

上证 380 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
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.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末上市基金前十名持有人	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
§9 开放式基金份额变动	47
§10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方上证 380ETF
基金主代码	510290
交易代码	510290
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 16 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	150,448,915.00 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	2011 年 11 月 8 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“380ETF”。

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，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。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。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。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为上证 380 指数，简称 380 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	010-67595096
传真	0755-82763889	010-66275853
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街一号楼
邮政编码	518017	100033
法定代表人	张海波	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的互联网网址	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	-7,613,056.50
本期利润	34,850,573.91
加权平均基金份额本期利润	0.2279
本期加权平均净值利润率	16.74%
本期基金份额净值增长率	21.47%
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	56,720,696.64
期末可供分配基金份额利润	0.3770
期末基金资产净值	208,217,260.23

期末基金份额净值	1.3840
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	38.40%

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。

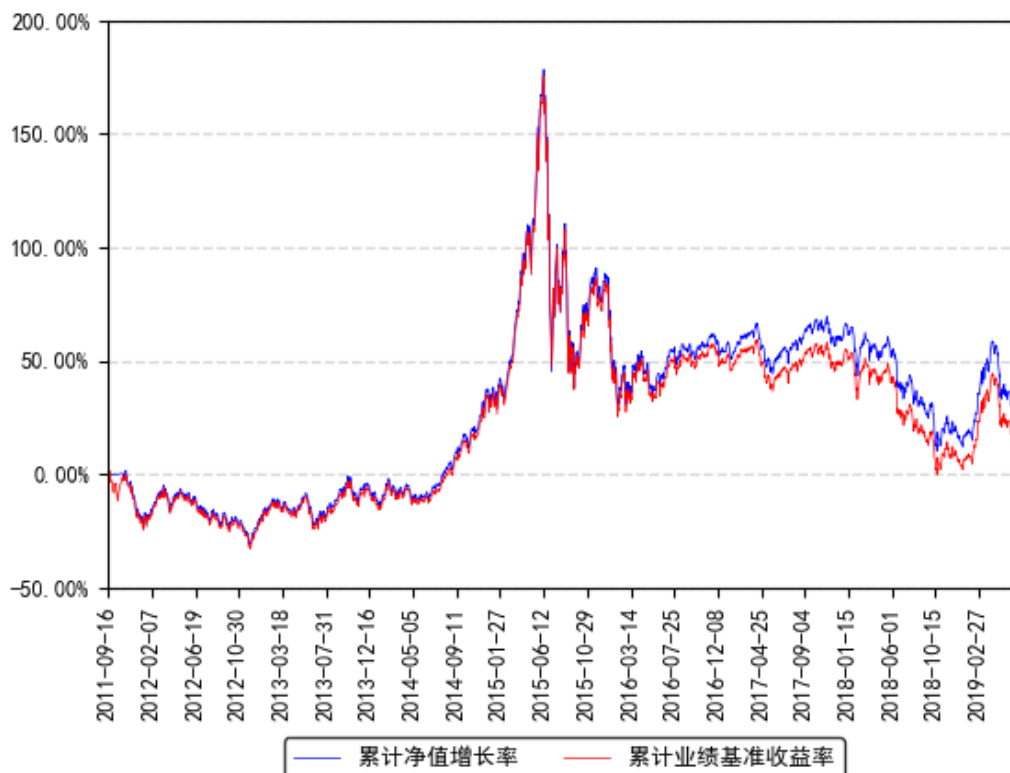
3.2 基金净值表现

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	1.82%	1.23%	1.06%	1.23%	0.76%	0.00%
过去三个月	-7.31%	1.70%	-8.47%	1.70%	1.16%	0.00%
过去六个月	21.47%	1.65%	19.87%	1.65%	1.60%	0.00%
过去一年	-1.29%	1.60%	-2.99%	1.61%	1.70%	-0.01%
过去三年	-5.70%	1.25%	-12.93%	1.27%	7.23%	-0.02%
自基金合同生效起至今	38.40%	1.72%	24.28%	1.72%	14.12%	0.00%

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

南方上证380ETF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，孙伟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

本报告期内上证 380 指数上涨 19.87%。

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（包括调出指数成份股）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离；

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.3840 元，报告期内，份额净值增长率为 21.47%，同期业绩基准增长率为 19.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美联储如期降息，IMF 年内再度下调全球经济增长预期，各国央行相继降息托底经济下行，全球货币政策宽松态势明朗，支撑全球风险资产估值。730 中央政治局会议定调，下半年经济下行压力加大，但稳增长和调结构并重，不搞大水漫灌，货币政策保障流动性合理充裕，财政政策重视加力提效，为迎接祖国 70 周年，扎实推进做好经济工作，下半年经济失速风险不大，叠加去年低基数和减税降费政策效果逐步显现，上市公司盈利有望在 3、4 季度见底，盈利趋势有望在年底反转。

科创板平稳开板并形成赚钱效应，叠加 5G、AI、物联网等新基建投资在下半年展开，整体科创行情有望带动 A 股市场风险偏好抬升。

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。基金管理人根据基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：上证 380 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	6.4.3.1	1,173,108.32	798,370.07
结算备付金		10,264.87	6,688.75

