中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 8 月 23 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 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.....8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....8
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.....9
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.....10
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....10
§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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....11
6.1 资产负债表.....11
6.2 利润表.....13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....14
6.4 报表附注.....16
§7 投资组合报告.....31
7.1 期末基金资产组合情况.....31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....32
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.....33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....37
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.....37
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.....37
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.....38
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.....38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....38

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 38
7.12 投资组合报告附注 38
§8 基金份额持有人信息 39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 39
8.2 期末上市基金前十名持有人 40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 40
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 40
§9 开放式基金份额变动 40
§10 重大事件揭示 41
10.1 基金份额持有人大会决议 41
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 41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 41
10.4 基金投资策略的改变 41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 41
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 41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 41
10.8 其他重大事件 42
§11 影响投资者决策的其他重要信息 43
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 43
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 43
§12 备查文件目录 43
12.1 备查文件目录 43
12.2 存放地点 43
12.3 查阅方式 43

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方小康 ETF
场内简称	小康 ETF
基金主代码	510160
交易代码	510160
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2010 年 8 月 27 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	1,062,057,409.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010 年 11 月 1 日

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“小康 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。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，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证南方小康产业指数，简称小康指数。如果指数编制单位变更或停止中证南方小康产业指数的编制、发布或授权，或中证南方小康产业指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为中证南方小康产业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，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。
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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

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(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-11,954,329.72
本期利润	89,167,504.06
加权平均基金份额本期利润	0.0770
本期加权平均净值利润率	14.13%
本期基金份额净值增长率	16.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	33,822,194.29
期末可供分配基金份额利润	0.0318

期末基金资产净值	591,774,260.36
期末基金份额净值	0.5572
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	38.63%

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
过去一个月	4.87%	0.98%	4.37%	0.98%	0.50%	0.00%
过去三个月	-3.43%	1.47%	-4.50%	1.47%	1.07%	0.00%
过去六个月	16.08%	1.50%	14.89%	1.50%	1.19%	0.00%
过去一年	6.13%	1.44%	3.99%	1.44%	2.14%	0.00%
过去三年	25.81%	1.07%	20.80%	1.08%	5.01%	-0.01%
自基金合同生效起至今	38.63%	1.52%	33.15%	1.54%	5.48%	-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

§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，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳、南京等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 8800 亿元，旗下管理 191 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户理财投资组合。

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		
周豪	本基金基金经理	2016 年 8 月 19 日	-	10 年	北京大学软件工程专业硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金信息技术部，长期负责指数基金及 ETF 基金的投研及系统支持工作；2015 年 6 月，任数量化投资部高级研究员；2018 年 2 月至 2018 年 11 月，任南方消费活力基金经理；2016 年 4 月至今，任 500 工业 ETF、500 原材料 ETF 基金经理；2016 年 8 月至今，任 380ETF、南方 380、小康 ETF、南方小康、互联基金基金经理；2016 年 9 月至今，任 1000ETF 基金经理；2017 年 8 月至今，任南方有色金属基金经理；2017 年 9 月至今，任南方有色金属联接基金经理；2018 年 1 月至今，任南方中证 100 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；

3、本基金管理人于 2019 年 7 月 13 日发布公告，原基金经理周豪先生不在担任本基金基金经理，崔蕾女士、龚涛先生为本基金新任基金经理。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。 公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占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。

4.3.2 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超过该证券当日成交量的 5%的交易次数为 5 次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数成分股调整所致。

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

本报告期内小康指数上涨 14.89%。

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）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（包括调出指数成分股）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

（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 0.5572 元，报告期内，份额净值增长率为 16.08%，同期业绩基准增长率为 14.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着 A 股国际化的不断推进，外资持续流入国内，A 股市场相继被纳入 MSCI 和富时罗素指数，长远来看，市场风格将有望逐渐向外资偏好的价值蓝筹风格靠拢，预计 2019 年下半年，基本面较好的白马股仍存在机会。小康指数的编制方式基于财务指标，力求在经济下行的情况下挖掘出优质价值股，同时捕捉代表基础产业、先进制造业和现代服务业的发展势头。在国内经济仍以供给侧改革为主线的背景下，小康指数有望继续紧跟国家经济发展的方向，分享相应的产业成长红利。

