南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

2018年第三季度报告

基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月26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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24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2018年7月1日起至9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500ETF联接(LOF)	
场内简称	南方500	
基金主代码	160119	
基金运作方式	上市型开放式(LOF)	
基金合同生效日	2009年9月25日	
报告期末基金份额总额	5,357,442,988.12份	
投资目标	本基金通过投资于目标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,以中证500ETF作为其主要投资标的。为实现投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券及中国证监会允许本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%。	
业绩比较基准	中证500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,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,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	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	南方中证500ETF联接(LOF)A	南方中证500ETF联接(LOF)C
下属分级基金的场内简称	南方500	
下属分级基金的交易代码	160119	004348
下属分级基金的前端交易代码	160119	–
下属分级基金的后端交易代码	160120	–
报告期末下属分级基金的份额总额	4,289,714,516.59份	1,067,728,471.53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500"。

2.2 目标基金基本情况

基金名称	中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年2月6日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013年3月15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	中国农业银行股份有限公司

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"500ETF"。

2.3 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500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。

§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7月1日－2018年9月30日)	
	南方中证500ETF联接(LOF)A	南方中证500ETF联接(LOF)C
1.本期已实现收益	-29,076,812.23	-6,275,487.22
2.本期利润	-385,239,738.82	-49,720,269.99
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0912	-0.0656
4.期末基金资产净值	5,202,971,333.80	1,293,073,441.20
5.期末基金份额净值	1.2129	1.2111

注:1、上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;

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。

3.2 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

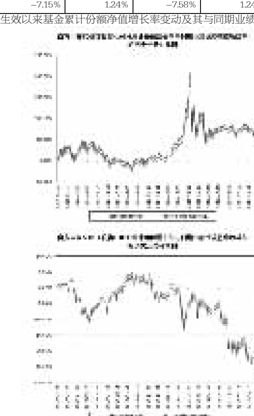
南方中证500ETF联接(LOF)A

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	-7.06%	1.24%	-7.58%	1.24%	0.52%	0.00%

南方中证500ETF联接(LOF)C

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	-7.15%	1.24%	-7.58%	1.24%	0.43%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效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



§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		
罗文杰	本基金基金经理	2013年4月22日	–	13年	女,美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士,具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行,从事量化分析工作。2008年9月加入南方基金,任南方基金数量化投资部基金经理助理。2013年4月起担任数量化投资部基金经理。现任指数投资部、数量化投资部总经理。2013年5月至2015年6月,任南方策略基金经理;2013年4月至今,任南方500、南方500ETF基金经理;2013年5月至今,任南方300、南方开元沪深300ETF基金经理;2014年10月至今,任500医药基金经理;2015年2月至今,任南方恒生ETF基金经理;2016年12月至今,任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理;2017年7月至今,任恒生联接基金经理;2017年8月至今,任南方房地产联接、南方房地产ETF基金经理;2017年11月至今,任南方策略、南方量化混合基金经理;2018年2月至今,任H股ETF、南方H股ETF联接基金经理;2018年4月至今,任MSCI基金基金经理;2018年6月至今,任MSCI联接基金经理。

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。

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 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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为4次,是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及投资组合的投资策略需要所致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,中证500指数跌7.99%。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) 大额申购赎回所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微小偏离;

(3) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离。

4.5 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1.2129元,报告期内,份额净值增长率为-7.06%,同期业绩基准增长率为-7.58%;本基金C份额净值为1.2111元,报告期内,份额净值增长率为-7.15%,同期业绩基准增长率为-7.58%。

4.6 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 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	156,253,360.69	2.39
	其中:股票	156,253,360.69	2.39
2	基金投资	6,006,863,308.26	92.06
3	固定收益投资	46,380,297.62	0.71
	其中:债券	46,380,297.62	0.71
	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	298,984,536.54	4.58
8	其他资产	16,469,973.69	0.25
9	合计	6,524,951,476.80	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

