

南方中证全指证券公司交易型开放式指数 证券投资基金 2018 年半年度报告(摘要)

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 27 日

重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 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。

本基金本报告期财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方中证全指证券 ETF
场内简称	证券基金
基金主代码	512900
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2017 年 3 月 10 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	521,206,000.00 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	2017 年 3 月 31 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“证券基金”。

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。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。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为中证全指证券公司指数。
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王永民
	联系电话	010-66594896
	电子邮箱	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	400-889-8899	95566
传真	0755-82763889	010-66594942

2.4 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

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(2018年01月01日-2018年06月30日)
本期已实现收益	-22,411,844.17
本期利润	-88,811,891.17
加权平均基金份额本期利润	-0.2051
本期基金份额净值增长率	-21.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2802
期末基金资产净值	375,164,753.12
期末基金份额净值	0.7198

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. 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(为期末余额,不是当期发生数)。

3. 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。

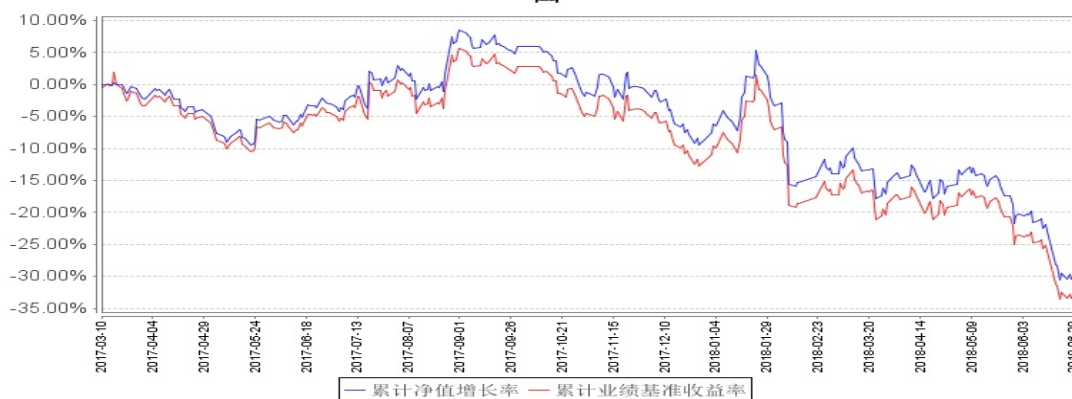
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	-9.44%	1.98%	-9.85%	1.96%	0.41%	0.02%
过去三个月	-15.43%	1.64%	-15.99%	1.64%	0.56%	0.00%
过去六个月	-21.00%	1.75%	-21.72%	1.75%	0.72%	0.00%
过去一年	-25.75%	1.53%	-28.02%	1.53%	2.27%	0.00%
自基金合同生效起至今	-28.02%	1.39%	-31.28%	1.40%	3.26%	-0.01%

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

南方中证全指证券ETF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，注册资本金3亿元人民币。目前股权结构：华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，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）管理资产规模近7,800亿元，旗下管理167只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企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		
孙伟	本基金基金经理	2017年3月10日	—	8	管理学学士，具有基金从业资格、金融分析师（CFA）资格、注册会计师（CPA）资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010年2月加入南方基金，历任运作

				保障部基金会计、量化投资部量化投资研究员；2014 年 12 月至 2015 年 5 月，担任南方恒生 ETF 的基金经理助理；2015 年 5 月至 2016 年 7 月，任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 7 月至今，任改革基金、高铁基金、500 信息基金经理；2016 年 5 月至今，任南方创业板 ETF、南方创业板 ETF 联接基金经理；2016 年 8 月至今，任 500 信息联接、深成 ETF、南方深成基金经理；2017 年 3 月至今，任南方全指证券 ETF 联接、南方中证全指证券 ETF 基金经理；2017 年 6 月至今，任南方中证银行 ETF、南方银行联接基金经理；2018 年 2 月至今，任 H 股 ETF、南方 H 股联接基金经理。
--	--	--	--	--

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《南方中证全指证券公司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 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均未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期证券公司指数下跌 21.72%。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）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；（3）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。

