**南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)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：中国农业银行股份有限公司**

**报告送出日期：2019年8月23日**

1. 重要提示及目录
   1. 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。

基金托管人中国农业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. 目录

[§1 重要提示及目录 1](#_Toc17363860)

[1.1 重要提示 1](#_Toc17363861)

[1.2 目录 2](#_Toc17363862)

[§2 基金简介 4](#_Toc17363863)

[2.1 基金基本情况 4](#_Toc17363864)

[2.2 基金产品说明 5](#_Toc17363865)

[2.3 基金管理人和基金托管人 5](#_Toc17363866)

[2.4 信息披露方式 6](#_Toc17363867)

[2.5 其他相关资料 6](#_Toc17363868)

[§3 主要财务指标和基金净值表现 6](#_Toc17363869)

[3.1 主要会计数据和财务指标 6](#_Toc17363870)

[3.2 基金净值表现 7](#_Toc17363871)

[§4 管理人报告 9](#_Toc17363872)

[4.1 基金管理人及基金经理情况 9](#_Toc17363873)

[4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10](#_Toc17363874)

[4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11](#_Toc17363875)

[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](#_Toc17363876)

[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](#_Toc17363877)

[4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12](#_Toc17363878)

[4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12](#_Toc17363879)

[4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 13](#_Toc17363880)

[§5 托管人报告 13](#_Toc17363881)

[5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13](#_Toc17363882)

[5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 13](#_Toc17363883)

[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](#_Toc17363884)

[§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13](#_Toc17363885)

[6.1 资产负债表 14](#_Toc17363886)

[6.2 利润表 15](#_Toc17363887)

[6.3 所有者权益（基金净值）变动表 17](#_Toc17363888)

[6.4 报表附注 18](#_Toc17363889)

[§7 投资组合报告 37](#_Toc17363890)

[7.1 期末基金资产组合情况 37](#_Toc17363891)

[7.2 期末按行业分类的股票投资组合 37](#_Toc17363892)

[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 38](#_Toc17363893)

[7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 50](#_Toc17363894)

[7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 51](#_Toc17363895)

[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 52](#_Toc17363896)

[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 52](#_Toc17363897)

[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 52](#_Toc17363898)

[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 52](#_Toc17363899)

[7.10 本报告期投资基金情况 52](#_Toc17363900)

[7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 53](#_Toc17363901)

[7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 53](#_Toc17363902)

[7.13 投资组合报告附注 53](#_Toc17363903)

[§8 基金份额持有人信息 54](#_Toc17363904)

[8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 54](#_Toc17363905)

[8.2 期末上市基金前十名持有人 55](#_Toc17363906)

[8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 55](#_Toc17363907)

[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 55](#_Toc17363908)

[§9 开放式基金份额变动 56](#_Toc17363909)

[§10 重大事件揭示 56](#_Toc17363910)

[10.1 基金份额持有人大会决议 56](#_Toc17363911)

[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 56](#_Toc17363912)

[10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 56](#_Toc17363913)

[10.4 基金投资策略的改变 56](#_Toc17363914)

[10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 57](#_Toc17363915)

[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 57](#_Toc17363916)

[10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 57](#_Toc17363917)

[10.8 其他重大事件 58](#_Toc17363918)

[§11 影响投资者决策的其他重要信息 60](#_Toc17363919)

[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 60](#_Toc17363920)

[11.2 影响投资者决策的其他重要信息 60](#_Toc17363921)

[§12 备查文件目录 60](#_Toc17363922)

[12.1 备查文件目录 60](#_Toc17363923)

[12.2 存放地点 60](#_Toc17363924)

[12.3 查阅方式 60](#_Toc17363925)

1. 基金简介
   1. 基金基本情况

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 基金名称 | 南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF) | |
| 基金简称 | 南方中证500ETF联接(LOF) | |
| 场内简称 | 南方500 | |
| 基金主代码 | 160119 | |
| 前端交易代码 | 160119 | |
| 后端交易代码 | 160120 | |
| 基金运作方式 | 上市型开放式(LOF) | |
| 基金合同生效日 | 2009年9月25日 | |
| 基金管理人 | 南方基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 8,986,635,441.59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 | 2009年11月11日 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 南方中证500ETF联接(LOF)A | 南方中证500ETF联接(LOF)C |
| 下属分级基金的场内简称 | 南方500 |  |
| 下属分级基金的交易代码 | 160119 | 004348 |
| 下属分级基金的前端交易代码 | 160119 |  |
| 下属分级基金的后端交易代码 | 160120 |  |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 7,742,649,822.59份 | 1,243,985,619.00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“南方500”。

* + 1. 目标基金基本情况

|  |  |
| --- | --- |
| 基金名称 | 中证500交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码 | 510500 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年2月6日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2013年3月15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 | 中国农业银行股份有限公司 |

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“500ETF”。

* 1. 基金产品说明

|  |  |
| --- | --- |
| 投资目标 | 本基金通过投资于目标ETF，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。 |
| 投资策略 | 本基金为完全被动式指数基金，以中证500ETF作为其主要投资标的。为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标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0.3%，年跟踪误差不超过4%。 |
| 业绩比较基准 | 中证500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，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，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。 |

* + 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 | 本基金为被动式指数基金，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。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证500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。 |

* 1. 基金管理人和基金托管人

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
| 名称 | | 南方基金管理股份有限公司 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 常克川 | 贺倩 |
| 联系电话 | 0755-82763888 | 010-66060069 |
| 电子邮箱 | manager@southernfund.com | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-889-8899 | 95599 |
| 传真 | | 0755-82763889 | 010-68121816 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦32-42楼 | 北京东城区建国门内大街69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28号凯晨世贸中心东座F9 |
| 邮政编码 | | 518017 | 100031 |
| 法定代表人 | | 张海波 | 周慕冰 |

* 1. 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 |

* 1. 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  南方基金管理股份有限公司 | 北京市西城区太平桥大街17号  深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦32-42楼 |

1. 主要财务指标和基金净值表现
   1. 主要会计数据和财务指标

1、南方中证500ETF联接(LOF)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 | -65,031,828.17 |
| 本期利润 | 723,790,085.05 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1064 |
| 本期加权平均净值利润率 | 8.35% |
| 本期基金份额净值增长率 | 17.94% |
| 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 | 2,001,626,407.38 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2585 |
| 期末基金资产净值 | 9,744,276,229.97 |
| 期末基金份额净值 | 1.2585 |
| 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 | 37.31% |

2、南方中证500ETF联接(LOF)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 | -18,559,183.23 |
| 本期利润 | 214,798,230.08 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1726 |
| 本期加权平均净值利润率 | 13.72% |
| 本期基金份额净值增长率 | 17.69% |
| 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 | 314,528,936.06 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2528 |
| 期末基金资产净值 | 1,558,514,555.06 |
| 期末基金份额净值 | 1.2528 |
| 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 | -20.37% |

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。

* 1. 基金净值表现
     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

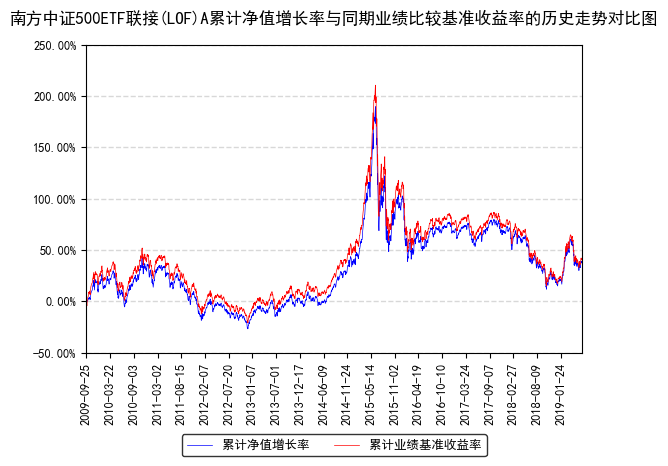
南方中证500ETF联接(LOF)A

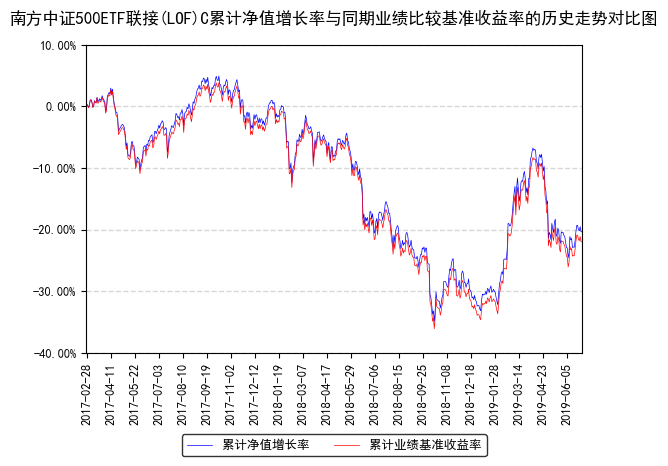
|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
| 过去一个月 | 1.01% | 1.35% | 0.75% | 1.32% | 0.26% | 0.03% |
| 过去三个月 | -9.72% | 1.73% | -10.21% | 1.72% | 0.49% | 0.01% |
| 过去六个月 | 17.94% | 1.70% | 17.87% | 1.70% | 0.07% | 0.00% |
| 过去一年 | -3.56% | 1.60% | -4.70% | 1.60% | 1.14% | 0.00% |
| 过去三年 | -15.71% | 1.24% | -18.00% | 1.25% | 2.29% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 37.31% | 1.63% | 40.25% | 1.64% | -2.94% | -0.01% |

南方中证500ETF联接(LOF)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 | 0.98% | 1.35% | 0.75% | 1.32% | 0.23% | 0.03% |
| 过去三个月 | -9.81% | 1.73% | -10.21% | 1.72% | 0.40% | 0.01% |
| 过去六个月 | 17.69% | 1.70% | 17.87% | 1.70% | -0.18% | 0.00% |
| 过去一年 | -3.95% | 1.60% | -4.70% | 1.60% | 0.75% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | -20.37% | 1.33% | -21.99% | 1.33% | 1.62% | 0.00% |

* + 1. 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





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。

1. 管理人报告
   1. 基金管理人及基金经理情况
      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。

* + 1. 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 |
| 罗文杰 | 本基金基金经理 | 2013年4月22日 | - | 14年 | 女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008年9月加入南方基金，任南方基金数量化投资部基金经理助理；2013年4月起担任数量化投资部基金经理；现任指数投资部总经理。2013年5月至2015年6月，任南方策略基金经理；2017年11月至2019年1月，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016年12月至2019年4月，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2013年4月至今，任南方500、南方500ETF基金经理；2013年5月至今，任南方300、南方300联接基金经理；2014年10月至今，任500医药基金经理；2015年2月至今，任南方恒生ETF基金经理；2017年7月至今，任恒生联接基金经理；2017年8月至今，任南方房地产联接、南方房地产ETF基金经理；2018年2月至今，任H股ETF、南方H股ETF联接基金经理；2018年4月至今，任MSCI基金基金经理；2018年6月至今，任MSCI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。

* 1. 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。

* 1. 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
     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，并且交易占优比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

* + 1. 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分股调整所致。

* 1. 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
     1. 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，中证500指数涨18.77%。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) 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（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

(3) 报告期内，我们根据指数定期的成份股调整进行了基金调仓，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，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

* + 1. 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1.2585元，报告期内，份额净值增长率为17.94%，同期业绩基准增长率为17.87%；本基金C份额净值为1.2528元，报告期内，份额净值增长率为17.69%，同期业绩基准增长率为17.87%。

