

深证成份交易型开放式指数证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	11
2.1 基金基本情况.....	11
2.2 基金产品说明.....	11
2.3 基金管理人和基金托管人.....	11
2.4 信息披露方式.....	11
2.5 其他相关资料.....	11
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	11
3.1 主要会计数据和财务指标.....	11
3.2 基金净值表现.....	11
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内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.....	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
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.....	14
§ 7 投资组合报告	22
7.1 期末基金资产组合情况.....	22
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	22
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.....	22
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	23
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	23
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.....	23
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.....	23

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.....	23
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.....	23
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	23
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	24
7.12 投资组合报告附注.....	24
§ 8 基金份额持有人信息.....	25
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	25
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	25
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	25
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.....	25
§ 9 开放式基金份额变动.....	25
§ 10 重大事件揭示.....	25
10.1 基金份额持有人大会决议.....	25
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.....	25
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	25
10.4 基金投资策略的改变.....	26
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	26
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.....	26
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	26
10.8 其他重大事件.....	26
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	26
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.....	26
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	26
§ 12 备查文件目录.....	26
12.1 备查文件目录.....	26
12.2 存放地点.....	26
12.3 查阅方式.....	27

基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方深证成份 ETF
场内简称	深成 ETF
基金主代码	159903
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2009 年 12 月 4 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	394,154,507.00 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	2010 年 2 月 2 日

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

2.2 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	<p>本基金为完全被动式指数基金,原则上采用完全复制法,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。</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,从而使使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p>
业绩比较基准	<p>本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证成份指数。</p> <p>如果指数编制单位变更或停止深证成份指数的编制及发布、或深证成份指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致深证成份指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,变更本基金的标的指数。</p>
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人姓名	常克川	郭明

责人	联系电话	0755-82763888	010-66105798
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105799
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		张海波	易会满

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	-26,089,226.15
本期利润	-67,325,026.42
加权平均基金份额本期利润	-0.1780
本期加权平均净值利润率	-15.43%
本期基金份额净值增长率	-14.91%
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	-132,513,382.24
期末可供分配基金份额利润	-0.3362
期末基金资产净值	401,671,085.97
期末基金份额净值	1.0191
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	-24.80%

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。

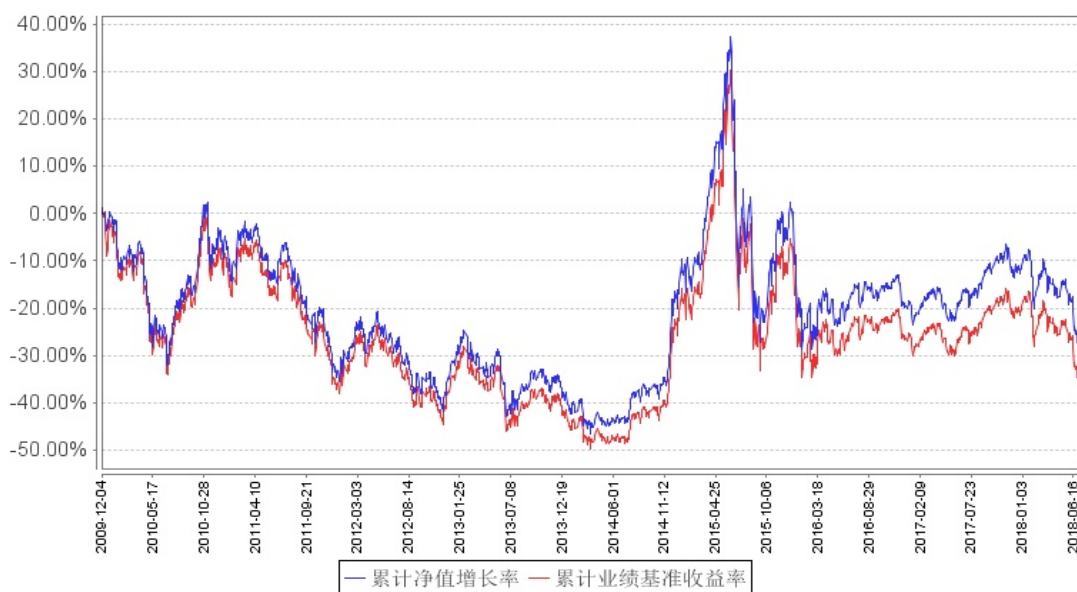
3.2 基金净值表现

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	-8.67%	1.73%	-8.90%	1.73%	0.23%	0.00%
过去三个月	-13.18%	1.34%	-13.70%	1.34%	0.52%	0.00%
过去六个月	-14.91%	1.36%	-15.04%	1.37%	0.13%	-0.01%
过去一年	-10.31%	1.15%	-10.92%	1.15%	0.61%	0.00%
过去三年	-31.03%	1.73%	-34.58%	1.77%	3.55%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-24.80%	1.61%	-32.45%	1.63%	7.65%	-0.02%

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

南方深证成份ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金合同中关于基金投资比例的约定，本基金将全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现，正常情况下，本基金的指数化投资比例不低于基金资产净值的 95%。

§ 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		
孙伟	本基金基金经理	2016 年 8 月 19 日	-	8	管理学学士，具有基金从业资格、金融分析师（CFA）资格、注册会计师（CPA）资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010 年 2 月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员；2014 年 12 月至 2015 年 5 月，担任南方恒生 ETF 的基金经理助理；2015 年 5 月至 2016 年 7 月，任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 7 月至今，任改革基金、高铁基金、500 信息基金经理；2016 年 5 月至今，任南方创业板 ETF、南方创业板 ETF 联接基金经理；2016 年 8 月至今，任 500 信息联接、深成 ETF、南方深成基金经理；2017 年 3 月至今，任南方全指证券 ETF 联接、南方中证全

					指证券 ETF 基金经理；2017 年 6 月至今，任南方中证银行 ETF、南方银行联接基金经理；2018 年 2 月至今，任 H 股 ETF、南方 H 股联接基金经理。
--	--	--	--	--	---

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《深证成份交易型开放式指数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

深证成指本报告期下跌 15.04%。期间我们通过自建的指数化交易系统、日内择时交易模型、跟踪误差归因分析系统、ETF 现金流精算系统等，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 ETF 基金的安全运作。我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：（1）大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪

误差最小化；（2）报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）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

本基金本报告期跟踪误差和正偏离分别为 0.25%和 1.9%，理想地完成了投资目标。积极参与网下新股申购对基金超越业绩基准收益贡献明显。

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0191 元，报告期内，份额净值增长率为-14.91%，同期业绩基准增长率为-15.04%。

本基金为指数化产品，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。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来市场波动较大有内外两方面原因：内部主要矛盾在于经济增长和金融风险释放的预期，外部重要因素在于中美贸易摩擦升级和人民币汇率贬值。我们认为，经济自身仍将保持良好的增长韧性，且管理层在财政和货币政策上会有适当的预调微调；人民币汇率下行压力有限，中美贸易摩擦常态化仍然是未来较长时间需要关注的重要变量。在“新结构市场”以及“新增资金机构化”的大背景下，预计基本面优秀和估值具有安全边际的公司将继续受到投资者青睐。深证成指于 15 年 5 月正式扩容，成份股由 40 只增至 500 只，在传统支柱产业外更全面纳入新兴成长行业公司。自 15 年 6 月高点至本报告期末，指数估值已跌去六成以上，市盈率几乎处于扩容后的历史最低区域。展望后市，深证成指有望在估值及业绩间找到新的平衡点。

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，当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。基金管理人根据基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益分配每年最多 12 次，每次基金收益分配比例不低于基金收益分配基准日可供分配利润的 5%。基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；本基金收益分配采取现金分红方式；《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；每一基金份额享有同等分配权；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

本报告期内，本基金托管人在对深证成份交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，深证成份交易型开放式指数证券投资基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在深证成份交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，深证成份交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

