

南方顶峰 TOPIX 交易型开放式指数证 券投资基金(QDII)2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期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2020年8月27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2020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.....	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	5
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	8
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	10
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	32
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	32
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细.....	32
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	32
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	32
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	32
7.8 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.....	32

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	32
7.10 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	33
7.11 投资组合报告附注	33
§8 基金份额持有人信息	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	34
8.2 期末上市基金前十名持有人	34
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	34
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	34
§9 开放式基金份额变动	35
§10 重大事件揭示	35
10.1 基金份额持有人大会决议	35
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	35
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	35
10.4 基金投资策略的改变	35
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	35
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	35
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	36
10.8 其他重大事件	37
§11 影响投资者决策的其他重要信息	37
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	37
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	37
§12 备查文件目录	38
12.1 备查文件目录	38
12.2 存放地点	38
12.3 查阅方式	38

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方顶峰 TOPIX 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)
基金简称	南方顶峰 TOPIX ETF(QDII)
场内简称	东证 ETF (东京证券指数 ETF)
基金主代码	513800
交易代码	513800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 6 月 12 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	53,044,394.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 6 月 25 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“东证 ETF”或“东京证券指数 ETF”。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以目标 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目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。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	本基金的业绩比较基准为经估值汇率调整的标的指数收益率，本基金标的指数为东证指数（Tokyo Stock Price Index, “TOPIX”）。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，一般而言，其风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的境外证券市场相似的风险收益特征。本基金主要投资日本证券市场上市的 ETF，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	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	010-66105798
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 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518017	100140
法定代表人		张海波	陈四清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外投资顾问	境外资产托管人
名称	中文	- 美国北美信托银行有限公司
	英文	- The Northern Trust Company
注册地址	-	50 South La Salle Street, Chicago, Illinois 60603 U.S.A.
办公地址	-	50 South La Salle Street, Chicago, Illinois 60603 U.S.A.
邮政编码	-	60603

2.5 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

2.6 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(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	451,019.68
本期利润	-2,339,133.40
加权平均基金份额本期利润	-0.0454
本期加权平均净值利润率	-4.44%

本期基金份额净值增长率	-5.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	2,396,187.11
期末可供分配基金份额利润	0.0451
期末基金资产净值	56,340,035.51
期末基金份额净值	1.0621
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	6.21%