* 1. 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美联储月底议息会议如期降息，IMF年内再度下调全球经济增长预期，各国央行相继降息支撑通胀托底经济下行，全球货币政策宽松态势明朗，支撑全球风险资产估值。 权益市场资金持续净流入，短期有所减弱，但在A股国际化的背景下， 预期中长期资金为净流入。 同时A股市场估值接近历史底部， 凸显长期配置价值。

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。

* 1. 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。

* 1. 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，可进行收益分配。基金管理人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；每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配采取现金分红方式；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。

* 1. 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。

1. 托管人报告
   1. 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司 2019 年 1 月 1 日至 2019年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

* 1. 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

1. 半年度财务会计报告（未经审计）
   1. 资产负债表

会计主体：南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

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 | 737,343,459.86 | 295,831,756.23 |
| 结算备付金 |  | 11,090,382.36 | 3,454,924.63 |
| 存出保证金 |  | 1,741,271.79 | 608,132.02 |
| 交易性金融资产 | 6.4.3.2 | 10,940,187,277.17 | 6,272,964,818.92 |
| 其中：股票投资 |  | 171,277,854.01 | 128,664,864.84 |
| 基金投资 |  | 10,606,391,439.76 | 6,098,197,149.08 |
| 债券投资 |  | 162,517,983.40 | 46,102,805.00 |
| 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 |  | 75,962,529.34 | 11,453,452.57 |
| 应收利息 | 6.4.3.5 | 3,346,428.00 | 2,026,201.29 |
| 应收股利 |  | - | - |
| 应收申购款 |  | 13,151,713.27 | 10,825,653.09 |
| 递延所得税资产 |  | - | - |
| 其他资产 | 6.4.3.6 | 19,341,234.35 | 5,229,051.94 |
| 资产总计 |  | 11,802,164,296.14 | 6,602,393,990.69 |
| 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 |  | 75,000,000.00 | 33,000,000.00 |
| 应付证券清算款 |  | - | 16,732,390.40 |
| 应付赎回款 |  | 423,032,683.66 | 4,079,865.89 |
| 应付管理人报酬 |  | 288,712.92 | 203,635.18 |
| 应付托管费 |  | 57,742.57 | 40,727.06 |
| 应付销售服务费 |  | 500,546.99 | 438,771.72 |
| 应付交易费用 | 6.4.3.7 | 262,803.02 | 81,642.00 |
| 应交税费 |  | 4.83 | 6.06 |
| 应付利息 |  | - | -3,362.74 |
| 应付利润 |  | - | - |
| 递延所得税负债 |  | - | - |
| 其他负债 | 6.4.3.8 | 231,017.12 | 431,701.87 |
| 负债合计 |  | 499,373,511.11 | 55,005,377.44 |
| 所有者权益： |  |  |  |
| 实收基金 | 6.4.3.9 | 8,986,635,441.59 | 6,138,478,178.78 |
| 未分配利润 | 6.4.3.10 | 2,316,155,343.44 | 408,910,434.47 |
| 所有者权益合计 |  | 11,302,790,785.03 | 6,547,388,613.25 |
| 负债和所有者权益总计 |  | 11,802,164,296.14 | 6,602,393,990.69 |

注：报告截止日2019年6月30日，南方中证500ETF联接(LOF)A份额净值1.2585元，基金份额总额7,742,649,822.59份；南方中证500ETF联接(LOF)C份额净值1.2528元，基金份额总额1,243,985,619.00份；总份额合计8,986,635,441.59份。

* 1. 利润表

会计主体：南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

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 |  | 947,917,432.00 | -849,123,891.13 |
| 1.利息收入 |  | 3,898,992.51 | 1,798,575.46 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.3.11 | 2,289,666.05 | 988,535.07 |
| 债券利息收入 |  | 1,609,326.46 | 810,040.39 |
| 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） |  | -88,215,275.84 | -7,504,723.57 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.3.12 | 26,337,793.66 | -12,583,246.00 |
| 基金投资收益 | 6.4.3.13 | -115,324,017.82 | 3,505,933.51 |
| 债券投资收益 | 6.4.3.14 | -516,874.07 | 161,393.72 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.3.15 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.3.16 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.3.17 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.3.18 | 1,287,822.39 | 1,411,195.20 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.3.19 | 1,022,179,326.53 | -845,069,983.03 |
| 4.汇兑收益（损失以“－”号填列） |  | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.3.20 | 10,054,388.80 | 1,652,240.01 |
| 减：二、费用 |  | 9,329,116.87 | 3,366,190.48 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.6.2.1 | 1,598,598.67 | 1,247,735.72 |
| 2.托管费 | 6.4.6.2.2 | 319,719.71 | 249,547.14 |
| 3.销售服务费 | 6.4.6.2.3 | 3,089,862.16 | 822,261.48 |
| 4.交易费用 | 6.4.3.21 | 3,614,131.23 | 774,656.34 |
| 5.利息支出 |  | 527,644.16 | 28,366.76 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 |  | 527,644.16 | 28,366.76 |
| 6.税金及附加 |  | 0.53 | 0.43 |
| 7.其他费用 | 6.4.3.22 | 179,160.41 | 243,622.61 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |  | 938,588,315.13 | -852,490,081.61 |
| 减：所得税费用 |  | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | 938,588,315.13 | -852,490,081.61 |

* 1. 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

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） | 6,138,478,178.78 | 408,910,434.47 | 6,547,388,613.25 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 938,588,315.13 | 938,588,315.13 |
| 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） | 2,848,157,262.81 | 968,656,593.84 | 3,816,813,856.65 |
| 其中：1.基金申购款 | 9,076,448,118.02 | 2,876,610,073.51 | 11,953,058,191.53 |
| 2.基金赎回款 | -6,228,290,855.21 | -1,907,953,479.67 | -8,136,244,334.88 |
| 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） | 8,986,635,441.59 | 2,316,155,343.44 | 11,302,790,785.03 |
| 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） | 2,767,041,393.43 | 1,497,374,155.70 | 4,264,415,549.13 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -852,490,081.61 | -852,490,081.61 |
| 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） | 1,486,197,411.04 | 652,008,291.48 | 2,138,205,702.52 |
| 其中：1.基金申购款 | 2,209,308,174.45 | 1,016,325,618.88 | 3,225,633,793.33 |
| 2.基金赎回款 | -723,110,763.41 | -364,317,327.40 | -1,087,428,090.81 |
| 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） | 4,253,238,804.47 | 1,296,892,365.57 | 5,550,131,170.04 |

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

* 1. 报表附注
     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。

* + 1. 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
       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。

* + 1. 重要财务报表项目的说明
       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 | 737,343,459.86 |
| 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 | 737,343,459.86 |

* + - 1. 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 | | 168,671,814.65 | 171,277,854.01 | 2,606,039.36 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 162,833,993.41 | 162,517,983.40 | -316,010.01 |
| 银行间市场 | - | - | - |
| 合计 | 162,833,993.41 | 162,517,983.40 | -316,010.01 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | 11,294,741,475.31 | 10,606,391,439.76 | -688,350,035.55 |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 11,626,247,283.37 | 10,940,187,277.17 | -686,060,006.20 |

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。

* + - 1. 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

* + - 1. 买入返售金融资产
         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。

* + - * 1. 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。

* + - 1. 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 | 245,485.49 |
| 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 | 4,491.63 |
| 应收债券利息 | 3,095,745.64 |
| 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 | 705.24 |
| 合计 | 3,346,428.00 |

* + - 1. 其他资产

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期末2019年6月30日 |
| 其他应收款 | - |
| 待摊费用 | - |
| 可收退补款 | - |
| 应收退补款 | 19,341,234.35 |
| 合计 | 19,341,234.35 |

* + - 1. 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 | 262,803.02 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 262,803.02 |

* + - 1. 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 | 73,906.52 |
| 应退退补款 | - |
| 预提费用 | 157,110.60 |
| 应付指数使用费 | - |
| 可退退补款 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 231,017.12 |

* + - 1. 实收基金

金额单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 南方中证500ETF联接(LOF)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 | 4,934,171,169.07 | 4,934,171,169.07 |
| 本期申购 | 7,487,432,030.44 | 7,487,432,030.44 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -4,678,953,376.92 | -4,678,953,376.92 |
| 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 | 7,742,649,822.59 | 7,742,649,822.59 |

金额单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 南方中证500ETF联接(LOF)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 | 1,204,307,009.71 | 1,204,307,009.71 |
| 本期申购 | 1,589,016,087.58 | 1,589,016,087.58 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,549,337,478.29 | -1,549,337,478.29 |
| 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 | 1,243,985,619.00 | 1,243,985,619.00 |

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

* + - 1. 未分配利润

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 南方中证500ETF联接(LOF)A | | | |
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 4,255,587,894.12 | -3,924,296,760.68 | 331,291,133.44 |
| 本期利润 | -65,031,828.17 | 788,821,913.22 | 723,790,085.05 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,401,717,624.24 | -1,455,172,435.35 | 946,545,188.89 |
| 其中：基金申购款 | 6,407,267,431.22 | -4,067,169,826.62 | 2,340,097,604.60 |
| 基金赎回款 | -4,005,549,806.98 | 2,611,997,391.27 | -1,393,552,415.71 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 6,592,273,690.19 | -4,590,647,282.81 | 2,001,626,407.38 |

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 南方中证500ETF联接(LOF)C | | | |
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 1,034,997,157.43 | -957,377,856.40 | 77,619,301.03 |
| 本期利润 | -18,559,183.23 | 233,357,413.31 | 214,798,230.08 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 35,832,485.35 | -13,721,080.40 | 22,111,404.95 |
| 其中：基金申购款 | 1,354,081,922.75 | -817,569,453.84 | 536,512,468.91 |
| 基金赎回款 | -1,318,249,437.40 | 803,848,373.44 | -514,401,063.96 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,052,270,459.55 | -737,741,523.49 | 314,528,936.06 |

* + - 1. 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 | 2,068,140.54 |
| 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 | 84,702.78 |
| 其他 | 136,822.73 |
| 合计 | 2,289,666.05 |

* + - 1. 股票投资收益
         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 | 12,501,625.16 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | 13,836,168.50 |
| 合计 | 26,337,793.66 |

* + - * 1. 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 | 2,100,317,579.89 |
| 减：卖出股票成本总额 | 2,087,815,954.73 |
| 买卖股票差价收入 | 12,501,625.16 |

* + - * 1. 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。

* + - * 1. 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 | 8,201,557,560.00 |
| 减：现金支付申购款总额 | 4,322,376,375.84 |
| 减：申购股票成本总额 | 3,865,345,015.66 |
| 申购差价收入 | 13,836,168.50 |

* + - 1. 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 | 4,611,594,397.52 |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 4,726,918,415.34 |
| 基金投资收益 | -115,324,017.82 |

* + - 1. 债券投资收益
         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 | 48,349,497.85 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 46,670,561.90 |
| 减：应收利息总额 | 2,195,810.02 |
| 买卖债券差价收入 | -516,874.07 |

* + - * 1. 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。

* + - * 1. 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。

* + - 1. 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。

* + - 1. 贵金属投资收益
         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。

* + - * 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。

* + - * 1. 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。

* + - * 1. 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。

* + - 1. 衍生工具收益
         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。

* + - * 1. 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。

* + - 1. 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 | 1,287,822.39 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 1,287,822.39 |

* + - 1. 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 | 1,022,179,326.53 |
| ——股票投资 | 13,659,554.05 |
| ——债券投资 | 124,446.89 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | 1,008,395,325.59 |
| ——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 | 1,022,179,326.53 |

* + - 1. 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 | 10,041,022.76 |
| 基金转换费收入 | 13,366.04 |
| 合计 | 10,054,388.80 |

注：1 本基金的A类基金份额的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产；C类基金份额的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中A类基金份额场内部分的赎回费率为0.5%，场外部分的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产；C类基金份额的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入基金资产。

