

中证 500 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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.....	6
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.....	9
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.....	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	10
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.....	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末上市基金前十名持有人	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 500ETF
场内简称	500ETF
基金主代码	510500
交易代码	510500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	9,035,067,244.00 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	2013 年 3 月 15 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“500ETF”。

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。本基金标的指数为中证 500 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。

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	中国农业银行股份有限公司
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	95599
传真	0755-82763889	010-68121816
注册地址	深圳市福田区莲花街道	北京东城区建国门内大街 69 号

	益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	
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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518017	100031
法定代表人	张海波	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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	1,342,313,406.47
本期利润	7,312,197,798.97
加权平均基金份额本期利润	0.9224
本期加权平均净值利润率	17.29%
本期基金份额净值增长率	19.40%
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	15,911,185,316.60
期末可供分配基金份额利润	1.7610
期末基金资产净值	48,141,988,752.15
期末基金份额净值	5.3283
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	49.37%

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。

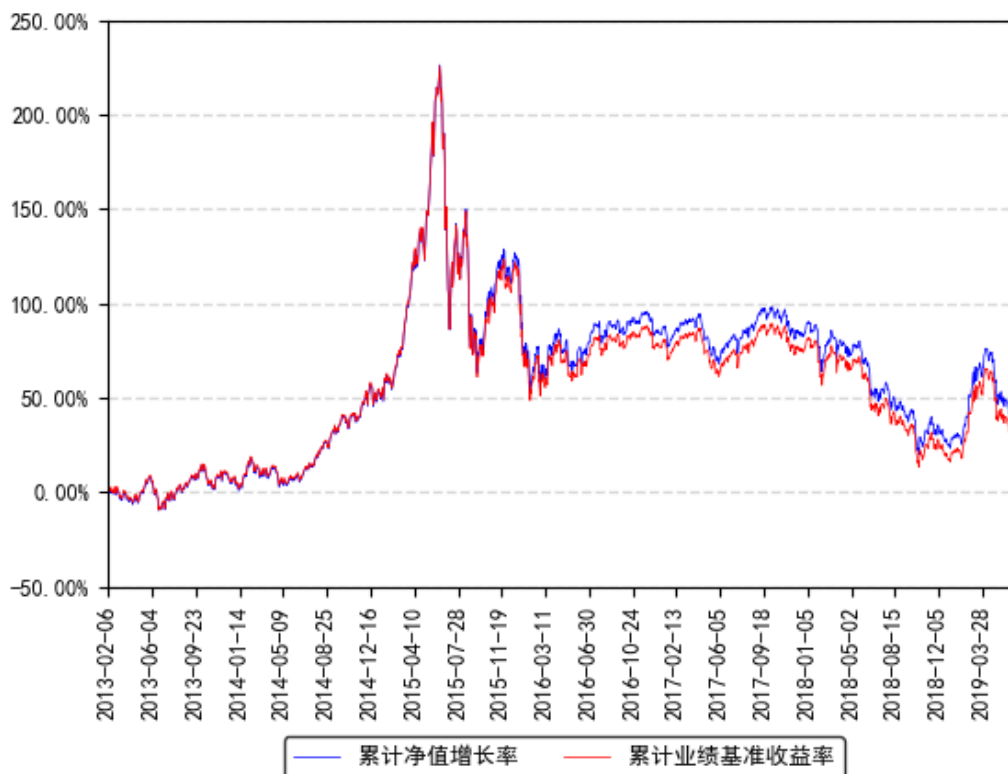
3.2 基金净值表现

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	1.11%	1.41%	0.78%	1.39%	0.33%	0.02%
过去三个月	-10.23%	1.82%	-10.76%	1.81%	0.53%	0.01%
过去六个月	19.40%	1.79%	18.77%	1.79%	0.63%	0.00%
过去一年	-3.60%	1.69%	-5.12%	1.69%	1.52%	0.00%
过去三年	-16.78%	1.31%	-19.16%	1.31%	2.38%	0.00%
自基金合同生效起至今	49.37%	1.75%	39.67%	1.75%	9.70%	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

南方中证500ETF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		
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日	-	14 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，任南方基金数量化投资部基金经理助理；2013 年 4 月起担任数量化投资部基金经理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月至 2015 年 6 月，任南方策略基金经理；2017 年 11 月至 2019 年 1 月，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月至 2019 年 4 月，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500、南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方 300、南方 300 联接基金经理；2014 年 10 月至今，任 500 医药基

				金经理；2015 年 2 月至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2017 年 7 月至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月至今，任南方房地产联接、南方房地产 ETF 基金经理；2018 年 2 月至今，任 H 股 ETF、南方 H 股 ETF 联接基金经理；2018 年 4 月至今，任 MSCI 基金基金经理；2018 年 6 月至今，任 MSCI 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 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

报告期内，中证 500 指数涨 18.77%。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，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

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

(2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

(3) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；

(4) 报告期内，我们根据指数定期的成份股调整进行了基金调仓，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，从实施结果来看，效果良好，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 5.3283 元，报告期内，份额净值增长率为 19.40%，同期业绩基准增长率为 18.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美联储月底议息会议如期降息，IMF 年内再度下调全球经济增长预期，各国央行相继降息支撑通胀托底经济下行，全球货币政策宽松态势明朗，支撑全球风险资产估值。权益市场资金持续净流入，短期有所减弱，但在 A 股国际化的背景下，预期中长期资金为净流入。同时 A 股市场估值接近历史底部，凸显长期配置价值。

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

4.6 管理人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，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；在符合有关基金分红条件的前提下，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。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；本基金收益分配采取现金分红方式；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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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 500 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	1,369,076,599.95	96,648,049.93
结算备付金		459,018,396.92	1,169,480,366.88
存出保证金		286,663,155.19	244,226,214.29
交易性金融资产	6.4.3.2	45,864,675,069.09	31,929,530,734.12
其中：股票投资		45,850,331,295.65	31,929,530,734.12
基金投资		-	-
债券投资		14,343,773.44	-
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	350,000,000.00	100,000,000.00
应收证券清算款		6,870,010.35	4,346,139.51
应收利息	6.4.3.5	3,715,138.58	791,397.02
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		48,340,018,370.08	33,545,022,901.75
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		99,579,682.50	34,118,506.26
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		18,748,984.70	14,655,148.66
应付托管费		3,749,796.93	2,931,029.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	3,561,975.44	2,365,098.60
应交税费		1,182,243.00	77.08
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	71,206,935.36	23,304,911.11
负债合计		198,029,617.93	77,374,771.46
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	32,230,803,435.55	26,754,283,100.01
未分配利润	6.4.3.10	15,911,185,316.60	6,713,365,030.28
所有者权益合计		48,141,988,752.15	33,467,648,130.29
负债和所有者权益总计		48,340,018,370.08	33,545,022,901.75

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 5.3283 元，基金份额总额 9,035,067,244.00 份。

6.2 利润表

会计主体：中证 500 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		7,479,213,682.79	-3,620,599,689.27
1. 利息收入		21,494,574.27	7,904,780.83
其中：存款利息收入	6.4.3.11	12,943,476.40	7,243,737.12
债券利息收入		21,997.97	15,248.25
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		8,529,099.90	645,795.46
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		1,489,060,650.13	-205,797,093.08
其中：股票投资收益	6.4.3.12	868,540,468.75	-304,968,369.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	3,901,906.38	1,278,859.28
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	231,183,946.85	-51,717,789.73
股利收益	6.4.3.17	385,434,328.15	149,610,206.45
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.3.18	5,969,884,392.50	-3,416,407,428.80
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-

