

# 南方深证成份交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 2018 年半年度报告

2018 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 27 日

## 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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 2018 年 8 月 22 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 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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
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

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
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
7.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	52
7.11	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.12	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.13	投资组合报告附注.....	52
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息.....</b>	<b>53</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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的情况.....	54
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动.....</b>	<b>54</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
10.1	基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4	基金投资策略的改变.....	55
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8	其他重大事件.....	57
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>58</b>
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.....	58
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	58
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录.....</b>	<b>58</b>
12.1	备查文件目录.....	58
12.2	存放地点.....	58
12.3	查阅方式.....	58

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	南方深证成份 ETF 联接	
基金主代码	202017	
前端交易代码	202017	
后端交易代码	202018	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 12 月 9 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	349,616,717.00 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	345,107,824.68 份	4,508,892.32 份

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

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159903
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2009-12-04
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010-02-02
基金管理人名称	南方基金管理股份有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

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

## 2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于深成 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>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。</p> <p>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，其目的是为了本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	深证成份指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金为完全被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。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。</p>
业绩比较基准	<p>本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证成份指数。如果指数编制单位变更或停止深证成份指数的编制及发布、或深证成份指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致深证成份指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。</p>
风险收益特征	<p>本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人姓名	常克川	郭明

责人	联系电话	0755-82763888	010-66105798
	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	010-66105799
注册地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		张海波	易会满

## 2.4 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、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理股份有限公司	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)	
	深成联接 A	深成联接 C
本期已实现收益	-193,424.03	-10,473.97
本期利润	-42,110,571.10	-233,393.26
加权平均基金份额本期利润	-0.1262	-0.1128
本期加权平均净值利润率	-14.38%	-13.13%
本期基金份额净值增长率	-13.84%	-14.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配利润	-75,505,576.46	-1,000,393.90
期末可供分配基金份额利润	-0.2188	-0.2219
期末基金资产净值	269,602,248.22	3,508,498.42
期末基金份额净值	0.7812	0.7781

3.1.3 累计期末指标	报告期末（2018 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-21.88%	-8.23%

注:1、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；

2、所述基金业绩指标不包括持有人认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。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

深成联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-8.20%	1.64%	-8.46%	1.64%	0.26%	0.00%
过去三个月	-12.52%	1.27%	-13.04%	1.27%	0.52%	0.00%
过去六个月	-13.84%	1.29%	-14.30%	1.30%	0.46%	-0.01%
过去一年	-9.84%	1.09%	-10.32%	1.10%	0.48%	-0.01%
过去三年	-29.42%	1.66%	-32.77%	1.71%	3.35%	-0.05%
自基金合同	-21.88%	1.51%	-29.53%	1.54%	7.65%	-0.03%

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	-8.23%	1.63%	-8.46%	1.64%	0.23%	-0.01%
过去三个月	-12.60%	1.27%	-13.04%	1.27%	0.44%	0.00%
过去六个月	-14.01%	1.29%	-14.30%	1.30%	0.29%	-0.01%
过去一年	-10.20%	1.09%	-10.32%	1.10%	0.12%	-0.01%
自基金合同	-8.23%	1.02%	-9.17%	1.02%	0.94%	0.00%

注:本基金 2017 年 2 月 20 日发布公告，增加 C 类收费模式，原收费模式称为 A 类。

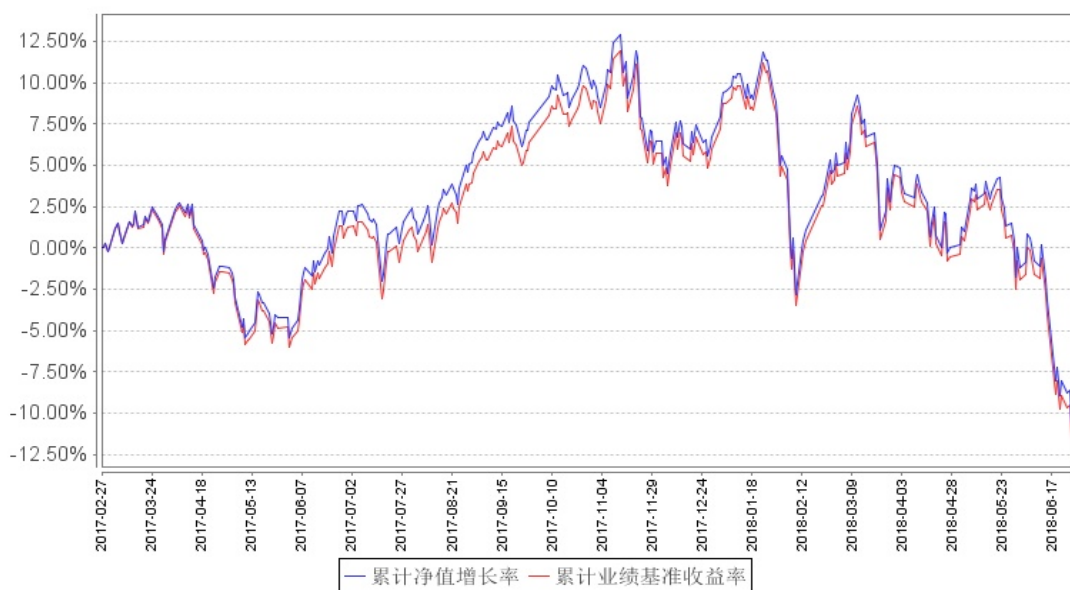


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

深成联接A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



深成联接C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金 2017 年 2 月 23 日新增 C 类份额。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司，注册资本金 3 亿元人民币。

目前股权结构：华泰证券股份有限公司 45%、深圳市投资控股有限公司 30%、厦门国际信托有限公司 15%及兴业证券股份有限公司 10%。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，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）管理资产规模近 7,800 亿元，旗下管理 167 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金和专户理财投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙伟	本基金基金经理	2016 年 8 月 19 日	-	8	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. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《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》的规定，本着

诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

深证成指本报告期下跌15.04%。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（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离，以及停牌股票的估值调整影响；（4）根据指数半年度成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金A份额净值为0.7812元，报告期内，份额净值增长率为-13.84%，同期业绩基准增长率为-14.30%；本基金C份额净值为0.7781元，报告期内，份额净值增长率为-14.01%，同期业绩基准增长率为-14.30%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来市场波动较大有内外两方面原因：内部主要矛盾在于经济增长和金融风险释放的预期，外部重要因素在于中美贸易摩擦升级和人民币汇率贬值。我们认为，经济自身仍将保持良好的增长韧性，且管理层在财政和货币政策上会有适当的预调微调；人民币汇率下行压力有限，中美贸易摩擦常态化仍然是未来较长时间需要关注的重要变量。在“新结构市场”以及“新增资金机构化”的大背景下，预计基本面优秀和估值具有安全边际的公司将继续受到投资者青睐。深证成指于 15 年 5 月正式扩容，成分股由 40 只增至 500 只，在传统支柱产业外更全面纳入新兴成长行业公司。自 15 年 6 月高点至本报告期末，指数估值已跌去六成以上，市盈率几乎处于扩容后的历史最低区域。展望后市，深证成指有望在估值及业绩间找到新的平衡点。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，同一类别每一基金份额享有同等分配权；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合相关基金分红条件的前提下，本基金每类基金份额的收益分配每年最多 6 次，各基金份额类别每次基金收益分配比例不得低于该类基金份额基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；本基金 A 类与 C 类基金份额收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金分红或将现金分红按除权日的该类基金份额净值自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金 A 类与 C 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；目