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	1,378,299.31	561,384.51
结算备付金		15,120.78	11,643.54
存出保证金		1,998.73	2,607.93
交易性金融资产	6.4.4.2	401,970,596.36	454,182,128.03
其中：股票投资		401,970,596.36	453,742,328.03
基金投资		-	-
债券投资		-	439,800.00
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		-	-
应收利息	6.4.4.5	260.37	136.89
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		403,366,275.55	454,757,900.90
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		1,165,890.61	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		169,603.05	192,179.60
应付托管费		33,920.60	38,435.93
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	4,847.81	457.25
应交税费		1.92	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	320,925.59	404,000.00
负债合计		1,695,189.58	635,072.78
所有者权益：			
实收基金	6.4.4.9	534,184,468.21	513,855,468.07
未分配利润	6.4.4.10	-132,513,382.24	-59,732,639.95
所有者权益合计		401,671,085.97	454,122,828.12
负债和所有者权益总计		403,366,275.55	454,757,900.90

6.2 利润表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

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		-65,646,131.72	24,737,422.48
1. 利息收入		4,246.52	4,805.92
其中：存款利息收入	6.4.4.11	4,125.48	4,805.92
债券利息收入		121.04	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-24,377,130.45	-94,277.47
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-27,153,808.36	-3,180,753.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	73,207.60	-
资产支持证券投资收益	6.4.4.13.3	-	-
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	2,703,470.31	3,086,475.93
3. 公允价值变动收益（损失以	6.4.4.17	-41,235,800.27	24,824,682.09

“-”号填列)			
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	-37,447.52	2,211.94
减：二、费用		1,678,894.70	1,764,332.36
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	1,079,229.01	1,202,486.76
2. 托管费	6.4.7.2.2	215,845.74	240,497.32
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.4.19	78,282.50	12,825.20
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.20	-
7. 其他费用	6.4.4.20	305,537.25	308,523.08
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-67,325,026.42	22,973,090.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-67,325,026.42	22,973,090.12

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

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)	513,855,468.07	-59,732,639.95	454,122,828.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-67,325,026.42	-67,325,026.42
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)	20,329,000.14	-5,455,715.87	14,873,284.27
其中：1. 基金申购款	48,789,600.33	-8,914,200.71	39,875,399.62
2. 基金赎回款	-28,460,600.19	3,458,484.84	-25,002,115.35
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)	534,184,468.21	-132,513,382.24	401,671,085.97
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)	619,566,268.78	-123,490,433.87	496,075,834.91
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期 利润)	-	22,973,090.12	22,973,090.12
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)	-32,526,400.22	5,607,794.62	-26,918,605.60
其中：1. 基金申购款	8,131,600.05	-1,664,054.17	6,467,545.88
2. 基金赎回款	-40,658,000.27	7,271,848.79	-33,386,151.48
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)	587,039,868.56	-94,909,549.13	492,130,319.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨小松

徐超

徐超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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

本报告期内所采用的会计政策、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	1,378,299.31
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	1,378,299.31

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	473,966,414.37	401,970,596.36	-71,995,818.01
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	473,966,414.37	401,970,596.36	-71,995,818.01

注：于 2018 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为-110.30。

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

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	235.18
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	24.38
应收债券利息	-
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	0.81
合计	260.37

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	4,847.81
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,847.81

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	-
应退替代款	2,140.64
预提费用	205,299.25
应付指数使用费	50,000.00
可退替代款	63,485.70
合计	320,925.59

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

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

6.4.4.9 实收基金

金额单位:人民币元

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	379,154,507.00	513,855,468.07
本期申购	36,000,000.00	48,789,600.33
本期赎回(以“-”号填列)	-21,000,000.00	-28,460,600.19
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	394,154,507.00	534,184,468.21

注:申购含红利再投、转换入份额,赎回含转换出份额

6.4.4.10 未分配利润

单位:人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	115,741,808.92	-175,474,448.87	-59,732,639.95
本期利润	-26,089,226.15	-41,235,800.27	-67,325,026.42
本期基金份额交易产生的变动数	4,050,195.13	-9,505,911.00	-5,455,715.87
其中:基金申购款	9,835,843.82	-18,750,044.53	-8,914,200.71
基金赎回款	-5,785,648.69	9,244,133.53	3,458,484.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	93,702,777.90	-226,216,160.14	-132,513,382.24

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	3,458.84
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	648.82
其他	17.82
合计	4,125.48

6.4.4.12 股票投资收益

6.4.4.12.1 股票投资收益项目构成

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-26,033,527.42
股票投资收益——赎回差价收入	-1,120,280.94
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-27,153,808.36

6.4.4.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	56,423,442.08
减:卖出股票成本总额	82,456,969.50
买卖股票差价收入	-26,033,527.42

6.4.4.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日
赎回基金份额对价总额	25,002,115.35
减：现金支付赎回款总额	-157,183.65
减：赎回股票成本总额	26,279,579.94
赎回差价收入	-1,120,280.94

6.4.4.13 债券投资收益**6.4.4.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	73,207.60
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	73,207.60

6.4.4.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	948,877.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	875,500.00
减：应收利息总额	169.60
买卖债券差价收入	73,207.60

6.4.4.13.3 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	2,703,470.31
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,703,470.31

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	-41,235,800.27
股票投资	-41,235,800.27
债券投资	-
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	-41,235,800.27

注：本基金本年度公允价值变动收益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动收益为130.14元。

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	-
替代损益	-37,447.52
合计	-37,447.52

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	78,282.50
银行间市场交易费用	-
合计	78,282.50

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	238.00
上市费	29,752.78
合计	305,537.25

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
南方深证成份 ETF 联接基金	本基金的基金管理人管理的其他基金

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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日		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	115,594,419.57	100.00	18,853,215.65	100.00
------	----------------	--------	---------------	--------

6.4.7.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
华泰证券	1,384,577.20	100.00	0.00	0.00

6.4.7.1.3 权证交易

注：无。

6.4.7.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	11,562.07	100.00	4,847.81	100.00
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	1,839.66	100.00	663.88	100.00

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	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	1,079,229.01	1,202,486.76
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	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	215,845.74	240,497.32

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 X 0.10% / 当年天数。

6.4.7.2.3 销售服务费

注：无。

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

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)

南方深证成份 ETF联接基金	243,321,432.00	61.73	237,321,432.00	62.59
-------------------	----------------	-------	----------------	-------

注：南方深证成份 ETF 联接基金投资本基金相关的费用按基金合同和更新的招募说明书的有关规定以及与券商约定的席位佣金费率支付。

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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日	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
中国工商银行股份有限公司	1,378,299.31	3,458.84	1,282,809.07	4,044.14

注：本基金由基金托管人中国工商银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

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

注：无。

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
000008	神州高铁	2018-06-06	重大事项	4.96	2018-08-07	4.46	107,100	913,260.30	531,216.00	-
000415	渤海金控	2018-01-17	重大资产重组	5.84	2018-07-17	5.26	114,060	1,027,028.78	666,110.40	-
000426	兴业矿业	2018-06-18	重大事项	7.21	-	-	36,800	323,534.52	265,328.00	-
000540	中天金融	2017-08-21	重大资产重组	4.87	-	-	284,700	1,861,148.37	1,386,489.00	-
000564	供销大集	2017-11-28	重大事项	4.78	2018-07-20	4.29	32,400	204,432.83	154,872.00	-
000566	海南	2017-	重大资产	12.89	2018-	11.60	57,034	938,109.69	735,168.26	-