存出保证金		1,514.34	1,650.62
交易性金融资产	6.4.3.2	207,191,095.83	168,831,435.97
其中：股票投资		207,139,515.83	168,831,435.97
基金投资		-	-
债券投资		51,580.00	-
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		119,441.83	-
应收利息	6.4.3.5	254.16	183.01
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		208,495,679.35	169,638,328.42
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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		85,306.71	73,586.84
应付托管费		17,061.30	14,717.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	6,628.80	5,525.64
应交税费		1.28	3.84
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.3.8	169,421.03	404,000.00
负债合计		278,419.12	497,833.68
所有者权益:			
实收基金	6.4.3.9	150,448,915.00	148,448,915.00
未分配利润	6.4.3.10	57,768,345.23	20,691,579.74
所有者权益合计		208,217,260.23	169,140,494.74
负债和所有者权益总计		208,495,679.35	169,638,328.42

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3840 元，基金份额总额 150,448,915.00 份。

6.2 利润表

会计主体：上证 380 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		35,734,098.36	-26,901,194.50
1. 利息收入		3,238.67	3,170.75
其中：存款利息收入	6.4.3.11	3,033.93	3,058.11
债券利息收入		204.74	112.64
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-6,749,164.68	2,810,337.24
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-9,266,862.71	678,173.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	22,894.94	10,208.39
资产支持证券投资 收益	6.4.3.14	-	-

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	2,494,803.09	2,121,955.17
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	42,463,630.41	-29,714,702.49
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	16,393.96	-
减：二、费用		883,524.45	983,597.95
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	513,700.44	525,781.45
2. 托管费	6.4.6.2.2	102,740.09	105,156.31
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.3.20	46,847.21	46,630.59
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.68	0.35
7. 其他费用	6.4.3.21	220,236.03	306,029.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		34,850,573.91	-27,884,792.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34,850,573.91	-27,884,792.45

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证 380 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（基金净值）	148,448,915.00	20,691,579.74	169,140,494.74

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	34,850,573.91	34,850,573.91
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）	2,000,000.00	2,226,191.58	4,226,191.58
其中：1. 基金申购款	24,000,000.00	11,530,092.10	35,530,092.10
2. 基金赎回款	-22,000,000.00	-9,303,900.52	-31,303,900.52
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）	150,448,915.00	57,768,345.23	208,217,260.23
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）	142,448,915.00	86,736,625.86	229,185,540.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-27,884,792.45	-27,884,792.45
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）	-4,000,000.00	-3,178,916.21	-7,178,916.21
其中：1. 基金申购款	4,000,000.00	1,621,509.14	5,621,509.14
2. 基金赎回款	-8,000,000.00	-4,800,425.35	-12,800,425.35
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）	-	-	-

列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	138,448,915.00	55,672,917.20	194,121,832.20

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 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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	1,173,108.32
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	1,173,108.32

6.4.3.2 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	224,299,402.55	207,139,515.83	-17,159,886.72
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	51,580.00	11,580.00
	银行间市场	-	-
	合计	51,580.00	11,580.00
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	224,339,402.55	207,191,095.83	-17,148,306.72

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)。

6.4.3.3 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 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	209.58
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	4.60
应收债券利息	39.28
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.70
合计	254.16

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 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	6,628.80
银行间市场应付交易费用	-
合计	6,628.80

6.4.3.8 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	119,421.03
应付指数使用费	50,000.00
可退退补款	-
其他	-
合计	169,421.03

6.4.3.9 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	148,448,915.00	148,448,915.00
本期申购	24,000,000.00	24,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-22,000,000.00	-22,000,000.00
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	150,448,915.00	150,448,915.00

本期申购含转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

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	63,331,961.65	-42,640,381.91	20,691,579.74
本期利润	-7,613,056.50	42,463,630.41	34,850,573.91
本期基金份额交易产生的变动数	1,001,791.49	1,224,400.09	2,226,191.58
其中：基金申购款	10,170,001.50	1,360,090.60	11,530,092.10
基金赎回款	-9,168,210.01	-135,690.51	-9,303,900.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	56,720,696.64	1,047,648.59	57,768,345.23

6.4.3.11 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	2,524.93
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	497.78
其他	11.22
合计	3,033.93

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 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	-6,914,451.43
股票投资收益——赎回差价收入	-2,352,411.28
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-9,266,862.71

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	34,679,212.80
减：卖出股票成本总额	41,593,664.23
买卖股票差价收入	-6,914,451.43

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	31,303,900.52
减：现金支付赎回款总额	-547,622.48
减：赎回股票成本总额	34,203,934.28
赎回差价收入	-2,352,411.28

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。

6.4.3.13 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 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	22,894.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	22,894.94

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 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	321,066.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	298,000.00
减：应收利息总额	171.26
买卖债券差价收入	22,894.94

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,494,803.09
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,494,803.09

6.4.3.18 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	42,463,630.41
——股票投资	42,452,050.41
——债券投资	11,580.00
——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	42,463,630.41

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 年上半年：6.00 元)。

6.4.3.19 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	16,393.96
合计	16,393.96

6.4.3.20 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	46,847.21
银行间市场交易费用	-
合计	46,847.21

6.4.3.21 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	59,915.47
指数使用费	100,000.00
银行费用	815.00
上市费	29,752.78
合计	220,236.03

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。

6.4.4 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

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。

6.4.5 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
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	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

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 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	67,820,085.05	100.00%	67,579,557.92	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 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	6,781.86	100.00%	6,628.80	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	6,758.04	100.00%	6,478.33	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 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	513,700.44	525,781.45
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×0.5%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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	102,740.09	105,156.31

