

南方中证全指房地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

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

送出日期:2018年08月27日

§1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年08月22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。

报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至2018年6月30日止。 §2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方中证全指房地产交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	512000
基金运作方式	交易型开放式(ETP)
基金合同生效日	2017-01-05
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
报告期截至日	2018-06-30
基金合同存续期	不长期
下一级基金的基金合同简称	南方房地产基金
南方房地产基金的代码	500043
报告期下一级基金的净值	0.0043
报告期下一级基金的份额	10,476,000.00份
报告期下一级基金的份额净值	11.13/0.0043份

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“南方房地产”。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	南方中证全指房地产交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	512000
基金运作方式	交易型开放式(ETP)
基金合同生效日	2017-01-05
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
报告期截至日	2018-06-30
基金合同存续期	不长期
下一级基金的基金合同简称	南方房地产基金
南方房地产基金的代码	500043
报告期下一级基金的净值	0.0043
报告期下一级基金的份额	10,476,000.00份
报告期下一级基金的份额净值	11.13/0.0043份

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“南方房地产”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于南方ETP,紧密跟踪标的指数,追求与指数基本走势一致的回报。
投资策略	本基金通过投资于南方ETP,紧密跟踪标的指数,追求与指数基本走势一致的回报。
投资范围	本基金的投资范围为在深圳证券交易所上市交易的南方中证全指房地产交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“南方房地产”)
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险收益特征与南方房地产一致。本基金通过投资于南方房地产,追求与指数基本走势一致的回报。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求与指数基本走势一致的回报。
投资策略	本基金通过投资于南方ETP,紧密跟踪标的指数,追求与指数基本走势一致的回报。
投资范围	本基金的投资范围为在深圳证券交易所上市交易的南方中证全指房地产交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“南方房地产”)
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险收益特征与南方房地产一致。本基金通过投资于南方房地产,追求与指数基本走势一致的回报。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人
名称	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
直销机构	南方官网(www.nffund.com)
电子邮箱	service@nffund.com
客户服务电话	400-888-0000
传真	020-85000000

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“南方房地产”。

2.4 信息披露方式

披露基金半年度报告的互联网站	http://www.nffund.com
基金半年度报告的公告页	南方基金管理有限公司

注:§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

序号	报告期	本期利润	利润总额	期初至报告期期末的利润总额	报告期利润占期初至报告期期末的利润总额的比例(%)
1	过去一个月	-630%	17.9%	-76.7%	0.0%
2	过去二个月	-166%	1.2%	-17.2%	1.0%
3	过去六个月	-172%	1.0%	-17.0%	1.0%
4	过去一年	-167%	1.0%	-16.8%	1.0%
5	成立以来	-167%	1.0%	-16.8%	1.0%

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)扣减相关费用后的余额,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.期初可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润之和已实现部分的孰低数,为本期余额,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,计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

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

南方房地产基金A	同期业绩比较基准
过去一个月	-630%
过去二个月	-166%
过去六个月	-172%
过去一年	-167%
成立以来	-167%

注:1.本基金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)扣减相关费用后的余额,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.期初可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润之和已实现部分的孰低数,为本期余额,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,计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.2 基金净值表现

3.2.3 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

南方房地产基金A	同期业绩比较基准
过去一个月	-630%
过去二个月	-166%
过去六个月	-172%
过去一年	-167%
成立以来	-167%

注:本基金合同于2017年8月24日生效,截至本报告期末基金成立未满一年;自基金成立日起6个月内为建仓期,建仓期间结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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1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%,深圳市广信资产有限公司15%及兴证证券股份有限公司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,南方东英是内地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8,000亿元,旗下管理17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(或基金经理助理)及基金经理助理简介

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

姓名	性别	任本基金的基金经理(或基金经理助理)日期	任本基金的基金经理(或基金经理助理)期限
罗文杰	男	2017年9月28日	-

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”为根据公司决定的解聘日期;对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

本基金报告期内,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、中国证监会令和南方中证全指房地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益。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,基金管理人严格执行《证券投资基金公司公平交易制度及流程》,完善交易监控和分析,公平对待旗下管理的所有基金。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金在交易所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,两组组合间单日、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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金在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

报告期内,全指地产指数跌18.92%。期间我们通过自建的“指数化交易系统”,“日内择时交易型”、“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,确保了本基金的安全运营。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,对此我们通过调低申购赎回价格,引起的成份股权重偏差离散度降低;(2) 报告期内跟踪误差归因分析进行了基金调仓,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,从实施结果来看,效果良好,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,本基金的A类份额净值为0