	海药	11-22	重组		07-09						
000587	金洲慈航	2018-06-15	重大事项	4.96	2018-07-02	4.46	58,300	644,380.62	289,168.00	-	
000666	经纬纺机	2018-03-12	重大资产重组	18.08	-	-	19,800	382,674.00	357,984.00	-	
000693	*ST华泽	2018-04-30	未及时披露定期报告	3.31	-	-	25,500	466,489.64	84,405.00	-	
000723	美锦能源	2018-03-27	重大资产重组	5.43	2018-07-31	4.89	65,700	448,590.19	356,751.00	-	
000793	华闻传媒	2018-02-01	重大资产重组	8.40	2018-07-16	7.56	107,000	1,483,081.34	898,800.00	-	
000825	太钢不锈	2018-04-16	重大资产重组	6.00	-	-	151,300	855,313.65	907,800.00	-	
000939	*ST凯迪	2017-11-16	实行退市风险警示公告	4.99	2018-07-02	4.74	114,800	810,610.48	572,852.00	-	
002011	盾安环境	2018-04-30	重大资产重组	6.40	-	-	35,000	278,051.73	224,000.00	-	
002051	中工国际	2018-04-05	重大资产重组	15.27	-	-	32,028	611,108.79	489,067.56	-	
002075	沙钢股份	2016-09-15	重大资产重组	16.12	-	-	47,600	513,321.68	767,312.00	-	
002089	新海宜	2018-04-20	重大资产重组	6.05	2018-07-20	5.45	59,300	606,782.93	358,765.00	-	
002143	印纪传媒	2018-02-02	重大资产重组	12.09	2018-07-09	10.88	20,140	389,347.54	243,492.60	-	
002147	新光圆成	2018-01-18	重大资产重组	14.76	-	-	37,240	464,020.06	549,662.40	-	
002252	上海莱士	2018-02-23	重大资产重组	19.52	-	-	87,540	1,798,996.71	1,708,780.80	-	
002310	东方园林	2018-05-25	重大资产重组	15.03	-	-	92,950	1,309,266.71	1,397,038.50	-	
002359	北讯集团	2018-05-21	拟披露重大事项	19.58	2018-08-21	17.62	29,100	653,554.86	569,778.00	-	
002408	齐翔腾达	2018-06-18	重大资产重组	12.28	-	-	53,700	598,422.32	659,436.00	-	
002411	必康股份	2018-06-18	拟披露重大事项	28.34	-	-	15,500	423,725.01	439,270.00	-	
002426	胜利精密	2018-06-18	拟披露重大事项	3.60	2018-07-03	3.26	128,300	1,178,604.45	461,880.00	-	
002431	棕榈	2018-	重大事项	6.71	-	-	56,950	622,208.78	382,134.50	-	

	股份	05-30									
002437	誉衡 药业	2018- 06-11	重大资产 重组	6.20	2018- 08-13	5.57	53,200	516,425.26	329,840.00	-	
002450	康得 新	2018- 06-04	重大资产 重组	17.08	-	-	-147,808	2,654,653.66	2,524,560.64	-	
002477	雏鹰 农牧	2018- 06-14	重大事项	3.31	-	-	-109,000	627,641.10	360,790.00	-	
002512	达华 智能	2018- 06-18	拟披露重 大事项	9.70	-	-	-28,400	498,273.19	275,480.00	-	
002573	清新 环境	2018- 06-18	拟披露重 大事项	11.55	-	-	-42,900	896,149.15	495,495.00	-	
002602	世纪 华通	2018- 06-12	重大资产 重组	32.50	-	-	-21,000	534,923.87	682,500.00	-	
002610	爱康 科技	2018- 06-05	重大事项	2.10	-	-	-250,100	724,361.11	525,210.00	-	
002665	首航 节能	2018- 05-29	重大资产 重组	5.80	-	-	-76,690	758,736.14	444,802.00	-	
002668	奥马 电器	2018- 06-15	拟披露重 大事项	20.10	-	-	-18,200	401,150.64	365,820.00	-	
002699	美盛 文化	2018- 02-05	重大资产 重组	18.76	2018- 07-02	16.88	20,100	370,296.82	377,076.00	-	
002716	金贵 银业	2018- 05-03	重大资产 重组	16.84	-	-	-22,200	502,283.47	373,848.00	-	
002739	万达 电影	2017- 07-04	重大资产 重组	52.04	-	-	-31,300	2,601,769.73	1,628,852.00	-	
300072	三聚 环保	2018- 06-18	拟披露重 大事项	23.28	2018- 07-10	24.00	59,346	1,090,104.41	1,381,574.88	-	
300090	盛运 环保	2018- 06-04	拟披露重 大事项	8.32	2018- 07-02	7.49	58,008	636,772.29	482,626.56	-	
300118	东方 日升	2018- 05-07	重大资产 重组	10.80	2018- 08-07	9.63	31,800	504,319.83	343,440.00	-	
300146	汤臣 倍健	2018- 01-31	重大资产 重组	16.60	2018- 07-31	16.50	49,100	846,374.76	815,060.00	-	
300197	铁汉 生态	2018- 05-28	重大资产 重组	5.37	-	-	-87,981	705,568.87	472,457.97	-	
300266	兴源 环境	2018- 02-05	重大资产 重组	19.99	2018- 07-02	17.99	37,900	848,766.02	757,621.00	-	
300317	珈伟 股份	2018- 02-05	重大资产 重组	11.90	2018- 07-03	10.71	18,100	267,877.88	215,390.00	-	
300324	旋极 信息	2018- 05-30	重大资产 重组	9.49	-	-	-60,556	642,885.46	574,676.44	-	

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注:无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

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

本基金是指数型基金，紧密跟踪深证成份指数，具有和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。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，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 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0。

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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

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 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%。

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、存出保证金及债券投资等。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	1,378,299.31	-	-	-	1,378,299.31
结算备付金	15,120.78	-	-	-	15,120.78
存出保证金	1,998.73	-	-	-	1,998.73
交易性金融资产	-	-	-	401,970,596.36	401,970,596.36

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	260.37	260.37
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,395,418.82	-	-	401,970,856.73	403,366,275.55
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	169,603.05	169,603.05
应付托管费	-	-	-	33,920.60	33,920.60
应付证券清算款	-	-	-	1,165,890.61	1,165,890.61
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	4,847.81	4,847.81
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.92	1.92
其他负债	-	-	-	320,925.59	320,925.59
负债总计	-	-	-	1,695,189.58	1,695,189.58
利率敏感度缺口	1,395,418.82	-	-	400,275,667.15	401,671,085.97
上年度末 2017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	561,384.51	-	-	-	561,384.51
结算备付金	11,643.54	-	-	-	11,643.54
存出保证金	2,607.93	-	-	-	2,607.93
交易性金融资产	-	38,300.00	401,500.00	453,742,328.03	454,182,128.03
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	136.89	136.89
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	575,635.98	38,300.00	401,500.00	453,742,464.92	454,757,900.90
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	192,179.60	192,179.60
应付托管费	-	-	-	38,435.93	38,435.93
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	457.25	457.25
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	404,000.00	404,000.00
负债总计	-	-	-	635,072.78	635,072.78
利率敏感度缺口	575,635.98	38,300.00	401,500.00	453,107,392.14	454,122,828.12

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 日本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0,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。

本基金采用完全复制法跟踪深证成份指数,以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中,深证成份指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%,新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例不高于基金资产净值的 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,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	401,970,596.36	100.07	453,742,328.03	99.92
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	401,970,596.36	100.07	453,742,328.03	99.92

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%	20,688,829.32	22,601,693.15
	2. 业绩比较基准下降 5%	-20,688,829.32	-22,601,693.15

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	401,970,596.36	99.65
	其中：股票	401,970,596.36	99.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,393,420.09	0.35
8	其他各项资产	2,259.10	0.00
9	合计	403,366,275.55	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