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。

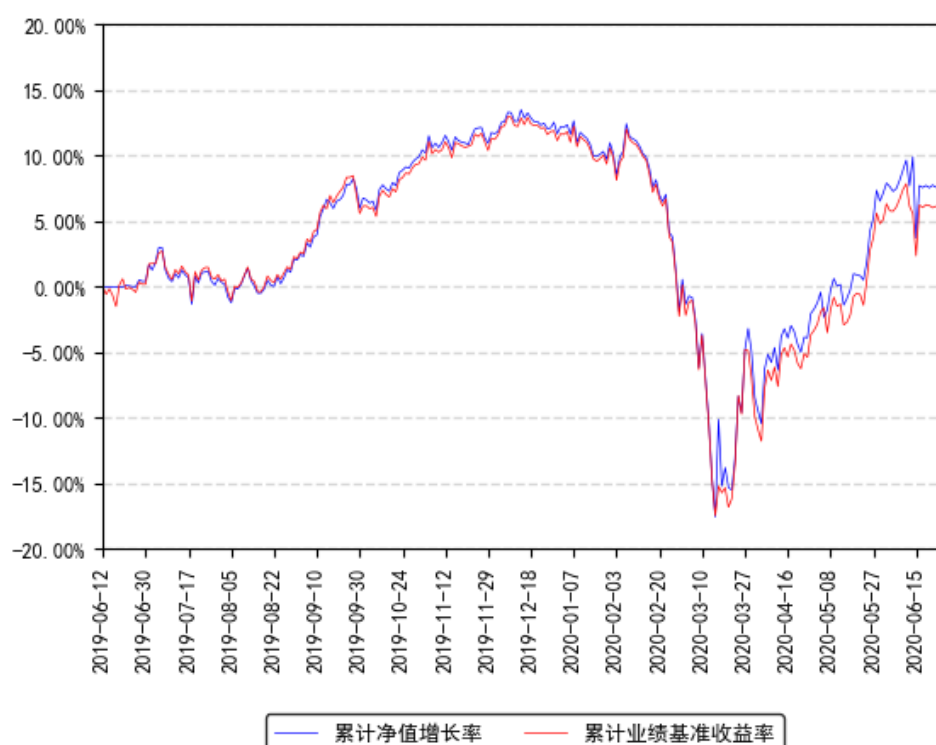
3.2 基金净值表现

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	-0.30%	1.81%	-0.94%	1.34%	0.64%	0.47%
过去三个月	11.72%	1.59%	11.55%	1.42%	0.17%	0.17%
过去六个月	-5.33%	2.03%	-7.01%	1.74%	1.68%	0.29%
过去一年	5.77%	1.48%	3.63%	1.29%	2.14%	0.19%
自基金合同生效起至今	6.21%	1.44%	3.83%	1.26%	2.38%	0.18%

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

南方顶峰TOPIXETF(QDII) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于2019年6月12日生效，截至本报告期末基金成立已满一年；自基金成立日起6个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子

公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，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 10000 亿元，旗下管理 220 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
崔蕾	本基金基金经理	2019 年 6 月 12 日	-	5 年	女，康奈尔大学金融工程硕士，金融风险管理师（FRM），特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2015 年 2 月加入南方基金，历任量化投资部助理研究员、研究员，指数投资部研究员；2018 年 11 月 8 日至今，任南方中证 500 增强基金经理；2019 年 6 月 12 日至今，任南方顶峰 TOPIX ETF（QDII）基金经理；2019 年 6 月 28 日至今，任大数据 300 基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任有色金属、南方有色金属联接、1000ETF、南方小康 ETF、南方小康 ETF 联接基金经理；2019 年 11 月 29 日至今，任南方粤港澳大湾区 ETF 基金经理；2020 年 1 月 17 日至今，任红利 50 基金经理；2020 年 1 月 21 日至今，任南方大盘红利 50 基金经理；2020 年 3 月 26 日至今，任南方粤港澳大湾区联接基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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，两两组合同单日、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。

4.4.2 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3次，是由于接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，东证指数下跌9.45%，日元对人民币汇率中间价上涨2.69%。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，确保了本基金的安全运作。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.0621元，报告期内，份额净值增长率为-5.33%，同期业绩基准增长率为-7.01%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

受新冠疫情影响，日本一季度实际 GDP 环比下降 0.6%，日本股市也因此大跌。自 6 月后随着疫情影响消退、宽松的货币环境、政府刺激方案以及逐步释放的需求支撑，日本央行提高了经济增长预期，预计日本经济在二季度触底，下半年好于上半年的经济增长，但是复苏较为缓慢。长期来看，将会有利于日本股市的基本面及情绪面，但是短期受到疫情的影响较大，充满较多的不确定性。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同约定，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。基金管理人对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；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配采取现金分红方式；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。

4.9 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，本基金已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，具体时间范围如下：

2020 年 02 月 27 日至 2020 年 04 月 21 日

§ 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顶峰 TOPIX ETF (QDII) 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，南方顶峰 TOPIX ETF (QDII) 的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方顶峰 TOPIX ETF(QDII)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，南方顶峰 TOPIX ETF (QDII) 未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期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顶峰 TOPIX ETF (QDII) 2020 年中期报告中财务指标、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 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方顶峰 TOPIX 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.5.1	15,659.05	36,193.57
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.5.2	56,840,628.13	56,957,832.14
其中：股票投资		-	-
基金投资		56,840,628.13	56,957,832.14
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.5.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.5.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.5.5	1.24	15.90
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.5.6	8.45	-
资产总计		56,856,296.87	56,994,041.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.5.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,470.27	9,720.66
应付托管费		2,367.57	2,430.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.5.7	-	-
应交税费		-	1,403.09
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.5.8	504,423.52	62,391.40
负债合计		516,261.36	75,945.31
所有者权益：			
实收基金	6.4.5.9	53,044,394.00	50,734,394.00
未分配利润	6.4.5.10	3,295,641.51	6,183,702.30
所有者权益合计		56,340,035.51	56,918,096.30
负债和所有者权益总计		56,856,296.87	56,994,041.61

