	264,537.00	0.00
216	002174	游族网络	15,400	264,418.00	0.00
217	300024	机 器 人	24,700	263,549.00	0.00
218	603000	人 民 网	15,300	263,007.00	0.00
219	600808	马钢股份	61,201	262,552.29	0.00
220	000050	深天马 A	18,500	262,330.00	0.00
221	300296	利 亚 德	33,300	260,406.00	0.00
222	002233	塔牌集团	25,100	258,028.00	0.00
223	600398	海澜之家	35,500	257,020.00	0.00
224	600737	中粮糖业	25,517	255,425.17	0.00
225	002019	亿帆医药	14,800	255,300.00	0.00
226	000078	海王生物	78,107	254,628.82	0.00
227	000883	湖北能源	55,000	252,450.00	0.00
228	300026	红日药业	59,200	251,600.00	0.00
229	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.00
230	603650	彤程新材	5,195	249,879.50	0.00
231	002815	崇达技术	19,900	248,352.00	0.00
232	002373	千方科技	14,800	247,160.00	0.00
233	600216	浙江医药	15,394	246,457.94	0.00
234	000997	新 大 陆	14,840	246,195.60	0.00
235	000528	柳 工	30,011	246,090.20	0.00
236	600022	山东钢铁	142,660	245,375.20	0.00
237	600037	歌华有线	25,500	245,055.00	0.00
238	002925	盈趣科技	6,290	244,743.90	0.00
239	600258	首旅酒店	10,254	244,660.44	0.00
240	002294	信 立 泰	7,400	243,460.00	0.00
241	002221	东华能源	22,200	243,090.00	0.00
242	600820	隧道股份	45,900	242,811.00	0.00
243	002831	裕同科技	8,166	242,448.54	0.00
244	300418	昆仑万维	14,800	242,424.00	0.00
245	601106	中国一重	71,400	242,046.00	0.00
246	000598	兴蓉环境	46,300	241,223.00	0.00
247	600325	华发股份	35,709	240,678.66	0.00
248	000887	中鼎股份	19,900	240,392.00	0.00
249	000877	天山股份	18,400	239,752.00	0.00
250	000061	农 产 品	43,400	239,568.00	0.00
251	300212	易 华 录	8,800	236,808.00	0.00
252	600410	华胜天成	30,400	235,904.00	0.00
253	601456	国联证券	15,300	235,620.00	0.00
254	600645	中源协和	10,259	235,444.05	0.00

255	600970	中材国际	25,554	234,330.18	0.00
256	603568	伟明环保	10,246	233,916.18	0.00
257	603885	吉祥航空	15,326	233,874.76	0.00
258	600811	东方集团	76,586	233,587.30	0.00
259	600881	亚泰集团	81,663	232,739.55	0.00
260	601118	海南橡胶	45,700	232,613.00	0.00
261	300133	华策影视	39,100	231,472.00	0.00
262	000089	深圳机场	29,600	229,992.00	0.00
263	000401	冀东水泥	18,531	228,857.85	0.00
264	600167	联美控股	25,550	228,161.50	0.00
265	600782	新钢股份	40,800	227,664.00	0.00
266	600348	华阳股份	30,600	227,052.00	0.00
267	601880	辽港股份	132,660	226,848.60	0.00
268	600260	凯乐科技	25,540	226,795.20	0.00
269	603198	迎驾贡酒	5,100	225,930.00	0.00
270	002266	浙富控股	44,900	224,051.00	0.00
271	300058	蓝色光标	37,000	223,850.00	0.00
272	600597	光明乳业	15,382	221,654.62	0.00
273	002195	二三四五	108,858	220,981.74	0.00
274	600446	金证股份	15,300	220,932.00	0.00
275	002368	太极股份	10,986	220,379.16	0.00
276	300315	掌趣科技	51,800	220,150.00	0.00
277	600026	中远海能	35,700	219,912.00	0.00
278	603927	中科软	5,100	219,045.00	0.00
279	000400	许继电气	17,300	219,018.00	0.00
280	000686	东北证券	25,900	218,855.00	0.00
281	002268	卫士通	11,194	218,059.12	0.00
282	300017	网宿科技	37,000	216,450.00	0.00
283	300168	万达信息	14,800	216,080.00	0.00
284	002399	海普瑞	13,500	215,055.00	0.00
285	002081	金螳螂	27,100	214,632.00	0.00
286	002701	奥瑞金	41,700	214,338.00	0.00
287	300271	华宇软件	11,100	213,675.00	0.00
288	601179	中国西电	51,000	210,120.00	0.00
289	002506	协鑫集成	60,000	208,800.00	0.00
290	000898	鞍钢股份	46,900	208,705.00	0.00
291	600908	无锡银行	35,700	207,060.00	0.00
292	600967	内蒙一机	20,432	206,771.84	0.00
293	000559	万向钱潮	38,900	206,559.00	0.00
294	601598	中国外运	40,800	206,040.00	0.00
295	600572	康恩贝	45,900	203,796.00	0.00
296	002419	天虹股份	31,000	203,360.00	0.00
297	002429	兆驰股份	33,300	202,131.00	0.00