* + - 1. 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 | 3,207,653.95 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 交易基金产生的费用 | 406,477.28 |
| 其中：申购费 | - |
| 赎回费 | - |
| 场内交易费 | 417.54 |
| 其他 | 406,059.74 |
| 合计 | 3,614,131.23 |

* + - 1. 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 | 67,440.60 |
| 信息披露费 | 59,917.22 |
| 银行费用 | 22,049.81 |
| 上市费 | 29,752.78 |
| 合计 | 179,160.41 |

* + 1. 或有事项、资产负债表日后事项的说明
       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。

* + - 1. 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。

* + 1. 关联方关系
       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。

* + - 1. 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 |
| 中国农业银行股份有限公司(“农业银行”) | 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 |
| 中证500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。

* + 1. 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
       1. 通过关联方交易单元进行的交易
          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 | 42,383,960.09 | 0.72% | 462,758,063.27 | 25.74% |

* + - * 1. 基金交易

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基金交易。

* + - * 1. 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。

* + - * 1. 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 | 4,238.88 | 0.72% | 2,754.22 | 1.05% |
| 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 | 46,280.12 | 25.74% | 23,173.26 | 35.45% |

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。

* + - 1. 关联方报酬
         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 | 1,598,598.67 | 1,247,735.72 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,656,395.06 | 2,395,722.54 |

注：本基金基金财产中投资于目标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0.5%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) X 0.5% / 当年天数。

* + - * 1. 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 | 319,719.71 | 249,547.14 |

注：本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费，支付基金托管人 中国农业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0.1%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝(前一日基金资产净值–前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产) X 0.1% /当年天数。

* + - * 1. 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 | | |
| 南方中证500ETF联接(LOF)A | 南方中证500ETF联接(LOF)C | 合计 |
| 华泰证券 | - | 2,578.33 | 2,578.33 |
| 南方基金 | - | 2,681,492.89 | 2,681,492.89 |
| 合计 | - | 2,684,071.22 | 2,684,071.22 |
| 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 | | |
| 南方中证500ETF联接(LOF)A | 南方中证500ETF联接(LOF)C | 合计 |
| 南方基金 | - | 812,679.03 | 812,679.03 |
| 华泰证券 | - | 68.59 | 68.59 |
| 合计 | - | 812,747.62 | 812,747.62 |

注:本基金基金资产中投资于目标ETF的部分不收取销售服务费，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的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类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日C类基金份额基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

* + - 1. 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。

* + - 1. 各关联方投资本基金的情况
         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2019年1月1日至2019年6月30日 | |
| 南方中证500ETF联接(LOF)A | 南方中证500ETF联接(LOF)C |
| 基金合同生效日（2009年9月25日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | - | - |
| 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 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | - |

份额单位：份

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 上年度可比期间2018年1月1日至2018年6月30日 | |
| 南方中证500ETF联接(LOF)A | 南方中证500ETF联接(LOF)C |
| 基金合同生效日（2009年9月25日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 39,873,972.73 | - |
| 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 | 50,195.00 | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 39,823,777.73 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.94% | - |

* + - * 1. 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。

* + - 1. 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 |
| 农业银行 | 737,343,459.86 | 2,068,140.54 | 241,723,950.39 | 902,882.66 |

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

* + - 1. 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

* + - 1. 其他关联交易事项的说明
         1. 其他关联交易事项的说明

于2019年6月30日，本基金持有1,990,577,002.00份目标ETF基金份额，占其总份额的比例为22.03%(2018年12月31日：本基金持有1,366,573,402份目标ETF基金份额，占其总份额的比例为18.22%)。

* + 1. 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

* + 1. 期末（2019年06月30日）本基金持有的流通受限证券
       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 |
| 300788 | 中信出版 | 2019年6月27日 | 2019年7月5日 | 新股未上市 | 14.85 | 14.85 | 1,556 | 23,106.60 | 23,106.60 | - |
| 601236 | 红塔证券 | 2019年6月26日 | 2019年7月5日 | 新股未上市 | 3.46 | 3.46 | 9,789 | 33,869.94 | 33,869.94 | - |
| 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 |
| 113027 | 华钰转债 | 2019年6月17日 | 2019年7月10日 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 30 | 3,000.00 | 3,000.00 | - |

注：1、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；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

* + - 1. 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。

* + - 1. 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
         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。

* + - * 1. 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额75,000,000.00元，截至2019年7月1日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

* + 1. 金融工具风险及管理
       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。本基金为被动式指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和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，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和股票投资。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。

* + - 1. 信用风险

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

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

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

于2019年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.0011%(2018年12月31日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.0000%)。

* + - 1. 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，除卖出回购金融资产款余额中有75,000,000.00元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

* + - * 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。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%。于2019年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.0005%。

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。于2019年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

* + - 1. 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。

* + - * 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。

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 | 737,343,459.86 | - | - | - | 737,343,459.86 |
| 结算备付金 | 11,090,382.36 | - | - | - | 11,090,382.36 |
| 存出保证金 | 1,741,271.79 | - | - | - | 1,741,271.79 |
| 交易性金融资产 | 162,404,034.80 | - | 113,948.60 | 10,777,669,293.77 | 10,940,187,277.17 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 3,346,428.00 | 3,346,428.00 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | 1,053,082.43 | - | - | 12,098,630.84 | 13,151,713.27 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 75,962,529.34 | 75,962,529.34 |
| 其他资产 | - | - | - | 19,341,234.35 | 19,341,234.35 |
| 资产总计 | 913,632,231.24 | - | 113,948.60 | 10,888,418,116.30 | 11,802,164,296.14 |
| 负债 |  |  |  |  |  |
| 应付赎回款 | - | - | - | 423,032,683.66 | 423,032,683.66 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 288,712.92 | 288,712.92 |
| 应付托管费 | - | - | - | 57,742.57 | 57,742.57 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 75,000,000.00 | - | - | - | 75,000,000.00 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 500,546.99 | 500,546.99 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 262,803.02 | 262,803.02 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | 4.83 | 4.83 |
| 其他负债 | - | - | - | 231,017.12 | 231,017.12 |
| 负债总计 | 75,000,000.00 | - | - | 424,373,511.11 | 499,373,511.11 |
| 利率敏感度缺口 | 838,632,231.24 | - | 113,948.60 | 10,464,044,605.19 | 11,302,790,785.03 |
| 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 | 295,831,756.23 | - | - | - | 295,831,756.23 |
| 结算备付金 | 3,454,924.63 | - | - | - | 3,454,924.63 |
| 存出保证金 | 608,132.02 | - | - | - | 608,132.02 |
| 交易性金融资产 | 46,102,805.00 | - | - | 6,226,862,013.92 | 6,272,964,818.92 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 2,026,201.29 | 2,026,201.29 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | 1,559,490.67 | - | - | 9,266,162.42 | 10,825,653.09 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 11,453,452.57 | 11,453,452.57 |
| 其他资产 | - | - | - | 5,229,051.94 | 5,229,051.94 |
| 资产总计 | 347,557,108.55 | - | - | 6,254,836,882.14 | 6,602,393,990.69 |
| 负债 |  |  |  |  |  |
| 应付赎回款 | - | - | - | 4,079,865.89 | 4,079,865.89 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 203,635.18 | 203,635.18 |
| 应付托管费 | - | - | - | 40,727.06 | 40,727.06 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 16,732,390.40 | 16,732,390.40 |
| 卖出回购金融资产款 | 33,000,000.00 | - | - | - | 33,000,000.00 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 438,771.72 | 438,771.72 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 81,642.00 | 81,642.00 |
| 应付利息 | - | - | - | -3,362.74 | -3,362.74 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | 6.06 | 6.06 |
| 其他负债 | - | - | - | 431,701.87 | 431,701.87 |
| 负债总计 | 33,000,000.00 | - | - | 22,005,377.44 | 55,005,377.44 |
| 利率敏感度缺口 | 314,557,108.55 | - | - | 6,232,831,504.70 | 6,547,388,613.25 |

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

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1.44%(2018年12月31日：0.70%)，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)。

* + - * 1. 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。

外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无外汇风险的敏感性分析。

* + - * 1. 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份额以及证券交易所上市的股票，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。

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 | 171,277,854.01 | 1.52 | 128,664,864.84 | 1.97 |
| 交易性金融资产-基金投资 | 10,606,391,439.76 | 93.84 | 6,098,197,149.08 | 93.14 |
| 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 | 10,777,669,293.77 | 95.35 | 6,226,862,013.92 | 95.10 |

注:交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标ETF份额。

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% | 531,298,983.64 | 343,083,163.33 |
| 2.组合自身基准下降 5% | -531,298,983.64 | -343,083,163.33 |

* + 1. 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。

1. 投资组合报告
   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 | 171,277,854.01 | 1.45 |
|  | 其中：股票 | 171,277,854.01 | 1.45 |
| 2 | 基金投资 | 10,606,391,439.76 | 89.87 |
| 3 | 固定收益投资 | 162,517,983.40 | 1.38 |
|  | 其中：债券 | 162,517,983.40 | 1.38 |
|  | 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 | 748,433,842.22 | 6.34 |
| 8 | 其他资产 | 113,543,176.75 | 0.96 |
| 9 | 合计 | 11,802,164,296.14 | 100.00 |

* 1. 期末按行业分类的股票投资组合
     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 | 1,888,302.40 | 0.02 |
| B | 采矿业 | 6,804,818.95 | 0.06 |
| C | 制造业 | 93,722,046.08 | 0.83 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,631,907.29 | 0.05 |
| E | 建筑业 | 3,250,429.52 | 0.03 |
| F | 批发和零售业 | 10,493,767.32 | 0.09 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 8,007,378.13 | 0.07 |
| H | 住宿和餐饮业 | 859,976.38 | 0.01 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 13,986,394.72 | 0.12 |
| J | 金融业 | 6,424,455.38 | 0.06 |
| K | 房地产业 | 9,099,953.80 | 0.08 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,883,939.61 | 0.02 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 374,917.29 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,195,749.00 | 0.01 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 202,865.60 | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作 | 1,157,483.46 | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 3,571,246.02 | 0.03 |
| S | 综合 | 2,722,223.06 | 0.02 |
|  | 合计 | 171,277,854.01 | 1.52 |

