

# 南方中证 1000 交易型开放式指数证券 投资基金发起式联接基金 2021 年年度 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 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，并由总经理（代为履行董事长职务）签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2021 年 9 月 27 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.....	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、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	15
§5 托管人报告.....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 审计报告.....	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表.....	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告.....	48
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	70

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	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	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	本报告期投资基金情况 .....	72
8.13	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	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	73
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	74
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	74
§10	开放式基金份额变动 .....	75
§11	重大事件揭示 .....	75
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	75
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 .....	75
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	75
11.4	基金投资策略的改变 .....	75
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	75
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 .....	76
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	76
11.8	其他重大事件 .....	77
§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 .....	78
13.2	存放地点 .....	78
13.3	查阅方式 .....	78

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
基金简称	南方中证 1000ETF 发起式联接	
基金主代码	011860	
交易代码	011860	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 9 月 27 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	127,313,936.49 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方中证 1000ETF 发起式联接 A	南方中证 1000ETF 发起式联接 C
下属分级基金的交易代码	011860	011861
报告期末下属分级基金的份额总额	64,636,551.97 份	62,677,384.52 份

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 1000ETF 发起式联接”。

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512100
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2016 年 9 月 29 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016 年 11 月 4 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	招商银行股份有限公司

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“1000ETF”或“中证 1000ETF”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，主要投资于目标 ETF。本基金并不参与

	目标 ETF 的管理。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。主要投资策略包括：资产配置策略、目标 ETF 投资策略、成份股、备选成份股投资策略、金融衍生品投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略等以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金的目标 ETF 为股票型基金，一般而言，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的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	中证 1000 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	招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
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95555
传真	0755-82763889	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518017	518040
法定代表人	杨小松（代为履行法定代表人职责）	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	
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	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

### § 3 主要财务指标、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

## 1、南方中证 1000ETF 发起式联接 A

3.1.1 期间数据和指标	2021 年 9 月 27 日-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	728,591.94
本期利润	5,340,519.19
加权平均基金份额本期利润	0.0674
本期加权平均净值利润率	6.58%
本期基金份额净值增长率	6.83%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末
期末可供分配利润	700,807.14
期末可供分配基金份额利润	0.0108
期末基金资产净值	69,048,289.92
期末基金份额净值	1.0683
3.1.3 累计期末指标	2021 年末
基金份额累计净值增长率	6.83%

## 2、南方中证 1000ETF 发起式联接 C

3.1.1 期间数据和指标	2021 年 9 月 27 日-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	720,187.92
本期利润	3,686,806.55
加权平均基金份额本期利润	0.0485
本期加权平均净值利润率	4.72%
本期基金份额净值增长率	6.80%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末
期末可供分配利润	662,528.51
期末可供分配基金份额利润	0.0105
期末基金资产净值	66,937,825.36
期末基金份额净值	1.0680
3.1.3 累计期末指标	2021 年末
基金份额累计净值增长率	6.80%

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、本基金合同生效日为 2021 年 9 月 27 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

南方中证 1000ETF 发起式联接 A

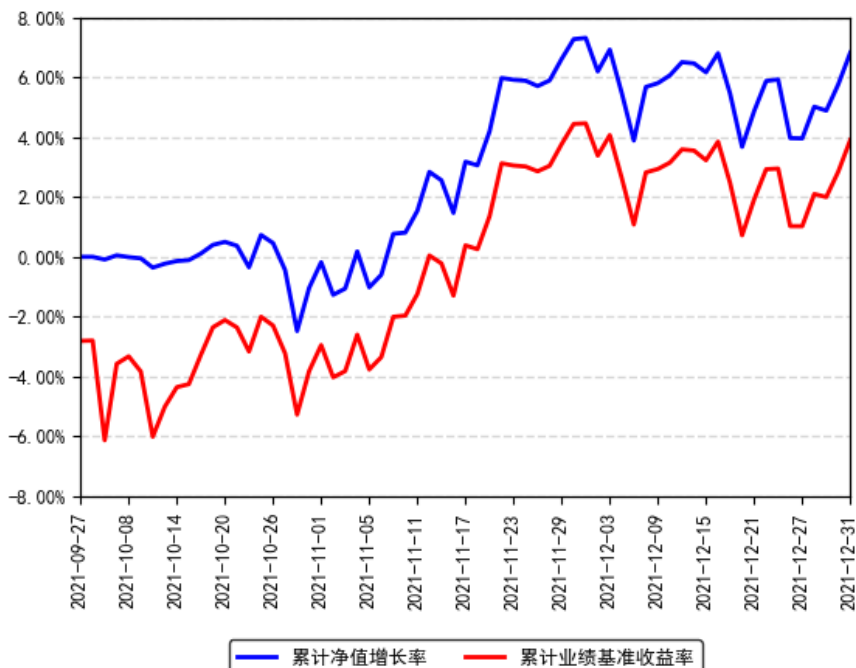
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.78%	0.90%	7.77%	1.00%	-0.99%	-0.10%
自基金合同生效起至今	6.83%	0.88%	3.91%	1.17%	2.92%	-0.29%

南方中证 1000ETF 发起式联接 C

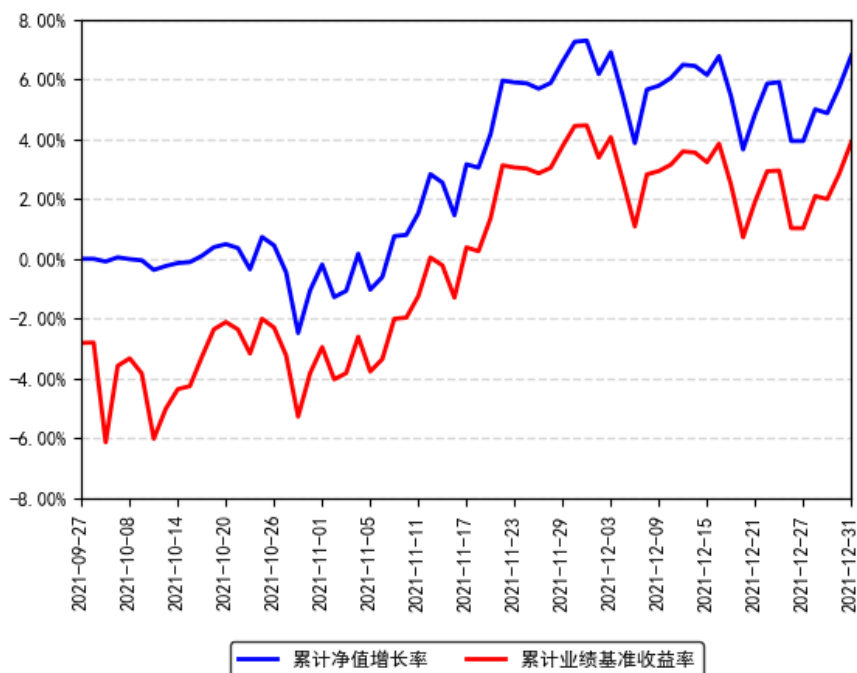
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.75%	0.90%	7.77%	1.00%	-1.02%	-0.10%
自基金合同生效起至今	6.80%	0.87%	3.91%	1.17%	2.89%	-0.30%

#### 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1000ETF发起式联接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



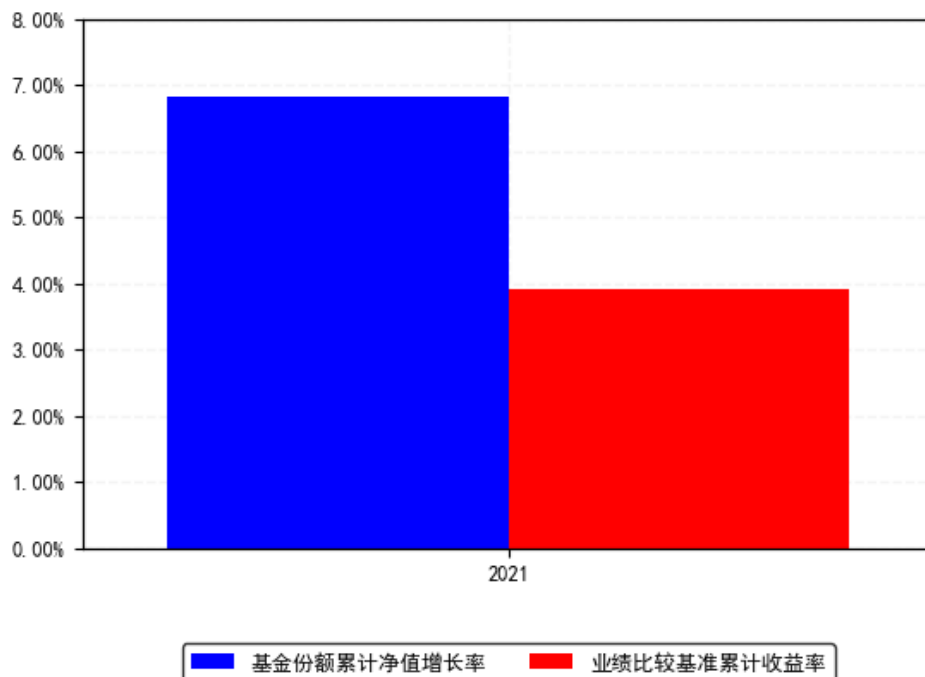
南方中证1000ETF发起式联接C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



