**南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金2019年半年度报告**

**2019年06月30日**

**基金管理人：南方基金管理股份有限公司**

**基金托管人：中国工商银行股份有限公司**

**报告送出日期：2019年8月23日**

1. 重要提示及目录
   1. 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

* 1. 目录

[§1 重要提示及目录 1](#_Toc17121468)

[1.1 重要提示 1](#_Toc17121469)

[1.2 目录 2](#_Toc17121470)

[§2 基金简介 4](#_Toc17121471)

[2.1 基金基本情况 4](#_Toc17121472)

[2.2 基金产品说明 4](#_Toc17121473)

[2.3 基金管理人和基金托管人 5](#_Toc17121474)

[2.4 信息披露方式 6](#_Toc17121475)

[2.5 其他相关资料 6](#_Toc17121476)

[§3 主要财务指标和基金净值表现 6](#_Toc17121477)

[3.1 主要会计数据和财务指标 6](#_Toc17121478)

[3.2 基金净值表现 7](#_Toc17121479)

[§4 管理人报告 9](#_Toc17121480)

[4.1 基金管理人及基金经理情况 9](#_Toc17121481)

[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](#_Toc17121482)

[4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11](#_Toc17121483)

[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](#_Toc17121484)

[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](#_Toc17121485)

[4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12](#_Toc17121486)

[4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12](#_Toc17121487)

[4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 13](#_Toc17121488)

[§5 托管人报告 13](#_Toc17121489)

[5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13](#_Toc17121490)

[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](#_Toc17121491)

[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](#_Toc17121492)

[§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14](#_Toc17121493)

[6.1 资产负债表 14](#_Toc17121494)

[6.2 利润表 15](#_Toc17121495)

[6.3 所有者权益（基金净值）变动表 17](#_Toc17121496)

[6.4 报表附注 18](#_Toc17121497)

[§7 投资组合报告 34](#_Toc17121498)

[7.1 期末基金资产组合情况 35](#_Toc17121499)

[7.2 期末按行业分类的股票投资组合 35](#_Toc17121500)

[7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 36](#_Toc17121501)

[7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 47](#_Toc17121502)

[7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 49](#_Toc17121503)

[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](#_Toc17121504)

[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](#_Toc17121505)

[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](#_Toc17121506)

[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](#_Toc17121507)

[7.10 本报告期投资基金情况 49](#_Toc17121508)

[7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 50](#_Toc17121509)

[7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 50](#_Toc17121510)

[7.13 投资组合报告附注 50](#_Toc17121511)

[§8 基金份额持有人信息 51](#_Toc17121512)

[8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 51](#_Toc17121513)

[8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 52](#_Toc17121514)

[8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 52](#_Toc17121515)

[§9 开放式基金份额变动 52](#_Toc17121516)

[§10 重大事件揭示 52](#_Toc17121517)

[10.1 基金份额持有人大会决议 52](#_Toc17121518)

[10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 53](#_Toc17121519)

[10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 53](#_Toc17121520)

[10.4 基金投资策略的改变 53](#_Toc17121521)

[10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 53](#_Toc17121522)

[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](#_Toc17121523)

[10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 53](#_Toc17121524)

[10.8 其他重大事件 55](#_Toc17121525)

[§11 影响投资者决策的其他重要信息 56](#_Toc17121526)

[11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况 56](#_Toc17121527)

[11.2 影响投资者决策的其他重要信息 56](#_Toc17121528)

[§12 备查文件目录 56](#_Toc17121529)

[12.1 备查文件目录 56](#_Toc17121530)

[12.2 存放地点 56](#_Toc17121531)

[12.3 查阅方式 56](#_Toc17121532)

1. 基金简介
   1. 基金基本情况

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 基金名称 | 南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | |
| 基金简称 | 南方深证成份ETF联接 | |
| 基金主代码 | 202017 | |
| 前端交易代码 | 202017 | |
| 后端交易代码 | 202018 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2009年12月9日 | |
| 基金管理人 | 南方基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 346,184,095.68份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 深成联接A | 深成联接C |
| 下属分级基金的交易代码 | 202017 | 004345 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 330,673,904.60份 | 15,510,191.08份 |

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

* + 1. 目标基金基本情况

|  |  |
| --- | --- |
| 基金名称 | 深证成份交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码 | 159903 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年12月4日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2010年2月2日 |
| 基金管理人名称 | 南方基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中国工商银行股份有限公司 |

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

* 1. 基金产品说明

|  |  |
| --- | --- |
| 投资目标 | 通过投资于深成ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为完全被动式指数基金，以深成ETF作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资深成ETF。本基金并不参与深成ETF的管理。为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于深成ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。在正常市场情况下，本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 |
| 业绩比较基准 | 深证成份指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |

* + 1. 目标基金产品说明

|  |  |
| --- | --- |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为完全被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。  当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证成份指数。  如果指数编制单位变更或停止深证成份指数的编制及发布、或深证成份指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致深证成份指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。 |
| 风险收益特征 | 本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |

* 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 |

* 1. 信息披露方式

|  |  |
| --- | --- |
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.nffund.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人的办公地址 |

* 1. 其他相关资料

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 名称 | 办公地址 |
| 注册登记机构 | 南方基金管理股份有限公司 | 深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦32-42楼 |

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、深成联接A

金额单位：人民币元

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

2、深成联接C

金额单位：人民币元

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

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

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

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

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

* 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

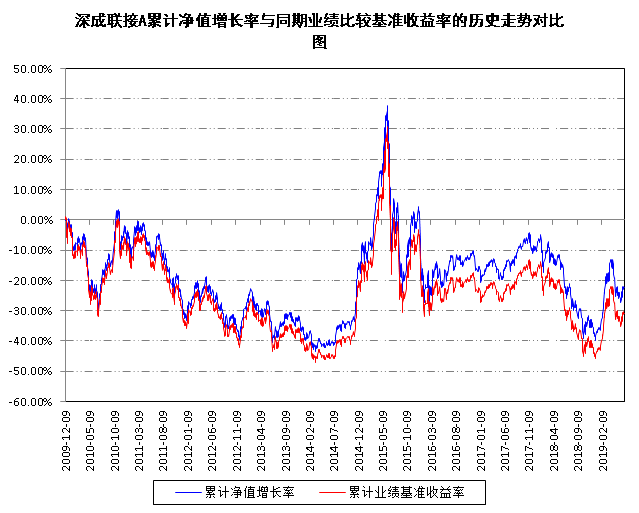
深成联接A

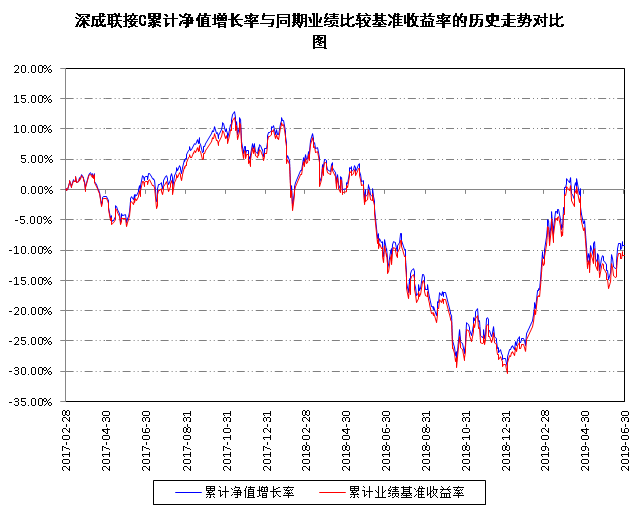
|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
| 过去一个月 | 3.00% | 1.30% | 2.73% | 1.31% | 0.27% | -0.01% |
| 过去三个月 | -6.29% | 1.74% | -6.95% | 1.74% | 0.66% | 0.00% |
| 过去六个月 | 26.20% | 1.70% | 25.41% | 1.71% | 0.79% | -0.01% |
| 过去一年 | -0.65% | 1.63% | -1.85% | 1.64% | 1.20% | -0.01% |
| 过去三年 | -8.32% | 1.23% | -11.61% | 1.24% | 3.29% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -22.39% | 1.54% | -30.83% | 1.56% | 8.44% | -0.02% |

深成联接C

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

* + 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 |
| 孙伟 | 本基金基金经理 | 2016年8月19日 | - | 9年 | 管理学学士，具有基金从业资格、金融分析师（CFA）资格、注册会计师（CPA）资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010年2月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员；2014年12月至2015年5月，担任南方恒生ETF的基金经理助理；2015年5月至2016年7月，任南方500工业ETF、南方500原材料ETF基金经理；2015年7月至今，任改革基金、高铁基金、500信息基金经理；2016年5月至今，任南方创业板ETF、南方创业板ETF联接基金经理；2016年8月至今，任500信息联接、深成ETF、南方深成基金经理；2017年3月至今，任南方全指证券ETF联接、南方中证全指证券ETF基金经理；2017年6月至今，任南方中证银行ETF、南方银行联接基金经理；2018年2月至今，任H股ETF、南方H股联接基金经理。 |

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

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

* 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

深证成指报告期内上涨26.78%。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

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

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

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

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

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

* 1. 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

* 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，同一类别每一基金份额享有同等分配权；若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合相关基金分红条件的前提下，本基金每类基金份额的收益分配每年最多6次，各基金份额类别每次基金收益分配比例不得低于该类基金份额基金收益分配基准日可供分配利润的10%；本基金A类与C类基金份额收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金分红或将现金分红按除权日的该类基金份额净值自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金A类与C类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；目前本基金H类基金份额收益分配方式仅为现金分红；如未来条件允许，本基金H类基金份额可增加红利再投资的收益分配方式供H类基金份额持有人选择，该项调整须经基金管理人与基金托管人协商一致并报中国证监会备案并公告后实施，无需召开基金份额持有人大会审议；增加红利再投资的收益分配后，如H类基金份额持有人未选择，本基金H类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