* + 1. 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。

* 1. 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 | 600872 | 中炬高新 | 32,828 | 1,406,023.24 | 0.01 |
| 2 | 600536 | 中国软件 | 21,600 | 1,159,272.00 | 0.01 |
| 3 | 600739 | 辽宁成大 | 76,100 | 1,106,494.00 | 0.01 |
| 4 | 600201 | 生物股份 | 65,716 | 1,031,084.04 | 0.01 |
| 5 | 600298 | 安琪酵母 | 32,475 | 1,027,184.25 | 0.01 |
| 6 | 600183 | 生益科技 | 65,342 | 983,397.10 | 0.01 |
| 7 | 600642 | 申能股份 | 163,463 | 982,412.63 | 0.01 |
| 8 | 600426 | 华鲁恒升 | 65,654 | 975,618.44 | 0.01 |
| 9 | 600763 | 通策医疗 | 11,000 | 974,490.00 | 0.01 |
| 10 | 603369 | 今 世 缘 | 32,572 | 908,433.08 | 0.01 |
| 11 | 600895 | 张江高科 | 43,800 | 898,776.00 | 0.01 |
| 12 | 600801 | 华新水泥 | 43,451 | 879,882.75 | 0.01 |
| 13 | 600161 | 天坛生物 | 32,817 | 828,629.25 | 0.01 |
| 14 | 000860 | 顺鑫农业 | 17,639 | 822,859.35 | 0.01 |
| 15 | 600879 | 航天电子 | 130,800 | 805,728.00 | 0.01 |
| 16 | 600549 | 厦门钨业 | 54,300 | 777,033.00 | 0.01 |
| 17 | 600497 | 驰宏锌锗 | 152,600 | 775,208.00 | 0.01 |
| 18 | 600325 | 华发股份 | 98,368 | 768,254.08 | 0.01 |
| 19 | 601168 | 西部矿业 | 119,600 | 763,048.00 | 0.01 |
| 20 | 603939 | 益丰药房 | 10,900 | 762,891.00 | 0.01 |
| 21 | 600528 | 中铁工业 | 65,560 | 758,529.20 | 0.01 |
| 22 | 601128 | 常熟银行 | 98,153 | 757,741.16 | 0.01 |
| 23 | 600820 | 隧道股份 | 119,400 | 753,414.00 | 0.01 |
| 24 | 600745 | 闻泰科技 | 21,900 | 727,518.00 | 0.01 |
| 25 | 600460 | 士 兰 微 | 43,800 | 727,080.00 | 0.01 |
| 26 | 600392 | 盛和资源 | 65,310 | 722,328.60 | 0.01 |
| 27 | 601005 | 重庆钢铁 | 359,200 | 721,992.00 | 0.01 |
| 28 | 600909 | 华安证券 | 109,000 | 712,860.00 | 0.01 |
| 29 | 600584 | 长电科技 | 54,670 | 702,509.50 | 0.01 |
| 30 | 600410 | 华胜天成 | 65,400 | 701,742.00 | 0.01 |
| 31 | 600699 | 均胜电子 | 32,838 | 701,419.68 | 0.01 |
| 32 | 600572 | 康 恩 贝 | 109,200 | 698,880.00 | 0.01 |
| 33 | 600718 | 东软集团 | 54,382 | 697,177.24 | 0.01 |
| 34 | 600875 | 东方电气 | 65,420 | 694,760.40 | 0.01 |
| 35 | 600811 | 东方集团 | 184,831 | 687,571.32 | 0.01 |
| 36 | 600673 | 东 阳 光 | 87,427 | 686,301.95 | 0.01 |
| 37 | 600376 | 首开股份 | 76,400 | 682,252.00 | 0.01 |
| 38 | 600848 | 上海临港 | 21,900 | 681,747.00 | 0.01 |
| 39 | 600959 | 江苏有线 | 152,250 | 677,512.50 | 0.01 |
| 40 | 600315 | 上海家化 | 21,732 | 676,951.80 | 0.01 |
| 41 | 600839 | 四川长虹 | 228,400 | 673,780.00 | 0.01 |
| 42 | 600022 | 山东钢铁 | 402,660 | 672,442.20 | 0.01 |
| 43 | 600166 | 福田汽车 | 283,300 | 671,421.00 | 0.01 |
| 44 | 601333 | 广深铁路 | 206,900 | 668,287.00 | 0.01 |
| 45 | 601872 | 招商轮船 | 152,100 | 663,156.00 | 0.01 |
| 46 | 600567 | 山鹰纸业 | 196,000 | 660,520.00 | 0.01 |
| 47 | 600755 | 厦门国贸 | 76,348 | 658,883.24 | 0.01 |
| 48 | 600804 | 鹏 博 士 | 87,200 | 655,744.00 | 0.01 |
| 49 | 601866 | 中远海发 | 239,700 | 651,984.00 | 0.01 |
| 50 | 600260 | 凯乐科技 | 32,600 | 651,348.00 | 0.01 |
| 51 | 600881 | 亚泰集团 | 196,063 | 637,204.75 | 0.01 |
| 52 | 600808 | 马钢股份 | 184,901 | 630,512.41 | 0.01 |
| 53 | 002049 | 紫光国微 | 14,100 | 621,951.00 | 0.01 |
| 54 | 603883 | 老 百 姓 | 10,600 | 619,888.00 | 0.01 |
| 55 | 600160 | 巨化股份 | 86,936 | 618,114.96 | 0.01 |
| 56 | 600094 | 大 名 城 | 98,000 | 616,420.00 | 0.01 |
| 57 | 600521 | 华海药业 | 43,700 | 616,170.00 | 0.01 |
| 58 | 000066 | 中国长城 | 59,632 | 613,016.96 | 0.01 |
| 59 | 600967 | 内蒙一机 | 54,231 | 607,387.20 | 0.01 |
| 60 | 601699 | 潞安环能 | 76,000 | 603,440.00 | 0.01 |
| 61 | 600486 | 扬农化工 | 11,000 | 601,700.00 | 0.01 |
| 62 | 603077 | 和邦生物 | 315,620 | 599,678.00 | 0.01 |
| 63 | 603501 | 韦尔股份 | 10,700 | 587,537.00 | 0.01 |
| 64 | 600143 | 金发科技 | 119,661 | 586,338.90 | 0.01 |
| 65 | 600435 | 北方导航 | 65,198 | 586,130.02 | 0.01 |
| 66 | 600258 | 首旅酒店 | 32,481 | 584,008.38 | 0.01 |
| 67 | 603000 | 人 民 网 | 32,700 | 583,041.00 | 0.01 |
| 68 | 600064 | 南京高科 | 54,394 | 582,559.74 | 0.01 |
| 69 | 600079 | 人福医药 | 54,680 | 574,140.00 | 0.01 |
| 70 | 600779 | 水 井 坊 | 11,248 | 571,623.36 | 0.01 |
| 71 | 600282 | 南钢股份 | 163,300 | 571,550.00 | 0.01 |
| 72 | 600737 | 中粮糖业 | 65,317 | 566,951.56 | 0.01 |
| 73 | 600021 | 上海电力 | 65,289 | 566,708.52 | 0.01 |
| 74 | 600026 | 中远海能 | 86,800 | 563,332.00 | 0.00 |
| 75 | 600037 | 歌华有线 | 54,800 | 561,700.00 | 0.00 |
| 76 | 601118 | 海南橡胶 | 108,600 | 559,290.00 | 0.00 |
| 77 | 000401 | 冀东水泥 | 31,731 | 558,782.91 | 0.00 |
| 78 | 600141 | 兴发集团 | 54,200 | 557,176.00 | 0.00 |
| 79 | 002463 | 沪电股份 | 40,800 | 555,696.00 | 0.00 |
| 80 | 601966 | 玲珑轮胎 | 32,466 | 551,922.00 | 0.00 |
| 81 | 601098 | 中南传媒 | 43,536 | 550,295.04 | 0.00 |
| 82 | 002129 | 中环股份 | 56,300 | 549,488.00 | 0.00 |
| 83 | 600863 | 内蒙华电 | 174,400 | 547,616.00 | 0.00 |
| 84 | 300253 | 卫宁健康 | 38,572 | 546,950.96 | 0.00 |
| 85 | 600373 | 中文传媒 | 43,540 | 546,862.40 | 0.00 |
| 86 | 600466 | 蓝光发展 | 87,465 | 544,032.30 | 0.00 |
| 87 | 600388 | 龙净环保 | 43,700 | 541,443.00 | 0.00 |
| 88 | 002195 | 二三四五 | 138,658 | 539,379.62 | 0.00 |
| 89 | 600885 | 宏发股份 | 22,125 | 537,637.50 | 0.00 |
| 90 | 600171 | 上海贝岭 | 32,800 | 533,000.00 | 0.00 |
| 91 | 600266 | 北京城建 | 65,543 | 528,276.58 | 0.00 |
| 92 | 600643 | 爱建集团 | 54,840 | 525,367.20 | 0.00 |
| 93 | 601231 | 环旭电子 | 43,377 | 522,692.85 | 0.00 |
| 94 | 300383 | 光环新网 | 31,140 | 522,217.80 | 0.00 |
| 95 | 002465 | 海格通信 | 54,600 | 520,884.00 | 0.00 |
| 96 | 601106 | 中国一重 | 163,600 | 513,704.00 | 0.00 |
| 97 | 000623 | 吉林敖东 | 31,300 | 513,007.00 | 0.00 |
| 98 | 601718 | 际华集团 | 130,900 | 511,819.00 | 0.00 |
| 99 | 300450 | 先导智能 | 15,200 | 510,720.00 | 0.00 |
| 100 | 601000 | 唐 山 港 | 184,819 | 508,252.25 | 0.00 |
| 101 | 603659 | 璞 泰 来 | 10,702 | 503,208.04 | 0.00 |
| 102 | 000750 | 国海证券 | 99,500 | 500,485.00 | 0.00 |
| 103 | 600008 | 首创股份 | 141,400 | 497,728.00 | 0.00 |
| 104 | 600511 | 国药股份 | 21,568 | 495,416.96 | 0.00 |
| 105 | 002223 | 鱼跃医疗 | 20,116 | 495,255.92 | 0.00 |
| 106 | 600649 | 城投控股 | 76,400 | 494,308.00 | 0.00 |
| 107 | 002507 | 涪陵榨菜 | 16,200 | 494,100.00 | 0.00 |
| 108 | 600782 | 新钢股份 | 98,000 | 490,000.00 | 0.00 |
| 109 | 002439 | 启明星辰 | 18,168 | 488,719.20 | 0.00 |
| 110 | 600500 | 中化国际 | 65,162 | 486,760.14 | 0.00 |
| 111 | 002268 | 卫 士 通 | 19,894 | 486,408.30 | 0.00 |
| 112 | 600515 | 海航基础 | 97,800 | 484,110.00 | 0.00 |
| 113 | 603233 | 大 参 林 | 10,653 | 479,385.00 | 0.00 |
| 114 | 600039 | 四川路桥 | 130,840 | 476,257.60 | 0.00 |
| 115 | 600380 | 健 康 元 | 54,813 | 474,132.45 | 0.00 |
| 116 | 002127 | 南极电商 | 42,150 | 473,766.00 | 0.00 |
| 117 | 601608 | 中信重工 | 108,700 | 469,584.00 | 0.00 |
| 118 | 600598 | 北 大 荒 | 43,600 | 467,828.00 | 0.00 |
| 119 | 002340 | 格 林 美 | 99,294 | 467,674.74 | 0.00 |
| 120 | 002506 | 协鑫集成 | 70,000 | 467,600.00 | 0.00 |
| 121 | 002385 | 大 北 农 | 88,000 | 465,520.00 | 0.00 |
| 122 | 002500 | 山西证券 | 57,200 | 463,320.00 | 0.00 |
| 123 | 600458 | 时代新材 | 44,329 | 460,578.31 | 0.00 |
| 124 | 600167 | 联美控股 | 43,422 | 459,404.76 | 0.00 |
| 125 | 600648 | 外 高 桥 | 21,800 | 457,364.00 | 0.00 |
| 126 | 000975 | 银泰资源 | 34,460 | 454,527.40 | 0.00 |
| 127 | 600748 | 上实发展 | 54,600 | 452,634.00 | 0.00 |
| 128 | 603866 | 桃李面包 | 10,811 | 450,278.15 | 0.00 |
| 129 | 600216 | 浙江医药 | 43,494 | 445,378.56 | 0.00 |
| 130 | 600563 | 法拉电子 | 10,801 | 444,677.17 | 0.00 |
| 131 | 601179 | 中国西电 | 120,100 | 444,370.00 | 0.00 |
| 132 | 601678 | 滨化股份 | 65,446 | 442,414.96 | 0.00 |
| 133 | 600348 | 阳泉煤业 | 76,100 | 442,141.00 | 0.00 |
| 134 | 600056 | 中国医药 | 32,768 | 442,040.32 | 0.00 |
| 135 | 603228 | 景旺电子 | 11,008 | 440,430.08 | 0.00 |
| 136 | 601200 | 上海环境 | 32,338 | 440,120.18 | 0.00 |
| 137 | 600259 | 广晟有色 | 10,900 | 439,270.00 | 0.00 |
| 138 | 600155 | 华创阳安 | 32,600 | 437,818.00 | 0.00 |
| 139 | 603517 | 绝味食品 | 11,180 | 435,013.80 | 0.00 |
| 140 | 000723 | 美锦能源 | 41,500 | 433,675.00 | 0.00 |
| 141 | 600409 | 三友化工 | 76,271 | 431,693.86 | 0.00 |
| 142 | 000998 | 隆平高科 | 29,800 | 431,504.00 | 0.00 |
| 143 | 600827 | 百联股份 | 43,886 | 430,521.66 | 0.00 |
| 144 | 600777 | 新潮能源 | 206,900 | 430,352.00 | 0.00 |
| 145 | 002299 | 圣农发展 | 16,970 | 429,680.40 | 0.00 |
| 146 | 002371 | 北方华创 | 6,200 | 429,350.00 | 0.00 |
| 147 | 603885 | 吉祥航空 | 32,700 | 428,370.00 | 0.00 |
| 148 | 600507 | 方大特钢 | 43,560 | 426,016.80 | 0.00 |
| 149 | 002373 | 千方科技 | 24,800 | 424,080.00 | 0.00 |
| 150 | 600277 | 亿利洁能 | 86,900 | 423,203.00 | 0.00 |
| 151 | 000778 | 新兴铸管 | 94,700 | 420,468.00 | 0.00 |
| 152 | 600970 | 中材国际 | 65,254 | 419,583.22 | 0.00 |
| 153 | 000686 | 东北证券 | 47,500 | 418,475.00 | 0.00 |
| 154 | 600717 | 天 津 港 | 65,126 | 418,108.92 | 0.00 |
| 155 | 600120 | 浙江东方 | 32,818 | 418,101.32 | 0.00 |
| 156 | 600138 | 中 青 旅 | 32,883 | 417,285.27 | 0.00 |
| 157 | 600312 | 平高电气 | 54,232 | 417,044.08 | 0.00 |
| 158 | 600845 | 宝信软件 | 14,560 | 414,668.80 | 0.00 |
| 159 | 603868 | 飞科电器 | 10,581 | 414,246.15 | 0.00 |
| 160 | 000009 | 中国宝安 | 72,541 | 414,209.11 | 0.00 |
| 161 | 600525 | 长园集团 | 65,286 | 412,607.52 | 0.00 |
| 162 | 600062 | 华润双鹤 | 32,611 | 411,224.71 | 0.00 |
| 163 | 600633 | 浙数文化 | 43,881 | 410,287.35 | 0.00 |
| 164 | 000997 | 新 大 陆 | 23,940 | 404,346.60 | 0.00 |
| 165 | 600823 | 世茂股份 | 87,400 | 402,914.00 | 0.00 |
| 166 | 002092 | 中泰化学 | 50,600 | 402,776.00 | 0.00 |
| 167 | 600073 | 上海梅林 | 43,400 | 399,280.00 | 0.00 |
| 168 | 601869 | 长飞光纤 | 10,600 | 397,500.00 | 0.00 |
