南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月25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2017年10月23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2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	南方中证银行ETF
交易代码	512700
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017年06月28日
报告期末基金份额总额	73,981,000.00份
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收益率。本基金标的指数为中证银行指数。
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。
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

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“银行基金”。

§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(2017年07月01日 - 2017年09月30日)
1.本期已实现收益	1,861,245.49
2.本期利润	1,365,260.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.0084
4.期末基金资产净值	73,768,018.31
5.期末基金份额净值	0.9971

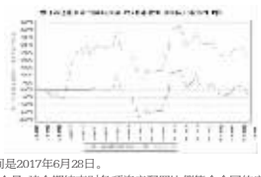
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	-0.29%	0.70%	4.23%	0.88%	-4.52%	-0.18%

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



1、基金合同生效时间是2017年6月28日。
2、本基金建仓期为3个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。
3、基金合同中关于基金投资比例的约定,本基金将全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现,正常情况下,本基金的指数化投资比例不低于基金资产净值的90%。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
孙伟	本基金基金经理		2017年6月28日	-	7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、数量化投资策量化投资研究员;2014年12月至2015年5月,担任南方恒生ETF四基金经理助理;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。

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《南方中证银行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 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3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型基金成份股调整所致。

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,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《南方中证银行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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内份额净值增长率为-0.29%,同期业绩基准增长率为4.23%。

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	73,594,613.81	99.47
	其中:股票	73,594,613.81	99.47
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	288,746.63	0.39
8	其他资产	102,573.22	0.14
-	合计	73,985,933.66	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。

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	-	-
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	73,028,558.00	99.00
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	73,028,558.00	99.00

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	396,269.41	0.52
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	26,385.45	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.03
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	115,299.99	0.16
R	文化,体育和娱乐业	12,499.06	0.02
S	综合	-	-
	合计	566,055.81	0.77

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	600036	招商银行	403,500	10,309,425.00	13.97
2	601166	兴业银行	487,600	8,430,604.00	11.43
3	600016	民生银行	927,400	7,437,748.00	10.08
4	601328	交通银行	1,074,900	6,793,368.00	9.21
5	601288	农业银行	1,496,500	5,712,810.00	7.74
6	600000	浦发银行	439,800	5,660,226.00	7.67
7	601398	工商银行	843,900	5,063,400.00	6.86
8	601169	北京银行	570,700	4,257,422.00	5.77
9	000001	平安银行	334,800	3,719,628.00	5.04
10	601988	中国银行	824,500	3,396,940.00	4.60

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	603882	金域医学	2,763	115,299.99	0.16
2	603106	恒银金融	2,786	84,025.76	0.11
3	603321	梅轮电梯	2,725	54,309.25	0.07
4	603055	台华新材	2,047	48,124.97	0.07
5	603386	广东骏亚	1,644	41,823.36	0.06

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注: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序的前五名债券投资明细

注: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。

5.9.2 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。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体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。

5.11.2

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	98,416.64
2	应收证券清算款	3,979.87
3	应收股利	-
4	应收利息	176.71
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
-	合计	102,573.22

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

报告期期初基金份额总额	343,781,000.00
报告期期间基金总申购份额	24,600,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	294,400,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金份额总额	73,981,000.00

§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

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(%)
南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	20170926-20170930	15,936,200.00	-	-	15,936,200.00	21.54
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。							

注:申购份额包含红利再投资和份额折算。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金合同。
2、南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金托管协议。
3、南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金2017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

南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

2017年第三季度报告

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月25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2017年10月23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2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	南方中证银行ETF联接
基金主代码	004597
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年06月29日
报告期末基金份额总额	17,856,048.78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,本基金力争使跟踪误差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	南方银行联接A 南方银行联接C
下属分级基金的交易代码	004597 004598
报告期末下属分级基金的份额总额	14,474,279.55份 3,380,769.23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“南方银行联接”。

2.2 目标基金基本情况

基金名称	南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512700
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017年06月28日
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07月26日
基金管理人名称	南方基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.3 目标基金产品