5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6. 4. 3. 19	-1, 225, 934. 11	-6, 299, 948. 22
减: 二、费用		167, 015, 883. 82	76, 797, 343. 22
1. 管理人报酬	6. 4. 6. 2. 1	104, 461, 329. 50	53, 552, 388. 58
2. 托管费	6. 4. 6. 2. 2	20, 892, 265. 84	10, 710, 477. 80
3. 销售服务费	6. 4. 6. 2. 3	-	-
4. 交易费用	6. 4. 3. 20	34, 354, 476. 87	9, 019, 406. 83
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		832, 341. 45	12, 076. 31
7. 其他费用	6. 4. 3. 21	6, 475, 470. 16	3, 502, 993. 70
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		7, 312, 197, 798. 97	-3, 697, 397, 032. 49
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		7, 312, 197, 798. 97	-3, 697, 397, 032. 49

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 中证 500 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)	26, 754, 283, 100. 01	6, 713, 365, 030. 28	33, 467, 648, 130. 29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7, 312, 197, 798. 97	7, 312, 197, 798. 97
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)	5, 476, 520, 335. 54	1, 885, 622, 487. 35	7, 362, 142, 822. 89

其中：1. 基金申购款	26,279,592,204.86	13,428,699,958.72	39,708,292,163.58
2. 基金赎回款	-20,803,071,869.32	-11,543,077,471.37	-32,346,149,340.69
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）	32,230,803,435.55	15,911,185,316.60	48,141,988,752.15
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）	10,026,495,762.18	8,490,637,067.38	18,517,132,829.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,697,397,032.49	-3,697,397,032.49
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）	5,600,662,398.56	3,792,848,655.92	9,393,511,054.48
其中：1. 基金申购款	8,598,622,067.42	6,078,886,600.29	14,677,508,667.71
2. 基金赎回款	-2,997,959,668.86	-2,286,037,944.37	-5,283,997,613.23
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）	15,627,158,160.74	8,586,088,690.81	24,213,246,851.55

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	419,076,599.95
定期存款	950,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	300,000,000.00
存款期限 3 个月以上	650,000,000.00
其他存款	-
合计	1,369,076,599.95

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

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	46,286,694,778.06	45,850,331,295.65	-436,363,482.41
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	12,956,100.00	14,343,773.44
	银行间市场	-	-
	合计	12,956,100.00	14,343,773.44
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	46,299,650,878.06	45,864,675,069.09	-434,975,808.97

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-27,773.00 元(2018 年 12 月 31 日：-78.00 元)。

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,340,325,080.00	-	-	-
— 股指期货	2,340,325,080.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,340,325,080.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资/国债期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	350,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	350,000,000.00	-

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	185,787.07
应收定期存款利息	2,584,083.44
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	231,289.98
应收债券利息	16,488.01
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	692,394.55
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	5,095.53
合计	3,715,138.58

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	3,561,975.44
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,561,975.44

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	67,012,710.56
预提费用	173,970.75
应付指数使用费	3,355,548.77
可退退补款	664,705.28
其他	-
合计	71,206,935.36

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	7,499,867,244.00	26,754,283,100.01
本期申购	7,366,800,000.00	26,279,592,204.86
本期赎回（以“-”号填列）	-5,831,600,000.00	-20,803,071,869.32
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	9,035,067,244.00	32,230,803,435.55

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	32,513,040,363.13	-25,799,675,332.85	6,713,365,030.28
本期利润	1,342,313,406.47	5,969,884,392.50	7,312,197,798.97
本期基金份额交易产生的变动数	7,009,667,629.28	-5,124,045,141.93	1,885,622,487.35
其中：基金申购款	32,882,070,942.73	-19,453,370,984.01	13,428,699,958.72

基金赎回款	-25,872,403,313.45	14,329,325,842.08	-11,543,077,471.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,865,021,398.88	-24,953,836,082.28	15,911,185,316.60

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	1,431,858.39
定期存款利息收入	4,669,500.11
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,748,631.76
其他	93,486.14
合计	12,943,476.40

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	181,060,875.20
股票投资收益——赎回差价收入	687,479,593.55
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	868,540,468.75

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	24,299,135,000.78
减：卖出股票成本总额	24,118,074,125.58
买卖股票差价收入	181,060,875.20

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	32,346,149,340.69
减：现金支付赎回款总额	16,813,497,068.69
减：赎回股票成本总额	14,845,172,678.45
赎回差价收入	687,479,593.55

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	3,901,906.38
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	3,901,906.38

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	33,143,876.78
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	29,235,800.00
减：应收利息总额	6,170.40
买卖债券差价收入	3,901,906.38

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	231,183,946.85

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	385,434,328.15
基金投资产生的股利收益	-
合计	385,434,328.15

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	5,911,401,809.75
——股票投资	5,910,014,136.31
——债券投资	1,387,673.44
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	58,482,582.75
——权证投资	-
——期货投资	58,482,582.75
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	5,969,884,392.50

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 -27,695.00 元(2018 年上半年：11,108.78 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	-1,225,934.11
合计	-1,225,934.11

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	34,354,476.87
银行间市场交易费用	-
合计	34,354,476.87

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	84,300.75
信息披露费	59,917.22
指数使用费	6,267,679.72
银行费用	33,819.69
上市费	29,752.78
合计	6,475,470.16

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

中国农业银行股份有限公司(“农业银行”)	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
南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)(“南方中证 500ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	38,546,179,173.21	72.61%	-	-

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	3,855,127.63	72.61%	2,232,704.66	62.68%
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
-	-	-	-	-

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	104,461,329.50	53,552,388.58

其中：支付销售机构的客户维护费	9,493.25	115,180.09
-----------------	----------	------------

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

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

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	20,892,265.84	10,710,477.80

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

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

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
华泰证券股份有限公司	11,584,289.00	0.1282%	-	-
华泰证券股份有限公司-资运部	-	-	22,723,900.00	0.3030%
南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	1,990,577,002.00	22.0317%	1,366,573,402.00	18.2213%
兴业证券股份有限公司	100.00	0.0000%	-	-

注：华泰证券、兴业证券、南方中证 500ETF 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
农业银行	419,076,599.95	1,431,858.39	198,004,832.67	422,247.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业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
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股未上市	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
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
113027	华钰转债	2019 年 6 月 17 日	2019 年 7 月 10 日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

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，紧密跟踪中证 500 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，跟踪中证 500 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农业银行，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 0.03%(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。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的投资股指期货，以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。

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。

6.4.9.3.1 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期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 0.0001%。

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、存出保证金和买入返售金融资产等。

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	1,369,076,599.95	-	-	-	1,369,076,599.95
结算备付金	459,018,396.92	-	-	-	459,018,396.92
存出保证金	12,581,556.79	-	-	274,081,598.40	286,663,155.19
交易性金融资产	-	-	14,343,773.44	45,850,331.295.65	45,864,675.069.09
买入返售金融资产	350,000,000.00	-	-	-	350,000,000.00
应收利息	-	-	-	3,715,138.58	3,715,138.58
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	6,870,010.35	6,870,010.35
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,190,676,553.66	-	14,343,773.44	46,134,998.042.98	48,340,018,370.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	18,748,984.70	18,748,984.70
应付托管费	-	-	-	3,749,796.93	3,749,796.93
应付证券清算款	-	-	-	99,579,682.50	99,579,682.50
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	3,561,975.44	3,561,975.44
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,182,243.00	1,182,243.00

