

深证成份交易型开放式指数证券投资 基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 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：2020 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本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 2020 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
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.....	10
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告.....	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告.....	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
8.3 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.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62

8.6 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	63
8.7 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	63
8.8 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	63
8.9 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	63
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	64
§9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末上市基金前十名持有人	65
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	66
§10 开放式基金份额变动	66
§11 重大事件揭示	66
11.1 基金份额持有人大会决议	66
11.2 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	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8 其他重大事件	69
§12 影响投资者决策的其他重要信息	69
12.1 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	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§13 备查文件目录	70
13.1 备查文件目录	70
13.2 存放地点	70
13.3 查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方深证成份 ETF
场内简称	深成 ETF
基金主代码	159903
交易代码	159903
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 4 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	349,154,507.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 2 月 2 日

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

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798
注册地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518017	100140
法定代表人		张海波	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	-16,037,767.05	-55,652,923.99	-17,447,257.18
本期利润	154,978,245.87	-161,132,316.20	48,645,736.05
加权平均基金份额本期利润	0.3864	-0.4027	0.1156
本期加权平均净值利润率	38.08%	-39.74%	10.15%
本期基金份额净值增长率	45.78%	-34.07%	10.38%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	-71,261,689.30	-250,061,343.91	-59,732,639.95
期末可供分配基金份额利润	-0.2041	-0.5656	-0.1575
期末基金资产净值	401,935,778.47	349,175,924.70	454,122,828.12
期末基金份额净值	1.1512	0.7897	1.1977
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	-15.06%	-41.73%	-11.63%

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

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

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

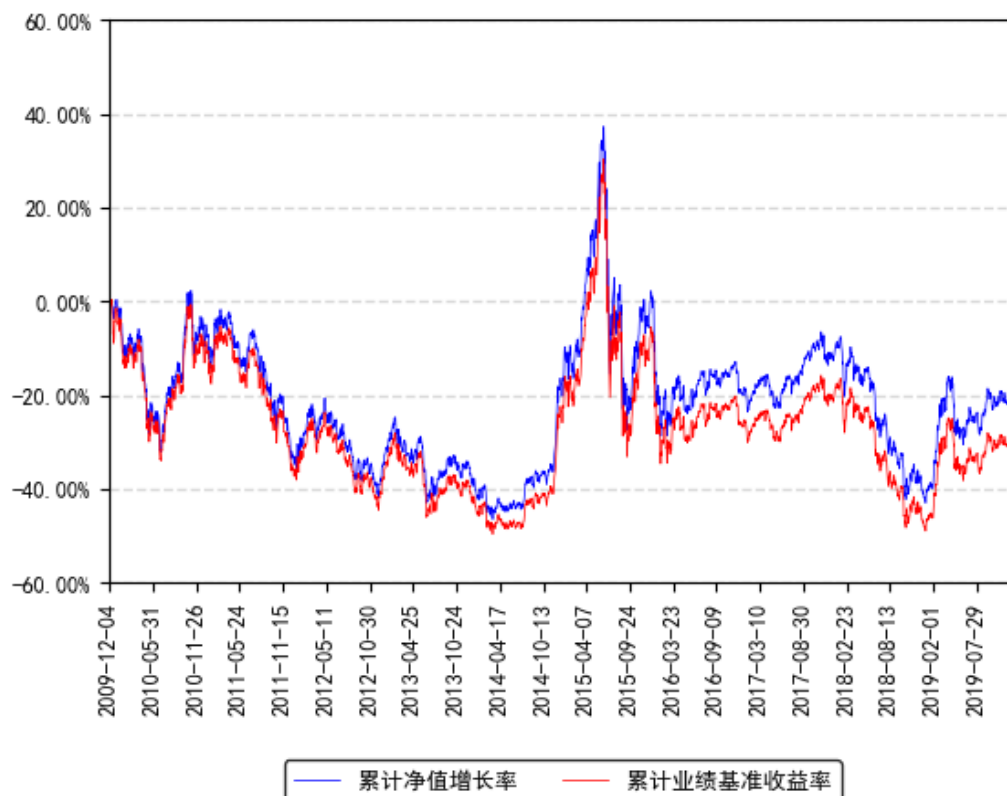
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	10.40%	0.89%	10.42%	0.89%	-0.02%	0.00%
过去六个月	14.10%	1.05%	13.65%	1.05%	0.45%	0.00%
过去一年	45.78%	1.46%	44.08%	1.46%	1.70%	0.00%
过去三年	6.09%	1.31%	2.49%	1.32%	3.60%	-0.01%
过去五年	-0.50%	1.73%	-5.30%	1.76%	4.80%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	-15.06%	1.59%	-24.88%	1.62%	9.82%	-0.03%

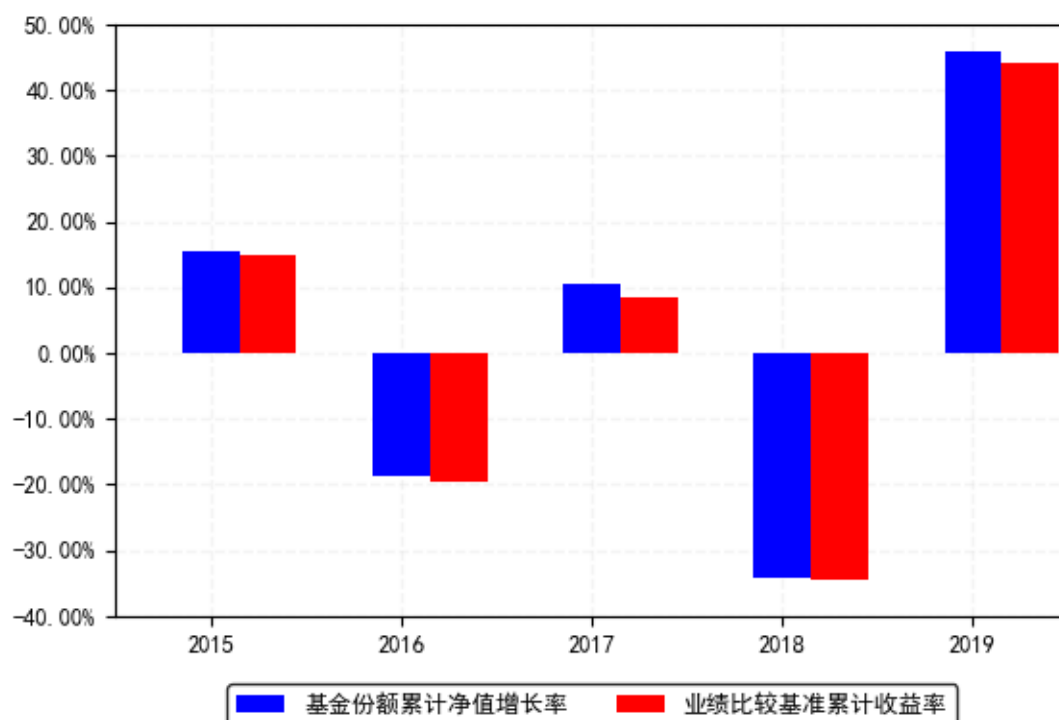
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方深证成份ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方深证成份ETF每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019 年 7 月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙) 2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙) 2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有

