

# 南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资 基金 2016 年第 4 季度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 1 月 19 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 10 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 南方中证 1000ETF  |
| 场内简称       | 1000ETF   |
| 交易代码       | 512100  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式 (ETF)  |
| 基金合同生效日    | 2016 年 9 月 29 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 167,892,000.00 份  |
| 投资目标       | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。   |
| 投资策略       | 本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。                |
| 业绩比较基准     | 本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 1000 指数。   |
| 风险收益特征     | 本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |
| 基金管理人      | 南方基金管理有限公司  |
| 基金托管人      | 招商银行股份有限公司  |

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“1000ETF”。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2016年10月1日—2016年12月31日） |
|-----------------|-----------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 3,158,311.17                |
| 2. 本期利润         | -5,875,103.02               |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0181                     |
| 4. 期末基金资产净值     | 158,808,487.33              |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9459                      |

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

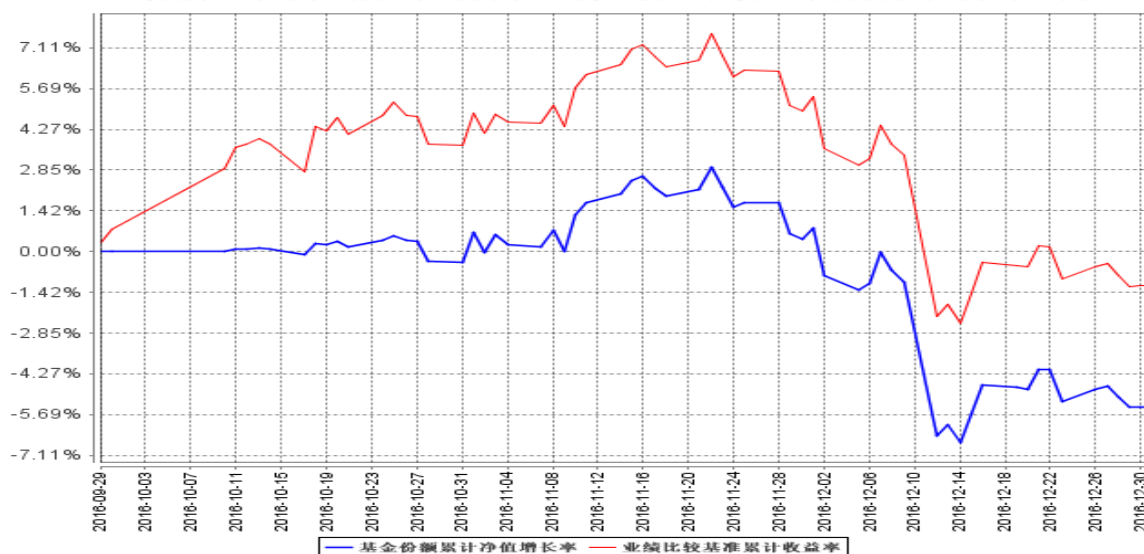
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率标<br>准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -5.43%     | 0.90%         | -1.96%         | 0.99%                 | -3.47% | -0.09% |

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

基金份额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



- 注：1、基金合同生效时间是 2016 年 9 月 29 日。
- 2、本基金建仓期为 3 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。
- 3、基金合同中关于基金投资比例的约定，本基金将全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现，正常情况下，本基金的指数化投资比例不低于基金资产净值的 90%。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明  |
|----|---------|-----------------|------|--------|---|
|    |         | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 周豪 | 本基金基金经理 | 2016 年 9 月 29 日 | -    | 8 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，任量化投资部高级研究员；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。 |

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内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《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现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% 的情况。

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金于 2016 年 9 月 29 日正式成立，于 2016 年 11 月 4 日上市交易并开放申购赎回，本报告期内中证 1000 指数下跌 1.96%。

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) 基金建仓期间整体仓位的偏离。
- (2) 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；
- (3) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离。
- (4) 根据指数半年度成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.9459 元，报告期内，份额净值增长率为-5.43%，同期业绩基准增长率为-1.96%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 157,377,318.19 | 98.88        |
|    | 其中：股票             | 157,377,318.19 | 98.88        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | -              | -            |
|    | 其中：债券             | -              | -            |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -              | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 1,508,457.10   | 0.95         |
| 8  | 其他资产              | 269,624.20     | 0.17         |
| 9  | 合计                | 159,155,399.49 | 100.00       |