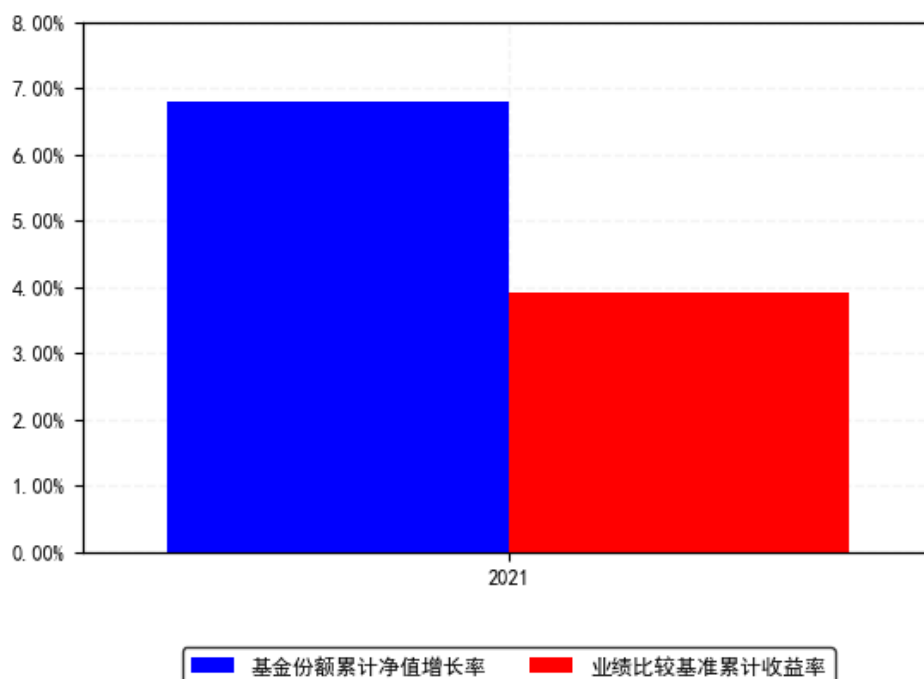
注：本基金合同于 2021 年 9 月 27 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末建仓期尚未结束。

### 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

南方中证1000ETF发起式联接A每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



南方中证1000ETF发起式联接C每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



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 2021 年 9 月 27 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 1.5 万亿元，旗下管理 274 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		
崔蕾	本基金基金经理	2021 年 9 月 27 日	-	6 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，历任数量化投资部助理研究员、研究员，指数投资部研究员；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 4 月 23 日，任南方小康 ETF、南方小康 ETF 联接基金经理；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。

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 基金经理薪酬机制

公司基金经理薪酬由工资、奖金等部分构成。工资由基金经理的 MD 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，按超出基础创收以上部分的一定比例计提激励奖金，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。

### 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，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

自本基金开放申赎至报告期末，中证 1000 指数上涨 8.98%。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。

我们对本基金跟踪误差归因分析如下：

- （1）接受申购赎回所带来的股票仓位偏离，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- （2）本基金申赎目标 ETF 所带来的成份股权重偏离，对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行应对；
- （3）报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；
- （4）根据指数成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内；
- （5）新股上市初期涨幅较大的影响。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 1.0683 元，报告期内，份额净值增长率为 6.83%，同期业绩基准增长率为 3.91%；本基金 C 份额净值为 1.0680 元，报告期内，份额净值增长率为 6.80%，同期业绩基准增长率为 3.91%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年 2 月以来，小盘股持续占优，既是因为小盘股在疫情过后存在低基数效应，业绩弹性更大；也是受到硬科技板块高增长的驱动。展望 2022 年，低基数效应已经消失，小盘股内部板块分化，绝对收益由其自身增长水平决定。相对大盘股来说，需要观察传统经济的信用扩张力度，以及大盘蓝筹的业绩增速是否有拐头的趋势。从当前市场风格看，阶段性大盘蓝筹可能托底占优，有估值修复行情；但是中长期看，下半年中小盘风格或将再次成为主导。

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 2021 年度发布的《关于依法从严打击证券违法活动的意见》《证券期货业网络安全事件报告与调查处理办法》和《个人信息保护法》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，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》《制度管理办法》《廉洁从业内部控制制度》《内控稽核工作操作指引》《“洗钱和恐怖融资风险”自评估制度》和《反洗钱内部控制制度》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，本基金管理人积极开展形式丰富的合规培训与考试，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，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，排查业务中的风险点并完善内控措施，促进公司业务合规运作、稳健经营；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，及时检查基金销售业务的合法合规情况，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；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，通过研究监管形势，开展洗钱风险自评估工作，参考同业先进经验，按照风险为本的工作思路，积极主动的采取有效措施防控洗钱风险。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，积极健全内部管理制度，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字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、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。

#### 4.8 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



不适用。

## § 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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(2022)第 22051 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 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接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 1000 交易型开放式指数

	<p>证券投资基金发起式联接基金(以下简称“南方中证 1000ETF 发起式联接基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <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 1000ETF 发起式联接基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</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 1000ETF 发起式联接基金,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 1000ETF 发起式联接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 1000ETF 发起式联接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 1000ETF 发起式</p>

	<p>联接基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督南方中证 1000ETF 发起式联接基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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。(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。(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。(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 1000ETF 发起式联接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 1000ETF 发起式联接基金不能持续经营。(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>

	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。
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；曹阳
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	2022 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	7,188,164.08
结算备付金		1,578,464.33
存出保证金		442,494.27
交易性金融资产	7.4.7.2	130,865,496.11
其中：股票投资		2,776,579.01
基金投资		123,087,417.10
债券投资		5,001,500.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	84,128.64
应收股利		-
应收申购款		306,979.86
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	1,022,968.36
资产总计		141,488,695.65
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-

卖出回购金融资产款		2,000,000.00
应付证券清算款		2,603,858.70
应付赎回款		834,304.38
应付管理人报酬		6,663.26
应付托管费		1,332.67
应付销售服务费		7,041.90
应付交易费用	7.4.7.7	7,212.41
应交税费		4,799.90
应付利息		2,367.15
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	35,000.00
负债合计		5,502,580.37
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	127,313,936.49
未分配利润	7.4.7.10	8,672,178.79
所有者权益合计		135,986,115.28
负债和所有者权益总计		141,488,695.65

注：1、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，南方中证 1000ETF 发起式联接 A 份额净值 1.0683 元，基金份额总额 64,636,551.97 份；南方中证 1000ETF 发起式联接 C 份额净值 1.0680 元，基金份额总额 62,677,384.52 份；总份额合计 127,313,936.49 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2021 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

本报告期：2021 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		9,226,410.55
1.利息收入		248,005.67
其中：存款利息收入	7.4.7.11	152,793.28
债券利息收入		17,974.96
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		77,237.43
其他利息收入		-

证券出借利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		1,397,593.18
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-59,003.28
基金投资收益	7.4.7.13	1,313,182.98
债券投资收益	7.4.7.14	349.83
资产支持证券投资 收益	7.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	142,854.37
股利收益	7.4.7.17	209.28
3.公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	7.4.7.18	7,578,545.88
4.汇兑收益(损失以“-”号 填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填 列)	7.4.7.19	2,265.82
减:二、费用		199,084.81
1.管理人报酬	7.4.10.3.1	74,894.12
2.托管费	7.4.10.3.2	14,978.83
3.销售服务费	7.4.10.3.3	20,681.68
4.交易费用	7.4.7.20	38,568.50
5.利息支出		10,398.93
其中:卖出回购金融资产支出		10,398.93
6.税金及附加		514.27
7.其他费用	7.4.7.21	39,048.48
三、利润总额(亏损总额以“-” 号填列)		9,027,325.74
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-” 号填列)		9,027,325.74

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

本报告期:2021 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 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)	205,200,280.41	-	205,200,280.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,027,325.74	9,027,325.74

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)	-77,886,343.92	-355,146.95	-78,241,490.87
其中：1.基金申购款	63,719,414.21	3,164,064.84	66,883,479.05
2.基金赎回款	-141,605,758.13	-3,519,211.79	-145,124,969.92
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）	127,313,936.49	8,672,178.79	135,986,115.28

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 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(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]732 号《关于准予南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的批复》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 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 205,178,989.99 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(2021)第 0953 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》于 2021 年 9 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 205,200,280.41 份基金份额，其中认购资金利息折合 21,290.42 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,000.00 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用、不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别

设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

本基金为南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对中证 1000 指数紧密跟踪的被动指数基金，本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。本基金可少量投资于非成份股(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、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、现金资产、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)。本基金可投资于存托凭证。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。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，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为中证 1000 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

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 2022 年 3 月 28 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》、各项具体会计准则及相关规定(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 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》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 2021 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及



2021 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值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 2021 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 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

###### (1) 金融资产的分类

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

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

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

###### (2) 金融负债的分类

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

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 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、基金投资、债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。上述

申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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

本基金同一类别的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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

无。

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 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。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)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(可转换债券和私募债券除外)，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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金在编制 2021 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 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 2021 年 12 月 31 日
活期存款	7,188,164.08
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	7,188,164.08

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,767,838.22	2,776,579.01	8,740.79
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,003,600.00	5,001,500.00
	银行间市场	-	-
	合计	5,003,600.00	5,001,500.00
资产支持证券	-	-	-
基金	115,551,052.01	123,087,417.10	7,536,365.09
其他	-	-	-
合计	123,322,490.23	130,865,496.11	7,543,005.88

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。本基金可采用股票组合申赎的方式或证券二级市场买卖的方式进行目标ETF份额的交易。

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日

	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,915,580.00	-	-	-
—股指期货	2,915,580.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,915,580.00	-	-	-

注：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。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2201	IC2201	2.00	2,951,120.00	35,540.00
总额合计	-	2.00	2,951,120.00	35,540.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	35,540.00
股指期货投资净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,048.47
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	950.58
应收债券利息	82,115.07
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	14.52
合计	84,128.64

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
其他应收款	-
待摊费用	-
可收退补款	-
应收退补款	1,022,968.36
合计	1,022,968.36

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	7,212.41
银行间市场应付交易费用	-
合计	7,212.41

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	-
应退替代款	-
预提费用	35,000.00
应付指数使用费	-
可退替代款	-
其他	-
合计	35,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

南方中证 1000ETF 发起式联接 A		
项目	本期 2021 年 9 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	93,484,707.13	93,484,707.13
本期申购	4,991,548.66	4,991,548.66
本期赎回（以“-”号填列）	-33,839,703.82	-33,839,703.82
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	64,636,551.97	64,636,551.97

南方中证 1000ETF 发起式联接 C		
项目	本期 2021 年 9 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	111,715,573.28	111,715,573.28
本期申购	58,727,865.55	58,727,865.55
本期赎回（以“-”号填列）	-107,766,054.31	-107,766,054.31
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	62,677,384.52	62,677,384.52

