

南方中证 500 量化增强股票型发起式 证券投资基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2022 年 1 月 24 日

§ 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-------------|---|---------------|
| 基金简称 | 南方 500 量化增强股票发起 | |
| 基金主代码 | 002906 | |
| 交易代码 | 002906 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 11 月 23 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 502,252,995.95 份 | |
| 投资目标 | 本基金为增强型股票指数基金，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 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。 | |
| 投资策略 | 本基金利用量化投资模型，在控制组合跟踪误差的基础上，力求投资收益能够超越目标指数。 | |
| 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×95%+1% | |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 | |
| 基金管理人 | 南方基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国光大银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 南方中证 500 增强 A | 南方中证 500 增强 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 002906 | 002907 |

| | | |
|---------------------|------------------|------------------|
| 报告期末下属分级基金的份 额总额 | 396,071,745.28 份 | 106,181,250.67 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“南方中证 500 增强”。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2021 年 10 月 1 日—2021 年 12 月 31 日） | |
|--------------------|---------------------------------------|----------------|
| | 南方中证 500 增强 A | 南方中证 500 增强 C |
| 1.本期已实现收益 | 33,048,839.40 | 8,920,193.02 |
| 2.本期利润 | 7,002,326.49 | 1,873,706.96 |
| 3.加权平均基金份额本期利 润 | 0.0179 | 0.0138 |
| 4.期末基金资产净值 | 570,087,061.92 | 150,560,599.77 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.439 | 1.418 |

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 500 增强 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 |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.20% | 0.81% | 3.69% | 0.72% | -2.49% | 0.09% |
| 过去六个月 | 2.71% | 1.09% | 8.25% | 0.91% | -5.54% | 0.18% |
| 过去一年 | 8.44% | 1.23% | 15.97% | 0.92% | -7.53% | 0.31% |
| 过去三年 | 91.36% | 1.42% | 77.45% | 1.31% | 13.91% | 0.11% |
| 过去五年 | 46.69% | 1.34% | 23.17% | 1.27% | 23.52% | 0.07% |
| 自基金合同 生效起至今 | 43.90% | 1.33% | 16.81% | 1.26% | 27.09% | 0.07% |