| 169 | 002384 | 东山精密 | 27,250 | 397,032.50 | 0.00 |
| 170 | 000060 | 中金岭南 | 84,600 | 396,774.00 | 0.00 |
| 171 | 600418 | 江淮汽车 | 76,568 | 395,090.88 | 0.00 |
| 172 | 601880 | 大 连 港 | 185,360 | 394,816.80 | 0.00 |
| 173 | 603806 | 福 斯 特 | 10,683 | 392,386.59 | 0.00 |
| 174 | 000039 | 中集集团 | 36,000 | 384,480.00 | 0.00 |
| 175 | 000999 | 华润三九 | 13,075 | 383,620.50 | 0.00 |
| 176 | 600993 | 马 应 龙 | 21,613 | 381,469.45 | 0.00 |
| 177 | 000960 | 锡业股份 | 34,100 | 380,897.00 | 0.00 |
| 178 | 600179 | ST 安 通 | 129,860 | 380,489.80 | 0.00 |
| 179 | 000690 | 宝新能源 | 59,000 | 379,960.00 | 0.00 |
| 180 | 002916 | 深南电路 | 3,720 | 379,142.40 | 0.00 |
| 181 | 002353 | 杰瑞股份 | 16,400 | 378,840.00 | 0.00 |
| 182 | 000830 | 鲁西化工 | 34,810 | 378,732.80 | 0.00 |
| 183 | 600060 | 海信电器 | 43,900 | 378,418.00 | 0.00 |
| 184 | 600759 | 洲际油气 | 98,000 | 378,280.00 | 0.00 |
| 185 | 002191 | 劲嘉股份 | 30,300 | 376,023.00 | 0.00 |
| 186 | 600338 | 西藏珠峰 | 21,480 | 375,470.40 | 0.00 |
| 187 | 600645 | 中源协和 | 21,659 | 374,917.29 | 0.00 |
| 188 | 002372 | 伟星新材 | 21,480 | 373,752.00 | 0.00 |
| 189 | 601717 | 郑 煤 机 | 65,192 | 372,246.32 | 0.00 |
| 190 | 000729 | 燕京啤酒 | 55,600 | 369,184.00 | 0.00 |
| 191 | 600580 | 卧龙电驱 | 43,811 | 368,450.51 | 0.00 |
| 192 | 601958 | 金钼股份 | 54,800 | 367,160.00 | 0.00 |
| 193 | 600478 | 科 力 远 | 65,600 | 366,704.00 | 0.00 |
| 194 | 600006 | 东风汽车 | 68,700 | 366,171.00 | 0.00 |
| 195 | 600307 | 酒钢宏兴 | 179,500 | 364,385.00 | 0.00 |
| 196 | 000581 | 威孚高科 | 19,600 | 363,776.00 | 0.00 |
| 197 | 600968 | 海油发展 | 102,375 | 363,431.25 | 0.00 |
| 198 | 600664 | 哈药股份 | 87,400 | 361,836.00 | 0.00 |
| 199 | 600835 | 上海机电 | 21,722 | 360,585.20 | 0.00 |
| 200 | 002078 | 太阳纸业 | 52,800 | 359,568.00 | 0.00 |
| 201 | 600597 | 光明乳业 | 33,022 | 354,986.50 | 0.00 |
| 202 | 601928 | 凤凰传媒 | 43,816 | 353,595.12 | 0.00 |
| 203 | 601100 | 恒立液压 | 11,265 | 353,495.70 | 0.00 |
| 204 | 000547 | 航天发展 | 36,961 | 353,347.16 | 0.00 |
| 205 | 600125 | 铁龙物流 | 54,500 | 351,525.00 | 0.00 |
| 206 | 600575 | 皖江物流 | 119,700 | 350,721.00 | 0.00 |
| 207 | 603816 | 顾家家居 | 10,980 | 350,481.60 | 0.00 |
| 208 | 603515 | 欧普照明 | 10,865 | 350,396.25 | 0.00 |
| 209 | 600884 | 杉杉股份 | 32,900 | 350,385.00 | 0.00 |
| 210 | 300168 | 万达信息 | 26,800 | 347,596.00 | 0.00 |
| 211 | 600751 | 海航科技 | 108,900 | 346,302.00 | 0.00 |
| 212 | 002281 | 光迅科技 | 13,000 | 344,240.00 | 0.00 |
| 213 | 600017 | 日 照 港 | 109,100 | 343,665.00 | 0.00 |
| 214 | 601611 | 中国核建 | 43,800 | 340,764.00 | 0.00 |
| 215 | 600582 | 天地科技 | 98,234 | 338,907.30 | 0.00 |
| 216 | 600729 | 重庆百货 | 11,177 | 337,992.48 | 0.00 |
| 217 | 600151 | 航天机电 | 65,100 | 335,265.00 | 0.00 |
| 218 | 600499 | 科达洁能 | 76,347 | 334,399.86 | 0.00 |
| 219 | 600859 | 王 府 井 | 21,990 | 334,028.10 | 0.00 |
| 220 | 002221 | 东华能源 | 38,700 | 333,207.00 | 0.00 |
| 221 | 000559 | 万向钱潮 | 55,600 | 332,488.00 | 0.00 |
| 222 | 600901 | 江苏租赁 | 54,500 | 331,905.00 | 0.00 |
| 223 | 600317 | 营 口 港 | 119,700 | 330,372.00 | 0.00 |
| 224 | 601689 | 拓普集团 | 21,520 | 329,686.40 | 0.00 |
| 225 | 000970 | 中科三环 | 29,000 | 329,150.00 | 0.00 |
| 226 | 000988 | 华工科技 | 20,800 | 329,056.00 | 0.00 |
| 227 | 600291 | 西水股份 | 32,663 | 328,589.78 | 0.00 |
| 228 | 002670 | 国盛金控 | 26,063 | 328,393.80 | 0.00 |
| 229 | 600267 | 海正药业 | 32,805 | 328,050.00 | 0.00 |
| 230 | 600557 | 康缘药业 | 22,022 | 327,246.92 | 0.00 |
| 231 | 000513 | 丽珠集团 | 9,809 | 325,953.07 | 0.00 |
| 232 | 600565 | 迪马股份 | 87,300 | 325,629.00 | 0.00 |
| 233 | 300027 | 华谊兄弟 | 66,200 | 325,042.00 | 0.00 |
| 234 | 300274 | 阳光电源 | 34,660 | 324,071.00 | 0.00 |
| 235 | 002038 | 双鹭药业 | 13,750 | 323,950.00 | 0.00 |
| 236 | 300315 | 掌趣科技 | 93,000 | 320,850.00 | 0.00 |
| 237 | 603486 | 科 沃 斯 | 10,558 | 319,379.50 | 0.00 |
| 238 | 300001 | 特 锐 德 | 17,688 | 318,737.76 | 0.00 |
| 239 | 601326 | 秦港股份 | 87,100 | 316,173.00 | 0.00 |
| 240 | 600316 | 洪都航空 | 22,085 | 316,036.35 | 0.00 |
| 241 | 300088 | 长信科技 | 61,900 | 313,214.00 | 0.00 |
| 242 | 600787 | 中储股份 | 54,482 | 312,181.86 | 0.00 |
| 243 | 002690 | 美亚光电 | 9,500 | 309,700.00 | 0.00 |
| 244 | 000089 | 深圳机场 | 34,800 | 309,372.00 | 0.00 |
| 245 | 600908 | 无锡银行 | 54,600 | 307,944.00 | 0.00 |
| 246 | 600329 | 中新药业 | 21,518 | 307,492.22 | 0.00 |
| 247 | 000878 | 云南铜业 | 28,900 | 307,207.00 | 0.00 |
| 248 | 300166 | 东方国信 | 24,899 | 306,008.71 | 0.00 |
| 249 | 002174 | 游族网络 | 18,100 | 305,528.00 | 0.00 |
| 250 | 600611 | 大众交通 | 65,454 | 304,361.10 | 0.00 |
| 251 | 002074 | 国轩高科 | 23,200 | 304,152.00 | 0.00 |
| 252 | 002110 | 三钢闽光 | 32,700 | 304,110.00 | 0.00 |
| 253 | 603056 | 德邦股份 | 21,500 | 302,720.00 | 0.00 |
| 254 | 600393 | 粤泰股份 | 65,101 | 302,719.65 | 0.00 |
| 255 | 600765 | 中航重机 | 32,722 | 302,024.06 | 0.00 |
| 256 | 600694 | 大商股份 | 10,768 | 300,534.88 | 0.00 |
| 257 | 002019 | 亿帆医药 | 24,500 | 300,125.00 | 0.00 |
| 258 | 600195 | 中牧股份 | 21,600 | 299,160.00 | 0.00 |
| 259 | 000563 | 陕国投Ａ | 66,970 | 297,346.80 | 0.00 |
| 260 | 600862 | 中航高科 | 32,800 | 294,872.00 | 0.00 |
| 261 | 000636 | 风华高科 | 24,200 | 292,820.00 | 0.00 |
| 262 | 600770 | 综艺股份 | 43,800 | 292,584.00 | 0.00 |
| 263 | 002440 | 闰土股份 | 23,425 | 291,875.50 | 0.00 |
| 264 | 600169 | 太原重工 | 108,900 | 290,763.00 | 0.00 |
| 265 | 600640 | 号百控股 | 21,720 | 290,613.60 | 0.00 |
| 266 | 002155 | 湖南黄金 | 28,600 | 288,002.00 | 0.00 |
| 267 | 600978 | 宜华生活 | 75,945 | 285,553.20 | 0.00 |
| 268 | 601127 | 小康股份 | 21,557 | 282,396.70 | 0.00 |
| 269 | 600750 | 江中药业 | 21,700 | 282,317.00 | 0.00 |
| 270 | 002152 | 广电运通 | 41,100 | 281,535.00 | 0.00 |
| 271 | 000930 | 中粮生化 | 37,400 | 281,248.00 | 0.00 |
| 272 | 000732 | 泰禾集团 | 16,900 | 278,850.00 | 0.00 |
| 273 | 002273 | 水晶光电 | 24,060 | 278,614.80 | 0.00 |
| 274 | 300316 | 晶盛机电 | 21,900 | 277,911.00 | 0.00 |
| 275 | 002250 | 联化科技 | 24,927 | 276,440.43 | 0.00 |
| 276 | 600754 | 锦江股份 | 11,200 | 275,968.00 | 0.00 |
| 277 | 000598 | 兴蓉环境 | 60,600 | 275,730.00 | 0.00 |
| 278 | 002589 | 瑞康医药 | 36,280 | 275,365.20 | 0.00 |
| 279 | 603766 | 隆鑫通用 | 65,218 | 273,263.42 | 0.00 |
| 280 | 000932 | 华菱钢铁 | 56,920 | 271,508.40 | 0.00 |
| 281 | 000681 | 视觉中国 | 14,000 | 271,320.00 | 0.00 |
| 282 | 002002 | 鸿达兴业 | 43,600 | 269,884.00 | 0.00 |
| 283 | 002131 | 利欧股份 | 140,977 | 269,266.07 | 0.00 |
| 284 | 002399 | 海 普 瑞 | 12,600 | 264,474.00 | 0.00 |
| 285 | 601016 | 节能风电 | 98,213 | 261,246.58 | 0.00 |
| 286 | 600416 | 湘电股份 | 43,341 | 260,912.82 | 0.00 |
| 287 | 002583 | 海 能 达 | 31,000 | 260,090.00 | 0.00 |
| 288 | 000758 | 中色股份 | 46,900 | 257,481.00 | 0.00 |
| 289 | 000031 | 大 悦 城 | 40,100 | 257,442.00 | 0.00 |
| 290 | 601019 | 山东出版 | 33,006 | 256,786.68 | 0.00 |
| 291 | 002368 | 太极股份 | 8,462 | 256,398.60 | 0.00 |
| 292 | 000685 | 中山公用 | 29,940 | 255,687.60 | 0.00 |
| 293 | 300113 | 顺网科技 | 16,300 | 255,584.00 | 0.00 |
| 294 | 002266 | 浙富控股 | 53,600 | 254,600.00 | 0.00 |
| 295 | 000738 | 航发控制 | 18,800 | 251,920.00 | 0.00 |
| 296 | 600053 | 九鼎投资 | 10,791 | 251,430.30 | 0.00 |
| 297 | 600623 | 华谊集团 | 32,815 | 250,706.60 | 0.00 |
| 298 | 000027 | 深圳能源 | 40,400 | 250,480.00 | 0.00 |
| 299 | 000877 | 天山股份 | 21,500 | 249,830.00 | 0.00 |
| 300 | 000807 | 云铝股份 | 53,100 | 249,039.00 | 0.00 |
| 301 | 000008 | 神州高铁 | 66,028 | 248,925.56 | 0.00 |
| 302 | 300418 | 昆仑万维 | 19,300 | 248,391.00 | 0.00 |
| 303 | 601001 | 大同煤业 | 54,200 | 247,694.00 | 0.00 |
| 304 | 600869 | 智慧能源 | 54,504 | 246,358.08 | 0.00 |
| 305 | 002414 | 高德红外 | 12,616 | 242,227.20 | 0.00 |
| 306 | 000488 | 晨鸣纸业 | 45,019 | 241,301.84 | 0.00 |
| 307 | 601311 | 骆驼股份 | 22,100 | 239,785.00 | 0.00 |
| 308 | 002183 | 怡 亚 通 | 50,100 | 238,977.00 | 0.00 |
| 309 | 000887 | 中鼎股份 | 24,700 | 236,873.00 | 0.00 |
| 310 | 002004 | 华邦健康 | 48,700 | 236,682.00 | 0.00 |
| 311 | 603568 | 伟明环保 | 10,987 | 236,440.24 | 0.00 |
| 312 | 603712 | 七 一 二 | 11,100 | 235,653.00 | 0.00 |
| 313 | 300182 | 捷成股份 | 53,100 | 234,171.00 | 0.00 |
| 314 | 002064 | 华峰氨纶 | 46,500 | 233,430.00 | 0.00 |
| 315 | 002408 | 齐翔腾达 | 30,120 | 233,430.00 | 0.00 |
| 316 | 600545 | 卓郎智能 | 32,791 | 233,144.01 | 0.00 |
| 317 | 601615 | 明阳智能 | 21,500 | 233,060.00 | 0.00 |
| 318 | 600996 | 贵广网络 | 21,600 | 232,848.00 | 0.00 |
| 319 | 002603 | 以岭药业 | 20,100 | 232,758.00 | 0.00 |
| 320 | 000528 | 柳 工 | 34,911 | 232,507.26 | 0.00 |
| 321 | 000813 | 德展健康 | 30,300 | 230,886.00 | 0.00 |
| 322 | 603650 | 彤程新材 | 10,500 | 229,320.00 | 0.00 |
| 323 | 600158 | 中体产业 | 22,300 | 228,129.00 | 0.00 |
| 324 | 603355 | 莱克电气 | 10,578 | 227,638.56 | 0.00 |
| 325 | 002407 | 多 氟 多 | 18,950 | 224,368.00 | 0.00 |
| 326 | 600657 | 信达地产 | 54,400 | 224,128.00 | 0.00 |
| 327 | 600757 | 长江传媒 | 32,889 | 223,974.09 | 0.00 |
| 328 | 300115 | 长盈精密 | 21,290 | 223,332.10 | 0.00 |
| 329 | 300010 | 立 思 辰 | 23,665 | 222,214.35 | 0.00 |
| 330 | 000028 | 国药一致 | 5,311 | 222,159.13 | 0.00 |
| 331 | 603328 | 依顿电子 | 21,622 | 222,057.94 | 0.00 |
| 332 | 000727 | 华东科技 | 105,800 | 221,122.00 | 0.00 |
| 333 | 002176 | 江特电机 | 45,305 | 220,635.35 | 0.00 |
| 334 | 603888 | 新 华 网 | 11,050 | 220,558.00 | 0.00 |
| 335 | 002244 | 滨江集团 | 52,800 | 219,120.00 | 0.00 |
| 336 | 002242 | 九阳股份 | 10,500 | 218,505.00 | 0.00 |
| 337 | 600707 | 彩虹股份 | 43,600 | 218,436.00 | 0.00 |
