

深证成份交易型开放式指数证券投资 基金 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 信息披露方式.....	5
2.5 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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	35
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.....	48
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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 市场中性策略执行情况	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 期末上市基金前十名持有人	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
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	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
交易代码	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	307,154,507.00 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。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	<p>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。</p>

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 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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）

2.5 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(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	18,336,190.99
本期利润	62,815,642.33
加权平均基金份额本期利润	0.1854
本期加权平均净值利润率	15.51%
本期基金份额净值增长率	15.64%
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	-7,352,534.19

期末可供分配基金份额利润	-0.0239
期末基金资产净值	408,923,733.20
期末基金份额净值	1.3313
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	-1.77%

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。

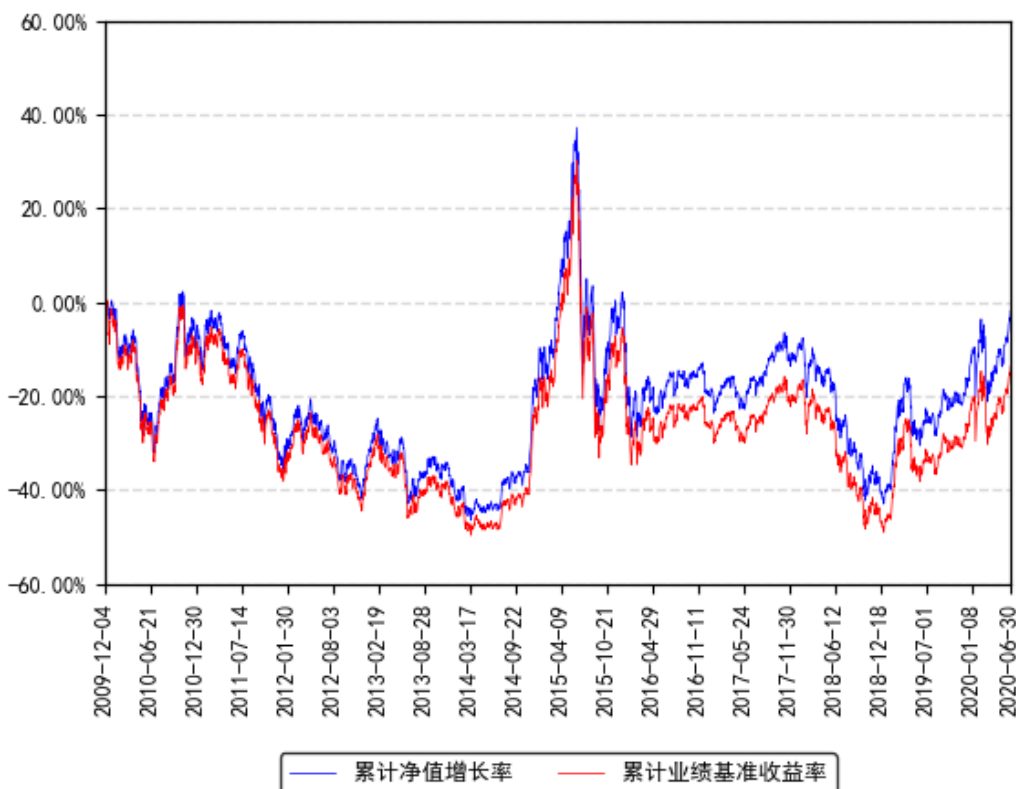
3.2 基金净值表现

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	12.04%	0.96%	11.60%	0.97%	0.44%	-0.01%
过去三个月	21.19%	1.13%	20.38%	1.13%	0.81%	0.00%
过去六个月	15.64%	1.82%	14.97%	1.82%	0.67%	0.00%
过去一年	31.96%	1.47%	30.66%	1.47%	1.30%	0.00%
过去三年	17.17%	1.47%	13.89%	1.47%	3.28%	0.00%
自基金合同生效起至今	-1.77%	1.60%	-13.63%	1.63%	11.86%	-0.03%

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



§ 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		
孙伟	本基金基金经理	2016 年 8 月 19 日	-	10 年	管理学学士，特许金融分析师（CFA）、注册会计师（CPA），具有基金从业资格。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、基金经理助理；2015 年 5 月 22 日至 2016 年 7 月 29 日，任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 7 月 2 日至今，任改革基金、高铁基金基金经理；2015 年 7 月 10 日至今，任 500 信息基金经理；2016 年 5 月 13 日至今，任南方创业板 ETF 基金经理；2016 年 5 月 20 日至今，任南方创业板 ETF 联接基金经理；2016 年 8 月 17 日至今，任 500 信息联接基金经理；2016 年 8 月 19 日至今，任深成 ETF、南方深成基金经理；2017 年 3 月 8 日至今，任南方全指证券 ETF 联接基金经理；2017 年 3 月 10 日至今，任南方中证全指证券 ETF 基金经理；2017 年 6 月 28 日至今，任南方中证银行 ETF 基金经理；2017 年 6 月 29 日至今，任南方银行联接基金经理；2018 年 2 月 8 日至今，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至今，任南方 H 股联接基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任南方中证 500 工业 ETF、南方中证 500 原材料 ETF、南方上证 380ETF、南方上证 380ETF 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

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，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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3次，是由于接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

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14.97%。

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）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) 新股上市初期涨幅较大的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.3313 元，报告期内，份额净值增长率为 15.64%，同期业绩基准增长率为 14.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

疫情影响消退，经济生活回暖。国内大循环下，科技产业景气向上，资本市场创新活跃，相关行业仍具有中长期投资价值；另一方面，随着估值分化达到历史较高水平，低估值行业预计将迎来估值修复机会。

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，力求实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

4.6 管理人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。基金管理人就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 报告期内基金持有人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深证成份交易型开放式指数证券投资基金 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：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

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	6.4.7.1	560,810.21	766,438.96
结算备付金		13,550.39	9,437.76
存出保证金		3,140.52	1,644.80
交易性金融资产	6.4.7.2	408,895,628.68	401,578,494.60
其中：股票投资		408,720,828.68	401,460,066.84
基金投资		-	-
债券投资		174,800.00	118,427.76
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	10,823.18
应收利息	6.4.7.5	114.34	172.89
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		409,473,244.14	402,367,012.19
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		228,182.51	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		161,433.07	169,092.48
应付托管费		32,286.62	33,818.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	6,078.63	4,320.89
应交税费		5.49	1.88
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	121,524.62	224,000.00
负债合计		549,510.94	431,233.72
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	416,276,267.39	473,197,467.77
未分配利润	6.4.7.10	-7,352,534.19	-71,261,689.30
所有者权益合计		408,923,733.20	401,935,778.47
负债和所有者权益总计		409,473,244.14	402,367,012.19