298	000553	安道麦 A	21,800	202,086.00	0.00
299	600435	北方导航	25,398	201,660.12	0.00
300	600718	东软集团	20,482	200,313.96	0.00
301	000999	华润三九	7,475	199,956.25	0.00
302	002500	山西证券	29,714	199,380.94	0.00
303	300113	顺网科技	15,400	199,276.00	0.00
304	600120	浙江东方	46,484	198,951.52	0.00
305	600707	彩虹股份	21,000	197,610.00	0.00
306	002595	豪迈科技	7,400	197,580.00	0.00
307	002653	海思科	9,165	197,230.80	0.00
308	601016	节能风电	52,013	194,528.62	0.00
309	002048	宁波华翔	9,900	193,050.00	0.00
310	000090	天健集团	34,756	192,200.68	0.00
311	603712	七一二	5,300	191,330.00	0.00
312	002155	湖南黄金	24,600	190,650.00	0.00
313	002010	传化智联	24,700	190,437.00	0.00
314	600064	南京高科	20,494	190,389.26	0.00
315	000028	国药一致	5,011	189,616.24	0.00
316	002038	双鹭药业	17,825	187,697.25	0.00
317	600985	淮北矿业	15,344	187,350.24	0.00
318	000537	广宇发展	35,800	187,234.00	0.00
319	600056	中国医药	15,368	186,721.20	0.00
320	601975	招商南油	86,700	185,538.00	0.00
321	000758	中色股份	39,000	185,250.00	0.00
322	601000	唐山港	76,519	184,410.79	0.00
323	600126	杭钢股份	35,910	184,218.30	0.00
324	300166	东方国信	14,899	184,151.64	0.00
325	601333	广深铁路	86,700	183,804.00	0.00
326	600195	中牧股份	15,355	183,645.80	0.00
327	601200	上海环境	15,338	183,595.86	0.00
328	600062	华润双鹤	15,357	182,901.87	0.00
329	600673	东阳光	40,627	182,415.23	0.00
330	000685	中山公用	22,340	182,294.40	0.00
331	002281	光迅科技	7,400	182,040.00	0.00
332	000629	攀钢钒钛	79,200	181,368.00	0.00
333	002128	露天煤业	17,300	180,093.00	0.00
334	601098	中南传媒	20,414	180,051.48	0.00
335	002563	森马服饰	14,800	176,860.00	0.00
336	600021	上海电力	25,398	175,500.18	0.00
337	600259	广晟有色	5,183	175,237.23	0.00
338	600158	中体产业	15,300	174,573.00	0.00
339	600388	龙净环保	20,400	173,808.00	0.00
340	600507	方大特钢	25,585	173,466.30	0.00