前本基金 H 类基金份额收益分配方式仅为现金分红；如未来条件允许，本基金 H 类基金份额可增加红利再投资的收益分配方式供 H 类基金份额持有人选择，该项调整须经基金管理人与基金托管人协商一致并报中国证监会备案并公告后实施，无需召开基金份额持有人大会审议；增加红利再投资的收益分配后，如 H 类基金份额持有人未选择，本基金 H 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2018 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.4.1	4,426,094.07	16,414,227.92
结算备付金		37,905.70	1,137.05
存出保证金		11,200.02	6,787.33
交易性金融资产	6.4.4.2	268,704,706.94	288,235,322.91
其中: 股票投资		10,697,835.59	5,174,950.96
基金投资		247,968,871.35	283,053,271.95
债券投资		10,038,000.00	7,100.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.4.5	89,945.71	3,238.58
应收股利		-	-
应收申购款		215,770.57	106,179.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	18,837.40	-
资产总计		273,504,460.41	304,766,893.40
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年6月30日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		200,418.43	337,299.29
应付管理人报酬		11,361.05	9,370.37
应付托管费		2,272.18	1,874.09
应付销售服务费		922.01	213.72
应付交易费用	6.4.4.7	2,924.08	1,643.74
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	175,816.02	354,316.92
负债合计		393,713.77	704,718.13
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.4.9	349,616,717.00	335,364,316.58
未分配利润	6.4.4.10	-76,505,970.36	-31,302,141.31

所有者权益合计		273,110,746.64	304,062,175.27
负债和所有者权益总计		273,504,460.41	304,766,893.40

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额 349,616,717.00 份，其中南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金 A 类基金份额总额 345,107,824.68 份，基金份额净值为 0.7812 元；南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金 C 类基金份额 4,508,892.32 份，基金份额净值为 0.7781 元。

## 6.2 利润表

会计主体：南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-42,068,172.88	14,218,618.37
1. 利息收入		136,866.79	189,194.32
其中：存款利息收入	6.4.4.11	39,727.41	32,172.42
债券利息收入		97,139.38	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	157,021.90
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-88,012.88	51,794.20
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-821,962.77	116,202.55
基金投资收益	6.4.4.13	657,243.45	-94,991.30
债券投资收益	6.4.4.14	4,185.48	-
资产支持证券投资收益	6.4.4.14.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.4.15	-	-
衍生工具收益	6.4.4.16	-	-
股利收益	6.4.4.17	72,520.96	30,582.95
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	-42,140,066.36	13,964,636.13
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.19	23,039.57	12,993.72
减：二、费用		275,791.48	253,544.74
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	58,859.00	46,451.37
2. 托管费	6.4.7.2.2	11,771.76	9,290.27
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	3,553.39	708.37
4. 交易费用	6.4.4.20	25,741.95	18,462.43

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	6.4.4.21	175,670.47	178,632.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-42,343,964.36	13,965,073.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-42,343,964.36	13,965,073.63

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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）	378,088,340.31	-64,352,367.03	313,735,973.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,965,073.63	13,965,073.63



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）	-11,464,745.26	1,451,813.33	-10,012,931.93
其中：1. 基金申购款	18,085,557.80	-3,126,150.11	14,959,407.69
2. 基金赎回款	-29,550,303.06	4,577,963.44	-24,972,339.62
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）	366,623,595.05	-48,935,480.07	317,688,114.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨小松

徐超

徐超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

### 6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c)对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(d)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

#### 6.4.4 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	4,426,094.07
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 个月及以上	-
其他存款	-
合计	4,426,094.07

##### 6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	11,637,433.25	10,697,835.59	-939,597.66
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	10,018,743.10	10,038,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	10,018,743.10	10,038,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	270,210,362.10	247,968,871.35	-22,241,490.75
其他	-	-	-
合计	291,866,538.45	268,704,706.94	-23,161,831.51

#### 6.4.4.3 衍生金融资产/负债

注:无。

#### 6.4.4.4 买入返售金融资产

注:无。

#### 6.4.4.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	860.33
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	17.87
应收债券利息	89,063.01
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	4.50
合计	89,945.71

#### 6.4.4.6 其他资产

单位:人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	-
可收退补款	18,837.40

合计	18,837.40
----	-----------

#### 6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,924.08
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,924.08

#### 6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	269.55
预提费用	175,546.47
合计	175,816.02

#### 6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 深成联接 A

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	334,402,166.11	334,402,166.11
本期申购	43,685,235.90	43,685,235.90
本期赎回（以“-”号填列）	-32,979,577.33	-32,979,577.33
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	345,107,824.68	345,107,824.68

##### 深成联接 C

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	962,150.47	962,150.47
本期申购	8,507,931.57	8,507,931.57
本期赎回（以“-”号填列）	-4,961,189.72	-4,961,189.72
-基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	4,508,892.32	4,508,892.32

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额

#### 6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

深成联接 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	62,177,477.51	-93,388,088.43	-31,210,610.92
本期利润	-193,424.03	-41,917,147.07	-42,110,571.10
本期基金份额交易产生的变动数	2,018,645.74	-4,203,040.18	-2,184,394.44
其中：基金申购款	8,195,650.32	-13,778,895.63	-5,583,245.31
基金赎回款	-6,177,004.58	9,575,855.45	3,398,850.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	64,002,699.22	-139,508,275.68	-75,505,576.46
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	177,247.62	-268,778.01	-91,530.39
本期利润	-10,473.97	-222,919.29	-233,393.26
本期基金份额交易产生的变动数	653,957.44	-1,329,427.69	-675,470.25
其中：基金申购款	1,571,596.17	-2,770,449.82	-1,198,853.65
基金赎回款	-917,638.73	1,441,022.13	523,383.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	820,731.09	-1,821,124.99	-1,000,393.90

#### 6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	39,148.74
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	489.81
其他	88.86
合计	39,727.41

#### 6.4.4.12 股票投资收益

##### 6.4.4.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,253.12
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-830,215.89
合计	-821,962.77

##### 6.4.4.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日
卖出股票成交总额	16,624,322.28
减：卖出股票成本总额	16,616,069.16
买卖股票差价收入	8,253.12

##### 6.4.4.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日
申购基金份额总额	13,006,500.00
减：现金支付申购款总额	128,484.01
减：申购股票成本总额	13,708,231.88
申购差价收入	-830,215.89

#### 6.4.4.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	7,328,642.37
减：卖出/赎回基金成本总额	6,671,398.92
基金投资收益	657,243.45

#### 6.4.4.14 债券投资收益

##### 6.4.4.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至 2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	4,185.48
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	4,185.48

#### 6.4.4.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至 2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,541,866.86
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,420,067.79
减：应收利息总额	117,613.59
买卖债券差价收入	4,185.48

#### 6.4.4.14.3 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 6.4.4.15 贵金属投资收益

注：无。

#### 6.4.4.16 衍生工具收益

注：无。

#### 6.4.4.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至 2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	72,520.96
基金投资产生的股利收益	-
合计	72,520.96

#### 6.4.4.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年1月1日至 2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-42,140,066.36

股票投资	-742,218.02
债券投资	19,256.90
资产支持证券投资	-
基金投资	-41,417,105.24
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
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	-42,140,066.36

#### 6.4.4.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	20,153.72
补差费归资产	2,885.85
合计	23,039.57

#### 6.4.4.20 交易费用

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	25,339.29
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	402.66
其中：申购费	-
赎回费	-
其他	402.66
合计	25,741.95