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	8,744,775.88	2.18
B	采矿业	3,328,517.40	0.83
C	制造业	241,954,485.39	60.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,357,852.10	1.08
E	建筑业	6,599,064.63	1.64
F	批发和零售业	10,633,366.08	2.65
G	交通运输、仓储和邮政业	2,807,906.95	0.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,118,575.68	9.49
J	金融业	21,743,632.38	5.41
K	房地产业	20,571,636.91	5.12
L	租赁和商务服务业	6,630,925.70	1.65
M	科学研究和技术服务业	223,170.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	4,009,404.58	1.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,560,824.91	1.38
R	文化、体育和娱乐业	7,598,129.73	1.89
S	综合	609,892.60	0.15
	合计	383,492,160.92	95.47

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	84,405.00	0.02
C	制造业	14,416,883.74	3.59

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	89,320.00	0.02
E	建筑业	308,865.00	0.08
F	批发和零售业	689,586.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	552,427.00	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	918,840.00	0.23
J	金融业	287,744.00	0.07
K	房地产业	278,596.00	0.07
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	280,749.00	0.07
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	571,130.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	18,478,545.74	4.60

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	000333	美的集团	297,207	15,520,149.54	3.86
2	000651	格力电器	309,040	14,571,236.00	3.63
3	000858	五粮液	118,741	9,024,316.00	2.25
4	002415	海康威视	226,381	8,405,526.53	2.09
5	000002	万科A	261,358	6,429,406.80	1.60
6	000725	京东方A	1,676,942	5,936,374.68	1.48
7	300498	温氏股份	246,324	5,424,054.48	1.35
8	000001	平安银行	542,212	4,928,707.08	1.23
9	002304	洋河股份	36,361	4,785,107.60	1.19
10	300059	东方财富	252,703	3,330,625.54	0.83
11	002027	分众传媒	342,396	3,276,729.72	0.82
12	002230	科大讯飞	101,370	3,250,935.90	0.81

13	002024	苏宁易购	227,151	3,198,286.08	0.80
14	000538	云南白药	28,986	3,100,342.56	0.77
15	002008	大族激光	57,400	3,053,106.00	0.76
16	000568	泸州老窖	46,692	2,841,675.12	0.71
17	000338	潍柴动力	307,108	2,687,195.00	0.67
18	002475	立讯精密	119,017	2,682,643.18	0.67
19	002142	宁波银行	163,583	2,664,767.07	0.66
20	000776	广发证券	194,759	2,584,451.93	0.64
21	002594	比亚迪	54,136	2,581,204.48	0.64
22	002450	康得新	147,808	2,524,560.64	0.63
23	002236	大华股份	106,678	2,405,588.90	0.60
24	001979	招商蛇口	125,827	2,397,004.35	0.60
25	002466	天齐锂业	47,487	2,354,880.33	0.59
26	000661	长春高新	9,800	2,231,460.00	0.56
27	300003	乐普医疗	59,100	2,167,788.00	0.54
28	002044	美年健康	93,780	2,119,428.00	0.53
29	002456	欧菲科技	129,802	2,093,706.26	0.52
30	000963	华东医药	43,346	2,091,444.50	0.52
31	300124	汇川技术	63,694	2,090,437.08	0.52
32	000100	TCL 集团	697,871	2,023,825.90	0.50
33	000063	中兴通讯	154,233	2,009,655.99	0.50
34	002422	科伦药业	61,078	1,960,603.80	0.49
35	002460	赣锋锂业	49,400	1,905,852.00	0.47
36	000166	申万宏源	427,569	1,868,476.53	0.47
37	000423	东阿阿胶	32,571	1,752,645.51	0.44
38	002202	金风科技	138,397	1,749,338.08	0.44
39	300015	爱尔眼科	53,655	1,732,519.95	0.43
40	000895	双汇发展	65,424	1,727,847.84	0.43
41	002252	上海莱士	87,540	1,708,780.80	0.43
42	300408	三环集团	70,100	1,647,350.00	0.41
43	002739	万达电影	31,300	1,628,852.00	0.41
44	300136	信维通信	51,260	1,575,219.80	0.39
45	000503	国新健康	49,550	1,574,699.00	0.39
46	000413	东旭光电	259,300	1,571,358.00	0.39
47	000069	华侨城 A	214,949	1,554,081.27	0.39
48	300142	沃森生物	75,700	1,512,486.00	0.38
49	300070	碧水源	106,826	1,488,086.18	0.37
50	000783	长江证券	266,419	1,446,655.17	0.36
51	002310	东方园林	92,950	1,397,038.50	0.35
52	300024	机器人	79,790	1,388,346.00	0.35
53	000540	中天金融	284,700	1,386,489.00	0.35
54	300072	三聚环保	59,346	1,381,574.88	0.34

55	300122	智飞生物	30,100	1,376,774.00	0.34
56	000768	中航飞机	85,390	1,335,499.60	0.33
57	002241	歌尔股份	130,910	1,333,972.90	0.33
58	300347	泰格医药	21,200	1,311,644.00	0.33
59	002736	国信证券	143,500	1,305,850.00	0.33
60	000977	浪潮信息	53,630	1,279,075.50	0.32
61	002572	索菲亚	39,664	1,276,387.52	0.32
62	300296	利亚德	97,150	1,251,292.00	0.31
63	000157	中联重科	303,527	1,247,495.97	0.31
64	000625	长安汽车	137,998	1,241,982.00	0.31
65	000425	徐工机械	285,808	1,211,825.92	0.30
66	002410	广联达	43,219	1,198,462.87	0.30
67	000703	恒逸石化	79,760	1,186,828.80	0.30
68	000830	鲁西化工	69,200	1,181,936.00	0.29
69	002049	紫光国微	26,213	1,156,517.56	0.29
70	002007	华兰生物	35,400	1,138,464.00	0.28
71	002405	四维图新	56,131	1,136,652.75	0.28
72	002340	格林美	185,600	1,122,880.00	0.28
73	300017	网宿科技	104,445	1,118,605.95	0.28
74	002065	东华软件	126,800	1,090,480.00	0.27
75	300144	宋城演艺	46,270	1,087,345.00	0.27
76	002001	新和成	55,581	1,053,815.76	0.26
77	000998	隆平高科	55,500	1,046,730.00	0.26
78	002038	双鹭药业	27,400	1,040,926.00	0.26
79	002050	三花智控	54,600	1,029,210.00	0.26
80	000786	北新建材	55,200	1,022,856.00	0.25
81	002384	东山精密	42,400	1,017,600.00	0.25
82	002271	东方雨虹	59,809	1,017,351.09	0.25
83	000623	吉林敖东	56,468	1,015,294.64	0.25
84	002179	中航光电	26,030	1,015,170.00	0.25
85	002146	荣盛发展	115,400	1,007,442.00	0.25
86	300168	万达信息	48,846	996,458.40	0.25
87	000418	小天鹅A	14,300	991,705.00	0.25
88	000728	国元证券	131,296	971,590.40	0.24
89	000792	盐湖股份	89,134	964,429.88	0.24
90	002508	老板电器	31,460	963,305.20	0.24
91	002311	海大集团	45,140	952,454.00	0.24
92	002714	牧原股份	21,400	951,444.00	0.24
93	000860	顺鑫农业	25,000	937,500.00	0.23
94	300253	卫宁健康	75,556	936,138.84	0.23
95	002092	中泰化学	97,100	936,044.00	0.23
96	002673	西部证券	123,154	929,812.70	0.23

