

南方深证成份交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 2019 年半年度报告

2019 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

报告送出日期：2019 年 8 月 23 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本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 2019 年 8 月 21 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
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.....	12
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 本报告期投资基金情况.....	49

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.13 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
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.....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	南方深证成份 ETF 联接	
基金主代码	202017	
前端交易代码	202017	
后端交易代码	202018	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 12 月 9 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	346,184,095.68 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	深成联接 A	深成联接 C
下属分级基金的交易代码	202017	004345
报告期末下属分级基金的份 额总额	330,673,904.60 份	15,510,191.08 份

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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159903
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 4 日
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
基金管理人名称	南方基金管理股份有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

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

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于深成 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，以深成 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资深成 ETF。本基金并不参与深成 ETF 的管理。为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于深成 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。在正常市场情况下，本基金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、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	深证成份指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为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。 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，从而使投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证成份指数。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。
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
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95588
传真	0755-82763889	010-66105798
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	厦 32-42 楼	
邮政编码	518017	100140
法定代表人	张海波	陈四清

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

1、深成联接 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,461,850.48
本期利润	62,235,505.31
加权平均基金份额本期利润	0.1785
本期加权平均净值利润率	23.77%
本期基金份额净值增长率	26.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-74,040,608.12
期末可供分配基金份额利润	-0.2239
期末基金资产净值	256,633,296.48
期末基金份额净值	0.7761
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-22.39%

2、深成联接 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	20,558.17
本期利润	1,731,776.11
加权平均基金份额本期利润	0.1317
本期加权平均净值利润率	17.58%
本期基金份额净值增长率	25.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	-3,567,739.23
期末可供分配基金份额利润	-0.2300
期末基金资产净值	11,942,451.85
期末基金份额净值	0.7700
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-9.19%

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

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

深成联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.00%	1.30%	2.73%	1.31%	0.27%	-0.01%
过去三个月	-6.29%	1.74%	-6.95%	1.74%	0.66%	0.00%
过去六个月	26.20%	1.70%	25.41%	1.71%	0.79%	-0.01%
过去一年	-0.65%	1.63%	-1.85%	1.64%	1.20%	-0.01%

过去三年	-8.32%	1.23%	-11.61%	1.24%	3.29%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-22.39%	1.54%	-30.83%	1.56%	8.44%	-0.02%

深成联接 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.97%	1.30%	2.73%	1.31%	0.24%	-0.01%
过去三个月	-6.38%	1.74%	-6.95%	1.74%	0.57%	0.00%
过去六个月	25.94%	1.70%	25.41%	1.71%	0.53%	-0.01%
过去一年	-1.04%	1.63%	-1.85%	1.64%	0.81%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-9.19%	1.31%	-10.85%	1.32%	1.66%	-0.01%

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

深成联接A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



深成联接C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018年1月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019年7月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为36172万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司41.16%、深圳市投资控股有限公司27.44%、厦门国际信托有限公司13.72%、兴业证券股份有限公司9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业（有限合伙）2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）2.20%。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳、南京等地设有分公司，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）管理资产规模超过 8800 亿元，旗下管理 191 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户理财投资组合。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用

基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为5次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数成份股调整所致。

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

深证成指报告期内上涨 26.78%。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

(1) 接受申购赎回所带来的股票仓位偏离，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

(2) 本基金大额赎回目标 ETF 所带来的成份股权重偏离，对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行应对；

(3) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

(4) 根据指数成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 0.7761 元，报告期内，份额净值增长率为 26.20%，同期业绩基准增长率为 25.41%；本基金 C 份额净值为 0.7700 元，报告期内，份额净值增长率为 25.94%，同期业绩基准增长率为 25.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美联储如期降息，IMF 年内再度下调全球经济增长预期，各国央行相继降息托底经济下行，全球货币政策宽松态势明朗，支撑全球风险资产估值。730 中央政治局会议定调，下半年经济下行压力加大，但稳增长和调结构并重，不搞大水漫灌，货币政策保障流动性合理充裕，财政政策重视加力提效，为迎接祖国 70 周年，扎实推进做好经济工作，下半年经济失速风险不大，叠加去年低基数和减税降费政策效果逐步显现，上市公司盈利有望在 3、4 季度见底，盈利趋势有望在年底反转。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，同一类别每一基金份额享有同等分配权；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合相关基金分红条件的前提下，本基金每类基金份额的收益分配每年最多 6 次，各基金份额类别每次基金收益分配比例不得低于该类基金份额基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；本基金 A 类与 C 类基金份额收益分

配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金分红或将现金分红按除权日的该类基金份额净值自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金 A 类与 C 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；目前本基金 H 类基金份额收益分配方式仅为现金分红；如未来条件允许，本基金 H 类基金份额可增加红利再投资的收益分配方式供 H 类基金份额持有人选择，该项调整须经基金管理人与基金托管人协商一致并报中国证监会备案并公告后实施，无需召开基金份额持有人大会审议；增加红利再投资的收益分配后，如 H 类基金份额持有人未选择，本基金 H 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，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，南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、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，南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接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南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2019 上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：南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	14,027,347.43	3,583,157.60
结算备付金		47,568.45	21,977.35
存出保证金		12,995.53	6,718.62
交易性金融资产	6.4.3.2	255,625,657.04	227,441,925.02
其中：股票投资		10,138,664.30	8,663,290.17
基金投资		245,486,992.74	208,734,634.85
债券投资		-	10,044,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	2,562.55	280,324.46
应收股利		-	-
应收申购款		204,926.58	216,962.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	2,379.41
资产总计		269,921,057.58	231,553,444.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,233,595.27	57,115.12
应付管理人报酬		10,247.88	9,572.39
应付托管费		2,049.59	1,914.46
应付销售服务费		4,142.69	2,361.34
应付交易费用	6.4.3.7	1,925.59	986.14
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	93,348.23	354,074.95
负债合计		1,345,309.25	426,024.40
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	346,184,095.68	375,886,140.83
未分配利润	6.4.3.10	-77,608,347.35	-144,758,720.69
所有者权益合计		268,575,748.33	231,127,420.14
负债和所有者权益总计		269,921,057.58	231,553,444.54

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，深成联接 A 份额净值 0.7761 元，基金份额总额 330,673,904.60 份；深成联接 C 份额净值 0.7700 元，基金份额总额 15,510,191.08 份；总份额合计 346,184,095.68 份。

6.2 利润表

会计主体：南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		64,189,237.27	-42,068,172.88
1. 利息收入		133,625.63	136,866.79
其中：存款利息收入	6.4.3.11	35,242.00	39,727.41
债券利息收入		98,383.63	97,139.38