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3313 元，基金份额总额 307,154,507.00 份。

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：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 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		64,248,821.38	102,546,639.76

1. 利息收入		2,354.02	3,022.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,211.76	3,006.97
债券利息收入		142.26	15.48
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		19,766,127.51	-11,168,192.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	16,409,554.08	-14,810,878.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	201,073.73	2,538.05
资产支持证券投资	6.4.7.14	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	3,155,499.70	3,640,148.73
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	44,479,451.34	113,717,440.27
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	888.51	-5,630.87
减：二、费用		1,433,179.05	1,475,304.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,010,171.70	1,016,001.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	202,034.42	203,200.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	50,214.73	36,436.46
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 税金及附加		0.59	0.04
7. 其他费用	6.4.7.21	170,757.61	219,666.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		62,815,642.33	101,071,334.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		62,815,642.33	101,071,334.96

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：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）	473,197,467.77	-71,261,689.30	401,935,778.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	62,815,642.33	62,815,642.33
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）	-56,921,200.38	1,093,512.78	-55,827,687.60
其中：1. 基金申购款	93,513,400.57	-13,445,792.59	80,067,607.98
2. 基金赎回款	-150,434,600.95	14,539,305.37	-135,895,295.58
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）	416,276,267.39	-7,352,534.19	408,923,733.20
项目	上年度可比期间 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)	599,237,268.61	-250,061,343.91	349,175,924.70
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	-	101,071,334.96	101,071,334.96
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)	-52,855,400.38	9,357,967.71	-43,497,432.67
其中: 1. 基金申购款	56,921,200.30	-16,671,372.09	40,249,828.21
2. 基金赎回款	-109,776,600.68	26,029,339.80	-83,747,260.88
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)	546,381,868.23	-139,632,041.24	406,749,826.99

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 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。

6.4.2.2 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。

6.4.2.3 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。

6.4.3 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	560,810.21
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	560,810.21

6.4.3.2 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	329,464,774.37	408,720,828.68	79,256,054.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	174,800.00	174,800.00
	银行间市场	-	-
	合计	174,800.00	174,800.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	329,639,574.37	408,895,628.68	79,256,054.31

注：于 2020 年 06 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 0.00 元(2019 年 12 月 31 日：0.00 元)。

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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	69.65
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	25.01
应收债券利息	18.42
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	1.26
合计	114.34

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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	6,078.63
银行间市场应付交易费用	-
合计	6,078.63

6.4.3.8 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	86,524.62
应付指数使用费	35,000.00
可退替代款	-
其他	-
合计	121,524.62

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

2. 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。

6.4.3.9 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	349,154,507.00	473,197,467.77
本期申购	69,000,000.00	93,513,400.57
本期赎回（以“-”号填列）	-111,000,000.00	-150,434,600.95
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	307,154,507.00	416,276,267.39

注：本期申购含转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.3.10 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	45,586,998.63	-116,848,687.93	-71,261,689.30
本期利润	18,336,190.99	44,479,451.34	62,815,642.33
本期基金份额交易产生的变动数	-7,206,435.74	8,299,948.52	1,093,512.78
其中：基金申购款	10,324,037.95	-23,769,830.54	-13,445,792.59
基金赎回款	-17,530,473.69	32,069,779.06	14,539,305.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	56,716,753.88	-64,069,288.07	-7,352,534.19

6.4.3.11 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	1,439.78
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	753.14
其他	18.84
合计	2,211.76

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,961,860.56
股票投资收益——赎回差价收入	18,371,414.64
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	16,409,554.08

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	35,891,820.30
减：卖出股票成本总额	37,853,680.86
买卖股票差价收入	-1,961,860.56

6.4.3.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	135,895,295.58
减：现金支付赎回款总额	-4,293,573.42
减：赎回股票成本总额	121,817,454.36
赎回差价收入	18,371,414.64

6.4.3.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.3.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

6.4.3.13 债券投资收益

6.4.3.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	201,073.73
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	201,073.73

6.4.3.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	949,116.40

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	747,900.00
减：应收利息总额	142.67
买卖债券差价收入	201,073.73

6.4.3.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.3.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.3.14 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。

6.4.3.15 贵金属投资收益

6.4.3.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.3.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.3.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.3.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.3.16 衍生工具收益

6.4.3.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.3.16.2 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。

6.4.3.17 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	3,155,499.70
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-

合计	3,155,499.70
----	--------------

6.4.3.18 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	44,479,451.34
——股票投资	44,479,579.10
——债券投资	-127.76
——资产支持证券投资	-
——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	44,479,451.34

注：本基金本期公允价值变动损益-股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益为 0.00 元(2019 上半年度：0.00 元)。

6.4.3.19 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	888.51
合计	888.51

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票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股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.3.20 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	50,214.73
银行间市场交易费用	-
合计	50,214.73

6.4.3.21 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	26,852.28

信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	70,000.00
银行费用	222.00
其他	14,010.99
合计	170,757.61

指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 50,000 元。

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

无。

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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“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：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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	75,621,771.09	100.00%	54,652,352.48	100.00%
------	---------------	---------	---------------	---------

6.4.6.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	7,565.18	100.00%	6,078.63	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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	5,466.92	100.00%	4,539.07	100.00%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,010,171.70	1,016,001.21
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

注：支付基金管理人南方基金管理股份有限公司的基金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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

6.4.6.2.2 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 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	202,034.42	203,200.31

注：支付基金托管人工商银行的基金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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

6.4.6.2.3 销售服务费

无。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间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 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

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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
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	192,728,774.00	62.75%	213,321,432.00	61.10%
-	-	-	-	-

注：南方深证成份 ETF 联接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。

6.4.6.6 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 1 月 1 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
工商银行	560,810.21	1,439.78	1,315,897.98	2,163.33

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。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
兴业证券股份有限公司	000750	国海证券	网上申购	50,775	165,018.75

上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
兴业证券股份有限公司	000750	-	-	-	-

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（2020 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002500	山西证券	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 10 日	增发未上市	5.00	6.54	20,280	101,400.00	132,631.20	-
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020 年	2020 年	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

		6月22日	7月1日	上市						
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
127017	万青转债	2020年6月3日	2020年7月2日	配债未上市	100.00	100.00	266	26,600.00	26,600.00	-
128112	歌尔转2	2020年6月12日	2020年7月13日	配债未上市	100.00	100.00	1,274	127,400.00	127,400.00	-
128115	巨星转债	2020年6月24日	2020年7月16日	配债未上市	100.00	100.00	208	20,800.00	20,800.00	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