注：

1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2021 年 9 月 3 日至 2021 年 9 月 23 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 205,178,989.99 元，折合为 205,178,989.99 份基金份额（其中 A 类基金份额 93,472,694.94 份，C 类基金份额 111,706,295.05 份）。根据《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》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 21,290.42 元在本基金成立后，折合为 21,290.42 份基金份额（其中 A 类基金份额 12,012.19 份，C 类基金份额 9,278.23 份），划入基金份额持有人账户。

3. 根据《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》及《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告》的相关规定，本基金于 2021 年 9 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 10 月 17 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务、赎回业务和转换业务自 2021 年 10 月 18 日起开始办理。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

南方中证 1000ETF 发起式联接 A			
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	728,591.94	4,611,927.25	5,340,519.19
本期基金份额交易产生的变动数	-27,784.80	-900,996.44	-928,781.24

其中：基金申购款	9,464.18	219,550.07	229,014.25
基金赎回款	-37,248.98	-1,120,546.51	-1,157,795.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	700,807.14	3,710,930.81	4,411,737.95

南方中证 1000ETF 发起式联接 C			
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	720,187.92	2,966,618.63	3,686,806.55
本期基金份额交易产生的变动数	-57,659.41	631,293.70	573,634.29
其中：基金申购款	76,510.70	2,858,539.89	2,935,050.59
基金赎回款	-134,170.11	-2,227,246.19	-2,361,416.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	662,528.51	3,597,912.33	4,260,440.84

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	21,909.00
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	130,809.23
其他	75.05
合计	152,793.28

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	13,512.18
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-72,515.46
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-59,003.28

##### 7.4.7.12.2 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 9 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	21,270,380.33

减：卖出股票成本总额	21,256,868.15
买卖股票差价收入	13,512.18

#### 7.4.7.12.3 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。

#### 7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 27 日（基金合同生效日） 至 2021 年 12 月 31 日
申购基金份额总额	127,796,700.00
减：现金支付申购款总额	82,871,396.17
减：申购股票成本总额	44,997,819.29
申购差价收入	-72,515.46

#### 7.4.7.12.5 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。

#### 7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 27 日（基金合同生效日） 至 2021 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	30,782,222.31
减：卖出/赎回基金成本总额	29,469,039.33
基金投资收益	1,313,182.98

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 27 日（基金合同生效日） 至 2021 年 12 月 31 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	349.83
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	349.83

##### 7.4.7.14.2 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 9 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑	1,350.00

付)成交总额	
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	1,000.00
减:应收利息总额	0.17
买卖债券差价收入	349.83

#### 7.4.7.14.3 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。

#### 7.4.7.14.4 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。

#### 7.4.7.14.5 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。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

##### 7.4.7.15.1 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。

##### 7.4.7.15.2 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。

##### 7.4.7.15.3 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。

##### 7.4.7.15.4 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。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 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。

##### 7.4.7.16.2 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 2021 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
股指期货-投资收益	142,854.37

#### 7.4.7.17 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 27 日（基金合同生效日） 至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	209.28
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	209.28

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 9 月 27 日（基金合同生效日） 至 2021 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	7,543,005.88
——股票投资	8,740.79
——债券投资	-2,100.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	7,536,365.09
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	35,540.00
——权证投资	-
——期货投资	35,540.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	7,578,545.88

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 27 日（基金合同生效日） 至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,604.67
基金转换费收入	661.15
合计	2,265.82

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入基金资产。
2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，赎回费全额归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 27 日（基金合同生效日） 至 2021 年 12 月 31 日
----	---

交易所市场交易费用	36,672.99
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	1,895.51
其中：申购费	-
赎回费	-
场内交易费	688.55
其他	1,206.96
合计	38,568.50

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	35,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	3,648.48
其他	400.00
合计	39,048.48

#### 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、登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司("招商银行")	基金托管人
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
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
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

南方中证 1000 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。

#### 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 2021 年 9 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 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	79,390,991.69	100.00%

###### 7.4.10.1.2 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 9 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰证券	175,798,904.11	100.00%

注：本报告期内基金成交金额中基金申购赎回 158,578,922.31 元，基金二级市场买卖 17,219,981.80 元。

###### 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。

##### 7.4.10.2 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 9 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 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	7,939.78	100.00%	7,212.41	100.00%

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。

##### 7.4.10.3 关联方报酬

###### 7.4.10.3.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	74,894.12
其中：支付销售机构的客户维护费	28,819.51

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。

#### 7.4.10.3.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	14,978.83

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。支付基金托管人招商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：

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

#### 7.4.10.3.3 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 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方中证 1000ETF 发起式联接 A	南方中证 1000ETF 发起式联接 C	合计
华泰证券	-	873.49	873.49
南方基金	-	5,883.40	5,883.40
招商银行	-	2,311.50	2,311.50
合计	-	9,068.39	9,068.39

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 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

#### 7.4.10.4 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。

#### 7.4.10.5 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

##### 7.4.10.5.1 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。

##### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.6.1 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	本期 2021 年 9 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	南方中证 1000ETF 发起式联接 A	南方中证 1000ETF 发起式联接 C
基金合同生效日（2021 年 9 月 27 日）持有的基金份额	10,003,819.82	-
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	10,003,819.82	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.86%	-

基金管理人南方基金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。

##### 7.4.10.6.2 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。

#### 7.4.10.7 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 9 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	7,188,164.08	21,909.00

注：本基金由基金托管人招商银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

#### 7.4.10.8 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.9 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.9.1 其他关联交易事项的说明

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有目标 ETF 基金份额，成本总额为人民币 115,551,052.01 元，估值总额为人民币 123,087,417.10 元，占本基金基金资产净值的比例为 90.51%。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021 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	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
871245	威博液压	2021 年 12 月 24 日	2022 年 1 月 6 日	新股未上市	9.68	9.68	100	968.00	968.00	-
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	可流通日	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：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。

##### 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
600072	中船	2021 年 12	重大	14.65	2022	16.12	1,100	16,112.11	16,115.00	-

	科技	月 29 日	事项 停牌		年 1 月 13 日					
--	----	--------	----------	--	---------------------	--	--	--	--	--

本基金截至 2021 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

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,000,000.00 元，截至 2022 年 1 月 13 日到期。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。

#### 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型基金、债券型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，将风险控制可在承受的范围之内。

#### 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招商银行，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，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 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

#### 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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 2021 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 2,000,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 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%。于 2021 年 12 月 31 日，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 0.01%。

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。于 2021 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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、存出保证金和债券投资等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,188,164.08	-	-	-	7,188,164.08
结算备付金	1,578,464.33	-	-	-	1,578,464.33
存出保证金	29,337.47	-	-	413,156.80	442,494.27
交易性金融资产	5,001,500.00	-	-	125,863,996.11	130,865,496.11
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	84,128.64	84,128.64
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	306,979.86	306,979.86
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	1,022,968.36	1,022,968.36
资产总计	13,797,465.88	-	-	127,691,229.77	141,488,695.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	834,304.38	834,304.38
应付管理人报酬	-	-	-	6,663.26	6,663.26
应付托管费	-	-	-	1,332.67	1,332.67
应付证券清算款	-	-	-	2,603,858.70	2,603,858.70
卖出回购金融资产款	2,000,000.00	-	-	-	2,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	7,041.90	7,041.90

应付交易费用	-	-	-	7,212.41	7,212.41
应付利息	-	-	-	2,367.15	2,367.15
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	4,799.90	4,799.90
其他负债	-	-	-	35,000.00	35,000.00
负债总计	2,000,000.00	-	-	3,502,580.37	5,502,580.37
利率敏感度缺口	11,797,465.88	-	-	124,188,649.40	135,986,115.28

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（2021年12月31日）
	1.市场利率平行上升 25 个基点	-3,820.38
2.市场利率平行下降 25 个基点	3,832.65	

#### 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。

#### 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 2021 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	2,776,579.01	2.04
交易性金融资产-基金投资	123,087,417.10	90.51
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	125,863,996.11	92.55

注：1. 交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标 ETF 份额。

2. 其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。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(2021年12月31日)
	1.组合自身基准上升 5%	4,699,517.38
	2.组合自身基准下降 5%	-4,699,517.38

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值



于 2021 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为 125,846,913.11 元，属于第二层次的余额为 5,018,583.00 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,776,579.01	1.96

	其中：股票	2,776,579.01	1.96
2	基金投资	123,087,417.10	86.99
3	固定收益投资	5,001,500.00	3.53
	其中：债券	5,001,500.00	3.53
	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	8,766,628.41	6.20
8	其他资产	1,856,571.13	1.31
9	合计	141,488,695.65	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	16,228.00	0.01
B	采矿业	76,106.00	0.06
C	制造业	1,937,970.13	1.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	80,028.00	0.06
E	建筑业	60,391.00	0.04
F	批发和零售业	74,600.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	43,374.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	254,644.88	0.19
J	金融业	47,233.00	0.03
K	房地产业	51,644.00	0.04
L	租赁和商务服务业	15,688.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	40,983.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	43,771.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	11,648.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	19,873.00	0.01
S	综合	2,397.00	0.00
	合计	2,776,579.01	2.04

### 8.2.2 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。

## 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

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	600986	浙文互联	3,400	28,662.00	0.02
2	300012	华测检测	800	21,496.00	0.02
3	688122	西部超导	220	21,326.80	0.02
4	603026	石大胜华	100	19,799.00	0.01
5	002176	江特电机	800	16,608.00	0.01
6	600072	中船科技	1,100	16,115.00	0.01
7	002850	科达利	100	16,034.00	0.01
8	002326	永太科技	300	15,363.00	0.01
9	002756	永兴材料	100	14,802.00	0.01
10	601058	赛轮轮胎	1,000	14,790.00	0.01
11	002497	雅化集团	500	14,330.00	0.01
12	300725	药石科技	100	14,217.00	0.01
13	002407	多氟多	300	13,497.00	0.01
14	002192	融捷股份	100	13,015.00	0.01
15	600499	科达制造	500	12,410.00	0.01
16	002625	光启技术	500	12,005.00	0.01
17	002240	盛新锂能	200	11,590.00	0.01
18	000591	太阳能	1,000	11,200.00	0.01
19	600110	诺德股份	700	11,165.00	0.01
20	300568	星源材质	300	11,019.00	0.01
21	002402	和而泰	400	10,972.00	0.01
22	600711	盛屯矿业	1,000	10,730.00	0.01
23	603606	东方电缆	200	10,232.00	0.01
24	300726	宏达电子	100	10,006.00	0.01
25	600096	云天化	500	9,810.00	0.01
26	002436	兴森科技	700	9,800.00	0.01
27	000423	东阿阿胶	200	9,750.00	0.01
28	300118	东方日升	300	9,741.00	0.01
29	002036	联创电子	400	9,704.00	0.01
30	002610	爱康科技	2,000	9,400.00	0.01
31	002312	川发龙蟒	700	9,156.00	0.01
32	000516	ST 国医	800	8,824.00	0.01
33	601677	明泰铝业	200	8,818.00	0.01
34	000683	远兴能源	1,200	8,760.00	0.01
35	002456	欧菲光	900	8,730.00	0.01
36	300073	当升科技	100	8,687.00	0.01
37	600771	广誉远	200	8,612.00	0.01