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）		1,416,956.84	-88,012.88
其中：股票投资收益	6.4.3.12	1,858,373.58	-821,962.77
基金投资收益		-478,332.62	657,243.45
债券投资收益	6.4.3.13	-18,732.04	4,185.48
资产支持证券投资	6.4.3.14	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.3.15	-	-
衍生工具收益	6.4.3.16	-	-
股利收益	6.4.3.17	55,647.92	72,520.96
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	62,484,872.77	-42,140,066.36
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.19	153,782.03	23,039.57
减：二、费用		221,955.85	275,791.48
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	50,727.33	58,859.00
2. 托管费	6.4.6.2.2	10,145.53	11,771.76
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	19,345.49	3,553.39
4. 交易费用	6.4.3.20	51,955.50	25,741.95
5. 利息支出		-	194.91
其中：卖出回购金融资产支出		-	194.91
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.21	89,782.00	175,670.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		63,967,281.42	-42,343,964.36

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		63,967,281.42	-42,343,964.36

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	375,886,140.83	-144,758,720.69	231,127,420.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	63,967,281.42	63,967,281.42
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）	-29,702,045.15	3,183,091.92	-26,518,953.23
其中：1. 基金申购款	90,354,338.23	-22,024,502.50	68,329,835.73
2. 基金赎回款	-120,056,383.38	25,207,594.42	-94,848,788.96
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）	346,184,095.68	-77,608,347.35	268,575,748.33
项目	上年度可比期间 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）	335,364,316.58	-31,302,141.31	304,062,175.27
二、本期经营活动产	-	-42,343,964.36	-42,343,964.36

生的基金净值变动数 (本期利润)			
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)	14,252,400.42	-2,859,864.69	11,392,535.73
其中: 1. 基金申购款	52,193,167.47	-6,782,098.96	45,411,068.51
2. 基金赎回款	-37,940,767.05	3,922,234.27	-34,018,532.78
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)	349,616,717.00	-76,505,970.36	273,110,746.64

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

本报告期所采用的会计政策, 会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 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 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	14,027,347.43
定期存款	-
其中: 存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	14,027,347.43

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	9,881,746.76	10,138,664.30	256,917.54
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	263,712,076.94	245,486,992.74	-18,225,084.20
其他	-	-	-
合计	273,593,823.70	255,625,657.04	-17,968,166.66

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

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,538.07
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	19.26
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	5.22
合计	2,562.55

6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,925.59
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,925.59

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,678.23
应退退补款	-
预提费用	89,670.00
应付指数使用费	-
可退退补款	-
其他	-
合计	93,348.23

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

深成联接 A		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	363,578,640.20	363,578,640.20
本期申购	54,711,975.30	54,711,975.30
本期赎回（以“-”号填列）	-87,616,710.90	-87,616,710.90
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	330,673,904.60	330,673,904.60

金额单位：人民币元

深成联接 C		
--------	--	--

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	12,307,500.63	12,307,500.63
本期申购	35,642,362.93	35,642,362.93
本期赎回 (以“-”号填列)	-32,439,672.48	-32,439,672.48
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	15,510,191.08	15,510,191.08

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. H 类份额尚未开放申购赎回业务。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

深成联接 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	65,065,847.23	-205,041,351.83	-139,975,504.60
本期利润	1,461,850.48	60,773,654.83	62,235,505.31
本期基金份额交易产生的变动数	-6,029,177.93	9,728,569.10	3,699,391.17
其中：基金申购款	9,912,900.54	-23,772,767.08	-13,859,866.54
基金赎回款	-15,942,078.47	33,501,336.18	17,559,257.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,498,519.78	-134,539,127.90	-74,040,608.12

单位：人民币元

深成联接 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,143,871.99	-6,927,088.08	-4,783,216.09
本期利润	20,558.17	1,711,217.94	1,731,776.11
本期基金份额交易产生的变动数	576,335.64	-1,092,634.89	-516,299.25
其中：基金申购款	6,301,381.83	-14,466,017.79	-8,164,635.96
基金赎回款	-5,725,046.19	13,373,382.90	7,648,336.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,740,765.80	-6,308,505.03	-3,567,739.23

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	34,943.29
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	220.65
其他	78.06
合计	35,242.00

6.4.3.12 股票投资收益

6.4.3.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,597,882.62
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	260,490.96
合计	1,858,373.58

6.4.3.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	40,756,033.24
减：卖出股票成本总额	39,158,150.62
买卖股票差价收入	1,597,882.62

6.4.3.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

6.4.3.12.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	7,952,700.00
减：现金支付申购款总额	-303,680.66
减：申购股票成本总额	7,995,889.70
申购差价收入	260,490.96

6.4.3.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	32,035,705.48
减：卖出/赎回基金成本总额	32,514,038.10
基金投资收益	-478,332.62

6.4.3.14 债券投资收益

6.4.3.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,378,211.13
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	10,018,943.10
减：应收利息总额	378,000.07
买卖债券差价收入	-18,732.04

6.4.3.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.3.16 贵金属投资收益

6.4.3.16.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.3.17 衍生工具收益

6.4.3.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.3.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.3.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	55,647.92
基金投资产生的股利收益	-
合计	55,647.92

6.4.3.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	62,484,872.77
——股票投资	1,194,229.23
——债券投资	-25,256.90
——资产支持证券投资	-
——基金投资	61,315,900.44
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-

——期货投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	62,484,872.77

6.4.3.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	148,238.65
基金转换费收入	5,543.38
合计	153,782.03

注：1. A类、C类基金份额的赎回费率按持有期间递减，A类基金份额不低于赎回费总额的25%归入基金资产，C类基金份额赎回费全额归入基金资产；H类基金份额赎回费率为0.125%，赎回费全额归入基金资产。

2. A类、C类基金份额的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费两部分构成，其中A类基金份额不低于赎回费部分的25%归入转出基金的基金资产，C类基金份额赎回费部分全额归入基金资产。

6.4.3.21 交易费用

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	51,115.53
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	839.97
其中：申购费	-
赎回费	-
场内交易费	-
其他	839.97
合计	51,955.50

6.4.3.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,917.22
银行费用	112.00
合计	89,782.00

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司新增厦门合泽吉企业管理合伙企业（有限合伙）、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）四名股东，股权结构发生变更。基金管理人已于 2019 年 8 月 1 日发布相关公告。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
深证成份交易型开放式指数证券投资基金(“目标ETF”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	54,893,246.78	100.00%	45,833,584.97	100.00%

6.4.6.1.2 基金交易

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰证券	40,466,738.10	100.00%	19,677,898.92	100.00%

注：本报告期内基金成交金额中基金申购赎回 40466738.10 元，基金二级市场买卖 0.00 元。

6.4.6.1.3 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.6.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	5,489.67	100.00%	1,935.61	100.52%
关联方名称	上年度可比期间 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	4,584.13	100.22%	2,934.10	100.34%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	50,727.33	58,859.00
其中：支付销售机构的客户 维护费	66,202.64	134,886.18

