

南方中证互联网指数分级证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 27 日

重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	39

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	39
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 投资组合报告附注.....	39
§ 8 基金份额持有人信息.....	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	42
§ 9 开放式基金份额变动.....	42
§ 10 重大事件揭示.....	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	44
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	45
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	45
§ 12 备查文件目录.....	46
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证互联网指数分级证券投资基金		
基金简称	南方中证互联网指数分级		
场内简称	互联基金		
基金主代码	160137		
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）		
基金合同生效日	2015 年 7 月 1 日		
基金管理人	南方基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	272,606,298.56 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015 年 7 月 13 日		
下属分级基金的基金简称	南方中证互联网指数分级	互联 A 级	互联 B 级
下属分级基金的场内简称	互联基金	互联 A 级	互联 B 级
下属分级基金的交易代码	160137	150297	150298
报告期末下属分级基金的份 额总额	248,518,629.56 份	12,043,834.00 份	12,043,835.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，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	<p>本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，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。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、</p>

	跟踪误差进一步扩大。		
业绩比较基准	中证互联网指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。		
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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。同时本基金为指数型基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。		
	南方中证互联网指数分级	互联 A 级	互联 B 级
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于股票型基金，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。同时本基金为指数型基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。	互联网 A 份额为稳健收益类份额，具有低预期风险且预期收益相对较低的特征。	互联网 B 份额为积极收益类份额，具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95599
传真	0755-82763889	010-68121816
注册地址	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518048	100031
法定代表人	张海波	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)
本期已实现收益	-6,460,298.98
本期利润	-33,746,275.70
加权平均基金份额本期利润	-0.1209
本期加权平均净值利润率	-15.56%
本期基金份额净值增长率	-15.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配利润	-64,779,790.67
期末可供分配基金份额利润	-0.2376
期末基金资产净值	185,126,986.06
期末基金份额净值	0.6791
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-25.92%

注:1. 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。

2. 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(为期末余额,不是当期发生数)。

3. 所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。

3.2 基金净值表现

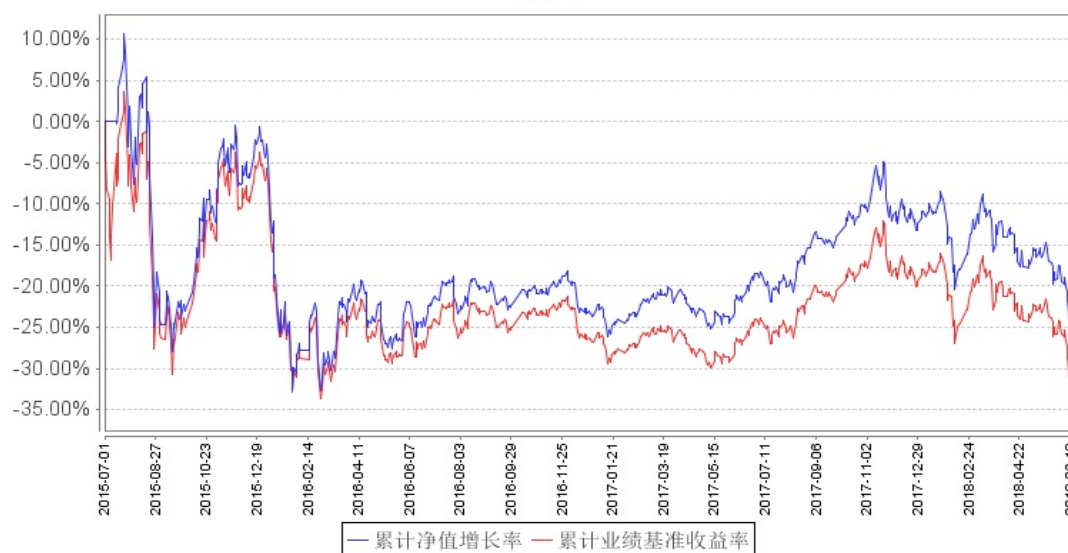
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-9.31%	1.81%	-10.42%	1.87%	1.11%	-0.06%
过去三个月	-15.51%	1.38%	-16.46%	1.41%	0.95%	-0.03%
过去六个月	-15.36%	1.43%	-16.69%	1.44%	1.33%	-0.01%
过去一年	-9.20%	1.22%	-11.56%	1.22%	2.36%	0.00%

自基金合同生效起至今	-25.92%	1.70%	-32.82%	1.70%	6.90%	0.00%
------------	---------	-------	---------	-------	-------	-------