限合伙) 2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙) 2.20%。目前, 公司总部设在深圳, 在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司, 在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中, 南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末, 南方基金管理股份有限公司(不含子公司)管理资产规模超过 9200 亿元, 旗下管理 204 只开放式基金, 多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙伟	本基金 基金经 理	2016 年 8 月 19 日	-	9 年	管理学学士, 特许金融分析师(CFA)、注册会计师(CPA), 具有基金从业资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010 年 2 月加入南方基金, 历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员、基金经理助理; 2015 年 5 月 22 日至 2016 年 7 月 29 日, 任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理; 2015 年 7 月 2 日至今, 任改革基金、高铁基金基金经理; 2015 年 7 月 10 日至今, 任 500 信息基金经理; 2016 年 5 月 13 日至今, 任南方创业板 ETF 基金经理; 2016 年 5 月 20 日至今, 任南方创业板 ETF 联接基金经理; 2016 年 8 月 17 日至今, 任 500 信息联接基金经理; 2016 年 8 月 19 日至今, 任深成 ETF、南方深成基金经理; 2017 年 3 月 8 日至今, 任南方全指证券 ETF 联接基金经理; 2017 年 3 月 10 日至今, 任南方中证全指证券 ETF 基金经理; 2017 年 6 月 28 日至今, 任南方中证银行 ETF 基金经理; 2017 年 6 月 29 日至今, 任南方银行联接基金经理; 2018 年 2 月 8 日至今, 任 H 股 ETF 基金经理; 2018 年 2 月 12 日至今, 任南方 H 股联接基金经理; 2019 年 7 月 12 日至今, 任南方中证 500 工业 ETF、南方中证 500 原材料 ETF、南方上证 380ETF、南方上证 380ETF 联接基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 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。

4.3.3 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 8 次，由于投资组合的投资策略需要以及接受投资者申赎后被动增减仓位和指数成份股调整所致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

深证成指报告期内上涨 44.08%。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

（1）大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.1512 元，报告期内，份额净值增长率为 45.78%，同期业绩基准增长率为 44.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

新冠疫情对短期经济增长形成了较大压力，但国家适时加强了逆周期政策调节力度以进行对冲，疫情一次性影响过去后，预计市场将重回基本面主导格局。当前 A 股市场整体估值仍具有较强吸引力，具备明显的长期配置价值。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求、自律规则和业务发展情况，严格遵循和落实包括《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金参与转融通证券出借业务指引（试行）》、《关于证券基金期货业反洗钱工作有关事项文件

的通知》、《关于公募基金投资科创板股票的通知》等 2019 年发布或实施的新规在内的公募基金行业法律法规及其他规范要求。本基金管理人坚持从保护基金持有人利益出发，树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础、合规为先、行稳致远”的合规理念，继续致力于合规与内控机制的完善，积极推动主动合规风控管理，持续加强业务风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程，制订和修订了包括《合规手册》、《防控内幕信息和交易管理制度》、《反洗钱内部控制制度》、《廉洁从业内部控制制度》、《信息和保密管理制度》、《制度管理规定》、《离任审计及审查制度》等一系列与监察稽核和合规内控相关的管理制度。

在遵循和完善制度机制建设的基础上，本基金管理人积极开展形式丰富的合规培训与考试，加强员工行为规范检查、严格进行合规问责，强化全员合规、主动合规理念；对投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务和相关部门开展了定期稽核、专项稽核及多项自查，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，排查业务中的风险点并完善内控措施，促进公司业务合规运作、稳健经营；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，持续完善投资合规风控制度流程和系统，加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控，有效确保投研交易业务合规运作；全面履行新产品、新业务合规评估程序，保障新产品、新业务合规开展；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况，督促落实投资者适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；监督和落实客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人高度重视反洗钱相关工作，通过研究监管形势，参考同业先进经验，按照风险为本的工作方法，积极主动的采取有效措施防控洗钱风险。从制度建设、系统功能建设、业务流程规范、宣传培训、监督检查等方面入手，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程，有效提升了公司反洗钱工作的合规水平。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总

经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。基金管理人根据基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益分配每年最多 12 次，每次基金收益分配比例不低于基金收益分配基准日可供分配利润的 5%。基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；本基金收益分配采取现金分红方式；《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本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深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2019 年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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2020)第 21248 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	深证成份交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了深证成份交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“南方深证成份 ETF 基金”)的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了南方深证成份 ETF 基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于南方深证成份 ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	南方深证成份 ETF 基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估南方深证成份 ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算南方深证成份 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督南方深证成份 ETF 基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务

	报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对南方深证成份 ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致南方深证成份 ETF 基金不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	薛竞、曹阳
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2020 年 3 月 30 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	766,438.96	528,764.08
结算备付金		9,437.76	21,389.30
存出保证金		1,644.80	2,364.56
交易性金融资产	7.4.7.2	401,578,494.60	348,884,893.39
其中：股票投资		401,460,066.84	348,884,893.39
基金投资		-	-
债券投资		118,427.76	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		10,823.18	335,581.25
应收利息	7.4.7.5	172.89	129.51
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		402,367,012.19	349,773,122.09
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		169,092.48	153,211.95
应付托管费		33,818.47	30,642.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,320.89	5,073.00
应交税费		1.88	1.92
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	224,000.00	408,268.11
负债合计		431,233.72	597,197.39
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	473,197,467.77	599,237,268.61
未分配利润	7.4.7.10	-71,261,689.30	-250,061,343.91
所有者权益合计		401,935,778.47	349,175,924.70
负债和所有者权益总计		402,367,012.19	349,773,122.09

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1512 元，基金份额总额 349,154,507.00 份。

7.2 利润表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		157,921,210.47	-157,964,902.43
1. 利息收入		5,976.61	10,257.76
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,923.60	10,136.72
债券利息收入		53.01	121.04
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）		-13,095,464.83	-52,358,484.39
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-18,981,164.03	-57,270,700.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	17,761.96	73,207.60
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	5,867,937.24	4,839,008.49
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.17	171,016,012.92	-105,479,392.21
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.18	-5,314.23	-137,283.59
减：二、费用		2,942,964.60	3,167,413.77
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,030,673.07	2,026,939.44
2. 托管费	7.4.10.2.2	406,134.64	405,387.87
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	71,684.70	120,632.26
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		0.19	0.20
7. 其他费用	7.4.7.20	434,472.00	614,454.00
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		154,978,245.87	-161,132,316.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		154,978,245.87	-161,132,316.20

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	599,237,268.61	-250,061,343.91	349,175,924.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	154,978,245.87	154,978,245.87
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)	-126,039,800.84	23,821,408.74	-102,218,392.10
其中：1. 基金申购款	60,987,000.32	-17,766,944.01	43,220,056.31
2. 基金赎回款	-187,026,801.16	41,588,352.75	-145,438,448.41
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)	473,197,467.77	-71,261,689.30	401,935,778.47
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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)	513,855,468.07	-59,732,639.95	454,122,828.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-161,132,316.20	-161,132,316.20
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)	85,381,800.54	-29,196,387.76	56,185,412.78

填列)			
其中：1. 基金申购款	134,171,400.87	-39,375,347.61	94,796,053.26
2. 基金赎回款	-48,789,600.33	10,178,959.85	-38,610,640.48
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)	599,237,268.61	-250,061,343.91	349,175,924.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

深证成份交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]1066 号《关于核准深证成份交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准，由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司，已于 2018 年 1 月 4 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 4,127,252,482.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 263 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 12 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,127,538,537.00 份基金份额，其中通过代销机构网上现金及直销机构网下现金认购部分的认购资金利息折合 286,055.00 元份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司确定 2010 年 1 月 13 日为本基金的基金份额折算日。当日深证成份指数收盘值为 13,016.557 点，本基金的基金资产净值为 3,964,290,323.04 元，折算前基金份额总额为 4,127,538,537.00 份，折算前基金份额净值为 0.960 元。根据基金份额折算公式，基金份

额折算比例为 0.73786718，折算后基金份额总额为 3,045,554,507.00 份，折算后基金份额净值为 1.302 元。本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司已根据上述折算比例，对所有基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2010 年 1 月 15 日完成了变更登记。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2010]38 号审核同意，本基金于 2010 年 2 月 2 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数深证成份指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；主要投资范围为标的指数的成份股和备选成份股，该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%；本基金可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为深证成份指数。