97	002797	第一创业	136,640	925,052.80	0.23
98	002081	金螳螂	91,426	923,402.60	0.23
99	002589	瑞康医药	67,260	917,426.40	0.23
100	000630	铜陵有色	411,800	910,078.00	0.23
101	000825	太钢不锈	151,300	907,800.00	0.23
102	002129	中环股份	115,920	907,653.60	0.23
103	002078	太阳纸业	92,900	900,201.00	0.22
104	000793	华闻传媒	107,000	898,800.00	0.22
105	002217	合力泰	108,600	895,950.00	0.22
106	002294	信立泰	23,800	884,646.00	0.22
107	000066	中国长城	123,538	878,355.18	0.22
108	000876	新希望	136,252	863,837.68	0.22
109	002195	二三四五	201,742	863,455.76	0.21
110	000513	丽珠集团	19,631	862,782.45	0.21
111	000709	河钢股份	286,500	845,175.00	0.21
112	300383	光环新网	63,000	844,830.00	0.21
113	000839	中信国安	177,450	839,338.50	0.21
114	000050	深天马A	58,800	836,136.00	0.21
115	002465	海格通信	104,100	835,923.00	0.21
116	002176	江特电机	85,600	832,032.00	0.21
117	000656	金科股份	171,200	821,760.00	0.20
118	000826	启迪桑德	46,710	816,490.80	0.20
119	300146	汤臣倍健	49,100	815,060.00	0.20
120	000581	威孚高科	36,851	814,775.61	0.20
121	002493	荣盛石化	76,550	789,996.00	0.20
122	000690	宝新能源	113,300	788,568.00	0.20
123	002268	卫士通	35,700	779,331.00	0.19
124	300166	东方国信	52,223	769,244.79	0.19
125	000983	西山煤电	102,400	769,024.00	0.19
126	002075	沙钢股份	47,600	767,312.00	0.19
127	002439	启明星辰	36,100	766,042.00	0.19
128	002624	完美世界	24,500	759,745.00	0.19
129	000961	中南建设	120,200	758,462.00	0.19
130	300266	兴源环境	37,900	757,621.00	0.19
131	002223	鱼跃医疗	38,800	756,212.00	0.19
132	000060	中金岭南	154,245	749,630.70	0.19
133	000488	晨鸣纸业	57,900	748,068.00	0.19
134	002127	南极电商	79,500	746,505.00	0.19
135	300009	安科生物	40,430	745,529.20	0.19
136	000778	新兴铸管	172,932	740,148.96	0.18
137	300450	先导智能	24,062	727,634.88	0.18
138	002035	华帝股份	29,700	725,571.00	0.18

139	002019	亿帆医药	41,100	725,415.00	0.18
140	002352	顺丰控股	16,100	724,500.00	0.18
141	300088	长信科技	124,804	723,863.20	0.18
142	000039	中集集团	54,500	723,760.00	0.18
143	002085	万丰奥威	76,928	723,123.20	0.18
144	002500	山西证券	105,900	713,766.00	0.18
145	002558	巨人网络	30,000	713,400.00	0.18
146	000596	古井贡酒	8,000	710,240.00	0.18
147	002110	三钢闽光	44,300	710,129.00	0.18
148	002640	跨境通	47,200	708,944.00	0.18
149	000750	国海证券	198,250	707,752.50	0.18
150	000999	华润三九	25,400	706,882.00	0.18
151	300170	汉得信息	43,450	705,628.00	0.18
152	300315	掌趣科技	168,700	705,166.00	0.18
153	002221	东华能源	71,900	702,463.00	0.17
154	000997	新大陆	44,380	698,985.00	0.17
155	002602	世纪华通	21,000	682,500.00	0.17
156	300433	蓝思科技	31,840	668,003.20	0.17
157	002074	国轩高科	47,500	667,850.00	0.17
158	000415	渤海金控	114,060	666,110.40	0.17
159	000887	中鼎股份	46,200	665,742.00	0.17
160	002470	金正大	96,600	664,608.00	0.17
161	300418	昆仑万维	35,200	664,576.00	0.17
162	000040	东旭蓝天	65,400	660,540.00	0.16
163	002408	齐翔腾达	53,700	659,436.00	0.16
164	300027	华谊兄弟	105,675	650,958.00	0.16
165	002013	中航机电	85,778	649,339.46	0.16
166	000732	泰禾集团	33,100	643,795.00	0.16
167	002371	北方华创	12,900	640,743.00	0.16
168	002183	怡亚通	96,340	640,661.00	0.16
169	002185	华天科技	113,240	638,673.60	0.16
170	000671	阳光城	106,890	638,133.30	0.16
171	300251	光线传媒	62,220	633,399.60	0.16
172	000402	金融街	78,363	630,822.15	0.16
173	002153	石基信息	21,385	620,165.00	0.15
174	000988	华工科技	42,900	619,905.00	0.15
175	000960	锡业股份	51,300	616,113.00	0.15
176	300182	捷成股份	81,259	615,943.22	0.15
177	000686	东北证券	95,700	613,437.00	0.15
178	000009	中国宝安	124,264	608,893.60	0.15
179	000938	紫光股份	9,700	607,220.00	0.15
180	000930	中粮生化	57,900	596,370.00	0.15

181	000975	银泰资源	58,760	595,826.40	0.15
182	300271	华宇软件	33,440	591,219.20	0.15
183	300558	贝达药业	10,600	590,102.00	0.15
184	002385	大北农	142,650	589,144.50	0.15
185	300014	亿纬锂能	33,421	588,209.60	0.15
186	002273	水晶光电	45,580	586,614.60	0.15
187	000046	泛海控股	102,812	585,000.28	0.15
188	002506	协鑫集成	124,900	584,532.00	0.15
189	000559	万向钱潮	85,340	580,312.00	0.14
190	000401	冀东水泥	65,300	579,211.00	0.14
191	300324	旋极信息	60,556	574,676.44	0.14
192	000939	*ST 凯迪	114,800	572,852.00	0.14
193	300073	当升科技	16,800	572,208.00	0.14
194	002138	顺络电子	35,600	569,956.00	0.14
195	002359	北讯集团	29,100	569,778.00	0.14
196	002497	雅化集团	53,900	568,106.00	0.14
197	002030	达安基因	36,442	561,935.64	0.14
198	300274	阳光电源	62,535	560,938.95	0.14
199	002491	通鼎互联	50,400	557,928.00	0.14
200	300413	芒果超媒	14,700	557,718.00	0.14
201	002373	千方科技	42,700	557,235.00	0.14
202	000729	燕京啤酒	81,800	550,514.00	0.14
203	002147	新光圆成	37,240	549,662.40	0.14
204	002032	苏泊尔	10,600	545,900.00	0.14
205	000970	中科三环	58,200	544,170.00	0.14
206	000547	航天发展	68,400	534,204.00	0.13
207	002280	联络互动	93,175	532,961.00	0.13
208	300316	晶盛机电	40,010	531,732.90	0.13
209	000008	神州高铁	107,100	531,216.00	0.13
210	000717	韶钢松山	80,900	530,704.00	0.13
211	000898	鞍钢股份	95,053	529,445.21	0.13
212	300010	立思辰	43,100	527,544.00	0.13
213	300287	飞利信	73,200	526,308.00	0.13
214	002610	爱康科技	250,100	525,210.00	0.13
215	000878	云南铜业	54,796	522,753.84	0.13
216	002396	星网锐捷	25,500	521,985.00	0.13
217	002353	杰瑞股份	31,887	518,163.75	0.13
218	002407	多氟多	36,800	515,936.00	0.13
219	300203	聚光科技	20,100	514,560.00	0.13
220	000627	天茂集团	73,100	513,162.00	0.13
221	002023	海特高新	40,900	512,886.00	0.13
222	000591	太阳能	139,900	512,034.00	0.13

