

---

# 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 **2018** 年半年度 报告

**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 重要提示及目录

### 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 2018 年 8 月 22 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1</b> 重要提示及目录.....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介.....</b>	<b>12</b>
2.1 基金基本情况.....	12
2.2 基金产品说明.....	12
2.3 基金管理人和基金托管人.....	12
2.4 信息披露方式.....	12
2.5 其他相关资料.....	12
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现.....</b>	<b>12</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	12
3.2 基金净值表现.....	12
<b>§4 管理人报告.....</b>	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告.....</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	15
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>24</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	24
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	24
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	24
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	24
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	25
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.....	25
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.....	25

<b>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.....</b>	<b>25</b>
<b>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.....</b>	<b>25</b>
<b>7.10 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.....</b>	<b>25</b>
<b>7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....</b>	<b>25</b>
<b>7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....</b>	<b>25</b>
<b>7.13 投资组合报告附注.....</b>	<b>26</b>
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>26</b>
<b>8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....</b>	<b>26</b>
<b>8.2 期末上市基金前十名持有人.....</b>	<b>26</b>
<b>8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....</b>	<b>26</b>
<b>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的情况.....</b>	<b>27</b>
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>27</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>27</b>
<b>10.1 基金份额持有人大会决议.....</b>	<b>27</b>
<b>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.....</b>	<b>27</b>
<b>10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....</b>	<b>27</b>
<b>10.4 基金投资策略的改变.....</b>	<b>27</b>
<b>10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....</b>	<b>27</b>
<b>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.....</b>	<b>27</b>
<b>10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....</b>	<b>27</b>
<b>10.8 其他重大事件.....</b>	<b>28</b>
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>28</b>
<b>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.....</b>	<b>28</b>
<b>11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>28</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>28</b>
<b>12.1 备查文件目录.....</b>	<b>28</b>
<b>12.2 存放地点.....</b>	<b>28</b>
<b>12.3 查阅方式.....</b>	<b>28</b>

## §2 基金简介

### 2.1 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发起式联接基金	
基金简称	南方银行联接	
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 6 月 29 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	82,176,617.20 份	
基金合同存续期	不定期	
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	40,045,658.05 份	42,130,959.15 份

### 1.

### 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	

### 2.2 基金产品说明

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 $\times$ 95% + 银行人民币活期存款利率（税后） $\times$ 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。

**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。

**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	010-66105799
注册地址	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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	张海波	易会满

**2.4 信息披露方式**

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
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	南方基金管理有限公司	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

## §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

报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)		
	南方银行联接 A	南方银行联接 C
本期已实现收益	-370,962.85	-318,120.97
本期利润	-7,360,055.72	-5,774,323.36
加权平均基金份额本期利润	-0.1950	-0.2126
本期加权平均净值利润率	-19.22%	-21.46%
本期基金份额净值增长率	-11.46%	-11.64%
报告期末(2018年06月30日)		
期末可供分配利润	-4,086,654.08	-4,451,887.87
期末可供分配基金份额利润	-0.1020	-0.1057
期末基金资产净值	35,959,003.97	37,679,071.28
期末基金份额净值	0.8980	0.8943
报告期末(2018年06月30日)		
3.1.3 累计期末指标		
基金份额累计净值增长率	-10.20%	-10.58%

