

中证南方小康产业交易型开放式指数 证券投资基金联接基金 2019 年半年度 报告摘要

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---------------|----------------------------|--------|
| 基金名称 | 中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | |
| 基金简称 | 南方小康 ETF 联接 | |
| 基金主代码 | 202021 | |
| 交易代码 | 202021 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2010 年 8 月 27 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 | |
| 报告期末基金份额总额 | 484,703,466.43 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 南方小康 A | 南方小康 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 202021 | 004346 |
| 下属分级基金的前端交易代码 | 202021 | 004346 |
| 下属分级基金的后端交易代码 | 202022 | |

| | | |
|---------------------|------------------|----------------|
| 报告期末下属分级基金的份 额总额 | 483,331,835.94 份 | 1,371,630.49 份 |
|---------------------|------------------|----------------|

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“南方小康”。

2.1.1 目标基金基本情况

| | |
|--------------|----------------------------|
| 基金名称 | 中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资 基金 |
| 基金主代码 | 510160 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式（ETF） |
| 基金合同生效日 | 2010 年 8 月 27 日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2010 年 11 月 1 日 |
| 基金管理人名称 | 南方基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中国工商银行股份有限公司 |

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“小康 ETF”。

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 通过投资于小康 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为完全被动式指数基金，以小康 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资小康 ETF。本基金并不参与小康 ETF 的管理。为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于小康 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、非成份股、新股、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 |
| 业绩比较基准 | 中证南方小康产业指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金属股票基金，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。同时本基金为指数型基金，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。 |

2.2.1 目标基金产品说明

| | |
|------|---|
| 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 | 本基金为完全被动式指数基金，原则上采用完全复制法，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，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。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，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。 |
| 业绩比较基准 | 本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证南方小康产业指数，简称小康指数。如果指数编制单位变更或停止中证南方小康产业指数的编制、发布或授权，或中证南方小康产业指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为中证南方小康产业指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。 |
| 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。本基金为指数型基金，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、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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 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 | 95588 |
| 传真 | 0755-82763889 | 010-66105798 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|-----------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 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 |

§ 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

1、南方小康 A

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 | -11,300,784.48 |
| 本期利润 | 87,640,489.06 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1734 |
| 本期基金份额净值增长率 | 15.41% |

| | |
|---------------|------------------|
| 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 | -0.1514 |
| 期末基金资产净值 | 592,299,936.22 |
| 期末基金份额净值 | 1.2255 |

2、南方小康 C

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 | -470,282.14 |
| 本期利润 | -1,328,978.80 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0494 |
| 本期基金份额净值增长率 | 15.34% |
| 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 | -0.1607 |
| 期末基金资产净值 | 1,669,025.34 |
| 期末基金份额净值 | 1.2168 |

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；

4、本基金从 2017 年 2 月 23 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2017 年 2 月 28 日起存续。

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

南方小康 A

| 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 | 4.65% | 0.93% | 4.15% | 0.93% | 0.50% | 0.00% |
| 过去三个月 | -3.14% | 1.40% | -4.24% | 1.40% | 1.10% | 0.00% |
| 过去六个月 | 15.41% | 1.42% | 14.17% | 1.43% | 1.24% | -0.01% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去一年 | 6.09% | 1.37% | 3.94% | 1.37% | 2.15% | 0.00% |
| 过去三年 | 25.15% | 1.02% | 19.97% | 1.03% | 5.18% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 24.98% | 1.43% | 33.10% | 1.47% | -8.12% | -0.04% |

南方小康 C

| 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 | 4.62% | 0.93% | 4.15% | 0.93% | 0.47% | 0.00% |
| 过去三个月 | -3.11% | 1.39% | -4.24% | 1.40% | 1.13% | -0.01% |
| 过去六个月 | 15.34% | 1.42% | 14.17% | 1.43% | 1.17% | -0.01% |
| 过去一年 | 5.82% | 1.37% | 3.94% | 1.37% | 1.88% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.37% | 1.07% | -3.60% | 1.07% | 2.23% | 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

南方小康A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



南方小康C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、本基金从 2017 年 2 月 23 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2017 年 2 月 28 日起存续。