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。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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之内。

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人中国工商银行，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。

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。

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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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。

6.4.9.4 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 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	560,810.21	-	-	-	560,810.21
结算备付金	13,550.39	-	-	-	13,550.39
存出保证金	3,140.52	-	-	-	3,140.52
交易性金融资产	-	-	174,800.00	408,720,828.68	408,895,628.68
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	114.34	114.34
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	577,501.12	-	174,800.00	408,720,943.02	409,473,244.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	161,433.07	161,433.07
应付托管费	-	-	-	32,286.62	32,286.62
应付证券清算款	-	-	-	228,182.51	228,182.51
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	6,078.63	6,078.63
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	5.49	5.49

其他负债	-	-	-	121,524.62	121,524.62
负债总计	-	-	-	549,510.94	549,510.94
利率敏感度缺口	577,501.12	-	174,800.00	408,171,432.08	408,923,733.20
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	766,438.96	-	-	-	766,438.96
结算备付金	9,437.76	-	-	-	9,437.76
存出保证金	1,644.80	-	-	-	1,644.80
交易性金融资产	-	-	118,427.76	401,460,066.84	401,578,494.60
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	172.89	172.89
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	10,823.18	10,823.18
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	777,521.52	-	118,427.76	401,471,062.91	402,367,012.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	169,092.48	169,092.48
应付托管费	-	-	-	33,818.47	33,818.47
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	-	-	-	4,320.89	4,320.89
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.88	1.88
其他负债	-	-	-	224,000.00	224,000.00
负债总计	-	-	-	431,233.72	431,233.72
利率敏感度缺口	777,521.52	-	118,427.76	401,039,829.19	401,935,778.47

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 2020 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 0.04% (2019 年 12 月 31 日：0.03%)，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)。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.3.1 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	408,720,828.68	99.95	401,460,066.84	99.88
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	408,720,828.68	99.95	401,460,066.84	99.88

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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	1.组合自身基准上升 5%	20,328,427.73	19,976,208.19
	2.组合自身基准下降 5%	-20,328,427.73	-19,976,208.19

6.4.10 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

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	408,720,828.68	99.82
	其中：股票	408,720,828.68	99.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	174,800.00	0.04
	其中：债券	174,800.00	0.04
	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	574,360.60	0.14
8	其他资产	3,254.86	0.00
9	合计	409,473,244.14	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 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	12,773,172.30	3.12
B	采矿业	2,815,288.60	0.69
C	制造业	266,714,558.70	65.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,207,501.60	0.54
E	建筑业	1,138,522.20	0.28
F	批发和零售业	5,592,498.25	1.37
G	交通运输、仓储和邮政业	5,848,064.55	1.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,313,699.05	10.35
J	金融业	28,258,883.88	6.91
K	房地产业	16,034,778.19	3.92
L	租赁和商务服务业	5,882,332.12	1.44
M	科学研究和技术服务业	3,333,358.00	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	1,447,951.32	0.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	838,050.00	0.20
Q	卫生和社会工作	7,804,874.21	1.91
R	文化、体育和娱乐业	4,904,738.41	1.20
S	综合	753,279.67	0.18
	合计	408,661,551.05	99.94

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	47,180.06	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,097.57	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	59,277.63	0.01

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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 报告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

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	000858	五粮液	75,441	12,909,463.92	3.16
2	000333	美的集团	208,742	12,480,684.18	3.05
3	000651	格力电器	205,140	11,604,769.80	2.84
4	002475	立讯精密	180,008	9,243,410.80	2.26
5	000002	万科A	293,058	7,660,536.12	1.87
6	300750	宁德时代	34,700	6,050,292.00	1.48
7	002714	牧原股份	73,588	6,034,216.00	1.48
8	000725	京东方A	1,143,142	5,338,473.14	1.31
9	300760	迈瑞医疗	17,400	5,319,180.00	1.30
10	300059	东方财富	256,831	5,187,986.20	1.27
11	000661	长春高新	11,900	5,180,070.00	1.27
12	000001	平安银行	369,412	4,728,473.60	1.16
13	300498	温氏股份	207,109	4,514,976.20	1.10
14	002415	海康威视	148,681	4,512,468.35	1.10
15	000063	中兴通讯	107,533	4,315,299.29	1.06
16	002352	顺丰控股	62,383	3,412,350.10	0.83
17	300142	沃森生物	61,900	3,241,084.00	0.79
18	000100	TCL 科技	508,471	3,152,520.20	0.77
19	300015	爱尔眼科	72,201	3,137,133.45	0.77
20	002142	宁波银行	112,983	2,968,063.41	0.73
21	000568	泸州老窖	32,292	2,942,447.04	0.72
22	002410	广联达	39,019	2,719,624.30	0.67
23	002241	歌尔股份	90,310	2,651,501.60	0.65
24	000876	新希望	87,452	2,606,069.60	0.64
25	000338	潍柴动力	188,708	2,589,073.76	0.63
26	002027	分众传媒	462,996	2,578,887.72	0.63
27	002230	科大讯飞	67,970	2,544,117.10	0.62