* 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

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

* 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

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

* 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

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金2019上半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

1. 半年度财务会计报告（未经审计）
   1. 资产负债表

会计主体：南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 资产 | 附注号 | 本期末2019年6月30日 | 上年度末2018年12月31日 |
| 资产： |  |  |  |
| 银行存款 | 6.4.3.1 | 14,027,347.43 | 3,583,157.60 |
| 结算备付金 |  | 47,568.45 | 21,977.35 |
| 存出保证金 |  | 12,995.53 | 6,718.62 |
| 交易性金融资产 | 6.4.3.2 | 255,625,657.04 | 227,441,925.02 |
| 其中：股票投资 |  | 10,138,664.30 | 8,663,290.17 |
| 基金投资 |  | 245,486,992.74 | 208,734,634.85 |
| 债券投资 |  | - | 10,044,000.00 |
| 资产支持证券投资 |  | - | - |
| 贵金属投资 |  | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.3.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.3.4 | - | - |
| 应收证券清算款 |  | - | - |
| 应收利息 | 6.4.3.5 | 2,562.55 | 280,324.46 |
| 应收股利 |  | - | - |
| 应收申购款 |  | 204,926.58 | 216,962.08 |
| 递延所得税资产 |  | - | - |
| 其他资产 | 6.4.3.6 | - | 2,379.41 |
| 资产总计 |  | 269,921,057.58 | 231,553,444.54 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末2019年6月30日 | 上年度末2018年12月31日 |
| 负债： |  |  |  |
| 短期借款 |  | - | - |
| 交易性金融负债 |  | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.3.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 |  | - | - |
| 应付证券清算款 |  | - | - |
| 应付赎回款 |  | 1,233,595.27 | 57,115.12 |
| 应付管理人报酬 |  | 10,247.88 | 9,572.39 |
| 应付托管费 |  | 2,049.59 | 1,914.46 |
| 应付销售服务费 |  | 4,142.69 | 2,361.34 |
| 应付交易费用 | 6.4.3.7 | 1,925.59 | 986.14 |
| 应交税费 |  | - | - |
| 应付利息 |  | - | - |
| 应付利润 |  | - | - |
| 递延所得税负债 |  | - | - |
| 其他负债 | 6.4.3.8 | 93,348.23 | 354,074.95 |
| 负债合计 |  | 1,345,309.25 | 426,024.40 |
| 所有者权益： |  |  |  |
| 实收基金 | 6.4.3.9 | 346,184,095.68 | 375,886,140.83 |
| 未分配利润 | 6.4.3.10 | -77,608,347.35 | -144,758,720.69 |
| 所有者权益合计 |  | 268,575,748.33 | 231,127,420.14 |
| 负债和所有者权益总计 |  | 269,921,057.58 | 231,553,444.54 |

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

* 1. 利润表

会计主体：南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 项目 | 附注号 | 本期2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间2018年1月1日至2018年6月30日 |
| 一、收入 |  | 64,189,237.27 | -42,068,172.88 |
| 1.利息收入 |  | 133,625.63 | 136,866.79 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.3.11 | 35,242.00 | 39,727.41 |
| 债券利息收入 |  | 98,383.63 | 97,139.38 |
| 资产支持证券利息收入 |  | - | - |
| 买入返售金融资产收入 |  | - | - |
| 其他利息收入 |  | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |  | 1,416,956.84 | -88,012.88 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.3.12 | 1,858,373.58 | -821,962.77 |
| 基金投资收益 |  | -478,332.62 | 657,243.45 |
| 债券投资收益 | 6.4.3.13 | -18,732.04 | 4,185.48 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.3.14 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.3.15 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.3.16 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.3.17 | 55,647.92 | 72,520.96 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.3.18 | 62,484,872.77 | -42,140,066.36 |
| 4.汇兑收益（损失以“－”号填列） |  | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.3.19 | 153,782.03 | 23,039.57 |
| 减：二、费用 |  | 221,955.85 | 275,791.48 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.6.2.1 | 50,727.33 | 58,859.00 |
| 2.托管费 | 6.4.6.2.2 | 10,145.53 | 11,771.76 |
| 3.销售服务费 | 6.4.6.2.3 | 19,345.49 | 3,553.39 |
| 4.交易费用 | 6.4.3.20 | 51,955.50 | 25,741.95 |
| 5.利息支出 |  | - | 194.91 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 |  | - | 194.91 |
| 6.税金及附加 |  | - | - |
| 7.其他费用 | 6.4.3.21 | 89,782.00 | 175,670.47 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |  | 63,967,281.42 | -42,343,964.36 |
| 减：所得税费用 |  | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | 63,967,281.42 | -42,343,964.36 |

* 1. 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 项目 | 本期2019年1月1日至2019年6月30日 | | |
| 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 375,886,140.83 | -144,758,720.69 | 231,127,420.14 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 63,967,281.42 | 63,967,281.42 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“－”号填列） | -29,702,045.15 | 3,183,091.92 | -26,518,953.23 |
| 其中：1.基金申购款 | 90,354,338.23 | -22,024,502.50 | 68,329,835.73 |
| 2.基金赎回款 | -120,056,383.38 | 25,207,594.42 | -94,848,788.96 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“－”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 346,184,095.68 | -77,608,347.35 | 268,575,748.33 |
| 项目 | 上年度可比期间2018年1月1日至2018年6月30日 | | |
| 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 335,364,316.58 | -31,302,141.31 | 304,062,175.27 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -42,343,964.36 | -42,343,964.36 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“－”号填列） | 14,252,400.42 | -2,859,864.69 | 11,392,535.73 |
| 其中：1.基金申购款 | 52,193,167.47 | -6,782,098.96 | 45,411,068.51 |
| 2.基金赎回款 | -37,940,767.05 | 3,922,234.27 | -34,018,532.78 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“－”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 349,616,717.00 | -76,505,970.36 | 273,110,746.64 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_杨小松\_\_\_ \_\_\_\_徐超\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_徐超\_\_\_\_

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

* 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 | 14,027,347.43 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限1个月以内 | - |
| 存款期限1-3个月 | - |
| 存款期限3个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 14,027,347.43 |

* + - 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 | | 9,881,746.76 | 10,138,664.30 | 256,917.54 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| 银行间市场 | - | - | - |
| 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | 263,712,076.94 | 245,486,992.74 | -18,225,084.20 |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 273,593,823.70 | 255,625,657.04 | -17,968,166.66 |

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

* + - 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 | 2,538.07 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 19.26 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 5.22 |
| 合计 | 2,562.55 |

* + - 1. 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

* + - 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 | 1,925.59 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 1,925.59 |

* + - 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 | 3,678.23 |
| 应退退补款 | - |
| 预提费用 | 89,670.00 |
| 应付指数使用费 | - |
| 可退退补款 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 93,348.23 |

* + - 1. 实收基金

金额单位：人民币元

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

金额单位：人民币元

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

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. H类份额尚未开放申购赎回业务。

* + - 1. 未分配利润

单位：人民币元

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

单位：人民币元

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

* + - 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 | 34,943.29 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 220.65 |
| 其他 | 78.06 |
| 合计 | 35,242.00 |

* + - 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 | 1,597,882.62 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | 260,490.96 |
| 合计 | 1,858,373.58 |

* + - * 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 | 40,756,033.24 |
| 减：卖出股票成本总额 | 39,158,150.62 |
| 买卖股票差价收入 | 1,597,882.62 |

* + - * 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 | 7,952,700.00 |
| 减：现金支付申购款总额 | -303,680.66 |
| 减：申购股票成本总额 | 7,995,889.70 |
| 申购差价收入 | 260,490.96 |

* + - 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 | 32,035,705.48 |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 32,514,038.10 |
| 基金投资收益 | -478,332.62 |

* + - 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 | 10,378,211.13 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 10,018,943.10 |
| 减：应收利息总额 | 378,000.07 |
| 买卖债券差价收入 | -18,732.04 |

* + - 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——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. 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 | 55,647.92 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 55,647.92 |

* + - 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 | 62,484,872.77 |
| ——股票投资 | 1,194,229.23 |
| ——债券投资 | -25,256.90 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | 61,315,900.44 |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| ——期货投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 62,484,872.77 |

* + - 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 | 148,238.65 |
| 基金转换费收入 | 5,543.38 |
| 合计 | 153,782.03 |

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

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

* + - 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 | 51,115.53 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 交易基金产生的费用 | 839.97 |
| 其中：申购费 | - |
| 赎回费 | - |
| 场内交易费 | - |
| 其他 | 839.97 |
| 合计 | 51,955.50 |

* + - 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 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 59,917.22 |
| 银行费用 | 112.00 |
| 合计 | 89,782.00 |

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

* + 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 | 54,893,246.78 | 100.00% | 45,833,584.97 | 100.00% |

* + - * 1. 基金交易

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

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

* + - * 1. 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

* + - * 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 | 5,489.67 | 100.00% | 1,935.61 | 100.52% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间2018年1月1日至2018年6月30日 | | | |
| 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 华泰证券 | 4,584.13 | 100.22% | 2,934.10 | 100.34% |

注：1.上述佣金按市场佣金率计算。

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

* + - 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 | 50,727.33 | 58,859.00 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 66,202.64 | 134,886.18 |

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

日管理人报酬＝(前一日基金资产净值–前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产) X 0.50% / 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 | 10,145.53 | 11,771.76 |

注：本基金基金资产中投资于目标ETF的部分不收取托管费，支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数，则取零)的0.10%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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 0.10% /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 | | |
| 深成联接A | 深成联接C | 合计 |
| 工商银行 | - | 1,857.78 | 1,857.78 |
| 华泰证券 | - | 413.33 | 413.33 |
| 南方基金 | - | 1,847.66 | 1,847.66 |
| 合计 | - | 4,118.77 | 4,118.77 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间2018年1月1日至2018年6月30日 | | |
| 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| 深成联接A | 深成联接C | 合计 |
| 工商银行 | - | 360.29 | 360.29 |
| 南方基金 | - | 768.89 | 768.89 |
| 华泰证券 | - | 4.39 | 4.39 |
| 合计 | - | 1,133.57 | 1,133.57 |