§ 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 | | |
| 周豪 | 本基金基金经理 | 2016 年 8 月 19 日 | - | 10 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；2018 年 2 月至 2018 年 11 月，任南方消费活力基金经理；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。 |

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；

3、本基金管理人于 2019 年 7 月 13 日发布公告，原基金经理周豪先生不在担任本基金基金经理，崔蕾女士、龚涛先生为本基金新任基金经理。

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，两两组合同单日、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

本报告期内小康指数上涨 14.89%。

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) 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）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) 根据指数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 A 份额净值为 1.2255 元，报告期内，份额净值增长率为 15.41%，同期业绩基准增长率为 14.17%；本基金 C 份额净值为 1.2168 元，报告期内，份额净值增长率为 15.34%，同期业绩基准增长率为 14.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着 A 股国际化的不断推进，外资持续流入国内，A 股市场相继被纳入 MSCI 和富时罗素指数，长远来看，市场风格将有望逐渐向外资偏好的价值蓝筹风格靠拢，预计 2019 年下半年，基本面较好的白马股仍存在机会。小康指数的编制方式基于财务指标，力求在经济下行的情况下挖掘出优质价值股，同时捕捉代表基础产业、先进制造业和现代服务业的发展势头。在国内经济仍以供给侧改革为主线的背景下，小康指数有望继续紧跟国家经济发展的方向，分享相应的产业成长红利。

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，每一基金份额享有同等分配权；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合相关基金分红条件的前提下，本基金收益分配每年最多 6 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金分红或将现金分红按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；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

本报告期内，本基金托管人在对中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，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，中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、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，中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接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中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金 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：中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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 | 10,461,729.65 | 12,503,377.34 |

| | | |
|-----------|---------------------|-----------------------|
| 结算备付金 | 48,715.49 | 8,224.79 |
| 存出保证金 | 38,076.10 | 12,239.93 |
| 交易性金融资产 | 583,697,174.78 | 567,205,000.19 |
| 其中：股票投资 | 10,041,301.70 | 18,926,128.19 |
| 基金投资 | 553,112,325.08 | 530,238,672.00 |
| 债券投资 | 20,543,548.00 | 18,040,200.00 |
| 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 | 353,397.77 | 807,119.04 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 57,294.81 | 121,264.50 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 594,656,388.60 | 580,657,225.79 |
| 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 | 0.88 | - |
| 应付赎回款 | 565,951.03 | 256,124.89 |
| 应付管理人报酬 | 17,999.50 | 21,380.64 |
| 应付托管费 | 3,599.88 | 4,276.10 |
| 应付销售服务费 | 548.80 | 6,972.44 |
| 应付交易费用 | 8,762.83 | 1,541.99 |
| 应交税费 | 0.01 | 8,410.19 |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |

| | | |
|------------|----------------|----------------|
| 其他负债 | 90,564.11 | 361,035.00 |
| 负债合计 | 687,427.04 | 659,741.25 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 484,703,466.43 | 546,324,746.04 |
| 未分配利润 | 109,265,495.13 | 33,672,738.50 |
| 所有者权益合计 | 593,968,961.56 | 579,997,484.54 |
| 负债和所有者权益总计 | 594,656,388.60 | 580,657,225.79 |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，南方小康 A 份额净值 1.2255 元，基金份额总额 483,331,835.94 份；南方小康 C 份额净值 1.2168 元，基金份额总额 1,371,630.49 份；总份额合计 484,703,466.43 份。

6.2 利润表

会计主体：中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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 | 86,754,899.82 | -106,600,558.67 |
| 1. 利息收入 | 294,737.84 | 368,377.12 |
| 其中：存款利息收入 | 65,732.05 | 109,177.12 |
| 债券利息收入 | 229,005.79 | 259,200.00 |
| 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） | -11,667,514.64 | -3,640,006.85 |
| 其中：股票投资收益 | 1,509,892.30 | -697,363.68 |
| 基金投资收益 | -13,123,684.03 | -3,001,844.47 |
| 债券投资收益 | -202,711.45 | - |
| 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 | 148,988.54 | 59,201.30 |

