南方恒生交易型开放式指数证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年8月23日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方恒生ETF
场内简称	恒指ETF
基金主代码	513600
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014年12月23日
报告期末基金份额总额	26,829,500.00份
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
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	2015年1月26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“恒指ETF”。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金,采用指数复制法。本基金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,在保持基金资产的流动性前提下,达到有效复制标的指数的目的。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数(使用估值汇率调整),本基金标的指数为恒生指数。
风险收益特征	本基金属股票指数基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资香港证券市场上市的股票,需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

无。

2.5 信息披露方式

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

§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	875,067.03
本期利润	7,768,212.16
加权平均基金份额本期利润	0.2803
本期基金份额净值增长率	11.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.2579
期末基金资产净值	71,940,216.31
期末基金份额净值	2.6814

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	6.48%	1.03%	6.17%	1.04%	0.31%	-0.01%
过去三个月	1.72%	0.91%	0.75%	0.92%	0.97%	-0.01%
过去六个月	11.72%	0.97%	10.87%	0.98%	0.85%	-0.01%
过去一年	4.64%	1.14%	2.86%	1.16%	1.78%	-0.02%
过去三年	46.01%	1.00%	41.28%	1.06%	4.73%	-0.06%
自基金合同生效起至今	39.07%	1.12%	35.86%	1.18%	3.21%	-0.06%

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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗文杰	本基金基金经理	2015年2月16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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内, 两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在, 并且交易占优比也没有明显异常,未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,恒生指数涨10.43%。 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) 港股通的交易风控资金的安排,导致基金实际仓位和基准的偏离。

4.5.2 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2.6814元, 报告期内, 份额净值增长率为11.72%,同期业绩基准增长率为10.87%。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定,当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时,可进行收益分配。基金管理人对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》;本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提, 收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值;在符合有关基金分红条件的前提下,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; 本基金收益分配采取现金分红的方式;同一类别内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。

4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:南方恒生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	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	1,292,225.92	1,660,989.49
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	70,368,617.63	67,645,032.03
其中:股票投资	70,368,617.63	67,645,032.03
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	250.45	544.03
应收股利	473,773.72	455.62
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	72,134,867.72	69,307,021.17
负债和所有者权益	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	15.47	14.64
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	28,504.60	28,416.01
应付托管费	5,700.93	5,683.23
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,519.98	20,049.81
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	156,910.43	58,204.01
负债合计	194,651.41	112,367.70
所有者权益:		
实收基金	51,730,276.48	55,586,500.14
未分配利润	20,209,939.83	13,608,153.33
所有者权益合计	71,940,216.31	69,194,653.47
负债和所有者权益总计	72,134,867.72	69,307,021.17

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值2.6814元,基金份额总额26,829,500.00份。

6.2 利润表

会计主体:南方恒生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	上年度可比期间2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	8,142,533.62	-1,095,348.55
1.利息收入	5,614.19	9,798.82
其中:存款利息收入	5,614.19	9,798.82
债券利息收入	-	-
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)	1,248,073.62	1,991,237.55
其中:股票投资收益	102,601.59	1,049,269.42
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,145,472.03	941,968.13
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6,893,145.13	-3,217,869.60
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-4,299.32	121,484.68
减:二、费用	374,321.46	507,556.17
1.管理人报酬	178,014.65	186,850.99
2.托管费	35,602.93	37,370.20
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	31,865.46	64,926.28
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	-	-
7.其他费用	128,838.42	218,408.70
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	7,768,212.16	-1,602,904.72
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	7,768,212.16	-1,602,904.72

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:南方恒生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)	55,586,500.14	13,608,153.33	69,194,653.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,768,212.16	7,768,212.16
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)	-3,856,223.66	-1,166,425.66	-5,022,649.32
其中:1.基金申购款	1,928,111.83	519,782.92	2,447,894.75
2.基金赎回款	-5,784,335.49	-1,686,208.58	-7,470,544.07
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)	51,730,276.48	20,209,939.83	71,940,216.31
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)	55,586,500.15	19,627,111.32	75,213,611.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,602,904.72	-1,602,904.72
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)	-3,856,223.67	-1,000,771.62	-4,856,995.29
其中:1.基金申购款	7,712,447.33	3,313,328.33	11,025,775.66
2.基金赎回款	-11,568,671.00	-4,314,099.95	-15,882,770.95
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)	51,730,276.48	17,023,434.98	68,753,711.46

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 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
南方恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“南方恒生ETF联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 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	14,970,880.40	100.00%	32,136,884.07	100.00%

6.4.4.1.2 基金交易

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基金交易。

6.4.4.1.3 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.4.1.4 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	11,976.75	100.00%	3,519.98	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	期末应付佣金总额的比例
华泰证券	25,709.63	100.00%	4,873.52	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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 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	178,014.65	186,850.99
其中:支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