注：支付C类基金份额销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额、H类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

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

无。

* + - * 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 |
| 工商银行 | 14,027,347.43 | 34,943.29 | 4,426,094.07 | 39,148.74 |

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

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

* + 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

* + - 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

无。

* + 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。本基金为完全被动式指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资及债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

* + - 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工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于2019年6月30日，本基金未持有债券投资。

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

* + - * 1. 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.8。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

* + - 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 | 14,027,347.43 | - | - | - | 14,027,347.43 |
| 结算备付金 | 47,568.45 | - | - | - | 47,568.45 |
| 存出保证金 | 12,995.53 | - | - | - | 12,995.53 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 255,625,657.04 | 255,625,657.04 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 2,562.55 | 2,562.55 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 204,926.58 | 204,926.58 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 14,087,911.41 | - | - | 255,833,146.17 | 269,921,057.58 |
| 负债 |  |  |  |  |  |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,233,595.27 | 1,233,595.27 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 10,247.88 | 10,247.88 |
| 应付托管费 | - | - | - | 2,049.59 | 2,049.59 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 4,142.69 | 4,142.69 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 1,925.59 | 1,925.59 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 93,348.23 | 93,348.23 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,345,309.25 | 1,345,309.25 |
| 利率敏感度缺口 | 14,087,911.41 | - | - | 254,487,836.92 | 268,575,748.33 |
| 上年度末2018年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 |  |  |  |  |  |
| 银行存款 | 3,583,157.60 | - | - | - | 3,583,157.60 |
| 结算备付金 | 21,977.35 | - | - | - | 21,977.35 |
| 存出保证金 | 6,718.62 | - | - | - | 6,718.62 |
| 交易性金融资产 | 10,044,000.00 | - | - | 217,397,925.02 | 227,441,925.02 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 280,324.46 | 280,324.46 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 216,962.08 | 216,962.08 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | 2,379.41 | 2,379.41 |
| 资产总计 | 13,655,853.57 | - | - | 217,897,590.97 | 231,553,444.54 |
| 负债 |  |  |  |  |  |
| 应付赎回款 | - | - | - | 57,115.12 | 57,115.12 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 9,572.39 | 9,572.39 |
| 应付托管费 | - | - | - | 1,914.46 | 1,914.46 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 2,361.34 | 2,361.34 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 986.14 | 986.14 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 354,074.95 | 354,074.95 |
| 负债总计 | - | - | - | 426,024.40 | 426,024.40 |
| 利率敏感度缺口 | 13,655,853.57 | - | - | 217,471,566.57 | 231,127,420.14 |

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

利率风险的敏感性分析

于2019年06月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.00%(2018年12月31日：4.35%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018年12月31日：同)。

* + - * 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。

* + - * 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，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 | 10,138,664.30 | 3.77 | 8,663,290.17 | 3.75 |
| 交易性金融资产-基金投资 | 245,486,992.74 | 91.40 | 208,734,634.85 | 90.31 |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 255,625,657.04 | 95.18 | 217,397,925.02 | 94.06 |

注：交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标ETF份额。

其他价格风险的敏感性分析

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

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 | 10,138,664.30 | 3.76 |
|  | 其中：股票 | 10,138,664.30 | 3.76 |
| 2 | 基金投资 | 245,486,992.74 | 90.95 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
|  | 其中：债券 | - | - |
|  | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
|  | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 14,074,915.88 | 5.21 |
| 8 | 其他资产 | 220,484.66 | 0.08 |
| 9 | 合计 | 269,921,057.58 | 100.00 |

* 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 | 303,285.20 | 0.11 |
| B | 采矿业 | 83,615.60 | 0.03 |
| C | 制造业 | 6,448,523.58 | 2.40 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 111,061.00 | 0.04 |
| E | 建筑业 | 60,926.00 | 0.02 |
| F | 批发和零售业 | 201,659.50 | 0.08 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 108,360.40 | 0.04 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 967,722.58 | 0.36 |
| J | 金融业 | 720,901.30 | 0.27 |
| K | 房地产业 | 528,186.00 | 0.20 |
| L | 租赁和商务服务业 | 168,715.44 | 0.06 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 43,358.00 | 0.02 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 67,653.00 | 0.03 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 15,103.00 | 0.01 |
| Q | 卫生和社会工作 | 157,275.70 | 0.06 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 136,095.89 | 0.05 |
| S | 综合 | 16,222.11 | 0.01 |
|  | 合计 | 10,138,664.30 | 3.77 |