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	1,505,867.20	0.02
B	采矿业	5,076,567.37	0.08
C	制造业	93,813,291.12	1.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,928,362.41	0.08
E	建筑业	2,841,054.61	0.04
F	批发和零售业	7,238,401.81	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	5,334,015.49	0.08
H	住宿和餐饮业	610,784.55	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,455,304.25	0.22
J	金融业	4,089,799.80	0.06
K	房地产业	7,804,204.78	0.12
L	租赁和商务服务业	2,738,801.86	0.04
M	科学研究和技术服务业	254,595.06	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	1,116,591.73	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	119,523.80	0.00
Q	卫生和社会工作	264,135.24	0.00
R	文化、体育和娱乐业	2,828,197.53	0.04
S	综合	1,233,862.08	0.02
	合计	156,253,360.69	2.41

5.2.2 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投资股票。

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

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	000661	长春高新	7,180	1,701,660.00	0.03
2	000703	恒逸石化	61,037	1,034,577.15	0.02
3	000977	浪潮信息	40,900	984,872.00	0.02
4	000860	顺鑫农业	21,184	965,990.40	0.01
5	300146	汤臣倍健	46,600	955,300.00	0.01
6	002410	广联达	35,500	950,690.00	0.01
7	002179	中航光电	20,928	920,832.00	0.01
8	603019	中科曙光	19,000	890,720.00	0.01
9	600256	广汇能源	173,891	888,583.01	0.01
10	300253	卫宁健康	59,972	864,796.24	0.01

5.4 报告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	5,005,000.00	0.08
2	央行票据	–	–
3	金融债券	41,313,684.00	0.64
	其中:政策性金融债	41,313,684.00	0.64
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)	61,613.62	0.00
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	46,380,297.62	0.71

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	018002	国开1302	240,100	24,211,684.00	0.37
2	018005	国开1701	170,000	17,102,000.00	0.26
3	019592	18国债10	50,000	5,005,000.00	0.08
4	128038	利欧转债	570	47,714.70	0.00
5	113018	常熟转债	110	12,421.20	0.00

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

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

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	南方中证500ETF	股票型	交易型开放式	南方基金管理股份有限公司	6,006,863,308.26	92.47

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

无。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11.3 本期国债期货投资评价

无。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	424,212.04
2	应收证券清算款	519,272.91
3	应收股利	1,691.14
4	应收利息	1,465,080.73
5	应收申购款	12,285,630.05
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	1,774,086.82
9	合计	16,469,973.69

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128038	利欧转债	47,714.70	0.00
2	113018	常熟转债	12,421.20	0.00
3	128020	水晶转债	643.93	0.00
4	123004	铁汉转债	365.16	0.00
5	128027	崇达转债	358.29	0.00
6	128029	太阳转债	110.34	0.00

5.12.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	南方中证500ETF联接(LOF)A	南方中证500ETF联接(LOF)C
报告期期初基金份额总额	3,804,706,464.50	448,532,339.97
报告期期间基金总申购份额	749,288,454.43	789,762,521.64
减:报告期期间基金总赎回份额	264,280,402.34	170,566,390.08
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	4,289,714,516.59	1,067,728,471.53

§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

单位:份

项目	份额
报告期期初管理人持有的本基金份额	39,823,777.73
报告期期间买入/申购总份额	–
报告期期间卖出/赎回总份额	–
报告期期末管理人持有的本基金份额	39,823,777.73
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.74

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》;

2、《南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)托管协议》;

3、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)2018年3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

南方中证500量化增强股票型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司

报告送出日期:2018年10月26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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南方中证500增强发起式	
基金主代码	002906	
交易代码	002906	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年11月23日	
报告期末基金份额总额	421,394,627.09份	
投资目标	本基金为增强型股票指数基金,在力求对中证500指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过0.5%,年化跟踪误差不超过7.75%。	
投资策略	本基金利用量化投资模型,在控制组合跟踪误差的基础上,力求投资收益能够超越目标指数。	
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+1%	
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种,其预期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。	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	南方中证500增强A	南方中证500增强C
下属分级基金的交易代码	002906	002907
报告期末下属分级基金的份额总额	242,572,946.77份	178,821,680.32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"500量化增强"。