#### 6.4.4.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	26,778.95
信息披露费	148,767.52
银行费用	124.00
合计	175,670.47

注：于2016年3月31日前，指数使用费为支付给标的指数供应商的指数授权使用费，按前一日基金资产净值扣除所持有深证成份交易型开放式指数证券投资基金部分资产后的余额（若为负数，则取零）的0.02%的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数授权使用费不设最低下限金额。



自 2016 年 4 月 1 日起，本基金不再支付标的指数的指数使用费。

#### 6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.6 关联方关系

##### 6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限公司	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：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》，公司名称由“南方基金管理有限公司”变更为“南方基金管理股份有限公司”，公司股权结构等事项未发生变化，并已于 2018 年 1 月 4 日在深圳市市场监督管理局完成相应变更登记手续。

#### 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	45,833,584.97	100.00	18,969,041.48	100.00

## 6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
华泰证券	3,428,224.15	25.49	0.00	0.00

## 6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
华泰证券	2,100,000.00	100.00	-	-

## 6.4.7.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	19,677,898.92	100.00	-	-

## 6.4.7.1.5 权证交易

注：无。

## 6.4.7.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	1,897.58	100.00	1,077.15	100.00

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

## 6.4.7.2 关联方报酬

### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	58,859.00	46,451.37
其中:支付销售机构的客户维护费	134,886.18	73,238.20

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:

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

### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	11,771.76	9,290.27

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

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

X 0.10% / 当年天数。

### 6.4.7.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
南方基金	-	708.37	708.37
合计	-	708.37	708.37

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 0.40% 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。

### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

#### 6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:无。

#### 6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
中国工商银行股份有限公司	4,426,094.07	39,148.74	15,744,970.92	25,732.74

注:本基金由基金托管人中国工商银行保管的银行存款,按银行约定利率计息。

#### 6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

#### 6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.7.7.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末,本基金持有 243,321,432 份目标 ETF 基金份额,占其份额的比例为 61.73%。

##### 6.4.7.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用 2018年1月1日至2018年 6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 6月30日
当期交易基金产生的申购费(元)	-	-
当期交易基金产生的赎回费(元)	-	-
当期交易基金产生的其他费(元)	402.66	322.48
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	-	-
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	670,291.56	725,061.55
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	134,058.31	145,012.31

注:申购费、赎回费是实际产生的费用,销售服务费、管理费和托管费等其他费用为估算费用。

#### 6.4.8 利润分配情况

注:无。

## 6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无。

## 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位: 人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日 期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000008	神州 高铁	2018- 06-06	重大事项	4.41	2018- 08-07	4.46	1,400	9,243.71	6,174.00	-
000426	兴业 矿业	2018- 06-18	重大事项	7.21	-	-	400	3,707.24	2,884.00	-
000540	中天 金融	2017- 08-21	重大资产重 组	4.18	-	-	11,700	57,362.60	48,906.00	-
000566	海南 海药	2017- 11-22	重大资产重 组	12.89	2018- 07-09	11.60	1,285	16,594.64	16,563.65	-
000587	金洲 慈航	2018- 06-15	重大事项	4.96	2018- 07-02	4.46	500	3,567.57	2,480.00	-
000693	*ST 华泽	2018- 04-30	未及时披露 定期报告	3.31	-	-	200	2,500.00	662.00	-
000825	太钢 不锈	2018- 04-16	重大资产重 组	6.00	-	-	1,400	7,916.74	8,400.00	-
000939	*ST 凯迪	2017- 11-16	实行退市风 险警示公告	4.99	2018- 07-02	4.74	1,000	4,988.73	4,990.00	-
002011	盾安 环境	2018- 04-30	重大资产重 组	6.40	-	-	300	2,124.89	1,920.00	-
002075	沙钢 股份	2016- 09-15	重大资产重 组	16.12	-	-	8,200	131,085.20	132,184.00	-
002089	新 海 宜	2018- 04-20	重大资产重 组	6.05	2018- 07-20	5.45	500	2,925.60	3,025.00	-
002310	东方 园林	2018- 05-25	重大资产重 组	15.03	-	-	750	14,771.04	11,272.50	-
002359	北讯 集团	2018- 05-21	拟披露重大 事项	19.58	2018- 08-21	17.62	400	10,489.35	7,832.00	-
002408	齐翔 腾达	2018- 06-18	重大资产重 组	12.28	-	-	1,000	13,607.69	12,280.00	-
002411	必康 股份	2018- 06-18	拟披露重大 事项	28.34	-	-	300	8,578.23	8,502.00	-
002426	胜利 精密	2018- 06-18	拟披露重大 事项	3.60	2018- 07-03	3.26	2,250	10,639.94	8,100.00	-

002431	棕榈股份	2018-05-30	重大事项	6.71	-	-	700	5,193.55	4,697.00	-
002437	誉衡药业	2018-06-11	重大资产重组	6.20	2018-08-13	5.57	900	6,132.00	5,580.00	-
002450	康得新	2018-06-04	重大资产重组	17.08	-	-	1,600	33,291.32	27,328.00	-
002477	雏鹰农牧	2018-06-14	重大事项	3.31	-	-	2,000	7,450.49	6,620.00	-
002512	达华智能	2018-06-18	拟披露重大事项	9.70	-	-	400	4,919.35	3,880.00	-
002573	清新环境	2018-06-18	拟披露重大事项	11.55	-	-	800	11,535.94	9,240.00	-
002602	世纪华通	2018-06-12	重大资产重组	32.50	-	-	300	10,334.74	9,750.00	-
002610	爱康科技	2018-06-05	重大事项	2.10	-	-	2,900	6,578.72	6,090.00	-
002665	首航节能	2018-05-29	重大资产重组	5.80	-	-	940	6,161.03	5,452.00	-
002668	奥马电器	2018-06-15	拟披露重大事项	20.10	-	-	380	9,193.41	7,638.00	-
002716	金贵银业	2018-05-03	重大资产重组	16.84	-	-	300	5,791.90	5,052.00	-
002739	万达电影	2017-07-04	重大资产重组	52.04	-	-	1,400	72,856.00	72,856.00	-
300072	三聚环保	2018-06-18	拟披露重大事项	23.28	2018-07-10	24.00	900	26,774.03	20,952.00	-
300090	盛运环保	2018-06-04	拟披露重大事项	8.32	2018-07-02	7.49	300	2,954.64	2,496.00	-
300118	东方日升	2018-05-07	重大资产重组	9.45	2018-08-07	9.63	500	5,800.65	4,725.00	-
300197	铁汉生态	2018-05-28	重大资产重组	5.37	-	-	640	4,617.36	3,436.80	-
300324	旋极信息	2018-05-30	重大资产重组	9.49	-	-	655	7,393.80	6,215.95	-

注:本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注:无。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.10 金融工具风险及管理

#### 6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

#### 6.4.10.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所



进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2018 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。

#### 6.4.10.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.10.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金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 6.4.9。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。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

#### 6.4.10.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.10.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