* + 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 | 000651 | 格力电器 | 7,200 | 396,000.00 | 0.15 |
| 2 | 000333 | 美的集团 | 7,600 | 394,136.00 | 0.15 |
| 3 | 000858 | 五 粮 液 | 2,800 | 330,260.00 | 0.12 |
| 4 | 300498 | 温氏股份 | 5,920 | 212,291.20 | 0.08 |
| 5 | 000002 | 万 科Ａ | 7,100 | 197,451.00 | 0.07 |
| 6 | 000001 | 平安银行 | 12,600 | 173,628.00 | 0.06 |
| 7 | 002415 | 海康威视 | 5,387 | 148,573.46 | 0.06 |
| 8 | 000725 | 京东方Ａ | 38,900 | 133,816.00 | 0.05 |
| 9 | 000063 | 中兴通讯 | 3,700 | 120,361.00 | 0.04 |
| 10 | 002304 | 洋河股份 | 900 | 109,404.00 | 0.04 |
| 11 | 300059 | 东方财富 | 7,865 | 106,570.75 | 0.04 |
| 12 | 000568 | 泸州老窖 | 1,200 | 96,996.00 | 0.04 |
| 13 | 002475 | 立讯精密 | 3,730 | 92,466.70 | 0.03 |
| 14 | 002027 | 分众传媒 | 16,936 | 89,591.44 | 0.03 |
| 15 | 002142 | 宁波银行 | 3,590 | 87,021.60 | 0.03 |
| 16 | 000338 | 潍柴动力 | 6,900 | 84,801.00 | 0.03 |
| 17 | 002230 | 科大讯飞 | 2,400 | 79,776.00 | 0.03 |
| 18 | 300750 | 宁德时代 | 1,100 | 75,768.00 | 0.03 |
| 19 | 001979 | 招商蛇口 | 3,600 | 75,240.00 | 0.03 |
| 20 | 000661 | 长春高新 | 200 | 67,600.00 | 0.03 |
| 21 | 002594 | 比 亚 迪 | 1,300 | 65,936.00 | 0.02 |
| 22 | 000776 | 广发证券 | 4,500 | 61,830.00 | 0.02 |
| 23 | 000166 | 申万宏源 | 12,200 | 61,122.00 | 0.02 |
| 24 | 002024 | 苏宁易购 | 5,300 | 60,844.00 | 0.02 |
| 25 | 002714 | 牧原股份 | 1,000 | 58,790.00 | 0.02 |
| 26 | 000538 | 云南白药 | 700 | 58,394.00 | 0.02 |
| 27 | 300015 | 爱尔眼科 | 1,850 | 57,294.50 | 0.02 |
| 28 | 300142 | 沃森生物 | 2,000 | 56,720.00 | 0.02 |
| 29 | 000876 | 新 希 望 | 3,100 | 53,847.00 | 0.02 |
| 30 | 000100 | TCL 集团 | 16,100 | 53,613.00 | 0.02 |
| 31 | 002202 | 金风科技 | 4,054 | 50,391.22 | 0.02 |
| 32 | 000783 | 长江证券 | 6,200 | 48,422.00 | 0.02 |
| 33 | 002008 | 大族激光 | 1,300 | 44,694.00 | 0.02 |
| 34 | 000157 | 中联重科 | 7,400 | 44,474.00 | 0.02 |
| 35 | 002736 | 国信证券 | 3,300 | 43,428.00 | 0.02 |
| 36 | 002422 | 科伦药业 | 1,400 | 41,622.00 | 0.02 |
| 37 | 300003 | 乐普医疗 | 1,800 | 41,436.00 | 0.02 |
| 38 | 002044 | 美年健康 | 3,180 | 39,559.20 | 0.01 |
| 39 | 300124 | 汇川技术 | 1,700 | 38,947.00 | 0.01 |
| 40 | 300347 | 泰格医药 | 500 | 38,550.00 | 0.01 |
| 41 | 002007 | 华兰生物 | 1,230 | 37,502.70 | 0.01 |
| 42 | 000895 | 双汇发展 | 1,500 | 37,335.00 | 0.01 |
| 43 | 000860 | 顺鑫农业 | 790 | 36,853.50 | 0.01 |
| 44 | 002236 | 大华股份 | 2,500 | 36,300.00 | 0.01 |
| 45 | 002410 | 广 联 达 | 1,100 | 36,179.00 | 0.01 |
| 46 | 002311 | 海大集团 | 1,100 | 33,990.00 | 0.01 |
| 47 | 002001 | 新 和 成 | 1,760 | 33,950.40 | 0.01 |
| 48 | 000413 | 东旭光电 | 6,500 | 33,410.00 | 0.01 |
| 49 | 002157 | 正邦科技 | 2,000 | 33,320.00 | 0.01 |
| 50 | 000069 | 华侨城Ａ | 4,700 | 32,665.00 | 0.01 |
| 51 | 300760 | 迈瑞医疗 | 200 | 32,640.00 | 0.01 |
| 52 | 002271 | 东方雨虹 | 1,430 | 32,403.80 | 0.01 |
| 53 | 002405 | 四维图新 | 2,000 | 32,200.00 | 0.01 |
| 54 | 000963 | 华东医药 | 1,240 | 32,190.40 | 0.01 |
| 55 | 000768 | 中航飞机 | 2,000 | 31,500.00 | 0.01 |
| 56 | 300017 | 网宿科技 | 2,900 | 31,262.00 | 0.01 |
| 57 | 300408 | 三环集团 | 1,600 | 31,120.00 | 0.01 |
| 58 | 000977 | 浪潮信息 | 1,300 | 31,018.00 | 0.01 |
| 59 | 300136 | 信维通信 | 1,260 | 30,807.00 | 0.01 |
| 60 | 002352 | 顺丰控股 | 900 | 30,564.00 | 0.01 |
| 61 | 300122 | 智飞生物 | 700 | 30,170.00 | 0.01 |
| 62 | 300033 | 同 花 顺 | 300 | 29,508.00 | 0.01 |
| 63 | 000425 | 徐工机械 | 6,600 | 29,436.00 | 0.01 |
| 64 | 000066 | 中国长城 | 2,844 | 29,236.32 | 0.01 |
| 65 | 300024 | 机 器 人 | 1,900 | 28,937.00 | 0.01 |
| 66 | 002460 | 赣锋锂业 | 1,200 | 28,116.00 | 0.01 |
| 67 | 002127 | 南极电商 | 2,500 | 28,100.00 | 0.01 |
| 68 | 000728 | 国元证券 | 3,050 | 27,968.50 | 0.01 |
| 69 | 000423 | 东阿阿胶 | 700 | 27,874.00 | 0.01 |
| 70 | 002673 | 西部证券 | 2,760 | 27,820.80 | 0.01 |
| 71 | 002466 | 天齐锂业 | 1,100 | 27,808.00 | 0.01 |
| 72 | 002241 | 歌尔股份 | 3,000 | 26,670.00 | 0.01 |
| 73 | 002049 | 紫光国微 | 600 | 26,466.00 | 0.01 |
| 74 | 002129 | 中环股份 | 2,700 | 26,352.00 | 0.01 |
| 75 | 002195 | 二三四五 | 6,651 | 25,872.39 | 0.01 |
| 76 | 300253 | 卫宁健康 | 1,820 | 25,807.60 | 0.01 |
| 77 | 002340 | 格 林 美 | 5,430 | 25,575.30 | 0.01 |
| 78 | 300144 | 宋城演艺 | 1,100 | 25,454.00 | 0.01 |
| 79 | 002179 | 中航光电 | 756 | 25,295.76 | 0.01 |
| 80 | 300383 | 光环新网 | 1,500 | 25,155.00 | 0.01 |
| 81 | 000750 | 国海证券 | 5,000 | 25,150.00 | 0.01 |
| 82 | 000703 | 恒逸石化 | 1,820 | 24,861.20 | 0.01 |
| 83 | 002463 | 沪电股份 | 1,800 | 24,516.00 | 0.01 |
| 84 | 002146 | 荣盛发展 | 2,600 | 24,414.00 | 0.01 |
| 85 | 002507 | 涪陵榨菜 | 800 | 24,400.00 | 0.01 |
| 86 | 300014 | 亿纬锂能 | 799 | 24,337.54 | 0.01 |
| 87 | 000401 | 冀东水泥 | 1,376 | 24,231.36 | 0.01 |
| 88 | 002439 | 启明星辰 | 900 | 24,210.00 | 0.01 |
| 89 | 002465 | 海格通信 | 2,500 | 23,850.00 | 0.01 |
| 90 | 000961 | 中南建设 | 2,750 | 23,815.00 | 0.01 |
| 91 | 000540 | 中天金融 | 6,200 | 23,746.00 | 0.01 |
| 92 | 000596 | 古井贡酒 | 200 | 23,702.00 | 0.01 |
| 93 | 000938 | 紫光股份 | 868 | 23,653.00 | 0.01 |
| 94 | 000630 | 铜陵有色 | 9,600 | 23,616.00 | 0.01 |
| 95 | 000786 | 北新建材 | 1,300 | 23,569.00 | 0.01 |
| 96 | 002456 | 欧 菲 光 | 3,000 | 23,520.00 | 0.01 |
| 97 | 300450 | 先导智能 | 700 | 23,520.00 | 0.01 |
| 98 | 300146 | 汤臣倍健 | 1,200 | 23,280.00 | 0.01 |
| 99 | 300012 | 华测检测 | 2,100 | 22,680.00 | 0.01 |
| 100 | 002384 | 东山精密 | 1,550 | 22,583.50 | 0.01 |
| 101 | 002120 | 韵达股份 | 720 | 22,190.40 | 0.01 |
| 102 | 002223 | 鱼跃医疗 | 900 | 22,158.00 | 0.01 |
| 103 | 000623 | 吉林敖东 | 1,350 | 22,126.50 | 0.01 |
| 104 | 300296 | 利 亚 德 | 2,800 | 21,924.00 | 0.01 |
| 105 | 002555 | 三七互娱 | 1,600 | 21,680.00 | 0.01 |
| 106 | 002081 | 金 螳 螂 | 2,100 | 21,651.00 | 0.01 |
| 107 | 000625 | 长安汽车 | 3,200 | 21,216.00 | 0.01 |
| 108 | 300601 | 康泰生物 | 400 | 21,000.00 | 0.01 |
| 109 | 002065 | 东华软件 | 3,000 | 20,970.00 | 0.01 |
| 110 | 002493 | 荣盛石化 | 1,725 | 20,803.50 | 0.01 |
| 111 | 002371 | 北方华创 | 300 | 20,775.00 | 0.01 |
| 112 | 002385 | 大 北 农 | 3,900 | 20,631.00 | 0.01 |
| 113 | 000656 | 金科股份 | 3,400 | 20,502.00 | 0.01 |
| 114 | 002916 | 深南电路 | 200 | 20,384.00 | 0.01 |
| 115 | 002739 | 万达电影 | 1,100 | 20,284.00 | 0.01 |
| 116 | 000997 | 新 大 陆 | 1,200 | 20,268.00 | 0.01 |
| 117 | 300070 | 碧 水 源 | 2,600 | 20,254.00 | 0.01 |
| 118 | 002797 | 第一创业 | 3,180 | 20,161.20 | 0.01 |
| 119 | 002268 | 卫 士 通 | 820 | 20,049.00 | 0.01 |
| 120 | 002506 | 协鑫集成 | 3,000 | 20,040.00 | 0.01 |
| 121 | 000629 | 攀钢钒钛 | 5,900 | 20,001.00 | 0.01 |
| 122 | 002926 | 华西证券 | 1,900 | 19,950.00 | 0.01 |
| 123 | 000709 | 河钢股份 | 6,600 | 19,734.00 | 0.01 |
| 124 | 002821 | 凯 莱 英 | 200 | 19,616.00 | 0.01 |
| 125 | 002500 | 山西证券 | 2,400 | 19,440.00 | 0.01 |
| 126 | 000686 | 东北证券 | 2,200 | 19,382.00 | 0.01 |
| 127 | 002050 | 三花智控 | 1,830 | 19,306.50 | 0.01 |
| 128 | 002092 | 中泰化学 | 2,400 | 19,104.00 | 0.01 |
| 129 | 002508 | 老板电器 | 700 | 18,998.00 | 0.01 |
| 130 | 000988 | 华工科技 | 1,200 | 18,984.00 | 0.01 |
| 131 | 000503 | 国新健康 | 1,100 | 18,876.00 | 0.01 |
| 132 | 000050 | 深天马Ａ | 1,400 | 18,816.00 | 0.01 |
| 133 | 002373 | 千方科技 | 1,100 | 18,810.00 | 0.01 |
| 134 | 002252 | 上海莱士 | 2,700 | 18,765.00 | 0.01 |
| 135 | 000060 | 中金岭南 | 3,950 | 18,525.50 | 0.01 |
| 136 | 002353 | 杰瑞股份 | 800 | 18,480.00 | 0.01 |
| 137 | 002013 | 中航机电 | 2,675 | 18,404.00 | 0.01 |
| 138 | 000627 | 天茂集团 | 2,800 | 18,172.00 | 0.01 |
| 139 | 300168 | 万达信息 | 1,400 | 18,158.00 | 0.01 |
| 140 | 002153 | 石基信息 | 500 | 18,095.00 | 0.01 |
| 141 | 300285 | 国瓷材料 | 1,050 | 17,860.50 | 0.01 |
| 142 | 000778 | 新兴铸管 | 4,000 | 17,760.00 | 0.01 |
| 143 | 002299 | 圣农发展 | 700 | 17,724.00 | 0.01 |
| 144 | 000975 | 银泰资源 | 1,340 | 17,674.60 | 0.01 |
| 145 | 000999 | 华润三九 | 600 | 17,604.00 | 0.01 |
| 146 | 002138 | 顺络电子 | 1,000 | 17,580.00 | 0.01 |
| 147 | 300454 | 深 信 服 | 200 | 17,508.00 | 0.01 |
| 148 | 000830 | 鲁西化工 | 1,600 | 17,408.00 | 0.01 |
| 149 | 300207 | 欣 旺 达 | 1,500 | 17,280.00 | 0.01 |
| 150 | 300676 | 华大基因 | 300 | 17,112.00 | 0.01 |
| 151 | 300271 | 华宇软件 | 900 | 17,100.00 | 0.01 |
| 152 | 002602 | 世纪华通 | 1,560 | 17,035.20 | 0.01 |
| 153 | 002387 | 维 信 诺 | 1,300 | 16,965.00 | 0.01 |
| 154 | 000960 | 锡业股份 | 1,500 | 16,755.00 | 0.01 |
| 155 | 000690 | 宝新能源 | 2,600 | 16,744.00 | 0.01 |
| 156 | 002572 | 索 菲 亚 | 900 | 16,704.00 | 0.01 |
| 157 | 000839 | 中信国安 | 4,150 | 16,683.00 | 0.01 |
| 158 | 000039 | 中集集团 | 1,560 | 16,660.80 | 0.01 |
| 159 | 000513 | 丽珠集团 | 500 | 16,615.00 | 0.01 |
| 160 | 000547 | 航天发展 | 1,700 | 16,252.00 | 0.01 |
| 161 | 000831 | 五矿稀土 | 1,000 | 16,230.00 | 0.01 |
| 162 | 000009 | 中国宝安 | 2,841 | 16,222.11 | 0.01 |
| 163 | 002191 | 劲嘉股份 | 1,300 | 16,133.00 | 0.01 |
| 164 | 002600 | 领益智造 | 2,700 | 16,011.00 | 0.01 |
| 165 | 000970 | 中科三环 | 1,400 | 15,890.00 | 0.01 |