本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司以本基金为目标 ETF，于 2009 年 12 月 9 日募集成立了南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“南方深成 ETF 联接基金”)。南方深成 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2020 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及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。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。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。

(4) 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。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	766,438.96	528,764.08
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	766,438.96	528,764.08

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		366,683,591.63	401,460,066.84	34,776,475.21
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	118,300.00	118,427.76	127.76
	银行间市场	-	-	-
	合计	118,300.00	118,427.76	127.76
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		366,801,891.63	401,578,494.60	34,776,602.97
项目		上年度末 2018 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		485,124,303.34	348,884,893.39	-136,239,409.95
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		-	-	-
其他		-	-	-
合计		485,124,303.34	348,884,893.39	-136,239,409.95

于 2019 年 12 月 31 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为零(2018 年 12 月 31 日：同)。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	77.93	117.02
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	80.33	11.39
应收债券利息	13.93	-
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	0.70	1.10
合计	172.89	129.51

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	4,320.89	5,073.00
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	4,320.89	5,073.00

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应退退补款	-	844.31
预提费用	174,000.00	354,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
可退退补款	-	3,423.80
其他	-	-
合计	224,000.00	408,268.11

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

2. 应退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时, 替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	442,154,507.00	599,237,268.61
本期申购	45,000,000.00	60,987,000.32
本期赎回（以“-”号填列）	-138,000,000.00	-187,026,801.16
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	349,154,507.00	473,197,467.77

注：本期申购含转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	75,286,566.19	-325,347,910.10	-250,061,343.91
本期利润	-16,037,767.05	171,016,012.92	154,978,245.87
本期基金份额交易产生的变动数	-13,661,800.51	37,483,209.25	23,821,408.74
其中：基金申购款	7,217,379.16	-24,984,323.17	-17,766,944.01
基金赎回款	-20,879,179.67	62,467,532.42	41,588,352.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	45,586,998.63	-116,848,687.93	-71,261,689.30

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	4,514.67	8,780.84
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	1,375.09	1,321.86
其他	33.84	34.02
合计	5,923.60	10,136.72

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
----	-------------------------------------	--

股票投资收益——买卖股票差价收入	-16,892,292.57	-52,162,631.42
股票投资收益——赎回差价收入	-2,088,871.46	-5,108,069.06
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-18,981,164.03	-57,270,700.48

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	52,221,147.74	87,063,826.35
减：卖出股票成本总额	69,113,440.31	139,226,457.77
买卖股票差价收入	-16,892,292.57	-52,162,631.42

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	145,438,448.41	38,610,640.48
减：现金支付赎回款总额	-5,019,254.59	-449,563.52
减：赎回股票成本总额	152,546,574.46	44,168,273.06
赎回差价收入	-2,088,871.46	-5,108,069.06

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票申购差价收入。

7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	175,002.73	948,877.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	157,200.00	875,500.00
减：应收利息总额	40.77	169.60
买卖债券差价收入	17,761.96	73,207.60

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入****7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	5,867,937.24	4,839,008.49
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,867,937.24	4,839,008.49

7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	171,016,012.92	-105,479,392.21

——股票投资	171,015,885.16	-105,479,392.21
——债券投资	127.76	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	171,016,012.92	-105,479,392.21

本基金本年度公允价值变动收益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动收益为零元(2018 度：同)。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-5,314.23	-137,283.59
合计	-5,314.23	-137,283.59

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

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	71,684.70	120,632.26
银行间市场交易费用	-	-
合计	71,684.70	120,632.26

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	54,000.00	54,000.00
信息披露费	120,000.00	300,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
银行费用	472.00	454.00

上市费	60,000.00	60,000.00
合计	434,472.00	614,454.00

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

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司
南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“南方深证成份 ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

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。

3. 根据《南方基金管理股份有限公司关于公司股东及股东出资比例变更的公告》，经南方基金管理股份有限公司(以下简称“南方基金”)股东大会决议，并经中国证监会证监许可[2019]1361 号《关于核准南方基金管理股份有限公司变更股权的批复》核准，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)和厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)为南方基金的股东，并于 2019 年 7 月 31 日完成了工商变更登记手续。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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	107,600,439.59	100.00%	177,293,186.30	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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	10,761.54	100.00%	4,320.89	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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	17,733.07	100.00%	5,073.00	100.00%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,030,673.07	2,026,939.44
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

注：支付基金管理人南方基金管理股份有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	406,134.64	405,387.87

注：支付基金托管人工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	213,321,432.00	61.10%	264,321,432.00	59.78%

注：南方深证成份 ETF 联接投资本基金相关的费用按基金合同和更新的招募说明书的有关规定以及与券商约定的席位佣金费率支付。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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	766,438.96	4,514.67	528,764.08	8,780.84

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：）	总金额
华泰联合证券有限责任公司	002466	天齐锂业	网上申购	11,696	102,340.00

单位：人民币元

上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：）	总金额
华泰联合证券有限责任公司	-	-	-	-	-

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002466	天齐锂业	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 3 日	配股未上市	8.75	30.18	11,696	102,340.00	352,985.28	-
002973	侨银环保	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新股未上市	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123036	先导转债	2019 年 12 月 11 日	2020 年 1 月 10 日	配债未上市	100.00	100.00	298	29,800.00	29,800.00	-
128086	国轩转债	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 10 日	配债未上市	100.00	100.00	632	63,200.00	63,200.00	-
128088	深南转债	2019 年 12 月 24 日	2020 年 1 月 16 日	配债未上市	100.00	100.00	245	24,500.00	24,500.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪深证成份指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.03% (2018 年 12 月 31 日：本基金无债券投资)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2019 年 12 月 31 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，本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，如根据基金合同的规定，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.12%。

同时，基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按

公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	766,438.96	-	-	-	766,438.96
结算备付金	9,437.76	-	-	-	9,437.76
存出保证金	1,644.80	-	-	-	1,644.80
交易性金融资产	-	-	118,427.76	401,460,066.84	401,578,494.60
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	172.89	172.89
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	10,823.18	10,823.18
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	777,521.52	-	118,427.76	401,471,062.91	402,367,012.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人	-	-	-	169,092.48	169,092.48

报酬					
应付托管费	-	-	-	33,818.47	33,818.47
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	4,320.89	4,320.89
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.88	1.88
其他负债	-	-	-	224,000.00	224,000.00
负债总计	-	-	-	431,233.72	431,233.72
利率敏感度缺口	777,521.52	-	118,427.76	401,039,829.19	401,935,778.47
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	528,764.08	-	-	-	528,764.08
结算备付金	21,389.30	-	-	-	21,389.30
存出保证金	2,364.56	-	-	-	2,364.56
交易性金融资产	-	-	-	348,884,893.39	348,884,893.39
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	129.51	129.51
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	335,581.25	335,581.25
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	552,517.94	-	-	349,220,604.15	349,773,122.09
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	153,211.95	153,211.95
应付托管费	-	-	-	30,642.41	30,642.41
应付证券清算款	-	-	-	-	-

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	5,073.00	5,073.00
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.92	1.92
其他负债	-	-	-	408,268.11	408,268.11
负债总计	-	-	-	597,197.39	597,197.39
利率敏感度缺口	552,517.94	-	-	348,623,406.76	349,175,924.70

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 12 月 31 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 0.03%(2018 年 12 月 31 日：无)，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)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，深证成份指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%，新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例不高于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 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	401,460,066.84	99.88	348,884,893.39	99.92
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	401,460,066.84	99.88	348,884,893.39	99.92

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	19,976,208.19	17,359,281.10
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-19,976,208.19	-17,359,281.10