4.4.2 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 0.7198 元，本报告期，份额净值增长率为-21.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来市场波动较大，有内外两方面原因：内部主要矛盾在于经济增长和金融风险释放的预期，外部重要因素在于中美贸易摩擦升级和人民币汇率贬值。我们认为，经济自身仍将保持良好的增长韧性，且管理层在财政和货币政策上会有适当的预调微调；人民币汇率下行压力有限，中美贸易摩擦常态化仍然是未来较长时间需要关注的重要变量。在“新结构市场”以及“新增资金机构化”的大背景下，预计基本面优秀和估值具有安全边际的公司将继续受到投资者青睐。

展望后市，我们认为，证券行业仍然是攻守兼备的中长期战略性投资品种：守的方面，当前证券公司指数估值 1.2 倍左右的市净率，几乎处于指数发布以来的历史最低水平，加之证券行业资产质量高，净资产回报率持续为正的特点，具有显著安全边际；攻的方面看，证券行业在熊市后期较为抗跌，在牛市到来时启动早，业绩和估值叠加往往催生大幅上涨，15 年牛市为例，彼时高点相比 14 年行情启动前上涨 270%以上，市净率最高摸至 5 倍以上，以史为鉴，投资者可考虑采用定投等分散化投资方式布局，静候市场情绪转暖。

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新准则、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。基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；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方式；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在南方中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，

完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：南方中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	4,180,284.38	607,665.97
结算备付金	166,945.55	249,829.27
存出保证金	32,536.30	62,296.69
交易性金融资产	373,799,841.53	326,486,855.27
其中：股票投资	373,799,841.53	326,486,855.27
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	155,989.10	22,730.40
应收利息	324.63	350.04
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-

资产总计	378,335,921.49	327,429,727.64
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2018年6月30日	2017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	2,226,633.15	96,343.30
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	163,197.73	136,302.78
应付托管费	32,639.55	27,260.55
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	12,537.84	13,170.55
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	736,160.10	426,194.76
负债合计	3,171,168.37	699,271.94
所有者权益:		
实收基金	521,206,000.00	358,606,000.00
未分配利润	-146,041,246.88	-31,875,544.30
所有者权益合计	375,164,753.12	326,730,455.70
负债和所有者权益总计	378,335,921.49	327,429,727.64

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7198 元，基金份额总额 521,206,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：南方中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年03月10日（基金合同 生效日）至2017年06月 30日
一、收入	-87,256,509.70	-33,992,960.93
1. 利息收入	7,202.13	891,696.52
其中：存款利息收入	7,079.83	617,821.49
债券利息收入	122.30	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	273,875.03

其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-21,210,749.19	-16,145,041.59
其中：股票投资收益	-22,873,883.14	-20,330,869.63
基金投资收益	-	-
债券投资收益	66,756.70	-
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	1,596,377.25	4,185,828.04
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-66,400,047.00	-18,840,723.78
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	347,084.36	101,107.92
减：二、费用	1,555,381.47	2,196,664.96
1. 管理人报酬	913,355.93	1,268,464.92
2. 托管费	182,671.18	253,692.97
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	148,831.70	469,856.99
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	310,522.66	204,650.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-88,811,891.17	-36,189,625.89
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-88,811,891.17	-36,189,625.89

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 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）	358,606,000.00	-31,875,544.30	326,730,455.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-88,811,891.17	-88,811,891.17
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）	162,600,000.00	-25,353,811.41	137,246,188.59
其中：1. 基金申购款	430,200,000.00	-53,971,984.89	376,228,015.11

2. 基金赎回款	-267,600,000.00	28,618,173.48	-238,981,826.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	521,206,000.00	-146,041,246.88	375,164,753.12
项目	上年度可比期间 2017年03月10日（基金合同生效日）至2017年06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）	1,197,106,000.00	-	1,197,106,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-36,189,625.89	-36,189,625.89
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）	-557,100,000.00	16,636,763.37	-540,463,236.63
其中：1. 基金申购款	83,700,000.00	-1,960,644.56	81,739,355.44
2. 基金赎回款	-640,800,000.00	18,597,407.93	-622,202,592.07
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）	640,006,000.00	-19,552,862.52	620,453,137.48