| 166 | 002281 | 光迅科技 | 600 | 15,888.00 | 0.01 |
| 167 | 002075 | 沙钢股份 | 2,000 | 15,680.00 | 0.01 |
| 168 | 000723 | 美锦能源 | 1,500 | 15,675.00 | 0.01 |
| 169 | 300072 | 三聚环保 | 1,970 | 15,622.10 | 0.01 |
| 170 | 000671 | 阳 光 城 | 2,400 | 15,552.00 | 0.01 |
| 171 | 002624 | 完美世界 | 600 | 15,486.00 | 0.01 |
| 172 | 002217 | 合 力 泰 | 2,800 | 15,484.00 | 0.01 |
| 173 | 002032 | 苏 泊 尔 | 200 | 15,166.00 | 0.01 |
| 174 | 002607 | 中公教育 | 1,100 | 15,103.00 | 0.01 |
| 175 | 300009 | 安科生物 | 948 | 15,073.20 | 0.01 |
| 176 | 300226 | 上海钢联 | 200 | 14,992.00 | 0.01 |
| 177 | 002078 | 太阳纸业 | 2,200 | 14,982.00 | 0.01 |
| 178 | 300170 | 汉得信息 | 1,100 | 14,949.00 | 0.01 |
| 179 | 002131 | 利欧股份 | 7,810 | 14,917.10 | 0.01 |
| 180 | 000402 | 金 融 街 | 1,900 | 14,896.00 | 0.01 |
| 181 | 000581 | 威孚高科 | 800 | 14,848.00 | 0.01 |
| 182 | 002601 | 龙蟒佰利 | 1,000 | 14,830.00 | 0.01 |
| 183 | 300088 | 长信科技 | 2,900 | 14,674.00 | 0.01 |
| 184 | 000983 | 西山煤电 | 2,400 | 14,544.00 | 0.01 |
| 185 | 300166 | 东方国信 | 1,180 | 14,502.20 | 0.01 |
| 186 | 000998 | 隆平高科 | 1,000 | 14,480.00 | 0.01 |
| 187 | 300001 | 特 锐 德 | 800 | 14,416.00 | 0.01 |
| 188 | 300274 | 阳光电源 | 1,540 | 14,399.00 | 0.01 |
| 189 | 300098 | 高 新 兴 | 1,798 | 14,348.04 | 0.01 |
| 190 | 000883 | 湖北能源 | 3,300 | 14,322.00 | 0.01 |
| 191 | 000089 | 深圳机场 | 1,600 | 14,224.00 | 0.01 |
| 192 | 002038 | 双鹭药业 | 600 | 14,136.00 | 0.01 |
| 193 | 000598 | 兴蓉环境 | 3,100 | 14,105.00 | 0.01 |
| 194 | 002019 | 亿帆医药 | 1,150 | 14,087.50 | 0.01 |
| 195 | 300747 | 锐科激光 | 100 | 14,001.00 | 0.01 |
| 196 | 002110 | 三钢闽光 | 1,500 | 13,950.00 | 0.01 |
| 197 | 000046 | 泛海控股 | 2,500 | 13,950.00 | 0.01 |
| 198 | 000932 | 华菱钢铁 | 2,920 | 13,928.40 | 0.01 |
| 199 | 002074 | 国轩高科 | 1,060 | 13,896.60 | 0.01 |
| 200 | 000825 | 太钢不锈 | 3,400 | 13,838.00 | 0.01 |
| 201 | 002085 | 万丰奥威 | 1,900 | 13,832.00 | 0.01 |
| 202 | 000878 | 云南铜业 | 1,300 | 13,819.00 | 0.01 |
| 203 | 000800 | 一汽轿车 | 1,400 | 13,776.00 | 0.01 |
| 204 | 300027 | 华谊兄弟 | 2,800 | 13,748.00 | 0.01 |
| 205 | 000563 | 陕国投Ａ | 3,080 | 13,675.20 | 0.01 |
| 206 | 300357 | 我武生物 | 400 | 13,568.00 | 0.01 |
| 207 | 002180 | 纳 思 达 | 600 | 13,560.00 | 0.01 |
| 208 | 002152 | 广电运通 | 1,975 | 13,528.75 | 0.01 |
| 209 | 002396 | 星网锐捷 | 600 | 13,464.00 | 0.01 |
| 210 | 300315 | 掌趣科技 | 3,900 | 13,455.00 | 0.01 |
| 211 | 002294 | 信 立 泰 | 600 | 13,428.00 | 0.00 |
| 212 | 002237 | 恒邦股份 | 800 | 13,368.00 | 0.00 |
| 213 | 000898 | 鞍钢股份 | 3,510 | 13,302.90 | 0.00 |
| 214 | 002185 | 华天科技 | 2,600 | 13,234.00 | 0.00 |
| 215 | 002372 | 伟星新材 | 760 | 13,224.00 | 0.00 |
| 216 | 000732 | 泰禾集团 | 800 | 13,200.00 | 0.00 |
| 217 | 002690 | 美亚光电 | 400 | 13,040.00 | 0.00 |
| 218 | 002002 | 鸿达兴业 | 2,100 | 12,999.00 | 0.00 |
| 219 | 000826 | 启迪环境 | 1,100 | 12,969.00 | 0.00 |
| 220 | 002233 | 塔牌集团 | 1,100 | 12,848.00 | 0.00 |
| 221 | 002773 | 康弘药业 | 390 | 12,838.80 | 0.00 |
| 222 | 002266 | 浙富控股 | 2,700 | 12,825.00 | 0.00 |
| 223 | 300058 | 蓝色光标 | 3,000 | 12,810.00 | 0.00 |
| 224 | 002035 | 华帝股份 | 1,050 | 12,789.00 | 0.00 |
| 225 | 002558 | 巨人网络 | 700 | 12,719.00 | 0.00 |
| 226 | 000807 | 云铝股份 | 2,700 | 12,663.00 | 0.00 |
| 227 | 002004 | 华邦健康 | 2,600 | 12,636.00 | 0.00 |
| 228 | 000758 | 中色股份 | 2,300 | 12,627.00 | 0.00 |
| 229 | 300180 | 华峰超纤 | 900 | 12,618.00 | 0.00 |
| 230 | 000729 | 燕京啤酒 | 1,900 | 12,616.00 | 0.00 |
| 231 | 002595 | 豪迈科技 | 600 | 12,606.00 | 0.00 |
| 232 | 002310 | 东方园林 | 2,100 | 12,600.00 | 0.00 |
| 233 | 300182 | 捷成股份 | 2,849 | 12,564.09 | 0.00 |
| 234 | 000559 | 万向钱潮 | 2,100 | 12,558.00 | 0.00 |
| 235 | 300188 | 美亚柏科 | 700 | 12,481.00 | 0.00 |
| 236 | 300529 | 健帆生物 | 200 | 12,470.00 | 0.00 |
| 237 | 002440 | 闰土股份 | 1,000 | 12,460.00 | 0.00 |
| 238 | 300558 | 贝达药业 | 300 | 12,450.00 | 0.00 |
| 239 | 002273 | 水晶光电 | 1,070 | 12,390.60 | 0.00 |
| 240 | 002212 | 南洋股份 | 900 | 12,330.00 | 0.00 |
| 241 | 300413 | 芒果超媒 | 300 | 12,315.00 | 0.00 |
| 242 | 002511 | 中顺洁柔 | 1,000 | 12,280.00 | 0.00 |
| 243 | 002023 | 海特高新 | 1,000 | 12,240.00 | 0.00 |
| 244 | 000415 | 渤海租赁 | 3,100 | 12,152.00 | 0.00 |
| 245 | 002368 | 太极股份 | 400 | 12,120.00 | 0.00 |
| 246 | 002155 | 湖南黄金 | 1,200 | 12,084.00 | 0.00 |
| 247 | 002589 | 瑞康医药 | 1,590 | 12,068.10 | 0.00 |
| 248 | 000738 | 航发控制 | 900 | 12,060.00 | 0.00 |
| 249 | 002010 | 传化智联 | 1,600 | 12,048.00 | 0.00 |
| 250 | 300203 | 聚光科技 | 500 | 11,950.00 | 0.00 |
| 251 | 300316 | 晶盛机电 | 940 | 11,928.60 | 0.00 |
| 252 | 002174 | 游族网络 | 700 | 11,816.00 | 0.00 |
| 253 | 300212 | 易 华 录 | 480 | 11,760.00 | 0.00 |
| 254 | 002583 | 海 能 达 | 1,400 | 11,746.00 | 0.00 |
| 255 | 000683 | 远兴能源 | 4,500 | 11,745.00 | 0.00 |
| 256 | 002938 | 鹏鼎控股 | 400 | 11,744.00 | 0.00 |
| 257 | 000516 | 国际医学 | 2,300 | 11,684.00 | 0.00 |
| 258 | 300496 | 中科创达 | 400 | 11,632.00 | 0.00 |
| 259 | 300418 | 昆仑万维 | 900 | 11,583.00 | 0.00 |
| 260 | 000887 | 中鼎股份 | 1,200 | 11,508.00 | 0.00 |
| 261 | 300073 | 当升科技 | 500 | 11,485.00 | 0.00 |
| 262 | 000591 | 太 阳 能 | 3,500 | 11,480.00 | 0.00 |
| 263 | 002183 | 怡 亚 通 | 2,400 | 11,448.00 | 0.00 |
| 264 | 002727 | 一 心 堂 | 400 | 11,396.00 | 0.00 |
| 265 | 000528 | 柳 工 | 1,710 | 11,388.60 | 0.00 |
| 266 | 300339 | 润和软件 | 800 | 11,280.00 | 0.00 |
| 267 | 300010 | 立 思 辰 | 1,200 | 11,268.00 | 0.00 |
| 268 | 300038 | 数知科技 | 1,200 | 11,232.00 | 0.00 |
| 269 | 002610 | 爱康科技 | 6,000 | 11,220.00 | 0.00 |
| 270 | 300133 | 华策影视 | 1,660 | 11,171.80 | 0.00 |
| 271 | 000008 | 神州高铁 | 2,956 | 11,144.12 | 0.00 |
| 272 | 002080 | 中材科技 | 1,230 | 11,143.80 | 0.00 |
| 273 | 300699 | 光威复材 | 340 | 11,118.00 | 0.00 |
| 274 | 000560 | 我爱我家 | 2,300 | 10,994.00 | 0.00 |
| 275 | 300113 | 顺网科技 | 700 | 10,976.00 | 0.00 |
| 276 | 000031 | 大 悦 城 | 1,700 | 10,914.00 | 0.00 |
| 277 | 300251 | 光线传媒 | 1,600 | 10,880.00 | 0.00 |
| 278 | 002408 | 齐翔腾达 | 1,400 | 10,850.00 | 0.00 |
| 279 | 002640 | 跨 境 通 | 1,300 | 10,829.00 | 0.00 |
| 280 | 000650 | 仁和药业 | 1,500 | 10,815.00 | 0.00 |
| 281 | 002449 | 国星光电 | 810 | 10,756.80 | 0.00 |
| 282 | 002701 | 奥 瑞 金 | 2,300 | 10,741.00 | 0.00 |
| 283 | 000902 | 新 洋 丰 | 1,000 | 10,730.00 | 0.00 |
| 284 | 000488 | 晨鸣纸业 | 2,000 | 10,720.00 | 0.00 |
| 285 | 300628 | 亿联网络 | 100 | 10,707.00 | 0.00 |
| 286 | 300595 | 欧普康视 | 300 | 10,680.00 | 0.00 |
| 287 | 002407 | 多 氟 多 | 900 | 10,656.00 | 0.00 |
| 288 | 000040 | 东旭蓝天 | 1,600 | 10,624.00 | 0.00 |
| 289 | 000021 | 深 科 技 | 1,300 | 10,569.00 | 0.00 |
| 290 | 000027 | 深圳能源 | 1,700 | 10,540.00 | 0.00 |
| 291 | 002399 | 海 普 瑞 | 500 | 10,495.00 | 0.00 |
| 292 | 000877 | 天山股份 | 900 | 10,458.00 | 0.00 |
| 293 | 002402 | 和 而 泰 | 1,100 | 10,417.00 | 0.00 |
| 294 | 002648 | 卫星石化 | 700 | 10,416.00 | 0.00 |
| 295 | 002176 | 江特电机 | 2,100 | 10,227.00 | 0.00 |
| 296 | 300244 | 迪安诊断 | 600 | 10,188.00 | 0.00 |
| 297 | 002665 | 首航节能 | 3,000 | 10,170.00 | 0.00 |
| 298 | 002042 | 华孚时尚 | 1,400 | 10,164.00 | 0.00 |
| 299 | 002557 | 洽洽食品 | 400 | 10,100.00 | 0.00 |
| 300 | 000793 | 华闻传媒 | 3,000 | 10,080.00 | 0.00 |
| 301 | 002670 | 国盛金控 | 800 | 10,080.00 | 0.00 |
| 302 | 300463 | 迈克生物 | 400 | 10,052.00 | 0.00 |
| 303 | 300026 | 红日药业 | 2,900 | 10,005.00 | 0.00 |
| 304 | 300053 | 欧 比 特 | 1,000 | 9,980.00 | 0.00 |
| 305 | 002468 | 申通快递 | 400 | 9,976.00 | 0.00 |
| 306 | 300457 | 赢合科技 | 400 | 9,972.00 | 0.00 |
| 307 | 000400 | 许继电气 | 1,100 | 9,966.00 | 0.00 |
| 308 | 002563 | 森马服饰 | 900 | 9,954.00 | 0.00 |
| 309 | 000156 | 华数传媒 | 900 | 9,909.00 | 0.00 |
| 310 | 002056 | 横店东磁 | 1,300 | 9,880.00 | 0.00 |
| 311 | 000739 | 普洛药业 | 1,000 | 9,830.00 | 0.00 |
| 312 | 002497 | 雅化集团 | 1,400 | 9,786.00 | 0.00 |
| 313 | 000930 | 中粮生化 | 1,300 | 9,776.00 | 0.00 |
| 314 | 002025 | 航天电器 | 400 | 9,752.00 | 0.00 |
| 315 | 300451 | 创业慧康 | 650 | 9,717.50 | 0.00 |
| 316 | 002491 | 通鼎互联 | 1,200 | 9,708.00 | 0.00 |
| 317 | 000681 | 视觉中国 | 500 | 9,690.00 | 0.00 |
| 318 | 002426 | 胜利精密 | 3,750 | 9,600.00 | 0.00 |
| 319 | 002414 | 高德红外 | 500 | 9,600.00 | 0.00 |
| 320 | 000059 | 华锦股份 | 1,500 | 9,600.00 | 0.00 |
| 321 | 300002 | 神州泰岳 | 2,400 | 9,552.00 | 0.00 |
| 322 | 300294 | 博雅生物 | 350 | 9,502.50 | 0.00 |
| 323 | 002912 | 中新赛克 | 100 | 9,387.00 | 0.00 |
| 324 | 002608 | 江苏国信 | 1,100 | 9,383.00 | 0.00 |
| 325 | 002812 | 恩捷股份 | 200 | 9,350.00 | 0.00 |
| 326 | 300433 | 蓝思科技 | 1,340 | 9,339.80 | 0.00 |
| 327 | 002151 | 北斗星通 | 400 | 9,292.00 | 0.00 |
| 328 | 002603 | 以岭药业 | 800 | 9,264.00 | 0.00 |
| 329 | 000727 | 华东科技 | 4,400 | 9,196.00 | 0.00 |
| 330 | 002488 | 金固股份 | 1,100 | 9,163.00 | 0.00 |
