

# 南方中证 100 指数证券投资基金 2018 年 第 2 季度报告

2018 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 07 月 18 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 7 月 16 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，投资者在做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 2018 年 4 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	南方中证 100 指数
交易代码	202211
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 01 月 16 日
报告期末基金份额总额	162,106,182.64 份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%，年跟踪误差不超过 4%，以实现中证 100 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在中证 100 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，并辅之以金融衍生产品投资管理等，使跟踪误差控制在限定的范围之内。	
业绩比较基准	<p>本基金业绩比较基准为：中证 100 指数收益率×90%+一年期银行定期存款收益率（税后）×10%。</p> <p>如果中证 100 指数被停止编制及发布，或中证 100 指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致中证 100 指数不宜继续作为业绩比较基准或证券市场出现其他代表性更强、更合适作为业绩比较基准的指数，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则更换本基金的业绩比较基准。本基金由于上述原因变更业绩比较基准，不需召开基金份额持有人大会通过，但应报中国证监会，并在至少一种指定报刊和网站上公告。</p>	
风险收益特征	本基金为股票型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
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	
下属分级基金的基金简称	南方中证 100 指数 A 级	南方中证 100 指数 C 级
下属分级基金的交易代码	202211	005691
报告期末下属分级基金的份额总额	161,776,521.42 份	329,661.22 份

注：1. 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“南方中证 100”。

2. 本基金转型日期为 2018 年 1 月 16 日，该日起原南方恒元保本混合型证券投资基金正式变更

为南方中证 100 指数证券投资基金。

3. 本基金 2018 年 3 月 9 日发布公告，增加 C 类收费模式，原有收费模式称为 A 类。

### § 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(2018 年 04 月 01 日 - 2018 年 06 月 30 日)	
	南方中证 100 指数 A 级	南方中证 100 指数 C 级
1. 本期已实现收益	389,806.80	573.20
2. 本期利润	-12,667,629.56	-10,670.81
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0785	-0.1137
4. 期末基金资产净值	158,916,139.16	323,495.76
5. 期末基金份额净值	0.9823	0.9813

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

南方中证 100 指数 A 级

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-7.36%	1.08%	-7.76%	1.06%	0.40%	0.02%

南方中证 100 指数 C 级

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差	业绩比较基准	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④

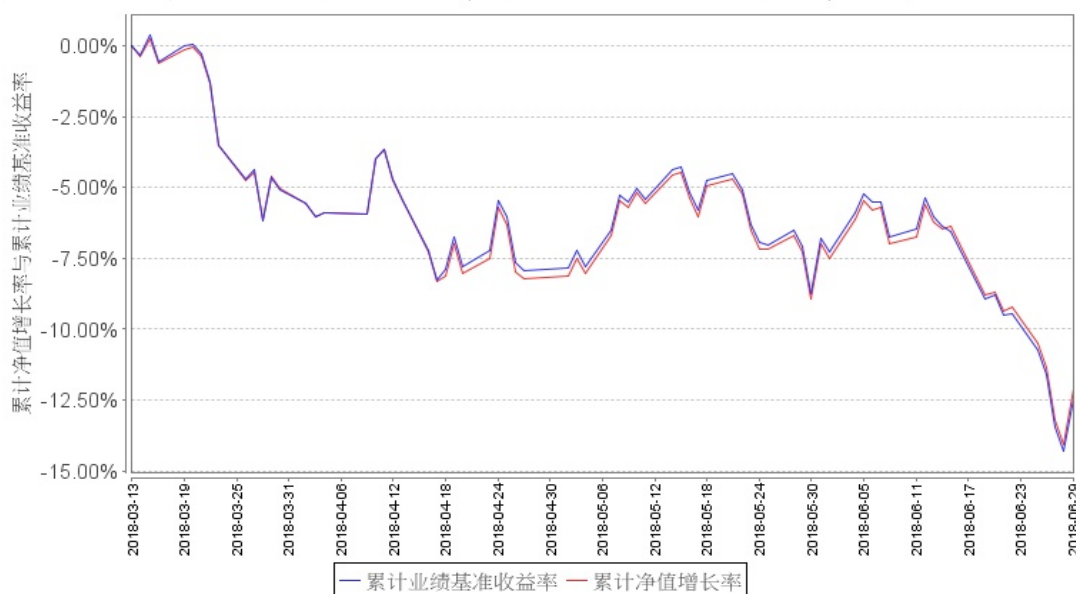
		②	收益率 ③	准差④		
过去 三个 月	-7.44%	1.08%	-7.76%	1.06%	0.32%	0.02%

### 3.2.2 自基金转型以来基金累计份额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100指数A级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



