

深证成份交易型开放式指数证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 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.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
§8 基金份额持有人信息.....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
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.....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 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	199,154,507.00 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	深证成份指数
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
	联系电话	0755-82763888
		郭明
		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		杨小松（代为履行法定代表人职责）	陈四清

因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长缺位，根据相关法律法规和公司章程，公司董事会决定由公司总经理杨小松先生代为履行公司董事长职务（包括代为履行公司法定代表人职责以及法定、公司章程和制度规定的公司董事长其他各项职责）。该决定自 2021 年 2 月 19 日起生效。

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	39,064,955.91
本期利润	23,209,822.96
加权平均基金份额本期利润	0.1110
本期加权平均净值利润率	6.71%
本期基金份额净值增长率	6.23%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	76,959,546.91
期末可供分配基金份额利润	0.3864
期末基金资产净值	346,867,013.40
期末基金份额净值	1.7417
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	28.51%

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

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

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

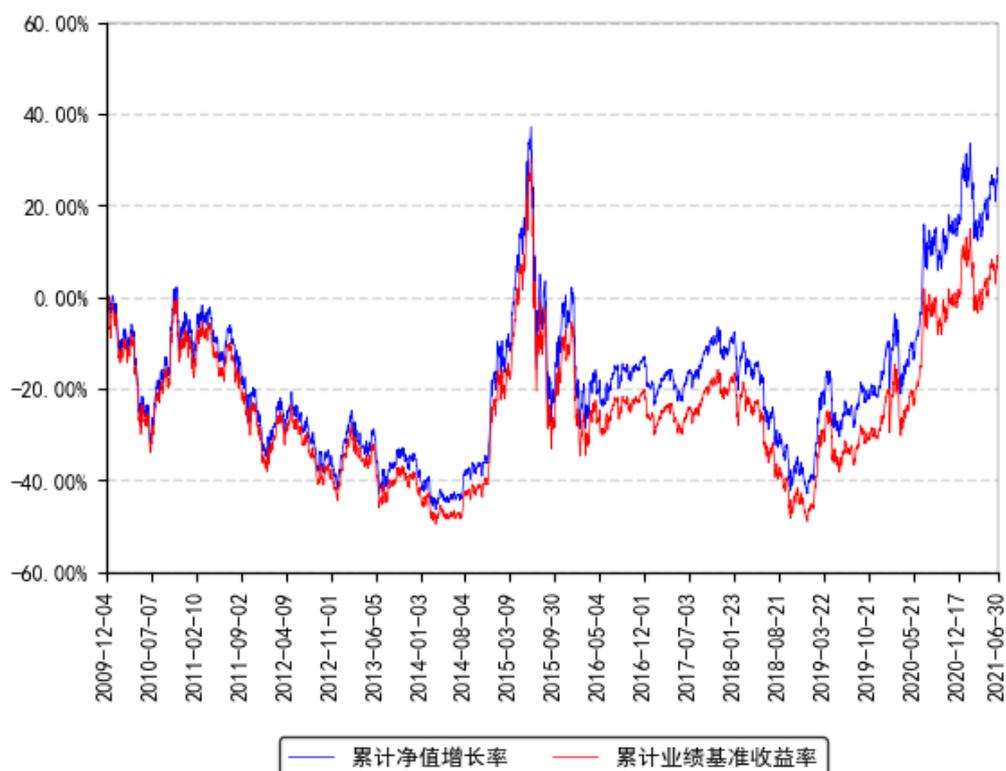
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.73%	1.03%	1.10%	1.03%	0.63%	0.00%
过去三个月	11.32%	1.08%	10.04%	1.08%	1.28%	0.00%
过去六个月	6.23%	1.44%	4.78%	1.44%	1.45%	0.00%
过去一年	30.83%	1.48%	26.43%	1.48%	4.40%	0.00%
过去三年	70.91%	1.56%	61.65%	1.56%	9.26%	0.00%
自基金合同生效起至今	28.51%	1.59%	9.20%	1.61%	19.31%	-0.02%

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

南方深证成份ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018年1月,公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019年7月,根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议,并经中国证监会核准,本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本,认购完成后注册资本为36172万元人民币。目前股权结构为:华泰证券股份有限公司41.16%、深圳市投资控股有限公司27.44%、厦门国际信托有限公司13.72%、兴业证券股份有限公司9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)2.20%。目前,公司总部设在深圳,在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司,在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中,南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至本报告期末，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 1.4 万亿元，旗下管理 245 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	-	11 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 2020 年 12 月 1 日，任改革基金、高铁基金基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 7 日，任南方中证 500 工业 ETF 基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 14 日，任南方中证 500 原材料 ETF 基金经理；2020 年 12 月 1 日至 2021 年 4 月 19 日，任改革基金基金经理；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，任南方上证 380ETF、南方上证 380ETF 联接基金经理；2020 年 12 月 1 日至今，任高铁基金基金经理。

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，两组组合间单日、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，未出现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%的情况。

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 4.78%。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

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

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

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

(4) 新股上市初期涨幅较大的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.7417 元，报告期内，份额净值增长率为 6.23%，同期业绩基准增长率为 4.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

疫情影响消退，经济生活回暖，我国货币政策和财政政策预计将回归常态。经济结构转型背景下，科技产业景气向上，资本市场创新活跃，深证成指重点行业仍具有中长期投资价值。

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	480,625.96	438,113.81
结算备付金		7,657.77	21,370.86
存出保证金		2,185.13	4,319.96
交易性金融资产	6.4.3.2	346,591,912.86	375,704,161.10
其中：股票投资		346,549,012.86	375,481,861.10
基金投资		-	-
债券投资		42,900.00	222,300.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		75,646.69	3,482.53
应收利息	6.4.3.5	40.05	57.20
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		347,158,068.46	376,171,505.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日

负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	21.17
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		140,194.95	159,517.09
应付托管费		28,038.98	31,903.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	3,515.58	4,830.12
应交税费		2.99	8.65
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	119,302.56	275,000.00
负债合计		291,055.06	471,280.45
所有者权益:			
实收基金	6.4.3.9	269,907,466.49	310,565,466.77
未分配利润	6.4.3.10	76,959,546.91	65,134,758.24
所有者权益合计		346,867,013.40	375,700,225.01
负债和所有者权益总计		347,158,068.46	376,171,505.46

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7417 元，基金份额总额 199,154,507.00 份。

6.2 利润表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		24,428,736.51	64,248,821.38

1. 利息收入		1, 530. 67	2, 354. 02
其中：存款利息收入	6. 4. 3. 11	1, 432. 95	2, 211. 76
债券利息收入		97. 72	142. 26
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		40, 283, 613. 51	19, 766, 127. 51
其中：股票投资收益	6. 4. 3. 12	38, 210, 861. 33	16, 409, 554. 08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6. 4. 3. 13	156, 248. 48	201, 073. 73
资产支持证券投资	6. 4. 3. 14	-	-
收益			
贵金属投资收益	6. 4. 3. 15	-	-
衍生工具收益	6. 4. 3. 16	-	-
股利收益	6. 4. 3. 17	1, 916, 503. 70	3, 155, 499. 70
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 3. 18	-15, 855, 132. 95	44, 479, 451. 34
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 3. 19	-1, 274. 72	888. 51
减：二、费用		1, 218, 913. 55	1, 433, 179. 05
1. 管理人报酬	6. 4. 6. 2. 1	860, 562. 18	1, 010, 171. 70
2. 托管费	6. 4. 6. 2. 2	172, 112. 44	202, 034. 42
3. 销售服务费	6. 4. 6. 2. 3	-	-
4. 交易费用	6. 4. 3. 20	31, 708. 04	50, 214. 73
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 税金及附加		0.33	0.59
7. 其他费用	6.4.3.21	154,530.56	170,757.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,209,822.96	62,815,642.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,209,822.96	62,815,642.33