| 331 | 300118 | 东方日升 | 900 | 9,162.00 | 0.00 |
| 332 | 002244 | 滨江集团 | 2,200 | 9,130.00 | 0.00 |
| 333 | 002597 | 金禾实业 | 500 | 9,120.00 | 0.00 |
| 334 | 002249 | 大洋电机 | 2,100 | 9,114.00 | 0.00 |
| 335 | 002643 | 万润股份 | 900 | 9,090.00 | 0.00 |
| 336 | 002030 | 达安基因 | 843 | 9,045.39 | 0.00 |
| 337 | 000926 | 福星股份 | 1,300 | 8,996.00 | 0.00 |
| 338 | 300197 | 铁汉生态 | 2,500 | 8,975.00 | 0.00 |
| 339 | 000012 | 南 玻Ａ | 2,149 | 8,939.84 | 0.00 |
| 340 | 002302 | 西部建设 | 800 | 8,912.00 | 0.00 |
| 341 | 000717 | 韶钢松山 | 2,000 | 8,860.00 | 0.00 |
| 342 | 002573 | 清新环境 | 1,100 | 8,855.00 | 0.00 |
| 343 | 002168 | 惠程科技 | 1,000 | 8,850.00 | 0.00 |
| 344 | 000301 | 东方盛虹 | 1,600 | 8,784.00 | 0.00 |
| 345 | 000901 | 航天科技 | 700 | 8,708.00 | 0.00 |
| 346 | 000078 | 海王生物 | 2,500 | 8,700.00 | 0.00 |
| 347 | 300324 | 旋极信息 | 1,500 | 8,685.00 | 0.00 |
| 348 | 002128 | 露天煤业 | 1,000 | 8,650.00 | 0.00 |
| 349 | 300630 | 普利制药 | 150 | 8,643.00 | 0.00 |
| 350 | 002262 | 恩华药业 | 800 | 8,632.00 | 0.00 |
| 351 | 300115 | 长盈精密 | 820 | 8,601.80 | 0.00 |
| 352 | 000761 | 本钢板材 | 2,000 | 8,600.00 | 0.00 |
| 353 | 002716 | 金贵银业 | 1,100 | 8,580.00 | 0.00 |
| 354 | 000685 | 中山公用 | 1,000 | 8,540.00 | 0.00 |
| 355 | 000818 | 航锦科技 | 800 | 8,520.00 | 0.00 |
| 356 | 002839 | 张家港行 | 1,500 | 8,445.00 | 0.00 |
| 357 | 002366 | 台海核电 | 900 | 8,424.00 | 0.00 |
| 358 | 300145 | 中金环境 | 1,940 | 8,419.60 | 0.00 |
| 359 | 002280 | 联络互动 | 2,300 | 8,418.00 | 0.00 |
| 360 | 000035 | 中国天楹 | 1,400 | 8,400.00 | 0.00 |
| 361 | 300078 | 思创医惠 | 820 | 8,372.20 | 0.00 |
| 362 | 000028 | 国药一致 | 200 | 8,366.00 | 0.00 |
| 363 | 002376 | 新 北 洋 | 700 | 8,365.00 | 0.00 |
| 364 | 002939 | 长城证券 | 500 | 8,345.00 | 0.00 |
| 365 | 000848 | 承德露露 | 1,000 | 8,330.00 | 0.00 |
| 366 | 001965 | 招商公路 | 1,000 | 8,330.00 | 0.00 |
| 367 | 000718 | 苏宁环球 | 2,400 | 8,304.00 | 0.00 |
| 368 | 002505 | 大康农业 | 4,200 | 8,274.00 | 0.00 |
| 369 | 002421 | 达实智能 | 2,200 | 8,206.00 | 0.00 |
| 370 | 300355 | 蒙草生态 | 2,000 | 8,200.00 | 0.00 |
| 371 | 000006 | 深振业Ａ | 1,500 | 8,175.00 | 0.00 |
| 372 | 002358 | 森源电气 | 800 | 8,120.00 | 0.00 |
| 373 | 002285 | 世 联 行 | 1,800 | 8,118.00 | 0.00 |
| 374 | 002118 | 紫鑫药业 | 1,200 | 8,088.00 | 0.00 |
| 375 | 002596 | 海南瑞泽 | 1,000 | 8,080.00 | 0.00 |
| 376 | 002618 | 丹邦科技 | 600 | 8,046.00 | 0.00 |
| 377 | 002051 | 中工国际 | 700 | 8,029.00 | 0.00 |
| 378 | 000933 | 神火股份 | 1,900 | 7,999.00 | 0.00 |
| 379 | 002444 | 巨星科技 | 800 | 7,984.00 | 0.00 |
| 380 | 000016 | 深康佳Ａ | 1,900 | 7,980.00 | 0.00 |
| 381 | 002028 | 思源电气 | 800 | 7,968.00 | 0.00 |
| 382 | 002383 | 合众思壮 | 700 | 7,952.00 | 0.00 |
| 383 | 300054 | 鼎龙股份 | 1,000 | 7,950.00 | 0.00 |
| 384 | 000158 | 常山北明 | 1,460 | 7,913.20 | 0.00 |
| 385 | 300068 | 南都电源 | 700 | 7,910.00 | 0.00 |
| 386 | 002390 | 信邦制药 | 1,500 | 7,905.00 | 0.00 |
| 387 | 300367 | 东方网力 | 800 | 7,896.00 | 0.00 |
| 388 | 300474 | 景 嘉 微 | 200 | 7,892.00 | 0.00 |
| 389 | 300567 | 精测电子 | 150 | 7,878.00 | 0.00 |
| 390 | 002419 | 天虹股份 | 600 | 7,836.00 | 0.00 |
| 391 | 002389 | 航天彩虹 | 700 | 7,812.00 | 0.00 |
| 392 | 002925 | 盈趣科技 | 200 | 7,802.00 | 0.00 |
| 393 | 002841 | 视源股份 | 100 | 7,751.00 | 0.00 |
| 394 | 000712 | 锦龙股份 | 600 | 7,704.00 | 0.00 |
| 395 | 002831 | 裕同科技 | 400 | 7,668.00 | 0.00 |
| 396 | 000789 | 万 年 青 | 760 | 7,615.20 | 0.00 |
| 397 | 002048 | 宁波华翔 | 700 | 7,574.00 | 0.00 |
| 398 | 002203 | 海亮股份 | 700 | 7,574.00 | 0.00 |
| 399 | 300616 | 尚品宅配 | 100 | 7,562.00 | 0.00 |
| 400 | 300482 | 万孚生物 | 200 | 7,540.00 | 0.00 |
| 401 | 002537 | 海联金汇 | 1,000 | 7,540.00 | 0.00 |
| 402 | 000921 | 海信家电 | 600 | 7,488.00 | 0.00 |
| 403 | 002807 | 江阴银行 | 1,600 | 7,488.00 | 0.00 |
| 404 | 300308 | 中际旭创 | 220 | 7,477.80 | 0.00 |
| 405 | 002091 | 江苏国泰 | 1,300 | 7,423.00 | 0.00 |
| 406 | 300036 | 超图软件 | 500 | 7,390.00 | 0.00 |
| 407 | 000600 | 建投能源 | 1,100 | 7,370.00 | 0.00 |
| 408 | 300377 | 赢 时 胜 | 650 | 7,358.00 | 0.00 |
| 409 | 300199 | 翰宇药业 | 800 | 7,336.00 | 0.00 |
| 410 | 002429 | 兆驰股份 | 2,650 | 7,261.00 | 0.00 |
| 411 | 002709 | 天赐材料 | 300 | 7,260.00 | 0.00 |
| 412 | 002430 | 杭氧股份 | 600 | 7,236.00 | 0.00 |
| 413 | 300055 | 万 邦 达 | 1,000 | 7,130.00 | 0.00 |
| 414 | 300085 | 银 之 杰 | 500 | 7,095.00 | 0.00 |
| 415 | 002292 | 奥飞娱乐 | 1,100 | 7,051.00 | 0.00 |
| 416 | 002745 | 木 林 森 | 600 | 7,032.00 | 0.00 |
| 417 | 300159 | 新研股份 | 1,400 | 6,972.00 | 0.00 |
| 418 | 000937 | 冀中能源 | 1,800 | 6,948.00 | 0.00 |
| 419 | 002424 | 贵州百灵 | 700 | 6,916.00 | 0.00 |
| 420 | 002867 | 周 大 生 | 200 | 6,838.00 | 0.00 |
| 421 | 000555 | 神州信息 | 600 | 6,828.00 | 0.00 |
| 422 | 002672 | 东江环保 | 600 | 6,804.00 | 0.00 |
| 423 | 002156 | 通富微电 | 800 | 6,784.00 | 0.00 |
| 424 | 300476 | 胜宏科技 | 600 | 6,780.00 | 0.00 |
| 425 | 002635 | 安洁科技 | 500 | 6,745.00 | 0.00 |
| 426 | 000980 | 众泰汽车 | 1,600 | 6,736.00 | 0.00 |
| 427 | 002047 | 宝鹰股份 | 1,200 | 6,732.00 | 0.00 |
| 428 | 000990 | 诚志股份 | 400 | 6,564.00 | 0.00 |
| 429 | 002614 | 奥 佳 华 | 400 | 6,528.00 | 0.00 |
| 430 | 300348 | 长亮科技 | 450 | 6,525.00 | 0.00 |
| 431 | 000564 | 供销大集 | 2,500 | 6,525.00 | 0.00 |
| 432 | 002544 | 杰赛科技 | 500 | 6,500.00 | 0.00 |
| 433 | 000539 | 粤电力Ａ | 1,500 | 6,450.00 | 0.00 |
| 434 | 000034 | 神州数码 | 500 | 6,450.00 | 0.00 |
| 435 | 000426 | 兴业矿业 | 1,200 | 6,444.00 | 0.00 |
| 436 | 000553 | 安道麦A | 600 | 6,432.00 | 0.00 |
| 437 | 002341 | 新纶科技 | 1,100 | 6,424.00 | 0.00 |
| 438 | 000869 | 张 裕Ａ | 200 | 6,424.00 | 0.00 |
| 439 | 000951 | 中国重汽 | 400 | 6,420.00 | 0.00 |
| 440 | 000935 | 四川双马 | 400 | 6,396.00 | 0.00 |
| 441 | 300458 | 全志科技 | 300 | 6,270.00 | 0.00 |
| 442 | 300037 | 新 宙 邦 | 300 | 6,252.00 | 0.00 |
| 443 | 002242 | 九阳股份 | 300 | 6,243.00 | 0.00 |
| 444 | 002815 | 崇达技术 | 400 | 6,236.00 | 0.00 |
| 445 | 002611 | 东方精工 | 1,600 | 6,160.00 | 0.00 |
| 446 | 002737 | 葵花药业 | 400 | 6,156.00 | 0.00 |
| 447 | 002108 | 沧州明珠 | 1,564 | 6,099.60 | 0.00 |
| 448 | 002517 | 恺英网络 | 1,900 | 6,061.00 | 0.00 |
| 449 | 300748 | 金力永磁 | 100 | 6,008.00 | 0.00 |
| 450 | 000088 | 盐 田 港 | 1,100 | 6,006.00 | 0.00 |
| 451 | 300618 | 寒锐钴业 | 100 | 6,000.00 | 0.00 |
| 452 | 002681 | 奋达科技 | 1,378 | 5,842.72 | 0.00 |
| 453 | 300633 | 开立医疗 | 200 | 5,712.00 | 0.00 |
| 454 | 300459 | 金科文化 | 1,000 | 5,690.00 | 0.00 |
| 455 | 002936 | 郑州银行 | 1,100 | 5,588.00 | 0.00 |
| 456 | 000910 | 大亚圣象 | 500 | 5,570.00 | 0.00 |
| 457 | 300257 | 开山股份 | 500 | 5,540.00 | 0.00 |
| 458 | 002437 | 誉衡药业 | 1,400 | 5,530.00 | 0.00 |
| 459 | 000766 | 通化金马 | 800 | 5,440.00 | 0.00 |
| 460 | 002434 | 万 里 扬 | 800 | 5,432.00 | 0.00 |
| 461 | 000676 | 智度股份 | 600 | 5,412.00 | 0.00 |
| 462 | 000989 | 九 芝 堂 | 600 | 5,340.00 | 0.00 |
| 463 | 000062 | 深圳华强 | 400 | 5,316.00 | 0.00 |
| 464 | 000429 | 粤高速Ａ | 700 | 5,285.00 | 0.00 |
| 465 | 002258 | 利尔化学 | 400 | 5,220.00 | 0.00 |
| 466 | 300222 | 科大智能 | 400 | 5,208.00 | 0.00 |
| 467 | 002509 | 天广中茂 | 2,500 | 5,150.00 | 0.00 |
| 468 | 002503 | 搜 于 特 | 1,800 | 4,950.00 | 0.00 |
| 469 | 000537 | 广宇发展 | 700 | 4,844.00 | 0.00 |
| 470 | 002061 | 浙江交科 | 800 | 4,784.00 | 0.00 |
| 471 | 002251 | 步 步 高 | 600 | 4,782.00 | 0.00 |
| 472 | 002625 | 光启技术 | 510 | 4,737.90 | 0.00 |
| 473 | 000968 | 蓝焰控股 | 400 | 4,644.00 | 0.00 |
| 474 | 000582 | 北部湾港 | 500 | 4,500.00 | 0.00 |
| 475 | 300373 | 扬杰科技 | 300 | 4,497.00 | 0.00 |
| 476 | 002920 | 德赛西威 | 200 | 4,480.00 | 0.00 |
| 477 | 300634 | 彩讯股份 | 200 | 4,334.00 | 0.00 |
| 478 | 300323 | 华灿光电 | 700 | 4,326.00 | 0.00 |
| 479 | 002653 | 海 思 科 | 300 | 4,260.00 | 0.00 |
| 480 | 000959 | 首钢股份 | 1,200 | 4,224.00 | 0.00 |
| 481 | 002382 | 蓝帆医疗 | 300 | 4,146.00 | 0.00 |
| 482 | 002320 | 海峡股份 | 450 | 4,023.00 | 0.00 |
| 483 | 000525 | 红 太 阳 | 300 | 3,873.00 | 0.00 |
| 484 | 000950 | 重药控股 | 700 | 3,822.00 | 0.00 |
| 485 | 300666 | 江丰电子 | 100 | 3,792.00 | 0.00 |
| 486 | 300409 | 道氏技术 | 300 | 3,789.00 | 0.00 |
| 487 | 000987 | 越秀金控 | 400 | 3,608.00 | 0.00 |
| 488 | 000710 | 贝瑞基因 | 100 | 3,566.00 | 0.00 |
| 489 | 002901 | 大博医疗 | 100 | 3,288.00 | 0.00 |
| 490 | 002016 | 世荣兆业 | 400 | 3,280.00 | 0.00 |
| 491 | 001872 | 招商港口 | 200 | 3,262.00 | 0.00 |
| 492 | 002461 | 珠江啤酒 | 500 | 3,175.00 | 0.00 |
| 493 | 300741 | 华宝股份 | 100 | 3,170.00 | 0.00 |
| 494 | 002512 | 达华智能 | 700 | 3,164.00 | 0.00 |
| 495 | 300504 | 天邑股份 | 100 | 2,695.00 | 0.00 |
| 496 | 300724 | 捷佳伟创 | 100 | 2,662.00 | 0.00 |
| 497 | 002818 | 富 森 美 | 200 | 2,566.00 | 0.00 |
| 498 | 000617 | 中油资本 | 200 | 2,472.00 | 0.00 |
| 499 | 002907 | 华森制药 | 100 | 1,780.00 | 0.00 |
| 500 | 002911 | 佛燃股份 | 100 | 1,503.00 | 0.00 |