38	601222	林洋能源	700	8,491.00	0.01
39	002025	航天电器	100	8,395.00	0.01
40	600559	老白干酒	300	8,382.00	0.01
41	002558	巨人网络	700	8,379.00	0.01
42	002463	沪电股份	500	8,290.00	0.01
43	002245	蔚蓝锂芯	300	8,253.00	0.01
44	002585	双星新材	300	8,124.00	0.01
45	300671	富满微	100	8,105.00	0.01
46	300390	天华超净	100	8,100.00	0.01
47	000155	川能动力	300	7,959.00	0.01
48	300502	新易盛	200	7,836.00	0.01
49	000831	五矿稀土	200	7,804.00	0.01
50	002531	天顺风能	400	7,756.00	0.01
51	600873	梅花生物	1,000	7,670.00	0.01
52	000860	顺鑫农业	200	7,636.00	0.01
53	002617	露笑科技	500	7,600.00	0.01
54	603678	火炬电子	100	7,565.00	0.01
55	300685	艾德生物	100	7,551.00	0.01
56	600338	西藏珠峰	200	7,532.00	0.01
57	600596	新安股份	300	7,497.00	0.01
58	002139	拓邦股份	400	7,476.00	0.01
59	000818	航锦科技	200	7,422.00	0.01
60	300682	朗新科技	200	7,406.00	0.01
61	688033	天宜上佳	224	7,403.20	0.01
62	300054	鼎龙股份	300	7,302.00	0.01
63	000875	吉电股份	800	7,272.00	0.01
64	300567	精测电子	100	7,243.00	0.01
65	600456	宝钛股份	100	7,178.00	0.01
66	002738	中矿资源	100	7,036.00	0.01
67	603039	泛微网络	100	6,977.00	0.01
68	603596	伯特利	100	6,960.00	0.01
69	300339	润和软件	300	6,831.00	0.01
70	300327	中颖电子	100	6,790.00	0.00
71	300373	扬杰科技	100	6,718.00	0.00
72	600641	万业企业	200	6,654.00	0.00
73	600100	同方股份	1,100	6,633.00	0.00
74	300395	菲利华	100	6,574.00	0.00
75	600416	湘电股份	300	6,567.00	0.00
76	603520	司太立	100	6,500.00	0.00
77	601908	京运通	700	6,419.00	0.00
78	000933	神火股份	700	6,363.00	0.00
79	300458	全志科技	100	6,328.00	0.00
80	603688	石英股份	100	6,311.00	0.00

81	002145	中核钛白	500	6,295.00	0.00
82	300623	捷捷微电	200	6,292.00	0.00
83	300777	中简科技	100	6,188.00	0.00
84	300079	数码视讯	700	6,181.00	0.00
85	688106	金宏气体	222	6,173.82	0.00
86	002810	山东赫达	100	6,157.00	0.00
87	300457	赢合科技	200	6,144.00	0.00
88	300035	中科电气	200	6,050.00	0.00
89	300476	胜宏科技	200	6,050.00	0.00
90	300036	超图软件	200	6,010.00	0.00
91	300709	精研科技	100	5,995.00	0.00
92	300747	锐科激光	100	5,911.00	0.00
93	300379	东方通	200	5,906.00	0.00
94	601258	庞大集团	3,600	5,904.00	0.00
95	300432	富临精工	200	5,880.00	0.00
96	000049	德赛电池	100	5,832.00	0.00
97	688158	优刻得	219	5,807.88	0.00
98	300773	拉卡拉	200	5,804.00	0.00
99	300034	钢研高纳	100	5,760.00	0.00
100	300604	长川科技	100	5,750.00	0.00
101	688277	天智航	219	5,748.75	0.00
102	600179	安通控股	1,500	5,715.00	0.00
103	300083	创世纪	400	5,712.00	0.00
104	300393	中来股份	300	5,712.00	0.00
105	600773	西藏城投	200	5,652.00	0.00
106	600882	妙可蓝多	100	5,600.00	0.00
107	601678	滨化股份	700	5,579.00	0.00
108	002389	航天彩虹	200	5,560.00	0.00
109	600151	航天机电	400	5,540.00	0.00
110	000829	天音控股	300	5,532.00	0.00
111	603005	晶方科技	100	5,509.00	0.00
112	002906	华阳集团	100	5,496.00	0.00
113	002091	江苏国泰	400	5,492.00	0.00
114	600777	新潮能源	2,400	5,472.00	0.00
115	002484	江海股份	200	5,464.00	0.00
116	300638	广和通	100	5,450.00	0.00
117	601375	中原证券	1,100	5,401.00	0.00
118	002318	久立特材	300	5,364.00	0.00
119	002541	鸿路钢构	100	5,354.00	0.00
120	002706	良信股份	300	5,346.00	0.00
121	603588	高能环境	300	5,271.00	0.00
122	600277	亿利洁能	1,000	5,270.00	0.00
123	300666	江丰电子	100	5,258.00	0.00

124	300679	电连技术	100	5,250.00	0.00
125	600211	西藏药业	100	5,236.00	0.00
126	600577	精达股份	700	5,208.00	0.00
127	601208	东材科技	300	5,205.00	0.00
128	002747	埃斯顿	200	5,190.00	0.00
129	002123	梦网科技	300	5,160.00	0.00
130	002597	金禾实业	100	5,135.00	0.00
131	601399	国机重装	1,300	5,135.00	0.00
132	600459	贵研铂业	200	5,090.00	0.00
133	000503	国新健康	300	5,070.00	0.00
134	000902	新洋丰	300	5,067.00	0.00
135	300171	东富龙	100	5,054.00	0.00
136	300185	通裕重工	1,400	5,040.00	0.00
137	300755	华致酒行	100	5,008.00	0.00
138	603305	旭升股份	100	4,988.00	0.00
139	603583	捷昌驱动	100	4,963.00	0.00
140	601777	力帆科技	800	4,952.00	0.00
141	601567	三星医疗	300	4,893.00	0.00
142	300775	三角防务	100	4,889.00	0.00
143	600330	天通股份	300	4,869.00	0.00
144	002960	青鸟消防	100	4,855.00	0.00
145	300409	道氏技术	200	4,850.00	0.00
146	300702	天宇股份	100	4,835.00	0.00
147	600378	昊华科技	100	4,820.00	0.00
148	603027	千禾味业	200	4,816.00	0.00
149	603690	至纯科技	100	4,815.00	0.00
150	000035	中国天楹	800	4,808.00	0.00
151	300674	宇信科技	200	4,780.00	0.00
152	600812	华北制药	400	4,768.00	0.00
153	600055	万东医疗	200	4,762.00	0.00
154	002544	杰赛科技	200	4,748.00	0.00
155	603187	海容冷链	100	4,745.00	0.00
156	002675	东诚药业	300	4,734.00	0.00
157	000917	电广传媒	700	4,732.00	0.00
158	002643	万润股份	200	4,728.00	0.00
159	300438	鹏辉能源	100	4,724.00	0.00
160	601137	博威合金	200	4,720.00	0.00
161	603098	森特股份	100	4,697.00	0.00
162	600685	中船防务	200	4,666.00	0.00
163	000650	仁和药业	500	4,660.00	0.00
164	300346	南大光电	100	4,644.00	0.00
165	603279	景津装备	100	4,638.00	0.00
166	600252	中恒集团	1,200	4,632.00	0.00

167	600273	嘉化能源	400	4,628.00	0.00
168	600583	海油工程	1,000	4,610.00	0.00
169	300627	华测导航	100	4,600.00	0.00
170	601311	骆驼股份	300	4,599.00	0.00
171	600210	紫江企业	500	4,590.00	0.00
172	002182	云海金属	200	4,588.00	0.00
173	600612	老凤祥	100	4,585.00	0.00
174	300659	中孚信息	100	4,535.00	0.00
175	300748	金力永磁	100	4,489.00	0.00
176	300596	利安隆	100	4,476.00	0.00
177	300451	创业慧康	400	4,472.00	0.00
178	300470	中密控股	100	4,467.00	0.00
179	603308	应流股份	200	4,464.00	0.00
180	002413	雷科防务	600	4,458.00	0.00
181	300101	振芯科技	200	4,436.00	0.00
182	603179	新泉股份	100	4,328.00	0.00
183	600063	皖维高新	700	4,291.00	0.00
184	300068	南都电源	300	4,248.00	0.00
185	600323	瀚蓝环境	200	4,196.00	0.00
186	601666	平煤股份	500	4,185.00	0.00
187	601126	四方股份	200	4,180.00	0.00
188	600688	上海石化	1,000	4,170.00	0.00
189	603989	艾华集团	100	4,140.00	0.00
190	300768	迪普科技	100	4,125.00	0.00
191	002099	海翔药业	500	4,120.00	0.00
192	600389	江山股份	100	4,112.00	0.00
193	603128	华贸物流	300	4,104.00	0.00
194	300151	昌红科技	100	4,090.00	0.00
195	002837	英维克	100	4,089.00	0.00
196	300236	上海新阳	100	4,085.00	0.00
197	603733	仙鹤股份	100	4,081.00	0.00
198	002773	康弘药业	200	4,070.00	0.00
199	300226	上海钢联	100	4,065.00	0.00
200	002216	三全食品	200	4,042.00	0.00
201	002839	张家港行	700	4,032.00	0.00
202	000672	上峰水泥	200	4,014.00	0.00
203	002291	星期六	200	3,992.00	0.00
204	002171	楚江新材	300	3,978.00	0.00
205	002063	远光软件	400	3,976.00	0.00
206	601212	白银有色	1,300	3,965.00	0.00
207	600366	宁波韵升	300	3,963.00	0.00
208	300027	华谊兄弟	1,000	3,960.00	0.00
209	002332	仙琚制药	300	3,960.00	0.00