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

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

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	10,145.53	11,771.76

注：本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，支付基金托管人中国工商银行

的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额

(若为负数，则取零)的 0.10%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式

为：

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

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	深成联接 A	深成联接 C	合计
工商银行	-	1,857.78	1,857.78
华泰证券	-	413.33	413.33
南方基金	-	1,847.66	1,847.66
合计	-	4,118.77	4,118.77
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	深成联接 A	深成联接 C	合计
工商银行	-	360.29	360.29
南方基金	-	768.89	768.89
华泰证券	-	4.39	4.39
合计	-	1,133.57	1,133.57

注：支付 C 类基金份额销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值

0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支

付给各基金销售机构。A 类基金份额、H 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

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

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.4.2 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

无。

6.4.6.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日 至 2018 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
工商银行	14,027,347.43	34,943.29	4,426,094.07	39,148.74

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

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

6.4.6.7.1 其他关联交易事项的说明

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有 243,321,432 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 60.35% (2018 年 12 月 31 日，本基金持有 264,321,432 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 59.78%)。

6.4.7 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.8 期末（2019 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为完全被动式指数型基金，紧密跟踪标的指数，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。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资及债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，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。

6.4.9.2 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 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。

6.4.9.3 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 2019 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，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。

6.4.9.3.1 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时间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 6.4.8。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。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 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、存出保证金和债券投资等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	14,027,347.43	-	-	-	14,027,347.43
结算备付金	47,568.45	-	-	-	47,568.45
存出保证金	12,995.53	-	-	-	12,995.53
交易性金融资产	-	-	-	255,625,657.04	255,625,657.04
买入返售金	-	-	-	-	-

融资产					
应收利息	-	-	-	2,562.55	2,562.55
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	204,926.58	204,926.58
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,087,911.41	-	-	255,833,146.17	269,921,057.58
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,233,595.27	1,233,595.27
应付管理人报酬	-	-	-	10,247.88	10,247.88
应付托管费	-	-	-	2,049.59	2,049.59
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	4,142.69	4,142.69
应付交易费用	-	-	-	1,925.59	1,925.59
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	93,348.23	93,348.23
负债总计	-	-	-	1,345,309.25	1,345,309.25
利率敏感度缺口	14,087,911.41	-	-	254,487,836.92	268,575,748.33
上年度末 2018 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	3,583,157.60	-	-	-	3,583,157.60
结算备付金	21,977.35	-	-	-	21,977.35
存出保证金	6,718.62	-	-	-	6,718.62
交易性金融资产	10,044,000.00	-	-	217,397,925.02	227,441,925.02
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	280,324.46	280,324.46
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	216,962.08	216,962.08

应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	2,379.41	2,379.41
资产总计	13,655,853.57	-	-	217,897,590.97	231,553,444.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	57,115.12	57,115.12
应付管理人报酬	-	-	-	9,572.39	9,572.39
应付托管费	-	-	-	1,914.46	1,914.46
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	2,361.34	2,361.34
应付交易费用	-	-	-	986.14	986.14
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	354,074.95	354,074.95
负债总计	-	-	-	426,024.40	426,024.40
利率敏感度缺口	13,655,853.57	-	-	217,471,566.57	231,127,420.14

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 06 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 0.00% (2018 年 12 月 31 日：4.35%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2018 年 12 月 31 日：同)。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于能通过股票组合赎回

或二级市场交易卖出的目标 ETF 份额，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	10,138,664.30	3.77	8,663,290.17	3.75
交易性金融资产-基金投资	245,486,992.74	91.40	208,734,634.85	90.31
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	255,625,657.04	95.18	217,397,925.02	94.06

注：交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标 ETF 份额。

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	12,591,502.52	12,078,232.39
	2.组合自身基准下降 5%	-12,591,502.52	-12,078,232.39

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	10,138,664.30	3.76
	其中：股票	10,138,664.30	3.76
2	基金投资	245,486,992.74	90.95
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	14,074,915.88	5.21
8	其他资产	220,484.66	0.08
9	合计	269,921,057.58	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	303,285.20	0.11
B	采矿业	83,615.60	0.03
C	制造业	6,448,523.58	2.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	111,061.00	0.04
E	建筑业	60,926.00	0.02
F	批发和零售业	201,659.50	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	108,360.40	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	967,722.58	0.36
J	金融业	720,901.30	0.27
K	房地产业	528,186.00	0.20
L	租赁和商务服务业	168,715.44	0.06
M	科学研究和技术服务业	43,358.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	67,653.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	15,103.00	0.01
Q	卫生和社会工作	157,275.70	0.06
R	文化、体育和娱乐业	136,095.89	0.05
S	综合	16,222.11	0.01

合计	10,138,664.30	3.77
----	---------------	------

7.2.2 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投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：

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	000651	格力电器	7,200	396,000.00	0.15
2	000333	美的集团	7,600	394,136.00	0.15
3	000858	五粮液	2,800	330,260.00	0.12
4	300498	温氏股份	5,920	212,291.20	0.08
5	000002	万科A	7,100	197,451.00	0.07
6	000001	平安银行	12,600	173,628.00	0.06
7	002415	海康威视	5,387	148,573.46	0.06
8	000725	京东方A	38,900	133,816.00	0.05
9	000063	中兴通讯	3,700	120,361.00	0.04
10	002304	洋河股份	900	109,404.00	0.04
11	300059	东方财富	7,865	106,570.75	0.04
12	000568	泸州老窖	1,200	96,996.00	0.04
13	002475	立讯精密	3,730	92,466.70	0.03
14	002027	分众传媒	16,936	89,591.44	0.03
15	002142	宁波银行	3,590	87,021.60	0.03
16	000338	潍柴动力	6,900	84,801.00	0.03
17	002230	科大讯飞	2,400	79,776.00	0.03
18	300750	宁德时代	1,100	75,768.00	0.03
19	001979	招商蛇口	3,600	75,240.00	0.03
20	000661	长春高新	200	67,600.00	0.03
21	002594	比亚迪	1,300	65,936.00	0.02
22	000776	广发证券	4,500	61,830.00	0.02
23	000166	申万宏源	12,200	61,122.00	0.02
24	002024	苏宁易购	5,300	60,844.00	0.02
25	002714	牧原股份	1,000	58,790.00	0.02
26	000538	云南白药	700	58,394.00	0.02
27	300015	爱尔眼科	1,850	57,294.50	0.02
28	300142	沃森生物	2,000	56,720.00	0.02
29	000876	新希望	3,100	53,847.00	0.02
30	000100	TCL 集团	16,100	53,613.00	0.02
31	002202	金风科技	4,054	50,391.22	0.02
32	000783	长江证券	6,200	48,422.00	0.02