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

#### 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

南方银行联接 A

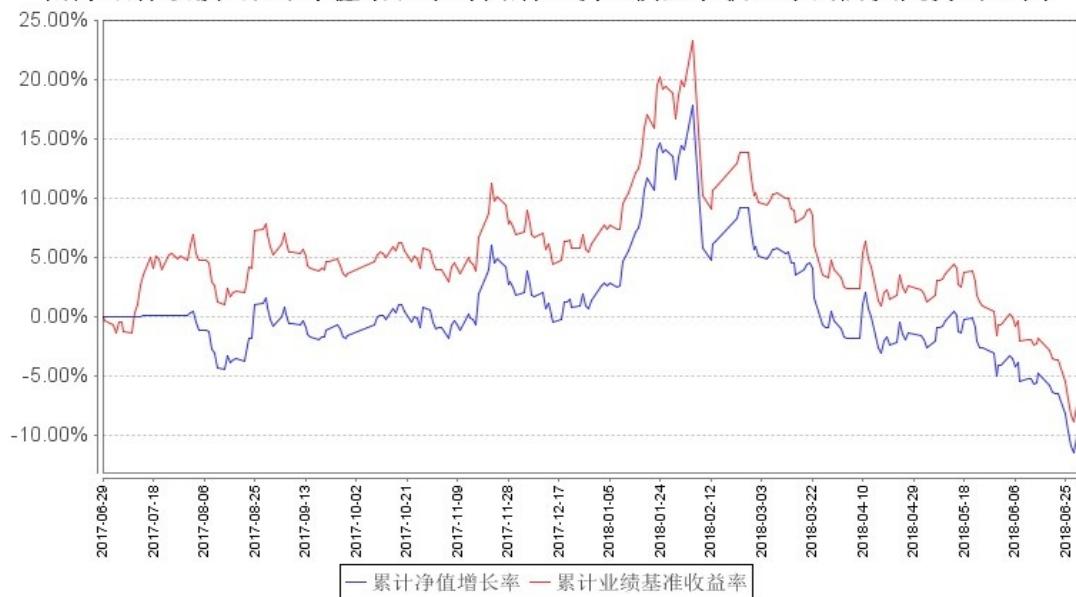
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-6.38%	0.87%	-7.05%	0.84%	0.67%	0.03%
过去三个月	-9.95%	0.95%	-11.16%	0.95%	1.21%	0.00%
过去六个月	-11.46%	1.15%	-12.97%	1.16%	1.51%	-0.01%
过去一年	-10.21%	0.96%	-7.28%	1.02%	-2.93%	-0.06%
自基金合同	-10.20%	0.96%	-7.63%	1.02%	-2.57%	-0.06%

南方银行联接 C

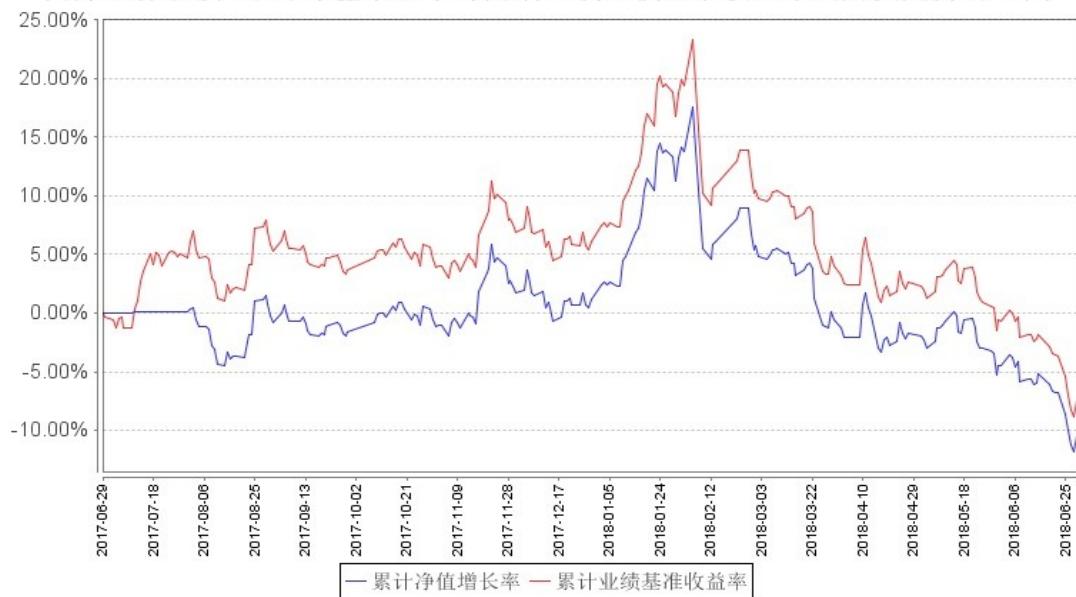
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-6.41%	0.87%	-7.05%	0.84%	0.64%	0.03%
过去三个月	-10.05%	0.95%	-11.16%	0.95%	1.11%	0.00%
过去六个月	-11.64%	1.14%	-12.97%	1.16%	1.33%	-0.02%
过去一年	-10.59%	0.96%	-7.28%	1.02%	-3.31%	-0.06%
自基金合同	-10.58%	0.96%	-7.63%	1.02%	-2.95%	-0.06%

## 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

南方银行联接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



南方银行联接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：本基金的基金合同生效日为 2017 年 6 月 29 日，本基金建仓期为 6 个月，报告期末建仓期尚未结束。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 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。