* 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 | 000651 | 格力电器 | 484,189.00 | 0.21 |
| 2 | 000333 | 美的集团 | 483,590.00 | 0.21 |
| 3 | 000858 | 五 粮 液 | 307,343.00 | 0.13 |
| 4 | 300498 | 温氏股份 | 294,427.00 | 0.13 |
| 5 | 000002 | 万 科Ａ | 261,991.00 | 0.11 |
| 6 | 002415 | 海康威视 | 223,419.00 | 0.10 |
| 7 | 000001 | 平安银行 | 221,647.00 | 0.10 |
| 8 | 000725 | 京东方Ａ | 193,056.00 | 0.08 |
| 9 | 002304 | 洋河股份 | 148,463.00 | 0.06 |
| 10 | 300750 | 宁德时代 | 148,291.00 | 0.06 |
| 11 | 300059 | 东方财富 | 143,546.00 | 0.06 |
| 12 | 002027 | 分众传媒 | 137,204.00 | 0.06 |
| 13 | 000063 | 中兴通讯 | 117,731.00 | 0.05 |
| 14 | 002230 | 科大讯飞 | 115,902.00 | 0.05 |
| 15 | 000568 | 泸州老窖 | 112,618.00 | 0.05 |
| 16 | 001979 | 招商蛇口 | 107,233.00 | 0.05 |
| 17 | 000338 | 潍柴动力 | 105,169.00 | 0.05 |
| 18 | 002475 | 立讯精密 | 104,827.00 | 0.05 |
| 19 | 002142 | 宁波银行 | 104,328.00 | 0.05 |
| 20 | 002594 | 比 亚 迪 | 100,746.00 | 0.04 |