28	002594	比亚迪	34,636	2,486,864.80	0.61
29	300014	亿纬锂能	51,251	2,452,360.35	0.60
30	002304	洋河股份	23,261	2,445,661.54	0.60
31	300122	智飞生物	23,300	2,333,495.00	0.57
32	002555	三七互娱	49,500	2,316,600.00	0.57
33	300347	泰格医药	21,900	2,231,172.00	0.55
34	002007	华兰生物	43,930	2,201,332.30	0.54
35	001979	招商蛇口	131,227	2,157,371.88	0.53
36	300601	康泰生物	12,600	2,043,216.00	0.50
37	000538	云南白药	20,886	1,959,315.66	0.48
38	000166	申万宏源	385,069	1,944,598.45	0.48
39	002271	东方雨虹	45,309	1,840,904.67	0.45
40	000895	双汇发展	39,924	1,840,097.16	0.45
41	300136	信维通信	34,460	1,827,069.20	0.45
42	300124	汇川技术	47,494	1,804,297.06	0.44
43	000938	紫光股份	40,656	1,747,394.88	0.43
44	000776	广发证券	123,559	1,744,653.08	0.43
45	300003	乐普医疗	47,600	1,738,352.00	0.43
46	002129	中环股份	76,620	1,720,885.20	0.42
47	002460	赣锋锂业	32,100	1,719,597.00	0.42
48	002624	完美世界	28,900	1,665,796.00	0.41
49	002050	三花智控	75,460	1,652,574.00	0.40
50	000977	浪潮信息	41,486	1,625,421.48	0.40
51	002127	南极电商	75,800	1,604,686.00	0.39
52	300253	卫宁健康	69,623	1,597,151.62	0.39
53	300413	芒果超媒	24,400	1,590,880.00	0.39
54	002371	北方华创	9,200	1,572,372.00	0.38
55	002044	美年健康	106,856	1,539,794.96	0.38
56	002456	欧菲光	82,702	1,520,889.78	0.37
57	300454	深信服	7,200	1,482,912.00	0.36
58	002384	东山精密	47,600	1,425,620.00	0.35
59	002001	新和成	48,881	1,422,437.10	0.35
60	002311	海大集团	29,640	1,410,567.60	0.34
61	300433	蓝思科技	49,258	1,381,194.32	0.34
62	002236	大华股份	70,878	1,361,566.38	0.33
63	000157	中联重科	209,127	1,344,686.61	0.33
64	002821	凯莱英	5,500	1,336,500.00	0.33
65	002008	大族激光	36,600	1,315,770.00	0.32
66	002602	世纪华通	85,576	1,310,168.56	0.32
67	002024	苏宁易购	147,251	1,291,391.27	0.32
68	002463	沪电股份	50,300	1,256,494.00	0.31
69	002841	视源股份	12,600	1,253,952.00	0.31
70	002185	华天科技	92,474	1,251,173.22	0.31

71	300408	三环集团	45,100	1,249,270.00	0.31
72	002049	紫光国微	16,913	1,230,420.75	0.30
73	002439	启明星辰	29,100	1,224,237.00	0.30
74	300383	光环新网	46,400	1,209,648.00	0.30
75	300558	贝达药业	8,500	1,189,830.00	0.29
76	000860	顺鑫农业	20,630	1,175,497.40	0.29
77	300033	同花顺	8,800	1,171,104.00	0.29
78	300529	健帆生物	16,830	1,169,685.00	0.29
79	300661	圣邦股份	3,800	1,159,190.00	0.28
80	002405	四维图新	69,696	1,149,287.04	0.28
81	300012	华测检测	57,800	1,142,128.00	0.28
82	000783	长江证券	166,719	1,123,686.06	0.27
83	300676	华大基因	7,200	1,122,552.00	0.27
84	002120	韵达股份	45,861	1,121,301.45	0.27
85	000425	徐工机械	181,608	1,073,303.28	0.26
86	002916	深南电路	6,372	1,067,437.44	0.26
87	002202	金风科技	106,813	1,064,925.61	0.26
88	300450	先导智能	22,562	1,042,590.02	0.25
89	002736	国信证券	91,100	1,029,430.00	0.25
90	002385	大北农	112,550	1,025,330.50	0.25
91	002812	恩捷股份	15,580	1,025,164.00	0.25
92	000066	中国长城	77,638	1,024,821.60	0.25
93	300144	宋城演艺	59,126	1,022,879.80	0.25
94	002065	东华软件	81,300	1,017,876.00	0.25
95	000768	中航飞机	56,490	1,002,132.60	0.25
96	002212	南洋股份	37,100	986,118.00	0.24
97	000069	华侨城 A	162,149	982,622.94	0.24
98	002157	正邦科技	56,100	980,628.00	0.24
99	300088	长信科技	87,504	980,044.80	0.24
100	000625	长安汽车	87,698	964,678.00	0.24
101	002179	中航光电	23,489	963,283.89	0.24
102	002131	利欧股份	248,843	960,533.98	0.23
103	300285	国瓷材料	28,050	939,955.50	0.23
104	002223	鱼跃医疗	25,200	917,280.00	0.22
105	002465	海格通信	70,200	908,388.00	0.22
106	002466	天齐锂业	39,283	901,544.85	0.22
107	300496	中科创达	11,554	897,745.80	0.22
108	300463	迈克生物	15,400	896,742.00	0.22
109	002600	领益智造	83,100	883,353.00	0.22
110	002074	国轩高科	32,700	877,668.00	0.21
111	000656	金科股份	106,100	865,776.00	0.21
112	002493	荣盛石化	69,850	859,155.00	0.21
113	002075	沙钢股份	68,300	853,750.00	0.21

114	000988	华工科技	34,600	845,278.00	0.21
115	002607	中公教育	30,200	838,050.00	0.20
116	000963	华东医药	33,095	837,303.50	0.20
117	002422	科伦药业	39,278	824,838.00	0.20
118	002340	格林美	165,700	823,529.00	0.20
119	002373	千方科技	34,300	822,857.00	0.20
120	002601	龙蟠佰利	43,800	810,300.00	0.20
121	000786	北新建材	37,800	806,274.00	0.20
122	300770	新媒股份	3,600	805,176.00	0.20
123	300271	华宇软件	28,540	805,113.40	0.20
124	300782	卓胜微	1,980	803,424.60	0.20
125	002180	纳思达	24,400	803,004.00	0.20
126	000617	中油资本	76,800	797,952.00	0.20
127	300212	易华录	14,248	797,888.00	0.20
128	300595	欧普康视	11,350	787,009.00	0.19
129	300315	掌趣科技	107,000	784,310.00	0.19
130	000513	丽珠集团	16,260	780,642.60	0.19
131	300207	欣旺达	41,200	778,680.00	0.19
132	300326	凯利泰	26,700	776,970.00	0.19
133	000750	国海证券	177,925	772,194.50	0.19
134	300482	万孚生物	7,400	769,600.00	0.19
135	300168	万达信息	34,746	766,844.22	0.19
136	000596	古井贡酒	5,100	766,224.00	0.19
137	002603	以岭药业	24,300	757,917.00	0.19
138	002507	涪陵榨菜	21,000	756,210.00	0.18
139	002273	水晶光电	44,054	755,085.56	0.18
140	000009	中国宝安	88,517	753,279.67	0.18
141	002797	第一创业	108,540	751,096.80	0.18
142	300628	亿联网络	10,900	744,034.00	0.18
143	300058	蓝色光标	93,734	731,125.20	0.18
144	000703	恒逸石化	80,078	731,112.14	0.18
145	300308	中际旭创	11,560	728,280.00	0.18
146	300759	康龙化成	7,400	728,160.00	0.18
147	002252	上海莱士	85,640	724,514.40	0.18
148	000423	东阿阿胶	20,171	722,323.51	0.18
149	000021	深科技	32,700	713,841.00	0.17
150	000547	航天发展	52,100	712,207.00	0.17
151	300699	光威复材	11,320	710,103.60	0.17
152	002030	达安基因	26,026	709,989.28	0.17
153	002019	亿帆医药	30,800	707,476.00	0.17
154	000728	国元证券	83,296	699,686.40	0.17
155	002353	杰瑞股份	22,487	697,097.00	0.17
156	002138	顺络电子	27,900	696,105.00	0.17