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	310,565,466.77	65,134,758.24	375,700,225.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,209,822.96	23,209,822.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-40,658,000.28	-11,385,034.29	-52,043,034.57
其中：1. 基金申购款	52,855,400.30	10,481,823.97	63,337,224.27
2. 基金赎回款	-93,513,400.58	-21,866,858.26	-115,380,258.84
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）	269,907,466.49	76,959,546.91	346,867,013.40
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	473,197,467.77	-71,261,689.30	401,935,778.47
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	-	62,815,642.33	62,815,642.33
三、本期基金份额交 易产生的基金净值变 动数(净值减少以 “-”号填列)	-56,921,200.38	1,093,512.78	-55,827,687.60
其中: 1. 基金申购款	93,513,400.57	-13,445,792.59	80,067,607.98
2. 基金赎回款	-150,434,600.95	14,539,305.37	-135,895,295.58
四、本期向基金份额 持有人分配利润产生 的基金净值变动(净 值减少以“-”号填 列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	416,276,267.39	-7,352,534.19	408,923,733.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

____ 杨小松 ____ 徐超 ____ 徐超 ____
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策, 会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	480,625.96
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	480,625.96

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	254,170,434.44	346,549,012.86	92,378,578.42
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	42,900.00	42,900.00
	银行间市场	-	-
	合计	42,900.00	42,900.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	254,213,334.44	346,591,912.86	92,378,578.42

注：于 2021 年 06 月 30 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为 0.00 元(2020 年 12 月 31 日：0.00 元)。

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	32.60
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	3.14
应收债券利息	3.41
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	0.90
合计	40.05

6.4.3.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	3,515.58
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,515.58

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应退替代款	-
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	35,000.00
可退替代款	-
其他	-
合计	119,302.56

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

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

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	229,154,507.00	310,565,466.77
本期申购	39,000,000.00	52,855,400.30
本期赎回（以“-”号填列）	-69,000,000.00	-93,513,400.58
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	199,154,507.00	269,907,466.49

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	92,726,872.04	-27,592,113.80	65,134,758.24
本期利润	39,064,955.91	-15,855,132.95	23,209,822.96
本期基金份额交易产生的变动数	-13,982,062.49	2,597,028.20	-11,385,034.29
其中：基金申购款	20,004,000.38	-9,522,176.41	10,481,823.97
基金赎回款	-33,986,062.87	12,119,204.61	-21,866,858.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	117,809,765.46	-40,850,218.55	76,959,546.91

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,122.56
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	285.31
其他	25.08
合计	1,432.95

6.4.3.12 股票投资收益

6.4.3.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,252,774.22
股票投资收益——赎回差价收入	31,958,087.11
股票投资收益——申购差价收入	-

股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	38,210,861.33

6.4.3.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	23,111,569.43
减：卖出股票成本总额	16,858,795.21
买卖股票差价收入	6,252,774.22

6.4.3.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	115,380,258.84
减：现金支付赎回款总额	-34,678.16
减：赎回股票成本总额	83,456,849.89
赎回差价收入	31,958,087.11

6.4.3.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.3.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

6.4.3.13 债券投资收益

6.4.3.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	156,248.48
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	156,248.48

6.4.3.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,101,462.99
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	945,100.00
减：应收利息总额	114.51

买卖债券差价收入	156,248.48
----------	------------

6.4.3.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.3.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.3.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.3.15 贵金属投资收益

6.4.3.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.3.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.3.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.3.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.3.16 衍生工具收益

6.4.3.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.3.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.3.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,916,503.70
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,916,503.70

6.4.3.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-15,855,132.95
——股票投资	-15,855,132.95
——债券投资	-
——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	-15,855,132.95

注：本基金本期公允价值变动损益-股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益为 0.00 元(2020 上半年度：0.00 元)。

6.4.3.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-1,274.72
合计	-1,274.72

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

6.4.3.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	31,708.04
银行间市场交易费用	-
合计	31,708.04

6.4.3.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	70,000.00

银行费用	228.00
合计	154,530.56

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。于 2019 年度，标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 50,000 元；自 2020 年度起，当本基金的季度日均基金资产净值大于人民币 5,000 万元时，标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 35,000 元，当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5,000 万元时，无标的指数许可使用费的收取下限。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“南方深成 ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票	成交金额	占当期股票

		成交总额的比例		成交总额的比例
华泰证券	14,549,012.97	32.08%	75,621,771.09	100.00%

6.4.6.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	1,454.86	32.09%	436.25	12.41%
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	7,565.18	100.00%	6,078.63	100.00%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	860,562.18	1,010,171.70
其中：支付销售机构的客户维护费	-	0.00

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

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

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	172,112.44	202,034.42

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：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数

6.4.6.2.3 销售服务费

无。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	120,728,774.00	60.62%	141,728,774.00	61.85%

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

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	480,625.96	1,122.56	560,810.21	1,439.78

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

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券	300975	商络电子	网下申购	4,917	26,945.16
兴业证券	300941	创识科技	网下申购	3,989	85,005.59
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-

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

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.7 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.8 期末（2021 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18	2021 年 11 月 25	创业板新股锁	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-

		日	日	定期						
300930	屹通新材	2021年 1月13 日	2021年 7月21 日	创业板 新股锁 定期	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300933	中辰股份	2021年 1月15 日	2021年 7月22 日	创业板 新股锁 定期	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年 1月20 日	2021年 7月27 日	创业板 新股锁 定期	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300941	创识科技	2021年 2月2 日	2021年 8月9 日	创业板 新股锁 定期	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021年 2月2 日	2021年 8月9 日	创业板 新股锁 定期	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年 2月3 日	2021年 8月10 日	创业板 新股锁 定期	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年 2月3 日	2021年 8月10 日	创业板 新股锁 定期	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年 6月4 日	2021年 8月25 日	锁定期 转增	-	27.42	108	-	2,961.36	-
300948	冠中生态	2021年 2月18 日	2021年 8月25 日	创业板 新股锁 定期	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300953	震裕科技	2021年 3月11 日	2021年 9月22 日	创业板 新股锁 定期	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021年 3月16 日	2021年 9月24 日	创业板 新股锁 定期	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300960	通业科技	2021年 3月22 日	2021年 9月29 日	创业板 新股锁 定期	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年 3月23 日	2021年 9月30 日	创业板 新股锁 定期	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年 3月29 日	2021年 10月11 日	创业板 新股锁 定期	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同药业	2021年	2021年	创业板	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-

		3月31日	10月11日	新股锁定期						
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	创业板新股锁定期	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	创业板新股锁定期	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	创业板新股锁定期	48.59	90.39	283	13,750.97	25,580.37	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	创业板新股锁定期	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	创业板新股锁定期	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	创业板新股锁定期	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	创业板新股锁定期	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	创业板新股锁定期	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	创业板新股锁定期	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	创业板新股锁定期	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	创业板新股锁定期	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	创业板新股锁定期	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	创业板新股锁定期	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301006	迈拓股份	2021年5月31日	2021年12月7日	创业板新股锁定期	14.42	24.89	5,051	72,835.42	125,719.39	-