#### 6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018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	4,426,094.07	-	-	-	4,426,094.07
结算备付金	37,905.70	-	-	-	37,905.70
存出保证金	11,200.02	-	-	-	11,200.02
交易性金融资产	10,038,000.00	-	-	-258,666,706.94	268,704,706.94
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	89,945.71	89,945.71
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	215,770.57	215,770.57
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	18,837.40	18,837.40
资产总计	14,513,199.79	-	-	-258,991,260.62	273,504,460.41
负债					
应付赎回款	-	-	-	200,418.43	200,418.43
应付管理人报酬	-	-	-	11,361.05	11,361.05
应付托管费	-	-	-	2,272.18	2,272.18
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	922.01	922.01
应付交易费用	-	-	-	2,924.08	2,924.08
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	175,816.02	175,816.02
负债总计	-	-	-	393,713.77	393,713.77
利率敏感度缺口	14,513,199.79	-	-	-258,597,546.85	273,110,746.64
上年度末 2017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	16,414,227.92	-	-	-	16,414,227.92
结算备付金	1,137.05	-	-	-	1,137.05
存出保证金	6,787.33	-	-	-	6,787.33
交易性金融资产	-	500.00	6,600.00	288,228,222.91	288,235,322.91
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	3,238.58	3,238.58
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	4,136.51	-	-	102,043.10	106,179.61
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,426,288.81	500.00	6,600.00	288,333,504.59	304,766,893.40
负债					
应付赎回款	-	-	-	337,299.29	337,299.29
应付管理人报酬	-	-	-	9,370.37	9,370.37
应付托管费	-	-	-	1,874.09	1,874.09
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	213.72	213.72
应付交易费用	-	-	-	1,643.74	1,643.74
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	354,316.92	354,316.92
负债总计	-	-	-	704,718.13	704,718.13
利率敏感度缺口	16,426,288.81	500.00	6,600.00	287,628,786.46	304,062,175.27

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。

#### 6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注:于 2018 年 6 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 3.68%,因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.10.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

#### 6.4.10.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于能通过股票组合赎回或二级市场交

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

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

#### 6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017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	10,697,835.59	3.92	5,174,950.96	1.70
交易性金融资产—基金投资	247,968,871.35	90.79	283,053,271.95	93.09
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	258,666,706.94	94.71	288,228,222.91	94.79

#### 6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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 (2018年 6月30日)	上年度末 (2017年 12月31日)	
分析	1. 业绩比较基准上升 5%	20,688,829.32	14,340,724.27
	2. 业绩比较基准下降 5%	-20,688,829.32	-14,340,724.27

## 6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	10,697,835.59	3.91
	其中：股票	10,697,835.59	3.91
2	基金投资	247,968,871.35	90.66
3	固定收益投资	10,038,000.00	3.67
	其中：债券	10,038,000.00	3.67
	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	4,463,999.77	1.63
8	其他各项资产	335,753.70	0.12
9	合计	273,504,460.41	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	251,626.40	0.09
B	采矿业	94,446.60	0.03
C	制造业	6,835,191.21	2.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	127,011.00	0.05
E	建筑业	153,547.50	0.06
F	批发和零售业	308,472.60	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	64,660.00	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,029,039.16	0.38
J	金融业	601,100.07	0.22
K	房地产业	593,131.20	0.22
L	租赁和商务服务业	164,602.78	0.06
M	科学研究和技术服务业	16,733.20	0.01

N	水利、环境和公共设施管理业	86,129.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	149,604.75	0.05
R	文化、体育和娱乐业	201,174.22	0.07
S	综合	21,365.90	0.01
	合计	10,697,835.59	3.92

### 7.2.2 报告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股票投资。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	000333	美的集团	8,500	443,870.00	0.16
2	000651	格力电器	9,000	424,350.00	0.16
3	000858	五粮液	3,500	266,000.00	0.10
4	002415	海康威视	6,300	233,919.00	0.09
5	000002	万科A	7,600	186,960.00	0.07
6	000725	京东方A	47,700	168,858.00	0.06
7	300498	温氏股份	7,020	154,580.40	0.06
8	002304	洋河股份	1,100	144,760.00	0.05
9	000001	平安银行	15,900	144,531.00	0.05
10	002075	沙钢股份	8,200	132,184.00	0.05
11	002027	分众传媒	9,936	95,087.52	0.03
12	002230	科大讯飞	2,900	93,003.00	0.03
13	002024	苏宁易购	6,500	91,520.00	0.03
14	002008	大族激光	1,700	90,423.00	0.03
15	300059	东方财富	6,804	89,676.72	0.03
16	000538	云南白药	800	85,568.00	0.03
17	000568	泸州老窖	1,400	85,204.00	0.03
18	000338	潍柴动力	9,000	78,750.00	0.03
19	002475	立讯精密	3,400	76,636.00	0.03
20	002594	比亚迪	1,600	76,288.00	0.03
21	000776	广发证券	5,700	75,639.00	0.03
22	002739	万达电影	1,400	72,856.00	0.03
23	001979	招商蛇口	3,700	70,485.00	0.03
24	002236	大华股份	3,100	69,905.00	0.03
25	002142	宁波银行	4,290	69,884.10	0.03
26	002466	天齐锂业	1,390	68,930.10	0.03
27	000661	长春高新	300	68,310.00	0.03

28	300124	汇川技术	2,000	65,640.00	0.02
29	000963	华东医药	1,300	62,725.00	0.02
30	300003	乐普医疗	1,700	62,356.00	0.02
31	002456	欧菲科技	3,800	61,294.00	0.02
32	000063	中兴通讯	4,500	58,635.00	0.02
33	002044	美年健康	2,580	58,308.00	0.02
34	000166	申万宏源	12,500	54,625.00	0.02
35	002422	科伦药业	1,700	54,570.00	0.02
36	002460	赣锋锂业	1,400	54,012.00	0.02
37	000423	东阿阿胶	1,000	53,810.00	0.02
38	002202	金风科技	4,070	51,444.80	0.02
39	300015	爱尔眼科	1,575	50,856.75	0.02
40	300408	三环集团	2,100	49,350.00	0.02
41	000540	中天金融	11,700	48,906.00	0.02
42	000100	TCL 集团	16,700	48,430.00	0.02
43	000895	双汇发展	1,800	47,538.00	0.02
44	000413	东旭光电	7,600	46,056.00	0.02
45	000069	华侨城 A	6,300	45,549.00	0.02
46	300136	信维通信	1,460	44,865.80	0.02
47	000503	国新健康	1,400	44,492.00	0.02
48	300142	沃森生物	2,200	43,956.00	0.02
49	000783	长江证券	7,800	42,354.00	0.02
50	300122	智飞生物	900	41,166.00	0.02
51	300070	碧水源	2,900	40,397.00	0.01
52	000768	中航飞机	2,500	39,100.00	0.01
53	300024	机器人	2,200	38,280.00	0.01
54	000977	浪潮信息	1,590	37,921.50	0.01
55	002241	歌尔股份	3,700	37,703.00	0.01
56	000157	中联重科	8,900	36,579.00	0.01
57	000625	长安汽车	4,000	36,000.00	0.01
58	000425	徐工机械	8,400	35,616.00	0.01
59	002572	索菲亚	1,100	35,398.00	0.01
60	300296	利亚德	2,700	34,776.00	0.01
61	002410	广联达	1,200	33,276.00	0.01
62	300144	宋城演艺	1,400	32,900.00	0.01
63	002340	格林美	5,430	32,851.50	0.01
64	002007	华兰生物	1,020	32,803.20	0.01
65	000830	鲁西化工	1,900	32,452.00	0.01
66	300017	网宿科技	2,999	32,119.29	0.01
67	000703	恒逸石化	2,120	31,545.60	0.01
68	002001	新 和 成	1,660	31,473.60	0.01
69	002736	国信证券	3,400	30,940.00	0.01