其他负债	-	-	-	71,206,935.36	71,206,935.36
负债总计	-	-	-	198,029,617.93	198,029,617.93
利率敏感度缺口	2,190,676,553.66	-	14,343,773.44	45,936,968,425.05	48,141,988,752.15
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	96,648,049.93	-	-	-	96,648,049.93
结算备付金	1,169,480,366.88	-	-	-	1,169,480,366.88
存出保证金	10,057,842.29	-	-	234,168,372.00	244,226,214.29
交易性金融资产	-	-	-	31,929,530,734.12	31,929,530,734.12
买入返售金融资产	100,000,000.00	-	-	-	100,000,000.00
应收利息	-	-	-	791,397.02	791,397.02
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	4,346,139.51	4,346,139.51
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,376,186,259.10	-	-	32,168,836,642.65	33,545,022,901.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	14,655,148.66	14,655,148.66
应付托管费	-	-	-	2,931,029.75	2,931,029.75
应付证券清算款	-	-	-	34,118,506.26	34,118,506.26
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,365,098.60	2,365,098.60
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	77.08	77.08
其他负债	-	-	-	23,304,911.11	23,304,911.11
负债总计	-	-	-	77,374,771.46	77,374,771.46
利率敏感度缺口	1,376,186.25 9.10	-	-	32,091,461.87 71.19	33,467,648.13 30.29

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 0.03%(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，跟踪中证 500 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 500 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%。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	45,850,331,295.65	95.24	31,929,530,734.12	95.40
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	45,850,331,295.65	95.24	31,929,530,734.12	95.40

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（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%	2,389,768,321.66	1,671,709,024.11
	2.组合自身基准下降 5%	-2,389,768,321.66	-1,671,709,024.11

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	45,850,331,295.65	94.85
	其中：股票	45,850,331,295.65	94.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,343,773.44	0.03
	其中：债券	14,343,773.44	0.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	350,000,000.00	0.72
	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	1,828,094,996.87	3.78
8	其他资产	297,248,304.12	0.61
9	合计	48,340,018,370.08	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	511,441,565.93	1.06
B	采矿业	1,625,861,667.58	3.38
C	制造业	25,586,222,334.91	53.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,453,349,402.04	3.02
E	建筑业	813,951,821.79	1.69
F	批发和零售业	2,437,469,580.71	5.06
G	交通运输、仓储和邮政业	1,553,553,844.88	3.23
H	住宿和餐饮业	176,123,163.24	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,397,132,628.95	9.13
J	金融业	2,054,137,203.71	4.27
K	房地产业	2,126,111,784.55	4.42
L	租赁和商务服务业	631,686,242.69	1.31
M	科学研究和技术服务业	64,776,858.84	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	409,642,938.17	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	155,349,847.18	0.32
Q	卫生和社会工作	274,513,141.92	0.57
R	文化、体育和娱乐业	952,503,909.46	1.98
S	综合	625,894,213.27	1.30
	合计	45,849,722,149.82	95.24

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	0.00
C	制造业	176,907.28	0.00
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	0.00
J	金融业	33,869.94	0.00
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	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	636,918.83	0.00

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	002405	四维图新	18,997,446	305,858,880.60	0.64
2	000860	顺鑫农业	6,253,670	291,733,705.50	0.61
3	600872	中炬高新	6,686,208	286,370,288.64	0.59
4	002157	正邦科技	14,315,011	238,488,083.26	0.50
5	002049	紫光国微	5,037,396	222,199,537.56	0.46
6	000066	中国长城	21,184,652	217,778,222.56	0.45
7	600201	生物股份	13,859,121	217,449,608.49	0.45
8	300253	卫宁健康	15,229,670	215,956,720.60	0.45
9	600739	辽宁成大	14,783,249	214,948,440.46	0.45
10	300450	先导智能	6,356,913	213,592,276.80	0.44
11	002195	二三四五	53,989,677	210,019,843.53	0.44
12	002506	协鑫集成	30,409,666	203,136,568.88	0.42
13	600763	通策医疗	2,289,938	202,865,607.42	0.42
14	002507	涪陵榨菜	6,622,277	201,979,448.50	0.42
15	002439	启明星辰	7,450,525	200,419,122.50	0.42
16	600426	华鲁恒升	13,442,722	199,758,848.92	0.41
17	000401	冀东水泥	11,288,487	198,790,256.07	0.41
18	002127	南极电商	17,663,006	198,532,187.44	0.41

19	600642	申能股份	32,903,480	197,749,914.80	0.41
20	002463	沪电股份	14,480,158	197,219,751.96	0.41
21	002129	中环股份	20,024,901	195,443,033.76	0.41
22	600536	中国软件	3,612,801	193,899,029.67	0.40
23	600183	生益科技	12,824,225	193,004,586.25	0.40
24	600895	张江高科	9,251,099	189,832,551.48	0.39
25	600298	安琪酵母	5,979,436	189,129,560.68	0.39
26	000975	银泰资源	14,224,284	187,618,305.96	0.39
27	002340	格林美	39,810,315	187,506,583.65	0.39
28	300383	光环新网	11,068,100	185,612,037.00	0.39
29	002465	海格通信	19,405,366	185,127,191.64	0.38
30	000623	吉林敖东	11,144,410	182,656,879.90	0.38
31	000750	国海证券	35,373,420	177,928,302.60	0.37
32	002223	鱼跃医疗	7,166,957	176,450,481.34	0.37
33	002268	卫士通	7,012,556	171,456,994.20	0.36
34	603369	今世缘	6,051,129	168,765,987.81	0.35
35	002821	凯莱英	1,719,322	168,631,101.76	0.35
36	002384	东山精密	11,519,079	167,832,981.03	0.35
37	002075	沙钢股份	21,330,583	167,231,770.72	0.35
38	600801	华新水泥	8,210,254	166,257,643.50	0.35
39	002500	山西证券	20,297,048	164,406,088.80	0.34
40	002926	华西证券	15,651,176	164,337,348.00	0.34
41	000998	隆平高科	11,136,948	161,263,007.04	0.33
42	002797	第一创业	25,407,985	161,086,624.90	0.33
43	600879	航天电子	26,133,926	160,984,984.16	0.33
44	600161	天坛生物	6,283,764	158,665,041.00	0.33
45	600325	华发股份	20,306,322	158,592,374.82	0.33
46	002385	大北农	29,663,321	156,918,968.09	0.33
47	600460	士兰微	9,395,378	155,963,274.80	0.32
48	600497	驰宏锌锗	30,693,702	155,924,006.16	0.32
49	000723	美锦能源	14,799,372	154,653,437.40	0.32
50	600528	中铁工业	13,295,187	153,825,313.59	0.32
51	002373	千方科技	8,917,516	152,489,523.60	0.32
52	002371	北方华创	2,201,523	152,455,467.75	0.32
53	601128	常熟银行	19,736,674	152,367,123.28	0.32
54	000988	华工科技	9,591,793	151,742,165.26	0.32
55	002299	圣农发展	5,991,726	151,710,502.32	0.32
56	600745	闻泰科技	4,551,800	151,210,796.00	0.31
57	600848	上海临港	4,831,375	150,400,703.75	0.31
58	000778	新兴铸管	33,657,801	149,440,636.44	0.31
59	000686	东北证券	16,933,630	149,185,280.30	0.31
60	000997	新大陆	8,772,347	148,164,940.83	0.31
61	600584	长电科技	11,497,694	147,745,367.90	0.31