210	300803	指南针	100	3,957.00	0.00
211	002214	大立科技	200	3,948.00	0.00
212	002151	北斗星通	100	3,925.00	0.00
213	002254	泰和新材	200	3,922.00	0.00
214	300055	万邦达	300	3,906.00	0.00
215	601369	陕鼓动力	300	3,906.00	0.00
216	603008	喜临门	100	3,903.00	0.00
217	603599	广信股份	100	3,900.00	0.00
218	603915	国茂股份	100	3,890.00	0.00
219	002097	山河智能	400	3,868.00	0.00
220	603919	金徽酒	100	3,861.00	0.00
221	002727	一心堂	100	3,851.00	0.00
222	002807	江阴银行	1,000	3,850.00	0.00
223	600977	中国电影	300	3,843.00	0.00
224	300294	博雅生物	100	3,835.00	0.00
225	603826	坤彩科技	100	3,828.00	0.00
226	601028	玉龙股份	200	3,808.00	0.00
227	002126	银轮股份	300	3,768.00	0.00
228	603876	鼎胜新材	100	3,765.00	0.00
229	601965	中国汽研	200	3,722.00	0.00
230	002859	洁美科技	100	3,720.00	0.00
231	600586	金晶科技	400	3,704.00	0.00
232	603906	龙蟠科技	100	3,704.00	0.00
233	603881	数据港	100	3,692.00	0.00
234	600562	国睿科技	200	3,676.00	0.00
235	300394	天孚通信	100	3,660.00	0.00
236	002239	奥特佳	1,000	3,650.00	0.00
237	603960	克来机电	100	3,638.00	0.00
238	002335	科华数据	100	3,636.00	0.00
239	000426	兴业矿业	500	3,620.00	0.00
240	300323	华灿光电	300	3,618.00	0.00
241	000727	冠捷科技	1,200	3,612.00	0.00
242	300075	数字政通	200	3,600.00	0.00
243	002400	省广集团	700	3,591.00	0.00
244	002984	森麒麟	100	3,557.00	0.00
245	600682	南京新百	300	3,528.00	0.00
246	002163	海南发展	300	3,525.00	0.00
247	600116	三峡水利	300	3,498.00	0.00
248	002217	合力泰	1,000	3,490.00	0.00
249	002135	东南网架	300	3,468.00	0.00
250	600185	格力地产	500	3,455.00	0.00
251	300188	美亚柏科	200	3,438.00	0.00
252	300224	正海磁材	200	3,416.00	0.00



253	600850	电科数字	100	3,413.00	0.00
254	600635	大众公用	900	3,411.00	0.00
255	600490	鹏欣资源	700	3,409.00	0.00
256	600496	精工钢构	800	3,408.00	0.00
257	600057	厦门象屿	400	3,396.00	0.00
258	600320	振华重工	900	3,393.00	0.00
259	000767	晋控电力	900	3,384.00	0.00
260	000951	中国重汽	200	3,378.00	0.00
261	002467	二六三	700	3,374.00	0.00
262	002258	利尔化学	100	3,373.00	0.00
263	002130	沃尔核材	400	3,300.00	0.00
264	002261	拓维信息	400	3,300.00	0.00
265	002015	协鑫能科	200	3,292.00	0.00
266	600075	新疆天业	400	3,288.00	0.00
267	600328	中盐化工	200	3,282.00	0.00
268	600206	有研新材	200	3,276.00	0.00
269	000016	深康佳 A	500	3,275.00	0.00
270	300497	富祥药业	200	3,266.00	0.00
271	603113	金能科技	200	3,260.00	0.00
272	600483	福能股份	200	3,256.00	0.00
273	300131	英唐智控	400	3,256.00	0.00
274	000848	承德露露	300	3,255.00	0.00
275	300737	科顺股份	200	3,250.00	0.00
276	600587	新华医疗	100	3,220.00	0.00
277	002833	弘亚数控	100	3,218.00	0.00
278	603997	继峰股份	200	3,216.00	0.00
279	000657	中钨高新	200	3,216.00	0.00
280	000969	安泰科技	300	3,213.00	0.00
281	002100	天康生物	300	3,210.00	0.00
282	002851	麦格米特	100	3,202.00	0.00
283	300326	凯利泰	300	3,198.00	0.00
284	600246	万通发展	300	3,198.00	0.00
285	300633	开立医疗	100	3,193.00	0.00
286	600305	恒顺醋业	200	3,190.00	0.00
287	601918	新集能源	700	3,178.00	0.00
288	300369	绿盟科技	200	3,172.00	0.00
289	002612	朗姿股份	100	3,171.00	0.00
290	002534	杭锅股份	100	3,169.00	0.00
291	000034	神州数码	200	3,166.00	0.00
292	300219	鸿利智汇	200	3,162.00	0.00
293	600285	羚锐制药	200	3,160.00	0.00
294	600963	岳阳林纸	400	3,152.00	0.00
295	000712	锦龙股份	200	3,150.00	0.00

296	002726	龙大美食	300	3,138.00	0.00
297	300348	长亮科技	200	3,134.00	0.00
298	002626	金达威	100	3,133.00	0.00
299	600877	声光电科	200	3,132.00	0.00
300	002262	恩华药业	200	3,130.00	0.00
301	002108	沧州明珠	400	3,128.00	0.00
302	600720	祁连山	300	3,120.00	0.00
303	600740	山西焦化	500	3,105.00	0.00
304	600363	联创光电	100	3,104.00	0.00
305	600966	博汇纸业	300	3,102.00	0.00
306	000612	焦作万方	400	3,084.00	0.00
307	000811	冰轮环境	200	3,078.00	0.00
308	300287	飞利信	500	3,065.00	0.00
309	603718	海利生物	200	3,060.00	0.00
310	300263	隆华科技	300	3,060.00	0.00
311	300319	麦捷科技	200	3,060.00	0.00
312	300065	海兰信	200	3,052.00	0.00
313	300352	北信源	500	3,050.00	0.00
314	000915	华特达因	100	3,046.00	0.00
315	603801	志邦家居	100	3,042.00	0.00
316	300087	荃银高科	100	3,040.00	0.00
317	000921	海信家电	200	3,030.00	0.00
318	600578	京能电力	900	3,024.00	0.00
319	002891	中宠股份	100	3,024.00	0.00
320	300007	汉威科技	100	3,022.00	0.00
321	600481	双良节能	300	3,018.00	0.00
322	300735	光弘科技	200	3,014.00	0.00
323	300298	三诺生物	100	2,991.00	0.00
324	002567	唐人神	400	2,988.00	0.00
325	000627	天茂集团	900	2,979.00	0.00
326	002639	雪人股份	200	2,974.00	0.00
327	002022	科华生物	200	2,968.00	0.00
328	300639	凯普生物	100	2,951.00	0.00
329	601519	大智慧	400	2,948.00	0.00
330	002759	天际股份	100	2,930.00	0.00
331	002055	得润电子	200	2,922.00	0.00
332	000059	华锦股份	400	2,912.00	0.00
333	300233	金城医药	100	2,909.00	0.00
334	002425	凯撒文化	300	2,892.00	0.00
335	600750	江中药业	200	2,890.00	0.00
336	601001	晋控煤业	300	2,883.00	0.00
337	000801	四川九洲	300	2,877.00	0.00
338	600993	马应龙	100	2,876.00	0.00

339	300401	花园生物	200	2,876.00	0.00
340	603686	福龙马	200	2,872.00	0.00
341	002293	罗莱生活	200	2,866.00	0.00
342	002918	蒙娜丽莎	100	2,863.00	0.00
343	000923	河钢资源	200	2,860.00	0.00
344	002020	京新药业	300	2,853.00	0.00
345	000735	罗牛山	400	2,852.00	0.00
346	603693	江苏新能	100	2,846.00	0.00
347	603565	中谷物流	100	2,839.00	0.00
348	000927	中国铁物	800	2,832.00	0.00
349	002283	天润工业	300	2,832.00	0.00
350	300203	聚光科技	100	2,826.00	0.00
351	002324	普利特	200	2,824.00	0.00
352	300143	盈康生命	200	2,824.00	0.00
353	600123	兰花科创	300	2,811.00	0.00
354	000403	派林生物	100	2,803.00	0.00
355	600391	航发科技	100	2,800.00	0.00
356	600267	海正药业	200	2,798.00	0.00
357	000928	中钢国际	300	2,790.00	0.00
358	603877	太平鸟	100	2,788.00	0.00
359	601890	亚星锚链	300	2,787.00	0.00
360	000543	皖能电力	500	2,780.00	0.00
361	300322	硕贝德	200	2,776.00	0.00
362	300184	力源信息	400	2,776.00	0.00
363	000976	华铁股份	500	2,775.00	0.00
364	600458	时代新材	200	2,770.00	0.00
365	600621	华鑫股份	200	2,768.00	0.00
366	002777	久远银海	100	2,765.00	0.00
367	300149	睿智医药	200	2,762.00	0.00
368	600343	航天动力	200	2,760.00	0.00
369	300867	圣元环保	100	2,757.00	0.00
370	600491	龙元建设	400	2,756.00	0.00
371	300031	宝通科技	100	2,755.00	0.00
372	300762	上海瀚讯	100	2,742.00	0.00
373	000823	超声电子	200	2,724.00	0.00
374	600360	华微电子	300	2,724.00	0.00
375	002023	海特高新	200	2,722.00	0.00
376	300123	亚光科技	300	2,721.00	0.00
377	600797	浙大网新	400	2,720.00	0.00
378	603466	风语筑	100	2,720.00	0.00
379	600197	伊力特	100	2,712.00	0.00
380	002967	广电计量	100	2,708.00	0.00
381	002276	万马股份	300	2,703.00	0.00