70	300347	泰格医药	500	30,935.00	0.01
71	002049	紫光国微	700	30,884.00	0.01
72	002038	双鹭药业	800	30,392.00	0.01
73	002405	四维图新	1,500	30,375.00	0.01
74	002146	荣盛发展	3,400	29,682.00	0.01
75	000623	吉林敖东	1,650	29,667.00	0.01
76	000786	北新建材	1,600	29,648.00	0.01
77	002271	东方雨虹	1,730	29,427.30	0.01
78	002065	东华软件	3,400	29,240.00	0.01
79	000792	盐湖股份	2,650	28,673.00	0.01
80	300168	万达信息	1,400	28,560.00	0.01
81	000728	国元证券	3,850	28,490.00	0.01
82	000998	隆平高科	1,500	28,290.00	0.01
83	002050	三花智控	1,500	28,275.00	0.01
84	002179	中航光电	720	28,080.00	0.01
85	000418	小天鹅A	400	27,740.00	0.01
86	002673	西部证券	3,660	27,633.00	0.01
87	002311	海大集团	1,300	27,430.00	0.01
88	002450	康得新	1,600	27,328.00	0.01
89	002508	老板电器	890	27,251.80	0.01
90	002797	第一创业	3,980	26,944.60	0.01
91	000630	铜陵有色	12,100	26,741.00	0.01
92	002714	牧原股份	600	26,676.00	0.01
93	002129	中环股份	3,400	26,622.00	0.01
94	300253	卫宁健康	2,120	26,266.80	0.01
95	002081	金螳螂	2,600	26,260.00	0.01
96	000860	顺鑫农业	700	26,250.00	0.01
97	002092	中泰化学	2,700	26,028.00	0.01
98	002294	信立泰	700	26,019.00	0.01
99	000066	中国长城	3,644	25,908.84	0.01
100	000513	丽珠集团	589	25,886.55	0.01
101	000876	新希望	4,000	25,360.00	0.01
102	000709	河钢股份	8,400	24,780.00	0.01
103	000656	金科股份	5,100	24,480.00	0.01
104	000826	启迪桑德	1,400	24,472.00	0.01
105	000581	威孚高科	1,100	24,321.00	0.01
106	000050	深天马A	1,700	24,174.00	0.01
107	002465	海格通信	3,000	24,090.00	0.01
108	000839	中信国安	5,050	23,886.50	0.01
109	002176	江特电机	2,400	23,328.00	0.01
110	002078	太阳纸业	2,400	23,256.00	0.01
111	000690	宝新能源	3,300	22,968.00	0.01

112	002493	荣盛石化	2,225	22,962.00	0.01
113	002195	二三四五	5,362	22,949.36	0.01
114	000983	西山煤电	3,000	22,530.00	0.01
115	000961	中南建设	3,550	22,400.50	0.01
116	000060	中金岭南	4,550	22,113.00	0.01
117	002019	亿帆医药	1,250	22,062.50	0.01
118	300088	长信科技	3,800	22,040.00	0.01
119	002035	华帝股份	900	21,987.00	0.01
120	000488	晨鸣纸业	1,700	21,964.00	0.01
121	002624	完美世界	700	21,707.00	0.01
122	002589	瑞康医药	1,590	21,687.60	0.01
123	002085	万丰奥威	2,300	21,620.00	0.01
124	002127	南极电商	2,300	21,597.00	0.01
125	002217	合力泰	2,600	21,450.00	0.01
126	002223	鱼跃医疗	1,100	21,439.00	0.01
127	000039	中集集团	1,600	21,248.00	0.01
128	300450	先导智能	699	21,137.76	0.01
129	300072	三聚环保	900	20,952.00	0.01
130	002221	东华能源	2,100	20,517.00	0.01
131	000997	新大陆	1,300	20,475.00	0.01
132	300166	东方国信	1,380	20,327.40	0.01
133	000887	中鼎股份	1,400	20,174.00	0.01
134	300433	蓝思科技	960	20,140.80	0.01
135	300383	光环新网	1,500	20,115.00	0.01
136	002371	北方华创	400	19,868.00	0.01
137	300315	掌趣科技	4,700	19,646.00	0.01
138	002640	跨境通	1,300	19,526.00	0.01
139	300170	汉得信息	1,200	19,488.00	0.01
140	000999	华润三九	700	19,481.00	0.01
141	300009	安科生物	1,048	19,325.12	0.01
142	300182	捷成股份	2,549	19,321.42	0.01
143	000402	金融街	2,400	19,320.00	0.01
144	002470	金正大	2,800	19,264.00	0.01
145	002384	东山精密	800	19,200.00	0.01
146	002074	国轩高科	1,360	19,121.60	0.01
147	002439	启明星辰	900	19,098.00	0.01
148	002500	山西证券	2,800	18,872.00	0.01
149	000938	紫光股份	300	18,780.00	0.01
150	002013	中航机电	2,475	18,735.75	0.01
151	002183	怡亚通	2,800	18,620.00	0.01
152	000040	东旭蓝天	1,800	18,180.00	0.01
153	002185	华天科技	3,200	18,048.00	0.01

154	300027	华谊兄弟	2,900	17,864.00	0.01
155	000596	古井贡酒	200	17,756.00	0.01
156	300271	华宇软件	1,000	17,680.00	0.01
157	000930	中粮生化	1,700	17,510.00	0.01
158	000732	泰禾集团	900	17,505.00	0.01
159	000750	国海证券	4,900	17,493.00	0.01
160	002153	石基信息	600	17,400.00	0.01
161	002385	大北农	4,200	17,346.00	0.01
162	000988	华工科技	1,200	17,340.00	0.01
163	000671	阳光城	2,900	17,313.00	0.01
164	300073	当升科技	500	17,030.00	0.01
165	000960	锡业股份	1,400	16,814.00	0.01
166	300558	贝达药业	300	16,701.00	0.01
167	002558	巨人网络	700	16,646.00	0.01
168	000566	海南海药	1,285	16,563.65	0.01
169	000046	泛海控股	2,900	16,501.00	0.01
170	000009	中国宝安	3,341	16,370.90	0.01
171	002273	水晶光电	1,270	16,344.90	0.01
172	300251	光线传媒	1,600	16,288.00	0.01
173	000778	新兴铸管	3,800	16,264.00	0.01
174	002110	三钢闽光	1,000	16,030.00	0.01
175	000686	东北证券	2,500	16,025.00	0.01
176	002506	协鑫集成	3,400	15,912.00	0.01
177	300014	亿纬锂能	899	15,822.40	0.01
178	002497	雅化集团	1,500	15,810.00	0.01
179	002268	卫士通	720	15,717.60	0.01
180	000559	万向钱潮	2,300	15,640.00	0.01
181	000975	银泰资源	1,540	15,615.60	0.01
182	300033	同花顺	400	15,548.00	0.01
183	002399	海普瑞	700	15,498.00	0.01
184	000729	燕京啤酒	2,300	15,479.00	0.01
185	002032	苏泊尔	300	15,450.00	0.01
186	002168	深圳惠程	1,500	15,420.00	0.01
187	300203	聚光科技	600	15,360.00	0.01
188	300413	芒果超媒	400	15,176.00	0.01
189	300418	昆仑万维	800	15,104.00	0.01
190	000401	冀东水泥	1,700	15,079.00	0.01
191	000807	云铝股份	2,900	15,022.00	0.01
192	000028	国药一致	300	14,970.00	0.01
193	000547	航天发展	1,900	14,839.00	0.01
194	300274	阳光电源	1,640	14,710.80	0.01
195	300010	立思辰	1,200	14,688.00	0.01