341	000681	视觉中国	13,400	173,262.00	0.00
342	600804	鹏 博 士	35,700	172,788.00	0.00
343	601608	中信重工	45,900	171,666.00	0.00
344	600376	首开股份	30,640	171,584.00	0.00
345	600266	城建发展	35,752	169,464.48	0.00
346	002317	众生药业	19,400	167,034.00	0.00
347	601860	紫金银行	45,900	166,617.00	0.00
348	600928	西安银行	35,700	166,362.00	0.00
349	002818	富 森 美	13,777	166,150.62	0.00
350	000563	陕国投 A	51,570	166,055.40	0.00
351	600835	上海机电	10,201	165,766.25	0.00
352	601958	金钼股份	25,500	165,240.00	0.00
353	601718	际华集团	56,500	159,330.00	0.00
354	600582	天地科技	40,834	159,252.60	0.00
355	600901	江苏租赁	30,600	159,120.00	0.00
356	002396	星网锐捷	7,400	157,990.00	0.00
357	300146	汤臣倍健	4,800	157,920.00	0.00
358	002124	天邦股份	22,400	157,024.00	0.00
359	002424	贵州百灵	21,200	156,032.00	0.00
360	600959	江苏有线	51,050	155,702.50	0.00
361	600094	大 名 城	40,800	153,816.00	0.00
362	603317	天味食品	5,193	152,829.99	0.00
363	600373	中文传媒	15,340	151,252.40	0.00
364	000990	诚志股份	11,800	150,214.00	0.00
365	600006	东风汽车	20,400	148,920.00	0.00
366	002440	闰土股份	16,825	148,901.25	0.00
367	601611	中国核建	20,400	147,288.00	0.00
368	600633	浙数文化	20,481	147,053.58	0.00
369	002635	安洁科技	10,050	147,031.50	0.00
370	600546	山煤国际	20,400	146,472.00	0.00
371	601928	凤凰传媒	20,416	145,770.24	0.00
372	600649	城投控股	30,600	145,656.00	0.00
373	600764	中国海防	5,100	144,330.00	0.00
374	600717	天 津 港	36,757	144,087.44	0.00
375	600643	爱建集团	20,640	144,067.20	0.00
376	600329	中新药业	5,118	143,764.62	0.00
377	600863	内蒙华电	61,200	142,596.00	0.00
378	600729	重庆百货	5,177	142,108.65	0.00
379	002244	滨江集团	32,900	137,851.00	0.00
380	300180	华峰超纤	27,800	137,610.00	0.00
381	603228	景旺电子	5,165	135,323.00	0.00
382	600131	国网信通	10,200	135,048.00	0.00
383	600623	华谊集团	15,315	134,925.15	0.00

384	603515	欧普照明	5,165	132,585.55	0.00
385	600968	海油发展	51,000	132,090.00	0.00
386	000732	泰禾集团	60,900	131,544.00	0.00
387	000156	华数传媒	16,954	130,715.34	0.00
388	001914	招商积余	7,400	127,132.00	0.00
389	600776	东方通信	10,200	126,480.00	0.00
390	002583	海能达	25,000	126,000.00	0.00
391	601298	青岛港	20,200	124,836.00	0.00
392	600640	号百控股	10,231	124,715.89	0.00
393	601869	长飞光纤	5,100	124,236.00	0.00
394	600823	世茂股份	30,600	123,624.00	0.00
395	601828	美凯龙	10,200	122,400.00	0.00
396	000031	大悦城	33,800	121,680.00	0.00
397	300223	北京君正	1,200	121,104.00	0.00
398	600466	蓝光发展	40,665	119,961.75	0.00
399	600312	平高电气	20,432	119,322.88	0.00
400	601969	海南矿业	10,200	118,626.00	0.00
401	600339	中油工程	40,800	115,872.00	0.00
402	000415	渤海租赁	46,900	113,498.00	0.00
403	300919	中伟股份	693	112,959.00	0.00
404	603056	德邦股份	10,200	112,098.00	0.00
405	603225	新凤鸣	5,504	111,731.20	0.00
406	601778	晶科科技	20,400	111,384.00	0.00
407	002458	益生股份	11,100	110,667.00	0.00
408	600556	天下秀	10,400	109,824.00	0.00
409	600787	中储股份	20,482	109,169.06	0.00
410	603888	新华网	5,150	109,025.50	0.00
411	002948	青岛银行	21,900	108,843.00	0.00
412	000826	启迪环境	20,300	108,605.00	0.00
413	600517	国网英大	15,900	108,279.00	0.00
414	000813	德展健康	22,800	103,512.00	0.00
415	300463	迈克生物	2,400	101,016.00	0.00
416	601139	深圳燃气	15,390	100,958.40	0.00
417	600871	石化油服	50,800	100,076.00	0.00
418	002683	宏大爆破	3,600	99,972.00	0.00
419	601228	广州港	30,600	97,308.00	0.00
420	002302	西部建设	12,300	97,170.00	0.00
421	603379	三美股份	5,100	95,421.00	0.00
422	600350	山东高速	15,308	94,144.20	0.00
423	600566	济川药业	5,114	91,540.60	0.00
424	300699	光威复材	1,200	91,140.00	0.00
425	601003	柳钢股份	15,300	90,270.00	0.00
426	603708	家家悦	5,100	88,587.00	0.00