62	000009	中国宝安	25,793,075	147,278,458.25	0.31
63	600549	厦门钨业	10,273,072	147,007,660.32	0.31
64	601168	西部矿业	22,974,288	146,575,957.44	0.30
65	002572	索 菲 亚	7,861,545	145,910,275.20	0.30
66	600699	均胜电子	6,826,397	145,811,839.92	0.30
67	600779	水 井 坊	2,866,735	145,687,472.70	0.30
68	600820	隧道股份	22,706,804	143,279,933.24	0.30
69	002092	中泰化学	17,993,314	143,226,779.44	0.30
70	600410	华胜天成	13,213,233	141,777,990.09	0.29
71	600909	华安证券	21,632,050	141,473,607.00	0.29
72	600673	东 阳 光	18,021,366	141,467,723.10	0.29
73	601005	重庆钢铁	70,350,466	141,404,436.66	0.29
74	000060	中金岭南	29,993,317	140,668,656.73	0.29
75	600392	盛和资源	12,679,001	140,229,751.06	0.29
76	600875	东方电气	13,199,459	140,178,254.58	0.29
77	300168	万达信息	10,704,938	138,843,045.86	0.29
78	600376	首开股份	15,457,529	138,035,733.97	0.29
79	600572	康 恩 贝	21,506,658	137,642,611.20	0.29
80	000999	华润三九	4,679,415	137,294,036.10	0.29
81	000039	中集集团	12,834,892	137,076,646.56	0.28
82	000960	锡业股份	12,082,792	134,964,786.64	0.28
83	000690	宝新能源	20,934,012	134,815,037.28	0.28
84	600718	东软集团	10,479,872	134,351,959.04	0.28
85	000830	鲁西化工	12,347,398	134,339,690.24	0.28
86	002353	杰瑞股份	5,794,918	133,862,605.80	0.28
87	600811	东方集团	35,712,873	132,851,887.56	0.28
88	600166	福田汽车	56,008,536	132,740,230.32	0.28
89	002372	伟星新材	7,619,151	132,573,227.40	0.28
90	601333	广深铁路	40,909,305	132,137,055.15	0.27
91	600959	江苏有线	29,648,533	131,935,971.85	0.27
92	600755	厦门国贸	15,237,715	131,501,480.45	0.27
93	600022	山东钢铁	78,708,930	131,443,913.10	0.27
94	002191	劲嘉股份	10,584,059	131,348,172.19	0.27
95	002387	维 信 诺	10,058,611	131,264,873.55	0.27
96	600839	四川长虹	44,389,698	130,949,609.10	0.27
97	002916	深南电路	1,277,173	130,169,472.16	0.27
98	000581	威孚高科	7,007,675	130,062,448.00	0.27
99	600567	山鹰纸业	38,565,646	129,966,227.02	0.27
100	601866	中远海发	47,622,622	129,533,531.84	0.27
101	600804	鹏 博 士	17,184,606	129,228,237.12	0.27
102	603939	益丰药房	1,846,089	129,207,769.11	0.27
103	600521	华海药业	9,133,659	128,784,591.90	0.27
104	000547	航天发展	13,457,680	128,655,420.80	0.27

105	002281	光迅科技	4,851,767	128,474,790.16	0.27
106	600881	亚泰集团	39,437,332	128,171,329.00	0.27
107	002078	太阳纸业	18,728,805	127,543,162.05	0.26
108	600885	宏发股份	5,227,857	127,036,925.10	0.26
109	601872	招商轮船	29,096,309	126,859,907.24	0.26
110	600315	上海家化	4,052,309	126,229,425.35	0.26
111	002217	合力泰	22,504,453	124,449,625.09	0.26
112	002074	国轩高科	9,489,236	124,403,883.96	0.26
113	300009	安科生物	7,768,063	123,512,201.70	0.26
114	600486	扬农化工	2,237,984	122,417,724.80	0.25
115	600808	马钢股份	35,876,749	122,339,714.09	0.25
116	600260	凯乐科技	6,038,089	120,641,018.22	0.25
117	603077	和邦生物	63,456,523	120,567,393.70	0.25
118	002273	水晶光电	10,403,904	120,477,208.32	0.25
119	600094	大名城	19,141,132	120,397,720.28	0.25
120	600079	人福医药	11,335,209	119,019,694.50	0.25
121	002221	东华能源	13,795,796	118,781,803.56	0.25
122	603000	人民网	6,637,072	118,338,993.76	0.25
123	600037	歌华有线	11,517,069	118,049,957.25	0.25
124	600160	巨化股份	16,539,142	117,593,299.62	0.24
125	000970	中科三环	10,276,697	116,640,510.95	0.24
126	002670	国盛金控	9,248,566	116,531,931.60	0.24
127	002002	鸿达兴业	18,740,704	116,004,957.76	0.24
128	000983	西山煤电	19,045,000	115,412,700.00	0.24
129	002038	双鹭药业	4,896,415	115,359,537.40	0.24
130	300027	华谊兄弟	23,491,228	115,341,929.48	0.24
131	300274	阳光电源	12,306,204	115,063,007.40	0.24
132	000513	丽珠集团	3,458,833	114,937,020.59	0.24
133	601699	潞安环能	14,423,387	114,521,692.78	0.24
134	600967	内蒙一机	10,194,614	114,179,676.80	0.24
135	300315	掌趣科技	33,069,800	114,090,810.00	0.24
136	600845	宝信软件	3,987,011	113,550,073.28	0.24
137	002607	中公教育	8,221,046	112,874,961.58	0.23
138	600435	北方导航	12,552,007	112,842,542.93	0.23
139	000729	燕京啤酒	16,956,875	112,593,650.00	0.23
140	600143	金发科技	22,938,112	112,396,748.80	0.23
141	600282	南钢股份	31,915,979	111,705,926.50	0.23
142	600064	南京高科	10,420,502	111,603,576.42	0.23
143	300088	长信科技	22,041,104	111,527,986.24	0.23
144	600737	中粮糖业	12,838,364	111,436,999.52	0.23
145	600388	龙净环保	8,979,666	111,258,061.74	0.23
146	600466	蓝光发展	17,862,146	111,102,548.12	0.23
147	002085	万丰奥威	15,127,701	110,129,663.28	0.23