223	000883	湖北能源	124,500	511,695.00	0.13
224	000598	兴蓉环境	125,700	510,342.00	0.13
225	002281	光迅科技	24,000	508,800.00	0.13
226	002028	思源电气	30,100	505,379.00	0.13
227	002399	海普瑞	22,720	503,020.80	0.13
228	300113	顺网科技	28,882	502,835.62	0.13
229	002174	游族网络	25,185	501,181.50	0.12
230	002440	闰土股份	42,806	500,402.14	0.12
231	002583	海能达	59,920	500,332.00	0.12
232	300033	同花顺	12,800	497,536.00	0.12
233	002573	清新环境	42,900	495,495.00	0.12
234	002563	森马服饰	34,600	494,780.00	0.12
235	002051	中工国际	32,028	489,067.56	0.12
236	300133	华策影视	45,878	488,600.70	0.12
237	002168	深圳惠程	47,400	487,272.00	0.12
238	000807	云铝股份	94,000	486,920.00	0.12
239	002366	台海核电	33,860	482,843.60	0.12
240	300090	盛运环保	58,008	482,626.56	0.12
241	000516	国际医学	100,600	481,874.00	0.12
242	000078	海王生物	100,150	481,721.50	0.12
243	000089	深圳机场	62,900	481,185.00	0.12
244	300055	万邦达	41,600	477,984.00	0.12
245	300115	长盈精密	36,840	477,814.80	0.12
246	300058	蓝色光标	83,334	475,003.80	0.12
247	002368	太极股份	16,300	473,841.00	0.12
248	002603	以岭药业	33,800	472,524.00	0.12
249	300197	铁汉生态	87,981	472,457.97	0.12
250	002383	合众思壮	28,500	471,675.00	0.12
251	002004	华邦健康	91,800	466,344.00	0.12
252	000738	航发控制	34,950	465,883.50	0.12
253	002601	龙蟠佰利	35,900	464,187.00	0.12
254	002244	滨江集团	89,000	462,800.00	0.12
255	002426	胜利精密	128,300	461,880.00	0.11
256	002701	奥瑞金	84,000	458,640.00	0.11
257	300618	寒锐钴业	3,560	456,890.40	0.11
258	300355	蒙草生态	75,160	451,711.60	0.11
259	002600	领益智造	86,900	451,011.00	0.11
260	300036	超图软件	22,000	448,580.00	0.11
261	002517	恺英网络	62,150	446,858.50	0.11
262	002597	金禾实业	22,000	446,160.00	0.11
263	002131	利欧股份	212,443	446,130.30	0.11
264	002358	森源电气	29,600	445,480.00	0.11

265	002665	首航节能	76,690	444,802.00	0.11
266	000799	酒鬼酒	16,000	444,000.00	0.11
267	002411	必康股份	15,500	439,270.00	0.11
268	000848	承德露露	41,365	438,055.35	0.11
269	002285	世联行	69,770	437,457.90	0.11
270	300463	迈克生物	17,500	436,275.00	0.11
271	000917	电广传媒	75,400	434,304.00	0.11
272	000028	国药一致	8,700	434,130.00	0.11
273	000981	银亿股份	58,100	432,845.00	0.11
274	300199	翰宇药业	30,072	429,428.16	0.11
275	002191	劲嘉股份	57,475	429,338.25	0.11
276	002555	三七互娱	35,200	427,680.00	0.11
277	002831	裕同科技	8,500	425,000.00	0.11
278	002151	北斗星通	16,500	424,050.00	0.11
279	300496	中科创达	14,354	423,012.38	0.11
280	002152	广电运通	71,900	422,772.00	0.11
281	002343	慈文传媒	22,400	420,448.00	0.10
282	300026	红日药业	115,000	419,750.00	0.10
283	000758	中色股份	92,860	417,870.00	0.10
284	002595	豪迈科技	24,000	417,360.00	0.10
285	300098	高新兴	52,062	415,454.76	0.10
286	300367	东方网力	33,200	415,000.00	0.10
287	002745	木林森	23,300	414,507.00	0.10
288	300159	新研股份	58,400	413,472.00	0.10
289	002501	利源精制	66,505	412,331.00	0.10
290	000059	华锦股份	59,400	409,266.00	0.10
291	000800	一汽轿车	54,500	407,660.00	0.10
292	002266	浙富控股	107,030	401,362.50	0.10
293	002250	联化科技	45,200	398,664.00	0.10
294	002444	巨星科技	36,200	398,562.00	0.10
295	000902	新洋丰	43,302	398,378.40	0.10
296	000031	中粮地产	68,841	397,900.98	0.10
297	300244	迪安诊断	20,896	397,232.96	0.10
298	002709	天赐材料	10,300	396,962.00	0.10
299	002108	沧州明珠	67,466	396,025.42	0.10
300	002180	纳思达	14,400	395,424.00	0.10
301	300377	赢时胜	28,747	390,671.73	0.10
302	300101	振芯科技	27,300	385,749.00	0.10
303	002431	棕榈股份	56,950	382,134.50	0.10
304	002025	航天电器	16,490	380,919.00	0.09
305	000507	珠海港	40,500	379,890.00	0.09
306	300207	欣旺达	42,000	378,420.00	0.09

307	002699	美盛文化	20,100	377,076.00	0.09
308	300212	易华录	15,940	376,981.00	0.09
309	000027	深圳能源	76,300	376,922.00	0.09
310	000012	南玻A	76,051	376,452.45	0.09
311	000156	华数传媒	38,900	374,996.00	0.09
312	002505	大康农业	174,710	373,879.40	0.09
313	002716	金贵银业	22,200	373,848.00	0.09
314	300222	科大智能	20,100	372,654.00	0.09
315	000006	深振业A	63,400	371,524.00	0.09
316	000933	神火股份	77,000	370,370.00	0.09
317	002128	露天煤业	40,800	369,648.00	0.09
318	002672	东江环保	28,100	367,829.00	0.09
319	300053	欧比特	31,550	365,980.00	0.09
320	000926	福星股份	50,900	365,971.00	0.09
321	002668	奥马电器	18,200	365,820.00	0.09
322	002390	信邦制药	49,550	362,706.00	0.09
323	002056	横店东磁	51,700	362,417.00	0.09
324	000718	苏宁环球	98,696	362,214.32	0.09
325	002477	雏鹰农牧	109,000	360,790.00	0.09
326	002089	新海宜	59,300	358,765.00	0.09
327	002839	张家港行	58,800	358,092.00	0.09
328	000666	经纬纺机	19,800	357,984.00	0.09
329	000036	华联控股	60,100	356,994.00	0.09
330	000723	美锦能源	65,700	356,751.00	0.09
331	002120	韵达股份	6,699	355,381.95	0.09
332	002449	国星光电	33,340	354,737.60	0.09
333	300145	中金环境	45,300	354,699.00	0.09
334	002155	湖南黄金	51,500	352,260.00	0.09
335	300294	博雅生物	11,350	351,736.50	0.09
336	300459	金科文化	36,400	351,624.00	0.09
337	300068	南都电源	29,210	349,935.80	0.09
338	300628	亿联网络	5,300	349,323.00	0.09
339	002091	江苏国泰	55,000	349,250.00	0.09
340	300257	开山股份	22,800	348,612.00	0.09
341	000021	深科技	50,500	344,410.00	0.09
342	300118	东方日升	31,800	343,440.00	0.09
343	300078	思创医惠	35,760	339,004.80	0.08
344	002389	南洋科技	24,900	337,146.00	0.08
345	002157	正邦科技	82,500	335,775.00	0.08
346	300002	神州泰岳	80,084	333,950.28	0.08
347	002292	奥飞娱乐	37,000	330,410.00	0.08
348	000563	陕国投A	97,100	330,140.00	0.08