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。基金管理人对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；在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定。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；若《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，本基金托管人在对中证南方小康产业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，中证南方小康产业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中证南方小康产业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，中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.4.1	2,685,185.07	860,237.13

结算备付金		33,973.99	13,267.72
存出保证金		1,939.25	8,439.47
交易性金融资产	6.4.4.2	590,472,312.55	569,096,569.63
其中：股票投资		590,472,312.55	569,096,569.63
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.4.5	546.94	350.78
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		593,193,957.80	569,978,864.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		953,514.97	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		236,711.34	246,925.25
应付托管费		47,342.27	49,385.09
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	12,677.91	17,007.90
应交税费		28.17	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	169,422.78	410,000.00
负债合计		1,419,697.44	723,318.24
所有者权益：			
实收基金	6.4.4.9	426,887,804.83	476,728,884.54
未分配利润	6.4.4.10	164,886,455.53	92,526,661.95
所有者权益合计		591,774,260.36	569,255,546.49
负债和所有者权益总计		593,193,957.80	569,978,864.73

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.5572 元，基金份额总额 1,062,057,409.00 份。

6.2 利润表

会计主体：中证南方小康产业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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		91,350,541.50	-112,352,564.67
1.利息收入		6,005.80	39,815.36
其中：存款利息收入	6.4.4.11	5,149.99	16,293.93
债券利息收入		855.81	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	23,521.43
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-9,777,576.82	1,027,650.89
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-16,874,799.07	-5,808,639.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	37,151.84	-
资产支持证券投资	6.4.4.14	-	-

收益			
贵金属投资收益	6.4.4.15	-	-
衍生工具收益	6.4.4.16	-	-
股利收益	6.4.4.17	7,060,070.41	6,836,290.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	101,121,833.78	-113,348,736.33
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.19	278.74	-71,294.59
减：二、费用		2,183,037.44	2,667,452.66
1.管理人报酬	6.4.7.2.1	1,561,430.54	1,831,253.23
2.托管费	6.4.7.2.2	312,286.19	366,250.65
3.销售服务费	6.4.7.2.3	-	-
4.交易费用	6.4.4.20	89,650.91	139,158.01
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		3.02	-
7.其他费用	6.4.4.21	219,666.78	330,790.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		89,167,504.06	-115,020,017.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		89,167,504.06	-115,020,017.33

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中证南方小康产业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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益	476,728,884.54	92,526,661.95	569,255,546.49

（基金净值）			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	89,167,504.06	89,167,504.06
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）	-49,841,079.71	-16,807,710.48	-66,648,790.19
其中：1.基金申购款	15,273,879.18	6,328,560.07	21,602,439.25
2.基金赎回款	-65,114,958.89	-23,136,270.55	-88,251,229.44
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）	426,887,804.83	164,886,455.53	591,774,260.36
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	542,647,731.74	295,091,496.19	837,739,227.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-115,020,017.33	-115,020,017.33
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）	-65,114,958.82	-33,915,152.91	-99,030,111.73
其中：1.基金申购款	14,469,990.86	7,496,638.69	21,966,629.55
2.基金赎回款	-79,584,949.68	-41,411,791.60	-120,996,741.28
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）	477,532,772.92	146,156,325.95	623,689,098.87

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 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 6 月 30 日的财务状况以及自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.2 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。

6.4.3 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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。

6.4.3.3 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。

6.4.4 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	2,685,185.07
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-

其他存款	-
合计	2,685,185.07

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		620,514,358.74	590,472,312.55	-30,042,046.19
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		620,514,358.74	590,472,312.55	-30,042,046.19

注:于 2019 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(2018 年 12 月 31 日：0.00 元)。

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.4.4 买入返售金融资产

6.4.4.4.1 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。

6.4.4.4.2 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。

6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	306.28
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	239.85
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.81
合计	546.94

6.4.4.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	12,677.91
银行间市场应付交易费用	-
合计	12,677.91

6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应退退补款	-
预提费用	119,422.78
应付指数使用费	50,000.00
可退退补款	-
其他	-
合计	169,422.78

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。

6.4.4.9 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 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,186,057,409.00	476,728,884.54
本期申购	38,000,000.00	15,273,879.18
本期赎回（以“-”号填列）	-162,000,000.00	-65,114,958.89
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	1,062,057,409.00	426,887,804.83