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2019 年度,本基金申购基金份额的对价总额为 45,547,257.69 元(2018 年度: 94,796,053.26 元),其中包括以股票支付的申购款 44,383,657.00 元和以现金支付的申购款 -1,163,600.69 元(2018 年度: 其中包括以股票支付的申购款 91,675,957.11 元和以现金支付的申购款 3,120,096.15 元)。

(2) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 401,101,431.28 元,属于第二层次的余额为 477,063.32 元,无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日: 第一层次 346,682,597.99 元,第二层次 2,188,780.40 元,第三层次 13,515.00 元)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产		合计
	债券投资	权益工具投资	
2019 年 1 月 1 日	-	13,515.00	13,515.00
购买	-	-	-
出售	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	13,515.00	13,515.00
当期利得或损失总额	-	-	-
——计入损益的利得或损失	-	-	-
2019 年 12 月 31 日	-	-	-
2019 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2019 年度损益的未实现利得或损失的变动			
——公允价值变动损益	-	-	-
	交易性金融资产		合计
	债券投资	权益工具投资	
2018 年 1 月 1 日	-	-	-
购买	-	-	-
出售	-	-	-
转入第三层次	-	13,515.00	13,515.00
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
——计入损益的利得或损失	-	-	-
2018 年 12 月 31 日	-	13,515.00	13,515.00
2018 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2018 年度损益的未实现利得或损失的变动			
——公允价值变动损益	-	-305,235.00	-305,235.00

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下：

	2018 年 12 月 31 日 公允价值	估值技 术	名称	不可观察输入值 范围/加权平均值	与公允价值 之间的关系
交易性金融资产		净资产			
——股票投资	13,515.00	法	可回收率	30%-50%	正相关

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(3) 除基金申购款和公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	401,460,066.84	99.77
	其中: 股票	401,460,066.84	99.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	118,427.76	0.03
	其中: 债券	118,427.76	0.03
	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	775,876.72	0.19
8	其他资产	12,640.87	0.00
9	合计	402,367,012.19	100.00

上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而 8.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	12,689,448.00	3.16
B	采矿业	2,683,990.40	0.67
C	制造业	256,222,323.95	63.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,472,235.60	0.86
E	建筑业	1,641,579.48	0.41
F	批发和零售业	6,234,580.24	1.55
G	交通运输、仓储和邮政业	4,389,017.87	1.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,227,976.12	8.76
J	金融业	33,895,035.95	8.43
K	房地产业	21,474,059.40	5.34
L	租赁和商务服务业	6,257,575.46	1.56
M	科学研究和技术服务业	2,101,704.00	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	1,969,505.66	0.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	511,368.00	0.13
Q	卫生和社会工作	7,078,720.88	1.76
R	文化、体育和娱乐业	4,862,833.31	1.21
S	综合	720,002.23	0.18
	合计	401,431,956.55	99.87

8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	21,532.25	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	28,110.29	0.01

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 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

8.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000651	格力电器	240,540	15,774,613.20	3.92
2	000333	美的集团	254,542	14,827,071.50	3.69
3	000858	五粮液	92,441	12,295,577.41	3.06
4	000002	万科A	296,558	9,543,236.44	2.37
5	000001	平安银行	476,912	7,845,202.40	1.95
6	300498	温氏股份	211,824	7,117,286.40	1.77
7	002415	海康威视	181,181	5,931,865.94	1.48
8	002475	立讯精密	162,471	5,930,191.50	1.48
9	000725	京东方A	1,305,542	5,927,160.68	1.47
10	300750	宁德时代	42,300	4,500,720.00	1.12
11	000063	中兴通讯	126,733	4,485,080.87	1.12
12	300059	东方财富	261,643	4,126,110.11	1.03
13	002142	宁波银行	138,383	3,895,481.45	0.97
14	300760	迈瑞医疗	20,700	3,765,330.00	0.94
15	000338	潍柴动力	231,208	3,671,583.04	0.91
16	002027	分众传媒	567,196	3,550,646.96	0.88
17	000568	泸州老窖	39,592	3,431,834.56	0.85

18	002714	牧原股份	37,340	3,315,418.60	0.82
19	000661	长春高新	7,300	3,263,100.00	0.81
20	002304	洋河股份	28,561	3,155,990.50	0.79
21	001979	招商蛇口	155,927	3,098,269.49	0.77
22	000100	TCL 科技	626,171	2,798,984.37	0.70
23	002230	科大讯飞	80,870	2,788,397.60	0.69
24	300015	爱尔眼科	66,901	2,646,603.56	0.66
25	000166	申万宏源	471,669	2,414,945.28	0.60
26	000776	广发证券	151,359	2,296,116.03	0.57
27	002241	歌尔股份	112,610	2,243,191.20	0.56
28	000876	新 希 望	106,452	2,123,717.40	0.53
29	300142	沃森生物	64,900	2,105,356.00	0.52
30	002594	比 亚 迪	42,536	2,027,691.12	0.50
31	000538	云南白药	21,886	1,957,264.98	0.49
32	002044	美年健康	131,256	1,954,401.84	0.49
33	300003	乐普医疗	58,900	1,948,412.00	0.48
34	300136	信维通信	42,160	1,913,220.80	0.48
35	002008	大族激光	44,700	1,788,000.00	0.44
36	002024	苏宁易购	176,451	1,783,919.61	0.44
37	002352	顺丰控股	47,583	1,769,611.77	0.44
38	300124	汇川技术	56,594	1,734,040.16	0.43
39	000157	中联重科	252,427	1,686,212.36	0.42
40	300347	泰格医药	26,300	1,660,845.00	0.41
41	002236	大华股份	83,278	1,655,566.64	0.41
42	002555	三七互娱	60,200	1,621,186.00	0.40
43	002456	欧 菲 光	101,302	1,580,311.20	0.39
44	002202	金风科技	130,913	1,564,410.35	0.39
45	000069	华侨城 A	197,549	1,538,906.71	0.38
46	000066	中国长城	96,138	1,495,907.28	0.37
47	000783	长江证券	206,219	1,472,403.66	0.37
48	002466	天齐锂业	48,383	1,460,198.94	0.36
49	002007	华兰生物	41,300	1,451,695.00	0.36
50	002736	国信证券	111,600	1,400,580.00	0.35
51	002001	新 和 成	59,781	1,390,506.06	0.35
52	002384	东山精密	59,800	1,384,370.00	0.34
53	002460	赣锋锂业	39,300	1,368,819.00	0.34
54	002463	沪电股份	61,600	1,368,136.00	0.34
55	000977	浪潮信息	44,930	1,352,393.00	0.34
56	300014	亿纬锂能	26,621	1,335,309.36	0.33
57	000860	顺鑫农业	25,330	1,334,384.40	0.33
58	300122	智飞生物	26,300	1,306,058.00	0.32
59	002410	广 联 达	37,819	1,285,089.62	0.32
60	002311	海大集团	35,640	1,283,040.00	0.32