301007	德迈仕	2021年 6月4 日	2021年 12月16 日	创业板 新股锁 定期	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021年 6月8 日	2021年 12月17 日	创业板 新股锁 定期	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021年 6月9 日	2021年 12月20 日	创业板 新股锁 定期	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年 6月9 日	2021年 12月17 日	创业板 新股锁 定期	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年 6月15 日	2021年 12月22 日	创业板 新股锁 定期	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年 6月21 日	2021年 12月29 日	创业板 新股锁 定期	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021年 6月22 日	2021年 12月30 日	创业板 新股锁 定期	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301020	密封科技	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
300919	中伟股份	2020年 12月15 日	2021年 7月2 日	创业板 新股锁 定期	24.60	163.0 0	454	11,168.40	74,002.00	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认 购日	可流通 日	流通受 限类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量（单 位：张）	期末成本 总额	期末估值 总额	备注
127038	国微转债	2021年 6月10 日	2021年 7月14 日	配债未 上市	100.0 0	100.0 0	292	29,200.00	29,200.00	-
123117	健帆转债	2021年 6月23 日	2021年 7月12 日	配债未 上市	100.0 0	100.0 0	137	13,700.00	13,700.00	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的2020年2月14日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起12个月内不得转让。

根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

3、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.8.2 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
002024	苏宁易购	2021年6月16日	重大事项停牌	5.59	2021年7月6日	6.15	106,151	1,144,891.01	593,384.09	-

本基金截至 2021 年 06 月 30 日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。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，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。

6.4.9.2 信用风险

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

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

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

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金为履行与金融负债有关的义务而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，可能产生基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

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。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短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%。

同时，基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管

理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	480,625.96	-	-	-	480,625.96
结算备付金	7,657.77	-	-	-	7,657.77
存出保证金	2,185.13	-	-	-	2,185.13
交易性金融资产	-	-	42,900.00	346,549,012.86	346,591,912.86
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	40.05	40.05
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	75,646.69	75,646.69
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	490,468.86	-	42,900.00	346,624,699.60	347,158,068.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	140,194.95	140,194.95
应付托管费	-	-	-	28,038.98	28,038.98
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	-	-	-	3,515.58	3,515.58
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2.99	2.99
其他负债	-	-	-	119,302.56	119,302.56
负债总计	-	-	-	291,055.06	291,055.06
利率敏感度缺口	490,468.86	-	42,900.00	346,333,644.54	346,867,013.40
上年度末 2020 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	438,113.81	-	-	-	438,113.81
结算备付金	21,370.86	-	-	-	21,370.86
存出保证金	4,319.96	-	-	-	4,319.96
交易性金融资产	-	-	222,300.00	375,481,861.10	375,704,161.10
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	57.20	57.20
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	3,482.53	3,482.53
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	463,804.63	-	222,300.00	375,485,400.83	376,171,505.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	159,517.09	159,517.09
应付托管费	-	-	-	31,903.42	31,903.42
应付证券清算款	-	-	-	21.17	21.17
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	4,830.12	4,830.12
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	8.65	8.65
其他负债	-	-	-	275,000.00	275,000.00
负债总计	-	-	-	471,280.45	471,280.45
利率敏感度缺口	463,804.63	-	222,300.00	375,014,120.38	375,700,225.01

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1.市场利率平行上升25个基点	-609.64	-3,148.44
2.市场利率平行下降25个基点	620.02	3,201.92	

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

本基金采用完全复制法跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合

中，深证成份指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%，新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例不高于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	346,549,012.86	99.91	375,481,861.10	99.94
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	346,549,012.86	99.91	375,481,861.10	99.94

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1.组合自身基准上升 5%	17,294,778.61	18,711,042.82
	2.组合自身基准下降 5%	-17,294,778.61	-18,711,042.82

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例
----	----	-------	-----------

			(%)
1	权益投资	346,549,012.86	99.82
	其中：股票	346,549,012.86	99.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	42,900.00	0.01
	其中：债券	42,900.00	0.01
	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	488,283.73	0.14
8	其他资产	77,871.87	0.02
9	合计	347,158,068.46	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而下表中的合计项中不含可退替代款估值增值；

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6,806,790.89	1.96
B	采矿业	1,966,067.24	0.57
C	制造业	249,822,743.38	72.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,191,144.60	0.63
E	建筑业	421,549.92	0.12
F	批发和零售业	3,325,575.61	0.96
G	交通运输、仓储和邮政业	4,101,331.18	1.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,959,049.67	6.04
J	金融业	25,764,352.29	7.43
K	房地产业	8,430,674.88	2.43
L	租赁和商务服务业	3,965,038.46	1.14
M	科学研究和技术服务业	3,514,543.00	1.01
N	水利、环境和公共设施管理业	1,269,054.26	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	710,260.00	0.20
Q	卫生和社会工作	8,660,804.08	2.50
R	文化、体育和娱乐业	2,826,827.17	0.81

S	综合	837,076.59	0.24
	合计	345,572,883.22	99.63

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	589,378.77	0.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	17,322.28	0.00
F	批发和零售业	286,119.06	0.08
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	46,807.09	0.01
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	36,502.44	0.01
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	976,129.64	0.28

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	29,200	15,616,160.00	4.50
2	000858	五粮液	47,841	14,251,355.49	4.11
3	000333	美的集团	128,742	9,188,316.54	2.65
4	300059	东方财富	208,757	6,845,142.03	1.97
5	002415	海康威视	105,981	6,835,774.50	1.97
6	000651	格力电器	124,640	6,493,744.00	1.87

7	002475	立讯精密	116,708	5,368,568.00	1.55
8	002594	比亚迪	21,236	5,330,236.00	1.54
9	300760	迈瑞医疗	11,100	5,328,555.00	1.54
10	000001	平安银行	222,812	5,040,007.44	1.45
11	000725	京东方 A	744,242	4,644,070.08	1.34
12	000568	泸州老窖	19,592	4,622,536.48	1.33
13	300015	爱尔眼科	59,644	4,233,531.12	1.22
14	000002	万科 A	176,758	4,208,607.98	1.21
15	002714	牧原股份	62,203	3,783,186.46	1.09
16	300122	智飞生物	18,500	3,454,505.00	1.00
17	002142	宁波银行	84,583	3,296,199.51	0.95
18	300124	汇川技术	43,091	3,199,937.66	0.92
19	300014	亿纬锂能	29,851	3,102,414.43	0.89
20	000661	长春高新	8,000	3,096,000.00	0.89
21	002230	科大讯飞	45,270	3,059,346.60	0.88
22	002304	洋河股份	14,761	3,058,479.20	0.88
23	300274	阳光电源	25,135	2,892,033.10	0.83
24	002352	顺丰控股	42,283	2,862,559.10	0.83
25	300782	卓胜微	5,104	2,743,400.00	0.79
26	002812	恩捷股份	11,680	2,734,288.00	0.79
27	300347	泰格医药	13,700	2,648,210.00	0.76
28	002241	歌尔股份	61,510	2,628,937.40	0.76
29	000063	中兴通讯	77,833	2,586,390.59	0.75
30	002027	分众传媒	272,296	2,562,305.36	0.74
31	002460	赣锋锂业	21,000	2,542,890.00	0.73
32	300142	沃森生物	40,500	2,498,850.00	0.72
33	000100	TCL 科技	316,971	2,424,828.15	0.70
34	002271	东方雨虹	43,563	2,409,905.16	0.69
35	002129	中环股份	55,920	2,158,512.00	0.62
36	000338	潍柴动力	113,308	2,024,813.96	0.58
37	300498	温氏股份	126,009	1,810,749.33	0.52
38	002410	广联达	25,719	1,754,035.80	0.51
39	002049	紫光国微	11,213	1,728,932.47	0.50
40	002311	海大集团	20,440	1,667,904.00	0.48
41	002371	北方华创	5,900	1,636,542.00	0.47
42	002709	天赐材料	15,006	1,599,339.48	0.46
43	000799	酒鬼酒	6,100	1,559,160.00	0.45
44	300450	先导智能	25,499	1,533,509.86	0.44
45	000538	云南白药	12,586	1,456,451.92	0.42
46	002821	凯莱英	3,900	1,453,140.00	0.42
47	002493	荣盛石化	80,525	1,390,666.75	0.40
48	000625	长安汽车	50,998	1,340,227.44	0.39
49	300759	康龙化成	6,100	1,323,639.00	0.38