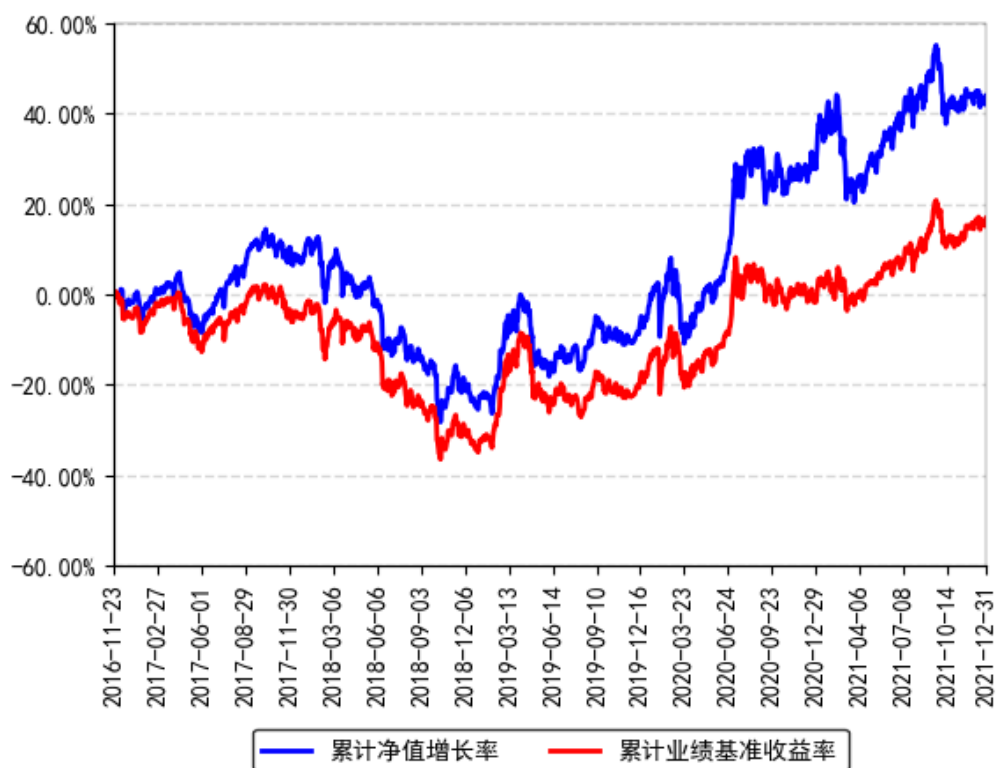
南方中证 500 增强 C

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

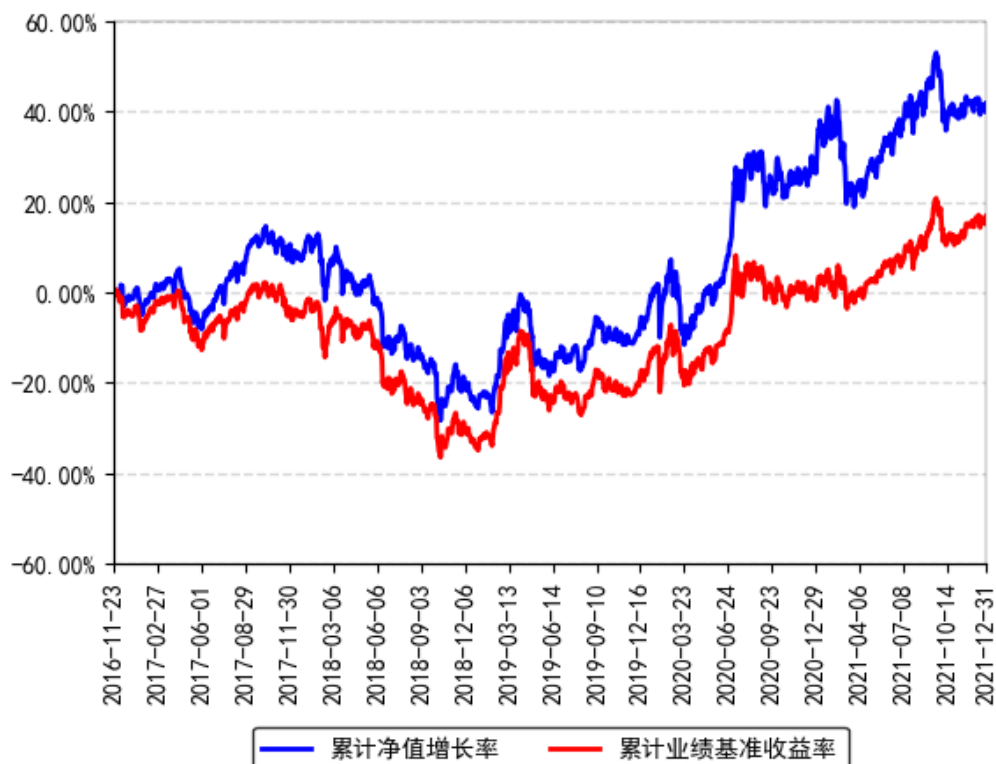
| | | ② | | 准差④ | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.14% | 0.81% | 3.69% | 0.72% | -2.55% | 0.09% |
| 过去六个月 | 2.53% | 1.09% | 8.25% | 0.91% | -5.72% | 0.18% |
| 过去一年 | 8.00% | 1.23% | 15.97% | 0.92% | -7.97% | 0.31% |
| 过去三年 | 89.07% | 1.42% | 77.45% | 1.31% | 11.62% | 0.11% |
| 过去五年 | 43.81% | 1.34% | 23.17% | 1.27% | 20.64% | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 41.80% | 1.33% | 16.81% | 1.26% | 24.99% | 0.07% |