196	002030	达安基因	943	14,541.06	0.01
197	002368	太极股份	500	14,535.00	0.01
198	300133	华策影视	1,360	14,484.00	0.01
199	000717	韶钢松山	2,200	14,432.00	0.01
200	002138	顺络电子	900	14,409.00	0.01
201	002373	千方科技	1,100	14,355.00	0.01
202	002396	星网锐捷	700	14,329.00	0.01
203	000878	云南铜业	1,500	14,310.00	0.01
204	000627	天茂集团	2,000	14,040.00	0.01
205	002440	闰土股份	1,200	14,028.00	0.01
206	000970	中科三环	1,500	14,025.00	0.01
207	002407	多氟多	1,000	14,020.00	0.01
208	300113	顺网科技	800	13,928.00	0.01
209	000898	鞍钢股份	2,500	13,925.00	0.01
210	000799	酒鬼酒	500	13,875.00	0.01
211	300316	晶盛机电	1,040	13,821.60	0.01
212	002023	海特高新	1,100	13,794.00	0.01
213	300055	万邦达	1,200	13,788.00	0.01
214	002280	联络互动	2,400	13,728.00	0.01
215	300058	蓝色光标	2,400	13,680.00	0.01
216	300287	飞利信	1,900	13,661.00	0.01
217	000883	湖北能源	3,300	13,563.00	0.00
218	002244	滨江集团	2,600	13,520.00	0.00
219	002352	顺丰控股	300	13,500.00	0.00
220	002028	思源电气	800	13,432.00	0.00
221	000598	兴蓉环境	3,300	13,398.00	0.00
222	002491	通鼎互联	1,200	13,284.00	0.00
223	002383	合众思壮	800	13,240.00	0.00
224	300628	亿联网络	200	13,182.00	0.00
225	000089	深圳机场	1,700	13,005.00	0.00
226	002353	杰瑞股份	800	13,000.00	0.00
227	000078	海王生物	2,700	12,987.00	0.00
228	000516	国际医学	2,700	12,933.00	0.00
229	002563	森马服饰	900	12,870.00	0.00
230	300199	翰宇药业	900	12,852.00	0.00
231	002366	台海核电	900	12,834.00	0.00
232	000848	承德露露	1,200	12,708.00	0.00
233	002583	海能达	1,500	12,525.00	0.00
234	300463	迈克生物	500	12,465.00	0.00
235	002600	领益智造	2,400	12,456.00	0.00
236	000591	太阳能	3,400	12,444.00	0.00
237	002299	圣农发展	800	12,392.00	0.00

238	002408	齐翔腾达	1,000	12,280.00	0.00
239	300036	超图软件	600	12,234.00	0.00
240	002004	华邦健康	2,400	12,192.00	0.00
241	002597	金禾实业	600	12,168.00	0.00
242	002358	森源电气	800	12,040.00	0.00
243	300355	蒙草生态	2,000	12,020.00	0.00
244	002343	慈文传媒	640	12,012.80	0.00
245	002701	奥瑞金	2,200	12,012.00	0.00
246	000738	航发控制	900	11,997.00	0.00
247	300098	高新兴	1,498	11,954.04	0.00
248	002174	游族网络	600	11,940.00	0.00
249	300115	长盈精密	920	11,932.40	0.00
250	000981	银亿股份	1,600	11,920.00	0.00
251	300496	中科创达	400	11,788.00	0.00
252	000059	华锦股份	1,700	11,713.00	0.00
253	002601	龙蟠佰利	900	11,637.00	0.00
254	002709	天赐材料	300	11,562.00	0.00
255	300377	赢时胜	850	11,551.50	0.00
256	002025	航天电器	500	11,550.00	0.00
257	000917	电广传媒	2,000	11,520.00	0.00
258	002517	恺英网络	1,600	11,504.00	0.00
259	002131	利欧股份	5,410	11,361.00	0.00
260	002310	东方园林	750	11,272.50	0.00
261	300367	东方网力	900	11,250.00	0.00
262	000800	一汽轿车	1,500	11,220.00	0.00
263	002191	劲嘉股份	1,500	11,205.00	0.00
264	002603	以岭药业	800	11,184.00	0.00
265	000012	南玻A	2,254	11,157.30	0.00
266	300077	国民技术	1,000	11,120.00	0.00
267	000902	新洋丰	1,200	11,040.00	0.00
268	002152	广电运通	1,875	11,025.00	0.00
269	002444	巨星科技	1,000	11,010.00	0.00
270	000031	中粮地产	1,900	10,982.00	0.00
271	300212	易华录	460	10,879.00	0.00
272	002266	浙富控股	2,900	10,875.00	0.00
273	300294	博雅生物	350	10,846.50	0.00
274	300068	南都电源	900	10,782.00	0.00
275	300037	新宙邦	400	10,716.00	0.00
276	002745	木林森	600	10,674.00	0.00
277	002285	世联行	1,700	10,659.00	0.00
278	300159	新研股份	1,500	10,620.00	0.00
279	002281	光迅科技	500	10,600.00	0.00

280	002036	联创电子	800	10,496.00	0.00
281	300053	欧比特	900	10,440.00	0.00
282	002595	豪迈科技	600	10,434.00	0.00
283	000027	深圳能源	2,100	10,374.00	0.00
284	002108	沧州明珠	1,764	10,354.68	0.00
285	000507	珠海港	1,100	10,318.00	0.00
286	002151	北斗星通	400	10,280.00	0.00
287	002424	贵州百灵	900	10,224.00	0.00
288	300026	红日药业	2,800	10,220.00	0.00
289	000933	神火股份	2,100	10,101.00	0.00
290	000710	贝瑞基因	200	10,072.00	0.00
291	000926	福星股份	1,400	10,066.00	0.00
292	002505	大康农业	4,700	10,058.00	0.00
293	002664	长鹰信质	400	10,040.00	0.00
294	002831	裕同科技	200	10,000.00	0.00
295	002128	露天煤业	1,100	9,966.00	0.00
296	000006	深振业 A	1,700	9,962.00	0.00
297	300207	欣旺达	1,100	9,911.00	0.00
298	000758	中色股份	2,200	9,900.00	0.00
299	300101	振芯科技	700	9,891.00	0.00
300	002048	宁波华翔	800	9,864.00	0.00
301	002056	横店东磁	1,400	9,814.00	0.00
302	002602	世纪华通	300	9,750.00	0.00
303	002250	联化科技	1,100	9,702.00	0.00
304	002277	友阿股份	2,100	9,681.00	0.00
305	300459	金科文化	1,000	9,660.00	0.00
306	300002	神州泰岳	2,300	9,591.00	0.00
307	000727	华东科技	5,100	9,588.00	0.00
308	002155	湖南黄金	1,400	9,576.00	0.00
309	000021	深科技	1,400	9,548.00	0.00
310	000718	苏宁环球	2,600	9,542.00	0.00
311	300020	银江股份	1,000	9,510.00	0.00
312	300244	迪安诊断	500	9,505.00	0.00
313	000036	华联控股	1,600	9,504.00	0.00
314	000766	通化金马	800	9,504.00	0.00
315	002389	南洋科技	700	9,478.00	0.00
316	300145	中金环境	1,200	9,396.00	0.00
317	000400	许继电气	1,200	9,372.00	0.00
318	300222	科大智能	500	9,270.00	0.00
319	000543	皖能电力	2,100	9,261.00	0.00
320	002573	清新环境	800	9,240.00	0.00
321	300257	开山股份	600	9,174.00	0.00