148	600643	爱建集团	11,471,951	109,901,290.58	0.23
149	000089	深圳机场	12,347,900	109,772,831.00	0.23
150	600863	内蒙华电	34,871,751	109,497,298.14	0.23
151	601098	中南传媒	8,636,291	109,162,718.24	0.23
152	300166	东方国信	8,871,420	109,029,751.80	0.23
153	600171	上海贝岭	6,706,156	108,975,035.00	0.23
154	000878	云南铜业	10,246,462	108,919,891.06	0.23
155	002110	三钢闽光	11,700,314	108,812,920.20	0.23
156	300001	特锐德	6,019,400	108,469,588.00	0.23
157	002174	游族网络	6,409,203	108,187,346.64	0.22
158	002690	美亚光电	3,313,326	108,014,427.60	0.22
159	600021	上海电力	12,372,337	107,391,885.16	0.22
160	300207	欣旺达	9,294,477	107,072,375.04	0.22
161	600026	中远海能	16,493,705	107,044,145.45	0.22
162	603444	吉比特	509,172	106,905,753.12	0.22
163	002131	利欧股份	55,885,915	106,742,097.65	0.22
164	601118	海南橡胶	20,725,095	106,734,239.25	0.22
165	002019	亿帆医药	8,689,776	106,449,756.00	0.22
166	600258	首旅酒店	5,919,654	106,435,378.92	0.22
167	603517	绝味食品	2,728,502	106,166,012.82	0.22
168	000563	陕国投 A	23,785,286	105,606,669.84	0.22
169	600266	北京城建	13,015,429	104,904,357.74	0.22
170	000636	风华高科	8,606,032	104,132,987.20	0.22
171	002589	瑞康医药	13,687,450	103,887,745.50	0.22
172	601106	中国一重	33,027,700	103,706,978.00	0.22
173	002440	闰土股份	8,314,600	103,599,916.00	0.22
174	601718	际华集团	26,350,615	103,030,904.65	0.21
175	000883	湖北能源	23,565,289	102,273,354.26	0.21
176	002155	湖南黄金	10,152,600	102,236,682.00	0.21
177	000826	启迪环境	8,632,030	101,771,633.70	0.21
178	600373	中文传媒	8,006,128	100,556,967.68	0.21
179	002233	塔牌集团	8,568,973	100,085,604.64	0.21
180	600380	健康元	11,570,426	100,084,184.90	0.21
181	000930	中粮生化	13,282,723	99,886,076.96	0.21
182	002152	广电运通	14,507,343	99,375,299.55	0.21
183	000732	泰禾集团	6,011,541	99,190,426.50	0.21
184	000559	万向钱潮	16,584,110	99,172,977.80	0.21
185	601966	玲珑轮胎	5,807,130	98,721,210.00	0.21
186	300316	晶盛机电	7,776,807	98,687,680.83	0.20
187	002250	联化科技	8,864,585	98,308,247.65	0.20
188	600649	城投控股	15,164,353	98,113,363.91	0.20
189	000598	兴蓉环境	21,561,040	98,102,732.00	0.20
190	601000	唐山港	35,434,703	97,445,433.25	0.20

191	601100	恒立液压	3,091,859	97,022,535.42	0.20
192	000681	视觉中国	4,986,748	96,643,176.24	0.20
193	000932	华菱钢铁	20,198,716	96,347,875.32	0.20
194	600008	首创股份	27,347,724	96,263,988.48	0.20
195	600782	新钢股份	19,166,813	95,834,065.00	0.20
196	601231	环旭电子	7,891,718	95,095,201.90	0.20
197	600039	四川路桥	26,004,183	94,655,226.12	0.20
198	002399	海普瑞	4,483,499	94,108,644.01	0.20
199	600648	外高桥	4,475,625	93,898,612.50	0.20
200	600500	中化国际	12,565,042	93,860,863.74	0.19
201	600827	百联股份	9,556,508	93,749,343.48	0.19
202	600515	海航基础	18,864,920	93,381,354.00	0.19
203	000685	中山公用	10,855,588	92,706,721.52	0.19
204	603501	韦尔股份	1,684,600	92,501,386.00	0.19
205	002583	海能达	11,023,070	92,483,557.30	0.19
206	300182	捷成股份	20,948,548	92,383,096.68	0.19
207	000738	航发控制	6,850,737	91,799,875.80	0.19
208	600598	北大荒	8,549,284	91,733,817.32	0.19
209	000758	中色股份	16,608,368	91,179,940.32	0.19
210	000031	大悦城	14,199,848	91,163,024.16	0.19
211	601179	中国西电	24,555,895	90,856,811.50	0.19
212	002266	浙富控股	19,123,919	90,838,615.25	0.19
213	601608	中信重工	20,876,632	90,187,050.24	0.19
214	300058	蓝色光标	21,090,024	90,054,402.48	0.19
215	600729	重庆百货	2,961,313	89,550,105.12	0.19
216	002004	华邦健康	18,401,465	89,431,119.90	0.19
217	002368	太极股份	2,929,815	88,773,394.50	0.18
218	300418	昆仑万维	6,891,807	88,697,556.09	0.18
219	000807	云铝股份	18,835,430	88,338,166.70	0.18
220	000027	深圳能源	14,227,646	88,211,405.20	0.18
221	000008	神州高铁	23,362,332	88,075,991.64	0.18
222	601678	滨化股份	12,987,587	87,796,088.12	0.18
223	600748	上实发展	10,586,833	87,764,845.57	0.18
224	000877	天山股份	7,550,390	87,735,531.80	0.18
225	600167	联美控股	8,250,197	87,287,084.26	0.18
226	600633	浙数文化	9,328,614	87,222,540.90	0.18
227	600138	中青旅	6,855,519	86,996,536.11	0.18
228	600120	浙江东方	6,799,890	86,630,598.60	0.18
229	300133	华策影视	12,810,310	86,213,386.30	0.18
230	002414	高德红外	4,484,538	86,103,129.60	0.18
231	600511	国药股份	3,734,233	85,775,332.01	0.18
232	000488	晨鸣纸业	15,982,750	85,667,540.00	0.18
233	600507	方大特钢	8,702,982	85,115,163.96	0.18

234	600777	新潮能源	40,908,200	85,089,056.00	0.18
235	002183	怡亚通	17,802,019	84,915,630.63	0.18
236	603885	吉祥航空	6,469,412	84,749,297.20	0.18
237	000887	中鼎股份	8,813,629	84,522,702.11	0.18
238	600155	华创阳安	6,284,152	84,396,161.36	0.18
239	600348	阳泉煤业	14,488,515	84,178,272.15	0.17
240	600056	中国医药	6,229,954	84,042,079.46	0.17
241	600216	浙江医药	8,150,936	83,465,584.64	0.17
242	600823	世茂股份	18,086,042	83,376,653.62	0.17
243	603228	景旺电子	2,076,173	83,067,681.73	0.17
244	002603	以岭药业	7,172,231	83,054,434.98	0.17
245	600158	中体产业	8,116,556	83,032,367.88	0.17
246	603883	老百姓	1,419,610	83,018,792.80	0.17
247	000528	柳工	12,435,036	82,817,339.76	0.17
248	002408	齐翔腾达	10,673,887	82,722,624.25	0.17
249	000813	德展健康	10,774,927	82,104,943.74	0.17
250	600418	江淮汽车	15,907,599	82,083,210.84	0.17
251	002812	恩捷股份	1,746,754	81,660,749.50	0.17
252	600409	三友化工	14,349,500	81,218,170.00	0.17
253	600060	海信电器	9,372,239	80,788,700.18	0.17
254	600277	亿利洁能	16,510,110	80,404,235.70	0.17
255	000301	东方盛虹	14,621,187	80,270,316.63	0.17
256	600525	长园集团	12,694,180	80,227,217.60	0.17
257	600478	科力远	14,209,500	79,431,105.00	0.16
258	600062	华润双鹤	6,279,528	79,184,848.08	0.16
259	601880	大连港	37,175,133	79,183,033.29	0.16
260	300010	立思辰	8,364,382	78,541,546.98	0.16
261	600597	光明乳业	7,291,301	78,381,485.75	0.16
262	000090	天健集团	15,764,611	77,877,178.34	0.16
263	600970	中材国际	12,104,675	77,833,060.25	0.16
264	600717	天津港	12,120,786	77,815,446.12	0.16
265	002244	滨江集团	18,750,354	77,813,969.10	0.16
266	002407	多氟多	6,567,968	77,764,741.12	0.16
267	300113	顺网科技	4,949,255	77,604,318.40	0.16
268	002242	九阳股份	3,727,981	77,579,284.61	0.16
269	601958	金铂股份	11,565,379	77,488,039.30	0.16
270	300002	神州泰岳	19,401,908	77,219,593.84	0.16
271	002212	南洋股份	5,617,691	76,962,366.70	0.16
272	300026	红日药业	22,219,501	76,657,278.45	0.16
273	002419	天虹股份	5,842,245	76,299,719.70	0.16
274	600307	酒钢宏兴	37,552,191	76,230,947.73	0.16
275	002701	奥瑞金	16,318,340	76,206,647.80	0.16
276	000028	国药一致	1,817,759	76,036,858.97	0.16