427	002299	圣农发展	3,600	85,968.00	0.00
428	300979	华利集团	946	83,329.40	0.00
429	002946	新 乳 业	5,300	80,295.00	0.00
430	300010	豆神教育	13,665	77,480.55	0.00
431	688636	智 明 达	918	74,100.96	0.00
432	601801	皖新传媒	15,309	72,258.48	0.00
433	600657	信达地产	20,400	70,992.00	0.00
434	002966	苏州银行	9,600	70,560.00	0.00
435	000540	中天金融	25,200	68,796.00	0.00
436	000046	泛海控股	29,600	68,080.00	0.00
437	603377	东方时尚	6,280	67,133.20	0.00
438	002705	新宝股份	2,400	63,000.00	0.00
439	000709	河钢股份	25,200	61,992.00	0.00
440	600956	新天绿能	5,100	59,721.00	0.00
441	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.00
442	001872	招商港口	3,500	59,220.00	0.00
443	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
444	300981	中红医疗	603	54,550.11	0.00
445	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
446	002423	中粮资本	5,800	52,490.00	0.00
447	688685	迈 信 林	2,612	50,934.00	0.00
448	601512	中新集团	5,100	50,796.00	0.00
449	600903	贵州燃气	5,100	46,920.00	0.00
450	603256	宏和科技	5,100	46,614.00	0.00
451	301020	C 密 封	4,210	44,794.40	0.00
452	600917	重庆燃气	5,300	43,301.00	0.00
453	688597	煜邦电力	3,907	39,695.12	0.00
454	603605	珀 莱 雅	200	39,342.00	0.00
455	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.00
456	601068	中铝国际	10,200	35,190.00	0.00
457	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
458	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.00
459	601636	旗滨集团	1,600	29,696.00	0.00
460	002468	申通快递	3,600	27,432.00	0.00
461	301021	C 英 诺	2,899	27,424.54	0.00
462	300941	创识科技	489	24,552.06	0.00
463	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
464	301009	可靠股份	807	22,541.97	0.00
465	688088	虹软科技	400	22,300.00	0.00
466	601117	中国化学	2,400	21,024.00	0.00
467	688321	微芯生物	400	18,476.00	0.00
468	300937	药 易 购	334	18,057.04	0.00
469	300982	苏文电能	370	17,322.28	0.00

470	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
471	603156	养元饮品	600	17,148.00	0.00
472	600637	东方明珠	2,000	16,380.00	0.00
473	300614	百川畅银	383	16,272.30	0.00
474	600487	亨通光电	1,400	15,960.00	0.00
475	600271	航天信息	1,200	15,636.00	0.00
476	600369	西南证券	3,200	15,584.00	0.00
477	600998	九州通	1,000	15,370.00	0.00
478	601198	东兴证券	1,400	15,302.00	0.00
479	300942	易瑞生物	528	15,159.71	0.00
480	300996	普联软件	310	14,068.34	0.00
481	301013	利和兴	504	13,986.51	0.00
482	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
483	600390	五矿资本	2,200	13,156.00	0.00
484	300997	欢乐家	979	13,067.16	0.00
485	600208	新湖中宝	4,200	12,768.00	0.00
486	300966	共同药业	358	12,311.56	0.00
487	300933	中辰股份	1,117	11,662.18	0.00
488	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
489	300962	中金辐照	657	11,373.12	0.00
490	600498	烽火通信	600	11,178.00	0.00
491	600732	爱旭股份	800	11,136.00	0.00
492	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
493	600027	华电国际	3,200	11,008.00	0.00
494	601577	长沙银行	1,200	10,728.00	0.00
495	600663	陆家嘴	800	10,656.00	0.00
496	300948	冠中生态	380	10,503.04	0.00
497	300930	屹通新材	420	10,321.78	0.00
498	300985	致远新能	394	10,179.06	0.00
499	300993	玉马遮阳	497	10,079.55	0.00
500	300945	曼卡龙	531	10,073.73	0.00
501	600803	新奥股份	600	9,906.00	0.00
502	301011	华立科技	250	9,424.50	0.00
503	300978	东箭科技	630	8,741.53	0.00
504	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
505	603707	健友股份	200	8,350.00	0.00
506	300987	川网传媒	304	8,186.69	0.00
507	300943	春晖智控	342	7,925.10	0.00
508	600095	湘财股份	600	7,026.00	0.00
509	300992	泰福泵业	298	6,885.42	0.00
510	300975	商络电子	517	6,872.51	0.00
511	601991	大唐发电	2,400	6,336.00	0.00
512	301010	晶雪节能	272	5,127.96	0.00