382	002421	达实智能	700	2,702.00	0.00
383	300355	蒙草生态	500	2,700.00	0.00
384	002079	苏州固锴	200	2,700.00	0.00
385	300102	乾照光电	300	2,697.00	0.00
386	000546	金圆股份	200	2,686.00	0.00
387	600105	永鼎股份	500	2,685.00	0.00
388	300232	洲明科技	300	2,682.00	0.00
389	603108	润达医疗	200	2,682.00	0.00
390	002310	东方园林	900	2,682.00	0.00
391	002206	海利得	300	2,664.00	0.00
392	002158	汉钟精机	100	2,663.00	0.00
393	002539	云图控股	200	2,654.00	0.00
394	600223	鲁商发展	200	2,650.00	0.00
395	000793	华闻集团	900	2,646.00	0.00
396	601011	宝泰隆	500	2,645.00	0.00
397	603025	大豪科技	100	2,639.00	0.00
398	002488	金固股份	300	2,634.00	0.00
399	300428	立中集团	100	2,630.00	0.00
400	603429	集友股份	100	2,610.00	0.00
401	002698	博实股份	200	2,608.00	0.00
402	600512	腾达建设	800	2,608.00	0.00
403	002979	雷赛智能	100	2,587.00	0.00
404	603033	三维股份	100	2,586.00	0.00
405	002768	国恩股份	100	2,586.00	0.00
406	603610	麒盛科技	100	2,586.00	0.00
407	002498	汉缆股份	500	2,585.00	0.00
408	002930	宏川智慧	100	2,585.00	0.00
409	600169	太原重工	900	2,583.00	0.00
410	601619	嘉泽新能	500	2,580.00	0.00
411	002041	登海种业	100	2,579.00	0.00
412	300170	汉得信息	300	2,577.00	0.00
413	600503	华丽家族	800	2,576.00	0.00
414	002614	奥佳华	200	2,576.00	0.00
415	300191	潜能恒信	100	2,576.00	0.00
416	603916	苏博特	100	2,576.00	0.00
417	002556	辉隆股份	200	2,574.00	0.00
418	000795	英洛华	300	2,565.00	0.00
419	002481	双塔食品	300	2,556.00	0.00
420	603533	掌阅科技	100	2,551.00	0.00
421	000903	云内动力	700	2,548.00	0.00
422	002832	比音勒芬	100	2,545.00	0.00
423	000555	神州信息	200	2,544.00	0.00
424	000682	东方电子	300	2,541.00	0.00

425	600103	青山纸业	900	2,538.00	0.00
426	002274	华昌化工	200	2,534.00	0.00
427	300134	大富科技	200	2,528.00	0.00
428	300091	金通灵	400	2,524.00	0.00
429	002928	华夏航空	200	2,520.00	0.00
430	000603	盛达资源	200	2,516.00	0.00
431	300180	华峰超纤	500	2,515.00	0.00
432	000560	我爱我家	800	2,512.00	0.00
433	300602	飞荣达	100	2,511.00	0.00
434	002518	科士达	100	2,510.00	0.00
435	603018	华设集团	300	2,508.00	0.00
436	600761	安徽合力	200	2,502.00	0.00
437	600810	神马股份	200	2,490.00	0.00
438	603601	再升科技	200	2,482.00	0.00
439	300377	赢时胜	200	2,474.00	0.00
440	600108	亚盛集团	700	2,471.00	0.00
441	002895	川恒股份	100	2,469.00	0.00
442	002961	瑞达期货	100	2,464.00	0.00
443	603393	新天然气	100	2,463.00	0.00
444	000539	粤电力 A	400	2,460.00	0.00
445	300158	振东制药	300	2,457.00	0.00
446	300456	赛微电子	100	2,456.00	0.00
447	600557	康缘药业	200	2,448.00	0.00
448	600059	古越龙山	200	2,446.00	0.00
449	600864	哈投股份	400	2,444.00	0.00
450	000789	万年青	200	2,444.00	0.00
451	600523	贵航股份	100	2,440.00	0.00
452	603323	苏农银行	500	2,435.00	0.00
453	000935	四川双马	100	2,430.00	0.00
454	600073	上海梅林	300	2,427.00	0.00
455	002446	盛路通信	400	2,420.00	0.00
456	300429	强力新材	200	2,420.00	0.00
457	300303	聚飞光电	400	2,416.00	0.00
458	300398	飞凯材料	100	2,416.00	0.00
459	002043	兔宝宝	200	2,416.00	0.00
460	300477	合纵科技	300	2,415.00	0.00
461	000582	北部湾港	300	2,412.00	0.00
462	300119	瑞普生物	100	2,412.00	0.00
463	600531	豫光金铅	400	2,412.00	0.00
464	603043	广州酒家	100	2,406.00	0.00
465	300378	鼎捷软件	100	2,400.00	0.00
466	002428	云南锗业	200	2,400.00	0.00
467	600770	综艺股份	300	2,397.00	0.00

468	600742	一汽富维	200	2,392.00	0.00
469	600751	海航科技	800	2,384.00	0.00
470	601952	苏垦农发	200	2,382.00	0.00
471	002226	江南化工	400	2,380.00	0.00
472	603728	鸣志电器	100	2,371.00	0.00
473	300267	尔康制药	500	2,370.00	0.00
474	300222	科大智能	200	2,362.00	0.00
475	600295	鄂尔多斯	100	2,359.00	0.00
476	600114	东睦股份	200	2,350.00	0.00
477	603337	杰克股份	100	2,345.00	0.00
478	600552	凯盛科技	200	2,344.00	0.00
479	002351	漫步者	200	2,344.00	0.00
480	300525	博思软件	100	2,338.00	0.00
481	002237	恒邦股份	200	2,338.00	0.00
482	002649	博彦科技	200	2,336.00	0.00
483	603730	岱美股份	100	2,332.00	0.00
484	000676	智度股份	300	2,331.00	0.00
485	300045	华力创通	200	2,326.00	0.00
486	002733	雄韬股份	100	2,313.00	0.00
487	002106	莱宝高科	200	2,302.00	0.00
488	002605	姚记科技	100	2,273.00	0.00
489	600217	中再资环	300	2,271.00	0.00
490	300738	奥飞数据	100	2,270.00	0.00
491	300441	鲍斯股份	200	2,258.00	0.00
492	300132	青松股份	200	2,258.00	0.00
493	601929	吉视传媒	1,000	2,250.00	0.00
494	600789	鲁抗医药	300	2,247.00	0.00
495	600984	建设机械	200	2,240.00	0.00
496	600331	宏达股份	700	2,233.00	0.00
497	002611	东方精工	400	2,232.00	0.00
498	603920	世运电路	100	2,230.00	0.00
499	002232	启明信息	100	2,226.00	0.00
500	000030	富奥股份	300	2,226.00	0.00
501	300078	思创医惠	300	2,214.00	0.00
502	000592	平潭发展	700	2,212.00	0.00
503	603566	普莱柯	100	2,210.00	0.00
504	600422	昆药集团	200	2,210.00	0.00
505	300523	辰安科技	100	2,210.00	0.00
506	603766	隆鑫通用	400	2,204.00	0.00
507	000966	长源电力	300	2,199.00	0.00
508	300684	中石科技	100	2,194.00	0.00
509	001696	宗申动力	300	2,181.00	0.00
510	600395	盘江股份	300	2,181.00	0.00

511	300109	新 开 源	100	2,180.00	0.00
512	000989	九 芝 堂	200	2,172.00	0.00
513	300208	青岛中程	200	2,168.00	0.00
514	000615	奥园美谷	200	2,156.00	0.00
515	002449	国星光电	200	2,156.00	0.00
516	603979	金 诚 信	100	2,148.00	0.00
517	600662	外服控股	300	2,148.00	0.00
518	600997	开滦股份	300	2,136.00	0.00
519	002581	未名医药	100	2,135.00	0.00
520	300439	美康生物	100	2,131.00	0.00
521	002537	海联金汇	300	2,130.00	0.00
522	002803	吉宏股份	100	2,123.00	0.00
523	300663	科蓝软件	100	2,121.00	0.00
524	000088	盐 田 港	400	2,120.00	0.00
525	002201	正威新材	100	2,102.00	0.00
526	002646	青青稞酒	100	2,099.00	0.00
527	002741	光华科技	100	2,098.00	0.00
528	601330	绿色动力	200	2,088.00	0.00
529	600502	安徽建工	500	2,075.00	0.00
530	600420	国药现代	200	2,074.00	0.00
531	000032	深桑达 A	100	2,074.00	0.00
532	300229	拓 尔 思	200	2,070.00	0.00
533	300527	中船应急	200	2,068.00	0.00
534	000901	航天科技	200	2,066.00	0.00
535	600477	杭萧钢构	500	2,065.00	0.00
536	300572	安车检测	100	2,065.00	0.00
537	600125	铁龙物流	400	2,064.00	0.00
538	688166	博瑞医药	56	2,055.76	0.00
539	300368	汇金股份	200	2,054.00	0.00
540	603612	索通发展	100	2,052.00	0.00
541	603609	禾丰股份	200	2,048.00	0.00
542	300194	福安药业	400	2,048.00	0.00
543	300673	佩蒂股份	100	2,048.00	0.00
544	300006	莱美药业	300	2,046.00	0.00
545	300531	优 博 讯	100	2,043.00	0.00
546	002437	誉衡药业	700	2,037.00	0.00
547	000828	东莞控股	200	2,036.00	0.00
548	300053	欧 比 特	200	2,034.00	0.00
549	002218	拓日新能	300	2,028.00	0.00
550	600428	中远海特	400	2,016.00	0.00
551	600452	涪陵电力	100	2,014.00	0.00
552	603387	基蛋生物	100	2,006.00	0.00
553	300215	电 科 院	200	2,006.00	0.00