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

* + 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 | 000651 | 格力电器 | 1,413,404.00 | 0.61 |
| 2 | 000333 | 美的集团 | 1,342,107.00 | 0.58 |
| 3 | 000858 | 五 粮 液 | 929,920.00 | 0.40 |
| 4 | 300498 | 温氏股份 | 907,740.00 | 0.39 |
| 5 | 002415 | 海康威视 | 753,189.00 | 0.33 |
| 6 | 000002 | 万 科Ａ | 742,367.00 | 0.32 |
| 7 | 000001 | 平安银行 | 647,610.00 | 0.28 |
| 8 | 000725 | 京东方Ａ | 612,794.00 | 0.27 |
| 9 | 300059 | 东方财富 | 449,817.00 | 0.19 |
| 10 | 002304 | 洋河股份 | 430,722.00 | 0.19 |
| 11 | 000063 | 中兴通讯 | 393,960.00 | 0.17 |
| 12 | 002230 | 科大讯飞 | 341,126.00 | 0.15 |
| 13 | 002475 | 立讯精密 | 326,212.00 | 0.14 |
| 14 | 000661 | 长春高新 | 319,427.00 | 0.14 |
| 15 | 000338 | 潍柴动力 | 313,594.00 | 0.14 |
| 16 | 002027 | 分众传媒 | 312,973.00 | 0.14 |
| 17 | 002142 | 宁波银行 | 298,982.00 | 0.13 |
| 18 | 000776 | 广发证券 | 294,719.00 | 0.13 |
| 19 | 000568 | 泸州老窖 | 293,801.00 | 0.13 |
| 20 | 002594 | 比 亚 迪 | 272,564.00 | 0.12 |

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

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

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

* 1. 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

* 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

本基金本报告期末未持有债券。

* 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 | 南方深证成份ETF | 股票型 | 交易型开放式 | 南方基金管理股份有限公司 | 245,486,992.74 | 91.40 |

* 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平安银行（证券代码000001）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

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

* + 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 | 12,995.53 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,562.55 |
| 5 | 应收申购款 | 204,926.58 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 220,484.66 |

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

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

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

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

* 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 | 深成联接A | 0 |
| 深成联接C | 0 |
| 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 深成联接A | 0~10 |
| 深成联接C | 0 |
| 合计 | 0~10 |

1. 开放式基金份额变动

单位：份

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

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。

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。

* 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 |
| 华泰证券 | 3 | 54,893,246.78 | 100.00% | 5,489.67 | 100.00% | - |
| 国泰君安 | 3 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |

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

A：选择标准

1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；

2、公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；

3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；

4、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

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

1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；

2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；

3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

* + 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 |
| 华泰证券 | 211.13 | 100.00% | - | - | - | - | 40,466,738.10 | 100.00% |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - | - | - |

* 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 | 证券时报 | 2019-01-03 |
| 2 | 南方基金关于旗下部分基金增加腾安基金为销售机构的公告 | 证券时报 | 2019-01-24 |
| 3 | 关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告 | 证券时报 | 2019-02-27 |
| 4 | 南方基金关于旗下部分基金增加基煜基金为销售机构及开通相关业务的公告 | 证券时报 | 2019-03-21 |
| 5 | 南方基金关于旗下部分基金增加长沙银行为销售机构及开通相关业务的公告 | 证券时报 | 2019-03-28 |
| 6 | 南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告 | 证券时报 | 2019-04-01 |
| 7 | 南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告 | 证券时报 | 2019-04-02 |
| 8 | 关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告 | 证券时报 | 2019-04-02 |
| 9 | 南方基金管理股份有限公司关于山东寿光农村商业银行股份有限公司终止代理销售本公司旗下基金的公告 | 证券时报 | 2019-04-03 |
| 10 | 南方基金关于旗下部分基金增加中信证券为销售机构及开通相关业务的公告 | 证券时报 | 2019-04-30 |
| 11 | 南方基金关于旗下部分基金增加汇林保大为销售机构及开通相关业务的公告 | 证券时报 | 2019-06-06 |
| 12 | 南方基金关于旗下部分基金增加诺亚正行为销售机构及开通相关业务的公告 | 证券时报 | 2019-06-18 |
| 13 | 南方基金管理股份有限公司关于浙江金观诚基金销售有限公司暂停部分业务的公告 | 证券时报 | 2019-06-25 |
| 14 | 南方基金管理股份有限公司关于深圳富济基金销售有限公司暂停部分业务的公告 | 证券时报 | 2019-06-25 |
| 15 | 南方基金管理股份有限公司关于深圳宜投基金销售有限公司暂停部分业务的公告 | 证券时报 | 2019-06-25 |
| 16 | 南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告 | 证券时报 | 2019-06-25 |
| 17 | 南方基金关于开展机构及企业网上交易部分基金赎回费率优惠活动的公告 | 证券时报 | 2019-06-26 |
| 18 | 南方基金关于调整中国银行各交易渠道基金定投申购费率优惠标准的公告 | 证券时报 | 2019-06-27 |
| 19 | 南方基金管理股份有限公司关于中信建投期货有限公司暂停部分业务的公告 | 证券时报 | 2019-06-28 |
| 20 | 南方基金管理股份有限公司关于中国国际期货有限公司暂停部分业务的公告 | 证券时报 | 2019-06-28 |
| 21 | 南方基金管理股份有限公司关于北京加和基金销售有限公司暂停部分业务的公告 | 证券时报 | 2019-06-28 |

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深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件；

2、《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；

3、《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；

6、《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金2019年半年度报告》原文。

* 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