33	002008	大族激光	1,300	44,694.00	0.02
34	000157	中联重科	7,400	44,474.00	0.02
35	002736	国信证券	3,300	43,428.00	0.02
36	002422	科伦药业	1,400	41,622.00	0.02
37	300003	乐普医疗	1,800	41,436.00	0.02
38	002044	美年健康	3,180	39,559.20	0.01
39	300124	汇川技术	1,700	38,947.00	0.01
40	300347	泰格医药	500	38,550.00	0.01
41	002007	华兰生物	1,230	37,502.70	0.01
42	000895	双汇发展	1,500	37,335.00	0.01
43	000860	顺鑫农业	790	36,853.50	0.01
44	002236	大华股份	2,500	36,300.00	0.01
45	002410	广联达	1,100	36,179.00	0.01
46	002311	海大集团	1,100	33,990.00	0.01
47	002001	新和成	1,760	33,950.40	0.01
48	000413	东旭光电	6,500	33,410.00	0.01
49	002157	正邦科技	2,000	33,320.00	0.01
50	000069	华侨城 A	4,700	32,665.00	0.01
51	300760	迈瑞医疗	200	32,640.00	0.01
52	002271	东方雨虹	1,430	32,403.80	0.01
53	002405	四维图新	2,000	32,200.00	0.01
54	000963	华东医药	1,240	32,190.40	0.01
55	000768	中航飞机	2,000	31,500.00	0.01
56	300017	网宿科技	2,900	31,262.00	0.01
57	300408	三环集团	1,600	31,120.00	0.01
58	000977	浪潮信息	1,300	31,018.00	0.01
59	300136	信维通信	1,260	30,807.00	0.01
60	002352	顺丰控股	900	30,564.00	0.01
61	300122	智飞生物	700	30,170.00	0.01
62	300033	同花顺	300	29,508.00	0.01
63	000425	徐工机械	6,600	29,436.00	0.01
64	000066	中国长城	2,844	29,236.32	0.01
65	300024	机器人	1,900	28,937.00	0.01
66	002460	赣锋锂业	1,200	28,116.00	0.01
67	002127	南极电商	2,500	28,100.00	0.01
68	000728	国元证券	3,050	27,968.50	0.01
69	000423	东阿阿胶	700	27,874.00	0.01
70	002673	西部证券	2,760	27,820.80	0.01
71	002466	天齐锂业	1,100	27,808.00	0.01
72	002241	歌尔股份	3,000	26,670.00	0.01
73	002049	紫光国微	600	26,466.00	0.01
74	002129	中环股份	2,700	26,352.00	0.01
75	002195	二三四五	6,651	25,872.39	0.01

76	300253	卫宁健康	1,820	25,807.60	0.01
77	002340	格林美	5,430	25,575.30	0.01
78	300144	宋城演艺	1,100	25,454.00	0.01
79	002179	中航光电	756	25,295.76	0.01
80	300383	光环新网	1,500	25,155.00	0.01
81	000750	国海证券	5,000	25,150.00	0.01
82	000703	恒逸石化	1,820	24,861.20	0.01
83	002463	沪电股份	1,800	24,516.00	0.01
84	002146	荣盛发展	2,600	24,414.00	0.01
85	002507	涪陵榨菜	800	24,400.00	0.01
86	300014	亿纬锂能	799	24,337.54	0.01
87	000401	冀东水泥	1,376	24,231.36	0.01
88	002439	启明星辰	900	24,210.00	0.01
89	002465	海格通信	2,500	23,850.00	0.01
90	000961	中南建设	2,750	23,815.00	0.01
91	000540	中天金融	6,200	23,746.00	0.01
92	000596	古井贡酒	200	23,702.00	0.01
93	000938	紫光股份	868	23,653.00	0.01
94	000630	铜陵有色	9,600	23,616.00	0.01
95	000786	北新建材	1,300	23,569.00	0.01
96	002456	欧菲光	3,000	23,520.00	0.01
97	300450	先导智能	700	23,520.00	0.01
98	300146	汤臣倍健	1,200	23,280.00	0.01
99	300012	华测检测	2,100	22,680.00	0.01
100	002384	东山精密	1,550	22,583.50	0.01
101	002120	韵达股份	720	22,190.40	0.01
102	002223	鱼跃医疗	900	22,158.00	0.01
103	000623	吉林敖东	1,350	22,126.50	0.01
104	300296	利亚德	2,800	21,924.00	0.01
105	002555	三七互娱	1,600	21,680.00	0.01
106	002081	金螳螂	2,100	21,651.00	0.01
107	000625	长安汽车	3,200	21,216.00	0.01
108	300601	康泰生物	400	21,000.00	0.01
109	002065	东华软件	3,000	20,970.00	0.01
110	002493	荣盛石化	1,725	20,803.50	0.01
111	002371	北方华创	300	20,775.00	0.01
112	002385	大北农	3,900	20,631.00	0.01
113	000656	金科股份	3,400	20,502.00	0.01
114	002916	深南电路	200	20,384.00	0.01
115	002739	万达电影	1,100	20,284.00	0.01
116	000997	新大陆	1,200	20,268.00	0.01
117	300070	碧水源	2,600	20,254.00	0.01
118	002797	第一创业	3,180	20,161.20	0.01

119	002268	卫 士 通	820	20,049.00	0.01
120	002506	协鑫集成	3,000	20,040.00	0.01
121	000629	攀钢钒钛	5,900	20,001.00	0.01
122	002926	华西证券	1,900	19,950.00	0.01
123	000709	河钢股份	6,600	19,734.00	0.01
124	002821	凯 莱 英	200	19,616.00	0.01
125	002500	山西证券	2,400	19,440.00	0.01
126	000686	东北证券	2,200	19,382.00	0.01
127	002050	三花智控	1,830	19,306.50	0.01
128	002092	中泰化学	2,400	19,104.00	0.01
129	002508	老板电器	700	18,998.00	0.01
130	000988	华工科技	1,200	18,984.00	0.01
131	000503	国新健康	1,100	18,876.00	0.01
132	000050	深天马 A	1,400	18,816.00	0.01
133	002373	千方科技	1,100	18,810.00	0.01
134	002252	上海莱士	2,700	18,765.00	0.01
135	000060	中金岭南	3,950	18,525.50	0.01
136	002353	杰瑞股份	800	18,480.00	0.01
137	002013	中航机电	2,675	18,404.00	0.01
138	000627	天茂集团	2,800	18,172.00	0.01
139	300168	万达信息	1,400	18,158.00	0.01
140	002153	石基信息	500	18,095.00	0.01
141	300285	国瓷材料	1,050	17,860.50	0.01
142	000778	新兴铸管	4,000	17,760.00	0.01
143	002299	圣农发展	700	17,724.00	0.01
144	000975	银泰资源	1,340	17,674.60	0.01
145	000999	华润三九	600	17,604.00	0.01
146	002138	顺络电子	1,000	17,580.00	0.01
147	300454	深 信 服	200	17,508.00	0.01
148	000830	鲁西化工	1,600	17,408.00	0.01
149	300207	欣 旺 达	1,500	17,280.00	0.01
150	300676	华大基因	300	17,112.00	0.01
151	300271	华宇软件	900	17,100.00	0.01
152	002602	世纪华通	1,560	17,035.20	0.01
153	002387	维 信 诺	1,300	16,965.00	0.01
154	000960	锡业股份	1,500	16,755.00	0.01
155	000690	宝新能源	2,600	16,744.00	0.01
156	002572	索 菲 亚	900	16,704.00	0.01
157	000839	中信国安	4,150	16,683.00	0.01
158	000039	中集集团	1,560	16,660.80	0.01
159	000513	丽珠集团	500	16,615.00	0.01
160	000547	航天发展	1,700	16,252.00	0.01
161	000831	五矿稀土	1,000	16,230.00	0.01