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

南方中证互联网指数分级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，注册资本金3亿元人民币。目前股权结构：华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，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）管理资产规模近7,800亿元，旗下管理167只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金和专户理财投资组合。

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		
周豪	本基金基金经理	2016年8月19日	-	9	北京大学软件工程专业硕士，具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金信息技术部，长期负责指数基金及ETF基金的投研及系统支持工作；2015年6月，任数量化投资部高级研究员；2016年4月至今，任500工业ETF、500原材料ETF基金经理；2016年8月至今，任380ETF、南方380、小康ETF、南方小康、互联基金基金经理；2016年9月至今，任1000ETF基金经理；2017年8月至今，任南方有色金属基金经理；2017年9月至今，任南方有色金属联接基金经理；2018年1月至今，任南方中证100基金经理；2018年2月至今，任南方消费活力基金经理。

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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《南方中证互联网指数分级证券投资基金基金合同》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，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为指数分级基金，在基础份额之外，还设计了配比为1:1的互联A级和互联B级两类子份额，并于深交所上市。上市交易的开放式基金都存在两套价格体系，分别是上市价格体系和净值价格体系，两者之间折溢价关系的明确可预期是交易型投资者的基础需求，长期配置型投资者（主要为场外份额投资者）也希望通过投资本基金获取贴近指数的投资回报。所以，我们一直致力于为投资者提供准确、透明的指数化投资工具，不管遭遇市场剧烈波动、大额申赎还是不定期折算，都始终坚守被动投资理念，力争将投资中的主动判断和操作降至最低限度，更不会主动进行大幅增减仓操作。我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：（1）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）报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离。（3）根据指数每半年度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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为0.6791元，报告期内，份额净值增长率为-15.36%，同期业绩基准增长率为-16.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观来看，国内经济增速预计平稳回落，企业盈利小幅下行，利率水平在外围美联储加息、内在降成本需求下，预计边际有所放松但空间不大，政策重点还是调结构、防风险。中美贸易冲突预计仍有反复，不过冲突继续扩大的可能性较小，且市场预期已较为充分，料相关因素影响将减弱。证券市场经过调整，风险得到一定释放，配置价值在提升，同时近期政策面也释放出积极信号，预计市场短期将迎来一定机会。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，实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在存续期内，本基金（包括南方互联网份额、互联网 A 份额、互联网 B 份额）不进行收益分配；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方中证互联网指数分级证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.4.1	10,138,731.65	12,519,114.39
结算备付金		60,897.82	64,602.87
存出保证金		8,946.96	25,014.47
交易性金融资产	6.4.4.2	175,474,663.80	221,393,570.52
其中：股票投资		175,473,878.28	221,393,570.52
基金投资		-	-
债券投资		785.52	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		-	677,418.91
应收利息	6.4.4.5	1,998.94	2,583.09
应收股利		-	-
应收申购款		105,935.87	18,621.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		185,791,175.04	234,700,925.26

负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		0.38	-
应付赎回款		209,880.33	994,833.97
应付管理人报酬		160,203.14	202,162.22
应付托管费		35,244.67	44,475.69
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	2,936.85	6,162.63
应交税费		2.21	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	255,921.40	404,121.56
负债合计		664,188.98	1,651,756.07
所有者权益:			
实收基金	6.4.4.9	249,906,776.73	266,288,306.76
未分配利润	6.4.4.10	-64,779,790.67	-33,239,137.57
所有者权益合计		185,126,986.06	233,049,169.19
负债和所有者权益总计		185,791,175.04	234,700,925.26

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额 272,606,298.56 份，其中南方中证互联网指数分级证券投资基金之基础份额的份额总额为 248,518,629.56 份，基金份额净值 0.6791 元；南方中证互联网指数分级证券投资基金之 A 份额的份额总额为 12,043,834.00 份，基金份额参考净值 1.0318 元；南方中证互联网指数分级证券投资基金之 B 份额的份额总额为 12,043,835.00 份，基金份额参考净值 0.3264 元。

6.2 利润表

会计主体：南方中证互联网指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-32,092,577.61	19,840,175.57
1. 利息收入		46,283.78	159,278.13
其中：存款利息收入	6.4.4.11	46,222.02	74,942.81