| 338 | 002212 | 南洋股份 | 15,700 | 215,090.00 | 0.00 |
| 339 | 002051 | 中工国际 | 18,622 | 213,594.34 | 0.00 |
| 340 | 002056 | 横店东磁 | 28,000 | 212,800.00 | 0.00 |
| 341 | 000156 | 华数传媒 | 19,300 | 212,493.00 | 0.00 |
| 342 | 300002 | 神州泰岳 | 53,200 | 211,736.00 | 0.00 |
| 343 | 300026 | 红日药业 | 61,100 | 210,795.00 | 0.00 |
| 344 | 002505 | 大康农业 | 106,700 | 210,199.00 | 0.00 |
| 345 | 600350 | 山东高速 | 43,408 | 208,358.40 | 0.00 |
| 346 | 002491 | 通鼎互联 | 25,406 | 205,534.54 | 0.00 |
| 347 | 002470 | 金 正 大 | 55,600 | 202,384.00 | 0.00 |
| 348 | 600098 | 广州发展 | 32,800 | 202,048.00 | 0.00 |
| 349 | 000021 | 深 科 技 | 24,800 | 201,624.00 | 0.00 |
| 350 | 600428 | 中远海特 | 54,360 | 201,132.00 | 0.00 |
| 351 | 002030 | 达安基因 | 18,716 | 200,822.68 | 0.00 |
| 352 | 300058 | 蓝色光标 | 47,000 | 200,690.00 | 0.00 |
| 353 | 002831 | 裕同科技 | 10,466 | 200,633.22 | 0.00 |
| 354 | 603198 | 迎驾贡酒 | 11,200 | 200,592.00 | 0.00 |
| 355 | 300134 | 大富科技 | 12,900 | 200,337.00 | 0.00 |
| 356 | 601801 | 皖新传媒 | 32,909 | 197,783.09 | 0.00 |
| 357 | 000012 | 南 玻Ａ | 47,465 | 197,454.40 | 0.00 |
| 358 | 600971 | 恒源煤电 | 32,874 | 192,312.90 | 0.00 |
| 359 | 002128 | 露天煤业 | 22,200 | 192,030.00 | 0.00 |
| 360 | 000712 | 锦龙股份 | 14,900 | 191,316.00 | 0.00 |
| 361 | 002358 | 森源电气 | 18,758 | 190,393.70 | 0.00 |
| 362 | 002701 | 奥 瑞 金 | 40,700 | 190,069.00 | 0.00 |
| 363 | 002317 | 众生药业 | 22,200 | 188,922.00 | 0.00 |
| 364 | 002444 | 巨星科技 | 18,918 | 188,801.64 | 0.00 |
| 365 | 601003 | 柳钢股份 | 32,600 | 188,754.00 | 0.00 |
| 366 | 000078 | 海王生物 | 53,807 | 187,248.36 | 0.00 |
| 367 | 002285 | 世 联 行 | 41,500 | 187,165.00 | 0.00 |
| 368 | 600058 | 五矿发展 | 22,111 | 186,837.95 | 0.00 |
| 369 | 601139 | 深圳燃气 | 32,800 | 186,632.00 | 0.00 |
| 370 | 601777 | 力帆股份 | 43,362 | 186,022.98 | 0.00 |
| 371 | 300324 | 旋极信息 | 32,068 | 185,673.72 | 0.00 |
| 372 | 600874 | 创业环保 | 22,100 | 183,209.00 | 0.00 |
| 373 | 000519 | 中兵红箭 | 23,700 | 183,201.00 | 0.00 |
| 374 | 002093 | 国脉科技 | 19,700 | 183,013.00 | 0.00 |
| 375 | 000400 | 许继电气 | 20,200 | 183,012.00 | 0.00 |
| 376 | 300244 | 迪安诊断 | 10,777 | 182,993.46 | 0.00 |
| 377 | 000717 | 韶钢松山 | 41,000 | 181,630.00 | 0.00 |
| 378 | 002426 | 胜利精密 | 70,700 | 180,992.00 | 0.00 |
| 379 | 600639 | 浦东金桥 | 11,185 | 180,861.45 | 0.00 |
| 380 | 002672 | 东江环保 | 15,750 | 178,605.00 | 0.00 |
| 381 | 000926 | 福星股份 | 25,800 | 178,536.00 | 0.00 |
| 382 | 002573 | 清新环境 | 22,108 | 177,969.40 | 0.00 |
| 383 | 002640 | 跨 境 通 | 21,300 | 177,429.00 | 0.00 |
| 384 | 000718 | 苏宁环球 | 51,000 | 176,460.00 | 0.00 |
| 385 | 002249 | 大洋电机 | 40,300 | 174,902.00 | 0.00 |
| 386 | 000006 | 深振业Ａ | 31,800 | 173,310.00 | 0.00 |
| 387 | 002839 | 张家港行 | 30,500 | 171,715.00 | 0.00 |
| 388 | 000543 | 皖能电力 | 36,320 | 171,067.20 | 0.00 |
| 389 | 300133 | 华策影视 | 25,300 | 170,269.00 | 0.00 |
| 390 | 603377 | 东方时尚 | 11,120 | 169,913.60 | 0.00 |
| 391 | 002028 | 思源电气 | 17,018 | 169,499.28 | 0.00 |
| 392 | 300197 | 铁汉生态 | 47,150 | 169,268.50 | 0.00 |
| 393 | 002807 | 江阴银行 | 35,880 | 167,918.40 | 0.00 |
| 394 | 300055 | 万 邦 达 | 23,500 | 167,555.00 | 0.00 |
| 395 | 002280 | 联络互动 | 45,200 | 165,432.00 | 0.00 |
| 396 | 002366 | 台海核电 | 17,600 | 164,736.00 | 0.00 |
| 397 | 000848 | 承德露露 | 19,660 | 163,767.80 | 0.00 |
| 398 | 603877 | 太 平 鸟 | 10,448 | 162,152.96 | 0.00 |
| 399 | 000600 | 建投能源 | 24,200 | 162,140.00 | 0.00 |
| 400 | 000090 | 天健集团 | 32,556 | 160,826.64 | 0.00 |
| 401 | 600939 | 重庆建工 | 32,700 | 159,903.00 | 0.00 |
| 402 | 002431 | 棕榈股份 | 40,350 | 159,382.50 | 0.00 |
| 403 | 000564 | 供销大集 | 60,900 | 158,949.00 | 0.00 |
| 404 | 300308 | 中际旭创 | 4,660 | 158,393.40 | 0.00 |
| 405 | 002233 | 塔牌集团 | 13,300 | 155,344.00 | 0.00 |
| 406 | 300376 | 易 事 特 | 31,300 | 154,309.00 | 0.00 |
| 407 | 600335 | 国机汽车 | 22,100 | 152,932.00 | 0.00 |
| 408 | 002390 | 信邦制药 | 29,000 | 152,830.00 | 0.00 |
| 409 | 300287 | 飞 利 信 | 38,482 | 152,773.54 | 0.00 |
| 410 | 000158 | 常山北明 | 27,960 | 151,543.20 | 0.00 |
| 411 | 603556 | 海兴电力 | 10,950 | 151,329.00 | 0.00 |
| 412 | 002745 | 木 林 森 | 12,900 | 151,188.00 | 0.00 |
| 413 | 300159 | 新研股份 | 30,300 | 150,894.00 | 0.00 |
| 414 | 002544 | 杰赛科技 | 11,600 | 150,800.00 | 0.00 |
| 415 | 002254 | 泰和新材 | 14,200 | 150,236.00 | 0.00 |
| 416 | 002302 | 西部建设 | 13,400 | 149,276.00 | 0.00 |
| 417 | 601068 | 中铝国际 | 21,600 | 149,040.00 | 0.00 |
| 418 | 600126 | 杭钢股份 | 32,610 | 148,701.60 | 0.00 |
| 419 | 002665 | 首航节能 | 43,600 | 147,804.00 | 0.00 |
| 420 | 002332 | 仙琚制药 | 21,850 | 147,706.00 | 0.00 |
| 421 | 300199 | 翰宇药业 | 16,000 | 146,720.00 | 0.00 |
| 422 | 002424 | 贵州百灵 | 14,700 | 145,236.00 | 0.00 |
| 423 | 600903 | 贵州燃气 | 11,100 | 144,633.00 | 0.00 |
| 424 | 000062 | 深圳华强 | 10,848 | 144,169.92 | 0.00 |
| 425 | 300459 | 金科文化 | 25,300 | 143,957.00 | 0.00 |
| 426 | 300266 | 兴源环境 | 31,642 | 143,654.68 | 0.00 |
| 427 | 002709 | 天赐材料 | 5,800 | 140,360.00 | 0.00 |
| 428 | 000501 | 鄂武商Ａ | 12,930 | 138,997.50 | 0.00 |
| 429 | 000937 | 冀中能源 | 35,900 | 138,574.00 | 0.00 |
| 430 | 002635 | 安洁科技 | 10,150 | 136,923.50 | 0.00 |
| 431 | 002048 | 宁波华翔 | 12,600 | 136,332.00 | 0.00 |
| 432 | 000990 | 诚志股份 | 8,300 | 136,203.00 | 0.00 |
| 433 | 603225 | 新 凤 鸣 | 10,884 | 135,941.16 | 0.00 |
| 434 | 000426 | 兴业矿业 | 25,300 | 135,861.00 | 0.00 |
| 435 | 002118 | 紫鑫药业 | 20,106 | 135,514.44 | 0.00 |
| 436 | 002437 | 誉衡药业 | 34,300 | 135,485.00 | 0.00 |
| 437 | 002375 | 亚厦股份 | 22,800 | 134,748.00 | 0.00 |
| 438 | 002517 | 恺英网络 | 41,900 | 133,661.00 | 0.00 |
| 439 | 601811 | 新华文轩 | 10,800 | 131,868.00 | 0.00 |
| 440 | 000537 | 广宇发展 | 18,800 | 130,096.00 | 0.00 |
| 441 | 601969 | 海南矿业 | 22,000 | 129,360.00 | 0.00 |
| 442 | 300257 | 开山股份 | 11,600 | 128,528.00 | 0.00 |
| 443 | 002815 | 崇达技术 | 8,200 | 127,838.00 | 0.00 |
| 444 | 000061 | 农 产 品 | 23,100 | 125,202.00 | 0.00 |
| 445 | 600985 | 淮北矿业 | 11,000 | 124,740.00 | 0.00 |
| 446 | 002434 | 万 里 扬 | 18,200 | 123,578.00 | 0.00 |
| 447 | 002489 | 浙江永强 | 36,650 | 122,411.00 | 0.00 |
| 448 | 300297 | 蓝盾股份 | 20,300 | 122,409.00 | 0.00 |
| 449 | 603569 | 长久物流 | 10,500 | 121,695.00 | 0.00 |
| 450 | 002503 | 搜 于 特 | 43,000 | 118,250.00 | 0.00 |
| 451 | 000536 | 华映科技 | 46,900 | 118,188.00 | 0.00 |
| 452 | 600280 | 中央商场 | 32,900 | 118,111.00 | 0.00 |
| 453 | 000980 | 众泰汽车 | 27,600 | 116,196.00 | 0.00 |
| 454 | 000541 | 佛山照明 | 22,130 | 115,961.20 | 0.00 |
| 455 | 000766 | 通化金马 | 16,100 | 109,480.00 | 0.00 |
| 456 | 603025 | 大豪科技 | 10,683 | 109,393.92 | 0.00 |
| 457 | 000587 | 金洲慈航 | 41,400 | 106,812.00 | 0.00 |
| 458 | 002509 | 天广中茂 | 51,500 | 106,090.00 | 0.00 |
| 459 | 002707 | 众信旅游 | 17,349 | 105,308.43 | 0.00 |
| 460 | 000552 | 靖远煤电 | 38,400 | 104,064.00 | 0.00 |
| 461 | 002344 | 海宁皮城 | 22,000 | 102,520.00 | 0.00 |
| 462 | 000829 | 天音控股 | 17,600 | 102,432.00 | 0.00 |
| 463 | 002512 | 达华智能 | 22,400 | 101,248.00 | 0.00 |
| 464 | 002482 | 广田集团 | 20,527 | 99,761.22 | 0.00 |
| 465 | 002818 | 富 森 美 | 7,677 | 98,495.91 | 0.00 |
| 466 | 002251 | 步 步 高 | 11,759 | 93,719.23 | 0.00 |
| 467 | 002681 | 奋达科技 | 21,871 | 92,733.04 | 0.00 |
| 468 | 002920 | 德赛西威 | 4,000 | 89,600.00 | 0.00 |
| 469 | 000987 | 越秀金控 | 9,700 | 87,494.00 | 0.00 |
| 470 | 002405 | 四维图新 | 5,400 | 86,940.00 | 0.00 |
| 471 | 300782 | 卓 胜 微 | 743 | 80,927.56 | 0.00 |
| 472 | 002416 | 爱 施 德 | 12,470 | 77,937.50 | 0.00 |
| 473 | 600917 | 重庆燃气 | 11,000 | 76,560.00 | 0.00 |
| 474 | 000025 | 特 力Ａ | 3,646 | 73,722.12 | 0.00 |
| 475 | 002699 | 美盛文化 | 12,280 | 73,680.00 | 0.00 |
| 476 | 002157 | 正邦科技 | 4,200 | 69,972.00 | 0.00 |
| 477 | 002821 | 凯 莱 英 | 600 | 58,848.00 | 0.00 |
| 478 | 000761 | 本钢板材 | 12,900 | 55,470.00 | 0.00 |
| 479 | 002075 | 沙钢股份 | 6,000 | 47,040.00 | 0.00 |
| 480 | 002797 | 第一创业 | 7,200 | 45,648.00 | 0.00 |
| 481 | 002572 | 索 菲 亚 | 2,400 | 44,544.00 | 0.00 |
| 482 | 002926 | 华西证券 | 4,200 | 44,100.00 | 0.00 |
| 483 | 601698 | 中国卫通 | 10,103 | 39,603.76 | 0.00 |
| 484 | 002387 | 维 信 诺 | 3,000 | 39,150.00 | 0.00 |
| 485 | 300009 | 安科生物 | 2,400 | 38,160.00 | 0.00 |
| 486 | 603863 | 松炀资源 | 1,612 | 37,204.96 | 0.00 |
| 487 | 601236 | 红塔证券 | 9,789 | 33,869.94 | 0.00 |
| 488 | 002217 | 合 力 泰 | 6,000 | 33,180.00 | 0.00 |
| 489 | 002607 | 中公教育 | 2,400 | 32,952.00 | 0.00 |
| 490 | 000983 | 西山煤电 | 5,400 | 32,724.00 | 0.00 |
| 491 | 300594 | 朗进科技 | 721 | 31,803.31 | 0.00 |
| 492 | 002085 | 万丰奥威 | 4,200 | 30,576.00 | 0.00 |
| 493 | 000883 | 湖北能源 | 6,600 | 28,644.00 | 0.00 |
| 494 | 000826 | 启迪环境 | 2,400 | 28,296.00 | 0.00 |
| 495 | 002812 | 恩捷股份 | 600 | 28,050.00 | 0.00 |
| 496 | 300207 | 欣 旺 达 | 2,400 | 27,648.00 | 0.00 |
| 497 | 603867 | 新化股份 | 1,045 | 26,971.45 | 0.00 |
| 498 | 002419 | 天虹股份 | 1,800 | 23,508.00 | 0.00 |
| 499 | 300788 | 中信出版 | 1,556 | 23,106.60 | 0.00 |
| 500 | 000301 | 东方盛虹 | 4,200 | 23,058.00 | 0.00 |
| 501 | 000869 | 张 裕Ａ | 600 | 19,272.00 | 0.00 |
| 502 | 000959 | 首钢股份 | 5,400 | 19,008.00 | 0.00 |
| 503 | 002382 | 蓝帆医疗 | 1,200 | 16,584.00 | 0.00 |
| 504 | 002941 | 新疆交建 | 600 | 15,600.00 | 0.00 |
| 505 | 002948 | 青岛银行 | 1,800 | 11,574.00 | 0.00 |
| 506 | 002936 | 郑州银行 | 1,800 | 9,144.00 | 0.00 |
| 507 | 002946 | 新 乳 业 | 600 | 9,084.00 | 0.00 |
| 508 | 603444 | 吉 比 特 | 25 | 5,249.00 | 0.00 |