| | | |
|------------------------|---------------|-----------------|
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 98,082,576.88 | -103,454,102.68 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 45,099.74 | 125,173.74 |
| 减：二、费用 | 443,389.56 | 412,677.13 |
| 1. 管理人报酬 | 117,387.63 | 110,558.79 |
| 2. 托管费 | 23,477.49 | 22,111.77 |
| 3. 销售服务费 | 64,444.66 | 3,138.04 |
| 4. 交易费用 | 148,255.78 | 86,787.61 |
| 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 | 89,824.00 | 190,080.92 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 86,311,510.26 | -107,013,235.80 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 86,311,510.26 | -107,013,235.80 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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） | 546,324,746.04 | 33,672,738.50 | 579,997,484.54 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 86,311,510.26 | 86,311,510.26 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变 | -61,621,279.61 | -10,718,753.63 | -72,340,033.24 |

| | | | |
|--|---|-----------------|-----------------|
| 动数（净值减少以“—”号填列） | | | |
| 其中：1. 基金申购款 | 54,827,137.26 | 12,967,086.76 | 67,794,224.02 |
| 2. 基金赎回款 | -116,448,416.87 | -23,685,840.39 | -140,134,257.26 |
| 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） | 484,703,466.43 | 109,265,495.13 | 593,968,961.56 |
| 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） | 612,078,655.51 | 215,864,394.74 | 827,943,050.25 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -107,013,235.80 | -107,013,235.80 |
| 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） | -76,559,620.31 | -25,772,900.41 | -102,332,520.72 |
| 其中：1. 基金申购款 | 55,003,463.22 | 17,819,158.42 | 72,822,621.64 |
| 2. 基金赎回款 | -131,563,083.53 | -43,592,058.83 | -175,155,142.36 |
| 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） | 535,519,035.20 | 83,078,258.53 | 618,597,293.73 |

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 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 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 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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。

6.4.4 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、登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 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 |
| 中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金(“目标 ETF”) | 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。

6.4.5 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 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 | 153,697,920.92 | 100.00% | 72,566,219.59 | 100.00% |

6.4.5.1.2 基金交易

| 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 | 占当期基金成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 华泰证券 | 105,203,187.10 | 100.00% | - | - |

本报告期内基金成交金额中基金申购赎回 105203187.10 元，基金二级市场买卖 0.00 元。

6.4.5.1.3 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。

6.4.5.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 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 | 15,370.26 | 100.00% | 8,762.83 | 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 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 华泰证券 | 7,257.09 | 100.00% | 2,768.74 | 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。

6.4.5.2 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 2019 年 1 月 1 日至 | 上年度可比期间 2018 年 |
|----|--------------------|----------------|
|----|--------------------|----------------|

| | 2019 年 6 月 30 日 | 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 | 117,387.63 | 110,558.79 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 261,039.10 | 592,350.45 |

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，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扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.50% 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 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 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 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 | 23,477.49 | 22,111.77 |

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.10% 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 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 0.10% / 当年天数。

6.4.5.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | | |
|----------------|---|-----------|-----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 南方小康 A | 南方小康 C | 合计 |
| 工商银行 | - | 188.23 | 188.23 |
| 华泰证券 | - | 16.20 | 16.20 |
| 南方基金 | - | 62,566.02 | 62,566.02 |
| 合计 | - | 62,770.45 | 62,770.45 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 南方小康 A | 南方小康 C | 合计 |
| 华泰证券 | - | 14.48 | 14.48 |
| 工商银行 | - | 178.34 | 178.34 |
| 南方基金 | - | 1,311.85 | 1,311.85 |

| | | | |
|----|---|----------|----------|
| 合计 | - | 1,504.67 | 1,504.67 |
|----|---|----------|----------|

本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取销售服务费，支付 C 类基金份额销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数，则取零)的 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

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

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。

6.4.5.4 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

无。

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 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 | 10,461,729.65 | 64,847.16 | 22,456,177.66 | 108,417.01 |

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。

6.4.5.6 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。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

6.4.5.7.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 992,663,900.00 份目标 ETF 基金份额(2018 年 12 月 31 日：1,104,663,900 份)，占其份额的比例为 93.47%(2018 年 12 月 31 日：93.14%)。

6.4.6 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.7 期末（2019 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 |
| 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 | - |

6.4.7.2 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。

6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.7.3.1 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。