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 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 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税

[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(d) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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
南方中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“南方中证全指证券公司 ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》，公司名称由“南方基金管理有限公司”变更为“南方基金管理股份有限公司”，公司股权结构等事项未发生变化，并已于 2018 年 1 月 4 日在深圳市市场监督管理局完成相应变更登记手续。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.5.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 03 月 10 日（基金合同生效日） 至 2017 年 06 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	11,812,089.58	4.81	789,309,747.87	54.75

6.4.5.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 03 月 10 日（基金合同生效日） 至 2017 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）
华泰证券	-	-	300,000,000.00	100.00

6.4.5.1.3 权证交易

无。

6.4.5.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
华泰证券	1,181.25	4.81	543.27	4.33
关联方名称	上年度可比期间 2017年03月10日（基金合同生效日）至 2017年06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	78,930.98	54.75	207.31	0.32

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年03月10日（基金合同生 效日）至 2017年06月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	913,355.93
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人南方基金的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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年03月10日（基金合同生 效日）至 2017年06月30日

当期发生的基金应支付的托管费	182,671.18	253,692.97
----------------	------------	------------

注：支付基金托管人中国银行的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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

6.4.5.2.3 销售服务费

无。

6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期内未运用固有资金投资本基金。

6.4.5.4.2 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

无。

6.4.5.5 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 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 03 月 10 日（基金合同生效日） 至 2017 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	4,180,284.38	4,752.05	1,705,619.81	308,307.44

注：本基金由基金托管人中国银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

1. 于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有 1,627,059.00 股华泰证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 29,791,438.92 元，估值总额为人民币 24,357,073.23 元，占基金资产净值的比例为 6.49%。

2. 于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有 2,312,420.00 股兴业证券的 A 股普通股，成本总额为人民

币 16,303,576.67 元, 估值总额为人民币 12,186,453.40 元, 占基金资产净值的比例为 3.25%。

6.4.6 利润分配情况

无。

6.4.7 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.7.1 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
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新股认购	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股认购	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-

6.4.7.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

§ 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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	373,799,841.53	98.80
	其中: 股票	373,799,841.53	98.80
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	4,347,229.93	1.15
8	其他各项资产	188,850.03	0.05
9	合计	378,335,921.49	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。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	373,502,042.80	99.56
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	373,502,042.80	99.56

7.2.2 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	采矿业	-	-
C	制造业	191,454.74	0.05

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,103.85	0.01
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	81,226.14	0.02
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	295,784.73	0.08

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 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

7.3.1 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股票投资明细

金额单位：人民币元

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	600030	中信证券	3,314,867	54,927,346.19	14.64
2	600837	海通证券	4,028,898	38,153,664.06	10.17
3	601211	国泰君安	1,871,272	27,582,549.28	7.35
4	601688	华泰证券	1,627,059	24,357,073.23	6.49
5	000776	广发证券	1,468,581	19,488,069.87	5.19
6	600958	东方证券	1,783,757	16,285,701.41	4.34
7	600999	招商证券	1,137,717	15,563,968.56	4.15
8	000166	申万宏源	3,367,600	14,716,412.00	3.92
9	601901	方正证券	2,044,912	13,680,461.28	3.65

10	601377	兴业证券	2,312,420	12,186,453.40	3.25
----	--------	------	-----------	---------------	------

注：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> 的年度报告正文。

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前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

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	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.03
2	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.02
3	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.01
4	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.01
5	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	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	000776	广发证券	22,061,973.00	6.75
2	000166	申万宏源	15,238,042.78	4.66
3	000783	长江证券	12,016,962.80	3.68
4	002736	国信证券	11,586,385.64	3.55
5	000728	国元证券	8,456,550.70	2.59
6	002673	西部证券	7,739,926.94	2.37
7	002797	第一创业	7,582,525.24	2.32
8	002500	山西证券	6,038,767.90	1.85
9	000750	国海证券	5,904,254.94	1.81
10	000686	东北证券	4,819,620.49	1.48
11	002670	国盛金控	4,754,674.74	1.46
12	601901	方正证券	4,039,191.53	1.24
13	600958	东方证券	3,585,078.70	1.10
14	601881	中国银河	2,920,792.00	0.89
15	600837	海通证券	2,570,060.00	0.79
16	601108	财通证券	2,516,777.00	0.77
17	000712	锦龙股份	2,460,397.59	0.75
18	600909	华安证券	2,376,616.00	0.73
19	601198	东兴证券	2,341,712.00	0.72
20	600030	中信证券	1,949,101.00	0.60