支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.4.2 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
南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	122,399,941.00	81.3565%	122,399,941.00	82.4526%

上证 380ETF 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。

6.4.6.5 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
建设银行	1,173,108.32	2,524.93	1,321,011.17	2,669.07

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

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

无。

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（2019 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
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	-
6.4.12.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.8.2 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。

6.4.8.3 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。

6.4.9 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，紧密跟踪上证 380 指数，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，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，跟踪上证 380 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，将风险控制可在承受的范围之内。

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行中国建设银行，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，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.02% (2018 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%)。

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同约定到期日均为一个月以内且不计息，本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

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》(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%。于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.02 %。

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。

6.4.9.4 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、结算备付金和存出保证金等。

6.4.9.4.1.1 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	1,173,108.32	-	-	-	1,173,108.32
结算备付金	10,264.87	-	-	-	10,264.87
存出保证金	1,514.34	-	-	-	1,514.34
交易性金融资产	-	-	51,580.00	207,139,515.83	207,191,095.83
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	254.16	254.16
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	119,441.83	119,441.83
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,184,887.53	-	51,580.00	207,259,211.82	208,495,679.35

负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	85,306.71	85,306.71
应付托管费	-	-	-	17,061.30	17,061.30
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	-	-	-	6,628.80	6,628.80
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.28	1.28
其他负债	-	-	-	169,421.03	169,421.03
负债总计	-	-	-	278,419.12	278,419.12
利率敏感度缺口	1,184,887.53	-	51,580.00	206,980,792.70	208,217,260.23
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	798,370.07	-	-	-	798,370.07
结算备付金	6,688.75	-	-	-	6,688.75
存出保证金	1,650.62	-	-	-	1,650.62
交易性金融资产	-	-	-	168,831,435.97	168,831,435.97
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	183.01	183.01
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	806,709.44	-	-	168,831,618.98	169,638,328.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	73,586.84	73,586.84

应付托管费	-	-	-	14,717.36	14,717.36
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	5,525.64	5,525.64
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3.84	3.84
其他负债	-	-	-	404,000.00	404,000.00
负债总计	-	-	-	497,833.68	497,833.68
利率敏感度缺口	806,709.44	-	-	168,333,785.30	169,140,494.74

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。

6.4.9.4.1.2 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 0.02%(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)。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

不适用。

6.4.9.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无外汇风险的敏感性分析。

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，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，跟踪上证 380 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，上证 380 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、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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 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	207,139,515.83	99.48	168,831,435.97	99.82
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	207,139,515.83	99.48	168,831,435.97	99.82

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(附注 7.4.1)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%	10,280,727.22	8,309,872.51
2.组合自身基准下降 5%	-10,280,727.22	-8,309,872.51	

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	207,139,515.83	99.35
	其中：股票	207,139,515.83	99.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	51,580.00	0.02
	其中：债券	51,580.00	0.02
	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	1,183,373.19	0.57
8	其他资产	121,210.33	0.06
9	合计	208,495,679.35	100.00

上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 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	741,483.00	0.36
B	采矿业	9,291,380.17	4.46
C	制造业	102,662,221.20	49.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,176,124.60	5.85
E	建筑业	8,140,928.02	3.91
F	批发和零售业	18,773,568.28	9.02
G	交通运输、仓储和邮政业	13,595,051.20	6.53
H	住宿和餐饮业	1,407,824.40	0.68
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,329,830.29	4.96
J	金融业	2,834,907.40	1.36
K	房地产业	13,515,970.77	6.49
L	租赁和商务服务业	2,351,767.17	1.13
M	科学研究和技术服务业	1,154,982.00	0.55
N	水利、环境和公共设施管理业	1,767,534.60	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	320,967.57	0.15
Q	卫生和社会工作	2,079,386.00	1.00

R	文化、体育和娱乐业	3,919,507.00	1.88
S	综合	1,805,921.20	0.87
	合计	206,869,354.87	99.35

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	132,510.85	0.06
C	制造业	64,176.41	0.03
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	0.02
J	金融业	33,869.94	0.02
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	270,160.96	0.13

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	600498	烽火通信	67,000	1,866,620.00	0.90
2	600201	生物股份	110,747	1,737,620.43	0.83
3	600739	辽宁成大	116,800	1,698,272.00	0.82
4	601018	宁波港	377,500	1,657,225.00	0.80
5	600763	通策医疗	18,400	1,630,056.00	0.78