50	300454	深信服	4,900	1,271,452.00	0.37
51	300408	三环集团	29,700	1,259,874.00	0.36
52	300496	中科创达	7,854	1,233,549.24	0.36
53	300595	欧普康视	11,830	1,224,996.50	0.35
54	300413	芒果超媒	17,400	1,193,640.00	0.34
55	300601	康泰生物	8,000	1,192,000.00	0.34
56	300012	华测检测	35,800	1,141,304.00	0.33
57	000776	广发证券	74,659	1,130,337.26	0.33
58	002179	中航光电	14,289	1,129,116.78	0.33
59	002050	三花智控	46,660	1,118,906.80	0.32
60	002841	视源股份	8,800	1,093,752.00	0.32
61	002074	国轩高科	25,100	1,093,356.00	0.32
62	000166	申万宏源	232,069	1,086,082.92	0.31
63	002340	格林美	116,000	1,084,600.00	0.31
64	000157	中联重科	114,727	1,060,077.48	0.31
65	300433	蓝思科技	34,958	1,028,114.78	0.30
66	300896	爱美客	1,300	1,025,544.00	0.30
67	002001	新和成	35,357	1,014,038.76	0.29
68	002601	龙佰集团	29,200	1,009,736.00	0.29
69	300285	国瓷材料	19,950	972,562.50	0.28
70	300529	健帆生物	11,130	961,186.80	0.28
71	300003	乐普医疗	29,700	953,964.00	0.28
72	002236	大华股份	44,778	944,815.80	0.27
73	002568	百润股份	9,900	938,421.00	0.27
74	000963	华东医药	20,295	933,772.95	0.27
75	300661	圣邦股份	3,650	922,464.50	0.27
76	300999	金龙鱼	10,758	913,999.68	0.26
77	000786	北新建材	23,200	910,600.00	0.26
78	000768	中航西飞	34,190	898,513.20	0.26
79	000895	双汇发展	28,124	894,343.20	0.26
80	002008	大族激光	22,100	892,619.00	0.26
81	001979	招商蛇口	79,227	867,535.65	0.25
82	002185	华天科技	55,774	858,361.86	0.25
83	300207	欣旺达	26,300	856,328.00	0.25
84	002007	华兰生物	23,230	852,076.40	0.25
85	000009	中国宝安	45,817	837,076.59	0.24
86	000876	新希望	55,752	817,881.84	0.24
87	002648	卫星石化	20,700	811,233.00	0.23
88	002202	金风科技	66,413	807,582.08	0.23
89	002736	国信证券	74,800	804,100.00	0.23
90	000301	东方盛虹	38,400	802,560.00	0.23
91	002624	完美世界	33,250	795,007.50	0.23
92	000938	紫光股份	35,858	784,573.04	0.23

93	300316	晶盛机电	15,510	783,255.00	0.23
94	002555	三七互娱	32,000	768,640.00	0.22
95	000596	古井贡酒	3,039	727,840.50	0.21
96	000069	华侨城 A	96,049	714,604.56	0.21
97	002607	中公教育	34,000	710,260.00	0.20
98	000977	浪潮信息	25,086	705,669.18	0.20
99	000516	国际医学	37,400	703,494.00	0.20
100	000425	徐工机械	109,408	696,928.96	0.20
101	002625	光启技术	33,490	696,926.90	0.20
102	300253	卫宁健康	42,823	696,730.21	0.20
103	002384	东山精密	33,400	696,056.00	0.20
104	300037	新宙邦	6,900	690,690.00	0.20
105	000783	长江证券	93,419	683,827.08	0.20
106	300676	华大基因	5,700	676,020.00	0.19
107	300677	英科医疗	5,400	673,920.00	0.19
108	000066	中国长城	46,138	673,614.80	0.19
109	300558	贝达药业	6,100	660,264.00	0.19
110	002044	美年健康	72,256	658,252.16	0.19
111	002459	晶澳科技	13,400	656,600.00	0.19
112	002405	四维图新	44,296	651,151.20	0.19
113	002797	第一创业	91,140	650,739.60	0.19
114	300136	信维通信	21,060	650,332.80	0.19
115	002138	顺络电子	16,700	647,459.00	0.19
116	000988	华工科技	27,500	646,800.00	0.19
117	300146	汤臣倍健	19,400	638,260.00	0.18
118	000547	航天发展	33,400	630,258.00	0.18
119	300144	宋城演艺	36,426	611,956.80	0.18
120	002920	德赛西威	5,500	605,440.00	0.17
121	002353	杰瑞股份	13,487	602,868.90	0.17
122	002223	鱼跃医疗	15,800	602,454.00	0.17
123	300033	同花顺	5,300	597,734.00	0.17
124	002252	上海莱士	79,640	596,503.60	0.17
125	002024	苏宁易购	106,151	593,384.09	0.17
126	300628	亿联网络	6,900	578,220.00	0.17
127	002600	领益智造	62,700	576,213.00	0.17
128	000703	恒逸石化	48,078	574,532.10	0.17
129	300725	药石科技	3,600	572,076.00	0.16
130	000728	国元证券	71,605	570,691.85	0.16
131	002508	老板电器	12,060	560,790.00	0.16
132	002444	巨星科技	16,400	558,912.00	0.16
133	300699	光威复材	7,320	555,954.00	0.16
134	002414	高德红外	20,088	554,027.04	0.16
135	000807	云铝股份	46,500	553,350.00	0.16