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	000776	广发证券	14,746,707.61	4.51
2	600030	中信证券	12,678,873.74	3.88
3	000166	申万宏源	9,368,521.21	2.87
4	000783	长江证券	7,724,418.00	2.36
5	002736	国信证券	7,535,204.56	2.31
6	000728	国元证券	5,623,769.50	1.72
7	002797	第一创业	5,062,984.20	1.55
8	002673	西部证券	5,049,181.14	1.55
9	002500	山西证券	4,039,786.00	1.24
10	000750	国海证券	3,895,692.00	1.19
11	002670	国盛金控	3,472,500.60	1.06
12	000686	东北证券	3,128,613.48	0.96
13	600837	海通证券	2,239,868.99	0.69
14	601688	华泰证券	1,872,271.34	0.57
15	000712	锦龙股份	1,456,765.95	0.45
16	601211	国泰君安	1,452,984.00	0.44
17	600999	招商证券	1,115,873.71	0.34
18	000987	越秀金控	1,058,683.00	0.32
19	601377	兴业证券	843,020.00	0.26
20	600958	东方证券	809,834.00	0.25

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	145,005,799.19
卖出股票收入（成交）总额	102,462,528.31

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.10.1 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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收到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体除方正证券(601901)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 3 月 29 日上海证券交易所网站披露《关于对方正证券股份有限公司和有关责任人予以纪律处分的决定》，公开谴责及通报批评方正证券股份有限公司（下称方正证券，股票代码：601901）存在信息披露虚假记载及重大遗漏情况，分别涉及两方面。一是公司控股股东方正集团和相关关联方隐瞒关联关系，方正证券未履行信息披露义务，二是公司控股股东方正集团未及时告知公司签署补充协议的相关情况，方正证券未履行信息披露义务。根据《股票上市规则》和《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》的有关规定，上海证券交易所给予相关责任人公开谴责及通报批评的决定。

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。

7.12.2 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

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。

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
1	存出保证金	32,536.30
2	应收证券清算款	155,989.10
3	应收股利	-
4	应收利息	324.63
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	188,850.03

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的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	公司名称	流通受限部分的公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603706	东方环宇	23,103.85	0.01	新股锁定
2	603105	芯能科技	16,470.30	0.00	新股锁定

§ 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		中国银行股份有限公司-南方中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)

4,190	124,392.84	8,065,490.00	1.55	187,317,510.00	35.94	325,823,000.00	62.51
-------	------------	--------------	------	----------------	-------	----------------	-------

注：户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

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	杜巍	4,600,000.00	0.88
2	方正证券股份有限公司	2,283,024.00	0.44
3	朱妍霖	1,999,000.00	0.38
4	孙丽华	1,667,900.00	0.32
5	冯俊杰	1,576,000.00	0.30
6	国信证券股份有限公司	1,500,000.00	0.29
7	柳宗荣	1,400,000.00	0.27
8	王君华	1,300,600.00	0.25
9	丁碧霞	1,293,000.00	0.25
10	贾国文	1,200,000.00	0.23
	中国银行股份有限公司—南方中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金	325,823,000.00	62.51

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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

期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	358,606,000.00
本报告期基金总申购份额	430,200,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	267,600,000.00
本报告期期末基金份额总额	521,206,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

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，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

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、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	
安信证券	1	168,168,314.08	68.50%	16,818.63	68.50%	-
中泰证券	2	65,520,810.49	26.69%	6,551.46	26.69%	-
华泰证券	1	11,812,089.58	4.81%	1,181.25	4.81%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
广发证券	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
安信证券	1,866,879.00	100.00%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	20180101-20180630	147,563,400.00	243,059,600.00	64,800,000.00	325,823,000.00	62.51
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。