§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7月1日－2018年9月30日)	
	南方中证500增强A	南方中证500增强C
1.本期已实现收益	-11,945,410.13	-10,443,961.71
2.本期利润	-12,121,973.93	-9,930,517.67
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0575	-0.0585
4.期末基金资产净值	204,625,171.84	150,610,614.46
5.期末基金份额净值	0.844	0.842

1、上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;

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。

3.2 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500增强A

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	-6.43%	1.18%	-7.35%	1.24%	0.92%	-0.06%

南方中证500增强C

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	-6.55%	1.18%	-7.35%	1.24%	0.80%	-0.06%

3.2.2 自基金合同生效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

§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		
李佳亮	本基金基金经理	2016年11月23日	–	6年	美国南加州大学金融工程硕士,注册金融分析师(CFA),具有基金从业资格。2012年8月加入南方基金,任数量化投资部研究员;2015年5月至2016年8月,任量化投资部助理;2017年4月至2018年9月,任南方荣优基金经理;2016年8月至今,任南方消费基金经理;2016年11月至今,任南方中证500增强基金经理;2016年12月至今,任南方绝对收益基金经理;2017年11月至今,任大数据100、大数据300、南方量化成长基金经理。

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。

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 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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为4次,是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及投资组合的投资策略需要所致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年三季度,本基金投资以指数增强选股模型股票投资为主,辅以网下新股申购及少量中证500期货多头持有。指数增强股票投资部分:指数增强股票投资策略以南方基金量化指数增强投资模型为主,依托南方大数据量化平台,根据多因子模型,风格模型及风险模型生成投资组合进行股票投资,力争获取相对指数的超额收益。期货多头持有部分:持有少量中证500期货多头。

4.5 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0.844元,报告期内,份额净值增长率为-6.43%,同期业绩基准增长率为-7.35%;本基金C份额净值为0.842元,报告期内,份额净值增长率为-6.55%,同期业绩基准增长率为-7.35%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

不适用。

§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	321,679,606.34	90.11
	其中:股票	321,679,606.34	90.11
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	31,204,989.58	8.74
8	其他资产	4,087,255.62	1.14
9	合计	356,971,851.54	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	95,220.00	0.03
B	采矿业	20,614,090.40	5.80
C	制造业	135,085,912.52	38.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,697,527.96	1.60
E	建筑业	7,553,444.00	2.13
F	批发和零售业	18,885,698.29	5.32
G	交通运输、仓储和邮政业	13,043,721.11	3.67
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,148,204.53	9.05
J	金融业	12,401,207.68	3.49
K	房地产业	17,539,587.96	4.94
L	租赁和商务服务业	4,176,573.20	1.18
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	894,234.00	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	266.20	0.00
Q	卫生和社会工作	1,146,996.00	0.32
R	文化、体育和娱乐业	4,485,529.89	1.26
S	综合	1,229,600.00	0.35
	合计	274,997,813.74	77.41

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	采矿业	–	–
C	制造业	39,063,360.80	11.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,439,816.80	0.41
E	建筑业	697,835.60	0.20
F	批发和零售业	245,626.00	0.07
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	4,828,886.96	1.36
J	金融业	328.86	0.00
K	房地产业	209,341.86	0.06
L	租赁和商务服务业	359.72	0.00
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	196,236.00	0.06
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	46,681,792.60	13.14

5.2.3 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投资股票。

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	000553	沙隆达A	632,041	8,039,561.52	2.26
2	600366	宁波韵升	1,401,800	7,457,576.00	2.10
3	300039	上海凯宝	1,404,247	7,049,319.94	1.98
4	300297	蓝盾股份	1,009,000	6,800,660.00	1.91
5	000975	银泰资源	762,494	6,176,201.40	1.74
6	300026	红日药业	1,637,400	5,730,900.00	1.61
7	600184	光电股份	477,588	5,649,866.04	1.59
8	300418	昆仑万维	397,900	5,622,327.00	1.58
9	600611	大众交通	1,370,863	5,442,326.11	1.53
10	600545	卓郎智能	677,873	5,219,622.10	1.47