6	600170	上海建工	425,200	1,598,752.00	0.77
7	601021	春秋航空	35,010	1,575,450.00	0.76
8	600642	申能股份	260,844	1,567,672.44	0.75
9	600219	南山铝业	684,900	1,547,874.00	0.74
10	600536	中国软件	28,394	1,523,905.98	0.73
11	600183	生益科技	101,247	1,523,767.35	0.73
12	600674	川投能源	168,200	1,496,980.00	0.72
13	600256	广汇能源	389,300	1,385,908.00	0.67
14	600369	西南证券	269,600	1,331,824.00	0.64
15	600801	华新水泥	65,000	1,316,250.00	0.63
16	600663	陆家嘴	84,040	1,302,620.00	0.63
17	603833	欧派家居	12,100	1,302,202.00	0.63
18	600879	航天电子	207,800	1,280,048.00	0.61
19	600325	华发股份	161,800	1,263,658.00	0.61
20	600161	天坛生物	49,875	1,259,343.75	0.60
21	600460	士兰微	75,245	1,249,067.00	0.60
22	600346	恒力石化	101,360	1,232,537.60	0.59
23	600728	佳都科技	123,600	1,217,460.00	0.58
24	601128	常熟银行	157,100	1,212,812.00	0.58
25	600848	上海临港	38,700	1,204,731.00	0.58
26	600153	建发股份	135,400	1,202,352.00	0.58
27	600779	水井坊	23,365	1,187,409.30	0.57
28	600583	海油工程	211,200	1,182,720.00	0.57
29	600584	长电科技	91,884	1,180,709.40	0.57
30	600027	华电国际	311,200	1,173,224.00	0.56
31	601168	西部矿业	182,074	1,161,632.12	0.56
32	600549	厦门钨业	81,000	1,159,110.00	0.56
33	603899	晨光文具	26,342	1,158,257.74	0.56
34	600820	隧道股份	180,200	1,137,062.00	0.55
35	600673	东阳光	143,992	1,130,337.20	0.54
36	600410	华胜天成	105,244	1,129,268.12	0.54
37	600392	盛和资源	100,660	1,113,299.60	0.53
38	600376	首开股份	123,200	1,100,176.00	0.53
39	600132	重庆啤酒	23,100	1,089,396.00	0.52
40	600688	上海石化	210,000	1,083,600.00	0.52
41	600415	小商品城	259,900	1,070,788.00	0.51
42	601216	君正集团	322,400	1,060,696.00	0.51
43	600811	东方集团	283,865	1,055,977.80	0.51
44	600236	桂冠电力	173,800	1,053,228.00	0.51
45	600755	厦门国贸	121,488	1,048,441.44	0.50
46	601333	广深铁路	323,900	1,046,197.00	0.50
47	601799	星宇股份	13,200	1,042,272.00	0.50
48	600885	宏发股份	42,700	1,037,610.00	0.50

49	600567	山鹰纸业	306,547	1,033,063.39	0.50
50	601872	招商轮船	231,800	1,010,648.00	0.49
51	600521	华海药业	71,606	1,009,644.60	0.48
52	603939	益丰药房	14,400	1,007,856.00	0.48
53	600315	上海家化	32,100	999,915.00	0.48
54	600486	扬农化工	17,767	971,854.90	0.47
55	600808	马钢股份	285,000	971,850.00	0.47
56	603077	和邦生物	506,114	961,616.60	0.46
57	600446	金证股份	48,800	958,432.00	0.46
58	600094	大名城	152,200	957,338.00	0.46
59	600260	凯乐科技	47,800	955,044.00	0.46
60	600273	嘉化能源	82,100	949,076.00	0.46
61	600566	济川药业	31,200	939,432.00	0.45
62	600160	巨化股份	131,200	932,832.00	0.45
63	600845	宝信软件	32,240	918,195.20	0.44
64	600655	豫园股份	111,200	910,728.00	0.44
65	600675	中华企业	174,720	906,796.80	0.44
66	600967	内蒙一机	80,692	903,750.40	0.43
67	600704	物产中大	164,500	891,590.00	0.43
68	600282	南钢股份	253,600	887,600.00	0.43
69	600388	龙净环保	71,407	884,732.73	0.42
70	600863	内蒙华电	277,378	870,966.92	0.42
71	600171	上海贝岭	53,520	869,700.00	0.42
72	600021	上海电力	100,000	868,000.00	0.42
73	601098	中南传媒	68,600	867,104.00	0.42
74	603444	吉比特	4,100	860,836.00	0.41
75	603517	绝味食品	21,880	851,350.80	0.41
76	600026	中远海能	130,700	848,243.00	0.41
77	600258	首旅酒店	46,780	841,104.40	0.40
78	600305	恒顺醋业	44,930	827,610.60	0.40
79	600373	中文传媒	65,800	826,448.00	0.40
80	600380	健康元	92,586	800,868.90	0.38
81	601100	恒立液压	25,300	793,914.00	0.38
82	601966	玲珑轮胎	45,900	780,300.00	0.37
83	603338	浙江鼎力	13,256	778,259.76	0.37
84	600252	中恒集团	265,600	778,208.00	0.37
85	601000	唐山港	282,932	778,063.00	0.37
86	600782	新钢股份	152,300	761,500.00	0.37
87	600039	四川路桥	206,886	753,065.04	0.36
88	601231	环旭电子	62,426	752,233.30	0.36
89	600648	外高桥	35,714	749,279.72	0.36
90	600372	中航电子	50,400	747,936.00	0.36
91	600500	中化国际	99,500	743,265.00	0.36