162	000009	中国宝安	2,841	16,222.11	0.01
163	002191	劲嘉股份	1,300	16,133.00	0.01
164	002600	领益智造	2,700	16,011.00	0.01
165	000970	中科三环	1,400	15,890.00	0.01
166	002281	光迅科技	600	15,888.00	0.01
167	002075	沙钢股份	2,000	15,680.00	0.01
168	000723	美锦能源	1,500	15,675.00	0.01
169	300072	三聚环保	1,970	15,622.10	0.01
170	000671	阳光城	2,400	15,552.00	0.01
171	002624	完美世界	600	15,486.00	0.01
172	002217	合力泰	2,800	15,484.00	0.01
173	002032	苏泊尔	200	15,166.00	0.01
174	002607	中公教育	1,100	15,103.00	0.01
175	300009	安科生物	948	15,073.20	0.01
176	300226	上海钢联	200	14,992.00	0.01
177	002078	太阳纸业	2,200	14,982.00	0.01
178	300170	汉得信息	1,100	14,949.00	0.01
179	002131	利欧股份	7,810	14,917.10	0.01
180	000402	金融街	1,900	14,896.00	0.01
181	000581	威孚高科	800	14,848.00	0.01
182	002601	龙蟠佰利	1,000	14,830.00	0.01
183	300088	长信科技	2,900	14,674.00	0.01
184	000983	西山煤电	2,400	14,544.00	0.01
185	300166	东方国信	1,180	14,502.20	0.01
186	000998	隆平高科	1,000	14,480.00	0.01
187	300001	特锐德	800	14,416.00	0.01
188	300274	阳光电源	1,540	14,399.00	0.01
189	300098	高新兴	1,798	14,348.04	0.01
190	000883	湖北能源	3,300	14,322.00	0.01
191	000089	深圳机场	1,600	14,224.00	0.01
192	002038	双鹭药业	600	14,136.00	0.01
193	000598	兴蓉环境	3,100	14,105.00	0.01
194	002019	亿帆医药	1,150	14,087.50	0.01
195	300747	锐科激光	100	14,001.00	0.01
196	002110	三钢闽光	1,500	13,950.00	0.01
197	000046	泛海控股	2,500	13,950.00	0.01
198	000932	华菱钢铁	2,920	13,928.40	0.01
199	002074	国轩高科	1,060	13,896.60	0.01
200	000825	太钢不锈	3,400	13,838.00	0.01
201	002085	万丰奥威	1,900	13,832.00	0.01
202	000878	云南铜业	1,300	13,819.00	0.01
203	000800	一汽轿车	1,400	13,776.00	0.01
204	300027	华谊兄弟	2,800	13,748.00	0.01

205	000563	陕国投 A	3,080	13,675.20	0.01
206	300357	我武生物	400	13,568.00	0.01
207	002180	纳思达	600	13,560.00	0.01
208	002152	广电运通	1,975	13,528.75	0.01
209	002396	星网锐捷	600	13,464.00	0.01
210	300315	掌趣科技	3,900	13,455.00	0.01
211	002294	信立泰	600	13,428.00	0.00
212	002237	恒邦股份	800	13,368.00	0.00
213	000898	鞍钢股份	3,510	13,302.90	0.00
214	002185	华天科技	2,600	13,234.00	0.00
215	002372	伟星新材	760	13,224.00	0.00
216	000732	泰禾集团	800	13,200.00	0.00
217	002690	美亚光电	400	13,040.00	0.00
218	002002	鸿达兴业	2,100	12,999.00	0.00
219	000826	启迪环境	1,100	12,969.00	0.00
220	002233	塔牌集团	1,100	12,848.00	0.00
221	002773	康弘药业	390	12,838.80	0.00
222	002266	浙富控股	2,700	12,825.00	0.00
223	300058	蓝色光标	3,000	12,810.00	0.00
224	002035	华帝股份	1,050	12,789.00	0.00
225	002558	巨人网络	700	12,719.00	0.00
226	000807	云铝股份	2,700	12,663.00	0.00
227	002004	华邦健康	2,600	12,636.00	0.00
228	000758	中色股份	2,300	12,627.00	0.00
229	300180	华峰超纤	900	12,618.00	0.00
230	000729	燕京啤酒	1,900	12,616.00	0.00
231	002595	豪迈科技	600	12,606.00	0.00
232	002310	东方园林	2,100	12,600.00	0.00
233	300182	捷成股份	2,849	12,564.09	0.00
234	000559	万向钱潮	2,100	12,558.00	0.00
235	300188	美亚柏科	700	12,481.00	0.00
236	300529	健帆生物	200	12,470.00	0.00
237	002440	闰土股份	1,000	12,460.00	0.00
238	300558	贝达药业	300	12,450.00	0.00
239	002273	水晶光电	1,070	12,390.60	0.00
240	002212	南洋股份	900	12,330.00	0.00
241	300413	芒果超媒	300	12,315.00	0.00
242	002511	中顺洁柔	1,000	12,280.00	0.00
243	002023	海特高新	1,000	12,240.00	0.00
244	000415	渤海租赁	3,100	12,152.00	0.00
245	002368	太极股份	400	12,120.00	0.00
246	002155	湖南黄金	1,200	12,084.00	0.00
247	002589	瑞康医药	1,590	12,068.10	0.00