61	002624	完美世界	29,000	1,280,060.00	0.32
62	300601	康泰生物	14,500	1,272,955.00	0.32
63	300408	三环集团	55,000	1,225,400.00	0.30
64	000425	徐工机械	222,408	1,216,571.76	0.30
65	000786	北新建材	46,300	1,178,335.00	0.29
66	300144	宋城演艺	37,370	1,155,106.70	0.29
67	002422	科伦药业	48,678	1,143,446.22	0.28
68	300033	同花顺	10,400	1,134,744.00	0.28
69	000768	中航飞机	69,190	1,133,332.20	0.28
70	002271	东方雨虹	43,009	1,131,566.79	0.28
71	002179	中航光电	28,789	1,124,498.34	0.28
72	300450	先导智能	24,562	1,103,816.28	0.27
73	300383	光环新网	54,900	1,101,843.00	0.27
74	002129	中环股份	92,320	1,090,299.20	0.27
75	000938	紫光股份	34,456	1,088,809.60	0.27
76	002157	正邦科技	66,700	1,080,540.00	0.27
77	000625	长安汽车	107,398	1,077,201.94	0.27
78	002405	四维图新	66,796	1,075,415.60	0.27
79	002439	启明星辰	31,800	1,074,840.00	0.27
80	002050	三花智控	61,600	1,067,528.00	0.27
81	002493	荣盛石化	85,750	1,062,442.50	0.26
82	300012	华测检测	71,000	1,058,610.00	0.26
83	002049	紫光国微	20,713	1,053,048.92	0.26
84	002065	东华软件	99,500	1,026,840.00	0.26
85	300088	长信科技	99,304	1,019,852.08	0.25
86	300413	芒果超媒	29,000	1,013,840.00	0.25
87	002797	第一创业	121,040	1,002,211.20	0.25
88	300207	欣旺达	51,200	999,424.00	0.25
89	002371	北方华创	11,300	994,400.00	0.25
90	002600	领益智造	91,500	992,775.00	0.25
91	000961	中南建设	94,100	992,755.00	0.25
92	000963	华东医药	40,595	989,706.10	0.25
93	002340	格林美	200,500	976,435.00	0.24
94	300253	卫宁健康	64,856	971,542.88	0.24
95	002353	杰瑞股份	25,987	960,479.52	0.24
96	000728	国元证券	102,096	946,429.92	0.24
97	002465	海格通信	86,700	938,961.00	0.23
98	300017	网宿科技	97,745	931,509.85	0.23
99	002127	南极电商	84,200	918,622.00	0.23
100	300454	深信服	8,000	915,120.00	0.23
101	002673	西部证券	92,554	907,029.20	0.23
102	002821	凯莱英	7,000	906,500.00	0.23
103	000750	国海证券	169,250	903,795.00	0.22

104	000656	金科股份	115,200	884,736.00	0.22
105	002146	荣盛发展	88,900	873,887.00	0.22
106	000423	东阿阿胶	24,671	872,613.27	0.22
107	300024	机 器 人	62,090	869,260.00	0.22
108	002506	协鑫集成	142,800	843,948.00	0.21
109	000596	古井贡酒	6,200	842,704.00	0.21
110	000703	恒逸石化	60,360	840,211.20	0.21
111	002185	华天科技	112,174	837,939.78	0.21
112	000988	华工科技	40,800	827,832.00	0.21
113	002508	老板电器	24,460	826,992.60	0.21
114	002120	韵达股份	24,547	817,415.10	0.20
115	002601	龙麟佰利	52,600	809,514.00	0.20
116	300315	掌趣科技	131,200	809,504.00	0.20
117	300285	国瓷材料	35,050	800,892.50	0.20
118	000401	冀东水泥	47,064	800,558.64	0.20
119	002926	华西证券	72,200	794,922.00	0.20
120	002138	顺络电子	34,200	790,020.00	0.20
121	300661	圣邦股份	3,100	782,688.00	0.19
122	002916	深南电路	5,480	778,708.00	0.19
123	002273	水晶光电	47,954	774,936.64	0.19
124	300271	华宇软件	30,440	773,176.00	0.19
125	000050	深天马 A	47,300	770,517.00	0.19
126	002180	纳 思 达	23,100	760,452.00	0.19
127	002268	卫 士 通	29,000	747,910.00	0.19
128	002195	二三四五	231,405	747,438.15	0.19
129	000630	铜陵有色	320,400	746,532.00	0.19
130	002602	世纪华通	64,876	741,532.68	0.18
131	002131	利欧股份	249,343	740,548.71	0.18
132	002396	星网锐捷	20,800	739,648.00	0.18
133	002252	上海莱士	99,440	737,844.80	0.18
134	000413	东旭光电	218,500	734,160.00	0.18
135	000623	吉林敖东	43,918	725,964.54	0.18
136	000009	中国宝安	116,317	720,002.23	0.18
137	002078	太阳纸业	73,000	718,320.00	0.18
138	002373	千方科技	39,600	714,384.00	0.18
139	300296	利 亚 德	92,750	711,392.50	0.18
140	002387	维 信 诺	44,100	701,190.00	0.17
141	002739	万达电影	38,250	694,237.50	0.17
142	000671	阳 光 城	81,590	693,515.00	0.17
143	000686	东北证券	74,500	692,850.00	0.17
144	002507	涪陵榨菜	25,800	689,634.00	0.17
145	000540	中天金融	206,200	686,646.00	0.17
146	300070	碧 水 源	90,226	685,717.60	0.17

147	300529	健帆生物	9,500	682,480.00	0.17
148	002939	长城证券	49,200	681,912.00	0.17
149	002500	山西证券	82,100	680,609.00	0.17
150	002385	大北农	136,150	678,027.00	0.17
151	000895	双汇发展	23,324	677,095.72	0.17
152	002812	恩捷股份	13,280	670,640.00	0.17
153	000513	丽珠集团	19,760	665,912.00	0.17
154	000998	隆平高科	44,800	659,008.00	0.16
155	002153	石基信息	16,685	650,715.00	0.16
156	000627	天茂集团	92,400	650,496.00	0.16
157	002013	中航机电	92,578	642,491.32	0.16
158	300558	贝达药业	9,700	637,290.00	0.16
159	002032	苏泊尔	8,300	637,274.00	0.16
160	300146	汤臣倍健	39,100	636,939.00	0.16
161	002572	索菲亚	30,264	634,030.80	0.16
162	002081	金螳螂	71,826	633,505.32	0.16
163	002223	鱼跃医疗	30,800	625,856.00	0.16
164	000999	华润三九	19,700	624,096.00	0.16
165	002019	亿帆医药	37,900	615,875.00	0.15
166	000997	新大陆	38,680	614,238.40	0.15
167	000975	银泰黄金	45,060	613,266.60	0.15
168	002174	游族网络	26,085	606,997.95	0.15
169	300699	光威复材	13,320	606,060.00	0.15
170	300357	我武生物	13,640	602,206.00	0.15
171	300676	华大基因	8,700	597,690.00	0.15
172	002152	广电运通	62,000	595,820.00	0.15
173	002123	梦网集团	30,600	585,378.00	0.15
174	300496	中科创达	12,954	584,743.56	0.15
175	300433	蓝思科技	42,258	584,005.56	0.15
176	300113	顺网科技	22,682	582,700.58	0.14
177	000878	云南铜业	42,596	581,861.36	0.14
178	300212	易华录	17,248	576,773.12	0.14
179	000060	中金岭南	134,045	576,393.50	0.14
180	000709	河钢股份	222,900	575,082.00	0.14
181	300251	光线传媒	48,720	574,896.00	0.14
182	002938	鹏鼎控股	12,800	574,720.00	0.14
183	000629	攀钢钒钛	196,700	574,364.00	0.14
184	002212	南洋股份	30,200	574,102.00	0.14
185	000547	航天发展	56,100	573,342.00	0.14
186	300168	万达信息	36,746	566,990.78	0.14
187	002281	光迅科技	19,000	565,820.00	0.14
188	000830	鲁西化工	53,800	565,438.00	0.14
189	002217	合力泰	101,600	563,880.00	0.14