157	002414	高德红外	23,720	694,521.60	0.17
158	000961	中南建设	78,000	694,200.00	0.17
159	300024	机器人	50,690	692,932.30	0.17
160	300017	网宿科技	80,545	683,827.05	0.17
161	300009	安科生物	37,889	678,213.10	0.17
162	002156	通富微电	26,980	675,849.00	0.17
163	002299	圣农发展	23,200	672,800.00	0.16
164	300357	我武生物	10,740	668,565.00	0.16
165	002709	天赐材料	19,780	668,366.20	0.16
166	002152	广电运通	50,600	654,764.00	0.16
167	002250	联化科技	30,000	654,000.00	0.16
168	002436	兴森科技	50,600	649,198.00	0.16
169	002557	洽洽食品	11,900	644,861.00	0.16
170	300244	迪安诊断	18,096	638,788.80	0.16
171	300316	晶盛机电	25,710	636,065.40	0.16
172	300146	汤臣倍健	32,300	635,987.00	0.16
173	002382	蓝帆医疗	20,900	629,299.00	0.15
174	002511	中顺洁柔	28,200	628,860.00	0.15
175	002926	华西证券	59,000	627,170.00	0.15
176	002146	荣盛发展	77,300	626,130.00	0.15
177	002174	游族网络	23,985	625,528.80	0.15
178	002683	宏大爆破	17,900	624,710.00	0.15
179	002508	老板电器	19,960	620,955.60	0.15
180	000739	普洛药业	26,600	619,514.00	0.15
181	000401	冀东水泥	38,464	616,962.56	0.15
182	002673	西部证券	75,554	616,520.64	0.15
183	000998	隆平高科	36,800	612,720.00	0.15
184	002739	万达电影	39,850	608,509.50	0.15
185	000623	吉林敖东	38,518	605,888.14	0.15
186	002938	鹏鼎控股	12,100	605,726.00	0.15
187	300773	拉卡拉	17,400	604,998.00	0.15
188	002396	星网锐捷	17,000	600,610.00	0.15
189	300010	立思辰	30,600	598,842.00	0.15
190	002572	索菲亚	24,764	598,545.88	0.15
191	002013	中航机电	75,478	596,276.20	0.15
192	000050	深天马A	38,600	592,896.00	0.14
193	300502	新易盛	9,300	587,016.00	0.14
194	000975	银泰黄金	37,360	585,804.80	0.14
195	300724	捷佳伟创	6,600	584,298.00	0.14
196	000630	铜陵有色	302,000	582,860.00	0.14
197	002500	山西证券	88,780	580,621.20	0.14
198	002195	二三四五	206,305	579,717.05	0.14
199	300274	阳光电源	40,235	578,981.65	0.14

200	002078	太阳纸业	59,600	567,392.00	0.14
201	002773	康弘药业	11,290	559,984.00	0.14
202	300115	长盈精密	24,240	553,884.00	0.14
203	002281	光迅科技	16,800	552,048.00	0.14
204	300070	碧水源	67,826	550,747.12	0.13
205	000540	中天金融	169,300	545,146.00	0.13
206	300418	昆仑万维	21,800	544,128.00	0.13
207	300451	创业慧康	29,350	542,681.50	0.13
208	002958	青农商行	121,900	540,017.00	0.13
209	002402	和而泰	33,200	538,172.00	0.13
210	002153	石基信息	13,685	534,125.55	0.13
211	300037	新宙邦	9,700	534,082.00	0.13
212	002690	美亚光电	10,100	531,260.00	0.13
213	001914	招商积余	17,200	528,556.00	0.13
214	300223	北京君正	5,200	524,888.00	0.13
215	002268	卫士通	24,500	522,830.00	0.13
216	002123	梦网集团	26,100	516,780.00	0.13
217	002387	维信诺	36,100	515,508.00	0.13
218	000686	东北证券	60,800	513,760.00	0.13
219	000997	新大陆	31,980	511,040.40	0.12
220	300001	特锐德	24,400	510,936.00	0.12
221	300073	当升科技	15,100	499,357.00	0.12
222	300054	鼎龙股份	30,000	498,000.00	0.12
223	002939	长城证券	40,100	494,032.00	0.12
224	300457	赢合科技	15,300	487,764.00	0.12
225	000413	东旭光电	182,000	485,940.00	0.12
226	000581	威孚高科	23,451	484,966.68	0.12
227	002032	苏泊尔	6,800	482,800.00	0.12
228	000878	云南铜业	45,496	482,712.56	0.12
229	300226	上海钢联	6,140	482,604.00	0.12
230	002368	太极股份	11,000	480,590.00	0.12
231	300251	光线传媒	43,720	476,985.20	0.12
232	002100	天康生物	29,600	476,560.00	0.12
233	000999	华润三九	16,200	472,878.00	0.12
234	300113	顺网科技	18,482	469,442.80	0.11
235	002080	中材科技	30,210	468,255.00	0.11
236	002124	天邦股份	36,200	465,170.00	0.11
237	002081	金螳螂	59,126	464,730.36	0.11
238	002568	百润股份	10,100	457,732.00	0.11
239	002028	思源电气	22,300	456,258.00	0.11
240	300476	胜宏科技	18,900	454,545.00	0.11
241	300369	绿盟科技	19,492	453,968.68	0.11
242	300296	利亚德	74,650	453,125.50	0.11