248	000738	航发控制	900	12,060.00	0.00
249	002010	传化智联	1,600	12,048.00	0.00
250	300203	聚光科技	500	11,950.00	0.00
251	300316	晶盛机电	940	11,928.60	0.00
252	002174	游族网络	700	11,816.00	0.00
253	300212	易华录	480	11,760.00	0.00
254	002583	海能达	1,400	11,746.00	0.00
255	000683	远兴能源	4,500	11,745.00	0.00
256	002938	鹏鼎控股	400	11,744.00	0.00
257	000516	国际医学	2,300	11,684.00	0.00
258	300496	中科创达	400	11,632.00	0.00
259	300418	昆仑万维	900	11,583.00	0.00
260	000887	中鼎股份	1,200	11,508.00	0.00
261	300073	当升科技	500	11,485.00	0.00
262	000591	太阳能	3,500	11,480.00	0.00
263	002183	怡亚通	2,400	11,448.00	0.00
264	002727	一心堂	400	11,396.00	0.00
265	000528	柳工	1,710	11,388.60	0.00
266	300339	润和软件	800	11,280.00	0.00
267	300010	立思辰	1,200	11,268.00	0.00
268	300038	数知科技	1,200	11,232.00	0.00
269	002610	爱康科技	6,000	11,220.00	0.00
270	300133	华策影视	1,660	11,171.80	0.00
271	000008	神州高铁	2,956	11,144.12	0.00
272	002080	中材科技	1,230	11,143.80	0.00
273	300699	光威复材	340	11,118.00	0.00
274	000560	我爱我家	2,300	10,994.00	0.00
275	300113	顺网科技	700	10,976.00	0.00
276	000031	大悦城	1,700	10,914.00	0.00
277	300251	光线传媒	1,600	10,880.00	0.00
278	002408	齐翔腾达	1,400	10,850.00	0.00
279	002640	跨境通	1,300	10,829.00	0.00
280	000650	仁和药业	1,500	10,815.00	0.00
281	002449	国星光电	810	10,756.80	0.00
282	002701	奥瑞金	2,300	10,741.00	0.00
283	000902	新洋丰	1,000	10,730.00	0.00
284	000488	晨鸣纸业	2,000	10,720.00	0.00
285	300628	亿联网络	100	10,707.00	0.00
286	300595	欧普康视	300	10,680.00	0.00
287	002407	多氟多	900	10,656.00	0.00
288	000040	东旭蓝天	1,600	10,624.00	0.00
289	000021	深科技	1,300	10,569.00	0.00
290	000027	深圳能源	1,700	10,540.00	0.00

291	002399	海普瑞	500	10,495.00	0.00
292	000877	天山股份	900	10,458.00	0.00
293	002402	和而泰	1,100	10,417.00	0.00
294	002648	卫星石化	700	10,416.00	0.00
295	002176	江特电机	2,100	10,227.00	0.00
296	300244	迪安诊断	600	10,188.00	0.00
297	002665	首航节能	3,000	10,170.00	0.00
298	002042	华孚时尚	1,400	10,164.00	0.00
299	002557	洽洽食品	400	10,100.00	0.00
300	000793	华闻传媒	3,000	10,080.00	0.00
301	002670	国盛金控	800	10,080.00	0.00
302	300463	迈克生物	400	10,052.00	0.00
303	300026	红日药业	2,900	10,005.00	0.00
304	300053	欧比特	1,000	9,980.00	0.00
305	002468	申通快递	400	9,976.00	0.00
306	300457	赢合科技	400	9,972.00	0.00
307	000400	许继电气	1,100	9,966.00	0.00
308	002563	森马服饰	900	9,954.00	0.00
309	000156	华数传媒	900	9,909.00	0.00
310	002056	横店东磁	1,300	9,880.00	0.00
311	000739	普洛药业	1,000	9,830.00	0.00
312	002497	雅化集团	1,400	9,786.00	0.00
313	000930	中粮生化	1,300	9,776.00	0.00
314	002025	航天电器	400	9,752.00	0.00
315	300451	创业慧康	650	9,717.50	0.00
316	002491	通鼎互联	1,200	9,708.00	0.00
317	000681	视觉中国	500	9,690.00	0.00
318	002426	胜利精密	3,750	9,600.00	0.00
319	002414	高德红外	500	9,600.00	0.00
320	000059	华锦股份	1,500	9,600.00	0.00
321	300002	神州泰岳	2,400	9,552.00	0.00
322	300294	博雅生物	350	9,502.50	0.00
323	002912	中新赛克	100	9,387.00	0.00
324	002608	江苏国信	1,100	9,383.00	0.00
325	002812	恩捷股份	200	9,350.00	0.00
326	300433	蓝思科技	1,340	9,339.80	0.00
327	002151	北斗星通	400	9,292.00	0.00
328	002603	以岭药业	800	9,264.00	0.00
329	000727	华东科技	4,400	9,196.00	0.00
330	002488	金固股份	1,100	9,163.00	0.00
331	300118	东方日升	900	9,162.00	0.00
332	002244	滨江集团	2,200	9,130.00	0.00
333	002597	金禾实业	500	9,120.00	0.00

334	002249	大洋电机	2,100	9,114.00	0.00
335	002643	万润股份	900	9,090.00	0.00
336	002030	达安基因	843	9,045.39	0.00
337	000926	福星股份	1,300	8,996.00	0.00
338	300197	铁汉生态	2,500	8,975.00	0.00
339	000012	南 玻 A	2,149	8,939.84	0.00
340	002302	西部建设	800	8,912.00	0.00
341	000717	韶钢松山	2,000	8,860.00	0.00
342	002573	清新环境	1,100	8,855.00	0.00
343	002168	惠程科技	1,000	8,850.00	0.00
344	000301	东方盛虹	1,600	8,784.00	0.00
345	000901	航天科技	700	8,708.00	0.00
346	000078	海王生物	2,500	8,700.00	0.00
347	300324	旋极信息	1,500	8,685.00	0.00
348	002128	露天煤业	1,000	8,650.00	0.00
349	300630	普利制药	150	8,643.00	0.00
350	002262	恩华药业	800	8,632.00	0.00
351	300115	长盈精密	820	8,601.80	0.00
352	000761	本钢板材	2,000	8,600.00	0.00
353	002716	金贵银业	1,100	8,580.00	0.00
354	000685	中山公用	1,000	8,540.00	0.00
355	000818	航锦科技	800	8,520.00	0.00
356	002839	张家港行	1,500	8,445.00	0.00
357	002366	台海核电	900	8,424.00	0.00
358	300145	中金环境	1,940	8,419.60	0.00
359	002280	联络互动	2,300	8,418.00	0.00
360	000035	中国天楹	1,400	8,400.00	0.00
361	300078	思创医惠	820	8,372.20	0.00
362	000028	国药一致	200	8,366.00	0.00
363	002376	新 北 洋	700	8,365.00	0.00
364	002939	长城证券	500	8,345.00	0.00
365	000848	承德露露	1,000	8,330.00	0.00
366	001965	招商公路	1,000	8,330.00	0.00
367	000718	苏宁环球	2,400	8,304.00	0.00
368	002505	大康农业	4,200	8,274.00	0.00
369	002421	达实智能	2,200	8,206.00	0.00
370	300355	蒙草生态	2,000	8,200.00	0.00
371	000006	深振业 A	1,500	8,175.00	0.00
372	002358	森源电气	800	8,120.00	0.00
373	002285	世 联 行	1,800	8,118.00	0.00
374	002118	紫鑫药业	1,200	8,088.00	0.00
375	002596	海南瑞泽	1,000	8,080.00	0.00
376	002618	丹邦科技	600	8,046.00	0.00