6.4.4.10 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	50,903,324.76	41,623,337.19	92,526,661.95
本期利润	-11,954,329.72	101,121,833.78	89,167,504.06
本期基金份额交易产生的变动数	-5,126,800.75	-11,680,909.73	-16,807,710.48
其中：基金申购款	1,598,775.67	4,729,784.40	6,328,560.07
基金赎回款	-6,725,576.42	-16,410,694.13	-23,136,270.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,822,194.29	131,064,261.24	164,886,455.53

6.4.4.11 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 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,573.38
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	1,558.51
其他	18.10
合计	5,149.99

6.4.4.12 股票投资收益

6.4.4.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-9,649,467.42
股票投资收益——赎回差价收入	-7,225,331.65
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-16,874,799.07

6.4.4.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	64,695,506.89
减：卖出股票成本总额	74,344,974.31
买卖股票差价收入	-9,649,467.42

6.4.4.12.3 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 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	88,251,229.44

减：现金支付赎回款总额	-480,743.56
减：赎回股票成本总额	95,957,304.65
赎回差价收入	-7,225,331.65

6.4.4.12.4 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。

6.4.4.13 债券投资收益

6.4.4.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	37,151.84
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	37,151.84

6.4.4.13.2 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 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,407,032.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,369,000.00
减：应收利息总额	880.96
买卖债券差价收入	37,151.84

6.4.4.13.3 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。

6.4.4.13.4 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。

6.4.4.14 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。

6.4.4.15 贵金属投资收益

6.4.4.15.1 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。

6.4.4.15.2 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。

6.4.4.15.3 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。

6.4.4.15.4 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。

6.4.4.16 衍生工具收益

6.4.4.16.1 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。

6.4.4.16.2 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。

6.4.4.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	7,060,070.41
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,060,070.41

6.4.4.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	101,121,833.78
——股票投资	101,121,833.78
——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	101,121,833.78

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(2018 年 12 月 31 日：0.00 元)。

6.4.4.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	278.74
合计	278.74

替代损益收入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。

6.4.4.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	89,650.91
银行间市场交易费用	-
合计	89,650.91

6.4.4.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,917.22
指数使用费	100,000.00
银行费用	244.00
上市费	29,752.78
合计	219,666.78

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(自然季度)人民币 50,000 元。

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司新增厦门合泽吉企业管理合伙企业（有限合伙）、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）四名股东，股权结构发生变更。基金管理人已于 2019 年 8 月 1 日发布相关公告。

6.4.6 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“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
中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“中证南方小康产业 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。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	132,254,841.15	100.00%	202,189,847.02	100.00%

6.4.7.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.7.1.3 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 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	13,225.47	100.00%	12,677.91	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	20,219.04	100.00%	16,436.31	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。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,561,430.54	1,831,253.23
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 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：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	312,286.19	366,250.65

支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 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：

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

6.4.7.2.3 销售服务费

无。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 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
中证南方小康产业交易	992,663,900.0	93.4661%	1,104,663,900.	93.1375%

型开放式指数证券投资基金联接基金	0		00	

南方小康产业 ETF 联接基金投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	2,685,185.07	3,573.38	3,237,908.47	13,807.35

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。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.9 期末（2019 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证南方小康产业指数，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，跟踪中证南方小康产业指数，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。

6.4.10.2 信用风险

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

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

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

于 2019 年 6 月 30 日,本基金无债券投资(2018 年 12 月 31 日：同)。

6.4.10.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。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。

6.4.10.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

6.4.10.4 市场风险

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

6.4.10.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,685,185.07	-	-	-	2,685,185.07
结算备付金	33,973.99	-	-	-	33,973.99
存出保证金	1,939.25	-	-	-	1,939.25
交易性金融资产	-	-	-	590,472,312.55	590,472,312.55
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	546.94	546.94
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,721,098.31	-	-	590,472,859.49	593,193,957.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人	-	-	-	236,711.34	236,711.34