554	600775	南京熊猫	200	1,990.00	0.00
555	002664	长鹰信质	100	1,985.00	0.00
556	601588	北辰实业	800	1,984.00	0.00
557	600480	凌云股份	200	1,982.00	0.00
558	300406	九强生物	100	1,982.00	0.00
559	300831	派瑞股份	100	1,975.00	0.00
560	000810	创维数字	200	1,970.00	0.00
561	600017	日照港	700	1,967.00	0.00
562	002285	世联行	500	1,960.00	0.00
563	300145	中金环境	600	1,956.00	0.00
564	600694	大商股份	100	1,951.00	0.00
565	600602	云赛智联	300	1,950.00	0.00
566	002516	旷达科技	300	1,947.00	0.00
567	601015	陕西黑猫	300	1,944.00	0.00
568	000710	贝瑞基因	100	1,940.00	0.00
569	000507	珠海港	300	1,938.00	0.00
570	600326	西藏天路	300	1,935.00	0.00
571	002647	仁东控股	200	1,932.00	0.00
572	002550	千红制药	400	1,932.00	0.00
573	603060	国检集团	100	1,930.00	0.00
574	600933	爱柯迪	100	1,928.00	0.00
575	000881	中广核技	200	1,926.00	0.00
576	000061	农产品	300	1,917.00	0.00
577	603587	地素时尚	100	1,916.00	0.00
578	000667	美好置业	1,100	1,914.00	0.00
579	300520	科大国创	100	1,912.00	0.00
580	603118	共进股份	200	1,912.00	0.00
581	300284	苏交科	300	1,911.00	0.00
582	002035	华帝股份	300	1,908.00	0.00
583	002292	奥飞娱乐	300	1,899.00	0.00
584	600284	浦东建设	300	1,896.00	0.00
585	002222	福晶科技	100	1,893.00	0.00
586	300177	中海达	200	1,892.00	0.00
587	002376	新北洋	200	1,886.00	0.00
588	000968	蓝焰控股	200	1,870.00	0.00
589	600581	八一钢铁	300	1,863.00	0.00
590	600308	华泰股份	300	1,857.00	0.00
591	300238	冠昊生物	100	1,853.00	0.00
592	300039	上海凯宝	300	1,848.00	0.00
593	603222	济民医疗	100	1,840.00	0.00
594	300016	北陆药业	200	1,836.00	0.00
595	300386	飞天诚信	100	1,829.00	0.00
596	002042	华孚时尚	400	1,828.00	0.00



597	300821	东岳硅材	100	1,828.00	0.00
598	002545	东方铁塔	200	1,824.00	0.00
599	300183	东软载波	100	1,823.00	0.00
600	603169	兰石重装	200	1,822.00	0.00
601	002461	珠江啤酒	200	1,820.00	0.00
602	605388	均瑶健康	100	1,819.00	0.00
603	002320	海峡股份	300	1,800.00	0.00
604	000851	高鸿股份	300	1,794.00	0.00
605	002782	可立克	100	1,787.00	0.00
606	000567	海德股份	100	1,785.00	0.00
607	000006	深振业 A	400	1,784.00	0.00
608	601827	三峰环境	200	1,784.00	0.00
609	601963	重庆银行	200	1,780.00	0.00
610	300020	银江技术	200	1,770.00	0.00
611	300114	中航电测	100	1,768.00	0.00
612	300204	舒泰神	100	1,755.00	0.00
613	600337	美克家居	500	1,755.00	0.00
614	600261	阳光照明	400	1,752.00	0.00
615	300080	易成新能	300	1,746.00	0.00
616	600855	航天长峰	100	1,738.00	0.00
617	000036	华联控股	400	1,736.00	0.00
618	600335	国机汽车	200	1,736.00	0.00
619	002677	浙江美大	100	1,735.00	0.00
620	300634	彩讯股份	100	1,733.00	0.00
621	603313	梦百合	100	1,731.00	0.00
622	000048	京基智农	100	1,731.00	0.00
623	601609	金田铜业	200	1,730.00	0.00
624	002034	旺能环境	100	1,727.00	0.00
625	000652	泰达股份	400	1,724.00	0.00
626	000697	炼石航空	200	1,724.00	0.00
627	603936	博敏电子	100	1,720.00	0.00
628	000882	华联股份	900	1,719.00	0.00
629	002234	民和股份	100	1,716.00	0.00
630	603298	杭叉集团	100	1,715.00	0.00
631	600565	迪马股份	700	1,708.00	0.00
632	002635	安洁科技	100	1,703.00	0.00
633	000900	现代投资	400	1,688.00	0.00
634	000557	西部创业	400	1,684.00	0.00
635	600575	淮河能源	700	1,680.00	0.00
636	600550	保变电气	300	1,677.00	0.00
637	002301	齐心集团	200	1,674.00	0.00
638	002061	浙江交科	300	1,674.00	0.00
639	600715	文投控股	500	1,665.00	0.00

640	002378	章源钨业	200	1,664.00	0.00
641	603105	芯能科技	100	1,662.00	0.00
642	600590	泰豪科技	200	1,654.00	0.00
643	300657	弘信电子	100	1,651.00	0.00
644	002737	葵花药业	100	1,646.00	0.00
645	002515	金字火腿	300	1,644.00	0.00
646	002838	道恩股份	100	1,640.00	0.00
647	002950	奥美医疗	100	1,635.00	0.00
648	300311	任子行	200	1,634.00	0.00
649	600846	同济科技	200	1,632.00	0.00
650	000550	江铃汽车	100	1,631.00	0.00
651	002695	煌上煌	100	1,631.00	0.00
652	000813	德展健康	400	1,628.00	0.00
653	601515	东风股份	200	1,626.00	0.00
654	300255	常山药业	200	1,626.00	0.00
655	600748	上实发展	400	1,620.00	0.00
656	600098	广州发展	200	1,616.00	0.00
657	600604	市北高新	300	1,611.00	0.00
658	002367	康力电梯	200	1,606.00	0.00
659	600184	光电股份	100	1,603.00	0.00
660	300607	拓斯达	100	1,600.00	0.00
661	002792	通宇通讯	100	1,600.00	0.00
662	603328	依顿电子	200	1,600.00	0.00
663	300292	吴通控股	400	1,596.00	0.00
664	002697	红旗连锁	300	1,596.00	0.00
665	300740	水羊股份	100	1,589.00	0.00
666	002435	长江健康	300	1,581.00	0.00
667	603439	贵州三力	100	1,578.00	0.00
668	603959	百利科技	100	1,576.00	0.00
669	000566	海南海药	300	1,575.00	0.00
670	300307	慈星股份	200	1,574.00	0.00
671	002589	瑞康医药	400	1,572.00	0.00
672	300047	天源迪科	200	1,572.00	0.00
673	300328	宜安科技	200	1,570.00	0.00
674	300388	节能国祯	200	1,570.00	0.00
675	300266	兴源环境	400	1,560.00	0.00
676	600032	浙江新能	100	1,546.00	0.00
677	688055	龙腾光电	225	1,541.25	0.00
678	000601	韶能股份	300	1,536.00	0.00
679	000931	中关村	200	1,534.00	0.00
680	300765	新诺威	100	1,534.00	0.00
681	300085	银之杰	100	1,532.00	0.00
682	000950	重药控股	300	1,530.00	0.00

683	000958	东方能源	300	1,530.00	0.00
684	300397	天和防务	100	1,529.00	0.00
685	000600	建投能源	300	1,527.00	0.00
686	000796	凯撒旅业	200	1,526.00	0.00
687	002298	中电兴发	200	1,518.00	0.00
688	002017	东信和平	100	1,517.00	0.00
689	300846	首都在线	100	1,512.00	0.00
690	002973	侨银股份	100	1,511.00	0.00
691	600894	广日股份	200	1,508.00	0.00
692	300066	三川智慧	300	1,506.00	0.00
693	002636	金安国纪	100	1,505.00	0.00
694	002562	兄弟科技	300	1,497.00	0.00
695	000025	特力A	100	1,496.00	0.00
696	600510	黑牡丹	200	1,496.00	0.00
697	600569	安阳钢铁	500	1,495.00	0.00
698	600929	雪天盐业	200	1,492.00	0.00
699	002798	帝欧家居	100	1,487.00	0.00
700	605008	长鸿高科	100	1,477.00	0.00
701	002267	陕天然气	200	1,474.00	0.00
702	002672	东江环保	200	1,472.00	0.00
703	002344	海宁皮城	300	1,470.00	0.00
704	300130	新国都	100	1,468.00	0.00
705	603808	歌力思	100	1,459.00	0.00
706	002573	清新环境	200	1,456.00	0.00
707	300423	昇辉科技	100	1,451.00	0.00
708	002383	合众思壮	200	1,448.00	0.00
709	300110	华仁药业	300	1,440.00	0.00
710	600007	中国国贸	100	1,440.00	0.00
711	603359	东珠生态	100	1,430.00	0.00
712	002489	浙江永强	400	1,428.00	0.00
713	002522	浙江众成	200	1,420.00	0.00
714	000913	钱江摩托	100	1,419.00	0.00
715	600874	创业环保	200	1,414.00	0.00
716	300448	浩云科技	200	1,408.00	0.00
717	300206	理邦仪器	100	1,408.00	0.00
718	000688	国城矿业	100	1,398.00	0.00
719	300805	电声股份	100	1,396.00	0.00
720	600624	复旦复华	200	1,386.00	0.00
721	002717	岭南股份	400	1,380.00	0.00
722	600746	江苏索普	100	1,380.00	0.00
723	600916	中国黄金	100	1,373.00	0.00
724	003012	东鹏控股	100	1,372.00	0.00
725	601163	三角轮胎	100	1,371.00	0.00