377	002051	中工国际	700	8,029.00	0.00
378	000933	神火股份	1,900	7,999.00	0.00
379	002444	巨星科技	800	7,984.00	0.00
380	000016	深康佳 A	1,900	7,980.00	0.00
381	002028	思源电气	800	7,968.00	0.00
382	002383	合众思壮	700	7,952.00	0.00
383	300054	鼎龙股份	1,000	7,950.00	0.00
384	000158	常山北明	1,460	7,913.20	0.00
385	300068	南都电源	700	7,910.00	0.00
386	002390	信邦制药	1,500	7,905.00	0.00
387	300367	东方网力	800	7,896.00	0.00
388	300474	景嘉微	200	7,892.00	0.00
389	300567	精测电子	150	7,878.00	0.00
390	002419	天虹股份	600	7,836.00	0.00
391	002389	航天彩虹	700	7,812.00	0.00
392	002925	盈趣科技	200	7,802.00	0.00
393	002841	视源股份	100	7,751.00	0.00
394	000712	锦龙股份	600	7,704.00	0.00
395	002831	裕同科技	400	7,668.00	0.00
396	000789	万年青	760	7,615.20	0.00
397	002048	宁波华翔	700	7,574.00	0.00
398	002203	海亮股份	700	7,574.00	0.00
399	300616	尚品宅配	100	7,562.00	0.00
400	300482	万孚生物	200	7,540.00	0.00
401	002537	海联金汇	1,000	7,540.00	0.00
402	000921	海信家电	600	7,488.00	0.00
403	002807	江阴银行	1,600	7,488.00	0.00
404	300308	中际旭创	220	7,477.80	0.00
405	002091	江苏国泰	1,300	7,423.00	0.00
406	300036	超图软件	500	7,390.00	0.00
407	000600	建投能源	1,100	7,370.00	0.00
408	300377	赢时胜	650	7,358.00	0.00
409	300199	翰宇药业	800	7,336.00	0.00
410	002429	兆驰股份	2,650	7,261.00	0.00
411	002709	天赐材料	300	7,260.00	0.00
412	002430	杭氧股份	600	7,236.00	0.00
413	300055	万邦达	1,000	7,130.00	0.00
414	300085	银之杰	500	7,095.00	0.00
415	002292	奥飞娱乐	1,100	7,051.00	0.00
416	002745	木林森	600	7,032.00	0.00
417	300159	新研股份	1,400	6,972.00	0.00
418	000937	冀中能源	1,800	6,948.00	0.00
419	002424	贵州百灵	700	6,916.00	0.00

420	002867	周大生	200	6,838.00	0.00
421	000555	神州信息	600	6,828.00	0.00
422	002672	东江环保	600	6,804.00	0.00
423	002156	通富微电	800	6,784.00	0.00
424	300476	胜宏科技	600	6,780.00	0.00
425	002635	安洁科技	500	6,745.00	0.00
426	000980	众泰汽车	1,600	6,736.00	0.00
427	002047	宝鹰股份	1,200	6,732.00	0.00
428	000990	诚志股份	400	6,564.00	0.00
429	002614	奥佳华	400	6,528.00	0.00
430	300348	长亮科技	450	6,525.00	0.00
431	000564	供销大集	2,500	6,525.00	0.00
432	002544	杰赛科技	500	6,500.00	0.00
433	000539	粤电力 A	1,500	6,450.00	0.00
434	000034	神州数码	500	6,450.00	0.00
435	000426	兴业矿业	1,200	6,444.00	0.00
436	000553	安道麦 A	600	6,432.00	0.00
437	002341	新纶科技	1,100	6,424.00	0.00
438	000869	张裕 A	200	6,424.00	0.00
439	000951	中国重汽	400	6,420.00	0.00
440	000935	四川双马	400	6,396.00	0.00
441	300458	全志科技	300	6,270.00	0.00
442	300037	新宙邦	300	6,252.00	0.00
443	002242	九阳股份	300	6,243.00	0.00
444	002815	崇达技术	400	6,236.00	0.00
445	002611	东方精工	1,600	6,160.00	0.00
446	002737	葵花药业	400	6,156.00	0.00
447	002108	沧州明珠	1,564	6,099.60	0.00
448	002517	恺英网络	1,900	6,061.00	0.00
449	300748	金力永磁	100	6,008.00	0.00
450	000088	盐田港	1,100	6,006.00	0.00
451	300618	寒锐钴业	100	6,000.00	0.00
452	002681	奋达科技	1,378	5,842.72	0.00
453	300633	开立医疗	200	5,712.00	0.00
454	300459	金科文化	1,000	5,690.00	0.00
455	002936	郑州银行	1,100	5,588.00	0.00
456	000910	大亚圣象	500	5,570.00	0.00
457	300257	开山股份	500	5,540.00	0.00
458	002437	誉衡药业	1,400	5,530.00	0.00
459	000766	通化金马	800	5,440.00	0.00
460	002434	万里扬	800	5,432.00	0.00
461	000676	智度股份	600	5,412.00	0.00
462	000989	九芝堂	600	5,340.00	0.00

463	000062	深圳华强	400	5,316.00	0.00
464	000429	粤高速 A	700	5,285.00	0.00
465	002258	利尔化学	400	5,220.00	0.00
466	300222	科大智能	400	5,208.00	0.00
467	002509	天广中茂	2,500	5,150.00	0.00
468	002503	搜于特	1,800	4,950.00	0.00
469	000537	广宇发展	700	4,844.00	0.00
470	002061	浙江交科	800	4,784.00	0.00
471	002251	步步高	600	4,782.00	0.00
472	002625	光启技术	510	4,737.90	0.00
473	000968	蓝焰控股	400	4,644.00	0.00
474	000582	北部湾港	500	4,500.00	0.00
475	300373	扬杰科技	300	4,497.00	0.00
476	002920	德赛西威	200	4,480.00	0.00
477	300634	彩讯股份	200	4,334.00	0.00
478	300323	华灿光电	700	4,326.00	0.00
479	002653	海思科	300	4,260.00	0.00
480	000959	首钢股份	1,200	4,224.00	0.00
481	002382	蓝帆医疗	300	4,146.00	0.00
482	002320	海峡股份	450	4,023.00	0.00
483	000525	红太阳	300	3,873.00	0.00
484	000950	重药控股	700	3,822.00	0.00
485	300666	江丰电子	100	3,792.00	0.00
486	300409	道氏技术	300	3,789.00	0.00
487	000987	越秀金控	400	3,608.00	0.00
488	000710	贝瑞基因	100	3,566.00	0.00
489	002901	大博医疗	100	3,288.00	0.00
490	002016	世荣兆业	400	3,280.00	0.00
491	001872	招商港口	200	3,262.00	0.00
492	002461	珠江啤酒	500	3,175.00	0.00
493	300741	华宝股份	100	3,170.00	0.00
494	002512	达华智能	700	3,164.00	0.00
495	300504	天邑股份	100	2,695.00	0.00
496	300724	捷佳伟创	100	2,662.00	0.00
497	002818	富森美	200	2,566.00	0.00
498	000617	中油资本	200	2,472.00	0.00
499	002907	华森制药	100	1,780.00	0.00
500	002911	佛燃股份	100	1,503.00	0.00