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	300427	红相股份	357,800	4,043,140.00	1.14
2	000666	经纬纺机	257,800	3,787,082.00	1.07
3	300099	精准信息	629,400	3,027,414.00	0.85
4	300440	运达科技	461,500	2,861,300.00	0.81
5	300268	佳沃股份	203,800	2,290,712.00	0.64

5.4 报告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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

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名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。

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

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名的前五名权证投资明细

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

金额单位:人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1810	IC1810	11	10,566,600.00	509,360.00	–
公允价值变动总额合计(元)					509,360.00
股指期货投资本期收益(元)					-1,787,800.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					1,208,960.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,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。

多头套期保值策略

本基金为指数增强基金,当指数期货大幅贴水时,可采用多头套期保值策略,即卖出部分股票持仓并买入指数期货的期货替代现货策略。持有至基差收敛,赚取期货与现货指数的价差,增强指数。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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。

报告期内基金投资的前十名证券除大众交通(证券代码600611)外其他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:

大众交通(证券代码600611)

该证券发行人于2018年7月27日发布公告称,因涉嫌违反《中华人民共和国证券法》、《上海证券交易所股票上市规则》等关于短线交易的相关规定,中国证监会对其立案调查。

对上述证券的投资决策程序的说明:本基金为指数型基金,因复制指数被动持有,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,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。

5.11.3 其他资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,283,133.52
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	6,523.85
5	应收申购款	1,797,598.25
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,087,255.62

5.11.4 报告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。

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

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的情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	000666	经纬纺机	3,787,082.00	1.07	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	南方中证500增强A	南方中证500增强C
报告期期初基金份额总额	177,671,251.62	163,379,517.70
报告期期间基金总申购份额	86,368,150.19	25,838,431.19
减:报告期期间基金总赎回份额	21,466,455.04	10,396,268.57
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	242,572,946.77	178,821,680.32

§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

单位:份

项目	份额
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,002,639.15
报告期期间买入/申购总份额	–
报告期期间卖出/赎回总份额	–
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,002,639.15
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.37

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,639.15	2.37	9,900,000.00	2.35	自合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	120,625.01	0.03	0.00	0.00	–
基金经理等人员	542,009.16	0.13	100,000.00	0.02	自合同生效之日起不少于3年
基金管理人股东	–	–	–	–	–
其他	–	–	–	–	–
合计	10,665,273.32	2.53	10,000,000.00	2.37	–

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	1	20180701-20180930	85,701,701.25	0.00	0.00	85,701,701.25	20.34%
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。							

申购份额包含红利再投资和份额折算。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、《南方中证500量化增强股票型发起式证券投资基金基金合同》;

2、《南方中证500量化增强股票型发起式证券投资基金托管协议》;

3、南方中证500量化增强股票型发起式证券投资基金2018年3季度报告原文。

10.2 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。

10.3 查阅方式

网站:http://www.nffund.com

南方中证500信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

2018年第三季度报告

基金管理人:南方基金管理股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月26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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24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2018年7月1日起至9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500信息ETF发起式联接	
基金主代码	002900	
交易代码	002900	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年8月17日	
报告期末基金份额总额	139,057,978.49份	
投资目标	本基金通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求与业绩比较基准相似的回报。	
投资策略	本基金以目标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目标ETF。本基金并不参与目标ETF的管理。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0.35%,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	本基金业绩比较基准为标的指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%。	
风险收益特征	本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为ETF联接基金,通过投资于目标ETF跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场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	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	南方500信息ETF发起式联接A	南方500信息ETF发起式联接C
下属分级基金的交易代码	002900	004347
报告期末下属分级基金的份额总额	123,610,085.05份	15,447,893.44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"500信息联接"。

2.2 目标基金基本情况

基金名称	中证500信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年6月29日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015年7月20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	中国农业银行股份有限公司

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"500信息ETF"。

2.3 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500信息技术指数。
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。

§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7月1日－2018年9月30日)	
	南方500信息ETF发起式联接A	南方500信息ETF发起式联接C
1.本期已实现收益	-161,133.82	-30,320.77
2.本期利润	-7,052,396.78	-847,519.73
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0576	-0.0598
4.期末基金资产净值	92,408,817.43	11,504,066.95
5.期末基金份额净值	0.7476	0.7447