349	002437	誉衡药业	53,200	329,840.00	0.08
350	000400	许继电气	42,200	329,582.00	0.08
351	000685	中山公用	41,340	329,479.80	0.08
352	002036	联创电子	25,000	328,000.00	0.08
353	000727	华东科技	174,000	327,120.00	0.08
354	002670	国盛金控	30,360	326,977.20	0.08
355	002249	大洋电机	74,634	321,672.54	0.08
356	002424	贵州百灵	28,300	321,488.00	0.08
357	002400	省广集团	99,066	319,983.18	0.08
358	002048	宁波华翔	25,900	319,347.00	0.08
359	000980	众泰汽车	44,800	318,528.00	0.08
360	002421	达实智能	78,500	317,925.00	0.08
361	000712	锦龙股份	31,800	317,364.00	0.08
362	000034	神州数码	19,785	316,164.30	0.08
363	002354	天神娱乐	34,020	315,025.20	0.08
364	002123	梦网集团	35,101	312,047.89	0.08
365	300001	特锐德	27,400	311,264.00	0.08
366	002299	圣农发展	19,900	308,251.00	0.08
367	000869	张裕A	7,700	306,922.00	0.08
368	300323	华灿光电	23,500	303,620.00	0.08
369	002237	恒邦股份	33,100	302,203.00	0.08
370	300020	银江股份	31,500	299,565.00	0.07
371	002664	长鹰信质	11,900	298,690.00	0.07
372	002002	鸿达兴业	64,657	298,068.77	0.07
373	000088	盐田港	45,200	297,868.00	0.07
374	000937	冀中能源	72,400	297,564.00	0.07
375	002544	杰赛科技	21,700	297,073.00	0.07
376	002468	申通快递	17,300	296,695.00	0.07
377	002055	得润电子	18,600	296,670.00	0.07
378	000667	美好置业	137,300	292,449.00	0.07
379	002073	软控股份	50,700	291,525.00	0.07
380	000979	中弘股份	286,316	289,179.16	0.07
381	000587	金洲慈航	58,300	289,168.00	0.07
382	002047	宝鹰股份	49,100	287,726.00	0.07
383	300038	梅泰诺	26,980	287,606.80	0.07
384	300083	劲胜智能	59,100	284,862.00	0.07
385	000921	海信科龙	27,400	283,864.00	0.07
386	002635	安洁科技	16,500	283,800.00	0.07
387	002242	九阳股份	16,000	283,040.00	0.07
388	000901	航天科技	28,100	281,562.00	0.07
389	300085	银之杰	21,470	278,680.60	0.07
390	000592	平潭发展	98,100	278,604.00	0.07

391	000158	常山北明	40,170	275,967.90	0.07
392	002512	达华智能	28,400	275,480.00	0.07
393	000687	华讯方舟	29,700	273,537.00	0.07
394	000877	天山股份	40,400	272,700.00	0.07
395	002308	威创股份	32,819	272,397.70	0.07
396	002245	澳洋顺昌	42,100	272,387.00	0.07
397	002043	兔宝宝	35,400	271,164.00	0.07
398	002233	塔牌集团	23,600	269,984.00	0.07
399	002434	万里扬	30,700	269,546.00	0.07
400	000090	天健集团	43,272	268,286.40	0.07
401	002303	美盈森	50,800	268,224.00	0.07
402	002429	兆驰股份	107,300	266,104.00	0.07
403	002503	搜于特	76,000	266,000.00	0.07
404	000426	兴业矿业	36,800	265,328.00	0.07
405	000822	山东海化	38,000	264,860.00	0.07
406	002657	中科金财	16,700	264,528.00	0.07
407	300431	暴风集团	17,341	263,236.38	0.07
408	000061	农产品	48,600	262,440.00	0.07
409	002773	康弘药业	5,000	260,050.00	0.06
410	002608	江苏国信	37,600	259,440.00	0.06
411	000762	西藏矿业	26,900	259,047.00	0.06
412	002145	中核钛白	69,900	257,232.00	0.06
413	002643	万润股份	33,950	253,606.50	0.06
414	002841	视源股份	4,740	253,163.40	0.06
415	300156	神雾环保	37,883	252,679.61	0.06
416	002428	云南锗业	32,300	249,356.00	0.06
417	002642	荣之联	26,800	246,292.00	0.06
418	000539	粤电力A	58,040	246,089.60	0.06
419	000600	建投能源	43,900	244,523.00	0.06
420	002143	印纪传媒	20,140	243,492.60	0.06
421	002542	中化岩土	45,500	242,970.00	0.06
422	002489	浙江永强	66,200	240,968.00	0.06
423	000555	神州信息	18,100	240,368.00	0.06
424	000990	诚志股份	17,100	239,400.00	0.06
425	300134	大富科技	26,769	239,314.86	0.06
426	300364	中文在线	33,764	237,698.56	0.06
427	300273	和佳股份	35,030	237,503.40	0.06
428	300075	数字政通	17,500	236,075.00	0.06
429	002010	传化智联	19,300	234,495.00	0.06
430	000062	深圳华强	11,908	233,396.80	0.06
431	000049	德赛电池	8,000	225,760.00	0.06
432	002011	盾安环境	35,000	224,000.00	0.06

433	300474	景嘉微	4,800	223,104.00	0.06
434	000710	贝瑞基因	4,400	221,584.00	0.06
435	002681	奋达科技	25,340	219,444.40	0.05
436	002482	广田集团	36,350	217,009.50	0.05
437	300317	珈伟股份	18,100	215,390.00	0.05
438	002302	西部建设	19,700	212,169.00	0.05
439	000973	佛塑科技	53,100	206,028.00	0.05
440	300458	全志科技	11,422	204,682.24	0.05
441	300310	宜通世纪	32,060	204,542.80	0.05
442	000959	首钢股份	48,700	200,157.00	0.05
443	002190	成飞集成	11,700	199,953.00	0.05
444	002625	光启技术	16,690	195,439.90	0.05
445	002522	浙江众成	30,000	194,100.00	0.05
446	000612	焦作万方	36,500	191,625.00	0.05
447	002261	拓维信息	41,200	189,520.00	0.05
448	300291	华录百纳	25,953	182,968.65	0.05
449	000957	中通客车	26,400	180,576.00	0.04
450	000806	银河生物	40,900	177,097.00	0.04
451	002648	卫星石化	14,800	163,244.00	0.04
452	300116	坚瑞沃能	56,700	156,492.00	0.04
453	000615	京汉股份	24,700	155,363.00	0.04
454	000564	供销大集	32,400	154,872.00	0.04
455	000987	越秀金控	18,500	145,410.00	0.04
456	000617	中油资本	8,200	92,168.00	0.02
457	000766	通化金马	6,171	73,311.48	0.02
458	002325	洪涛股份	4,100	15,170.00	0.00
459	300077	国民技术	300	3,336.00	0.00
460	300137	先河环保	200	3,196.00	0.00
461	002277	友阿股份	600	2,766.00	0.00
462	300037	新宙邦	100	2,679.00	0.00
463	002099	海翔药业	500	2,565.00	0.00
464	300079	数码科技	700	2,548.00	0.00
465	000543	皖能电力	570	2,513.70	0.00
466	002022	科华生物	201	2,381.85	0.00
467	300185	通裕重工	1,300	2,353.00	0.00
468	000620	新华联	400	2,268.00	0.00
469	000829	天音控股	300	2,199.00	0.00
470	002130	沃尔核材	500	2,180.00	0.00
471	300506	名家汇	100	2,073.00	0.00
472	000751	锌业股份	620	2,021.20	0.00
473	300157	恒泰艾普	300	1,950.00	0.00
474	000969	安泰科技	300	1,875.00	0.00