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0621 元，基金份额总额 53,044,394.00 份。

6.2 利润表

会计主体：南方顶峰 TOPIX 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 6 月 12 日（基金合同生 效日）至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		-2,177,113.73	652,747.69
1. 利息收入		348.44	210,752.43
其中：存款利息收入	6.4.5.11	348.44	164,673.67
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	46,078.76
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		544,059.33	-
其中：股票投资收益	6.4.5.12	-	-

基金投资收益	6.4.5.13	29,481.02	-
债券投资收益	6.4.5.14	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.5.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.5.16	-	-
衍生工具收益	6.4.5.17	-	-
股利收益	6.4.5.18	514,578.31	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.5.19	-2,790,153.08	356,434.12
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-14,042.00	-244.90
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.5.20	82,673.58	85,806.04
减：二、费用		162,019.67	142,905.05
1. 管理人报酬	6.4.8.1.1	52,502.84	24,702.18
2. 托管费	6.4.8.1.2	13,125.73	6,175.56
3. 销售服务费	6.4.8.1.3	-	-
4. 交易费用	6.4.5.21	16,461.21	105,106.22
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		276.77	-
7. 其他费用	6.4.5.22	79,653.12	6,921.09
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-2,339,133.40	509,842.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		-2,339,133.40	509,842.64

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方顶峰 TOPIX 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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)	50,734,394.00	6,183,702.30	56,918,096.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-2,339,133.40	-2,339,133.40
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)	2,310,000.00	-548,927.39	1,761,072.61
其中: 1. 基金申购款	7,010,000.00	-366,197.03	6,643,802.97
2. 基金赎回款	-4,700,000.00	-182,730.36	-4,882,730.36
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)	53,044,394.00	3,295,641.51	56,340,035.51
项目	上年度可比期间 2019 年 6 月 12 日(基金合同生效日)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)	308,434,394.00	-	308,434,394.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	509,842.64	509,842.64
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)	-236,910,000.00	-211,006.06	-237,121,006.06
其中: 1. 基金申购款	-	-	-

2. 基金赎回款	-236,910,000.00	-211,006.06	-237,121,006.06
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	71,524,394.00	298,836.58	71,823,230.58

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 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.2 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。

6.4.2.1 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.3 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.3.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.3.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.3.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.4 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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

6.4.5 重要财务报表项目的说明

6.4.5.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	15,659.05
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	15,659.05

注：货币资金中包括以下外币余额：

项目	本期末 2020年6月30日		
	外币金额	汇率	折合人民币

日元	46,088.00	0.065808	3,032.96
合计			3,032.96

6.4.5.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
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	54,801,177.38	56,840,628.13	2,039,450.75
其他	-	-	-
合计	54,801,177.38	56,840,628.13	2,039,450.75

6.4.5.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.5.4 买入返售金融资产

6.4.5.4.1 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。

6.4.5.4.2 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。

6.4.5.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1.24
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	-
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	-
应收出借证券利息	-
其他	-

合计	1.24
----	------

6.4.5.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	-
可收退补款	-
应收退补款	-
现金差额	8.45
合计	8.45

6.4.5.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.5.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应退替代款	-
预提费用	79,563.12
应付指数使用费	-
可退替代款	424,860.40
其他	-
合计	504,423.52

注：应退退补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。

6.4.5.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	50,734,394.00	50,734,394.00
本期申购	7,010,000.00	7,010,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-4,700,000.00	-4,700,000.00
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	53,044,394.00	53,044,394.00
-----	---------------	---------------

6.4.5.10 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	1,848,763.70	4,334,938.60	6,183,702.30
本期利润	451,019.68	-2,790,153.08	-2,339,133.40
本期基金份额交易产生的变动数	96,403.73	-645,331.12	-548,927.39
其中：基金申购款	311,316.29	-677,513.32	-366,197.03
基金赎回款	-214,912.56	32,182.20	-182,730.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,396,187.11	899,454.40	3,295,641.51

6.4.5.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	-3.12
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	351.56
其他	-
合计	348.44