136	002602	世纪华通	85,251	547,311.42	0.16
137	002791	坚朗五金	2,800	543,340.00	0.16
138	002497	雅化集团	23,700	539,886.00	0.16
139	002030	达安基因	25,281	536,968.44	0.15
140	300724	捷佳伟创	4,600	533,646.00	0.15
141	000860	顺鑫农业	12,630	532,733.40	0.15
142	002156	通富微电	22,080	530,803.20	0.15
143	300751	迈为股份	1,160	527,452.00	0.15
144	002013	中航机电	52,178	525,432.46	0.15
145	300073	当升科技	9,300	522,567.00	0.15
146	300458	全志科技	5,922	519,122.52	0.15
147	002439	启明星辰	17,700	513,477.00	0.15
148	002212	天融信	25,900	512,043.00	0.15
149	002180	纳思达	15,900	511,980.00	0.15
150	002064	华峰化学	35,900	509,780.00	0.15
151	002250	联化科技	18,100	504,990.00	0.15
152	000039	中集集团	27,760	504,676.80	0.15
153	300223	北京君正	5,000	504,600.00	0.15
154	002402	和而泰	20,900	500,973.00	0.14
155	002078	太阳纸业	37,500	500,625.00	0.14
156	000830	鲁西化工	26,500	496,345.00	0.14
157	300308	中际旭创	12,860	495,367.20	0.14
158	000630	铜陵有色	182,100	495,312.00	0.14
159	002385	大北农	72,350	491,980.00	0.14
160	002938	鹏鼎控股	13,700	491,556.00	0.14
161	000656	金科股份	84,200	487,518.00	0.14
162	002422	科伦药业	24,378	486,341.10	0.14
163	002747	埃斯顿	12,400	484,220.00	0.14
164	002507	涪陵榨菜	12,700	478,282.00	0.14
165	002080	中材科技	18,210	476,555.70	0.14
166	002463	沪电股份	30,700	474,929.00	0.14
167	002916	深南电路	4,272	474,747.36	0.14
168	002511	中顺洁柔	17,200	473,860.00	0.14
169	000739	普洛药业	16,100	473,340.00	0.14
170	000513	丽珠集团	9,460	473,189.20	0.14
171	000708	中信特钢	22,330	465,357.20	0.13
172	003816	中国广核	172,500	460,575.00	0.13
173	002456	欧菲光	51,302	455,561.76	0.13
174	002127	南极电商	46,100	450,397.00	0.13
175	300832	新产业	7,300	449,680.00	0.13
176	002075	沙钢股份	41,200	449,492.00	0.13
177	300357	我武生物	6,940	444,992.80	0.13
178	300001	特锐德	14,600	439,606.00	0.13

179	300088	长信科技	53,204	439,465.04	0.13
180	002409	雅克科技	5,400	437,400.00	0.13
181	300618	寒锐钴业	5,544	437,088.96	0.13
182	000423	东阿阿胶	12,071	433,469.61	0.12
183	000021	深 科 技	22,600	432,564.00	0.12
184	000050	深天马 A	30,200	428,236.00	0.12
185	002373	千方科技	25,600	427,520.00	0.12
186	002603	以岭药业	14,600	425,736.00	0.12
187	002120	韵达股份	31,461	425,667.33	0.12
188	002157	正邦科技	35,600	425,420.00	0.12
189	000932	华菱钢铁	64,440	425,304.00	0.12
190	000983	山西焦煤	50,920	423,145.20	0.12
191	002465	海格通信	44,700	422,862.00	0.12
192	300115	长盈精密	20,488	422,052.80	0.12
193	000825	太钢不锈	56,200	420,938.00	0.12
194	300244	迪安诊断	10,896	417,316.80	0.12
195	002028	思源电气	13,500	415,665.00	0.12
196	300009	安科生物	27,867	415,218.30	0.12
197	300383	光环新网	28,800	414,432.00	0.12
198	300463	迈克生物	9,700	408,273.00	0.12
199	002706	良信股份	18,000	405,720.00	0.12
200	000975	银泰黄金	42,504	404,213.04	0.12
201	002541	鸿路钢构	6,900	402,615.00	0.12
202	000960	锡业股份	25,000	400,750.00	0.12
203	300763	锦浪科技	2,210	399,126.00	0.12
204	002152	广电运通	30,500	397,415.00	0.11
205	002092	中泰化学	38,500	395,395.00	0.11
206	002673	西部证券	47,454	391,495.50	0.11
207	000750	国海证券	92,325	391,458.00	0.11
208	002273	水晶光电	26,554	390,078.26	0.11
209	300747	锐科激光	3,400	387,804.00	0.11
210	300296	利 亚 德	49,450	386,699.00	0.11
211	300482	万孚生物	5,970	386,199.30	0.11
212	002065	东华软件	48,600	385,398.00	0.11
213	300685	艾德生物	3,700	385,096.00	0.11
214	000998	隆平高科	23,700	380,148.00	0.11
215	000723	美锦能源	49,800	376,488.00	0.11
216	300070	碧 水 源	51,426	375,924.06	0.11
217	002151	北斗星通	8,600	370,402.00	0.11
218	002299	圣农发展	15,500	370,140.00	0.11
219	002436	兴森科技	33,600	369,600.00	0.11
220	002926	华西证券	38,200	367,866.00	0.11
221	300623	捷捷微电	9,700	366,951.00	0.11

222	300630	普利制药	6,963	364,861.20	0.11
223	300271	华宇软件	18,840	362,670.00	0.10
224	002572	索 菲 亚	14,964	362,128.80	0.10
225	000623	吉林敖东	23,118	358,097.82	0.10
226	000878	云南铜业	27,396	351,490.68	0.10
227	002131	利欧股份	150,043	351,100.62	0.10
228	002557	洽洽食品	8,100	349,110.00	0.10
229	300373	扬杰科技	5,760	348,710.40	0.10
230	002985	北摩高科	3,570	348,075.00	0.10
231	002500	山西证券	51,680	346,772.80	0.10
232	000617	中油资本	57,500	346,150.00	0.10
233	002382	蓝帆医疗	16,600	346,110.00	0.10
234	002430	杭氧股份	10,000	345,900.00	0.10
235	002690	美亚光电	6,200	345,712.00	0.10
236	000012	南 玻 A	33,346	341,463.04	0.10
237	300118	东方日升	17,300	335,620.00	0.10
238	002626	金 达 威	7,500	335,250.00	0.10
239	000591	太 阳 能	53,600	333,928.00	0.10
240	002683	宏大爆破	11,900	330,463.00	0.10
241	002019	亿帆医药	19,000	327,750.00	0.09
242	300024	机 器 人	30,590	326,395.30	0.09
243	002966	苏州银行	44,300	325,605.00	0.09
244	000997	新 大 陆	19,580	324,832.20	0.09
245	300379	东 方 通	11,340	323,076.60	0.09
246	002025	航天电器	6,390	320,586.30	0.09
247	300058	蓝色光标	52,634	318,435.70	0.09
248	000738	航发控制	15,250	317,657.50	0.09
249	002958	青农商行	73,500	314,580.00	0.09
250	300017	网宿科技	53,345	312,068.25	0.09
251	300251	光线传媒	28,820	311,544.20	0.09
252	000831	五矿稀土	16,100	310,730.00	0.09
253	002390	信邦制药	29,550	309,684.00	0.09
254	000686	东北证券	36,600	309,270.00	0.09
255	002756	永兴材料	5,200	308,828.00	0.09
256	000027	深圳能源	33,640	308,478.80	0.09
257	002123	梦网科技	17,000	307,020.00	0.09
258	300054	鼎龙股份	16,800	306,600.00	0.09
259	300346	南大光电	7,900	305,572.00	0.09
260	300474	景 嘉 微	3,100	303,552.00	0.09
261	002294	信 立 泰	9,200	302,680.00	0.09
262	002408	齐翔腾达	24,200	300,564.00	0.09
263	002506	协鑫集成	86,100	299,628.00	0.09
264	002372	伟星新材	14,220	293,927.40	0.08