190	300618	寒锐钴业	6,804	560,581.56	0.14
191	002110	三钢闽光	59,750	559,260.00	0.14
192	002807	江阴银行	119,620	557,429.20	0.14
193	000778	新兴铸管	132,832	553,909.44	0.14
194	000581	威孚高科	28,751	547,706.55	0.14
195	002092	中泰化学	79,500	539,805.00	0.13
196	000723	美锦能源	57,200	539,396.00	0.13
197	002074	国轩高科	37,000	538,350.00	0.13
198	300058	蓝色光标	94,934	536,377.10	0.13
199	300166	东方国信	41,023	533,299.00	0.13
200	000960	锡业股份	50,900	531,396.00	0.13
201	300115	长盈精密	29,640	527,295.60	0.13
202	002368	太极股份	13,500	525,420.00	0.13
203	002156	通富微电	31,880	524,426.00	0.13
204	000402	金融街	64,263	521,815.56	0.13
205	300274	阳光电源	49,135	517,391.55	0.13
206	002773	康弘药业	13,990	517,210.30	0.13
207	002075	沙钢股份	82,500	513,975.00	0.13
208	002607	中公教育	28,600	511,368.00	0.13
209	000735	罗牛山	50,200	510,032.00	0.13
210	300308	中际旭创	9,660	503,769.00	0.13
211	300073	当升科技	18,400	502,320.00	0.12
212	300009	安科生物	33,230	501,440.70	0.12
213	002191	劲嘉股份	43,875	500,613.75	0.12
214	002709	天赐材料	24,180	500,526.00	0.12
215	000039	中集集团	50,960	500,427.20	0.12
216	000690	宝新能源	88,100	497,765.00	0.12
217	300418	昆仑万维	29,700	497,475.00	0.12
218	300316	晶盛机电	31,210	490,621.20	0.12
219	000021	深科技	40,200	489,636.00	0.12
220	000983	西山煤电	79,800	489,174.00	0.12
221	300747	锐科激光	4,150	488,870.00	0.12
222	000839	中信国安	138,050	488,697.00	0.12
223	000970	中科三环	45,400	488,050.00	0.12
224	002690	美亚光电	12,400	484,840.00	0.12
225	300118	东方日升	34,900	483,365.00	0.12
226	300226	上海钢联	6,200	482,360.00	0.12
227	002458	益生股份	16,900	479,115.00	0.12
228	000089	深圳机场	48,900	477,753.00	0.12
229	002233	塔牌集团	37,600	473,760.00	0.12
230	002402	和而泰	36,600	473,238.00	0.12
231	002299	圣农发展	19,600	471,968.00	0.12
232	000825	太钢不锈	115,300	471,577.00	0.12

233	300001	特 锐 德	27,300	469,014.00	0.12
234	002035	华帝股份	34,850	467,687.00	0.12
235	002557	洽洽食品	13,700	465,389.00	0.12
236	002080	中材科技	37,010	458,924.00	0.11
237	300463	迈克生物	16,800	453,096.00	0.11
238	002010	传化智联	64,600	450,908.00	0.11
239	000598	兴蓉环境	95,800	443,554.00	0.11
240	300010	立 思 辰	34,000	438,940.00	0.11
241	300244	迪安诊断	19,796	438,085.48	0.11
242	002511	中顺洁柔	34,500	436,770.00	0.11
243	000932	华菱钢铁	91,240	436,127.20	0.11
244	300595	欧普康视	9,100	430,703.00	0.11
245	300482	万孚生物	8,300	429,691.00	0.11
246	002670	国盛金控	33,760	429,089.60	0.11
247	300567	精测电子	7,800	427,752.00	0.11
248	300369	绿盟科技	23,592	427,487.04	0.11
249	000563	陕国投 A	96,330	426,741.90	0.11
250	000807	云铝股份	83,000	426,620.00	0.11
251	002038	双鹭药业	32,200	423,430.00	0.11
252	000800	一汽轿车	42,400	422,728.00	0.11
253	000831	五矿稀土	32,600	422,496.00	0.11
254	300037	新 宙 邦	11,600	421,544.00	0.10
255	000739	普洛药业	32,500	421,525.00	0.10
256	002558	巨人网络	23,200	418,992.00	0.10
257	002085	万丰奥威	59,828	418,796.00	0.10
258	000883	湖北能源	100,100	417,417.00	0.10
259	000729	燕京啤酒	63,700	415,324.00	0.10
260	300451	创业慧康	23,100	414,414.00	0.10
261	002643	万润股份	27,250	413,927.50	0.10
262	003816	中国广核	113,500	408,600.00	0.10
263	300339	润和软件	29,300	406,391.00	0.10
264	002595	豪迈科技	21,400	404,460.00	0.10
265	002589	瑞康医药	52,560	404,186.40	0.10
266	300457	赢合科技	11,900	404,005.00	0.10
267	002648	卫星石化	24,700	403,845.00	0.10
268	002407	多 氟 多	30,600	401,166.00	0.10
269	000591	太 阳 能	108,900	398,574.00	0.10
270	300628	亿联网络	5,500	398,255.00	0.10
271	300133	华策影视	53,678	397,217.20	0.10
272	300072	三聚环保	62,740	396,516.80	0.10
273	000898	鞍钢股份	118,269	396,201.15	0.10
274	000738	航发控制	30,150	394,060.50	0.10
275	300036	超图软件	19,600	390,628.00	0.10

276	002023	海特高新	32,300	389,215.00	0.10
277	002004	华邦健康	78,500	387,790.00	0.10
278	002936	郑州银行	83,200	386,880.00	0.10
279	300180	华峰超纤	43,650	385,866.00	0.10
280	000415	渤海租赁	101,360	385,168.00	0.10
281	300630	普利制药	6,800	385,152.00	0.10
282	002048	宁波华翔	24,800	383,408.00	0.10
283	002440	闰土股份	34,206	383,107.20	0.10
284	002203	海亮股份	37,300	382,325.00	0.10
285	300188	美亚柏科	22,300	381,330.00	0.09
286	000031	大悦城	53,041	380,834.38	0.09
287	002597	金禾实业	16,800	379,848.00	0.09
288	002831	裕同科技	14,280	379,134.00	0.09
289	000516	国际医学	78,100	378,785.00	0.09
290	000712	锦龙股份	24,800	376,960.00	0.09
291	300098	高新兴	63,562	376,922.66	0.09
292	000046	泛海控股	82,812	376,794.60	0.09
293	002237	恒邦股份	26,800	376,272.00	0.09
294	002151	北斗星通	14,800	373,552.00	0.09
295	000877	天山股份	31,400	372,090.00	0.09
296	002294	信立泰	18,600	370,884.00	0.09
297	002583	海能达	43,920	369,367.20	0.09
298	300053	欧比特	29,450	365,769.00	0.09
299	000681	视觉中国	21,200	365,488.00	0.09
300	000528	柳工	52,660	365,460.40	0.09
301	002056	横店东磁	44,400	364,080.00	0.09
302	300294	博雅生物	11,550	360,706.50	0.09
303	002099	海翔药业	50,500	359,560.00	0.09
304	002414	高德红外	17,100	359,100.00	0.09
305	000027	深圳能源	57,600	357,696.00	0.09
306	000559	万向钱潮	66,440	356,782.80	0.09
307	000034	神州数码	17,885	355,017.25	0.09
308	000400	许继电气	32,800	353,256.00	0.09
309	002028	思源电气	25,600	352,512.00	0.09
310	300054	鼎龙股份	35,200	348,480.00	0.09
311	300170	汉得信息	35,950	348,355.50	0.09
312	300348	长亮科技	16,550	346,226.00	0.09
313	300182	捷成股份	99,059	345,715.91	0.09
314	002266	浙富控股	83,830	345,379.60	0.09
315	002025	航天电器	12,990	345,144.30	0.09
316	002372	伟星新材	26,020	342,683.40	0.09
317	002449	国星光电	26,740	342,004.60	0.09
318	002399	海普瑞	17,520	341,815.20	0.09