92	600756	浪潮软件	31,000	741,520.00	0.36
93	600323	瀚蓝环境	43,877	740,643.76	0.36
94	600748	上实发展	88,030	729,768.70	0.35
95	603501	韦尔股份	13,100	719,321.00	0.35
96	600729	重庆百货	23,270	703,684.80	0.34
97	600138	中青旅	55,313	701,921.97	0.34
98	600682	南京新百	61,776	698,686.56	0.34
99	601678	滨化股份	103,203	697,652.28	0.34
100	600167	联美控股	65,540	693,413.20	0.33
101	603228	景旺电子	17,300	692,173.00	0.33
102	600120	浙江东方	54,300	691,782.00	0.33
103	600056	中国医药	50,960	687,450.40	0.33
104	600507	方大特钢	69,250	677,265.00	0.33
105	600206	有研新材	56,600	676,370.00	0.32
106	600777	新潮能源	324,800	675,584.00	0.32
107	603885	吉祥航空	51,440	673,864.00	0.32
108	600559	老白干酒	51,359	672,289.31	0.32
109	600511	国药股份	29,225	671,298.25	0.32
110	600409	三友化工	118,261	669,357.26	0.32
111	600348	阳泉煤业	114,900	667,569.00	0.32
112	600998	九州通	53,800	664,968.00	0.32
113	600711	盛屯矿业	122,500	662,725.00	0.32
114	600823	世茂股份	143,360	660,889.60	0.32
115	600216	浙江医药	64,535	660,838.40	0.32
116	600418	江淮汽车	126,600	653,256.00	0.31
117	603883	老百姓	11,000	643,280.00	0.31
118	600970	中材国际	99,680	640,942.40	0.31
119	600525	长园集团	101,205	639,615.60	0.31
120	600277	亿利洁能	130,888	637,424.56	0.31
121	600597	光明乳业	58,500	628,875.00	0.30
122	600490	鹏欣资源	127,100	627,874.00	0.30
123	600062	华润双鹤	49,739	627,208.79	0.30
124	600580	卧龙电驱	74,082	623,029.62	0.30
125	601958	金钼股份	92,500	619,750.00	0.30
126	600717	天津港	95,880	615,549.60	0.30
127	600702	舍得酒业	22,600	614,268.00	0.30
128	600803	新奥股份	58,650	612,892.50	0.29
129	600667	太极实业	80,395	606,982.25	0.29
130	600366	宁波韵升	66,100	606,798.00	0.29
131	601636	旗滨集团	154,003	599,071.67	0.29
132	600664	哈药股份	144,669	598,929.66	0.29
133	600312	平高电气	77,796	598,251.24	0.29
134	600708	光明地产	106,465	594,074.70	0.29

135	601200	上海环境	43,620	593,668.20	0.29
136	600557	康缘药业	39,727	590,343.22	0.28
137	600422	昆药集团	50,952	587,476.56	0.28
138	603659	璞泰来	12,400	583,048.00	0.28
139	600596	新安股份	53,949	580,491.24	0.28
140	600073	上海梅林	62,740	577,208.00	0.28
141	600185	格力地产	118,000	574,660.00	0.28
142	601588	北辰实业	152,500	571,875.00	0.27
143	600284	浦东建设	74,161	571,039.70	0.27
144	603368	柳药股份	17,358	570,731.04	0.27
145	601717	郑煤机	99,600	568,716.00	0.27
146	600754	锦江股份	23,000	566,720.00	0.27
147	600859	王府井	37,048	562,759.12	0.27
148	600125	铁龙物流	87,248	562,749.60	0.27
149	603707	健友股份	15,900	562,065.00	0.27
150	601222	林洋能源	117,972	553,288.68	0.27
151	603816	顾家家居	17,320	552,854.40	0.27
152	603658	安图生物	8,000	546,880.00	0.26
153	600641	万业企业	46,200	546,084.00	0.26
154	600072	中船科技	42,200	546,068.00	0.26
155	600582	天地科技	158,160	545,652.00	0.26
156	603128	华贸物流	58,000	545,200.00	0.26
157	600612	老凤祥	12,033	537,875.10	0.26
158	601058	赛轮轮胎	180,640	536,500.80	0.26
159	603708	家家悦	23,260	530,793.20	0.25
160	600459	贵研铂业	29,277	529,035.39	0.25
161	600563	法拉电子	12,827	528,087.59	0.25
162	600499	科达洁能	120,500	527,790.00	0.25
163	603660	苏州科达	33,736	525,944.24	0.25
164	603866	桃李面包	12,560	523,124.00	0.25
165	600720	祁连山	59,341	521,607.39	0.25
166	600565	迪马股份	139,700	521,081.00	0.25
167	600850	华东电脑	24,471	520,987.59	0.25
168	600835	上海机电	30,790	511,114.00	0.25
169	600377	宁沪高速	47,450	509,613.00	0.24
170	600993	马应龙	28,808	508,461.20	0.24
171	600483	福能股份	59,300	507,608.00	0.24
172	600491	龙元建设	73,200	505,080.00	0.24
173	600326	西藏天路	66,070	502,132.00	0.24
174	600141	兴发集团	48,660	500,224.80	0.24
175	603043	广州酒家	15,400	497,882.00	0.24
176	600587	新华医疗	31,106	496,140.70	0.24
177	600093	易见股份	42,900	491,205.00	0.24