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500增强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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 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 | 2018年11月8日 | - | 6年 | 女，康奈尔大学金融工程硕士，金融风险管理者（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；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6月28日至今，任大数据300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。 | |
| 冯雨生 | 本基金基金经理 | 2021 年 11 月 12 日 | - | 14 年 | 北京大学金融学硕士，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。曾就职于长盛基金管理有限公司，历任量化投资部量化研究员、部门负责人兼基金经理；2011 年 7 月 11 日至 2019 年 10 月 9 日，任长盛中证 100 指数基金经理；2011 年 12 月 20 日至 2019 年 10 月 9 日，任长盛沪深 300 指数基金经理；2015 年 4 月 27 日至 2017 年 10 月 23 日，任长盛高端装备混合基金经理；2015 年 5 月 29 日至 2019 年 10 月 9 日，任长盛中证申万一带一路指数分级基金经理；2015 年 6 月 18 日至 2020 年 10 月 23 日，任长盛成长价值混合基金经理；2015 年 8 月 13 日至 2019 年 10 月 9 日，任长盛中证全指证券指数基金经理；2016 年 9 月 12 日至 2019 年 8 月 12 日，任长盛战略新兴产业混合基金经理；2016 年 9 月 12 日至 2019 年 10 月 9 日，任长盛盛世混合基金经理；2016 年 9 月 12 日至 2021 年 6 月 17 日，任长盛积极配置债券基金经理；2017 年 3 月 17 日至 2019 年 10 月 9 日，任长盛同鑫行业配置混合基金经理；2017 年 5 月 3 日至 2019 年 10 月 9 日，任长盛信息安全量化策略混合基金经理；2017 年 10 月 23 日至 2020 年 4 月 21 日，任长盛同德主题混合基金经理；2020 年 4 月 15 日至 2021 年 1 月 20 日，任长盛价值发现股票基金经理；2019 年 3 月 18 日至 2021 年 6 月 17 日，任长盛量化多策略灵活配置混合、长盛量化红利混合、长盛多因子策略优选基金经理。2021 年 7 月 |

| | | | | | |
|-----|--------------|------------------|------------------|-----|---|
| | | | | | 加入南方基金，现任数量化投资部总经理；2021 年 11 月 12 日至今，任南方量化成长、南方中证 500 增强、南方绝对收益基金经理；2021 年 12 月 13 日至今，兼任投资经理。 |
| 李佳亮 | 本基金基金经理（已离任） | 2016 年 11 月 23 日 | 2021 年 11 月 12 日 | 9 年 | 美国南加州大学金融工程硕士，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2012 年 8 月加入南方基金，任数量化投资部研究员；2015 年 5 月 28 日至 2016 年 8 月 5 日，任投资经理助理；2017 年 4 月 13 日至 2018 年 9 月 4 日，任南方荣优基金经理；2016 年 8 月 5 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方消费基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 6 月 28 日，任大数据 100、大数据 300 基金经理；2016 年 11 月 23 日至 2021 年 11 月 12 日，任南方中证 500 增强基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2021 年 11 月 12 日，任南方量化成长基金经理；2020 年 4 月 23 日至 2021 年 11 月 12 日，任南方上证 50 增强基金经理；2016 年 12 月 30 日至今，任南方绝对收益基金经理；2021 年 10 月 29 日至今，任南方 MSCI 中国 A50 互联互通 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。

4.2 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 公平交易专项说明

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。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年 4 季度，本基金投资以指数增强选股模型股票投资为主，辅以期货多头持有。指数增强股票投资部分：使用主模型中证 500 指数增强模型加卫星模型量化基本面模型构建组合进行股票投资。期货部分：持有少量中证 500 期货多头。

4.5 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 1.439 元，报告期内，份额净值增长率为 1.20%，同期业绩基准增长率为 3.69%；本基金 C 份额净值为 1.418 元，报告期内，份额净值增长率为 1.14%，同期业绩基准增长率为 3.69%。

4.6 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 投资组合报告

5.1 报告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 | 667,644,060.86 | 91.33 |
| | 其中：股票 | 667,644,060.86 | 91.33 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 155,090.50 | 0.02 |
| | 其中：债券 | 155,090.50 | 0.02 |
| | 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 | 61,171,449.80 | 8.37 |
| 8 | 其他资产 | 2,016,916.63 | 0.28 |
| 9 | 合计 | 730,987,517.79 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告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 | 10,187,917.00 | 1.41 |
| B | 采矿业 | 32,261,961.20 | 4.48 |
| C | 制造业 | 435,729,293.93 | 60.46 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 18,713,122.80 | 2.60 |
| E | 建筑业 | 15,322,203.00 | 2.13 |
| F | 批发和零售业 | 10,299,087.00 | 1.43 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 14,446,047.92 | 2.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | 3,802,996.00 | 0.53 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 60,726,206.90 | 8.43 |
| J | 金融业 | 20,611,069.00 | 2.86 |
| K | 房地产业 | 14,675,688.84 | 2.04 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,990,100.00 | 0.55 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 3,617,160.00 | 0.50 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,965,700.00 | 0.41 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 3,414,069.00 | 0.47 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 6,277,713.00 | 0.87 |
| S | 综合 | 6,799,642.44 | 0.94 |
| | 合计 | 663,839,978.03 | 92.12 |