322	002672	东江环保	700	9,163.00	0.00
323	002233	塔牌集团	800	9,152.00	0.00
324	002237	恒邦股份	1,000	9,130.00	0.00
325	300001	特锐德	800	9,088.00	0.00
326	000712	锦龙股份	900	8,982.00	0.00
327	002292	奥飞娱乐	1,000	8,930.00	0.00
328	002421	达实智能	2,200	8,910.00	0.00
329	002242	九阳股份	500	8,845.00	0.00
330	000563	陕国投 A	2,600	8,840.00	0.00
331	002390	信邦制药	1,200	8,784.00	0.00
332	000685	中山公用	1,100	8,767.00	0.00
333	300078	思创医惠	920	8,721.60	0.00
334	002099	海翔药业	1,700	8,721.00	0.00
335	002449	国星光电	810	8,618.40	0.00
336	002635	安洁科技	500	8,600.00	0.00
337	002400	省广集团	2,662	8,598.26	0.00
338	002841	视源股份	160	8,545.60	0.00
339	300038	梅泰诺	800	8,528.00	0.00
340	000667	美好置业	4,000	8,520.00	0.00
341	000620	新华联	1,500	8,505.00	0.00
342	002555	三七互娱	700	8,505.00	0.00
343	002411	必康股份	300	8,502.00	0.00
344	002670	国盛金控	781	8,411.37	0.00
345	000825	太钢不锈	1,400	8,400.00	0.00
346	002308	威创股份	1,000	8,300.00	0.00
347	002022	科华生物	700	8,295.00	0.00
348	000687	华讯方舟	900	8,289.00	0.00
349	000921	海信科龙	800	8,288.00	0.00
350	002130	沃尔核材	1,900	8,284.00	0.00
351	002180	纳思达	300	8,238.00	0.00
352	000592	平潭发展	2,900	8,236.00	0.00
353	002544	杰赛科技	600	8,214.00	0.00
354	002426	胜利精密	2,250	8,100.00	0.00
355	002501	利源精制	1,300	8,060.00	0.00
356	002073	软控股份	1,400	8,050.00	0.00
357	000901	航天科技	800	8,016.00	0.00
358	300079	数码科技	2,200	8,008.00	0.00
359	002123	梦网集团	900	8,001.00	0.00
360	300137	神州数码	500	7,990.00	0.00
361	000034	先河环保	500	7,990.00	0.00
362	002055	得润电子	500	7,975.00	0.00
363	000869	张裕 A	200	7,972.00	0.00

364	300185	通裕重工	4,400	7,964.00	0.00
365	002657	中科金财	500	7,920.00	0.00
366	000088	盐田港	1,200	7,908.00	0.00
367	002434	万里扬	900	7,902.00	0.00
368	002359	北讯集团	400	7,832.00	0.00
369	002429	兆驰股份	3,150	7,812.00	0.00
370	000937	冀中能源	1,900	7,809.00	0.00
371	300157	恒泰艾普	1,200	7,800.00	0.00
372	300085	银之杰	600	7,788.00	0.00
373	002245	澳洋顺昌	1,200	7,764.00	0.00
374	300323	华灿光电	600	7,752.00	0.00
375	300083	劲胜智能	1,600	7,712.00	0.00
376	000762	西藏矿业	800	7,704.00	0.00
377	300618	寒锐钴业	60	7,700.40	0.00
378	000979	中弘股份	7,620	7,696.20	0.00
379	300352	北信源	1,900	7,676.00	0.00
380	002668	奥马电器	380	7,638.00	0.00
381	002047	宝鹰股份	1,300	7,618.00	0.00
382	000877	天山股份	1,100	7,425.00	0.00
383	002303	美盈森	1,400	7,392.00	0.00
384	002642	荣之联	800	7,352.00	0.00
385	002503	搜于特	2,100	7,350.00	0.00
386	000829	天音控股	1,000	7,330.00	0.00
387	000158	常山北明	1,060	7,282.20	0.00
388	000600	建投能源	1,300	7,241.00	0.00
389	000061	农产品	1,300	7,020.00	0.00
390	000990	诚志股份	500	7,000.00	0.00
391	000822	山东海化	1,000	6,970.00	0.00
392	002157	正邦科技	1,700	6,919.00	0.00
393	002608	江苏国信	1,000	6,900.00	0.00
394	002249	大洋电机	1,600	6,896.00	0.00
395	002043	兔宝宝	900	6,894.00	0.00
396	002468	申通快递	400	6,860.00	0.00
397	000751	锌业股份	2,100	6,846.00	0.00
398	000612	焦作万方	1,300	6,825.00	0.00
399	300075	数字政通	500	6,745.00	0.00
400	002643	万润股份	900	6,723.00	0.00
401	000090	天健集团	1,080	6,696.00	0.00
402	300284	苏交科	840	6,661.20	0.00
403	002145	中核钛白	1,800	6,624.00	0.00
404	002477	雏鹰农牧	2,000	6,620.00	0.00
405	002489	浙江永强	1,800	6,552.00	0.00



406	002276	万马股份	1,100	6,424.00	0.00
407	002375	亚厦股份	1,200	6,408.00	0.00
408	000980	众泰汽车	900	6,399.00	0.00
409	000539	粤电力A	1,500	6,360.00	0.00
410	002091	江苏国泰	1,000	6,350.00	0.00
411	300156	神雾环保	950	6,336.50	0.00
412	002354	天神娱乐	680	6,296.80	0.00
413	002482	广田集团	1,050	6,268.50	0.00
414	000969	安泰科技	1,000	6,250.00	0.00
415	300506	名家汇	300	6,219.00	0.00
416	300324	旋极信息	655	6,215.95	0.00
417	002428	云南锗业	800	6,176.00	0.00
418	000008	神州高铁	1,400	6,174.00	0.00
419	300273	和佳股份	900	6,102.00	0.00
420	002610	爱康科技	2,900	6,090.00	0.00
421	002010	传化智联	500	6,075.00	0.00
422	002681	奋达科技	700	6,062.00	0.00
423	002625	光启技术	510	5,972.10	0.00
424	000680	山推股份	1,700	5,848.00	0.00
425	000973	佛塑科技	1,500	5,820.00	0.00
426	002106	莱宝高科	1,000	5,760.00	0.00
427	300310	宜通世纪	900	5,742.00	0.00
428	000875	吉电股份	2,000	5,660.00	0.00
429	000049	德赛电池	200	5,644.00	0.00
430	300291	华录百纳	800	5,640.00	0.00
431	300364	中文在线	800	5,632.00	0.00
432	002437	誉衡药业	900	5,580.00	0.00
433	002326	永太科技	800	5,560.00	0.00
434	002325	洪涛股份	1,500	5,550.00	0.00
435	002261	拓维信息	1,200	5,520.00	0.00
436	002665	首航节能	940	5,452.00	0.00
437	002413	雷科防务	1,000	5,390.00	0.00
438	002302	西部建设	500	5,385.00	0.00
439	300458	全志科技	300	5,376.00	0.00
440	002695	煌上煌	400	5,352.00	0.00
441	000959	首钢股份	1,300	5,343.00	0.00
442	000555	神州信息	400	5,312.00	0.00
443	002342	巨力索具	1,400	5,306.00	0.00
444	002120	韵达股份	100	5,305.00	0.00
445	002307	北新路桥	960	5,299.20	0.00
446	300116	坚瑞沃能	1,900	5,244.00	0.00
447	002773	康弘药业	100	5,201.00	0.00