报酬					
应付托管费	-	-	-	47,342.27	47,342.27
应付证券清算款	-	-	-	953,514.97	953,514.97
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	12,677.91	12,677.91
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	28.17	28.17
其他负债	-	-	-	169,422.78	169,422.78
负债总计	-	-	-	1,419,697.44	1,419,697.44
利率敏感度缺口	2,721,098.31	-	-	589,053,162.05	591,774,260.36
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	860,237.13	-	-	-	860,237.13
结算备付金	13,267.72	-	-	-	13,267.72
存出保证金	8,439.47	-	-	-	8,439.47
交易性金融资产	-	-	-	569,096,569.63	569,096,569.63
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	350.78	350.78
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	881,944.32	-	-	569,096,920.41	569,978,864.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	246,925.25	246,925.25
应付托管费	-	-	-	49,385.09	49,385.09
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	-	-	-	17,007.90	17,007.90
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	410,000.00	410,000.00
负债总计	-	-	-	723,318.24	723,318.24
利率敏感度缺口	881,944.32	-	-	568,373,602.17	569,255,546.49

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

6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%(2018 年 12 月 31 日：0.00%)，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)。

6.4.10.4.2 外汇风险

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

6.4.10.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，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，跟踪中证南方小康产业指数，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，中证南方小康产业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%，权证、股指期货及中国证监会允许的其他金融工具的投资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。

6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	590,472,312.55	99.78	569,096,569.63	99.97
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	590,472,312.55	99.78	569,096,569.63	99.97

6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2019 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2018 年 12 月 31 日 ）
	1.组合自身基准上升 5%	29,283,949.27	28,178,149.55
	2.组合自身基准下降 5%	-29,283,949.27	-28,178,149.55

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	590,472,312.55	99.54
	其中：股票	590,472,312.55	99.54
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	2,719,159.06	0.46
8	其他资产	2,486.19	0.00
9	合计	593,193,957.80	100.00

上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而下表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	-	-
B	采矿业	41,551,168.15	7.02
C	制造业	225,831,733.83	38.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,039,958.35	8.12
E	建筑业	65,872,826.50	11.13
F	批发和零售业	23,361,266.47	3.95
G	交通运输、仓储和邮政业	22,744,110.25	3.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,401,815.08	6.66
J	金融业	94,466,241.54	15.96
K	房地产业	23,488,677.87	3.97
L	租赁和商务服务业	5,213,433.15	0.88
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	589,971,231.19	99.70

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	363,431.25	0.06
C	制造业	64,176.41	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	39,603.76	0.01
J	金融业	33,869.94	0.01
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	501,081.36	0.08

7.2.3 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	600050	中国联通	5,391,518	33,211,750.88	5.61
2	600019	宝钢股份	4,369,783	28,403,589.50	4.80
3	600887	伊利股份	556,781	18,602,053.21	3.14
4	600690	海尔智家	1,047,134	18,104,946.86	3.06
5	601186	中国铁建	1,769,783	17,609,340.85	2.98
6	600795	国电电力	6,692,253	16,998,322.62	2.87
7	601390	中国中铁	2,524,446	16,459,387.92	2.78
8	600585	海螺水泥	389,928	16,182,012.00	2.73
9	600741	华域汽车	684,279	14,780,426.40	2.50
10	600011	华能国际	2,114,200	13,171,466.00	2.23
11	601899	紫金矿业	3,131,800	11,806,886.00	2.00
12	601669	中国电建	2,123,161	11,231,521.69	1.90
13	600362	江西铜业	657,343	10,346,578.82	1.75
14	601607	上海医药	562,609	10,211,353.35	1.73