277	600312	平高电气	9,845,316	75,710,480.04	0.16
278	000156	华数传媒	6,853,718	75,459,435.18	0.16
279	002056	横店东磁	9,927,516	75,449,121.60	0.16
280	601200	上海环境	5,522,833	75,165,757.13	0.16
281	600664	哈药股份	18,122,637	75,027,717.18	0.16
282	002640	跨境通	8,962,758	74,659,774.14	0.16
283	600259	广晟有色	1,835,923	73,987,696.90	0.15
284	601928	凤凰传媒	9,142,348	73,778,748.36	0.15
285	600557	康缘药业	4,951,953	73,586,021.58	0.15
286	600759	洲际油气	19,045,206	73,514,495.16	0.15
287	601611	中国核建	9,442,017	73,458,892.26	0.15
288	002491	通鼎互联	9,045,104	73,174,891.36	0.15
289	600316	洪都航空	5,103,805	73,035,449.55	0.15
290	600073	上海梅林	7,935,877	73,010,068.40	0.15
291	002665	首航节能	21,368,555	72,439,401.45	0.15
292	603659	璞泰来	1,532,284	72,047,993.68	0.15
293	002470	金正大	19,713,495	71,757,121.80	0.15
294	000021	深科技	8,825,598	71,752,111.74	0.15
295	600580	卧龙电驱	8,530,345	71,740,201.45	0.15
296	300324	旋极信息	12,375,345	71,653,247.55	0.15
297	300244	迪安诊断	4,219,525	71,647,534.50	0.15
298	600884	杉杉股份	6,720,720	71,575,668.00	0.15
299	002030	达安基因	6,667,417	71,541,384.41	0.15
300	002128	露天煤业	8,249,555	71,358,650.75	0.15
301	300134	大富科技	4,587,515	71,244,107.95	0.15
302	002064	华峰氨纶	14,164,566	71,106,121.32	0.15
303	600125	铁龙物流	10,970,024	70,756,654.80	0.15
304	300197	铁汉生态	19,677,304	70,641,521.36	0.15
305	000078	海王生物	20,280,775	70,577,097.00	0.15
306	300115	长盈精密	6,723,362	70,528,067.38	0.15
307	600859	王府井	4,636,820	70,433,295.80	0.15
308	600751	海航科技	22,067,147	70,173,527.46	0.15
309	002176	江特电机	14,383,100	70,045,697.00	0.15
310	600017	日照港	22,135,422	69,726,579.30	0.14
311	600754	锦江股份	2,828,238	69,687,784.32	0.14
312	603816	顾家家居	2,170,621	69,286,222.32	0.14
313	600267	海正药业	6,920,116	69,201,160.00	0.14
314	600582	天地科技	20,049,097	69,169,384.65	0.14
315	000712	锦龙股份	5,384,188	69,132,973.92	0.14
316	600575	皖江物流	23,594,400	69,131,592.00	0.14
317	601717	郑煤机	12,096,243	69,069,547.53	0.14
318	002426	胜利精密	26,848,606	68,732,431.36	0.14
319	002051	中工国际	5,977,440	68,561,236.80	0.14

320	000727	华东科技	32,616,300	68,168,067.00	0.14
321	002302	西部建设	6,100,370	67,958,121.80	0.14
322	002358	森源电气	6,680,148	67,803,502.20	0.14
323	000959	首钢股份	19,165,051	67,460,979.52	0.14
324	603866	桃李面包	1,614,008	67,223,433.20	0.14
325	002317	众生药业	7,872,485	66,994,847.35	0.14
326	002285	世联行	14,732,954	66,445,622.54	0.14
327	600499	科达洁能	15,148,270	66,349,422.60	0.14
328	600563	法拉电子	1,608,531	66,223,221.27	0.14
329	600291	西水股份	6,554,453	65,937,797.18	0.14
330	600901	江苏租赁	10,755,793	65,502,779.37	0.14
331	002424	贵州百灵	6,614,609	65,352,336.92	0.14
332	000400	许继电气	7,207,881	65,303,401.86	0.14
333	600835	上海机电	3,905,554	64,832,196.40	0.13
334	002505	大康农业	32,906,357	64,825,523.29	0.13
335	000519	中兵红箭	8,384,576	64,812,772.48	0.13
336	600645	中源协和	3,742,164	64,776,858.84	0.13
337	600993	马应龙	3,670,068	64,776,700.20	0.13
338	000158	常山北明	11,944,905	64,741,385.10	0.13
339	600317	营口港	23,397,943	64,578,322.68	0.13
340	000717	韶钢松山	14,555,100	64,479,093.00	0.13
341	002444	巨星科技	6,452,888	64,399,822.24	0.13
342	600565	迪马股份	17,255,200	64,361,896.00	0.13
343	000926	福星股份	9,222,040	63,816,516.80	0.13
344	000718	苏宁环球	18,324,300	63,402,078.00	0.13
345	002573	清新环境	7,847,442	63,171,908.10	0.13
346	002249	大洋电机	14,443,758	62,685,909.72	0.13
347	600908	无锡银行	11,092,679	62,562,709.56	0.13
348	002280	联络互动	17,090,100	62,549,766.00	0.13
349	600151	航天机电	12,119,490	62,415,373.50	0.13
350	600770	综艺股份	9,315,333	62,226,424.44	0.13
351	601326	秦港股份	17,124,100	62,160,483.00	0.13
352	600765	中航重机	6,718,548	62,012,198.04	0.13
353	000006	深振业 A	11,337,454	61,789,124.30	0.13
354	600611	大众交通	13,127,867	61,044,581.55	0.13
355	002839	张家港行	10,842,600	61,043,838.00	0.13
356	000012	南玻 A	14,660,229	60,986,552.64	0.13
357	002807	江阴银行	13,025,799	60,960,739.32	0.13
358	000543	皖能电力	12,896,836	60,744,097.56	0.13
359	600787	中储股份	10,555,041	60,480,384.93	0.13
360	300055	万邦达	8,437,643	60,160,394.59	0.12
361	600862	中航高科	6,659,413	59,868,122.87	0.12
362	002028	思源电气	5,978,753	59,548,379.88	0.12