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收益率。本基金标的指数为中证银行指数。
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。
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§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(2017年07月01日 - 2017年09月30日)	
	南方银行联接A	南方银行联接C
1.本期已实现收益	-51,761.26	-568.11
2.本期利润	-180,048.13	-21,528.03
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0163	-0.0089
4.期末基金资产净值	14,251,011.59	3,325,048.34
5.期末基金份额净值	0.9846	0.9835

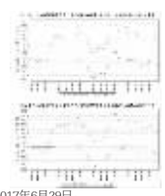
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	3.65%	0.65%	2.85%	0.36%	0.80%	0.29%

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



注:1、基金合同生效时间是2017年6月29日。
2、本基金建仓期为6个月。
3、本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
孙伟	本基金基金经理		2017年6月29日	-	7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、数量化投资策量化投资研究员;2014年12月至2015年5月,担任南方恒生ETF四基金经理助理;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。

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《南方中证银行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3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型基金成份股调整所致。

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

本报告期是基金成立后的首个完整季度,截至报告期末,本基金已完成建仓操作。

建仓完成后,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)本基金大额换购目标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(包括调出指数成分股)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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A级份额净值为0.9846元, 份额净值增长率为-1.55%,同期业绩基准增长率为4.03%;本基金C级份额净值为0.9835元,份额净值增长率为-1.66%,同期业绩基准增长率为4.03%。

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	431,320.00	2.44
	其中:股票	431,320.00	2.44
2	基金投资	15,891,578.64	89.85
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	1,176,450.24	6.65
8	其他资产	187,793.69	1.06
-	合计	17,687,132.57	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

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	3,366,893.60	1.89
C	制造业	125,916,386.87	63.14
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.02
E	建筑业	2,563.60	-
F	批发和零售业	5,136,326.30	2.58
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,623,062.35	1.82
J	金融业	32,757,695.00	16.43
K	房地产业	2,776,000.00	1.39
L	租赁和商务服务业	79,324.72	0.04
M	科学研究和技术服务业	58,318.14	0.03
N	水利,环境和公共设施管理业	3,616.08	-
O	居民服务,修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.06
R	文化,体育和娱乐业	47,351.86	0.02
S	综合	-	-
	合计	173,939,503.86	87.22

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

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	600519	贵州茅台	25,600	13,251,584.00	6.64
2	000651	格力电器	310,000	11,749,000.00	5.89
3	601318	中国平安	180,000	9,748,800.00	4.89
4	000063	中兴通讯	300,000	8,490,000.00	4.26
5	601328	交通银行	1,200,000	7,584,000.00	3.80
6	000568	泸州老窖	120,000	6,732,000.00	3.38
7	002217	合力泰	480,000	5,400,000.00	2.71
8	300323	华灿光电	280,000	5,160,400.00	2.59
9	601009	南京银行	574,600	4,545,086.00	2.28
10	002250	科达利	50,000	4,495,000.00	2.25

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	998,100.00	0.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,543,624.80	4.79
	其中:政策性金融债	9,543,624.80	4.79
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	10,541,724.80	5.29

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	54,540	5,569,624.80	2.79
2	018005	国开1701	40,000	3,974,000.00	1.99
3	019557	17国债03	10,000	998,100.00	0.50

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

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

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

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	南方银行联接A	南方银行联接C
报告期期初基金份额总额	10,352,725.39	5,516,339.11
报告期期间基金总申购份额	5,257,724.12	3,810,332.14
减:报告期期间基金总赎回份额	1,136,169.96	5,945,902.02
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	14,474,279.55	3,380,769.23

§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	南方银行联接A	南方银行联接C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,055.66	-
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	10,001,055.66	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	69.10	-

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 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	10,001,055.66	56.01	10,001,055.66	56.01	自合同生效之日起不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,055.66	56.01	10,001,055.66	56.01	自合同生效之日起不少于三年

§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	客户1	20170701-20170930	10,001,055.66	-	-	10,001,055.66	56.01
个人	客户2	20170701-20170731	5,000,000.00	-	5,000,000.00	-	0.00
-	-	-	-	-	-	-	-
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。							

注: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、南方中证银行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、南方中证银行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、南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金2017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

南方转型驱动灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月25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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23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2017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	南方驱动混合
基金主代码	002160
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年03月23日
报告期末基金份额总额	152,533,665.16份
投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下,通过专业化研究分析,力争实现基