15	600886	国投电力	1,304,749	10,137,899.73	1.71
16	601169	北京银行	1,712,656	10,121,796.96	1.71
17	601600	中国铝业	2,568,265	10,067,598.80	1.70
18	600309	万华化学	224,100	9,589,239.00	1.62
19	600048	保利地产	748,880	9,555,708.80	1.61
20	601225	陕西煤业	984,200	9,094,008.00	1.54
21	600297	广汇汽车	2,028,110	9,045,370.60	1.53
22	600030	中信证券	370,300	8,816,843.00	1.49
23	601818	光大银行	2,041,342	7,777,513.02	1.31
24	601766	中国中车	947,800	7,667,702.00	1.30
25	601601	中国太保	208,937	7,628,289.87	1.29
26	600837	海通证券	484,799	6,879,297.81	1.16
27	600015	华夏银行	889,474	6,848,949.80	1.16
28	601618	中国中冶	2,186,600	6,647,264.00	1.12
29	601985	中国核电	1,144,300	6,362,308.00	1.08
30	601800	中国交建	540,872	6,122,671.04	1.03
31	600352	浙江龙盛	375,685	5,924,552.45	1.00
32	601006	大秦铁路	728,205	5,891,178.45	1.00
33	601992	金隅集团	1,564,500	5,882,520.00	0.99
34	601229	上海银行	488,226	5,785,478.10	0.98
35	600066	宇通客车	428,869	5,583,874.38	0.94
36	601211	国泰君安	301,800	5,538,030.00	0.94
37	600188	兖州煤业	504,300	5,481,741.00	0.93
38	600068	葛 洲 坝	874,900	5,450,627.00	0.92
39	601233	桐昆股份	346,000	5,366,460.00	0.91
40	600522	中天科技	585,100	5,365,367.00	0.91
41	600010	包钢股份	3,172,480	5,361,491.20	0.91
42	600919	江苏银行	733,900	5,328,114.00	0.90
43	600276	恒瑞医药	79,340	5,236,440.00	0.88
44	600660	福耀玻璃	216,700	4,925,591.00	0.83
45	600089	特变电工	671,228	4,866,403.00	0.82
46	600637	东方明珠	459,430	4,842,392.20	0.82
47	601888	中国国旅	53,231	4,718,928.15	0.80
48	600547	山东黄金	114,365	4,708,407.05	0.80
49	600029	南方航空	599,865	4,630,957.80	0.78
50	601939	建设银行	621,470	4,623,736.80	0.78
51	601009	南京银行	539,189	4,453,701.14	0.75
52	600606	绿地控股	621,100	4,242,113.00	0.72
53	600489	中金黄金	405,750	4,167,052.50	0.70
54	600060	海信电器	481,177	4,147,745.74	0.70
55	601933	永辉超市	402,012	4,104,542.52	0.69
56	600271	航天信息	177,810	4,098,520.50	0.69
57	600703	三安光电	363,200	4,096,896.00	0.69

58	600340	华夏幸福	121,830	3,968,003.10	0.67
59	601111	中国国航	409,800	3,921,786.00	0.66
60	600196	复星医药	153,071	3,872,696.30	0.65
61	600115	东方航空	571,000	3,580,170.00	0.60
62	600031	三一重工	264,393	3,458,260.44	0.58
63	603993	洛阳钼业	842,800	3,337,488.00	0.56
64	601989	中国重工	592,095	3,292,048.20	0.56
65	601633	长城汽车	376,044	3,109,883.88	0.53
66	601699	潞安环能	372,240	2,955,585.60	0.50
67	600398	海澜之家	321,500	2,916,005.00	0.49
68	600383	金地集团	242,644	2,894,742.92	0.49
69	601336	新华保险	52,140	2,869,264.20	0.48
70	600332	白 云 山	67,300	2,757,281.00	0.47
71	600999	招商证券	155,462	2,656,845.58	0.45
72	601117	中国化学	390,700	2,352,014.00	0.40
73	601998	中信银行	372,300	2,222,631.00	0.38
74	601727	上海电气	413,100	2,222,478.00	0.38
75	601238	广汽集团	186,280	2,036,040.40	0.34
76	603288	海天味业	18,920	1,986,600.00	0.34
77	600009	上海机场	23,100	1,935,318.00	0.33
78	600958	东方证券	176,000	1,879,680.00	0.32
79	600528	中铁工业	161,000	1,862,770.00	0.31
80	601155	新城控股	40,705	1,620,466.05	0.27
81	601788	光大证券	138,100	1,577,102.00	0.27
82	600926	杭州银行	188,140	1,567,206.20	0.26
83	601997	贵阳银行	180,640	1,562,536.00	0.26
84	600705	中航资本	280,100	1,518,142.00	0.26
85	600018	上港集团	215,400	1,469,028.00	0.25
86	600025	华能水电	336,600	1,369,962.00	0.23
87	600406	国电南瑞	72,300	1,347,672.00	0.23
88	600893	航发动力	57,817	1,313,024.07	0.22
89	601877	正泰电器	56,100	1,295,349.00	0.22
90	601838	成都银行	144,700	1,277,701.00	0.22
91	601901	方正证券	172,846	1,228,935.06	0.21
92	600208	新湖中宝	384,600	1,207,644.00	0.20
93	600482	中国动力	46,964	1,109,289.68	0.19
94	601598	中国外运	223,700	1,071,523.00	0.18
95	600061	国投资本	74,300	1,040,943.00	0.18
96	601881	中国银河	60,900	746,025.00	0.13
97	601828	美 凯 龙	40,700	494,505.00	0.08
98	601577	长沙银行	30,600	291,924.00	0.05
99	601298	青 岛 港	29,100	244,149.00	0.04
100	601066	中信建投	10,700	225,556.00	0.04