363	603515	欧普照明	1,839,542	59,325,229.50	0.12
364	300308	中际旭创	1,739,730	59,133,422.70	0.12
365	002431	棕榈股份	14,967,740	59,122,573.00	0.12
366	002831	裕同科技	3,079,958	59,042,794.86	0.12
367	600141	兴发集团	5,726,318	58,866,549.04	0.12
368	002366	台海核电	6,260,194	58,595,415.84	0.12
369	603233	大参林	1,298,932	58,451,940.00	0.12
370	002390	信邦制药	11,064,566	58,310,262.82	0.12
371	000848	承德露露	6,999,341	58,304,510.53	0.12
372	600338	西藏珠峰	3,331,347	58,231,945.56	0.12
373	603712	七一二	2,742,500	58,223,275.00	0.12
374	600169	太原重工	21,796,293	58,196,102.31	0.12
375	002093	国脉科技	6,252,560	58,086,282.40	0.12
376	601311	骆驼股份	5,350,746	58,055,594.10	0.12
377	000600	建投能源	8,601,666	57,631,162.20	0.12
378	601019	山东出版	7,379,300	57,410,954.00	0.12
379	002672	东江环保	5,046,071	57,222,445.14	0.12
380	600393	粤泰股份	12,220,281	56,824,306.65	0.12
381	300297	蓝盾股份	9,396,536	56,661,112.08	0.12
382	000564	供销大集	21,618,301	56,423,765.61	0.12
383	002745	木林森	4,810,428	56,378,216.16	0.12
384	002048	宁波华翔	5,193,550	56,194,211.00	0.12
385	002635	安洁科技	4,155,053	56,051,664.97	0.12
386	002332	仙琚制药	8,278,337	55,961,558.12	0.12
387	000980	众泰汽车	13,089,000	55,104,690.00	0.11
388	600458	时代新材	5,286,988	54,931,805.32	0.11
389	300376	易事特	11,140,800	54,924,144.00	0.11
390	300287	飞利信	13,729,200	54,504,924.00	0.11
391	601689	拓普集团	3,545,322	54,314,333.04	0.11
392	600640	号百控股	4,047,467	54,155,108.46	0.11
393	600978	宜华生活	14,312,399	53,814,620.24	0.11
394	002254	泰和新材	5,073,417	53,676,751.86	0.11
395	002544	杰赛科技	4,125,801	53,635,413.00	0.11
396	300159	新研股份	10,736,872	53,469,622.56	0.11
397	601016	节能风电	19,940,100	53,040,666.00	0.11
398	603198	迎驾贡酒	2,935,584	52,576,309.44	0.11
399	000062	深圳华强	3,947,646	52,464,215.34	0.11
400	000937	冀中能源	13,446,444	51,903,273.84	0.11
401	603766	隆鑫通用	12,365,318	51,810,682.42	0.11
402	300199	翰宇药业	5,634,092	51,664,623.64	0.11
403	002503	搜于特	18,634,852	51,245,843.00	0.11
404	600623	华谊集团	6,688,759	51,102,118.76	0.11
405	300266	兴源环境	11,225,802	50,965,141.08	0.11

406	603888	新 华 网	2,547,356	50,845,225.76	0.11
407	600750	江中药业	3,906,076	50,818,048.76	0.11
408	600006	东风汽车	9,527,362	50,780,839.46	0.11
409	600195	中牧股份	3,661,334	50,709,475.90	0.11
410	000501	鄂武商 A	4,663,120	50,128,540.00	0.10
411	000990	诚志股份	3,049,200	50,037,372.00	0.10
412	600694	大商股份	1,789,531	49,945,810.21	0.10
413	002709	天赐材料	2,063,300	49,931,860.00	0.10
414	600329	中新药业	3,471,856	49,612,822.24	0.10
415	600757	长江传媒	7,222,133	49,182,725.73	0.10
416	002382	蓝帆医疗	3,548,434	49,039,357.88	0.10
417	000869	张 裕 A	1,507,820	48,431,178.40	0.10
418	603806	福 斯 特	1,316,559	48,357,212.07	0.10
419	600545	卓郎智能	6,800,683	48,352,856.13	0.10
420	600639	浦东金桥	2,982,414	48,225,634.38	0.10
421	600869	智慧能源	10,664,654	48,204,236.08	0.10
422	600416	湘电股份	7,998,340	48,150,006.80	0.10
423	000537	广宇发展	6,955,305	48,130,710.60	0.10
424	000426	兴业矿业	8,949,740	48,060,103.80	0.10
425	603568	伟明环保	2,227,090	47,926,976.80	0.10
426	002375	亚厦股份	8,094,585	47,838,997.35	0.10
427	002815	崇达技术	3,059,903	47,703,887.77	0.10
428	603056	德邦股份	3,380,739	47,600,805.12	0.10
429	601001	大同煤业	10,088,787	46,105,756.59	0.10
430	300257	开山股份	4,131,465	45,776,632.20	0.10
431	002434	万 里 扬	6,714,500	45,591,455.00	0.09
432	601127	小康股份	3,428,148	44,908,738.80	0.09
433	000536	华映科技	17,655,387	44,491,575.24	0.09
434	000061	农 产 品	8,181,519	44,343,832.98	0.09
435	600657	信达地产	10,738,562	44,242,875.44	0.09
436	002489	浙江永强	13,052,789	43,596,315.26	0.09
437	002920	德赛西威	1,939,829	43,452,169.60	0.09
438	600707	彩虹股份	8,663,700	43,405,137.00	0.09
439	601801	皖新传媒	7,203,295	43,291,802.95	0.09
440	600058	五矿发展	5,080,001	42,926,008.45	0.09
441	600874	创业环保	5,148,952	42,684,812.08	0.09
442	002948	青岛银行	6,622,100	42,580,103.00	0.09
443	603377	东方时尚	2,779,770	42,474,885.60	0.09
444	000766	通化金马	6,181,077	42,031,323.60	0.09
445	600971	恒源煤电	7,142,196	41,781,846.60	0.09
446	002437	誉衡药业	10,570,046	41,751,681.70	0.09
447	002118	紫鑫药业	6,172,122	41,600,102.28	0.09
448	002517	恺英网络	12,919,100	41,211,929.00	0.09

449	000541	佛山照明	7,816,277	40,957,291.48	0.09
450	600996	贵广网络	3,790,500	40,861,590.00	0.08
451	600098	广州发展	6,527,260	40,207,921.60	0.08
452	603328	依顿电子	3,914,067	40,197,468.09	0.08
453	002509	天广中茂	19,480,700	40,130,242.00	0.08
454	300459	金科文化	7,022,200	39,956,318.00	0.08
455	600350	山东高速	8,257,327	39,635,169.60	0.08
456	002707	众信旅游	6,491,000	39,400,370.00	0.08
457	000829	天音控股	6,719,435	39,107,111.70	0.08
458	601869	长飞光纤	1,039,800	38,992,500.00	0.08
459	002681	奋达科技	9,159,685	38,837,064.40	0.08
460	600428	中远海特	10,338,482	38,252,383.40	0.08
461	601003	柳钢股份	6,471,100	37,467,669.00	0.08
462	600053	九鼎投资	1,599,855	37,276,621.50	0.08
463	002818	富森美	2,903,888	37,256,883.04	0.08
464	000552	靖远煤电	13,659,905	37,018,342.55	0.08
465	601615	明阳智能	3,399,030	36,845,485.20	0.08
466	002512	达华智能	8,141,110	36,797,817.20	0.08
467	002344	海宁皮城	7,760,509	36,163,971.94	0.08
468	600335	国机汽车	5,172,760	35,795,499.20	0.07
469	002482	广田集团	7,309,345	35,523,416.70	0.07
470	600903	贵州燃气	2,705,360	35,250,840.80	0.07
471	002251	步步高	4,401,787	35,082,242.39	0.07
472	601777	力帆股份	7,932,743	34,031,467.47	0.07
473	601139	深圳燃气	5,974,638	33,995,690.22	0.07
474	603556	海兴电力	2,433,090	33,625,303.80	0.07
475	000587	金洲慈航	12,683,910	32,724,487.80	0.07
476	600939	重庆建工	6,507,936	31,823,807.04	0.07
477	002936	郑州银行	6,210,742	31,550,569.36	0.07
478	000987	越秀金控	3,366,812	30,368,644.24	0.06
479	000025	特力A	1,463,324	29,588,411.28	0.06
480	600126	杭钢股份	6,463,800	29,474,928.00	0.06
481	002416	爱施德	4,665,900	29,161,875.00	0.06
482	002699	美盛文化	4,482,189	26,893,134.00	0.06
483	600280	中央商场	7,467,898	26,809,753.82	0.06
484	601969	海南矿业	4,558,400	26,803,392.00	0.06
485	601811	新华文轩	2,144,622	26,185,834.62	0.05
486	603868	飞科电器	663,510	25,976,416.50	0.05
487	601068	中铝国际	3,742,769	25,825,106.10	0.05
488	600179	ST 安通	8,752,972	25,646,207.96	0.05
489	603486	科沃斯	833,319	25,207,899.75	0.05
490	603225	新凤鸣	2,012,781	25,139,634.69	0.05
491	603355	莱克电气	1,027,308	22,107,668.16	0.05