178	600197	伊力特	25,350	489,255.00	0.23
179	600337	美克家居	118,366	487,667.92	0.23
180	600611	大众交通	104,526	486,045.90	0.23
181	600787	中储股份	84,100	481,893.00	0.23
182	600123	兰花科创	65,600	480,192.00	0.23
183	600765	中航重机	52,000	479,960.00	0.23
184	601666	平煤股份	112,811	471,549.98	0.23
185	603712	七一二	22,200	471,306.00	0.23
186	600210	紫江企业	116,100	470,205.00	0.23
187	603515	欧普照明	14,460	466,335.00	0.22
188	601019	山东出版	59,900	466,022.00	0.22
189	600502	安徽水利	98,668	458,806.20	0.22
190	600338	西藏珠峰	26,020	454,829.60	0.22
191	600116	三峡水利	56,850	453,663.00	0.22
192	600363	联创光电	33,900	452,904.00	0.22
193	600020	中原高速	86,053	451,778.25	0.22
194	600393	粤泰股份	96,900	450,585.00	0.22
195	603882	金域医学	13,100	449,330.00	0.22
196	601311	骆驼股份	41,300	448,105.00	0.22
197	600577	精达股份	146,800	444,804.00	0.21
198	603233	大参林	9,860	443,700.00	0.21
199	600233	圆通速递	35,100	432,783.00	0.21
200	603039	泛微网络	5,816	431,547.20	0.21
201	600986	科达股份	101,240	428,245.20	0.21
202	600978	宜华生活	113,500	426,760.00	0.20
203	601689	拓普集团	27,800	425,896.00	0.20
204	600846	同济科技	47,824	424,198.88	0.20
205	601016	节能风电	159,059	423,096.94	0.20
206	600990	四创电子	9,076	422,215.52	0.20
207	600668	尖峰集团	32,880	420,864.00	0.20
208	600622	光大嘉宝	86,030	418,966.10	0.20
209	600531	豫光金铅	83,300	417,333.00	0.20
210	600742	一汽富维	38,900	415,063.00	0.20
211	600975	新五丰	37,500	413,625.00	0.20
212	603027	千禾味业	17,280	412,473.60	0.20
213	603198	迎驾贡酒	23,000	411,930.00	0.20
214	603766	隆鑫通用	98,293	411,847.67	0.20
215	603588	高能环境	38,500	410,795.00	0.20
216	600623	华谊集团	53,449	408,350.36	0.20
217	600105	永鼎股份	83,970	404,735.40	0.19
218	600477	杭萧钢构	123,330	404,522.40	0.19
219	603686	龙马环卫	20,000	397,600.00	0.19
220	600162	香江控股	162,615	396,780.60	0.19

221	600757	长江传媒	58,100	395,661.00	0.19
222	603888	新华网	19,800	395,208.00	0.19
223	600694	大商股份	14,073	392,777.43	0.19
224	600750	江中药业	30,138	392,095.38	0.19
225	603599	广信股份	26,700	391,689.00	0.19
226	600639	浦东金桥	24,100	389,697.00	0.19
227	603056	德邦股份	27,600	388,608.00	0.19
228	600329	中新药业	27,095	387,187.55	0.19
229	600545	卓郎智能	54,400	386,784.00	0.19
230	600495	晋西车轴	80,888	383,409.12	0.18
231	601567	三星医疗	65,525	380,045.00	0.18
232	600285	羚锐制药	44,877	378,313.11	0.18
233	603568	伟明环保	17,570	378,106.40	0.18
234	600343	航天动力	36,600	375,150.00	0.18
235	601069	西部黄金	24,000	369,600.00	0.18
236	600395	盘江股份	62,500	369,375.00	0.18
237	601001	大同煤业	80,071	365,924.47	0.18
238	603806	福斯特	9,870	362,525.10	0.17
239	603113	金能科技	32,300	355,946.00	0.17
240	600420	现代制药	39,900	355,908.00	0.17
241	601127	小康股份	27,000	353,700.00	0.17
242	603108	润达医疗	32,860	347,658.80	0.17
243	600874	创业环保	41,650	345,278.50	0.17
244	601801	皖新传媒	57,100	343,171.00	0.16
245	600987	航民股份	51,725	341,902.25	0.16
246	603118	共进股份	36,620	339,101.20	0.16
247	600657	信达地产	81,900	337,428.00	0.16
248	600971	恒源煤电	57,400	335,790.00	0.16
249	600626	申达股份	48,900	334,476.00	0.16
250	601908	京运通	95,500	333,295.00	0.16
251	603638	艾迪精密	14,600	328,500.00	0.16
252	600965	福成股份	30,930	327,858.00	0.16
253	600230	沧州大化	23,680	323,232.00	0.16
254	603881	数据港	10,100	321,382.00	0.15
255	600661	昂立教育	13,699	320,967.57	0.15
256	603363	傲农生物	16,700	319,972.00	0.15
257	600996	贵广网络	29,500	318,010.00	0.15
258	601002	晋亿实业	44,800	316,288.00	0.15
259	600345	长江通信	11,400	314,754.00	0.15
260	603609	禾丰牧业	26,500	313,760.00	0.15
261	603737	三棵树	7,114	309,743.56	0.15
262	601139	深圳燃气	54,300	308,967.00	0.15
263	600681	百川能源	41,440	308,313.60	0.15