## 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6月29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、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；

					<b>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。</b>
--	--	--	--	--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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《南方中证银行交易型开放式指数证券投资基金管理公司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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 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执行交易公平执行, 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，并且交易占优比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

## 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

### 1.

#### 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期中证银行指数下跌 13.65%。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偏离；（4）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。

### 2.

#### 报告期内基金的业绩表现

本报告期 A 级基金净值收益率为 -11.46%，同期业绩比较基准收益率为 -12.97%。C 级基金净值收益率为 -11.64%，同期业绩比较基准收益率为 -12.97%。

## 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。中证银行指数当前不足 0.9 倍的市净率处于指数发布以来的底部区域，已充分甚至过度反映了市场对银行业债务风险的忧虑。展望未来，在 A 股入摩和机构定价权提升的催化下，在资产质量改善和利差持续抬升的支撑下，银行业净资产回报率和股息率预期将稳定维持在较好水平，我们对银行指数的中长期市场表现较为乐观。

#### 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，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，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%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；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；同一类别内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

不适用。

### §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，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的管理人——南

方基金管理股份有限公司在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的投资运作、基金资产净值计算、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，本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 2018 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：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

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	1,328,510.13	1,582,890.48
结算备付金		29,930.77	68,755.31
存出保证金		23,038.75	7,482.27
交易性金融资产	6.4.3.2	72,927,345.86	27,886,652.90
其中：股票投资		346,994.36	524,759.00
基金投资		69,568,951.50	27,358,593.90
债券投资		3,011,400.00	3,300.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-

应收证券清算款			
应收利息	6.4.3.5	26,963.92	365.55
应收股利		-	-
应收申购款		36,384.94	55,871.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		74,372,174.37	29,602,018.30
负债和所有者权益	附注号	本期末 <b>2018年6月30日</b>	上年度末 <b>2017年12月31日</b>
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		551,290.67	68,065.93
应付管理人报酬		1,915.64	1,155.67
应付托管费		383.12	231.16
应付销售服务费		13,119.54	2,980.14
应付交易费用	6.4.3.7	2,660.97	1,229.31
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.3.8	164,729.18	30,105.64
负债合计		734,099.12	103,767.85
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.3.9	82,176,617.20	29,105,856.76
未分配利润	6.4.3.10	-8,538,541.95	392,393.69
所有者权益合计		73,638,075.25	29,498,250.45
负债和所有者权益总计		74,372,174.37	29,602,018.30

注: 1. 报告截止日 2018 年 6 月 30 日, 基金份额总额 82,176,617.20 份, 其中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 A 类基金份额 40,045,658.05 份, 基金份额净值 0.8980 元; 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 C 类基金份额 42,130,959.15 份, 基金份额净值为 0.8943 元。

## 6.2 利润表

会计主体: 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

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	附注号	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年06月29日(基 金合同生效日)至 2017年06月30日
一、收入		-12,867,953.84	2,614.64
1.利息收入		33,769.31	2,614.64
其中: 存款利息收入	6.4.3.11	12,020.02	317.38
债券利息收入		21,643.54	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		105.75	2,297.26
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-569,797.09	-

其中：股票投资收益	6.4.3.12	-410,134.83	
基金投资收益	6.4.3.13	-165,029.78	
债券投资收益	6.4.3.14	1,128.77	
资产支持证券投资收益	6.4.3.15	-	
贵金属投资收益	6.4.3.16	-	
衍生工具收益	6.4.3.17	-	
股利收益	6.4.3.18	4,238.75	
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.19	-12,445,295.26	
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.20	113,369.20	
减：二、费用		266,425.24	1,712.46
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	11,901.96	217.37
2. 托管费	6.4.6.2.2	2,380.32	43.47
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	53,251.77	
4. 交易费用	6.4.3.21	34,938.66	
5. 利息支出		206.62	
其中：卖出回购金融资产支出		206.62	
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.22	163,745.91	1,451.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,134,379.08	902.18
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,134,379.08	902.18
-------------------	--	----------------	--------

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

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）	29,105,856.76	392,393.69	29,498,250.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-13,134,379.08	-13,134,379.08
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)	53,070,760.44	4,203,443.44	57,274,203.88
其中：1.基金申购款	118,814,133.45	7,074,381.05	125,888,514.50
2.基金赎回款	-65,743,373.01	-2,870,937.61	-68,614,310.62
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）	82,176,617.20	-8,538,541.95	73,638,075.25
项目	上年度可比期间 2017年06月29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）	15,869,064.50	-	15,869,064.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	902.18	902.18
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-