债券利息收入		61.76	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	84,335.32
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,869,226.57	4,426,484.19
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-6,372,374.52	3,096,131.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	-13,151.16	-
资产支持证券投资	6.4.4.13.1	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.4.14	-	-
衍生工具收益	6.4.4.15	-	-
股利收益	6.4.4.16	1,516,299.11	1,330,352.56
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.17	-27,285,976.72	15,198,271.37
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	16,341.90	56,141.88
减：二、费用		1,653,698.09	2,085,006.08
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	1,072,970.41	1,371,918.18
2. 托管费	6.4.7.2.2	236,053.53	301,822.02
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.4.19	37,559.67	97,807.13
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.23	-
7. 其他费用	6.4.4.20	307,114.25	313,458.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-33,746,275.70	17,755,169.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-33,746,275.70	17,755,169.49

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证互联网指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	266,288,306.76	-33,239,137.57	233,049,169.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-33,746,275.70	-33,746,275.70
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)	-16,381,530.03	2,205,622.60	-14,175,907.43
其中: 1. 基金申购款	16,810,127.27	-2,517,207.14	14,292,920.13
2. 基金赎回款	-33,191,657.30	4,722,829.74	-28,468,827.56
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)	249,906,776.73	-64,779,790.67	185,126,986.06
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	382,267,174.11	-90,170,312.39	292,096,861.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,755,169.49	17,755,169.49
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)	-58,790,955.62	12,835,136.83	-45,955,818.79
其中: 1. 基金申购款	8,863,472.73	-2,036,673.46	6,826,799.27
2. 基金赎回款	-67,654,428.35	14,871,810.29	-52,782,618.06
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	323,476,218.49	-59,580,006.07	263,896,212.42

注:-

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>杨小松</u>	<u>徐超</u>	<u>徐超</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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：

(a) 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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税，对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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他

收入，暂不征收企业所得税。

(c)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。

(d)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。

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

6.4.4 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
活期存款	10,138,731.65
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个月及以上	-
其他存款	-
合计	10,138,731.65

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	202,344,024.12	175,473,878.28	-26,870,145.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	900.00	785.52
	银行间市场	-	-
	合计	900.00	785.52
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	202,344,924.12	175,474,663.80	-26,870,260.32

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

注:无。

6.4.4.4 买入返售金融资产**6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注:无。

6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注:无。

6.4.4.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	1,964.60
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	30.05
应收债券利息	0.60
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	-
其他	3.69
合计	1,998.94

6.4.4.6 其他资产

注:无。

6.4.4.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,936.85
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,936.85

6.4.4.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	622.15

预提费用	205,299.25
应付指数使用费	50,000.00
合计	255,921.40

6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	290,475,669.73	266,288,306.76
本期申购	18,337,101.06	16,810,127.27
本期赎回（以“-”号填列）	-36,206,472.23	-33,191,657.30
本期末	272,606,298.56	249,906,776.73

注：申购含配对转入份额；赎回含配对转出份额。

6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-22,744,443.29	-10,494,694.28	-33,239,137.57
本期利润	-6,460,298.98	-27,285,976.72	-33,746,275.70
本期基金份额交易产生的变动数	1,482,785.69	722,836.91	2,205,622.60
其中：基金申购款	-1,631,178.49	-886,028.65	-2,517,207.14
基金赎回款	3,113,964.18	1,608,865.56	4,722,829.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-27,721,956.58	-37,057,834.09	-64,779,790.67

6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	45,131.07
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	855.27
其他	235.68
合计	46,222.02

6.4.4.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	29,203,659.77

减：卖出股票成本总额	35,576,034.29
买卖股票差价收入	-6,372,374.52

6.4.4.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	83,911.98
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	97,000.00
减：应收利息总额	63.14
买卖债券差价收入	-13,151.16

6.4.4.13.1 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.4.14 贵金属投资收益

注：无。

6.4.4.15 衍生工具收益

注：无。

6.4.4.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,516,299.11
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,516,299.11

6.4.4.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-27,285,976.72
股票投资	-27,285,862.24
债券投资	-114.48
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-27,285,976.72

6.4.4.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	16,341.90
合计	16,341.90

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的0.5%，赎回费总额的25%归入基金资产。

6.4.4.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	37,559.67
银行间市场交易费用	-
合计	37,559.67

6.4.4.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	26,778.95
信息披露费	148,767.52
指数使用费	100,000.00
银行费用	1,815.00
上市费	29,752.78
合计	307,114.25

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币50,000.00元。

6.4.4.21 分部报告

无。

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 或有事项

无。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》，公司名称由“南方基金管理有限公司”变更为“南方基金管理股份有限公司”，公司股权结构等事项未发生变化，并已于 2018 年 1 月 4 日在深圳市市场监督管理局完成相应变更登记手续。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.7.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华泰证券	30,343,586.61	68.52	65,106,135.21	62.59