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	000651	格力电器	484,189.00	0.21
2	000333	美的集团	483,590.00	0.21
3	000858	五粮液	307,343.00	0.13
4	300498	温氏股份	294,427.00	0.13
5	000002	万科A	261,991.00	0.11
6	002415	海康威视	223,419.00	0.10
7	000001	平安银行	221,647.00	0.10
8	000725	京东方A	193,056.00	0.08
9	002304	洋河股份	148,463.00	0.06
10	300750	宁德时代	148,291.00	0.06
11	300059	东方财富	143,546.00	0.06
12	002027	分众传媒	137,204.00	0.06
13	000063	中兴通讯	117,731.00	0.05
14	002230	科大讯飞	115,902.00	0.05
15	000568	泸州老窖	112,618.00	0.05
16	001979	招商蛇口	107,233.00	0.05
17	000338	潍柴动力	105,169.00	0.05
18	002475	立讯精密	104,827.00	0.05
19	002142	宁波银行	104,328.00	0.05
20	002594	比亚迪	100,746.00	0.04

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	1,413,404.00	0.61
2	000333	美的集团	1,342,107.00	0.58
3	000858	五粮液	929,920.00	0.40
4	300498	温氏股份	907,740.00	0.39
5	002415	海康威视	753,189.00	0.33
6	000002	万科A	742,367.00	0.32
7	000001	平安银行	647,610.00	0.28
8	000725	京东方A	612,794.00	0.27
9	300059	东方财富	449,817.00	0.19
10	002304	洋河股份	430,722.00	0.19
11	000063	中兴通讯	393,960.00	0.17
12	002230	科大讯飞	341,126.00	0.15
13	002475	立讯精密	326,212.00	0.14

14	000661	长春高新	319,427.00	0.14
15	000338	潍柴动力	313,594.00	0.14
16	002027	分众传媒	312,973.00	0.14
17	002142	宁波银行	298,982.00	0.13
18	000776	广发证券	294,719.00	0.13
19	000568	泸州老窖	293,801.00	0.13
20	002594	比亚迪	272,564.00	0.12

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	14,144,555.22
卖出股票收入（成交）总额	40,756,033.24

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

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

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本报告期投资基金情况

7.10.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (人民币 元)	占基金资 产净值比 例 (%)
1	南方深证 成份 ETF	股票型	交易型开 放式	南方基金 管理股份 有限公司	245,486,99 2.74	91.40

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

无。

7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

7.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.12.3 本期国债期货投资评价

无。

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

报告期内基金投资的前十名证券除平安银行（证券代码 000001）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2018 年 7 月 10 日，平安银行公告，平安银行存在涉嫌违法违规行为，中国银行业监督管理委员会天津监管局根据《中国银监会关于印发〈节能减排授信工作指导意见〉的通知》，《中国银监会关于印发绿色信贷指引的通知》，《流动资金贷款管理暂行办法》，《中华人民共和国银行业监督管理法》对公司公开处罚，罚款人民币 50 万元。

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

7.13.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，

还应对相关股票的投资决策程序做出说明

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

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	12,995.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,562.55
5	应收申购款	204,926.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	220,484.66

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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
深成联接A	14,466	22,858.70	317,870.25	0.10%	330,356,034.35	99.90%
深成联接C	2,940	5,275.58	-	-	15,510,191.08	100.00%
合计	17,406	19,888.78	317,870.25	0.09%	345,866,225.43	99.91%

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

8.2 期末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	深成联接 A	2,034,177.10	0.6152%
	深成联接 C	24.49	0.0002%
	合计	2,034,201.59	0.5876%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	深成联接 A	深成联接 C
基金合同生效日(2009年12月09日)基金份额总额	3,272,356,687.80	-
本报告期期初基金份额总额	363,578,640.20	12,307,500.63
本报告期基金总申购份额	54,711,975.30	35,642,362.93
减：报告期基金总赎回份额	87,616,710.90	32,439,672.48
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	330,673,904.60	15,510,191.08

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门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，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	3	54,893,246.78	100.00%	5,489.67	100.00%	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

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

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰证券	211.13	100.00%	-	-	-	-	40,466,738.10	100.00%
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---	---

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于旗下部分基金增加阳光人寿为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报	2019-01-03
2	南方基金关于旗下部分基金增加腾安基金为销售机构的公告	证券时报	2019-01-24
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	证券时报	2019-02-27
4	南方基金关于旗下部分基金增加基煜基金为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报	2019-03-21
5	南方基金关于旗下部分基金增加长沙银行为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报	2019-03-28
6	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	证券时报	2019-04-01
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	证券时报	2019-04-02
8	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	证券时报	2019-04-02
9	南方基金管理股份有限公司关于山东寿光农村商业银行股份有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	证券时报	2019-04-03
10	南方基金关于旗下部分基金增加中信证券为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报	2019-04-30
11	南方基金关于旗下部分基金增加汇林保大为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报	2019-06-06
12	南方基金关于旗下部分基金增加诺亚正行为销售机构及开通相关业务的公告	证券时报	2019-06-18
13	南方基金管理股份有限公司关于浙江金观诚基金销售有限公司暂停部分业务的公告	证券时报	2019-06-25
14	南方基金管理股份有限公司关于深圳富济基金销售有限公司暂停部分业务的公告	证券时报	2019-06-25
15	南方基金管理股份有限公司关于深圳宜投基金销售有限公司暂停部分业务的公告	证券时报	2019-06-25
16	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	证券时报	2019-06-25
17	南方基金关于开展机构及企业网上交易部分基金赎回费率优惠活动的公告	证券时报	2019-06-26
18	南方基金关于调整中国银行各交易渠道基金定投申购费率优惠标准的公告	证券时报	2019-06-27

19	南方基金管理股份有限公司关于中信建投期货有限公司暂停部分业务的公告	证券时报	2019-06-28
20	南方基金管理股份有限公司关于中国国际期货有限公司暂停部分业务的公告	证券时报	2019-06-28
21	南方基金管理股份有限公司关于北京加和基金销售有限公司暂停部分业务的公告	证券时报	2019-06-28

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件；
- 2、《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 3、《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2019 年半年度报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>