319	000488	晨鸣纸业	67,100	341,539.00	0.08
320	300078	思创医惠	27,760	340,892.80	0.08
321	000826	启迪环境	37,110	340,669.80	0.08
322	002244	滨江集团	69,100	339,972.00	0.08
323	000012	南 玻 A	67,846	339,908.46	0.08
324	002640	跨 境 通	43,900	338,908.00	0.08
325	000008	神州高铁	93,152	338,141.76	0.08
326	300476	胜宏科技	20,600	335,986.00	0.08
327	300038	数知科技	38,880	335,145.60	0.08
328	002841	视源股份	3,900	334,230.00	0.08
329	300474	景 嘉 微	5,700	333,906.00	0.08
330	300068	南都电源	30,710	331,053.80	0.08
331	000158	常山北明	48,370	329,883.40	0.08
332	000933	神火股份	59,900	328,252.00	0.08
333	002292	奥飞娱乐	33,000	327,690.00	0.08
334	002912	中新赛克	2,600	327,600.00	0.08
335	002042	华孚时尚	44,600	327,364.00	0.08
336	002030	达安基因	28,442	327,083.00	0.08
337	300458	全志科技	10,222	327,001.78	0.08
338	002701	奥 瑞 金	73,800	325,458.00	0.08
339	000887	中鼎股份	35,900	324,895.00	0.08
340	002310	东方园林	64,300	322,786.00	0.08
341	002603	以岭药业	25,800	320,694.00	0.08
342	002262	恩华药业	27,300	317,499.00	0.08
343	000732	泰禾集团	51,600	317,340.00	0.08
344	000758	中色股份	72,360	316,936.80	0.08
345	002925	盈趣科技	7,200	316,440.00	0.08
346	002155	湖南黄金	40,100	316,389.00	0.08
347	000156	华数传媒	30,300	316,332.00	0.08
348	002665	首航高科	94,130	316,276.80	0.08
349	002183	怡 亚 通	75,040	315,918.40	0.08
350	000555	神州信息	21,300	315,453.00	0.08
351	002390	信邦制药	59,650	313,162.50	0.08
352	000028	国药一致	6,800	308,448.00	0.08
353	000672	上峰水泥	16,800	307,272.00	0.08
354	002610	爱康科技	189,600	305,256.00	0.08
355	000560	我爱我家	70,800	305,148.00	0.08
356	002429	兆驰股份	87,500	304,500.00	0.08
357	002444	巨星科技	28,200	302,868.00	0.08
358	002302	西部建设	26,800	302,572.00	0.08
359	002727	一 心 堂	12,900	300,054.00	0.07
360	002563	森马服饰	30,300	299,061.00	0.07
361	002002	鸿达兴业	71,857	298,925.12	0.07

362	000717	韶钢松山	63,000	298,620.00	0.07
363	000930	中粮科技	45,000	297,000.00	0.07
364	000951	中国重汽	13,200	297,000.00	0.07
365	300724	捷佳伟创	7,800	295,542.00	0.07
366	300324	旋极信息	52,611	294,621.60	0.07
367	002531	天顺风能	46,600	294,512.00	0.07
368	002242	九阳股份	11,700	294,372.00	0.07
369	002376	新北洋	24,200	292,820.00	0.07
370	000650	仁和药业	46,300	292,616.00	0.07
371	300026	红日药业	83,200	292,032.00	0.07
372	000683	远兴能源	128,400	291,468.00	0.07
373	000078	海王生物	78,050	291,126.50	0.07
374	002280	联络互动	74,075	286,670.25	0.07
375	300377	赢时胜	24,947	286,641.03	0.07
376	002839	张家港行	47,900	284,526.00	0.07
377	000789	万年青	23,220	283,516.20	0.07
378	000718	苏宁环球	73,896	282,282.72	0.07
379	000059	华锦股份	46,200	281,358.00	0.07
380	300085	银之杰	17,870	276,627.60	0.07
381	002091	江苏国泰	40,100	275,487.00	0.07
382	002128	露天煤业	31,700	274,522.00	0.07
383	300459	金科文化	85,689	273,347.91	0.07
384	002249	大洋电机	70,634	272,647.24	0.07
385	002408	齐翔腾达	38,100	272,415.00	0.07
386	001965	招商公路	30,700	269,239.00	0.07
387	300616	尚品宅配	3,600	268,272.00	0.07
388	002745	木林森	19,700	268,117.00	0.07
389	002421	达实智能	74,200	267,862.00	0.07
390	002468	申通快递	13,700	267,150.00	0.07
391	300203	聚光科技	15,900	265,689.00	0.07
392	000685	中山公用	32,140	264,833.60	0.07
393	000035	中国天楹	42,900	264,693.00	0.07
394	000921	海信家电	21,400	263,862.00	0.07
395	002389	航天彩虹	23,600	261,960.00	0.07
396	002815	崇达技术	15,100	261,079.00	0.06
397	000902	新洋丰	33,002	260,715.80	0.06
398	000710	贝瑞基因	7,100	259,860.00	0.06
399	002608	江苏国信	33,700	259,827.00	0.06
400	002618	丹邦科技	20,900	257,697.00	0.06
401	002681	奋达科技	46,138	257,450.04	0.06
402	000301	东方盛虹	49,700	257,446.00	0.06
403	000006	深振业 A	47,800	256,208.00	0.06
404	002430	杭氧股份	19,000	255,740.00	0.06

405	002635	安洁科技	15,300	255,051.00	0.06
406	000848	承德露露	32,165	253,138.55	0.06
407	002491	通鼎互联	38,200	252,502.00	0.06
408	002382	蓝帆医疗	20,700	251,298.00	0.06
409	300748	金力永磁	6,400	249,344.00	0.06
410	000967	盈峰环境	40,400	249,268.00	0.06
411	300002	神州泰岳	75,484	246,077.84	0.06
412	000901	航天科技	21,900	245,280.00	0.06
413	002176	江特电机	64,900	244,024.00	0.06
414	002051	中工国际	25,028	243,272.16	0.06
415	002488	金固股份	33,700	240,281.00	0.06
416	002118	紫鑫药业	38,500	240,240.00	0.06
417	300735	光弘科技	9,200	239,936.00	0.06
418	000708	中信特钢	10,400	238,472.00	0.06
419	000676	智度股份	26,320	237,932.80	0.06
420	300770	新媒股份	1,800	234,000.00	0.06
421	002505	大康农业	131,610	230,317.50	0.06
422	002047	宝鹰股份	39,600	228,492.00	0.06
423	002419	天虹股份	21,600	227,880.00	0.06
424	002544	杰赛科技	16,700	227,454.00	0.06
425	002424	贵州百灵	26,100	227,331.00	0.06
426	000688	国城矿业	16,500	226,215.00	0.06
427	002434	万里扬	23,300	220,884.00	0.05
428	300602	飞荣达	5,200	220,480.00	0.05
429	300197	铁汉生态	71,321	218,242.26	0.05
430	000935	四川双马	13,100	216,019.00	0.05
431	002537	海联金汇	30,400	213,408.00	0.05
432	002611	东方精工	50,100	212,925.00	0.05
433	000987	越秀金控	21,900	211,773.00	0.05
434	002573	清新环境	32,700	210,915.00	0.05
435	300666	江丰电子	4,900	210,210.00	0.05
436	300527	中国应急	19,200	210,048.00	0.05
437	000040	东旭蓝天	50,100	209,418.00	0.05
438	002285	世联行	55,170	206,887.50	0.05
439	000937	冀中能源	55,700	203,862.00	0.05
440	002920	德赛西威	6,700	203,211.00	0.05
441	300159	新研股份	51,600	202,272.00	0.05
442	002596	海南瑞泽	31,000	201,500.00	0.05
443	000564	供销大集	84,100	200,999.00	0.05
444	300633	开立医疗	8,300	198,370.00	0.05
445	002958	青农商行	30,600	197,982.00	0.05
446	300741	华宝股份	6,400	197,632.00	0.05
447	000088	盐田港	35,100	197,613.00	0.05