6.4.7.1.2 权证交易

注：无。

6.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
-------	--

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
华泰证券	3,034.53	68.57	1,975.30	67.26
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
华泰证券	6,510.58	62.59	4,512.50	53.69

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年 6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,072,970.41	1,371,918.18
其中:支付销售机构的客户维护费	365,792.06	414,674.11

注:支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%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 X 1.00% / 当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年 6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	236,053.53	301,822.02

注:支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22%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 X 0.22% / 当年天数。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

注:无。

6.4.7.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	10,138,731.65	45,131.07	17,364,499.22	17,807.63

注:本基金由基金托管人中国农业银行保管的银行存款,按银行约定利率计息。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 利润分配情况

注:无

6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券**6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1 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
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新股认购	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股认购	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000540	中天	2017-08-21	重大资	4.18	-	-	378,600	2,105,102.11	1,582,548.00	-

	金融		产重组								
000793	华闻传媒	2018-02-01	重大资产重组	8.40	2018-07-16	7.56	149,200	1,530,176.35	1,253,280.00	-	
002512	达华智能	2018-06-18	拟披露重大事项	9.70	-	-	46,800	544,284.00	453,960.00	-	
002602	世纪华通	2018-06-12	重大资产重组	32.50	-	-	20,800	739,564.68	676,000.00	-	
002699	美盛文化	2018-02-05	重大资产重组	18.76	2018-07-02	16.88	20,500	390,414.21	384,580.00	-	
300324	旋极信息	2018-05-30	重大资产重组	9.49	-	-	65,029	807,738.84	617,125.21	-	
600122	宏图高科	2018-06-18	拟筹划重大资产重组	7.40	-	-	65,900	735,880.65	487,660.00	-	
600158	中体产业	2018-03-27	拟筹划重大资产重组	11.64	2018-07-16	11.61	50,316	984,696.29	585,678.24	-	

注:本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注:无。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金,属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。从本基金所分拆的两类基金份额来看,南方互联 A 份额为稳健收益类份额,具有低风险且预期收益相对较低的特征;南方互联 B 份额为积极收益类份额,具有高风险且预期收益相对较高的特征。

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风险管理委员会,负责制定风险管理的宏观政策,审议通过风险控制的总体措施等;在管理层层面设立风险控制委员会,讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施;在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估,督察长负责组织指导监察稽核工作。

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

6.4.10.2 信用风险

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

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

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

6.4.10.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 2018 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不

计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.10.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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、流通受限制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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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 6.4.9。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

同时，本基金的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本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

6.4.10.4 市场风险

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

6.4.10.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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、结算备付金及存出保证金等。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,138,731.65	-	-	-	10,138,731.65
结算备付金	60,897.82	-	-	-	60,897.82
存出保证金	8,946.96	-	-	-	8,946.96
交易性金融资产	785.52	-	-	-175,473,878.28	175,474,663.80
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,998.94	1,998.94
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	2,721.99	-	-	103,213.88	105,935.87
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,212,083.94	-	-	-175,579,091.10	185,791,175.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	209,880.33	209,880.33
应付管理人报酬	-	-	-	160,203.14	160,203.14

应付托管费	-	-	-	35,244.67	35,244.67
应付证券清算款	-	-	-	0.38	0.38
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,936.85	2,936.85
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2.21	2.21
其他负债	-	-	-	255,921.40	255,921.40
负债总计	-	-	-	664,188.98	664,188.98
利率敏感度缺口	10,212,083.94	-	-	-174,914,902.12	185,126,986.06
上年度末 2017年12月 31日					
资产					
银行存款	12,519,114.39	-	-	-	12,519,114.39
结算备付金	64,602.87	-	-	-	64,602.87
存出保证金	25,014.47	-	-	-	25,014.47
交易性金融资产	-	-	-	-221,393,570.52	221,393,570.52
应收证券清算款	-	-	-	677,418.91	677,418.91
应收利息	-	-	-	2,583.09	2,583.09
应收申购款	8,007.02	-	-	10,613.99	18,621.01
资产总计	12,616,738.75	-	-	-222,084,186.51	234,700,925.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	994,833.97	994,833.97
应付管理人报酬	-	-	-	202,162.22	202,162.22
应付托管费	-	-	-	44,475.69	44,475.69
应付交易费用	-	-	-	6,162.63	6,162.63
其他负债	-	-	-	404,121.56	404,121.56
负债总计	-	-	-	1,651,756.07	1,651,756.07
利率敏感度缺口	12,616,738.75	-	-	-220,432,430.44	233,049,169.19