513	300995	奇德新材	209	5,008.52	0.00
514	301012	扬电科技	191	4,854.16	0.00
515	603355	莱克电气	78	4,853.94	0.00
516	301007	德迈仕	322	4,766.15	0.00
517	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
518	300998	宁波方正	203	4,347.24	0.00
519	600377	宁沪高速	400	3,904.00	0.00
520	601568	北元集团	400	3,424.00	0.00
521	603868	飞科电器	81	3,406.86	0.00
522	601187	厦门银行	200	1,896.00	0.00

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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603345	安井食品	945,616.00	0.01
2	600426	华鲁恒升	865,883.00	0.01
3	600089	特变电工	855,190.00	0.01
4	688538	和辉光电	830,920.75	0.01
5	603737	三棵树	758,750.60	0.01
6	688099	晶晨股份	758,440.00	0.01
7	601799	星宇股份	747,950.00	0.01
8	600143	金发科技	727,446.00	0.01
9	688002	睿创微纳	696,958.34	0.01
10	601233	桐昆股份	656,432.00	0.01
11	600079	人福医药	654,885.00	0.01
12	603816	顾家家居	654,011.00	0.01
13	601966	玲珑轮胎	639,925.00	0.01
14	603806	福斯特	631,072.00	0.01
15	600885	宏发股份	611,403.00	0.01
16	600733	北汽蓝谷	552,238.00	0.01
17	600219	南山铝业	534,240.00	0.01
18	601168	西部矿业	533,550.00	0.01
19	600739	辽宁成大	527,549.00	0.01
20	603882	金域医学	526,087.00	0.01

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600426	华鲁恒升	16,522,119.28	0.18
2	600143	金发科技	14,202,982.17	0.16
3	603345	安井食品	13,755,116.43	0.15
4	600089	特变电工	13,003,665.79	0.14
5	601799	星宇股份	12,894,040.16	0.14
6	688002	睿创微纳	12,469,574.78	0.14
7	603806	福斯特	11,523,123.47	0.13
8	601233	桐昆股份	10,777,015.60	0.12
9	603737	三棵树	10,309,762.00	0.11
10	603816	顾家家居	10,288,552.90	0.11
11	600885	宏发股份	10,055,677.68	0.11
12	600460	士兰微	9,970,147.00	0.11
13	603882	金域医学	9,639,500.04	0.11
14	600079	人福医药	9,316,084.12	0.10
15	600132	重庆啤酒	9,063,541.58	0.10
16	601966	玲珑轮胎	8,905,666.49	0.10
17	600739	辽宁成大	8,700,616.55	0.10
18	688099	晶晨股份	8,580,851.18	0.09
19	600486	扬农化工	8,439,715.25	0.09
20	601099	太平洋	8,196,201.50	0.09

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	77,225,566.17
卖出股票收入（成交）总额	874,103,513.68

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	217,909,176.60	2.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	124,513,925.70	1.46
	其中：政策性金融债	124,513,925.70	1.46

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）	32,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	342,455,102.30	4.03

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	108802	进出 1902	1,004,190	100,449,125.70	1.18
2	019640	20 国债 10	886,630	88,663,000.00	1.04
3	019654	21 国债 06	599,930	60,010,997.90	0.71
4	019649	21 国债 01	400,350	40,063,024.50	0.47
5	019645	20 国债 15	290,820	29,172,154.20	0.34

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本报告期投资基金情况

7.10.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	南方中证 500ETF	股票型	交易型开放式	南方基金管理股份有限公司	7,982,116,006.62	93.87