448	002383	合众思壮	21,200	197,584.00	0.05
449	000990	诚志股份	13,300	197,106.00	0.05
450	300222	科大智能	21,100	196,863.00	0.05
451	000062	深圳华强	13,712	195,258.88	0.05
452	000553	安道麦 A	19,300	193,000.00	0.05
453	002503	搜 于 特	79,900	190,961.00	0.05
454	002320	海峡股份	14,800	189,440.00	0.05
455	002366	台海核电	27,160	189,033.60	0.05
456	002867	周 大 生	9,850	187,544.00	0.05
457	300257	开山股份	17,200	187,136.00	0.05
458	002737	葵花药业	12,600	185,976.00	0.05
459	300145	中金环境	53,520	185,714.40	0.05
460	300759	康龙化成	3,600	185,544.00	0.05
461	002672	东江环保	20,500	184,500.00	0.05
462	002653	海 思 科	8,900	181,204.00	0.05
463	000429	粤高速 A	21,900	180,894.00	0.05
464	000766	通化金马	27,171	177,698.34	0.04
465	300373	扬杰科技	10,260	176,472.00	0.04
466	002358	森源电气	25,200	176,148.00	0.04
467	000537	广宇发展	22,500	174,825.00	0.04
468	300773	拉 卡 拉	2,200	172,634.00	0.04
469	300367	东方网力	39,729	172,026.57	0.04
470	002061	浙江交科	29,200	171,404.00	0.04
471	000869	张 裕 A	5,900	169,330.00	0.04
472	000600	建投能源	34,100	166,749.00	0.04
473	002614	奥 佳 华	14,600	154,468.00	0.04
474	000989	九 芝 堂	18,200	151,970.00	0.04
475	002437	誉衡药业	49,400	149,682.00	0.04
476	002948	青岛银行	25,000	148,500.00	0.04
477	000950	重药控股	25,300	145,728.00	0.04
478	000968	蓝焰控股	14,100	144,666.00	0.04
479	002625	光启技术	15,690	143,563.50	0.04
480	000980	众泰汽车	48,500	142,105.00	0.04
481	300761	立华股份	2,300	136,620.00	0.03
482	000959	首钢股份	38,700	136,611.00	0.03
483	000525	红 太 阳	13,800	134,136.00	0.03
484	000582	北部湾港	14,600	130,670.00	0.03
485	002901	大博医疗	2,200	129,998.00	0.03
486	002755	奥 赛 康	7,900	127,664.00	0.03
487	002461	珠江啤酒	16,200	115,668.00	0.03
488	300682	朗新科技	4,900	110,887.00	0.03
489	002818	富 森 美	7,900	99,935.00	0.02
490	000923	河钢资源	6,700	98,959.00	0.02

491	001872	招商港口	5,200	89,232.00	0.02
492	002423	中粮资本	9,000	87,390.00	0.02
493	300634	彩讯股份	4,600	83,076.00	0.02
494	300768	迪普科技	2,200	80,234.00	0.02
495	000617	中油资本	6,300	76,671.00	0.02
496	300766	每日互动	2,200	72,182.00	0.02
497	002946	新乳业	4,700	59,032.00	0.01
498	300674	宇信科技	2,200	57,970.00	0.01
499	002911	佛燃股份	3,100	47,802.00	0.01
500	002941	新疆交建	2,400	42,120.00	0.01

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.01
2	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300760	迈瑞医疗	2,836,455.00	0.81
2	300750	宁德时代	2,526,922.00	0.72
3	000002	万科A	1,564,186.00	0.45
4	000333	美的集团	1,369,772.15	0.39
5	002027	分众传媒	1,135,381.00	0.33
6	001979	招商蛇口	1,108,457.00	0.32
7	000629	攀钢钒钛	858,555.00	0.25
8	300661	圣邦股份	809,186.00	0.23
9	300454	深信服	758,706.00	0.22
10	000001	平安银行	726,638.00	0.21
11	002939	长城证券	725,975.00	0.21
12	002387	维信诺	720,967.00	0.21
13	002123	梦网集团	713,995.00	0.20
14	002352	顺丰控股	707,454.96	0.20
15	000166	申万宏源	608,879.00	0.17
16	003816	中国广核	608,002.00	0.17
17	000938	紫光股份	577,335.60	0.17

18	002458	益生股份	494,609.00	0.14
19	002926	华西证券	493,103.00	0.14
20	000735	罗 牛 山	491,099.00	0.14

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。

8.4.2 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	000651	格力电器	1,591,285.00	0.46
2	000333	美的集团	1,445,565.89	0.41
3	000858	五 粮 液	1,340,517.32	0.38
4	002450	*ST 康得	1,192,917.76	0.34
5	000895	双汇发展	933,985.00	0.27
6	000418	小天鹅 A	869,491.15	0.25
7	000503	国新健康	727,167.50	0.21
8	002221	东华能源	634,934.00	0.18
9	000725	京东方 A	590,501.00	0.17
10	002250	联化科技	492,460.00	0.14
11	002415	海康威视	475,140.00	0.14
12	300027	华谊兄弟	473,523.50	0.14
13	000069	华侨城 A	433,868.00	0.12
14	000338	潍柴动力	423,552.00	0.12
15	000001	平安银行	422,124.00	0.12
16	002470	金 正 大	383,035.00	0.11
17	000799	酒 鬼 酒	373,909.00	0.11
18	000818	航锦科技	370,340.00	0.11
19	002475	立讯精密	364,990.00	0.10
20	002304	洋河股份	338,951.00	0.10

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。

8.4.3 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	58,835,646.06
卖出股票收入（成交）总额	52,221,147.74

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	118,427.76	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	118,427.76	0.03

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	128086	国轩转债	632	63,200.00	0.02
2	123036	先导转债	298	29,800.00	0.01
3	128088	深南转债	245	24,500.00	0.01
4	128081	海亮转债	8	927.76	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

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

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

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

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,644.80
2	应收证券清算款	10,823.18
3	应收股利	-
4	应收利息	172.89
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,640.87

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
5,375	64,958.98	3,318,450.00	0.95%	132,514,625.00	37.95%	213,321,432.00	61.10%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	章斌	2,151,301.00	0.62%
2	刘素坚	1,845,018.00	0.53%
3	凌燕	1,475,778.00	0.42%
4	刘春霞	1,332,800.00	0.38%
5	钱中明	1,098,754.00	0.31%
6	屠文斌	1,000,000.00	0.29%
7	陈日英	943,541.00	0.27%
8	郝世军	911,711.00	0.26%
9	浙江华浙白马房地产开发有限公司	910,052.00	0.26%
10	王成章	818,100.00	0.23%
11	中国工商银行股份有限公司-南方深证成份交易型开放式指数证券投	213,321,432.00	61.10%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年12月04日)基金份额总额	4,127,538,537.00
本报告期期初基金份额总额	442,154,507.00
本报告期基金总申购份额	45,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	138,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	349,154,507.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 10 年，本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 54,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	107,600,439.59	100.00%	10,761.54	100.00%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	175,002.73	100.00%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	南方基金关于淘宝直营店销售手续费费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2019-01-21
2	南方基金关于旗下部分基金增加国盛证券为申购赎回代理券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2019-04-23
3	关于深证成份交易型开放式指数证券投资基金调整申购赎回规则并修改基金合同的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2019-10-18
4	南方基金管理股份有限公司关于旗下完全被动型指数基金认购关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2019-12-25
5	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2019-12-27

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20190101-20191231	264,321,432.00	63,000,000.00	114,000,000.00	213,321,432.00	61.10%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20% 的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立深证成份交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《深证成份交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2019 年年度报告》原文。

13.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>