2.基金赎回款			
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）	15,869,064.50	902.18	15,869,966.68

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

### 1. 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 2. 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

### 3. 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。

### 4. 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。

### 5. 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进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、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及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、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。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。

(e) 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. 重要财务报表项目的说明

### 7. 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	1,328,510.13
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月及以上	-
其他存款	-

合计	1,328,510.13
----	--------------

**8.****交易性金融资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	375,610.02	346,994.36	-28,615.66
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	3,004,080.60	3,011,400.00	7,319.40
交易所市场			
银行间市场	-	-	-
-	-	-	-
合计	3,004,080.60	3,011,400.00	7,319.40
资产支持证券	-	-	-
基金	81,672,637.50	69,568,951.50	-12,103,686.00
其他	-	-	-
合计	85,052,328.12	72,927,345.86	-12,124,982.26

**9.****衍生金融资产/负债**

注:无。

**10.****买入返售金融资产**

注:无。

**11.****应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	223.51
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	12.15
应收债券利息	26,718.90
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	9.36
合计	26,963.92

**12.****其他资产**

注:无。

**13.****应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,660.97
银行间市场应付交易费用	-
-	-
合计	2,660.97

**14.****其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,085.27
预提费用	163,643.91
合计	164,729.18

**15.****实收基金**

金额单位：人民币元

南方银行联接 A

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	19,026,112.55	19,026,112.55
本期申购	62,202,346.93	62,202,346.93
本期赎回(以“-”号填列)	-41,182,801.43	-41,182,801.43
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	40,045,658.05	40,045,658.05

南方银行联接 C

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	10,079,744.21	10,079,744.21
本期申购	56,611,786.52	56,611,786.52
本期赎回(以“-”号填列)	-24,560,571.58	-24,560,571.58
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	42,130,959.15	42,130,959.15

注:: 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额

## 16. 未分配利润

单位：人民币元

南方银行联接 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-132,670.32	403,106.49	270,436.17
本期利润	-370,962.85	-6,989,092.87	-7,360,055.72
本期基金份额交易产生的变动数	-49,393.49	3,052,358.96	3,002,965.47
其中：基金申购款	-364,422.03	5,122,377.77	4,757,955.74
基金赎回款	315,028.54	-2,070,018.81	-1,754,990.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-553,026.66	-3,533,627.42	-4,086,654.08

## 南方银行联接 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-91,232.37	213,189.89	121,957.52
本期利润	-318,120.97	-5,456,202.39	-5,774,323.36
本期基金份额交易产生的变动数	-342,565.62	1,543,043.59	1,200,477.97
其中：基金申购款	-602,057.40	2,918,482.71	2,316,425.31
基金赎回款	259,491.78	-1,375,439.12	-1,115,947.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-751,918.96	-3,699,968.91	-4,451,887.87

## 17. 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	10,596.57
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	1,210.99
其他	212.46
合计	12,020.02

**18. 股票投资收益****19. 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-91,310.53
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-318,824.30
合计	-410,134.83

**20. 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	17,864,220.17
减：卖出股票成本总额	17,955,530.70
买卖股票差价收入	-91,310.53

注:-

**21. 股票投资收益——申购差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
申购基金份额总额	56,860,420.00
减：现金支付申购款总额	4,599,882.23
减：申购股票成本总额	52,579,362.07
申购差价收入	-318,824.30

**22. 基金投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	10,265,030.50
减：卖出/赎回基金成本总额	10,430,060.28
基金投资收益	-165,029.78

**23.****债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	522,937.68
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	504,557.70
减：应收利息总额	17,251.21
买卖债券差价收入	1,128.77

**24.****资产支持证券投资收益**

注:无。

**25.****贵金属投资收益**

注:无。

**26.****衍生工具收益**

注:无。

**27.****股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,238.75
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,238.75

**28.****公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-12,445,295.26
股票投资	-18,210.98
债券投资	7,319.40
资产支持证券投资	-
基金投资	-12,434,403.68
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
-	-
3.其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-12,445,295.26