* 1. 报告期内股票投资组合的重大变动
     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 | 600201 | 生物股份 | 40,673,573.41 | 0.62 |
| 2 | 600426 | 华鲁恒升 | 36,871,916.10 | 0.56 |
| 3 | 600256 | 广汇能源 | 35,920,797.00 | 0.55 |
| 4 | 600872 | 中炬高新 | 35,594,534.18 | 0.54 |
| 5 | 600895 | 张江高科 | 34,577,750.20 | 0.53 |
| 6 | 600642 | 申能股份 | 31,775,159.51 | 0.49 |
| 7 | 600600 | 青岛啤酒 | 31,079,719.52 | 0.47 |
| 8 | 601005 | 重庆钢铁 | 30,963,217.83 | 0.47 |
| 9 | 600879 | 航天电子 | 30,724,579.02 | 0.47 |
| 10 | 600528 | 中铁工业 | 29,668,295.45 | 0.45 |
| 11 | 600298 | 安琪酵母 | 29,166,043.02 | 0.45 |
| 12 | 600325 | 华发股份 | 29,137,980.52 | 0.45 |
| 13 | 600673 | 东 阳 光 | 28,641,247.22 | 0.44 |
| 14 | 600820 | 隧道股份 | 28,055,891.80 | 0.43 |
| 15 | 600536 | 中国软件 | 27,990,544.47 | 0.43 |
| 16 | 600779 | 水 井 坊 | 27,639,484.99 | 0.42 |
| 17 | 600572 | 康 恩 贝 | 27,636,645.43 | 0.42 |
| 18 | 600885 | 宏发股份 | 27,195,270.49 | 0.42 |
| 19 | 600699 | 均胜电子 | 27,118,082.06 | 0.41 |
| 20 | 600875 | 东方电气 | 26,498,813.02 | 0.40 |