注:支付基金管理人南方基金管理股份有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.5%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:

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.5%÷当年天数

6.4.4.2.2 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	35,602.93	37,370.20

注:支付基金托管人中国工商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:

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%÷当年天数

6.4.4.2.3 销售服务费

无。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.4.4.2 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
南方恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金	19,768,876.00	73.68%	20,768,876.00	72.04%

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	1,292,225.92	4,986.39	837,451.14	8,068.19

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

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

于2019年6月30日,本基金持有631,000.00股中国工商银行的H股普通股,成本总额为人民币3,190,914.65元,估值总额为人民币3,163,873.12元,占基金资产净值的比例为4.40%(2018年12月31日,本基金持有685,000.00股中国工商银行的H股普通股,成本总额为人民币3,467,940.03元,估值总额为人民币3,355,101.23元,占基金资产净值的比例为4.85%)。

6.4.5 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.6 期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.6.3.1 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。

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	70,368,617.63	97.55
	其中:普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,292,225.92	1.79
8	其他资产	474,024.17	0.66
9	合计	72,134,867.72	100.00

注:股票投资中通过沪港通买入港股公允价值合计为人民币70,368,617.63元,占基金净值比为97.82%。

7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
中国香港	70,368,617.63	97.82
合计	70,368,617.63	97.82

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	3,994,870.33	5.55
材料	-	-
工业	364,223.22	0.51
非必需消费品	3,958,214.90	5.50
必需消费品	3,319,513.12	4.61
医疗保健	865,057.64	1.20
金融	42,923,733.46	59.67
科技	7,951,646.98	11.05
通讯	3,709,165.56	5.16
公用事业	3,282,192.42	4.56
合计	70,368,617.63	97.82

注:以上分类采用彭博行业分类标准(BICS)。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

7.4.1 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前十名权益投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	AIA Group Limited	友邦保险控股有限公司	1299 HK	香港联合交易所	香港	104,200	7,722,403.19	10.73
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	0700 HK	香港联合交易所	香港	23,400	7,257,933.91	10.09
3	HSBC Holdings PLC	汇丰控股有限公司	0005 HK	香港联合交易所	香港	121,600	6,931,439.31	9.63
4	China Construction Bank Corporation	中国建设银行股份有限公司	0939 HK	香港联合交易所	香港	932,000	5,517,544.20	7.67
5	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	香港联合交易所	香港	48,000	3,960,581.18	5.51
6	China Mobile Limited	中国移动有限公司	0941 HK	香港联合交易所	香港	53,000	3,317,153.88	4.61
7	Industrial and Commercial Bank of China Limited	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香港联合交易所	香港	631,000	3,163,873.12	4.40
8	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	香港交易及结算所有限公司	0388 HK	香港联合交易所	香港	10,200	2,474,624.33	3.44
9	Bank of China Limited	中国银行股份有限公司	3988 HK	香港联合交易所	香港	685,000	1,988,471.43	2.76
10	CNOOC Limited	中国海洋石油有限公司	0883 HK	香港联合交易所	香港	157,000	1,845,104.44	2.56

注:基金对以上证券代码采用港股通交易代码。投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细, 应阅读登载于http://www.nffund.com的半年度报告正文。

7.4.2 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权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的权益投资。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	HSBC Holdings PLC	5 HK	1,106,849.41	1.60
2	Techtronic Industries Co. Ltd.	669 HK	575,610.15	0.83
3	Tencent Holdings Ltd	700 HK	489,057.80	0.71
4	AIA Group Limited	1299 HK	355,735.39	0.51
5	China Construction Bank Corporation	939 HK	258,917.94	0.37
6	China Mobile Limited	941 HK	201,782.69	0.29
7	The Hong Kong and China Gas Co. Ltd.	3 HK	178,702.45	0.26
8	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	159,318.46	0.23
9	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	158,071.86	0.23
10	CK Hutchison Holdings Limited	1 HK	133,832.02	0.19
11	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	128,624.37	0.19
12	MTR Corporation Ltd.	66 HK	126,749.54	0.18
13	Sun Hung Kai Properties Ltd.	16 HK	112,157.21	0.16
14	CK Asset Holdings Limited	1113 HK	104,288.70	0.15
15	Bank of China Limited	3988 HK	102,701.93	0.15
16	CNOOC Limited	883 HK	87,693.85	0.13
17	Galaxy Entertainment Group Limited	27 HK	82,885.46	0.12
18	CLP Holdings Ltd.	2 HK	78,868.84	0.11
19	Shenzhou International Group Holdings Ltd.	2313 HK	77,347.22	0.11
20	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	2319 HK	73,592.99	0.11

注:1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

| 序号 | 公司名称(英文) | 证券代码