## 29. 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	92,856.80
补差费归资产	20,512.40
合计	113,369.20

注:本基金场内部分的赎回费率为 0.50%，场外部分的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

## 30. 交易费用

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	32,722.40
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	2,216.26
其中：申购费	-
赎回费	-
其他	2,216.26
-	-
合计	34,938.66

## 31. 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	148,767.52
银行费用	102.00
合计	163,745.91

## 32. 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 33. 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**34.****资产负债表日后事项**

无。

**35.****关联方关系****36.****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。

**37.****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、注册登记机构、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
南方中证银行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: 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。

**38.****本报告期及上年度可比期间的关联方交易****39.****通过关联方交易单元进行的交易****40.****股票交易**

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月 30日	占当期股票 成交总额的比例 (%)	2017年06月29日(基金合同生效 日)至2017年06月30日	占当期股票 成交总额的比例 (%)
兴业证券	76,270,826.75	96.87	0.00	0.00
华泰证券	2,462,361.53	3.13	0.00	0.00

**41.****债券交易**

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月 30日	占当期债券 成交金额的百分 比(%)	2017年06月29日(基金合同生效 日)至2017年06月30日	占当期债券 成交金额的百分 比(%)
	28.13	28.13		

**42.****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06月29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 (%)
兴业证券	1,000,000.00	38.76	-	-
华泰证券	1,580,000.00	61.24	-	-

**43.****基金交易**

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06月29日（基金合同生效 日）至2017年06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 (%)
兴业证券	8,192,377.30	100.00	-	-

**44.****权证交易**

注:无。

**45.****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	238.11	3.03	68.95	2.59
兴业证券	7,624.27	96.97	2,592.02	97.41
关联方名称	上年度可比期间 2017年06月29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	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-

注:: 1. 上述佣金按市场佣金率计算, 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后的净额列示。 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。

## 46. 关联方报酬

## 47. 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 06 月 29 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	11,901.96	217.37
其中: 支付销售机构的客户维护费	25,514.66	-

注: 本基金基金资产中投资于目标 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。

## 48. 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 06 月 29 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	2,380.32	43.47

注:: 本基金基金资产中投资于目标 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。

**49.****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 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		
	南方银行联接 A	南方银行联接 C	合计
工商银行	-	4,725.33	4,725.33
华泰证券	-	43.46	43.46
南方基金	-	31026.83	31026.83
合计	-	-	-

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年06月29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销售服务费		
	南方银行联接 A	南方银行联接 C	合计
工商银行	-	-	-
华泰证券	-	-	-
南方基金	-	-	-
合计	-	-	-

注: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。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为:

日销售服务费=前一日 C 类基金份额基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

**50.****与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注:无。

**51.****各关联方投资本基金的情况****52.****金的情况****报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位: 份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	南方银行联接 A	南方银行联接 C

基金合同生效日（2017年6月29日）持有的基金份额	10,001,055.66	
期初持有的基金份额	10,001,055.66	
期间申购/买入总份额	-	
期间因拆分变动份额	-	
减：期间赎回/卖出总份额	-	
期末持有的基金份额	10,001,055.66	
期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.1702%	-
项目	上年度可比期间 2017年06月29日（基金合同生效日）至2017年06月30日	
	南方银行联接A	南方银行联接C
基金合同生效日（2017年6月29日）持有的基金份额	10,001,055.66	
期初持有的基金份额	10,001,055.66	
期间申购/买入总份额	-	
期间因拆分变动份额	-	
减：期间赎回/卖出总份额	-	
期末持有的基金份额	10,001,055.66	
期末持有的基金份额占基金总份额比例	63.0223%	-

### 53. 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

注:无。

### 54. 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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日	当期利息收入	2017年06月29日（基金合同生效日）至2017年06月30日	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,328,510.13	10,596.57	869,064.50	317.38

注:本基金由基金托管人中国工商银行保管的银行存款,按银行约定利率计息。

**55.** 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

**56.** 其他关联交易事项的说明

**57.** 其他关联交易事项的说明

1. 于本报告期末, 本基金持有 76,533,500.00 份目标 ETF 基金份额, 占其份额的比例为 66.33%
2. 于本报告期末, 本基金持有 4,100.00 股中国工商银行的 A 股普通股, 成本总额为人民币 23,675.03 元, 估值总额为人民币 21,812.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.03%。

**58.** 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 06 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 06 月 30 日
当期交易基金产生的申购费 (元)		
当期交易基金产生的赎回费 (元)		
当期持有基金产生的应支付销售服务费 (元)		
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	151,001.11	
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	20,200.22	
当期交易基金产生的其他费用 (元)	2,216.26	