448	000806	银河生物	1,200	5,196.00	0.00
449	002522	浙江众成	800	5,176.00	0.00
450	300431	暴风集团	340	5,161.20	0.00
451	002479	富春环保	900	5,085.00	0.00
452	002716	金贵银业	300	5,052.00	0.00
453	000881	中广核技	500	4,995.00	0.00
454	000939	凯迪生态	1,000	4,990.00	0.00
455	000801	四川九洲	1,100	4,917.00	0.00
456	002542	中化岩土	900	4,806.00	0.00
457	000957	中通客车	700	4,788.00	0.00
458	002041	登海种业	700	4,774.00	0.00
459	300118	东方日升	500	4,725.00	0.00
460	002431	棕榈股份	700	4,697.00	0.00
461	300474	景嘉微	100	4,648.00	0.00
462	000018	神州长城	1,400	4,648.00	0.00
463	002284	亚太股份	800	4,640.00	0.00
464	300134	大富科技	500	4,470.00	0.00
465	000558	莱茵体育	1,200	4,296.00	0.00
466	300359	全通教育	600	4,272.00	0.00
467	300304	云意电气	1,000	4,200.00	0.00
468	000802	北京文化	400	4,176.00	0.00
469	000987	越秀金控	500	3,930.00	0.00
470	000062	深圳华强	200	3,920.00	0.00
471	002512	达华智能	400	3,880.00	0.00
472	300197	铁汉生态	640	3,436.80	0.00
473	002190	成飞集成	200	3,418.00	0.00
474	002648	卫星石化	300	3,309.00	0.00
475	002089	新海宜	500	3,025.00	0.00
476	000426	兴业矿业	400	2,884.00	0.00
477	300090	盛运环保	300	2,496.00	0.00
478	000587	金洲慈航	500	2,480.00	0.00
479	002636	金安国纪	300	2,421.00	0.00
480	000617	中油资本	200	2,248.00	0.00
481	002011	盾安环境	300	1,920.00	0.00
482	300216	千山药机	300	1,593.00	0.00
483	002175	东方网络	400	1,524.00	0.00
484	000615	京汉股份	200	1,258.00	0.00
485	002839	张家港行	200	1,218.00	0.00
486	002018	*ST 华信	800	1,160.00	0.00
487	000693	*ST 华泽	200	662.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	1,135,610.00	0.37
2	000651	格力电器	1,066,284.58	0.35
3	000858	五粮液	634,738.00	0.21
4	002415	海康威视	621,352.00	0.20
5	000002	万科A	589,716.00	0.19
6	000725	京东方A	566,682.00	0.19
7	000001	平安银行	426,691.00	0.14
8	300498	温氏股份	393,939.00	0.13
9	002304	洋河股份	319,649.00	0.11
10	002230	科大讯飞	266,347.00	0.09
11	002027	分众传媒	255,991.00	0.08
12	000063	中兴通讯	255,659.00	0.08
13	002008	大族激光	228,857.00	0.08
14	002024	苏宁易购	228,277.00	0.08
15	000776	广发证券	219,560.00	0.07
16	300059	东方财富	219,403.00	0.07
17	000568	泸州老窖	214,413.00	0.07
18	000538	云南白药	211,672.00	0.07
19	002594	比亚迪	204,017.00	0.07
20	002475	立讯精密	199,897.00	0.07

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	631,856.59	0.21
2	000651	格力电器	588,134.00	0.19
3	000858	五粮液	358,532.00	0.12
4	000725	京东方A	350,903.00	0.12
5	000002	万科A	336,772.80	0.11
6	002415	海康威视	330,249.00	0.11
7	000001	平安银行	257,944.00	0.08
8	300498	温氏股份	224,287.00	0.07
9	000063	中兴通讯	167,742.00	0.06

10	002304	洋河股份	159,842.00	0.05
11	002230	科大讯飞	153,313.00	0.05
12	002027	分众传媒	131,698.71	0.04
13	000776	广发证券	125,534.00	0.04
14	000538	云南白药	124,350.00	0.04
15	000661	长春高新	115,314.00	0.04
16	002008	大族激光	113,942.30	0.04
17	002024	苏宁易购	113,442.00	0.04
18	002594	比亚迪	112,079.00	0.04
19	000568	泸州老窖	111,694.00	0.04
20	300059	东方财富	107,962.00	0.04

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	29,213,992.69
卖出股票收入(成交)总额	16,624,322.28

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,038,000.00	3.68
	其中:政策性金融债	10,038,000.00	3.68
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,038,000.00	3.68

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	018005	国开1701	100,000	10,038,000.00	3.68

**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**

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注:本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

金额单位:人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	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	247,968,871.35	90.79

**7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

**7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

**7.13 投资组合报告附注****7.13.1**

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

**7.13.2**

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。

**7.13.3 期末其他各项资产构成**

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,200.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	89,945.71
5	应收申购款	215,770.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	可收退补款	18,837.40
9	其他	-
10	合计	335,753.70

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002075	沙钢股份	132,184.00	0.05	重大事项

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
南方深成 A 级	13,909	24,811.84	17,380,278.85	5.04	327,727,545.83	94.96
南方深成 C 级	804	5,608.08	-	-	4,508,892.32	100.00
合计	14,713	23,762.44	17,380,278.85	4.97	332,236,438.15	95.03

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例 (%)
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	深成联接 A	81,358.13	0.0236
	深成联接 C	11.03	0.0002
	合计	81,369.16	0.0233

注:分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的

分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	深成联接 A	深成联接 C
基金合同生效日 (2009 年 12 月 9 日) 基金份额总额	3,272,356,687.80	—
本报告期期初基金份额总额	334,402,166.11	962,150.47
本报告期基金总申购份额	43,685,235.90	8,507,931.57
减：本报告期基金总赎回份额	32,979,577.33	4,961,189.72
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	—	—
本报告期期末基金份额总额	345,107,824.68	4,508,892.32

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	3	45,833,584.97	100.00%	4,584.13	100.22%	
国泰君安	3	-	-	-	-	
国信证券	1	-	-	-	-	
海通证券	1	-	-	10.02	-0.22%	
华安证券	1	-	-	-	-	
中信建投	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	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
申万宏源	1	-	-	-	-	

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



## A: 选择标准

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

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

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

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	10,018,743.10	74.51%	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	3,428,224.15	25.49%	2,100,000.00	100.00%	-	-	19,677,898.92	100.00%
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---	---

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理有限公司关于东海期货有限责任公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月05日
2	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月06日
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招募说明书（更新）（2017年第2号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月12日
4	南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书（更新）摘要（2017年第2号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月12日
5	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月06日
6	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月06日
7	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月06日
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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月06日
9	南方基金关于旗下部分基金增加和耕传承为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年02月08日
10	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月06日
11	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分开放式基金赎回费调整的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年03月27日
12	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、上海证券报、证券时报	2018年03月30日
13	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、上海证券报、证券时报	2018年03月31日
14	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年01月06日
15	南方基金管理股份有限公司关于调整电子直销系统部分基金最低申购金额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年04月26日
16	南方基金关于旗下部分基金增加大连网金为代销机构及开通相关业务	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年04月27日

	的公告		
17	南方基金关于旗下部分基金增加紫金农商银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 05 月 08 日
18	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 01 月 06 日
19	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 01 月 06 日
20	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 01 月 06 日
21	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 01 月 06 日
22	南方基金关于旗下部分基金增加中民财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 06 月 25 日
23	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、上海证券报、证券时报	2018 年 03 月 31 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

注:无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注:无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层。

### 12.3 查阅方式

网站: <http://www.nffund.com>