6.4.7.3.2 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（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 10,041,301.70 | 1.69 |
| | 其中：股票 | 10,041,301.70 | 1.69 |
| 2 | 基金投资 | 553,112,325.08 | 93.01 |
| 3 | 固定收益投资 | 20,543,548.00 | 3.45 |
| | 其中：债券 | 20,543,548.00 | 3.45 |
| | 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 | 10,510,445.14 | 1.77 |
| 8 | 其他资产 | 448,768.68 | 0.08 |
| 9 | 合计 | 594,656,388.60 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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 | 1,038,838.85 | 0.17 |
| C | 制造业 | 3,712,761.77 | 0.63 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 769,070.00 | 0.13 |
| E | 建筑业 | 1,055,701.20 | 0.18 |
| F | 批发和零售业 | 373,327.30 | 0.06 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 378,658.00 | 0.06 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 670,076.56 | 0.11 |
| J | 金融业 | 1,566,503.02 | 0.26 |
| K | 房地产业 | 393,295.00 | 0.07 |
| L | 租赁和商务服务业 | 83,070.00 | 0.01 |
| 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 | 10,041,301.70 | 1.69 |

7.2.2 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前十名股票投资明细

金额单位：

| 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 | 600050 | 中国联通 | 86,084 | 530,277.44 | 0.09 |
| 2 | 600019 | 宝钢股份 | 69,784 | 453,596.00 | 0.08 |
| 3 | 600968 | 海油发展 | 102,375 | 363,431.25 | 0.06 |
| 4 | 600887 | 伊利股份 | 8,902 | 297,415.82 | 0.05 |
| 5 | 600690 | 海尔智家 | 16,700 | 288,743.00 | 0.05 |
| 6 | 601186 | 中国铁建 | 28,300 | 281,585.00 | 0.05 |
| 7 | 600795 | 国电电力 | 106,900 | 271,526.00 | 0.05 |
| 8 | 601390 | 中国中铁 | 40,300 | 262,756.00 | 0.04 |
| 9 | 600585 | 海螺水泥 | 6,236 | 258,794.00 | 0.04 |
| 10 | 600741 | 华域汽车 | 10,898 | 235,396.80 | 0.04 |

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> 的半年度报告正文。

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 | 600050 | 中国联通 | 2,651,420.00 | 0.46 |
| 2 | 600019 | 宝钢股份 | 1,824,948.00 | 0.31 |
| 3 | 600887 | 伊利股份 | 1,169,936.66 | 0.20 |
| 4 | 600690 | 海尔智家 | 1,164,945.00 | 0.20 |
| 5 | 600795 | 国电电力 | 1,140,331.00 | 0.20 |
| 6 | 601186 | 中国铁建 | 1,137,166.00 | 0.20 |
| 7 | 601390 | 中国中铁 | 1,061,610.00 | 0.18 |
| 8 | 600585 | 海螺水泥 | 934,186.00 | 0.16 |
| 9 | 600741 | 华域汽车 | 931,304.00 | 0.16 |
| 10 | 601600 | 中国铝业 | 859,078.00 | 0.15 |
| 11 | 600011 | 华能国际 | 800,153.00 | 0.14 |
| 12 | 600886 | 国投电力 | 767,856.00 | 0.13 |
| 13 | 600309 | 万华化学 | 734,493.00 | 0.13 |
| 14 | 600362 | 江西铜业 | 689,427.00 | 0.12 |
| 15 | 600030 | 中信证券 | 671,053.00 | 0.12 |
| 16 | 601669 | 中国电建 | 668,198.00 | 0.12 |
| 17 | 601169 | 北京银行 | 662,762.00 | 0.11 |
| 18 | 601607 | 上海医药 | 643,240.00 | 0.11 |
| 19 | 600048 | 保利地产 | 635,283.00 | 0.11 |
| 20 | 601899 | 紫金矿业 | 629,020.00 | 0.11 |