注: 申购费、赎回费是实际产生的费用, 销售服务费、管理费和托管费等其他费用为估算费用。

**59.** 利润分配情况

注:无。

**60.**  
通受限证券

期末(2018年06月30日)本基金持有的流

**61.**  
限证券

因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受

注:无。

**62.**

期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

**63.**

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注:无。

**64.**

金融工具风险及管理

**65.**

风险管理政策和组织架构

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为完全被动式指类型基金，紧密跟踪中证银行指数，具有和中证银行指数以及中证银行指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资的金融工具主要包括基金投资和股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“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”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，

及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

## 66.

### 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 4.09%。

## 67.

### 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

**68.****报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.8。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金管理规定》第四十条。

**69.****市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

**70.****利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

**6.4.1.1.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末 2018年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,328,510.1 3	-	-	-	1,328,510.13
结算备付金	29,930.77	-	-	-	29,930.77
存出保证金	23,038.75	-	-	-	23,038.75
交易性金融资产	3,011,400.0 0	-	-	69,915,945. 86	72,927,345.86
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	26,963.92	26,963.92
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	36,384.94	36,384.94
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,392,879.6 5	-	-	69,979,294. 72	74,372,174.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	551,290.67	551,290.67
应付管理人报酬	-	-	-	1,915.64	1,915.64
应付托管费	-	-	-	383.12	383.12

应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	13,119.54	13,119.54
应付交易费用	-	-	-	2,660.97	2,660.97
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	164,729.18	164,729.18
负债总计	-	-	-	734,099.12	734,099.12
利率敏感度缺口	4,392,879.6 5	-	-	69,245,195. 60	73,638,075.25
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,582,890.4 8	-	-	-	1,582,890.48
结算备付金	68,755.31	-	-	-	68,755.31
存出保证金	7,482.27	-	-	-	7,482.27
交易性金融资产	-	-	3,300.00	27,883,352. 90	27,886,652.90
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	365.55	365.55
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	34,958.84	-	-	20,912.95	55,871.79
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,694,086.9 0	-	3,300.00	27,904,631. 40	29,602,018.30
负债					
应付赎回款	-	-	-	68,065.93	68,065.93
应付管理人报酬	-	-	-	1,155.67	1,155.67
应付托管费	-	-	-	231.16	231.16
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	2,980.14	2,980.14
应付交易费用	-	-	-	1,229.31	1,229.31
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	30,105.64	30,105.64
负债总计	-	-	-	103,767.85	103,767.85

利率敏感度缺口	1,694,086.9 0	-	3,300.00	27,800,863. 55	29,498,250.45
---------	------------------	---	----------	-------------------	---------------

注:表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.1.1.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2018 年 6 月 30 日本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.09%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 1. 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 2. 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出的目标 ETF 份额以及证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、中证银行指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.1.1.1.3 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
----	-------------------	---------------------

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	346,994.36	0.47	524,759.00	1.78
交易性金融资产—基金投资	69,568,951.50	94.47	27,358,593.90	92.75
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	69,915,945.86	94.95	27,883,352.90	94.53

#### 6.4.1.1.1.4 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
分析		本期末(2018年6月30日)	上年度末(2017年12月31日)
1.业绩比较基准(附注7.4.1)上升 5%	3,408,825.80	1,306,038.26	
2.业绩比较基准(附注7.4.1)下降 5%	-3,408,825.80	-1,306,038.26	

#### 1. 事项

有助于理解和分析会计报表需要说明的其他

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	346,994.36	0.47
	其中: 股票	346,994.36	0.47
2	基金投资	69,568,951.50	93.54
3	固定收益投资	3,011,400.00	4.05
	其中: 债券	3,011,400.00	4.05
	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	1,358,440.90	1.83
-	-	-	-
8	其他各项资产	86,387.61	0.12
9	合计	74,372,174.37	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 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	-	-
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	346,994.36	0.47
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	346,994.36	0.47