6.4.5.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.5.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	4,164,501.34
减：卖出/赎回基金成本总额	4,135,020.32
基金投资收益	29,481.02

6.4.5.14 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.5.15 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。

6.4.5.16 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.5.17 衍生工具收益**6.4.5.17.1 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。

6.4.5.17.2 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。

6.4.5.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	514,578.31
合计	514,578.31

6.4.5.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-2,790,153.08
——股票投资	-
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-2,790,153.08
——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	-2,790,153.08

6.4.5.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	82,673.58
合计	82,673.58

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代证券的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代证券在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.5.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	16,461.21
银行间市场交易费用	-
合计	16,461.21

6.4.5.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	90.00
合计	79,653.12

6.4.6 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.6.1 或有事项

无。

6.4.6.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
美国北美信托银行有限公司(“北美信托银行”)	境外资产托管人

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

6.4.8.1 关联方报酬

6.4.8.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	52,502.84	24,702.18
其中：支付销售机构的客户维护费	13,638.06	-

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 0.20% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.8.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	13,125.73	6,175.56

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 0.05% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

6.4.8.1.3 销售服务费

无。

6.4.8.2 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.8.3 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.8.3.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.8.3.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2019 年 06 月 12 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	42,040,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	42,040,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	79.25%	-

基金管理人南方基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2019 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
美国北美信托银行股份有限公司	-	-313.79	13,279,135.32	-
中国工商银行股份有限公司	15,659.05	310.67	85,307,416.92	143,090.34

注：本基金由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人北美信托银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.10 期末（2020 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.11 金融工具风险及管理

6.4.11.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪东证指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的境外证券市场相似的风险收益特征。本基金以目标 ETF、东证指数成份股、备选成份股为主要投资对象。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之内。

6.4.11.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行及境外资产托管人北美信托银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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 2020 年 6 月 30 日，本基金无债券投资。

6.4.11.3 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。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.11.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受

限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。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，如根据基金合同的规定，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金无流动性受限资产。

同时，基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.11.4 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。

6.4.11.4.1 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等。

6.4.11.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	15,659.05	-	-	-	15,659.05

结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	56,840,628.13	56,840,628.13
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1.24	1.24
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	8.45	8.45
资产总计	15,659.05	-	-	56,840,637.82	56,856,296.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	9,470.27	9,470.27
应付托管费	-	-	-	2,367.57	2,367.57
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	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	504,423.52	504,423.52
负债总计	-	-	-	516,261.36	516,261.36
利率敏感度缺口	15,659.05	-	-	56,324,376.46	56,340,035.51
上年度末 2019 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	36,193.57	-	-	-	36,193.57
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	56,957,832.14	56,957,832.14
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	15.90	15.90
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	36,193.57	-	-	56,957,848.04	56,994,041.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	9,720.66	9,720.66
应付托管费	-	-	-	2,430.16	2,430.16
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	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,403.09	1,403.09
其他负债	-	-	-	62,391.40	62,391.40
负债总计	-	-	-	75,945.31	75,945.31
利率敏感度缺口	36,193.57	-	-	56,881,902.73	56,918,096.30

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。

6.4.11.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资 (2019 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2019 年 12 月 31 日：同)。

6.4.11.4.2 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.11.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
银行存款	-	-	-	3,032.96	-	3,032.96
交易性金融资产	-	-	-	56,840,628.13	-	56,840,628.13
应收利息	-	-	-	0.04	-	0.04
资产合计	-	-	-	56,843,661.13	-	56,843,661.13
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	56,843,661.13	-	56,843,661.13

项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日					
	美元折	港币折	欧元折	日元折合人	其他币	合计

	合人民币	合人民币	合人民币	人民币	种折合人民币	
以外币计价的资产						
银行存款	-	-	-	0.64	-	0.64
交易性金融资产	-	-	-	56,957,832.14	-	56,957,832.14
资产合计	-	-	-	56,957,832.78	-	56,957,832.78
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	56,957,832.78	-	56,957,832.78

6.4.11.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	2,842,183.06	2,847,891.64
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-2,842,183.06	-2,847,891.64

6.4.11.4.3 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%；本基金主要通过二级市场交易投资于目标 ETF。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。

