南方中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2018年07月18日

§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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	南方中证全指证券ETF
场内简称	证券基金
交易代码	512900
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2017年03月10日
报告期末基金份额总额	521,206,000.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金,采用完全复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为中证全指证券公司指数。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年04月01日 - 2018年06月30日)
1.本期已实现收益	-16,120,251.47
2.本期利润	-64,947,709.82
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1352
4.期末基金资产净值	375,164,753.12
5.期末基金份额净值	0.7198

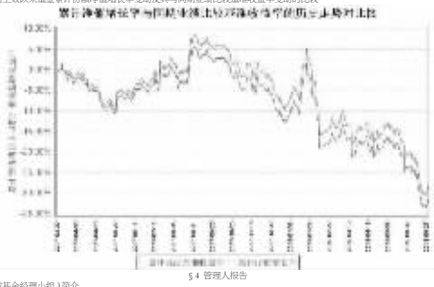
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-15.43%	1.64%	-15.99%	1.64%	0.56%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙作	本基金基金经理	2017年3月10日		8年	管理学学士,具有基金从业资格,金融分析师(CFA)资格,注册会计师(CPA)资格,曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部,德勤华永会计师事务所深圳分所审计部,2010年2月加入南方基金,历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员;2014年12月至2015年5月,担任南方恒生ETF的基金经理助理;2015年5月至2016年7月,任南方500工业ETF、南方500原材料ETF基金经理;2015年7月至今,任改革基金、高铁基金、500信息基金经理;2016年5月至今,任南方创业板ETF、南方创业板ETF联接基金经理;2016年8月至今,任500信息联接、深成ETF、南方深成基金经理;2017年3月至今,任南方金指证券ETF联接、南方中证金指证券ETF基金经理;2017年6月至今,任南方中证银行ETF、南方银行联接基金经理;2018年2月至今,任H股ETF、南方H股联接基金经理。

注:1.对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方中证金指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金份额持有人利益的情况。

4.3 公平交易专项说明

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

中证银行指数本季度下跌11.73%。

建仓完成后,我们通过目建的"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)市场因素带来的成份股权重偏差,对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化;
(2)报告期内指数成份股(包括调出指数成分股)的长期停牌,引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离;
(3)根据指数每半年度成份股调整进行的基金调仓,事前我们制定了详细的调仓方案,在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生,将跟踪误差控制在理想范围内。

4.5 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0.7198元,报告期内,份额净值增长率为-15.43%,同期业绩基准增长率为-15.99%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	373,799,841.53	98.80
	其中:股票	373,799,841.53	98.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,347,229.93	1.15
8	其他资产	188,850.03	0.05
	合计	378,335,921.49	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2的合计项中不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合(指数投资部分)

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	-	-
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	373,502,042.80	99.56
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	-	-
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	373,502,042.80	99.56

报告期末按行业分类的境内股票投资组合(积极投资部分)

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	191,454.74	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,103.85	0.01
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	81,226.14	0.02
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	295,784.73	0.08

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有港股通股票投资。
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600030	中信证券	3,314,867	54,927,346.19	14.64
2	600837	海通证券	4,028,898	38,153,664.06	10.17
3	601211	国泰君安	1,871,272	27,582,549.28	7.35
4	601688	华泰证券	1,627,059	24,357,073.23	6.49
5	000776	广发证券	1,468,581	19,488,069.87	5.19
6	600958	东方证券	1,783,757	16,285,701.41	4.34
7	600999	招商证券	1,137,717	15,563,968.56	4.15
8	000166	申万宏源	3,367,600	14,716,412.00	3.92
9	601901	方正证券	2,044,912	13,680,461.28	3.65
10	601377	兴业证券	2,312,420	12,186,453.40	3.25

积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.03
2	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.02
3	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.01
4	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.01
5	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
5.5 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债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。
5.7 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。
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和掘益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金可投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货合约。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 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浦发银行(证券代码600000 SH)、兴业银行(证券代码601166 SH)、招商银行(证券代码600036 SH)外其他证券的发行主体本年度监管部门立案调查、不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
1.浦发银行(证券代码600000 SH)
根据2018年5月4日中国银行保险监督委员会执行处罚信息公开表(银监罚决字(2018)14号),对上海浦东发展银行股份有限公司(下称浦发银行,股票代码:600000)内控管理严重违反审慎经营规则,通过资金计划投资分行协议存款,虚增一般存款等十九项违规事实罚款5845万元,没收违法所得10.927万元,罚没合计5855.927万元。
2.兴业银行(证券代码601166 SH)
根据2018年5月4日中国银行保险监督委员会执行处罚信息公开表(银监罚决字(2018)1号),对兴业银行股份有限公司(下称兴业银行,股票代码:601166)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产等十二项违规事实罚款5870万元。
3.招商银行(证券代码600036 SH)
根据2018年5月4日中国银行保险监督委员会执行处罚信息公开表(银监罚决字(2018)13号),对招商银行股份有限公司(下称招商银行,股票代码:600036)内控管理严重违反审慎经营规则,违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等十四项违规事实执行处罚决定,罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。
对上述涉及的投资决策程序的说明:本基金为指数型基金,限复制指数被动持有,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。
5.11.2 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。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,741.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	96.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,837.62

5.11.4 报告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。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。
5.11.5.2 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	603706	东方环宇	23,103.85	0.02	新股未上市
2	603105	芯能科技	16,470.30	0.02	新股未上市