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

6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.10.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基
第 29 页 共 47 页

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.10.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金采用被动式指数化投资方法，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。当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 80%以上，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	175,473,878.28	94.79	221,393,570.52	95.00

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	175,473,878.28	94.79	221,393,570.52	95.00

6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	9,424,491.43	11,697,903.05
	2. 业绩比较基准下降 5%	-9,424,491.43	-11,697,903.05

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	175,473,878.28	94.45
	其中：股票	175,473,878.28	94.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	785.52	0.00
	其中：债券	785.52	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,199,629.47	5.49
8	其他各项资产	116,881.77	0.06
9	合计	185,791,175.04	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	64,053,611.46	34.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,156,450.00	0.62
F	批发和零售业	11,550,968.72	6.24
G	交通运输、仓储和邮政业	2,543,388.00	1.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,663,839.35	26.29
J	金融业	28,008,959.60	15.13
K	房地产业	1,849,133.22	1.00
L	租赁和商务服务业	7,353,100.64	3.97
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,342,579.00	0.73
R	文化、体育和娱乐业	6,487,837.32	3.50
S	综合	-	-
	合计	173,009,867.31	93.45

7.2.2 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	191,454.74	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,103.85	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,168,226.24	1.17
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,464,010.97	1.33

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	245,725	9,123,769.25	4.93
2	601318	中国平安	154,300	9,038,894.00	4.88
3	601166	兴业银行	600,500	8,647,200.00	4.67
4	000725	京东方A	1,710,900	6,056,586.00	3.27
5	000001	平安银行	619,640	5,632,527.60	3.04
6	002027	分众传媒	529,752	5,069,726.64	2.74
7	002024	苏宁易购	268,800	3,784,704.00	2.04
8	300059	东方财富	261,141	3,441,838.38	1.86
9	002230	科大讯飞	105,178	3,373,058.46	1.82
10	600050	中国联通	671,900	3,305,748.00	1.79
11	002475	立讯精密	137,387	3,096,702.98	1.67
12	002236	大华股份	125,515	2,830,363.25	1.53
13	300003	乐普医疗	77,158	2,830,155.44	1.53
14	000100	TCL 集团	782,400	2,268,960.00	1.23
15	000063	中兴通讯	171,720	2,237,511.60	1.21
16	002456	欧菲科技	137,100	2,211,423.00	1.19
17	600487	亨通光电	96,180	2,120,769.00	1.15

18	601933	永辉超市	276,362	2,111,405.68	1.14
19	600271	航天信息	80,700	2,039,289.00	1.10
20	601607	上海医药	83,300	1,990,870.00	1.08
21	600570	恒生电子	35,700	1,890,315.00	1.02
22	300136	信维通信	56,800	1,745,464.00	0.94
23	600588	用友网络	68,590	1,681,140.90	0.91
24	000503	国新健康	51,900	1,649,382.00	0.89
25	600522	中天科技	177,000	1,559,370.00	0.84
26	002405	四维图新	74,050	1,499,512.50	0.81
27	603019	中科曙光	32,500	1,490,775.00	0.81
28	600637	东方明珠	95,365	1,436,196.90	0.78
29	002241	歌尔股份	140,500	1,431,695.00	0.77
30	600177	雅戈尔	180,960	1,393,392.00	0.75
31	601998	中信银行	221,200	1,373,652.00	0.74
32	002049	紫光国微	30,700	1,354,484.00	0.73
33	002410	广联达	48,511	1,345,210.03	0.73
34	300347	泰格医药	21,700	1,342,579.00	0.73
35	000977	浪潮信息	55,870	1,332,499.50	0.72
36	000793	华闻传媒	149,200	1,253,280.00	0.68
37	600804	鹏博士	103,400	1,240,800.00	0.67
38	600699	均胜电子	48,000	1,233,120.00	0.67
39	601555	东吴证券	173,200	1,182,956.00	0.64
40	002065	东华软件	135,990	1,169,514.00	0.63
41	002081	金螳螂	114,500	1,156,450.00	0.62
42	600584	长电科技	67,700	1,146,838.00	0.62
43	300017	网宿科技	103,871	1,112,458.41	0.60
44	600100	同方股份	126,500	1,110,670.00	0.60
45	600109	国金证券	150,600	1,070,766.00	0.58
46	300168	万达信息	51,511	1,050,824.40	0.57
47	000050	深天马A	72,901	1,036,652.22	0.56
48	002558	巨人网络	43,220	1,027,771.60	0.56
49	300253	卫宁健康	81,744	1,012,808.16	0.55
50	600498	烽火通信	39,600	984,060.00	0.53
51	300383	光环新网	72,000	965,520.00	0.52
52	000839	中信国安	195,200	923,296.00	0.50
53	002465	海格通信	114,900	922,647.00	0.50
54	002268	卫士通	41,720	910,747.60	0.49
55	000066	中国长城	125,700	893,727.00	0.48
56	002624	完美世界	28,500	883,785.00	0.48
57	002352	顺丰控股	18,800	846,000.00	0.46
58	601360	三六零	28,900	835,210.00	0.45
59	002223	鱼跃医疗	42,750	833,197.50	0.45