6.4.11.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	56,840,628.13	100.89	56,957,832.14	100.07

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	56,840,628.13	100.89	56,957,832.14	100.07

6.4.11.4.3.2 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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	1.业绩比较基准上升 5%	2,710,709.46	2,392,557.87
	2.业绩比较基准下降 5%	-2,710,709.46	-2,392,557.87

6.4.12 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	56,840,628.13	99.97
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,659.05	0.03

8	其他资产	9.69	0.00
9	合计	56,856,296.87	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

本基金本报告期内无权益投资。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

本基金本报告期内无权益投资。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

本基金本报告期内无权益投资。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	One ETF TOPIX	ETF	交易型开放式	Asset Management One Co Ltd	56,840,628.13	100.89

7.11 投资组合报告附注

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

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

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

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	8.45
9	合计	9.69

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
458	115,817.45	49,354,294.00	93.04%	3,690,100.00	6.96%

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	南方基金管理股份有限公司	42,040,000.00	79.25%
2	海通期货股份有限公司-海通期货-通聚荟萃五期资产管理计划	2,800,000.00	5.28%
3	海通期货股份有限公司-海通期货-通聚荟萃三期资产管理计划	1,200,000.00	2.26%
4	海通期货-华泰证券-海通期货-通聚荟萃十二期集合资产管理计划	800,000.00	1.51%
5	海通期货股份有限公司-海通期货-通聚荟萃十期资产管理计划	800,000.00	1.51%
6	中粮期货有限公司-中粮安鑫 1 号资产管理计划	711,800.00	1.34%
7	JPMORGAN CHASE BANK,NATIONAL ASSOCIATION	575,500.00	1.08%
8	海通期货股份有限公司-海通期货-通聚荟萃四期资产管理计划	400,000.00	0.75%
9	李卓毅	141,100.00	0.27%
10	张明策	117,400.00	0.22%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、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。

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

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(2019年6月12日)基金份额总额	308,434,394.00
本报告期期初基金份额总额	50,734,394.00
本报告期基金总申购份额	7,010,000.00
减：报告期基金总赎回份额	4,700,000.00
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	53,044,394.00

§ 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	
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
Mizuho Securities Asia Ltd	-	-	-	16,461.21	100.00%	-

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
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities Asia Ltd	-	-	-	-	-	-	10,974,777.16	100.00%

注：券商选择标准和程序：

为保障公司境外证券投资的顺利开展，规范券商选择及交易量分配标准与原则，基金管理人明确了券商选择、考核及交易量的分配等流程。

A. 券商的选择

券商的交易及清算执行能力、研究实力和提供的研究服务等，这是选择券商以及分配交易量最主要的原则和标准，包括以下几个方面：

交易及清算执行能力。主要指券商是否对投资指令进行了有效的执行、能否取得较高质量的成交结果以及成交以后的清算完成情况。衡量交易执行能力的指标主要有：是否完成交易、成交的及时性、成交价格、对市场的影响、清算系统的能力与清算时效性等；

研究机构的实力和水平。主要是指券商能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告，报告内容是否详实，投资建议是否准确；

提供研究服务的质量。主要指券商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。

其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

B. 券商交易量分仓

公司将定期根据交易执行能力、研究机构的实力和水平、提供专业服务的质量等标准对交易券商进行打分考核，并根据考核结果拟定下期的交易量分配。

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	南方基金管理股份有限公司旗下全部基金2019年第四季度报告提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-20
2	南方基金管理股份有限公司关于修订公司旗下部分公开募集证券投资基金基金合同信息披露有关条款的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-02-13
3	关于南方基金管理股份有限公司旗下部分基金新增扩位证券简称的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-16
4	关于南方顶峰 TOPIX 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)调整最小申购、赎回单位的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-17
5	南方基金关于旗下部分基金增加中信证券（华南）为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-04-28

§ 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

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	1	20200101-20200630	42,040,000.00	-	-	42,040,000.00	79.25%
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南方顶峰 TOPIX 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的文件；

2、《南方顶峰 TOPIX 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》；

3、《南方顶峰 TOPIX 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)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、《南方顶峰 TOPIX 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)2020 年中期报告》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>