5.2.2 报告期末积极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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,984,917.33 | 0.28 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 4,713.80 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 47,484.24 | 0.01 |

| | | | |
|---|-----------------|--------------|------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | 4,608.00 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,682,426.97 | 0.23 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 18,969.00 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 34,387.07 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 18,161.78 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 8,414.64 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,804,082.83 | 0.53 |

5.2.3 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 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前十名股票投资明细

| 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 | 600884 | 杉杉股份 | 193,200 | 6,331,164.00 | 0.88 |
| 2 | 002340 | 格林美 | 581,500 | 6,018,525.00 | 0.84 |
| 3 | 600380 | 健康元 | 450,000 | 5,778,000.00 | 0.80 |
| 4 | 000009 | 中国宝安 | 378,908 | 5,467,642.44 | 0.76 |
| 5 | 002385 | 大北农 | 501,000 | 5,255,490.00 | 0.73 |
| 6 | 600885 | 宏发股份 | 70,000 | 5,224,800.00 | 0.73 |
| 7 | 000733 | 振华科技 | 38,000 | 4,722,640.00 | 0.66 |
| 8 | 688099 | 晶晨股份 | 35,924 | 4,677,304.80 | 0.65 |
| 9 | 002353 | 杰瑞股份 | 116,100 | 4,644,000.00 | 0.64 |
| 10 | 688005 | 容百科技 | 40,000 | 4,623,200.00 | 0.64 |

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

| 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 | 601728 | 中国电信 | 394,011 | 1,682,426.97 | 0.23 |
| 2 | 688779 | 长远锂科 | 39,177 | 895,586.22 | 0.12 |
| 3 | 688075 | 安旭生物 | 4,177 | 537,872.29 | 0.07 |

| | | | | | |
|---|--------|------|-------|------------|------|
| 4 | 688305 | 科德数控 | 1,496 | 158,097.28 | 0.02 |
| 5 | 301050 | 雷电微力 | 233 | 54,694.42 | 0.01 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 155,090.50 | 0.02 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 155,090.50 | 0.02 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 | 113633 | 科沃转债 | 1,050 | 136,090.50 | 0.02 |
| 2 | 113634 | 珀莱转债 | 190 | 19,000.00 | 0.00 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.7 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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位：人民币元

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|-------------------|--------|----------|--------------|------------|------------|
| IC2206 | IC2206 | 5 | 7,147,800.00 | 127,800.00 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | 127,800.00 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | 391,960.00 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | 758,600.00 |

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

多头套期保值策略

本基金为指数增强基金，当指数期货大幅贴水时，可采用多头套期保值策略，即卖出部分股票持仓并买入指数期货的期货替代现货策略。持有至基差收敛，赚取期货与现货指数的价差，增强指数。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

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

5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,129,680.22 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 13,735.07 |
| 5 | 应收申购款 | 873,501.34 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,016,916.63 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 601728 | 中国电信 | 1,682,426.97 | 0.23 | 新股锁定期 |
| 2 | 688779 | 长远锂科 | 895,586.22 | 0.12 | 新股锁定期 |
| 3 | 688075 | 安旭生物 | 537,872.29 | 0.07 | 新股锁定期 |
| 4 | 688305 | 科德数控 | 158,097.28 | 0.02 | 新股锁定期 |
| 5 | 301050 | 雷电微力 | 54,694.42 | 0.01 | 新股锁定期 |

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 南方中证 500 增强 A | 南方中证 500 增强 C |
|--------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 368,147,716.80 | 174,593,501.48 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 67,319,592.76 | 16,310,534.96 |

| | | |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 39,395,564.28 | 84,722,785.77 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 396,071,745.28 | 106,181,250.67 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期末，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例（%） | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例（%） | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|--------------|-----------------|---------------|-----------------|-----------------|
| 基金管理人固有资金 | - | - | 9,900,000.00 | 1.97 | 自合同生效之日起不少于 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | 435,847.29 | 0.09 | - | - | - |
| 基金经理等人员 | 570,414.97 | 0.11 | 100,000.00 | 0.02 | 自合同生效之日起不少于 3 年 |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 1,006,262.26 | 0.20 | 10,000,000.00 | 1.99 | - |

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、《南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金 2021 年 4 季度报告原文。

10.2 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。

10.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>