60	600138	中青旅	41,200	821,116.00	0.44
61	300315	掌趣科技	196,200	820,116.00	0.44
62	002439	启明星辰	38,300	812,726.00	0.44
63	002195	二三四五	189,137	809,506.36	0.44
64	600718	东软集团	61,900	808,414.00	0.44
65	000997	新大陆	50,392	793,674.00	0.43
66	300418	昆仑万维	41,000	774,080.00	0.42
67	300166	东方国信	52,298	770,349.54	0.42
68	600839	四川长虹	262,800	751,608.00	0.41
69	600060	海信电器	55,900	748,501.00	0.40
70	002555	三七互娱	61,100	742,365.00	0.40
71	000627	天茂集团	105,500	740,610.00	0.40
72	300027	华谊兄弟	118,455	729,682.80	0.39
73	002183	怡亚通	105,500	701,575.00	0.38
74	600183	生益科技	75,320	689,931.20	0.37
75	002373	千方科技	52,200	681,210.00	0.37
76	600998	九州通	40,124	680,503.04	0.37
77	600572	康恩贝	94,900	680,433.00	0.37
78	002602	世纪华通	20,800	676,000.00	0.37
79	300271	华宇软件	37,900	670,072.00	0.36
80	002640	跨境通	44,200	663,884.00	0.36
81	002153	石基信息	22,813	661,577.00	0.36
82	002138	顺络电子	40,700	651,607.00	0.35
83	000938	紫光股份	10,400	651,040.00	0.35
84	601098	中南传媒	51,116	646,106.24	0.35
85	300251	光线传媒	62,590	637,166.20	0.34
86	002273	水晶光电	49,190	633,075.30	0.34
87	002174	游族网络	31,645	629,735.50	0.34
88	002385	大北农	151,125	624,146.25	0.34
89	300324	旋极信息	65,029	617,125.21	0.33
90	002603	以岭药业	42,900	599,742.00	0.32
91	300033	同花顺	15,300	594,711.00	0.32
92	300287	飞利信	81,700	587,423.00	0.32
93	002281	光迅科技	27,600	585,120.00	0.32
94	002517	恺英网络	76,650	551,113.50	0.30
95	002120	韵达股份	10,300	546,415.00	0.30
96	002583	海能达	64,600	539,410.00	0.29
97	300133	华策影视	50,328	535,993.20	0.29
98	300058	蓝色光标	93,130	530,841.00	0.29
99	600797	浙大网新	52,600	530,734.00	0.29
100	300113	顺网科技	29,600	515,336.00	0.28
101	600037	歌华有线	49,532	511,170.24	0.28