726	000791	甘肃电投	200	1,368.00	0.00
727	002251	步步高	200	1,364.00	0.00
728	002547	春兴精工	300	1,362.00	0.00
729	300664	鹏鹞环保	200	1,360.00	0.00
730	603093	南华期货	100	1,358.00	0.00
731	600975	新五丰	200	1,358.00	0.00
732	002309	中利集团	200	1,352.00	0.00
733	000910	大亚圣象	100	1,341.00	0.00
734	300205	天喻信息	100	1,338.00	0.00
735	002651	利君股份	100	1,323.00	0.00
736	002530	金财互联	200	1,320.00	0.00
737	300485	赛升药业	100	1,319.00	0.00
738	601886	江河集团	200	1,318.00	0.00
739	300276	三丰智能	300	1,317.00	0.00
740	300510	金冠股份	200	1,314.00	0.00
741	600710	苏美达	200	1,308.00	0.00
742	002204	大连重工	300	1,305.00	0.00
743	002277	友阿股份	400	1,304.00	0.00
744	000070	特发信息	200	1,300.00	0.00
745	601606	长城军工	100	1,299.00	0.00
746	600971	恒源煤电	200	1,292.00	0.00
747	600783	鲁信创投	100	1,292.00	0.00
748	301039	中集车辆	100	1,283.00	0.00
749	601158	重庆水务	200	1,282.00	0.00
750	000544	中原环保	200	1,280.00	0.00
751	002662	京威股份	300	1,278.00	0.00
752	002215	诺普信	200	1,276.00	0.00
753	002755	奥赛康	100	1,273.00	0.00
754	603363	傲农生物	100	1,270.00	0.00
755	000761	本钢板材	300	1,260.00	0.00
756	000936	华西股份	200	1,254.00	0.00
757	600618	氯碱化工	100	1,241.00	0.00
758	000498	山东路桥	200	1,236.00	0.00
759	601700	风范股份	200	1,230.00	0.00
760	601069	西部黄金	100	1,229.00	0.00
761	300190	维尔利	200	1,220.00	0.00
762	300366	创意信息	100	1,212.00	0.00
763	603626	科森科技	100	1,209.00	0.00
764	002941	新疆交建	100	1,209.00	0.00
765	300349	金卡智能	100	1,205.00	0.00
766	600449	宁夏建材	100	1,203.00	0.00
767	002479	富春环保	200	1,188.00	0.00
768	002542	中化岩土	400	1,180.00	0.00

769	601949	中国出版	200	1,168.00	0.00
770	600622	光大嘉宝	400	1,168.00	0.00
771	000011	深物业 A	100	1,166.00	0.00
772	002596	海南瑞泽	300	1,131.00	0.00
773	002243	力合科创	100	1,129.00	0.00
774	601528	瑞丰银行	100	1,128.00	0.00
775	002911	佛燃能源	100	1,120.00	0.00
776	002641	永高股份	200	1,096.00	0.00
777	002228	合兴包装	300	1,095.00	0.00
778	300455	康拓红外	100	1,087.00	0.00
779	002194	武汉凡谷	100	1,084.00	0.00
780	601595	上海电影	100	1,082.00	0.00
781	002303	美盈森	300	1,077.00	0.00
782	300365	恒华科技	100	1,075.00	0.00
783	600636	国新文化	100	1,074.00	0.00
784	000885	城发环境	100	1,060.00	0.00
785	603053	成都燃气	100	1,039.00	0.00
786	002793	罗欣药业	100	1,037.00	0.00
787	300302	同有科技	100	1,029.00	0.00
788	000639	西王食品	200	1,016.00	0.00
789	603869	新智认知	100	1,002.00	0.00
790	600548	深高速	100	998.00	0.00
791	300318	博晖创新	100	991.00	0.00
792	601686	友发集团	100	980.00	0.00
793	600054	黄山旅游	100	977.00	0.00
794	002609	捷顺科技	100	975.00	0.00
795	871245	威博液压	100	968.00	0.00
796	601921	浙版传媒	100	963.00	0.00
797	603299	苏盐井神	100	956.00	0.00
798	600800	渤海化学	200	946.00	0.00
799	600825	新华传媒	200	944.00	0.00
800	002314	南山控股	300	936.00	0.00
801	603636	南威软件	100	894.00	0.00
802	300252	金信诺	100	892.00	0.00
803	601858	中国科传	100	882.00	0.00
804	002582	好想你	100	870.00	0.00
805	000065	北方国际	100	858.00	0.00
806	002307	北新路桥	200	854.00	0.00
807	603887	城地香江	100	812.00	0.00
808	603815	交建股份	100	797.00	0.00
809	000797	中国武夷	300	783.00	0.00
810	601279	英利汽车	100	759.00	0.00
811	000918	嘉凯城	300	747.00	0.00

812	000517	荣安地产	300	738.00	0.00
813	000019	深粮控股	100	696.00	0.00
814	000058	深赛格	100	673.00	0.00
815	600686	金龙汽车	100	628.00	0.00
816	600738	丽尚国潮	100	608.00	0.00
817	002616	长青集团	100	608.00	0.00
818	688007	光峰科技	17	583.95	0.00
819	002969	嘉美包装	100	569.00	0.00
820	600248	陕西建工	100	480.00	0.00
821	688505	复旦张江	16	225.60	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。

## 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	603026	石大胜华	1,108,783.00	0.82
2	688005	容百科技	868,901.20	0.64
3	603185	上机数控	754,789.00	0.56
4	603345	安井食品	622,889.00	0.46
5	601058	赛轮轮胎	617,069.00	0.45
6	603127	昭衍新药	606,562.60	0.45
7	600499	科达制造	601,317.00	0.44
8	603236	移远通信	598,497.00	0.44
9	603267	鸿远电子	583,998.68	0.43
10	688122	西部超导	572,319.28	0.42
11	600711	盛屯矿业	554,254.00	0.41
12	600110	诺德股份	547,981.00	0.40
13	603613	国联股份	500,587.20	0.37
14	603456	九洲药业	464,808.00	0.34
15	601677	明泰铝业	451,408.00	0.33
16	600096	云天化	448,361.00	0.33
17	600338	西藏珠峰	442,486.00	0.33
18	600882	妙可蓝多	419,736.00	0.31
19	600596	新安股份	409,828.00	0.30
20	603678	火炬电子	397,552.00	0.29

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	600499	科达制造	236,041.00	0.17
2	603236	移远通信	217,809.00	0.16
3	603026	石大胜华	216,553.00	0.16
4	601058	赛轮轮胎	204,741.00	0.15
5	688122	西部超导	196,702.86	0.14
6	603678	火炬电子	172,836.00	0.13
7	600711	盛屯矿业	157,030.00	0.12
8	601677	明泰铝业	149,486.00	0.11
9	603606	东方电缆	145,679.00	0.11
10	603005	晶方科技	145,203.00	0.11
11	600110	诺德股份	144,276.00	0.11
12	600641	万业企业	138,426.72	0.10
13	600096	云天化	131,697.00	0.10
14	605111	新洁能	130,137.00	0.10
15	600338	西藏珠峰	130,023.00	0.10
16	601222	林洋能源	122,940.00	0.09
17	600559	老白干酒	121,292.00	0.09
18	600456	宝钛股份	118,082.00	0.09
19	603596	伯特利	116,062.00	0.09
20	603906	龙蟠科技	114,513.00	0.08

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	58,122,547.66
卖出股票收入（成交）总额	21,270,380.33

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

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	5,001,500.00	3.68
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,001,500.00	3.68

#### 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

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	019654	21 国债 06	50,000	5,001,500.00	3.68

#### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 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
IC2201	IC2201	2	2,951,120.00	35,540.00	-
公允价值变动总额合计（元）					35,540.00
股指期货投资本期收益（元）					142,854.37
股指期货投资本期公允价值变动（元）					35,540.00

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。



## 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

## 8.12 本报告期投资基金情况

### 8.12.1 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 1000ETF	股票型	交易型开 放式 (ETF)	南方基金 管理股份 有限公司	123,087,41 7.10	90.51

## 8.13 投资组合报告附注

### 8.13.1 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江特电机（证券代码 002176）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。

江特电机 2021 年 12 月 10 日公告称，因未及时披露公司重大事项，中国证券监督管理委员会对公司立案调查。

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。

### 8.13.2 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。

### 8.13.3 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	442,494.27
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	84,128.64
5	应收申购款	306,979.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	1,022,968.36
9	合计	1,856,571.13

### 8.13.4 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。

### 8.13.5 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	600072	中船科技	16,115.00	0.01	重大事项停牌

## § 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

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1000ETF发起式联接A	2,455	26,328.53	10,597,879.23	16.40%	54,038,672.74	83.60%
南方中证1000ETF发起式联接C	1,528	41,019.23	26,760,209.58	42.70%	35,917,174.94	57.30%
合计	3,983	31,964.33	37,358,088.81	29.34%	89,955,847.68	70.66%

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。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
----	------	-----------	----------

基金管理人所有从业人员持有本基金	南方中证 1000ETF 发起式联接 A	-	-
	南方中证 1000ETF 发起式联接 C	118,059.87	0.1884%
	合计	118,059.87	0.0927%

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

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	南方中证 1000ETF 发起式联接 A	0
	南方中证 1000ETF 发起式联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	南方中证 1000ETF 发起式联接 A	0
	南方中证 1000ETF 发起式联接 C	10~50
	合计	10~50

### 9.4 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	10,003,819.82	7.86	10,000,000.00	7.85	自合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	100,013.88	0.08	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,103,833.70	7.94	10,000,000.00	7.85	-

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方中证 1000ETF 发起式 联接 A	南方中证 1000ETF 发起式 联接 C
基金合同生效日(2021 年 9 月 27 日)基金份额总额	93,484,707.13	111,715,573.28
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,991,548.66	58,727,865.55
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	33,839,703.82	107,766,054.31
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	64,636,551.97	62,677,384.52

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

### 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

因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长张海波先生病逝缺位，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先生兼任首席信息官。

自 2021 年 10 月 27 日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 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 35,000.00 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

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。

## 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	79,390,991.69	100.00%	7,939.78	100.00%	-
兴业证券	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：

华泰证券

兴业证券

退租交易单元：

无

### 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		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
华泰证券	5,004,950.00	100.00%	68,000,000.00	100.00%	-	-	175,798,904.11	100.00%
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同及招募说明书提示性公告	、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-08-31
2	南方基金关于南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金增加销售机构的公告	、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-09-08
3	南方基金关于旗下电子直销平台部分基金相关调整的公告	、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-09-10
4	南方基金关于南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金增加销售机构的公告	、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-09-11
5	南方基金关于南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金增加销售机构的公告	、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-09-13
6	南方基金关于南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金增加销售机构的公告	、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-09-15
7	关于南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金调整募集期的公告	、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-09-15

8	南方基金关于南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金增加销售机构的公告	、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-09-23
9	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-10-13

## § 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 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的文件；

2、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》；

3、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；

6、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 2021 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>