264	600239	云南城投	106,058	307,568.20	0.15
265	601158	重庆水务	54,400	304,640.00	0.15
266	600350	山东高速	63,450	304,560.00	0.15
267	600075	新疆天业	57,300	304,263.00	0.15
268	600261	阳光照明	82,112	301,351.04	0.14
269	603127	昭衍新药	6,100	293,898.00	0.14
270	601858	中国科传	22,400	293,664.00	0.14
271	600053	九鼎投资	12,458	290,271.40	0.14
272	603328	依顿电子	28,200	289,614.00	0.14
273	600335	国机汽车	41,825	289,429.00	0.14
274	601869	长飞光纤	7,700	288,750.00	0.14
275	600299	安迪苏	27,800	288,286.00	0.14
276	600007	中国国贸	19,273	281,193.07	0.14
277	600122	宏图高科	87,300	280,233.00	0.13
278	601003	柳钢股份	48,200	279,078.00	0.13
279	603989	艾华集团	14,710	277,724.80	0.13
280	600897	厦门空港	11,399	274,829.89	0.13
281	600172	黄河旋风	83,772	269,745.84	0.13
282	600973	宝胜股份	70,030	269,615.50	0.13
283	603357	设计总院	21,420	268,392.60	0.13
284	600114	东睦股份	42,568	267,752.72	0.13
285	603220	贝通信	9,600	265,440.00	0.13
286	600452	涪陵电力	14,864	262,498.24	0.13
287	603337	杰克股份	12,801	262,292.49	0.13
288	603556	海兴电力	18,910	261,336.20	0.13
289	603803	瑞斯康达	20,100	260,496.00	0.13
290	600548	深高速	27,000	253,530.00	0.12
291	603387	基蛋生物	9,884	253,524.60	0.12
292	600231	凌钢股份	78,310	252,158.20	0.12
293	603367	辰欣药业	17,400	251,430.00	0.12
294	603393	新天然气	10,700	250,380.00	0.12
295	600136	当代明诚	23,000	246,100.00	0.12
296	600387	海越能源	31,300	243,201.00	0.12
297	601015	陕西黑猫	61,595	242,684.30	0.12
298	600439	瑞贝卡	74,740	241,410.20	0.12
299	603959	百利科技	16,636	239,558.40	0.12
300	601789	宁波建工	55,300	228,942.00	0.11
301	600180	瑞茂通	28,700	225,869.00	0.11
302	603298	杭叉集团	17,600	222,816.00	0.11
303	601330	绿色动力	14,300	221,793.00	0.11
304	600826	兰生股份	19,803	221,397.54	0.11
305	600295	鄂尔多斯	26,473	219,461.17	0.11
306	600693	东百集团	42,262	218,494.54	0.10

307	603505	金石资源	11,500	215,395.00	0.10
308	600738	兰州民百	29,600	214,896.00	0.10
309	600985	淮北矿业	18,600	210,924.00	0.10
310	600012	皖通高速	33,012	208,965.96	0.10
311	600179	ST 安通	70,200	205,686.00	0.10
312	603008	喜临门	18,500	204,055.00	0.10
313	600781	辅仁药业	18,000	198,540.00	0.10
314	603225	新凤鸣	15,872	198,241.28	0.10
315	600310	桂东电力	39,100	198,237.00	0.10
316	603898	好莱客	11,900	196,826.00	0.09
317	603728	鸣志电器	15,720	192,884.40	0.09
318	603808	歌力思	12,500	190,875.00	0.09
319	603060	国检集团	8,900	189,837.00	0.09
320	603466	风语筑	11,200	185,360.00	0.09
321	603583	捷昌驱动	5,000	184,350.00	0.09
322	601811	新华文轩	14,900	181,929.00	0.09
323	603305	旭升股份	7,600	181,716.00	0.09
324	603868	飞科电器	4,500	176,175.00	0.08
325	603421	鼎信通讯	9,000	175,500.00	0.08
326	603590	康辰药业	4,500	175,005.00	0.08
327	601020	华钰矿业	14,900	174,628.00	0.08
328	603587	地素时尚	7,600	172,824.00	0.08
329	603612	索通发展	16,120	172,645.20	0.08
330	603639	海利尔	6,540	170,236.20	0.08
331	603801	志邦家居	8,560	169,145.60	0.08
332	603595	东尼电子	7,588	165,494.28	0.08
333	603355	莱克电气	7,600	163,552.00	0.08
334	603126	中材节能	28,800	163,296.00	0.08
335	603603	博天环境	11,300	163,172.00	0.08
336	603619	中曼石油	7,600	162,868.00	0.08
337	603579	荣泰健康	5,400	158,220.00	0.08
338	603666	亿嘉和	2,800	153,356.00	0.07
339	603713	密尔克卫	4,300	149,769.00	0.07
340	600814	杭州解百	27,400	144,124.00	0.07
341	603669	灵康药业	19,128	143,460.00	0.07
342	603929	亚翔集成	8,300	141,349.00	0.07
343	603997	继峰股份	18,150	140,118.00	0.07
344	603185	上机数控	3,500	137,725.00	0.07
345	603871	嘉友国际	4,460	133,800.00	0.06
346	603711	香飘飘	3,900	132,483.00	0.06
347	603650	彤程新材	6,000	131,040.00	0.06
348	600933	爱柯迪	16,500	129,525.00	0.06
349	603876	鼎胜新材	8,100	128,142.00	0.06

350	601619	嘉泽新能	26,900	124,278.00	0.06
351	603533	掌阅科技	7,700	123,893.00	0.06
352	603626	科森科技	15,560	123,390.80	0.06
353	603585	苏利股份	5,160	123,220.80	0.06
354	600917	重庆燃气	17,700	123,192.00	0.06
355	603730	岱美股份	5,200	121,888.00	0.06
356	603283	赛腾股份	4,600	120,382.00	0.06
357	600828	茂业商业	23,646	118,702.92	0.06
358	603098	森特股份	9,280	118,598.40	0.06
359	603103	横店影视	7,200	114,048.00	0.05
360	603180	金牌厨柜	2,000	110,480.00	0.05
361	603007	花王股份	13,000	110,370.00	0.05
362	603121	华培动力	6,000	108,720.00	0.05
363	603025	大豪科技	10,474	107,253.76	0.05
364	603897	长城科技	5,100	102,000.00	0.05
365	603080	新疆火炬	5,400	101,844.00	0.05
366	603358	华达科技	9,052	99,572.00	0.05
367	603733	仙鹤股份	6,500	98,605.00	0.05
368	603165	荣晟环保	5,080	95,351.60	0.05
369	603680	今创集团	6,000	94,320.00	0.05
370	603339	四方科技	6,100	93,818.00	0.05
371	603351	威尔药业	2,700	93,609.00	0.04
372	603332	苏州龙杰	3,300	93,027.00	0.04
373	603877	太平鸟	5,700	88,464.00	0.04
374	603569	长久物流	7,580	87,852.20	0.04
375	603600	永艺股份	8,600	84,624.00	0.04
376	603773	沃格光电	2,700	84,456.00	0.04
377	603895	天永智能	2,900	71,282.00	0.03
378	603757	大元泵业	4,892	71,178.60	0.03
379	603596	伯特利	4,300	70,993.00	0.03
380	603848	好太太	4,800	70,128.00	0.03