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	452,506,000.00
报告期间基金总申购份额	186,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	117,300,000.00
报告期期末基金份额总额	521,206,000.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本基金管理人未持有本基金份额。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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(%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
南方中证金指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	20180401-20180630	249,923,000.00	99,300,000.00	23,400,000.00	325,823,000.00	62.51
产品持有风险							
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。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1.《南方中证金指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。
2.南方中证金指证券公司交易型开放式指数证券投资基金托管协议。
3.南方中证金指证券公司交易型开放式指数证券投资基金2018年2季度报告原文。
9.2 存放地点
深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层。
9.3 查阅方式
网站:http://www.nffund.com

南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6月30日

基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年7月18日

§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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方中证银行ETF
场内简称	银行基金
基金主代码	512700
交易代码	512700
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017年6月28日
报告期末基金份额总额	115,381,000.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金,采用完全复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率,本基金标的指数为中证银行指数。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金,本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

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"银行基金"。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日-2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-667,668.74
2.本期利润	-12,535,081.77
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1101
4.期末基金资产净值	104,883,810.38
5.期末基金份额净值	0.9090

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-10.47%	1.01%	-11.73%	1.00%	1.26%	0.01%

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

注:1.基金合同生效时间是2017年6月28日。
2.本基金建仓期为3个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。
3.基金合同中关于基金投资比例的约定,本基金将全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现,正常情况下,本基金的指数化投资比例不低于基金资产净值的90%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙作	本基金基金经理	2017年6月28日	-	8	管理学学士,具有基金从业资格,金融分析师(CFA)资格,注册会计师(CPA)资格,曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部,德勤华永会计师事务所深圳分所审计部,2010年2月加入南方基金,历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员;2014年12月至2015年5月,担任南方恒生ETF的基金经理助理;2015年5月至2016年7月,任南方500工业ETF、南方500原材料ETF基金经理;2015年7月至今,任改革基金、高铁基金、500信息基金经理;2016年5月至今,任南方创业板ETF、南方创业板ETF联接基金经理;2016年8月至今,任500信息联接、深成ETF、南方深成基金经理;2017年3月至今,任南方金指证券ETF联接、南方中证金指证券ETF基金经理;2017年6月至今,任南方中证银行ETF、南方银行联接基金经理;2018年2月至今,任H股ETF、南方H股联接基金经理。

注:1.本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日,后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告(生效)日期;
2.证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

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,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 公平交易专项说明

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

中证银行指数本季度下跌11.73%。

建仓完成后,我们通过目建的"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)市场因素带来的成份股权重偏差,对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化;
(2)报告期内指数成份股(包括调出指数成分股)的长期停牌,引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离;
(3)根据指数每半年度成份股调整进行的基金调仓,事前我们制定了详细的调仓方案,在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生,将跟踪误差控制在理想范围内。

4.5 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0.9090元,报告期内,份额净值增长率为-10.47%,同期业绩基准增长率为-11.73%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	104,631,799.33	99.50
	其中:股票	104,631,799.33	99.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	526,657.75	0.50
8	其他资产	3,837.62	0.00
9	合计	105,162,294.70	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2的合计项中不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	67,459.26	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,103.85	0.02
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	104,460,010.08	99.60
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	-	-
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	104,460,010.08	99.60

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有港股通股票投资。
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600036	招商银行	583,707	15,433,213.08	14.71
2	601166	兴业银行	722,000	10,396,800.00	9.91
3	600016	民生银行	1,370,000	9,590,000.00	9.14
4	601328	交通银行	1,592,000	9,138,080.00	8.71
5	601288	农业银行	2,215,200	7,620,288.00	7.27
6	601398	工商银行	1,249,800	6,648,936.00	6.34
7	600000	浦发银行	680,300	6,503,668.00	6.20
8	601169	北京银行	857,700	5,171,931.00	4.93
9	000001	平安银行	497,200	4,519,548.00	4.31
10	601988	中国银行	1,221,700	4,410,337.00	4.20

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.08
2	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.05
3	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.02
4	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。
5.7 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。
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和掘益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金可投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货合约。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 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浦发银行(证券代码600000 SH)、兴业银行(证券代码601166 SH)、招商银行(证券代码600036 SH)外其他证券的发行主体本年度监管部门立案调查、不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
1.浦发银行(证券代码600000 SH)
根据2018年5月4日中国银行保险监督委员会执行处罚信息公开表(银监罚决字(2018)14号),对上海浦东发展银行股份有限公司(下称浦发银行,股票代码:600000)内控管理严重违反审慎经营规则,通过资金计划投资分行协议存款,虚增一般存款等十九项违规事实罚款5845万元,没收违法所得10.927万元,罚没合计5855.927万元。
2.兴业银行(证券代码601166 SH)
根据2018年5月4日中国银行保险监督委员会执行处罚信息公开表(银监罚决字(2018)1号),对兴业银行股份有限公司(下称兴业银行,股票代码:601166)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产等十二项违规事实罚款5870万元。
3.招商银行(证券代码600036 SH)
根据2018年5月4日中国银行保险监督委员会执行处罚信息公开表(银监罚决字(2018)13号),对招商银行股份有限公司(下称招商银行,股票代码:600036)内控管理严重违反审慎经营规则,违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等十四项违规事实执行处罚决定,罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。
对上述涉及的投资决策程序的说明:本基金为指数型基金,限复制指数被动持有,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。
5.11.2 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。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,741.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	96.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,837.62

5.11.4 报告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。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。
5.11.5.2 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	603706	东方环宇	23,103.85	0.02	新股未上市
2	603105	芯能科技	16,470.30	0.02	新股未上市

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	90,381,000.00
报告期间基金总申购份额	40,400,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	15,400,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	115,381,000.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期末,基金管理人未持有本基金份额。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20180401-20180630	53,009,100.00	23,924,400.00	400,000.00	76,533,500.00	66.33%
产品持有风险							
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