492	600985	淮北矿业	1,936,558	21,960,567.72	0.05
493	000761	本钢板材	4,788,010	20,588,443.00	0.04
494	603650	彤程新材	862,414	18,835,121.76	0.04
495	002941	新疆交建	692,000	17,992,000.00	0.04
496	603025	大豪科技	1,548,300	15,854,592.00	0.03
497	600917	重庆燃气	2,226,263	15,494,790.48	0.03
498	603569	长久物流	1,209,873	14,022,428.07	0.03
499	002946	新乳业	867,500	13,133,950.00	0.03
500	603877	太平鸟	784,972	12,182,765.44	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	102,375	363,431.25	0.00
2	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
3	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
4	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
5	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
6	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
7	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
8	300788	中信出版	1,556	23,106.60	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	002405	四维图新	305,968,355.43	0.91
2	002157	正邦科技	272,629,175.48	0.81
3	000860	顺鑫农业	203,499,486.33	0.61
4	002916	深南电路	200,441,596.60	0.60
5	002075	沙钢股份	197,789,226.83	0.59
6	002049	紫光国微	197,673,087.78	0.59
7	300347	泰格医药	196,066,220.09	0.59
8	300450	先导智能	195,429,030.03	0.58
9	000623	吉林敖东	191,938,697.12	0.57
10	600739	辽宁成大	182,721,043.07	0.55
11	002195	二三四五	181,779,265.03	0.54
12	300253	卫宁健康	179,299,752.56	0.54
13	002129	中环股份	176,292,294.29	0.53
14	600763	通策医疗	175,318,744.15	0.52

15	000401	冀东水泥	175,187,343.49	0.52
16	002410	广联达	174,115,342.66	0.52
17	000750	国海证券	170,761,737.91	0.51
18	000656	金科股份	170,621,221.89	0.51
19	002465	海格通信	169,250,762.83	0.51
20	002507	涪陵榨菜	168,629,499.81	0.50

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	300347	泰格医药	428,735,562.76	1.28
2	002410	广联达	383,485,896.77	1.15
3	000656	金科股份	348,246,169.89	1.04
4	300146	汤臣倍健	336,215,164.45	1.00
5	000596	古井贡酒	281,298,328.29	0.84
6	300413	芒果超媒	251,838,798.20	0.75
7	002013	中航机电	207,958,510.86	0.62
8	000418	小天鹅 A	205,866,559.12	0.62
9	600600	青岛啤酒	196,827,503.93	0.59
10	002916	深南电路	184,570,603.57	0.55
11	002049	紫光国微	182,477,652.29	0.55
12	600256	广汇能源	174,521,377.23	0.52
13	000860	顺鑫农业	174,489,957.50	0.52
14	000623	吉林敖东	166,621,319.21	0.50
15	000401	冀东水泥	159,993,977.50	0.48
16	002129	中环股份	158,834,889.62	0.47
17	000750	国海证券	155,816,289.25	0.47
18	002465	海格通信	154,990,845.66	0.46
19	002384	东山精密	149,642,713.97	0.45
20	002223	鱼跃医疗	148,897,851.86	0.44

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	29,242,581,628.12
卖出股票收入（成交）总额	24,299,135,000.78

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）	14,343,773.44	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,343,773.44	0.03

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	127011	中鼎转 2	80,448	8,477,610.24	0.02
2	110052	贵广转债	49,090	5,863,800.50	0.01
3	113027	华钰转债	10	1,000.00	0.00
4	123022	长信转债	9	918.54	0.00
5	128061	启明转债	4	444.16	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1907	IC1907	586	575,030,080.00	20,397,080.00	-
IC1908	IC1908	41	39,840,520.00	-321,840.00	-
IC1909	IC1909	901	867,410,720.00	-75,019,400.00	-
IC1912	IC1912	852	801,732,000.00	-1,367,600.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-56,311,760.00
股指期货投资本期收益（元）					231,183,946.85
股指期货投资本期公允价值变动（元）					58,482,582.75

7.10.2 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。

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	286,663,155.19
2	应收证券清算款	6,870,010.35
3	应收股利	-
4	应收利息	3,715,138.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	297,248,304.12

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	0.00	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	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资

						基金联接基金(LOF)	
		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
221,309	40,825.58	4,878,939,876.00	54.00%	2,165,550,366.00	23.97%	1,990,577,002.00	22.03%

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	中央汇金投资有限责任公司	1,728,426,785.00	19.13%
2	兴业财富—兴业银行“现金宝(4号)”—私人银行类人民币理财产品—兴业财富—兴	369,449,855.00	4.09%
3	中国人寿保险股份有限公司	343,416,421.00	3.80%
4	中国人寿保险（集团）公司	173,093,765.00	1.92%
5	中国人民财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品—008C—CT001 沪	124,630,700.00	1.38%
6	中国人寿保险股份有限公司	106,671,483.00	1.18%
7	中国人民人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	61,594,470.00	0.68%
8	GIC PRIVATE LIMITED	57,412,220.00	0.64%
9	光大兴陇信托有限责任公司—光大信托—瑞富宝集合资金信托计划	50,998,600.00	0.56%
10	银华财富资本—建设银行—银华资本—粤盈 2 号专项资产管理计划	45,570,100.00	0.50%
11	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	1,990,577,002.00	22.03%

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(2013 年 2 月 06 日)基金份额	1,147,553,216.00
------------------------------	------------------

总额	
本报告期期初基金份额总额	7,499,867,244.00
本报告期基金总申购份额	7,366,800,000.00
减：报告期基金总赎回份额	5,831,600,000.00
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	9,035,067,244.00

§ 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。

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	3	38,546,179,173.21	72.61%	3,855,127.63	72.61%	-
平安证券	2	9,172,628,626.75	17.28%	917,277.68	17.28%	-
申万宏源	2	5,370,938,437.94	10.12%	537,141.32	10.12%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	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	18,930,229.38	57.12%	-	-	-	-
平安证券	10,780,105.90	32.53%	5,830,000,000.00	51.03%	-	-
申万宏源	3,433,541.50	10.36%	5,595,000,000.00	48.97%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

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	南方基金关于中证 500 交易型开放式指数证券投资基金增加东北证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报	2019-01-16
2	南方基金关于中证 500 交易型开放式指数证券投资基金增加浙商证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报	2019-02-21
3	南方基金关于中证 500 交易型开放式指数证券投资基金增加联讯证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报	2019-03-11

§ 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		间					
联接基金	1	20190306 -2019063 0	1,366,573 ,402.00	1,463,603 ,600.00	839,600,0 00.00	1,990,577 ,002.00	22.03%
机构	1	20190101 -2019052 6; 20190528 -2019061 8	1,728,426 ,785.00	0.00	-	1,728,426 ,785.00	19.13%
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中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证 500 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 500 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>