102	300115	长盈精密	38,840	503,754.80	0.27
103	600728	佳都科技	69,100	503,739.00	0.27
104	600373	中文传媒	39,200	503,720.00	0.27
105	002131	利欧股份	238,584	501,026.40	0.27
106	002419	天虹股份	34,200	499,320.00	0.27
107	600122	宏图高科	65,900	487,660.00	0.26
108	600859	王府井	22,100	470,067.00	0.25
109	000917	电广传媒	80,700	464,832.00	0.25
110	002285	世联行	72,686	455,741.22	0.25
111	002512	达华智能	46,800	453,960.00	0.25
112	000156	华数传媒	44,394	427,958.16	0.23
113	601231	环旭电子	46,402	420,866.14	0.23
114	300002	神州泰岳	97,700	407,409.00	0.22
115	600446	金证股份	36,399	400,752.99	0.22
116	600633	浙数文化	46,300	386,142.00	0.21
117	002699	美盛文化	20,500	384,580.00	0.21
118	002468	申通快递	21,800	373,870.00	0.20
119	300068	南都电源	31,100	372,578.00	0.20
120	000034	神州数码	23,300	372,334.00	0.20
121	002354	天神娱乐	40,040	370,770.40	0.20
122	000727	华东科技	195,700	367,916.00	0.20
123	002635	安洁科技	21,000	361,200.00	0.20
124	000021	深科技	52,300	356,686.00	0.19
125	002292	奥飞娱乐	38,471	343,546.03	0.19
126	300297	蓝盾股份	42,300	343,053.00	0.19
127	000676	智度股份	27,500	340,450.00	0.18
128	601928	凤凰传媒	54,940	334,035.20	0.18
129	603000	人民网	39,800	330,340.00	0.18
130	601801	皖新传媒	42,932	326,712.52	0.18
131	002429	兆驰股份	130,350	323,268.00	0.17
132	000712	锦龙股份	32,300	322,354.00	0.17
133	600233	圆通速递	24,200	319,440.00	0.17
134	002503	搜于特	88,900	311,150.00	0.17
135	002251	步步高	24,600	279,948.00	0.15
136	000555	神州信息	20,828	276,595.84	0.15
137	000536	华映科技	98,400	270,600.00	0.15
138	603444	吉比特	2,100	268,359.00	0.14
139	002711	欧浦智网	30,100	252,238.00	0.14
140	603888	新华网	14,800	249,528.00	0.13
141	300134	大富科技	27,600	246,744.00	0.13
142	600640	号百控股	22,600	229,842.00	0.12
143	600180	瑞茂通	21,700	210,273.00	0.11

144	603056	德邦股份	7,500	205,425.00	0.11
145	600715	文投控股	26,700	202,653.00	0.11
146	002619	艾格拉斯	39,400	165,086.00	0.09
147	002530	金财互联	16,780	152,865.80	0.08
148	000662	天夏智慧	23,661	152,140.23	0.08
149	603103	横店影视	3,900	119,808.00	0.06
150	603533	掌阅科技	3,100	100,316.00	0.05

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

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	000540	中天金融	378,600	1,582,548.00	0.85
2	600158	中体产业	50,316	585,678.24	0.32
3	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.07
4	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.04
5	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.03
6	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.01
7	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601360	三六零	1,058,673.00	0.45
2	002027	分众传媒	1,022,129.47	0.44
3	002352	顺丰控股	896,009.00	0.38
4	300271	华宇软件	657,423.45	0.28
5	002120	韵达股份	595,414.00	0.26
6	000100	TCL 集团	584,882.00	0.25
7	002512	达华智能	567,544.00	0.24
8	002419	天虹股份	528,369.00	0.23
9	002475	立讯精密	522,221.00	0.22
10	600699	均胜电子	522,094.50	0.22
11	600859	王府井	518,848.31	0.22
12	002468	申通快递	516,504.00	0.22
13	002555	三七互娱	491,861.00	0.21
14	600233	圆通速递	400,796.00	0.17
15	002251	步步高	330,168.00	0.14
16	002602	世纪华通	309,632.00	0.13
17	002268	卫士通	289,952.00	0.12

18	002711	欧浦智网	280,613.00	0.12
19	600180	瑞茂通	243,192.00	0.10
20	603056	德邦股份	235,299.64	0.10

注:买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002415	海康威视	1,731,036.00	0.74
2	300104	乐视网	1,091,437.20	0.47
3	601216	君正集团	1,043,090.00	0.45
4	601166	兴业银行	885,538.00	0.38
5	000547	航天发展	785,806.00	0.34
6	000725	京东方 A	759,453.00	0.33
7	000979	中弘股份	729,271.00	0.31
8	601318	中国平安	713,268.00	0.31
9	000001	平安银行	647,934.00	0.28
10	300010	立思辰	605,189.00	0.26
11	002400	省广集团	470,919.00	0.20
12	002602	世纪华通	408,450.00	0.18
13	002926	华西证券	386,505.98	0.17
14	002375	亚厦股份	379,308.00	0.16
15	002544	杰赛科技	379,090.93	0.16
16	002230	科大讯飞	348,216.00	0.15
17	000901	航天科技	336,373.50	0.14
18	002410	广联达	332,826.00	0.14
19	002024	苏宁易购	324,421.00	0.14
20	600986	科达股份	317,095.00	0.14

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	16,942,204.29
卖出股票收入(成交)总额	29,203,659.77

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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）	785.52	0.00
8	同业存单	-	-
-	-	-	-
9	其他	-	-
10	合计	785.52	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128038	利欧转债	9	785.52	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体除兴业银行(601166)以外,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。