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 | 600050 | 中国联通 | 6,975,468.00 | 1.20 |
| 2 | 600019 | 宝钢股份 | 4,805,629.00 | 0.83 |
| 3 | 600887 | 伊利股份 | 3,650,535.00 | 0.63 |
| 4 | 600690 | 海尔智家 | 3,390,007.00 | 0.58 |
| 5 | 600795 | 国电电力 | 3,149,218.92 | 0.54 |
| 6 | 600585 | 海螺水泥 | 3,082,705.00 | 0.53 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 7 | 601186 | 中国铁建 | 2,844,810.00 | 0.49 |
| 8 | 601390 | 中国中铁 | 2,786,242.00 | 0.48 |
| 9 | 600741 | 华域汽车 | 2,737,028.16 | 0.47 |
| 10 | 601600 | 中国铝业 | 2,469,087.00 | 0.43 |
| 11 | 600886 | 国投电力 | 2,187,849.00 | 0.38 |
| 12 | 600309 | 万华化学 | 2,181,794.65 | 0.38 |
| 13 | 600011 | 华能国际 | 2,170,777.00 | 0.37 |
| 14 | 600362 | 江西铜业 | 1,986,412.00 | 0.34 |
| 15 | 600352 | 浙江龙盛 | 1,923,751.00 | 0.33 |
| 16 | 601169 | 北京银行 | 1,848,545.00 | 0.32 |
| 17 | 600030 | 中信证券 | 1,807,746.00 | 0.31 |
| 18 | 601607 | 上海医药 | 1,744,195.00 | 0.30 |
| 19 | 600048 | 保利地产 | 1,722,619.00 | 0.30 |
| 20 | 601899 | 紫金矿业 | 1,666,889.00 | 0.29 |

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 | 40,965,708.93 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 113,568,344.26 |

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 | 19,995,000.00 | 3.37 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 548,548.00 | 0.09 |
| | 其中：政策性金融债 | 548,548.00 | 0.09 |
| 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 | 20,543,548.00 | 3.46 |

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 | 019544 | 16 国债 16 | 110,000 | 11,002,200.00 | 1.85 |
| 2 | 019611 | 19 国债 01 | 90,000 | 8,992,800.00 | 1.51 |
| 3 | 108901 | 农发 1801 | 5,480 | 548,548.00 | 0.09 |

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 本报告期投资基金情况

7.10.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------|------|--------|--------------|----------------|--------------|
| 1 | 南方中证小康 ETF | 股票型 | 交易型开放式 | 南方基金管理股份有限公司 | 553,112,325.08 | 93.12 |

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

无。

7.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.12.3 本期国债期货投资评价

无。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 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。

7.13.3 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 | 38,076.10 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 353,397.77 |
| 5 | 应收申购款 | 57,294.81 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 448,768.68 |

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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

| 份额级别 | 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 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 南方小康 A | 46,560 | 10,380.84 | 7,534,077.67 | 1.56% | 475,797,758.27 | 98.44% |
| 南方小康 C | 312 | 4,396.25 | - | - | 1,371,630.49 | 100.00% |
| 合计 | 46,872 | 10,341.00 | 7,534,077.67 | 1.55% | 477,169,388.76 | 98.45% |

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 南方小康 A | 532,115.31 | 0.1101% |
| | 南方小康 C | 395.56 | 0.0288% |
| | 合计 | 532,510.87 | 0.1099% |

注：分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 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

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------|--------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 南方小康 A | 10~50 |
| | 南方小康 C | 0 |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 南方小康 A | 0 |
| | 南方小康 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 南方小康 A | 南方小康 C |
|--------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日(2010 年 8 月 27 日)基金份额总额 | 899,612,348.46 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 527,249,510.91 | 19,075,235.13 |
| 本报告期基金总申购份额 | 21,801,021.18 | 33,026,116.08 |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 65,718,696.15 | 50,729,720.72 |
| 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 | 483,331,835.94 | 1,371,630.49 |

§ 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。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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 | 2 | 153,697,920.92 | 100.00% | 15,370.26 | 100.00% | - |
| 申万宏源 | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 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 | | 基金交易 | |
|------|------|--------------|--------|--------------|------|--------------|------|--------------|
| | 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 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |

| | | | | 比例 | | | | | |
|------|---------------|---------|---|----|---|---|----------------|---------|--|
| 华泰证券 | 20,555,465.60 | 100.00% | - | - | - | - | 105,203,187.10 | 100.00% | |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| 湘财证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | |

§ 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。