南方中证100指数C级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. 本基金转型日期为 2018 年 1 月 16 日，截止报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一  
第 5 页 共 13 页

年。

2. 本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月。截止本报告期末建仓期未结束。

## § 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	2018 年 1 月 16 日		9 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；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；2018 年 2 月至今，任南方消费活力基金经理。

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 100 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，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例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同日反向交易成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的 5%。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内中证 100 指数下跌 8.66%。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”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）接受申购赎回所带来的股票仓位偏离，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；（2）持仓中部分停牌股票复牌引起的偏离。（3）根据指数每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。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 级份额净值为 0.9823 元，本报告期 A 级份额净值增长率为-7.36%，同期业绩比较基准增长率为-7.76%。本基金 C 级份额净值为 0.9813 元，本报告期 C 级份额净值增长率为-7.44%，同期业绩比较基准增长率为-7.76%。

#### 4.5 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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	144,444,975.84	90.24
	其中：股票	144,444,975.84	90.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,075,500.00	6.29
	其中：债券	10,075,500.00	6.29
	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	3,000,000.00	1.87

	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	1,370,101.43	0.86
8	其他资产	1,178,103.30	0.74
9	合计	160,068,680.57	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

#### 报告期末按行业分类的境内股票投资组合（指数投资部分）

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	4,922,949.00	3.09
C	制造业	52,954,398.44	33.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,356,236.00	2.74
E	建筑业	5,086,685.40	3.19
F	批发和零售业	1,658,196.00	1.04
G	交通运输、仓储和邮政业	4,070,444.00	2.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,427,404.40	1.52
J	金融业	60,604,507.60	38.06
K	房地产业	6,686,004.00	4.20
L	租赁和商务服务业	1,424,016.00	0.89
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	144,190,840.84	90.55

#### 报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

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	-	-



C	制造业	254,135.00	0.16
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	-	-
J	金融业	-	-
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	254,135.00	0.16

### 5.2.2 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股票投资。

### 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

#### 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	601318	中国平安	220,500	12,916,890.00	8.11
2	600519	贵州茅台	10,216	7,472,595.36	4.69
3	600036	招商银行	209,900	5,549,756.00	3.48
4	000333	美的集团	93,900	4,903,458.00	3.08
5	000651	格力电器	98,000	4,620,700.00	2.90
6	601166	兴业银行	253,700	3,653,280.00	2.29
7	600887	伊利股份	123,700	3,451,230.00	2.17
8	600276	恒瑞医药	44,828	3,396,169.28	2.13
9	600016	民生银行	481,200	3,368,400.00	2.11
10	601328	交通银行	559,200	3,209,808.00	2.02

#### 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	600734	实达集团	37,100	254,135.00	0.16

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	5,000,500.00	3.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,075,000.00	3.19
	其中：政策性金融债	5,075,000.00	3.19
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,075,500.00	6.33

#### 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

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	018002	国开 1302	50,000	5,075,000.00	3.19
2	019571	17 国债 17	50,000	5,000,500.00	3.14

#### 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。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 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除招商银行(600036)、兴业银行(601166)以外，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。

根据 2018 年 5 月 4 日中国银行保险监督管理委员会执行处罚信息公开表(银监罚决字(2018)1 号)，对招商银行股份有限公司(下称招商银行，股票代码：600036)内控管理严重违反审慎经营规则、违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等十四项违规事实执行处罚决定，罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

根据 2018 年 5 月 4 日中国银行保险监督管理委员会执行处罚信息公开表(银保监银罚决字(2018)1 号)，对兴业银行股份有限公司(下称兴业银行，股票代码：601166)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产等十二项违规事实罚款 5870 万元。

基金管理人对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	64,675.85
2	应收证券清算款	661,578.65
3	应收股利	-
4	应收利息	297,377.41
5	应收申购款	154,471.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,178,103.30

### 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换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

**期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：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情况。

**期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

**§ 6 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	南方中证 100 指数 A 级	南方中证 100 指数 C 级
报告期期初基金份额总额	160,651,675.35	28,199.67
报告期期间基金总申购份额	9,012,089.96	508,499.06
减：报告期期间基金总赎回份额	7,887,243.89	207,037.51
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	161,776,521.42	329,661.22

**§ 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：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 影响投资者决策的其他重要信息****8.1 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**

注：无。

**§ 9 备查文件目录****9.1 备查文件目录**

1、《南方中证 100 指数证券投资基金基金合同》 2、《南方中证 100 指数证券投资基金托管协议》 3、南方中证 100 指数证券投资基金 2018 年第 2 季度报告原文

**9.2 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。

**9.3 查阅方式**

网站: <http://www.nffund.com>