475	002375	亚厦股份	350	1,869.00	0.00
476	300352	北信源	450	1,818.00	0.00
477	002276	万马股份	300	1,752.00	0.00
478	002106	莱宝高科	300	1,728.00	0.00
479	000680	山推股份	500	1,720.00	0.00
480	000875	吉电股份	600	1,698.00	0.00
481	002479	富春环保	300	1,695.00	0.00
482	002413	雷科防务	300	1,617.00	0.00
483	300284	苏交科	200	1,586.00	0.00
484	002307	北新路桥	280	1,545.60	0.00
485	002342	巨力索具	400	1,516.00	0.00
486	000801	四川九洲	338	1,510.86	0.00
487	300359	全通教育	200	1,424.00	0.00
488	002326	永太科技	200	1,390.00	0.00
489	002695	煌上煌	100	1,338.00	0.00
490	000018	神州长城	400	1,328.00	0.00
491	300304	云意电气	300	1,260.00	0.00
492	002284	亚太股份	200	1,160.00	0.00
493	002175	东方网络	300	1,143.00	0.00
494	000558	莱茵体育	300	1,074.00	0.00
495	000802	北京文化	100	1,044.00	0.00
496	002041	登海种业	150	1,023.00	0.00
497	000881	中广核技	100	999.00	0.00
498	002636	金安国纪	100	807.00	0.00
499	002018	*ST 华信	490	710.50	0.00
500	300216	千山药机	100	531.00	0.00

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	300601	康泰生物	16,300	1,011,415.00	0.25
2	000566	海南海药	57,034	735,168.26	0.18
3	000932	华菱钢铁	83,000	705,500.00	0.18
4	002821	凯莱英	8,000	697,840.00	0.17
5	002262	恩华药业	34,000	680,340.00	0.17
6	000681	视觉中国	19,900	571,130.00	0.14
7	000528	柳工	52,100	557,991.00	0.14
8	002341	新纶科技	40,100	532,929.00	0.13
9	000831	五矿稀土	40,600	472,584.00	0.12
10	300285	国瓷材料	23,500	468,590.00	0.12
11	300226	上海钢联	7,800	466,830.00	0.12

12	300188	美亚柏科	24,700	452,010.00	0.11
13	002372	伟星新材	24,900	440,481.00	0.11
14	000935	四川双马	26,400	408,672.00	0.10
15	000016	深康佳A	76,400	401,100.00	0.10
16	002419	天虹股份	27,200	397,120.00	0.10
17	000989	九芝堂	20,200	381,780.00	0.10
18	300308	中际旭创	6,200	372,248.00	0.09
19	300373	扬杰科技	13,000	371,800.00	0.09
20	002596	海南瑞泽	35,700	366,282.00	0.09
21	300476	胜宏科技	23,400	360,360.00	0.09
22	002156	通富微电	32,800	355,224.00	0.09
23	002402	和而泰	42,200	350,260.00	0.09
24	002212	南洋股份	29,200	347,188.00	0.09
25	002812	创新股份	6,800	334,084.00	0.08
26	000910	大亚圣象	19,300	326,170.00	0.08
27	300054	鼎龙股份	36,800	320,896.00	0.08
28	002916	深南电路	5,000	317,550.00	0.08
29	001965	招商公路	38,300	311,762.00	0.08
30	002061	浙江交科	29,500	308,865.00	0.08
31	300699	光威复材	6,600	298,320.00	0.07
32	000155	川化股份	52,800	296,208.00	0.07
33	002251	步步高	25,700	292,466.00	0.07
34	002222	福晶科技	22,400	292,096.00	0.07
35	002807	江阴银行	51,200	287,744.00	0.07
36	300666	江丰电子	5,100	281,163.00	0.07
37	300676	华大基因	2,900	280,749.00	0.07
38	300353	东土科技	21,800	278,822.00	0.07
39	000537	广宇发展	28,900	278,596.00	0.07
40	000553	沙隆达A	17,400	275,094.00	0.07
41	000789	万年青	25,100	274,594.00	0.07
42	000525	红太阳	15,200	257,640.00	0.06
43	002509	天广中茂	86,600	252,006.00	0.06
44	002320	海峡股份	12,700	240,665.00	0.06
45	002920	德赛西威	7,100	212,290.00	0.05
46	002080	中材科技	20,800	176,800.00	0.04
47	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.03
48	002911	佛燃股份	4,000	89,320.00	0.02
49	000693	*ST华泽	25,500	84,405.00	0.02
50	002907	华森制药	2,900	81,403.00	0.02

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	002027	分众传媒	1,532,942.00	0.34
2	000830	鲁西化工	1,170,427.00	0.26
3	002594	比亚迪	1,053,300.00	0.23
4	300601	康泰生物	1,008,286.10	0.22
5	002035	华帝股份	949,634.20	0.21
6	000401	冀东水泥	871,315.00	0.19
7	000040	东旭蓝天	870,685.00	0.19
8	000591	太阳能	755,703.00	0.17
9	000717	韶钢松山	733,597.00	0.16
10	002497	雅化集团	718,278.00	0.16
11	000932	华菱钢铁	703,178.00	0.15
12	002821	凯莱英	694,160.00	0.15
13	000703	恒逸石化	685,728.00	0.15
14	002262	恩华药业	676,660.00	0.15
15	000413	东旭光电	654,369.00	0.14
16	300316	晶盛机电	651,078.00	0.14
17	002359	北讯集团	635,272.70	0.14
18	002110	三钢闽光	598,919.00	0.13
19	002475	立讯精密	593,916.00	0.13
20	002597	金禾实业	574,577.18	0.13

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	000651	格力电器	1,278,126.00	0.28
2	000858	五粮液	947,018.78	0.21
3	300104	乐视网	769,534.90	0.17
4	000002	万科A	757,650.00	0.17
5	000333	美的集团	731,398.00	0.16
6	000697	炼石有色	724,699.00	0.16
7	000001	平安银行	645,732.00	0.14
8	000725	京东方A	609,018.00	0.13
9	300498	温氏股份	525,523.00	0.12
10	002926	华西证券	492,227.84	0.11
11	300077	国民技术	467,960.00	0.10
12	002630	华西能源	455,972.00	0.10
13	000518	四环生物	452,365.00	0.10

14	000601	韶能股份	451,694.83	0.10
15	002104	恒宝股份	436,709.00	0.10
16	002304	洋河股份	413,033.53	0.09
17	002067	景兴纸业	409,195.40	0.09
18	002251	步步高	397,004.00	0.09
19	002436	兴森科技	393,759.00	0.09
20	000063	中兴通讯	386,328.00	0.09

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	60,056,002.02
卖出股票收入(成交)总额	56,423,442.08

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

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 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收到公开谴责、处罚的情形

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

7.12.2 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

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	1,998.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	260.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,259.10

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：本基金本报告期末指数投资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价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000566	海南海药	735,168.26	0.18	重大事项停牌

§ 8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

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		中国工商银行股份有限公司-南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
5,467	72,097.04	43,422,620.00	0.87	147,410,455.00	37.40	243,321,432.00	61.73

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

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	董凤芹	2,900,000.00	0.74
2	董亮斗	2,841,806.00	0.72
3	刘素坚	1,845,018.00	0.47
4	刘萍	1,800,000.00	0.46
5	邬海滨	1,475,867.00	0.37
6	凌燕	1,475,778.00	0.37
7	杨悦文	1,418,265.00	0.36
8	刘春霞	1,332,800.00	0.34
9	王勇	1,200,000.00	0.30
10	章斌	1,151,301.00	0.29
11	中国工商银行股份有限公司—南方深证成份交易型开放式指数证券投	243,321,432.00	61.73

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注:无。

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

基金合同生效日(2009年12月4日)基金份额总额	4,127,538,537.00
本报告期期初基金份额总额	379,154,507.00
本报告期基金总申购份额	36,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	21,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	394,154,507.00

§ 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、基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

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	3	115,594,419.57	100.00%	11,562.07	100.00%	
中信建投	2	-	-	-	-	
国泰君安	2	-	-	-	-	
国信证券	1	-	-	-	-	

海通证券	1	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-

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
东北证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	1,384,577.20	100.00%	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

注：-

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	深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）（2017年第2号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月09日
2	深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017年第2号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月09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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况

	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	20180101-20180630	237,321,432.00	267,321,432.00	261,321,432.00	243,321,432.00	61.73
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

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深证成份交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同；
- 3、深证成份交易型开放式指数证券投资基金托管协议；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

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>