265	300773	拉卡拉	10,400	293,592.00	0.08
266	002597	金禾实业	8,400	291,480.00	0.08
267	002831	裕同科技	9,780	290,368.20	0.08
268	002389	航天彩虹	13,300	290,339.00	0.08
269	002081	金螳螂	36,426	288,493.92	0.08
270	002429	兆驰股份	47,500	288,325.00	0.08
271	002174	游族网络	16,785	288,198.45	0.08
272	000060	中金岭南	63,745	288,127.40	0.08
273	000158	常山北明	24,970	286,905.30	0.08
274	300418	昆仑万维	17,500	286,650.00	0.08
275	002675	东诚药业	13,600	286,552.00	0.08
276	000401	冀东水泥	23,164	286,075.40	0.08
277	002558	巨人网络	21,500	285,950.00	0.08
278	300777	中简科技	6,300	284,634.00	0.08
279	000581	威孚高科	13,651	284,350.33	0.08
280	300315	掌趣科技	66,900	284,325.00	0.08
281	000961	中南建设	47,800	282,976.00	0.08
282	000933	神火股份	29,900	282,555.00	0.08
283	002056	横店东磁	21,700	282,100.00	0.08
284	300476	胜宏科技	12,900	281,865.00	0.08
285	002195	二三四五	138,805	281,774.15	0.08
286	300212	易华录	10,357	278,706.87	0.08
287	002268	卫士通	14,300	278,564.00	0.08
288	000540	中天金融	101,900	278,187.00	0.08
289	002595	豪迈科技	10,400	277,680.00	0.08
290	002851	麦格米特	8,700	271,701.00	0.08
291	002153	石基信息	11,539	271,281.89	0.08
292	002221	东华能源	24,700	270,465.00	0.08
293	000709	河钢股份	109,600	269,616.00	0.08
294	002939	长城证券	24,100	268,233.00	0.08
295	300775	三角防务	7,000	267,400.00	0.08
296	000671	阳光城	51,390	267,228.00	0.08
297	300294	博雅生物	7,350	265,702.50	0.08
298	002727	一心堂	8,000	264,880.00	0.08
299	300182	捷成股份	52,959	264,265.41	0.08
300	000999	华润三九	9,800	262,150.00	0.08
301	002643	万润股份	14,450	256,921.00	0.07
302	000902	新洋丰	16,402	256,363.26	0.07
303	002124	天邦股份	36,400	255,164.00	0.07
304	002032	苏泊尔	4,000	255,160.00	0.07
305	300348	长亮科技	13,875	253,912.50	0.07
306	300298	三诺生物	8,100	253,692.00	0.07
307	002281	光迅科技	10,300	253,380.00	0.07

308	300451	创业慧康	28,545	252,337.80	0.07
309	002191	劲嘉股份	23,575	250,838.00	0.07
310	002396	星网锐捷	11,700	249,795.00	0.07
311	300502	新易盛	7,962	248,812.50	0.07
312	002002	鸿达兴业	62,857	247,028.01	0.07
313	002925	盈趣科技	6,330	246,300.30	0.07
314	300166	东方国信	19,923	246,248.28	0.07
315	300567	精测电子	4,000	245,600.00	0.07
316	000690	宝新能源	47,400	242,214.00	0.07
317	002146	荣盛发展	42,800	241,392.00	0.07
318	000488	晨鸣纸业	29,600	240,944.00	0.07
319	002010	传化智联	31,100	239,781.00	0.07
320	000778	新兴铸管	64,332	239,315.04	0.07
321	002745	木林森	17,800	238,520.00	0.07
322	002048	宁波华翔	12,200	237,900.00	0.07
323	300369	绿盟科技	14,892	237,527.40	0.07
324	002023	海特高新	15,900	237,228.00	0.07
325	300748	金力永磁	7,500	237,225.00	0.07
326	000718	苏宁环球	28,496	236,231.84	0.07
327	002387	维信诺	22,500	234,675.00	0.07
328	300326	凯利泰	17,100	232,389.00	0.07
329	300456	赛微电子	7,700	232,155.00	0.07
330	002332	仙琚制药	18,500	231,990.00	0.07
331	300803	指南针	6,000	231,600.00	0.07
332	000883	湖北能源	50,300	230,877.00	0.07
333	300638	广和通	4,900	228,830.00	0.07
334	300236	上海新阳	4,700	228,138.00	0.07
335	002004	华邦健康	36,600	227,286.00	0.07
336	000729	燕京啤酒	31,300	226,612.00	0.07
337	000800	一汽解放	20,900	226,138.00	0.07
338	000887	中鼎股份	18,700	225,896.00	0.07
339	002967	广电计量	5,100	223,380.00	0.06
340	002563	森马服饰	18,600	222,270.00	0.06
341	000629	攀钢钒钛	96,700	221,443.00	0.06
342	002242	九阳股份	6,800	220,932.00	0.06
343	002936	郑州银行	59,910	219,869.70	0.06
344	002203	海亮股份	20,600	219,184.00	0.06
345	300726	宏达电子	3,100	218,519.00	0.06
346	000034	神州数码	9,985	218,172.25	0.06
347	000970	中科三环	22,400	213,920.00	0.06
348	000528	柳工	26,060	213,692.00	0.06
349	002183	怡亚通	36,940	211,666.20	0.06
350	002249	大洋电机	40,234	211,228.50	0.06

351	002091	江苏国泰	23,200	211,120.00	0.06
352	002701	奥瑞金	41,000	210,740.00	0.06
353	002266	浙富控股	41,830	208,731.70	0.06
354	300002	神州泰岳	42,584	206,532.40	0.06
355	002099	海翔药业	25,500	205,785.00	0.06
356	000403	派林生物	6,600	205,392.00	0.06
357	002128	露天煤业	19,700	205,077.00	0.06
358	300226	上海钢联	3,440	204,852.00	0.06
359	002867	周大生	10,325	204,125.25	0.06
360	002262	恩华药业	13,200	202,620.00	0.06
361	000877	天山股份	15,500	201,965.00	0.06
362	002670	国盛金控	17,660	201,147.40	0.06
363	300376	易事特	25,000	201,000.00	0.06
364	000987	越秀金控	15,800	200,028.00	0.06
365	000930	中粮科技	22,200	200,022.00	0.06
366	002233	塔牌集团	19,400	199,432.00	0.06
367	000035	中国天楹	43,500	198,360.00	0.06
368	002531	天顺风能	22,900	198,085.00	0.06
369	000400	许继电气	15,600	197,496.00	0.06
370	300026	红日药业	46,300	196,775.00	0.06
371	300188	美亚柏科	11,300	196,620.00	0.06
372	300068	南都电源	18,510	196,206.00	0.06
373	000898	鞍钢股份	43,969	195,662.05	0.06
374	002481	双塔食品	16,900	195,364.00	0.06
375	000712	锦龙股份	11,300	194,360.00	0.06
376	000735	罗牛山	24,600	194,094.00	0.06
377	002773	康弘药业	8,390	194,060.70	0.06
378	002368	太极股份	9,659	193,759.54	0.06
379	002705	新宝股份	7,300	191,625.00	0.06
380	002110	三钢闽光	28,350	191,079.00	0.06
381	000598	兴蓉环境	36,300	189,123.00	0.05
382	300674	宇信科技	10,020	187,273.80	0.05
383	300457	赢合科技	9,400	186,684.00	0.05
384	002839	张家港行	34,300	186,592.00	0.05
385	000089	深圳机场	24,000	186,480.00	0.05
386	300616	尚品宅配	2,100	185,871.00	0.05
387	001914	招商积余	10,800	185,544.00	0.05
388	300072	三聚环保	32,240	185,057.60	0.05
389	000402	金融街	27,263	184,025.25	0.05
390	000555	神州信息	12,600	182,322.00	0.05
391	000990	诚志股份	14,300	182,039.00	0.05
392	002217	合力泰	50,400	179,928.00	0.05
393	000560	我爱我家	39,400	176,118.00	0.05