1、上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;

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、本基金自2017年2月28日起增加C类收费模式,原有收费模式称为A类。

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500信息ETF发起式联接A

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	-7.30%	1.74%	-7.80%	1.74%	0.50%	0.00%

南方500信息ETF发起式联接C

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	-7.40%	1.74%	-7.80%	1.74%	0.40%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效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

基金自2017年2月28日起增加C类收费模式,原有收费模式称为A类。

§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		
孙伟	本基金基金经理	2016年8月17日	–	8年	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、数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。

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。

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 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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为4次,是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及投资组合的投资策略需要所致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本季度中证500信息指数下跌8.25%。

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)本基金换购目标ETF所带来的成份股权重偏离,对此我们采取了优化的"再平衡"操作进行应对;

(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微小偏离。

4.5 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0.7476元,报告期内,份额净值增长率为-7.30%,同期业绩基准增长率为-7.80%;本基金C份额净值为0.7447元,报告期内,份额净值增长率为-7.40%,同期业绩基准增长率为-7.80%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

不适用。

§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	3,611,154.09	3.44
	其中:股票	3,611,154.09	3.44
2	基金投资	95,061,683.00	90.66
3	固定收益投资	3,018,000.00	2.88
	其中:债券	3,018,000.00	2.88
	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	2,804,254.35	2.67
8	其他资产	358,362.21	0.34
9	合计	104,853,453.65	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

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	–	–
C	制造业	1,980,516.45	1.91
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	44,304.00	0.04
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	1,586,333.64	1.53
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	3,611,154.09	3.48

5.2.2 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投资股票。

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

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	603019	中科曙光	3,000	140,640.00	0.14
2	000977	浪潮信息	5,200	125,216.00	0.12
3	002410	广联达	4,500	120,510.00	0.12
4	002179	中航光电	2,630	115,720.00	0.11
5	002049	紫光国微	2,900	109,330.00	0.11
6	300383	光环新网	7,500	107,850.00	0.10
7	002268	卫士通	3,980	90,226.60	0.09
8	600584	长电科技	6,500	84,500.00	0.08
9	300315	掌趣科技	18,500	78,810.00	0.08
10	000066	中国长城	11,900	78,183.00	0.08

5.4 报告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	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	3,018,000.00	2.90
	其中:政策性金融债	3,018,000.00	2.90
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	3,018,000.00	2.90

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	018005	国开1701	30,000	3,018,000.00	2.90

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

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

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	南方中证500信息技术ETF	股票型	交易型开放式	南方基金管理股份有限公司	95,061,683.00	91.48

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,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。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

无。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11.3 本期国债期货投资评价

无。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,254.89
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	55,853.03
5	应收申购款	291,976.69
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	2,277.60
9	合计	358,362.21

5.12.4 报告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。

5.12.5 报告期末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	300383	光环新网	107,850.00	0.10	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	南方500信息ETF发起式联接A	南方500信息ETF发起式联接C
报告期期初基金份额总额	115,824,817.02	13,498,655.69
报告期期间基金总申购份额	29,929,812.14	9,226,384.64
减:报告期期间基金总赎回份额	22,144,544.11	7,277,146.89
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	123,610,085.05	15,447,893.44

§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

单位:份

项目	份额
报告期期初管理人持有的本基金份额	11,006,916.66
报告期期间买入/申购总份额	–
报告期期间卖出/赎回总份额	–
报告期期末管理人持有的本基金份额	11,006,916.66
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	7.92

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	11,006,916.66	7.92	10,000,000.00	7.19	自合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	–	–	–	–	–
基金经理等人员	21.31	0.00	0.00	0.00	–
基金管理人股东	–	–	–	–	–
其他	–	–	–	–	–
合计	11,006,937.97	7.92	10,000,000.00	7.19	–

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、《南方中证500信息技术指数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》;

2、《南方中证500信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》;

3、南方中证500信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金2018年3季度报告原文。

10.2 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。

10.3 查阅方式

网站:http://www.nffund.com