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

无。

7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.12.1 本期国债期货投资政策**

无。

7.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.12.3 本期国债期货投资评价

无。

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

报告期内基金投资的前十名证券除国开 1805（证券代码 108604）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据中国银保监会公告，2020 年 12 月 25 日，因国家开发银行存在“为违规的政府购买服务项目提供融资”等 24 项违规情形，中国银保监会决定对其处罚款 4880 万元。

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

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

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

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	499,324.16

2	应收证券清算款	7,995,904.01
3	应收股利	-
4	应收利息	6,679,359.96
5	应收申购款	20,108,514.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,283,102.87

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600460	士 兰 微	1,149,540.00	0.01	重大事项停牌

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
南方中证 500ETF 联接(LOF)A	1,223,395	3,634.05	626,268,666.95	14.09%	3,819,612,882.67	85.91%
南方中证 500ETF 联接(LOF)C	34,893	9,058.08	184,693,190.71	58.44%	131,370,227.89	41.56%
合计	1,258,288	3,784.46	810,961,857.66	17.03%	3,950,983,110.56	82.97%

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

8.2 期末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	于永祥	1,640,427.00	2.20%

2	朱立新	1,135,575.00	1.52%
3	罗蓉	759,364.00	1.02%
4	张彩玉	741,441.00	0.99%
5	郭思含	701,432.00	0.94%
6	葛强	700,000.00	0.94%
7	张栋	690,909.00	0.93%
8	薛宜平	635,905.00	0.85%
9	杨钢	551,900.00	0.74%
10	姚红伟	529,900.00	0.71%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方中证 500ETF 联接(LOF)A	2,341,765.56	0.0527%
	南方中证 500ETF 联接(LOF)C	19,396.53	0.0061%
	合计	2,361,162.09	0.0496%

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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	南方中证 500ETF 联接(LOF)A	>100
	南方中证 500ETF 联接(LOF)C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	南方中证 500ETF 联接(LOF)A	10~50
	南方中证 500ETF 联接(LOF)C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方中证 500ETF 联接(LOF)A	南方中证 500ETF 联接(LOF)C
基金合同生效日(2009 年 9 月 25 日)基金份额总额	3,223,217,818.45	-
本报告期期初基金份额总额	4,953,164,477.46	533,301,453.01
本报告期基金总申购份额	1,773,691,802.74	191,953,222.84

减：报告期基金总赎回份额	2,280,974,730.58	409,191,257.25
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,445,881,549.62	316,063,418.60

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

2021 年 5 月 19 日，公司副总经理常克川兼任首席信息官。

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	907,238,683.62	96.10%	90,724.23	96.10%	-
华泰证券	1	36,857,848.86	3.90%	3,686.06	3.90%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安	156,446,265.30	99.66%	2,784,800,000.00	74.47%	-	-	2,439,377,828.22	100.00%
华泰证券	540,173.15	0.34%	954,800,000.00	25.53%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	南方基金管理股份有限公司关于北京恒宇天泽基金销售有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-07
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-25
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-04
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-23
5	南方基金关于旗下部分基金增加浙商证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-26
6	南方基金关于旗下部分基金增加信达证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-01
7	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资	中国证券报、基金管	2021-03-02

	关联方承销证券的公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
8	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-08
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-16
10	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-19
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公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
12	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-29
13	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分指数基金修订基金合同有关条款的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
14	南方基金关于旗下部分基金增加坤元基金为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-01
15	南方基金管理股份有限公司关于中信建投期货有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
16	南方基金关于调整中国银行各交易渠道基金申购费率优惠标准的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-08
17	南方基金关于旗下部分基金增加东吴证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-08
18	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-13
19	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方兴业证券承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-16
20	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方华泰联合证券承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-16
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证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-19

22	南方基金关于旗下部分基金增加唐鼎耀华为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-27
23	南方基金关于旗下部分基金增加北京恒天明泽基金销售有限公司为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-30
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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-01
25	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-13
26	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-15
27	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-05-21
28	南方基金关于旗下部分基金增加创金启富为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-07
29	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-11
30	南方基金关于旗下部分基金增加交通银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-24
31	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-25

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的文件；

2、《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金合同》；

3、《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 2021 年中期报告》
原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>