### 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600036	招商银行	1,894	50,077.36	0.07
2	601166	兴业银行	2,360	33,984.00	0.05
3	600016	民生银行	4,500	31,500.00	0.04
4	601328	交通银行	5,300	30,422.00	0.04
5	601288	农业银行	7,400	25,456.00	0.03
6	600000	浦发银行	2,300	21,988.00	0.03
7	601398	工商银行	4,100	21,812.00	0.03
8	601169	北京银行	2,800	16,884.00	0.02
9	000001	平安银行	1,700	15,453.00	0.02
10	601988	中国银行	4,100	14,801.00	0.02
11	601229	上海银行	800	12,608.00	0.02
12	601818	光大银行	3,100	11,346.00	0.02
13	601939	建设银行	1,500	9,825.00	0.01
14	600015	华夏银行	1,200	8,940.00	0.01
15	601009	南京银行	1,100	8,503.00	0.01
16	600919	江苏银行	1,300	8,333.00	0.01
17	002142	宁波银行	500	8,145.00	0.01
18	601998	中信银行	600	3,726.00	0.01
19	601997	贵阳银行	300	3,708.00	0.01
20	600926	杭州银行	300	3,327.00	0.00
21	002839	张家港行	200	1,218.00	0.00
22	600908	无锡银行	200	1,178.00	0.00
23	601128	常熟银行	200	1,144.00	0.00
24	002807	江阴银行	200	1,124.00	0.00
25	601838	成都银行	100	875.00	0.00
26	603323	吴江银行	100	617.00	0.00

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 1. 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	600036	招商银行	10,273,770.19	34.83
2	601166	兴业银行	6,808,554.09	23.08
3	600016	民生银行	6,334,837.75	21.48
4	601328	交通银行	5,626,521.00	19.07

5	601288	农业银行	4,961,161.00	16.82
6	600000	浦发银行	4,478,750.46	15.18
7	601398	工商银行	4,408,171.00	14.94
8	601169	北京银行	3,263,810.85	11.06
9	601988	中国银行	2,765,767.00	9.38
10	601818	光大银行	2,192,857.00	7.43
11	600015	华夏银行	1,928,130.00	6.54
12	601939	建设银行	1,762,156.00	5.97
13	600919	江苏银行	1,594,300.00	5.40
14	601009	南京银行	1,354,332.24	4.59
15	000001	平安银行	787,713.03	2.67
16	601998	中信银行	564,492.00	1.91
17	601997	贵阳银行	504,864.00	1.71
18	601229	上海银行	397,715.00	1.35
19	002142	宁波银行	363,817.50	1.23
20	600908	无锡银行	203,044.00	0.69

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(成交单价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。

## 2. 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	600036	招商银行	2,757,682.00	9.35
2	601166	兴业银行	1,918,654.00	6.50
3	600016	民生银行	1,737,408.00	5.89
4	601328	交通银行	1,547,807.00	5.25
5	601288	农业银行	1,360,145.00	4.61
6	600000	浦发银行	1,246,377.17	4.23
7	601398	工商银行	1,226,778.00	4.16
8	601169	北京银行	929,311.00	3.15
9	000001	平安银行	823,928.00	2.79
10	601988	中国银行	762,652.00	2.59
11	601818	光大银行	591,395.00	2.00
12	600015	华夏银行	518,738.00	1.76
13	601939	建设银行	475,034.00	1.61
14	600919	江苏银行	444,425.00	1.51
15	601009	南京银行	390,658.00	1.32
16	002142	宁波银行	386,692.00	1.31

17	601997	贵阳银行	200,455.00	0.68
18	601998	中信银行	172,241.00	0.58
19	601229	上海银行	112,818.00	0.38
20	600926	杭州银行	66,813.00	0.23

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(成交单价乘以成交量)填列, 不考虑相关交易费用。

### 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	60,886,528.11
卖出股票收入(成交)总额	17,864,220.17

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	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,011,400.00	4.09
	其中: 政策性金融债	3,011,400.00	4.09
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	3,011,400.00	4.09

### 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	占基金资产净值比例 (%)
1	018005	国开 1701	30,000	3,011,400.00	4.09

### 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

金额单位: 人民币元

注: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

注: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

注:本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 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	占基金资产净值比例(%)
1	南方中证银行 ETF	股票型	交易型开放式	南方基金管理股份有限公司	69,568.95 1.50	94.47

## 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 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。

### 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; 对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险; 利用金融衍生品的杠杆作用, 降低股票和目标 ETF 仓位频繁调整的交易成本, 达到有效跟踪对标的指数的目的。

## 7.12 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。

## 7.13 投资组合报告附注

### 1.

报告期内基金投资的前十名证券除浦发银行（证券代码 600000 SH）、兴业银行（证券代码 601166 SH）、招商银行（证券代码 600036 SH）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。