243	002294	信立泰	15,200	450,832.00	0.11
244	300567	精测电子	6,500	443,625.00	0.11
245	002675	东诚药业	21,100	442,045.00	0.11
246	300630	普利制药	5,950	440,002.50	0.11
247	002409	雅克科技	8,400	438,228.00	0.11
248	300002	神州泰岳	70,384	435,676.96	0.11
249	002791	坚朗五金	4,600	432,814.00	0.11
250	002217	合力泰	82,300	432,075.00	0.11
251	000671	阳光城	68,090	431,690.60	0.11
252	300118	东方日升	28,600	429,000.00	0.10
253	000158	常山北明	41,070	428,770.80	0.10
254	300379	东方通	9,900	425,997.00	0.10
255	002727	一心堂	11,400	423,054.00	0.10
256	300348	长亮科技	22,075	419,425.00	0.10
257	000735	罗牛山	40,900	418,816.00	0.10
258	300166	东方国信	33,523	416,020.43	0.10
259	002705	新宝股份	11,200	408,576.00	0.10
260	300766	每日互动	10,700	407,242.00	0.10
261	000060	中金岭南	109,245	406,391.40	0.10
262	002056	横店东磁	36,100	406,125.00	0.10
263	002023	海特高新	26,400	405,768.00	0.10
264	300674	宇信科技	9,400	405,610.00	0.10
265	300036	超图软件	16,100	405,398.00	0.10
266	300026	红日药业	72,200	398,544.00	0.10
267	002151	北斗星通	12,300	393,969.00	0.10
268	300747	锐科激光	3,600	391,788.00	0.10
269	300294	博雅生物	10,450	391,770.50	0.10
270	000034	神州数码	15,985	389,074.90	0.10
271	000877	天山股份	25,700	388,070.00	0.09
272	000723	美锦能源	61,900	387,494.00	0.09
273	002025	航天电器	10,590	387,382.20	0.09
274	300618	寒锐钴业	6,244	387,252.88	0.09
275	002558	巨人网络	22,200	386,280.00	0.09
276	002807	江阴银行	97,720	384,039.60	0.09
277	002233	塔牌集团	31,800	382,554.00	0.09
278	002912	中新赛克	2,300	376,257.00	0.09
279	002262	恩华药业	22,200	374,292.00	0.09
280	002468	申通快递	22,700	372,507.00	0.09
281	000800	一汽解放	34,600	371,604.00	0.09
282	000709	河钢股份	181,800	370,872.00	0.09
283	002925	盈趣科技	6,400	370,816.00	0.09
284	002643	万润股份	21,550	370,013.50	0.09
285	300188	美亚柏科	18,600	368,838.00	0.09

286	000778	新兴铸管	106,732	366,090.76	0.09
287	000970	中科三环	37,100	362,838.00	0.09
288	300078	思创医惠	26,660	360,709.80	0.09
289	002458	益生股份	23,430	357,776.10	0.09
290	000729	燕京啤酒	51,900	355,515.00	0.09
291	000960	锡业股份	41,500	355,240.00	0.09
292	000627	天茂集团	68,100	354,801.00	0.09
293	002242	九阳股份	9,500	354,065.00	0.09
294	002429	兆驰股份	71,500	353,925.00	0.09
295	000402	金融街	52,463	348,354.32	0.09
296	002920	德赛西威	5,600	343,448.00	0.08
297	002831	裕同科技	12,480	343,324.80	0.08
298	000738	航发控制	25,150	343,297.50	0.08
299	000400	许继电气	25,900	341,880.00	0.08
300	002595	豪迈科技	17,500	340,550.00	0.08
301	000710	贝瑞基因	5,700	340,518.00	0.08
302	000690	宝新能源	71,800	338,896.00	0.08
303	002038	双鹭药业	26,400	338,184.00	0.08
304	003816	中国广核	114,200	338,032.00	0.08
305	000951	中国重汽	10,800	337,608.00	0.08
306	000035	中国天楹	66,100	337,110.00	0.08
307	002099	海翔药业	42,100	333,011.00	0.08
308	002110	三钢闽光	49,550	330,003.00	0.08
309	000967	盈峰环境	40,000	330,000.00	0.08
310	000830	鲁西化工	44,000	328,240.00	0.08
311	002183	怡亚通	61,140	327,710.40	0.08
312	002648	卫星石化	20,100	327,027.00	0.08
313	002004	华邦健康	60,300	324,414.00	0.08
314	002839	张家港行	56,200	323,712.00	0.08
315	000672	上峰水泥	13,700	323,457.00	0.08
316	000629	攀钢钒钛	160,400	322,404.00	0.08
317	000681	视觉中国	17,300	322,126.00	0.08
318	002191	劲嘉股份	35,975	320,537.25	0.08
319	002597	金禾实业	13,900	319,283.00	0.08
320	000983	西山煤电	84,520	316,950.00	0.08
321	002085	万丰奥威	48,828	316,405.44	0.08
322	300474	景嘉微	4,700	316,310.00	0.08
323	002506	协鑫集成	121,100	316,071.00	0.08
324	002399	海普瑞	12,620	316,004.80	0.08
325	300133	华策影视	43,378	314,490.50	0.08
326	000825	太钢不锈	94,000	312,080.00	0.08
327	002048	宁波华翔	20,100	310,344.00	0.08
328	002635	安洁科技	12,400	308,760.00	0.08

329	000564	供销大集	68,600	308,014.00	0.08
330	300180	华峰超纤	35,721	305,771.76	0.07
331	000089	深圳机场	39,900	305,634.00	0.07
332	300456	赛微电子	11,000	303,820.00	0.07
333	000831	五矿稀土	26,600	303,772.00	0.07
334	300458	全志科技	8,222	302,569.60	0.07
335	000039	中集集团	41,660	301,201.80	0.07
336	300098	高新兴	49,562	300,345.72	0.07
337	300373	扬杰科技	8,960	300,339.20	0.07
338	300182	捷成股份	75,259	300,283.41	0.07
339	000591	太阳能	88,800	300,144.00	0.07
340	000598	兴蓉环境	65,100	299,460.00	0.07
341	000807	云铝股份	67,800	295,608.00	0.07
342	300324	旋极信息	44,311	295,111.26	0.07
343	002216	三全食品	12,300	293,970.00	0.07
344	002092	中泰化学	64,800	293,544.00	0.07
345	002310	东方园林	60,600	292,698.00	0.07
346	300768	迪普科技	6,300	291,627.00	0.07
347	002640	跨境通	44,900	291,401.00	0.07
348	300170	汉得信息	30,250	291,005.00	0.07
349	000563	陕国投 A	78,430	290,975.30	0.07
350	002203	海亮股份	33,200	290,500.00	0.07
351	000555	神州信息	18,800	289,144.00	0.07
352	002035	华帝股份	28,450	288,198.50	0.07
353	000883	湖北能源	81,600	287,232.00	0.07
354	002010	传化智联	52,800	287,232.00	0.07
355	000932	华菱钢铁	74,540	281,015.80	0.07
356	002237	恒邦股份	20,500	280,235.00	0.07
357	300068	南都电源	26,110	278,332.60	0.07
358	300633	开立医疗	7,000	277,550.00	0.07
359	000012	南玻 A	55,246	277,334.92	0.07
360	002583	海能达	36,120	274,150.80	0.07
361	002444	巨星科技	23,000	273,240.00	0.07
362	000528	柳工	43,060	271,708.60	0.07
363	000488	晨鸣纸业	54,900	271,206.00	0.07
364	000156	华数传媒	24,800	268,584.00	0.07
365	002407	多氟多	25,200	268,128.00	0.07
366	000839	中信国安	112,650	268,107.00	0.07
367	002670	国盛金控	29,260	267,729.00	0.07
368	300038	数知科技	32,680	266,668.80	0.07
369	002745	木林森	17,300	266,593.00	0.07
370	000415	渤海租赁	89,460	266,590.80	0.07
371	000078	海王生物	63,550	266,274.50	0.07