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	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.06
2	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
3	603863	松炀资源	1,612	37,204.96	0.01
4	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
5	603867	新化股份	1,045	26,971.45	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	601766	中国中车	7,653,816.70	1.34
2	600019	宝钢股份	5,463,598.76	0.96
3	600188	兖州煤业	5,137,065.00	0.90
4	600703	三安光电	3,876,100.93	0.68
5	601186	中国铁建	3,631,947.92	0.64
6	600297	广汇汽车	3,577,324.78	0.63
7	601390	中国中铁	2,861,665.00	0.50
8	601669	中国电建	2,782,859.00	0.49
9	600011	华能国际	2,479,021.00	0.44
10	601899	紫金矿业	1,982,459.00	0.35
11	601607	上海医药	1,615,807.00	0.28
12	601598	中国外运	1,067,811.72	0.19
13	601838	成都银行	1,033,088.00	0.18
14	600068	葛 洲 坝	992,105.00	0.17
15	601992	金隅集团	991,551.00	0.17
16	600795	国电电力	960,929.00	0.17
17	600048	保利地产	911,100.00	0.16
18	601233	桐昆股份	882,474.00	0.16
19	600276	恒瑞医药	799,595.00	0.14
20	600196	复星医药	784,503.00	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。

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	600153	建发股份	7,603,784.23	1.34
2	600023	浙能电力	6,740,279.10	1.18
3	600177	雅 戈 尔	5,468,058.68	0.96
4	600688	上海石化	3,750,321.85	0.66
5	600050	中国联通	3,202,356.00	0.56
6	600887	伊利股份	3,104,906.00	0.55
7	600352	浙江龙盛	3,079,154.86	0.54
8	600309	万华化学	2,519,782.26	0.44
9	601919	中远海控	2,394,124.00	0.42
10	601600	中国铝业	2,344,929.00	0.41
11	600837	海通证券	1,615,313.00	0.28
12	600518	ST 康 美	1,583,639.24	0.28
13	600031	三一重工	1,425,472.00	0.25
14	600030	中信证券	1,412,871.00	0.25
15	601633	长城汽车	1,279,290.00	0.22
16	600886	国投电力	1,042,381.00	0.18
17	600585	海螺水泥	860,701.00	0.15
18	600482	中国动力	748,239.64	0.13
19	600015	华夏银行	723,337.00	0.13
20	600919	江苏银行	687,161.00	0.12

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

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	68,828,668.10
卖出股票收入（成交）总额	64,695,506.89

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金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。

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

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

7.12.2 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	1,939.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	546.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,486.19

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	601236	红塔证券	33,869.94	0.01	新股未上市

§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		中证南方小康产业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

6,100	174,107.77	6,204,511.00	0.58%	63,188,998.00	5.95%	992,663,900.00	93.47%

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	国信证券股份有限公司	3,435,900.00	0.32%
2	方正证券股份有限公司	2,730,727.00	0.26%
3	高烨	2,380,000.00	0.22%
4	郭麟光	1,850,500.00	0.17%
5	符庆端	1,348,600.00	0.13%
6	梁威	1,342,900.00	0.13%
7	王殿成	1,227,400.00	0.12%
8	裘棋萍	826,100.00	0.08%
9	盛浩然	780,000.00	0.07%
10	肖凤兰	746,373.00	0.07%
11	中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金	992,663,900.00	93.47%

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(2010 年 8 月 27 日)基金份额总额	656,799,881.00
本报告期期初基金份额总额	1,186,057,409.00
本报告期基金总申购份额	38,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	162,000,000.00
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	1,062,057,409.00

§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

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。

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	
华泰证券	2	132,254,841.15	100.00%	13,225.47	100.00%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	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
华泰证券	1,407,032.80	100.00%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

无。

§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	20190101-20190630	1,104,663,900.00	196,000,000.00	308,000,000.00	992,663,900.00	93.47%
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。							

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中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金的文件；

2、《中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《中证南方小康产业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、《中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金 2019 年半年度报告》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