#### 1、浦发银行（证券代码 600000 SH）

根据 2018 年 5 月 4 日中国银行保险监督委员会执行处罚信息公开表（银监罚决字（2018）4 号），对上海浦东发展银行股份有限公司（下称浦发银行，股票代码：600000）内控管理严重违反审慎经营规则、通过资管计划投资分行协议存款，虚增一般存款等十九项违规事实罚款 5845 万元，没收违法所得 10.927 万元，罚没合计 5855.927 万元。

#### 2、兴业银行（证券代码 601166 SH）

根据 2018 年 5 月 4 日中国银行保险监督委员会执行处罚信息公开表（银保监银罚决字（2018）1 号），对兴业银行股份有限公司（下称兴业银行，股票代码：601166）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产等十二项违规事实罚款 5870 万元。

#### 3、招商银行（证券代码 600036 SH）

根据 2018 年 5 月 4 日中国银行保险监督委员会执行处罚信息公开表（银监罚决字（2018）1 号），对招商银行股份有限公司（下称招商银行，股票代码：600036）内控管理严重违反审慎经营规则、违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等十四项违规事实执行处罚决定，罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资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。

### 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。

### 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	23,038.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,963.92
5	应收申购款	36,384.94

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	86,387.61

#### 4. 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. 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。

### §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 银行 联接 A	3,559	11,251.94	10,001,055.66	24.97	30,044,602.39	75.03
南方 银行 联接 C	1,396	30,179.77	25,280,792.14	60.01	16,850,167.01	39.99
合计	4,955	16,584.58	35,281,847.80	42.93	46,894,769.40	57.07

注:分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中, 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)。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	南方银行联接 A	613,728.91	1.5326

理人所有从业人员持有本基金	南方银行联接 C	42,367.15	0.1006
	合计	656,096.06	0.7984

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，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的情况

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	南方银行联接 A	-
	南方银行联接 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	南方银行联接 A	10~50
	南方银行联接 C	0~10
	合计	10~50

## §9 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
基金合同生效日（2017年6月29日）基金份额总额	10,352,725.39	5,516,339.11
本报告期期初基金份额总额	19,026,112.55	10,079,744.21
本报告期基金总申购份额	62,202,346.93	56,611,786.52
减：本报告期基金总赎回份额	41,182,801.43	24,560,571.58
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	40,045,658.05	42,130,959.15

## §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**

#### **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	
兴业证券	1	76,270.8	96.87%	7,624.27	96.97%	-

		26.75				
华泰证券	2	2,462,36	3.13%	238.11	3.03%	-
		1.53				

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管理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。

## 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比例	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
华泰证券	503,006.38	14.33%	1,580,000.00	61.24%	-	-	-	-
兴业证券	3,006,019.60	85.62%	1,000,000.00	38.76%	-	-	8,192,377.30	100.00%

注:-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

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招募说明书（更新）（2017年第1号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年02月02日
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招募说明书（更新）摘要（2017年第1号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年02月02日
3	南方基金关于旗下部分基金增加和耕传承为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年02月08日
4	南方基金关于旗下部分基金增加国金证券为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年02月27日
5	南方基金关于旗下部分基金增加山西证券为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年03月09日
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分开放式基金赎回费调整的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年03月27日
7	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年03月30日
8	南方基金管理股份有限公司关于调整电子直销系统部分基金最低申购金额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年04月26日
9	南方基金关于旗下部分基金增加大连网金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年04月27日
10	南方基金关于旗下部分基金增加紫金农商银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年05月08日
11	南方基金关于旗下部分基金增加一路财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年05月25日
12	南方基金关于旗下部分基金增加华融湘江银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年06月01日
13	南方基金关于旗下部分基金增加上海银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年06月06日
14	南方基金关于旗下部分基金增加中民财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018年06月25日

注:-

## §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	1	201 804 12- 201 806 30	-	19,657,951.64	-	19,657,951.64	23.9 2
	2	201 801 01- 201 802 01	10,001,055.66	-	-	10,001,055.66	12.1 7
个人	-	-	-	-	-	-	-
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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立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的文件。
- 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基金合同。
- 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基金托管协议。
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。
- 6、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半年度报告原文。

### 12.2 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。

### 12.3 查阅方式

网站: <http://www.nffund.com>