394	002038	双鹭药业	16,500	173,745.00	0.05
395	000559	万向钱潮	32,640	173,318.40	0.05
396	000672	上峰水泥	9,900	173,052.00	0.05
397	000758	中色股份	35,660	169,385.00	0.05
398	002237	恒邦股份	14,600	167,754.00	0.05
399	300866	安克创新	1,000	167,470.00	0.05
400	300741	华宝股份	3,300	167,376.00	0.05
401	000967	盈峰环境	24,300	166,941.00	0.05
402	300459	金科文化	51,589	166,632.47	0.05
403	000681	视觉中国	12,800	165,504.00	0.05
404	300133	华策影视	27,878	165,037.76	0.05
405	300841	康华生物	600	161,280.00	0.05
406	300888	稳健医疗	1,300	160,706.00	0.05
407	002100	天康生物	18,000	160,380.00	0.05
408	300085	银之杰	8,970	158,320.50	0.05
409	001965	招商公路	21,900	158,118.00	0.05
410	002458	益生股份	15,630	155,831.10	0.04
411	000627	天茂集团	43,000	155,660.00	0.04
412	300633	开立医疗	4,900	154,742.00	0.04
413	002440	闰土股份	17,306	153,158.10	0.04
414	002155	湖南黄金	19,700	152,675.00	0.04
415	000563	陕国投 A	47,330	152,402.60	0.04
416	300770	新媒股份	3,100	150,970.00	0.04
417	000710	贝瑞基因	5,000	150,200.00	0.04
418	300666	江丰电子	3,000	149,610.00	0.04
419	000951	中国重汽	5,500	148,830.00	0.04
420	300113	顺网科技	11,482	148,577.08	0.04
421	002424	贵州百灵	20,100	147,936.00	0.04
422	002085	万丰奥威	26,128	146,316.80	0.04
423	300180	华峰超纤	29,421	145,633.95	0.04
424	002505	鹏都农牧	64,710	144,950.40	0.04
425	000717	韶钢松山	30,900	141,831.00	0.04
426	002216	三全食品	8,440	139,006.80	0.04
427	002351	漫步者	10,100	136,754.00	0.04
428	002244	滨江集团	32,400	135,756.00	0.04
429	000415	渤海租赁	55,460	134,213.20	0.04
430	002375	亚厦股份	16,800	133,056.00	0.04
431	000921	海信家电	9,200	132,204.00	0.04
432	300682	朗新科技	7,850	132,037.00	0.04
433	000789	万年青	11,420	130,644.80	0.04
434	002310	东方园林	38,300	130,603.00	0.04
435	000685	中山公用	15,840	129,254.40	0.04
436	000028	国药一致	3,400	128,656.00	0.04

437	000785	居然之家	20,700	125,649.00	0.04
438	000078	海王生物	38,250	124,695.00	0.04
439	300783	三只松鼠	2,600	123,136.00	0.04
440	300257	开山股份	8,500	122,145.00	0.04
441	002434	万里扬	14,800	120,028.00	0.03
442	300735	光弘科技	9,860	119,897.60	0.03
443	002847	盐津铺子	1,200	119,664.00	0.03
444	000959	首钢股份	20,600	115,772.00	0.03
445	000062	深圳华强	6,812	115,190.92	0.03
446	002399	海普瑞	7,220	115,014.60	0.03
447	000156	华数传媒	14,900	114,879.00	0.03
448	002583	海能达	22,620	114,004.80	0.03
449	002468	申通快递	14,900	113,538.00	0.03
450	002918	蒙娜丽莎	3,600	113,004.00	0.03
451	300761	立华股份	3,400	112,642.00	0.03
452	000826	启迪环境	20,910	111,868.50	0.03
453	000869	张裕 A	3,000	111,420.00	0.03
454	002635	安洁科技	7,500	109,725.00	0.03
455	002498	汉缆股份	30,300	108,474.00	0.03
456	000937	冀中能源	27,400	107,682.00	0.03
457	300702	天宇股份	2,980	105,551.60	0.03
458	002302	西部建设	13,300	105,070.00	0.03
459	002608	江苏国信	16,300	103,994.00	0.03
460	002461	珠江啤酒	9,500	103,930.00	0.03
461	001872	招商港口	6,100	103,212.00	0.03
462	002978	安宁股份	1,700	102,714.00	0.03
463	002945	华林证券	7,400	102,268.00	0.03
464	000031	大悦城	28,241	101,667.60	0.03
465	002912	中新赛克	2,480	101,605.60	0.03
466	002194	武汉凡谷	7,300	97,747.00	0.03
467	002815	崇达技术	7,800	97,344.00	0.03
468	002532	天山铝业	11,600	97,324.00	0.03
469	002320	海峡股份	16,425	96,414.75	0.03
470	000582	北部湾港	11,500	95,450.00	0.03
471	000046	泛海控股	41,212	94,787.60	0.03
472	300861	美畅股份	1,100	92,741.00	0.03
473	300768	迪普科技	2,400	92,712.00	0.03
474	002653	海思科	4,300	92,536.00	0.03
475	300602	飞荣达	5,132	91,349.60	0.03
476	000553	安道麦 A	9,600	88,992.00	0.03
477	000935	四川双马	6,400	87,296.00	0.03
478	300869	康泰医学	1,200	84,984.00	0.02
479	000539	粤电力 A	22,300	83,848.00	0.02

480	002948	青岛银行	16,600	82,502.00	0.02
481	000600	建投能源	16,700	81,997.00	0.02
482	002901	大博医疗	1,100	80,179.00	0.02
483	002959	小熊电器	1,200	79,728.00	0.02
484	002950	奥美医疗	4,800	79,488.00	0.02
485	000958	东方能源	18,100	79,459.00	0.02
486	002755	奥赛康	5,700	77,463.00	0.02
487	300815	玉禾田	2,200	76,626.00	0.02
488	002243	力合科创	7,700	73,227.00	0.02
489	002419	天虹股份	10,900	71,504.00	0.02
490	000688	国城矿业	8,100	70,713.00	0.02
491	002984	森麒麟	1,900	69,255.00	0.02
492	003012	东鹏控股	3,900	64,896.00	0.02
493	000537	广宇发展	12,100	63,283.00	0.02
494	002946	新乳业	4,000	60,600.00	0.02
495	000927	中国铁物	16,100	59,892.00	0.02
496	002961	瑞达期货	2,700	57,564.00	0.02
497	002793	罗欣药业	5,600	55,832.00	0.02
498	002818	富森美	4,000	48,240.00	0.01
499	002423	中粮资本	4,400	39,820.00	0.01
500	002911	佛燃能源	2,860	26,855.40	0.01