372	002266	浙富控股	68,330	264,437.10	0.06
373	002701	奥瑞金	63,000	263,970.00	0.06
374	000559	万向钱潮	54,140	262,037.60	0.06
375	002440	闰土股份	28,606	261,458.84	0.06
376	000027	深圳能源	56,340	261,417.60	0.06
377	000028	国药一致	5,800	261,058.00	0.06
378	300777	中简科技	7,200	260,640.00	0.06
379	300775	三角防务	12,000	259,680.00	0.06
380	000516	国际医学	63,700	257,985.00	0.06
381	002936	郑州银行	74,910	257,690.40	0.06
382	002155	湖南黄金	32,700	257,676.00	0.06
383	300666	江丰电子	4,300	256,624.00	0.06
384	002389	航天彩虹	19,000	255,550.00	0.06
385	000046	泛海控股	67,412	254,143.24	0.06
386	300459	金科文化	73,289	252,847.05	0.06
387	000712	锦龙股份	20,200	252,500.00	0.06
388	002815	崇达技术	12,400	250,852.00	0.06
389	000930	中粮科技	36,700	250,661.00	0.06
390	000887	中鼎股份	31,900	250,415.00	0.06
391	002449	国星光电	21,540	249,864.00	0.06
392	000708	中信特钢	14,530	248,317.70	0.06
393	000688	国城矿业	13,400	248,302.00	0.06
394	300339	润和软件	23,900	247,843.00	0.06
395	002372	伟星新材	21,220	246,788.60	0.06
396	000758	中色股份	58,960	246,452.80	0.06
397	000789	万年青	18,920	243,500.40	0.06
398	002505	大康农业	107,310	241,447.50	0.06
399	000987	越秀金控	20,600	240,196.00	0.06
400	002292	奥飞娱乐	28,400	239,128.00	0.06
401	000902	新洋丰	27,002	238,697.68	0.06
402	002244	滨江集团	55,900	238,693.00	0.06
403	000898	鞍钢股份	96,469	236,349.05	0.06
404	002002	鸿达兴业	65,157	235,216.77	0.06
405	300085	银之杰	14,670	235,013.40	0.06
406	002091	江苏国泰	38,200	231,110.00	0.06
407	000826	启迪环境	31,010	230,094.20	0.06
408	002589	瑞康医药	42,760	229,193.60	0.06
409	002625	光启技术	31,590	229,027.50	0.06
410	002611	东方精工	49,600	228,656.00	0.06
411	002194	武汉凡谷	11,000	227,700.00	0.06
412	300602	飞荣达	6,932	227,508.24	0.06
413	000650	仁和药业	37,800	226,800.00	0.06
414	002042	华孚时尚	36,400	226,772.00	0.06

415	300053	欧比特	20,850	226,431.00	0.06
416	000301	东方盛虹	40,500	225,180.00	0.06
417	002064	华峰氨纶	44,400	225,108.00	0.06
418	002531	天顺风能	37,500	224,250.00	0.05
419	002950	奥美医疗	7,900	224,202.00	0.05
420	300748	金力永磁	6,700	223,646.00	0.05
421	002390	信邦制药	48,850	222,756.00	0.05
422	000810	创维数字	18,400	222,272.00	0.05
423	000676	智度股份	26,020	222,210.80	0.05
424	000008	神州高铁	75,452	221,828.88	0.05
425	002430	杭氧股份	15,600	221,520.00	0.05
426	000031	大悦城	43,241	220,096.69	0.05
427	300072	三聚环保	50,840	217,595.20	0.05
428	002302	西部建设	22,400	215,040.00	0.05
429	002901	大博医疗	1,800	214,722.00	0.05
430	000732	泰禾集团	42,000	213,780.00	0.05
431	000921	海信家电	17,500	212,800.00	0.05
432	002434	万里扬	24,500	212,660.00	0.05
433	300377	赢时胜	22,747	212,456.98	0.05
434	000990	诚志股份	16,500	209,385.00	0.05
435	002249	大洋电机	57,934	209,141.74	0.05
436	002459	晶澳科技	11,100	208,458.00	0.05
437	000582	北部湾港	19,100	205,134.00	0.05
438	002596	海南瑞泽	30,800	205,128.00	0.05
439	002563	森马服饰	29,000	204,450.00	0.05
440	000685	中山公用	26,340	202,818.00	0.05
441	000933	神火股份	48,800	202,520.00	0.05
442	000560	我爱我家	63,100	201,920.00	0.05
443	002128	露天煤业	26,000	201,500.00	0.05
444	002376	新北洋	19,600	199,724.00	0.05
445	002320	海峡股份	18,150	199,650.00	0.05
446	002503	搜于特	71,000	199,510.00	0.05
447	002867	周大生	8,950	198,421.50	0.05
448	000683	远兴能源	105,200	195,672.00	0.05
449	300741	华宝股份	5,300	195,464.00	0.05
450	000717	韶钢松山	51,400	195,320.00	0.05
451	002408	齐翔腾达	31,200	193,752.00	0.05
452	300735	光弘科技	10,460	192,987.00	0.05
453	002665	首航高科	76,930	187,709.20	0.05
454	000718	苏宁环球	60,296	186,314.64	0.05
455	002653	海思科	7,000	186,270.00	0.05
456	300257	开山股份	14,100	184,287.00	0.05
457	300616	尚品宅配	3,000	180,240.00	0.04