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

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末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         | 1,784,700.00   | 1.12         |
| B  | 采矿业              | 2,452,448.20   | 1.54         |
| C  | 制造业              | 102,554,007.14 | 64.58        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,548,765.69   | 2.86         |
| E  | 建筑业              | 4,715,689.00   | 2.97         |
| F  | 批发和零售业           | 5,969,837.00   | 3.76         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 4,055,117.00   | 2.55         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 207,358.00     | 0.13         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 13,656,019.00  | 8.60         |
| J  | 金融业              | 164,943.00     | 0.10         |
| K  | 房地产业             | 7,340,413.00   | 4.62         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 2,151,328.00   | 1.35         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,240,547.00   | 0.78         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 1,248,611.00   | 0.79         |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -              | -     |
| P | 教育            | 127,935.00     | 0.08  |
| Q | 卫生和社会工作       | 732,903.00     | 0.46  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 2,338,078.00   | 1.47  |
| S | 综合            | 1,717,018.40   | 1.08  |
|   | 合计            | 157,005,717.43 | 98.86 |

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -          | -            |
| B  | 采掘业              | -          | -            |
| C  | 制造业              | 264,639.33 | 0.17         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -          | -            |
| E  | 建筑业              | 15,592.23  | 0.01         |
| 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  | 6,817.20   | 0.00         |
| J  | 金融业              | 84,552.00  | 0.05         |
| 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               | 371,600.76 | 0.23         |

### 5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

#### 5.3.1 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前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|------------|--------------|
| 1  | 002411 | 必康股份 | 15,900  | 430,095.00 | 0.27         |
| 2  | 600110 | 诺德股份 | 40,200  | 428,532.00 | 0.27         |
| 3  | 300142 | 沃森生物 | 37,200  | 405,480.00 | 0.26         |
| 4  | 600490 | 鹏欣资源 | 51,300  | 400,140.00 | 0.25         |
| 5  | 600868 | 梅雁吉祥 | 66,200  | 399,186.00 | 0.25         |
| 6  | 000059 | 华锦股份 | 33,300  | 396,270.00 | 0.25         |
| 7  | 002343 | 慈文传媒 | 8,700   | 392,979.00 | 0.25         |
| 8  | 300213 | 佳讯飞鸿 | 14,000  | 392,000.00 | 0.25         |
| 9  | 000516 | 国际医学 | 48,200  | 380,780.00 | 0.24         |
| 10 | 600401 | 海润光伏 | 164,000 | 380,480.00 | 0.24         |

#### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值（元）   | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|-----------|--------------|
| 1  | 601375 | 中原证券 | 21,138 | 84,552.00 | 0.05         |
| 2  | 603218 | 日月股份 | 1,652  | 68,805.80 | 0.04         |
| 3  | 300583 | 赛托生物 | 1,582  | 63,738.78 | 0.04         |
| 4  | 603877 | 太平鸟  | 2,194  | 46,732.20 | 0.03         |
| 5  | 002833 | 弘亚数控 | 2,060  | 36,297.20 | 0.02         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。



## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

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。

### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 263,285.55 |
| 2  | 应收证券清算款 | 5,705.79   |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 632.86     |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 269,624.20 |

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

**5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

| 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  | 300213 | 佳讯飞鸿 | 392,000.00     | 0.25         | 重大资产重组   |
| 2  | 000516 | 国际医学 | 380,780.00     | 0.24         | 重大资产重组   |

**5.11.5.2 报告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  | 601375 | 中原证券 | 84,552.00      | 0.05         | 新股未上市    |
| 2  | 300583 | 赛托生物 | 63,738.78      | 0.04         | 新股未上市    |
| 3  | 603877 | 太平鸟  | 46,732.20      | 0.03         | 新股未上市    |

**§6 开放式基金份额变动**

单位：份

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 587,892,000.00 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 3,000,000.00   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 423,000,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              |
| 报告期期末基金份额总额               | 167,892,000.00 |

**§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况****7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

注：本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

**7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细**

注：本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

## §8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同。
- 2、南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议。
- 3、南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年 4 季度报告原文。

### 8.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

### 8.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>