根据 2018 年 5 月 4 日中国银行保险监督管理委员会执行处罚信息公开表(银保监银罚决字(2018)1 号),对兴业银行股份有限公司(下称兴业银行,股票代码:601166)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产等十二项违规事实罚款 5870 万元。

基金管理人对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,946.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,998.94
5	应收申购款	105,935.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	116,881.77

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	公司名称	流通受限部分的公允	占基金资产净值	流通受限情况
----	------	------	-----------	---------	--------

			价值 (人民币元)	比例 (%)	说明
1	000540	中天金融	1,582,548.00	0.85	重大资产重组
2	600158	中体产业	585,678.24	0.32	重大资产重组

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
互联基金	9,037	27,500.12	216,084.93	0.09	248,302,544.63	99.91
互联 A	91	132,349.82	1,096,380.00	9.10	10,947,454.00	90.90
互联 B	503	23,944.01	30,645.00	0.25	12,013,190.00	99.75
合计	9,631	28,305.09	1,343,109.93	0.49	271,263,188.63	99.51

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

8.2 期末上市基金前十名持有人

互联 A 级

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	王雁波	4,376,000.00	36.33
2	丁碧霞	2,148,457.00	17.84
3	中国银河证券股份有限公司	1,096,224.00	9.10
4	梁小红	964,749.00	8.01
5	李怡名	774,319.00	6.43
6	郑志坤	477,009.00	3.96
7	蒋时秀	308,516.00	2.56
8	杨葵	200,029.00	1.66
9	殷晓棠	150,000.00	1.25
10	方春娣	143,800.00	1.19

互联 B 级

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	张文俊	500,400.00	4.15
2	邹光明	500,009.00	4.15
3	孙广煜	500,000.00	4.15
4	刘维清	473,500.00	3.93

5	黄启阶	467,904.00	3.89
6	赵向华	421,858.00	3.50
7	颜孟龙	360,800.00	3.00
8	赵香	258,097.00	2.14
9	贡维贞	224,300.00	1.86
10	李正博	208,200.00	1.73

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方中证互联网指数分级	1,149.16	0.0005
	互联 A 级	-	-
	互联 B 级	-	-
	合计	1,149.16	0.0004

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，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）。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方中证互联网指数分级	互联 A 级	互联 B 级
基金合同生效日（2015 年 7 月 1 日）基金份额总额	611,872,014.42	-	-
本报告期期初基金份额总额	262,767,136.73	13,854,266.00	13,854,267.00
本报告期基金总申购份额	18,337,101.06	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	36,206,472.23	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-3,620,864.00	1,810,432.00	1,810,432.00
本报告期期末基金份额总额	248,518,629.56	12,043,834.00	12,043,835.00

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及定期份额折算。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人没有发生重大人事变动。

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	30,343,586.61	68.52%	3,034.53	68.57%	
瑞银证券	1	13,939,174.72	31.48%	1,391.20	31.43%	
银河证券	2	-	-	-	-	
申万宏源	2	-	-	-	-	

国泰君安	1	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

注：交易单元的选择标准和程序 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	83,911.98	100.00%	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月06日

2	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 01 月 06 日
3	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 01 月 06 日
4	南方中证互联网指数分级证券投资基金招募说明书（更新）（2018 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 02 月 07 日
5	南方中证互联网指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2018 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 02 月 07 日
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分开放式基金赎回费调整的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 03 月 27 日
7	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 03 月 30 日
8	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 03 月 31 日
9	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 01 月 06 日
10	南方基金管理股份有限公司关于调整电子直销系统部分基金最低申购金额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 04 月 26 日
11	南方基金关于旗下部分基金增加大连网金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 04 月 27 日
12	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 01 月 06 日
13	南方中证互联网指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 06 月 20 日
14	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 01 月 06 日
15	南方中证互联网指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 06 月 20 日
16	南方中证互联网指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 06 月 20 日
17	南方基金关于旗下部分基金增加中民财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 06 月 25 日
18	南方中证互联网指数分级证券投资	中国证券报、上海证	2018 年 06 月 20 日

	基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	券报、证券时报	
19	南方中证互联网指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 06 月 20 日
20	南方中证互联网指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 06 月 20 日
21	南方中证互联网指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 06 月 20 日
22	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 03 月 31 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注:无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证互联网指数分级证券投资基金的文件。
- 2、南方中证互联网指数分级证券投资基金基金合同。
- 3、南方中证互联网指数分级证券投资基金托管协议。
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层。

12.3 查阅方式

网站: <http://www.nffund.com>