458	002544	杰赛科技	13,300	174,895.00	0.04
459	000059	华锦股份	37,700	170,404.00	0.04
460	001965	招商公路	25,100	168,923.00	0.04
461	002424	贵州百灵	20,300	168,490.00	0.04
462	002419	天虹股份	17,600	168,080.00	0.04
463	000869	张裕 A	4,900	167,335.00	0.04
464	002383	合众思壮	16,900	163,761.00	0.04
465	000062	深圳华强	11,212	163,022.48	0.04
466	300761	立华股份	4,200	161,868.00	0.04
467	002491	通鼎互联	31,100	159,232.00	0.04
468	300682	朗新科技	9,250	157,435.00	0.04
469	000989	九芝堂	15,300	154,224.00	0.04
470	002737	葵花药业	10,400	152,152.00	0.04
471	002051	中工国际	20,428	148,715.84	0.04
472	002118	紫鑫药业	33,100	146,964.00	0.04
473	300527	中船应急	15,800	143,306.00	0.04
474	000553	安道麦 A	15,800	142,516.00	0.03
475	002537	海联金汇	24,500	142,345.00	0.03
476	000600	建投能源	27,800	141,502.00	0.03
477	002948	青岛银行	27,300	138,957.00	0.03
478	002461	珠江啤酒	13,800	138,276.00	0.03
479	000935	四川双马	10,700	137,388.00	0.03
480	000937	冀中能源	45,400	137,108.00	0.03
481	300783	三只松鼠	1,800	136,764.00	0.03
482	000959	首钢股份	31,600	135,880.00	0.03
483	000537	广宇发展	18,300	133,590.00	0.03
484	300634	彩讯股份	6,000	133,380.00	0.03
485	002755	奥赛康	6,900	130,410.00	0.03
486	002966	苏州银行	15,100	126,538.00	0.03
487	000968	蓝焰控股	16,500	126,225.00	0.03
488	000958	东方能源	30,100	125,216.00	0.03
489	002946	新乳业	7,200	124,920.00	0.03
490	002061	浙江交科	24,100	124,838.00	0.03
491	002243	通产丽星	8,000	115,200.00	0.03
492	002941	新疆交建	7,600	107,540.00	0.03
493	000950	重药控股	20,600	103,824.00	0.03
494	002818	富森美	7,000	86,100.00	0.02
495	000923	河钢资源	5,600	70,560.00	0.02
496	002423	中粮资本	7,400	64,380.00	0.02
497	001872	招商港口	4,300	62,565.00	0.02
498	002961	瑞达期货	2,100	58,065.00	0.01
499	000785	居然之家	6,700	53,064.00	0.01
500	002911	佛燃能源	2,500	38,000.00	0.01

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

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	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
2	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
3	300847	N 中 船	1,421	9,861.74	0.00
4	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
5	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
6	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	002714	牧原股份	1,259,360.00	0.31
2	002352	顺丰控股	1,153,245.00	0.29
3	002841	视源股份	1,112,220.06	0.28
4	000002	万 科 A	916,053.00	0.23
5	000895	双汇发展	790,241.00	0.20
6	000617	中油资本	752,302.00	0.19
7	300782	卓 胜 微	749,742.00	0.19
8	300326	凯 利 泰	714,419.00	0.18
9	002683	宏大爆破	664,342.00	0.17
10	300661	圣邦股份	654,756.00	0.16
11	000661	长春高新	636,688.00	0.16
12	002436	兴森科技	622,583.00	0.15
13	002250	联化科技	575,274.00	0.14
14	001914	招商积余	557,865.00	0.14
15	300223	北京君正	548,872.00	0.14
16	002120	韵达股份	535,528.00	0.13
17	300773	拉 卡 拉	502,350.00	0.12
18	300759	康龙化成	500,467.00	0.12
19	300502	新 易 盛	491,233.00	0.12
20	300770	新媒股份	483,192.00	0.12

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 累计买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	000858	五 粮 液	1,061,537.12	0.26
2	000333	美的集团	1,035,577.00	0.26
3	000661	长春高新	747,807.00	0.19
4	000001	平安银行	710,537.00	0.18
5	000651	格力电器	527,127.00	0.13
6	300750	宁德时代	509,176.00	0.13
7	300661	圣邦股份	409,989.00	0.10
8	300498	温氏股份	398,881.00	0.10
9	000568	泸州老窖	376,716.00	0.09
10	002415	海康威视	375,132.00	0.09
11	300059	东方财富	367,023.00	0.09
12	002304	洋河股份	358,008.00	0.09
13	300760	迈瑞医疗	333,963.00	0.08
14	002475	立讯精密	305,884.00	0.08
15	002916	深南电路	286,239.00	0.07
16	002821	凯 莱 英	284,136.00	0.07
17	300203	聚光科技	276,662.00	0.07
18	002421	达实智能	275,385.00	0.07
19	000100	TCL 科技	270,515.00	0.07
20	002142	宁波银行	256,262.00	0.06

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	40,521,636.46
卖出股票收入（成交）总额	35,891,820.30

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	174,800.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	174,800.00	0.04

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	128112	歌尔转 2	1,274	127,400.00	0.03
2	127017	万青转债	266	26,600.00	0.01
3	128115	巨星转债	208	20,800.00	0.01

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 市场中性策略执行情况

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

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。

7.13.2 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	3,140.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	114.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,254.86

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处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

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的情况。

7.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300847	中船汉光	9,861.74	0.00	新股未上市
2	300845	捷安高科	8,286.10	0.00	新股未上市
3	300840	酷特智能	7,038.90	0.00	新股未上市

§ 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		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
5,023	61,149.61	2,047,740.00	0.67%	112,377,993.00	36.59%	192,728,774.00	62.75%

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	章斌	2,151,301.00	0.70%
2	凌燕	1,475,778.00	0.48%
3	刘素坚	1,080,000.00	0.35%
4	屠文斌	1,000,000.00	0.33%
5	神凤荣	956,718.00	0.31%
6	郝世军	911,711.00	0.30%
7	浙江华浙白马房地产开发有限公司	910,052.00	0.30%
8	贾伟	834,443.00	0.27%
9	曹莘	804,403.00	0.26%
10	曲怀仁	800,000.00	0.26%
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	192,728,774.00	62.75%

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(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	349,154,507.00
本报告期基金总申购份额	69,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	111,000,000.00
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	307,154,507.00

§ 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	75,621,771.09	100.00%	7,565.18	100.00%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-

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
华泰证券	946,963.40	99.77%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	2,153.00	0.23%	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司关于旗下完全被动型指数基金认购关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-13
2	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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-20
3	关于南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF	上海证券报、基金管	2020-03-25

	下调指数使用费的公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
4	南方基金关于旗下部分基金增加兴业证券为申购赎回代理券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-05-07
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	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-05-07

§ 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
联接基金	1	20200101-20200630	213,321,432.00	51,407,342.00	72,000,000.00	192,728,774.00	62.75%
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。							

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

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；

6、《深证成份交易型开放式指数证券投资基金 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>