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.07
2	301006	迈拓股份	5,051	125,719.39	0.04
3	300919	中伟股份	454	74,002.00	0.02
4	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
5	300981	中红医疗	330	30,884.79	0.01
6	300953	震裕科技	294	29,847.30	0.01
7	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
8	300941	创识科技	489	24,552.06	0.01
9	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
10	301009	可靠股份	807	22,541.97	0.01
11	300937	药易购	334	18,057.04	0.01
12	300982	苏文电能	370	17,322.28	0.00
13	300614	百川畅银	383	16,272.30	0.00
14	300942	易瑞生物	528	15,159.71	0.00

15	300955	嘉亨家化	314	14,830.88	0.00
16	300996	普联软件	310	14,068.34	0.00
17	301013	利和兴	504	13,986.51	0.00
18	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
19	300997	欢乐家	979	13,067.16	0.00
20	300966	共同药业	358	12,311.56	0.00
21	300933	中辰股份	1,117	11,662.18	0.00
22	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
23	300962	中金辐照	657	11,373.12	0.00
24	300948	冠中生态	380	10,503.04	0.00
25	300930	屹通新材	420	10,321.78	0.00
26	300993	玉马遮阳	497	10,079.55	0.00
27	300945	曼卡龙	531	10,073.73	0.00
28	300961	深水海纳	436	9,727.10	0.00
29	301011	华立科技	250	9,424.50	0.00
30	300985	致远新能	345	8,763.45	0.00
31	300978	东箭科技	630	8,741.53	0.00
32	300987	川网传媒	304	8,186.69	0.00
33	300943	春晖智控	342	7,925.10	0.00
34	300960	通业科技	332	7,806.84	0.00
35	300992	泰福泵业	298	6,885.42	0.00
36	300975	商络电子	517	6,872.51	0.00
37	301010	晶雪节能	272	5,127.96	0.00
38	300995	奇德新材	209	5,008.52	0.00
39	301012	扬电科技	191	4,854.16	0.00
40	301007	德迈仕	322	4,766.15	0.00
41	300998	宁波方正	203	4,347.24	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	000799	酒鬼酒	1,512,643.00	0.40
2	300896	爱美客	916,164.00	0.24
3	300750	宁德时代	839,192.00	0.22
4	000516	国际医学	732,019.00	0.19
5	002497	雅化集团	583,728.00	0.16
6	300122	智飞生物	533,775.00	0.14
7	002415	海康威视	512,028.00	0.14
8	300832	新产业	509,745.00	0.14
9	002812	恩捷股份	498,394.00	0.13

10	002747	埃斯顿	418,498.00	0.11
11	002607	中公教育	362,133.00	0.10
12	300760	迈瑞医疗	351,350.00	0.09
13	002756	永兴材料	339,760.00	0.09
14	002821	凯莱英	328,980.00	0.09
15	300763	锦浪科技	327,653.00	0.09
16	300782	卓胜微	312,454.00	0.08
17	002920	德赛西威	308,413.00	0.08
18	002221	东华能源	302,426.00	0.08
19	000063	中兴通讯	290,950.00	0.08
20	000661	长春高新	286,359.00	0.08

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	002709	天赐材料	835,553.00	0.22
2	300339	润和软件	669,328.00	0.18
3	300888	稳健医疗	396,097.94	0.11
4	300782	卓胜微	350,332.00	0.09
5	002594	比亚迪	341,819.00	0.09
6	000333	美的集团	336,212.00	0.09
7	000651	格力电器	329,298.00	0.09
8	300981	中红医疗	317,500.00	0.08
9	300059	东方财富	296,395.20	0.08
10	300997	欢乐家	254,226.00	0.07
11	000001	平安银行	250,947.00	0.07
12	300036	超图软件	248,414.00	0.07
13	002807	江阴银行	247,831.00	0.07
14	002304	洋河股份	244,235.00	0.07
15	000568	泸州老窖	231,358.00	0.06
16	300941	创识科技	229,548.00	0.06
17	002142	宁波银行	229,347.00	0.06
18	300953	震裕科技	216,300.00	0.06
19	000002	万科 A	209,875.00	0.06
20	301009	可靠股份	206,340.00	0.05

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	23,946,128.81
卖出股票收入（成交）总额	23,111,569.43

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	42,900.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	42,900.00	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127038	国微转债	292	29,200.00	0.01
2	123117	健帆转债	137	13,700.00	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

报告期内基金投资的前十名证券除平安银行（证券代码 000001）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

平安银行 2020 年 10 月 16 日公告称，因贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对公司合计罚款人民币 100 万元。

平安银行 2021 年 6 月 8 日公告称，因利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险；固定资产授信严重不审慎，贷款用途审查监控不到位等原因，中国银行保险监督管理委员会云南监管局对公司罚款人民币 210 万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.12.2 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。

7.12.3 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	2,185.13
2	应收证券清算款	75,646.69
3	应收股利	-
4	应收利息	40.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	77,871.87

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301006	迈拓股份	125,719.39	0.04	新股锁定期
2	301020	密封科技	44,794.40	0.01	新股未上市
3	300981	中红医疗	25,580.37	0.01	新股锁定期
4	301015	百洋医药	17,939.46	0.01	新股锁定期

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额	持有份额	占总份额	持有份额	占总份额

			比例		比例		比例
4,647	42,856.58	4,941,702.00	2.48%	73,484,031.00	36.90%	120,728,774.00	60.62%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	北京三和众恒机电技术有限公司	3,985,600.00	2.00%
2	章斌	2,526,375.00	1.27%
3	吴晓彤	1,821,551.00	0.91%
4	黎彩贞	1,065,490.00	0.53%
5	郝世军	911,711.00	0.46%
6	浙江华浙白马房地产开发有限公司	910,052.00	0.46%
7	曹苹	804,403.00	0.40%
8	吴飞	737,889.00	0.37%
9	陈志彪	716,192.00	0.36%
10	项志英	700,000.00	0.35%
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资基金联接基金	120,728,774.00	60.62%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年12月4日)基金份额总额	4,127,538,537.00
本报告期期初基金份额总额	229,154,507.00
本报告期基金总申购份额	39,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	69,000,000.00
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	199,154,507.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

因南方基金管理股份有限公司（以下简称“公司”）董事长病逝缺位，根据相关法律法规和公司章程，公司董事会决定由公司总经理杨小松先生代为履行公司董事长职务。该决定自 2021 年 2 月 19 日起生效。

2021 年 5 月 19 日，公司副总经理常克川兼任首席信息官。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	2	30,801,141.89	67.92%	3,079.56	67.92%	-
华泰证券	3	14,549,012.97	32.08%	1,454.86	32.09%	-
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	-	-	-0.23	-0.01%	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源	90,480.45	8.21%	-	-	-	-
华泰证券	797,014.94	72.36%	-	-	-	-
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	213,967.60	19.43%	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	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	2021-02-04
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分指数基金修订基金合同有关条款的公告	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	2021-03-31
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方华泰联合证券承销证券的关联交易公告	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	2021-04-16
4	南方基金关于深证成份交易型开放式指数证券投资基金增加广发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	2021-06-18

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20210101-20210630	141,728,774.00	27,000,000.00	48,000,000.00	120,728,774.00	60.62%

产品特有风险

本基金存在持有基金份额超过 20% 的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立深证成份交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《深证成份交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>