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。

* + 1. 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 | 600201 | 生物股份 | 22,211,709.05 | 0.34 |
| 2 | 600872 | 中炬高新 | 20,226,427.27 | 0.31 |
| 3 | 600426 | 华鲁恒升 | 19,729,756.73 | 0.30 |
| 4 | 600895 | 张江高科 | 19,206,855.58 | 0.29 |
| 5 | 600536 | 中国软件 | 18,088,086.26 | 0.28 |
| 6 | 600642 | 申能股份 | 17,535,236.09 | 0.27 |
| 7 | 600256 | 广汇能源 | 17,463,750.72 | 0.27 |
| 8 | 600879 | 航天电子 | 16,736,607.81 | 0.26 |
| 9 | 600298 | 安琪酵母 | 16,575,189.56 | 0.25 |
| 10 | 601005 | 重庆钢铁 | 16,482,137.00 | 0.25 |
| 11 | 600325 | 华发股份 | 16,071,764.32 | 0.25 |
| 12 | 600528 | 中铁工业 | 15,428,891.77 | 0.24 |
| 13 | 600572 | 康 恩 贝 | 15,379,001.83 | 0.23 |
| 14 | 600673 | 东 阳 光 | 15,374,648.22 | 0.23 |
| 15 | 600779 | 水 井 坊 | 15,241,785.40 | 0.23 |
| 16 | 600820 | 隧道股份 | 15,213,664.07 | 0.23 |
| 17 | 600183 | 生益科技 | 14,943,727.90 | 0.23 |
| 18 | 600460 | 士 兰 微 | 14,698,787.09 | 0.22 |
| 19 | 600600 | 青岛啤酒 | 14,633,846.53 | 0.22 |
| 20 | 600584 | 长电科技 | 14,392,315.10 | 0.22 |

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。

* + 1. 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 | 3,764,585,775.51 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,100,317,579.89 |

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。

* 1. 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 | 53,947,774.20 | 0.48 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 108,456,260.60 | 0.96 |
|  | 其中：政策性金融债 | 108,456,260.60 | 0.96 |
| 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） | 113,948.60 | 0.00 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 162,517,983.40 | 1.44 |

* 1. 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 | 108603 | 国开1804 | 627,810 | 62,818,668.60 | 0.56 |
| 2 | 108901 | 农发1801 | 455,920 | 45,637,592.00 | 0.40 |
| 3 | 019608 | 18国债26 | 299,430 | 29,948,988.60 | 0.26 |
| 4 | 019611 | 19国债01 | 240,180 | 23,998,785.60 | 0.21 |
| 5 | 110052 | 贵广转债 | 690 | 82,420.50 | 0.00 |

* 1. 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。

* 1. 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。

* 1. 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。

* 1. 本报告期投资基金情况
     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 | 南方中证500ETF | 股票型 | 交易型开放式 | 南方基金管理股份有限公司 | 10,606,391,439.76 | 93.84 |

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

无。

* + 1. 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

* + 1. 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

* + 1. 本期国债期货投资评价

无。

* 1. 投资组合报告附注
     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安琪酵母（证券代码600298）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8月15日安琪酵母公告，安琪酵母存在未依法履行其他职责违法违规行为，伊犁哈萨克自治州环境保护局根据《中华人民共和国大气污染物防治法》第九十九条第二项规定对公司进行公开处罚，罚款人民币60.00万元。2018年8月15日安琪酵母公告，安琪酵母存在未依法履行其他职责违法违规行为，赤峰市环境保护局根据《酵母工业水污染物排放标准》对公司进行公开处罚，罚款人民币35.00万元。2018年8月11日安琪酵母公告，安琪酵母存在未依法履行其他职责违法违规行为，崇左市安全生产监督管理局、崇左市环境保护局根据相关法律法规对公司进行公开处罚，罚款人民币44.556万元。

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。

* + 1. 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。

* + 1. 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 | 1,741,271.79 |
| 2 | 应收证券清算款 | 75,962,529.34 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,346,428.00 |
| 5 | 应收申购款 | 13,151,713.27 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | 19,341,234.35 |
| 9 | 合计 | 113,543,176.75 |

* + 1. 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。

* + 1. 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。

1. 基金份额持有人信息
   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 |
| 南方中证500ETF联接(LOF)A | 500,172 | 15,479.97 | 2,976,794,606.81 | 38.45% | 4,765,855,215.78 | 61.55% |
| 南方中证500ETF联接(LOF)C | 37,380 | 33,279.44 | 1,072,591,565.23 | 86.22% | 171,394,053.77 | 13.78% |
| 合计 | 537,552 | 16,717.70 | 4,049,386,172.04 | 45.06% | 4,937,249,269.55 | 54.94% |

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）。

* 1. 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 | 吴永强 | 2,546,021.00 | 1.94% |
| 2 | 解强 | 2,241,875.00 | 1.71% |
| 3 | 史丽君 | 1,267,382.00 | 0.97% |
| 4 | 程满富 | 999,937.00 | 0.76% |
| 5 | 何巧英 | 961,771.00 | 0.73% |
| 6 | 郭思含 | 890,391.00 | 0.68% |
| 7 | 郑林祥 | 800,000.00 | 0.61% |
| 8 | 赵秀群 | 777,626.00 | 0.59% |
| 9 | 卢志铭 | 763,557.00 | 0.58% |
| 10 | 张彩玉 | 741,441.00 | 0.56% |

* 1. 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 南方中证500ETF联接(LOF)A | 7,271,866.12 | 0.0939% |
| 南方中证500ETF联接(LOF)C | 950,892.02 | 0.0764% |
| 合计 | 8,222,758.14 | 0.0915% |

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）。

* 1. 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 | 南方中证500ETF联接(LOF)A | >100 |
| 南方中证500ETF联接(LOF)C | 0 |
| 合计 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 南方中证500ETF联接(LOF)A | 10~50 |
| 南方中证500ETF联接(LOF)C | 0 |
| 合计 | 10~50 |

1. 开放式基金份额变动

单位：份

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 南方中证500ETF联接(LOF)A | 南方中证500ETF联接(LOF)C |
| 基金合同生效日(2009年9月25日)基金份额总额 | 3,223,217,818.45 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,934,171,169.07 | 1,204,307,009.71 |
| 本报告期基金总申购份额 | 7,487,432,030.44 | 1,589,016,087.58 |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 4,678,953,376.92 | 1,549,337,478.29 |
| 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 | 7,742,649,822.59 | 1,243,985,619.00 |

1. 重大事件揭示
   1. 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

* 1. 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。

2019年1月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019年4月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

* 1. 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。

* 1. 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

* 1. 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。

* 1. 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。

* 1. 基金租用证券公司交易单元的有关情况
     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 |
| 国泰君安 | 1 | 5,818,948,339.97 | 99.28% | 581,896.53 | 99.28% | - |
| 华泰证券 | 1 | 42,383,960.09 | 0.72% | 4,238.88 | 0.72% | - |
| 申万宏源 | 2 | - | - | - | - | - |
| 英大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中天证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 日信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | 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。

* + 1. 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 |
| 国泰君安 | 54,021,946.30 | 33.17% | 1,345,600,000.00 | 27.18% | - | - | 12,937,755,395.14 | 100.00% |
| 华泰证券 | 108,856,660.96 | 66.83% | 3,606,000,000.00 | 72.82% | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 英大证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中天证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 日信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

* 1. 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 | 中国证券报 | 2019-01-03 |
| 2 | 南方基金关于旗下部分基金增加哈尔滨银行为销售机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报 | 2019-01-10 |
| 3 | 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 | 中国证券报 | 2019-01-24 |
| 4 | 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 | 中国证券报 | 2019-02-20 |
| 5 | 南方基金关于旗下部分基金增加恒泰证券为销售机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报 | 2019-02-20 |
| 6 | 南方基金关于旗下部分基金增加财达证券为销售机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报 | 2019-02-27 |
| 7 | 南方基金关于旗下部分基金增加东亚银行为销售机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报 | 2019-03-01 |
| 8 | 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 | 中国证券报 | 2019-03-21 |
| 9 | 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 | 中国证券报 | 2019-03-28 |
| 10 | 南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告 | 中国证券报 | 2019-04-01 |
| 11 | 南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报 | 2019-04-02 |
| 12 | 南方基金关于旗下部分基金增加珠海华润银行为销售机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报 | 2019-04-25 |
| 13 | 南方基金关于旗下部分基金增加中信银行为销售机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报 | 2019-04-30 |
| 14 | 南方基金关于旗下部分基金增加兴业银行为销售机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报 | 2019-05-28 |
| 15 | 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 | 中国证券报 | 2019-06-06 |
| 16 | 南方基金关于旗下部分基金增加青岛银行为销售机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报 | 2019-06-10 |
| 17 | 南方基金关于旗下部分基金增加国开证券为销售机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报 | 2019-06-14 |
| 18 | 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 | 中国证券报 | 2019-06-25 |
| 19 | 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 | 中国证券报 | 2019-06-25 |
| 20 | 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 | 中国证券报 | 2019-06-25 |
| 21 | 南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告 | 中国证券报 | 2019-06-25 |
| 22 | 南方基金关于旗下部分基金增加大智慧基金为销售机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报 | 2019-06-25 |
| 23 | 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 | 中国证券报 | 2019-06-26 |
| 24 | 南方基金关于旗下部分基金增加中原证券为销售机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报 | 2019-06-26 |
| 25 | 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 | 中国证券报 | 2019-06-27 |
| 26 | 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 | 中国证券报 | 2019-06-28 |

1. 影响投资者决策的其他重要信息
   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。

* 1. 影响投资者决策的其他重要信息

无。

1. 备查文件目录
   1. 备查文件目录

1、中国证监会批准设立南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的文件；

2、《南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》；

3、《南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)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、《南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)2019年半年度报告》原文。

* 1. 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。

* 1. 查阅方式

网站：http://www.nffund.com