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	37,327	132,510.85	0.06
2	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.02
3	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.02
4	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.02
5	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01

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	600170	上海建工	1,635,756.00	0.97
2	600219	南山铝业	1,609,293.00	0.95
3	601018	宁波港	1,584,203.00	0.94
4	600549	厦门钨业	1,308,702.45	0.77
5	600369	西南证券	1,297,196.00	0.77
6	600153	建发股份	1,237,664.00	0.73
7	600848	上海临港	1,193,776.00	0.71
8	600688	上海石化	1,094,614.00	0.65
9	600132	重庆啤酒	1,043,826.00	0.62
10	600675	中华企业	965,748.00	0.57
11	601872	招商轮船	952,692.00	0.56
12	600704	物产中大	893,550.02	0.53
13	600021	上海电力	848,097.00	0.50
14	600845	宝信软件	845,514.00	0.50
15	600373	中文传媒	831,184.00	0.49
16	600120	浙江东方	719,087.20	0.43
17	603501	韦尔股份	598,456.00	0.35
18	603659	璞泰来	595,742.00	0.35
19	601717	郑煤机	582,513.00	0.34
20	603712	七一二	497,907.00	0.29

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	600487	亨通光电	2,292,151.52	1.36
2	600872	中炬高新	2,195,994.37	1.30
3	600426	华鲁恒升	1,600,723.96	0.95
4	603369	今世缘	1,259,320.50	0.74
5	603986	兆易创新	1,165,053.00	0.69
6	600166	福田汽车	1,099,091.00	0.65
7	600881	亚泰集团	1,064,110.96	0.63
8	600572	康恩贝	980,836.44	0.58
9	600188	兖州煤业	921,655.60	0.54
10	601598	中国外运	761,711.72	0.45
11	600270	外运发展	670,961.04	0.40

12	600578	京能电力	638,521.26	0.38
13	600633	浙数文化	619,677.00	0.37
14	600988	赤峰黄金	586,519.00	0.35
15	600562	国睿科技	555,737.50	0.33
16	600175	美都能源	548,436.76	0.32
17	600779	水井坊	494,978.25	0.29
18	600685	中船防务	445,482.00	0.26
19	600200	江苏吴中	424,570.00	0.25
20	600416	湘电股份	420,042.04	0.25

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	35,887,673.96
卖出股票收入（成交）总额	34,679,212.80

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）	51,580.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	51,580.00	0.02

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	113529	绝味转债	400	51,580.00	0.02

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

本基金在进行股指期货投资时，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	1,514.34
2	应收证券清算款	119,441.83
3	应收股利	-
4	应收利息	254.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	121,210.33

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	601236	红塔证券	33,869.94	0.02	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	户均持有	持有人结构
------	------	-------

数(户)	的基金份额	机构投资者		个人投资者		南方上证 380 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
893	168,475.8 3	11,757,56 4.00	7.81%	16,291,41 0.00	10.83%	122,399,9 41.00	81.36%

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	芜湖歌斐资产管理有限公司—歌斐诺亚家族专享组合 5 号联接基金	7,604,800.00	5.05%
2	方正证券股份有限公司	1,733,601.00	1.15%
3	何秀娟	700,000.00	0.47%
4	王钧璧	673,900.00	0.45%
5	黄静	639,300.00	0.42%
6	北京无限立通通讯技术有限责任公司	609,600.00	0.41%
7	泰康资产强化回报混合型养老金产品—中国建设银行股份有限公司	604,900.00	0.40%
8	王一一	499,000.00	0.33%
9	芜湖歌斐资产管理有限公司—歌斐诺亚家族专享组合 5 号联接基金	459,200.00	0.31%
10	中国建设银行股份有限公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	376,600.00	0.25%
11	南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	122,399,941.00	81.36%

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(2011 年 9 月 16 日)基金份额	330,448,915.00
------------------------------	----------------

总额	
本报告期期初基金份额总额	148,448,915.00
本报告期基金总申购份额	24,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	22,000,000.00
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	150,448,915.00

§ 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。

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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	1	67,820,085.05	100.00%	6,781.86	100.00%	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
诚浩证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	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	321,066.20	100.00%	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
诚浩证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-

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	南方基金关于上证 380 交易型开放式指数证券投资基金增加招商证券为申购赎回代理券商的公告	证券时报	2019-04-02

§ 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	122,399,9	0.00	-	122,399,9	81.36%

		-2019063 0	41.00			41.00	
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。							

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上证 380 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《上证 380 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、《上证 380 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>