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：中国农业银行股份有限公司

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、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。

基金托管人中国农业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、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 6
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 7

§3 主要财务指标和基金净值表现 7

3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8

§4 管理人报告 9

4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
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 12

§5 托管人报告 12

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 13
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 13

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13

6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 15
6.4 报表附注 16

§7 投资组合报告 37

7.1 期末基金资产组合情况 37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 37
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 38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 41
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 42
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 42
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 42

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 42
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 42
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 42
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 43
7.13 投资组合报告附注 43

§8 基金份额持有人信息 43

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 44
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 44
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 44

§9 开放式基金份额变动 45

§10 重大事件揭示 45

10.1 基金份额持有人大会决议 45
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 45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 46
10.4 基金投资策略的改变 46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 46
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 46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 46
10.8 其他重大事件 47

§11 影响投资者决策的其他重要信息 48

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 48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 48

§12 备查文件目录 48

12.1 备查文件目录 48
12.2 存放地点 48
12.3 查阅方式 48

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	
基金简称	南方 500 信息 ETF 发起式联接	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	129,323,472.71 份	
基金合同存续期	不定期	
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	115,824,817.02 份	13,498,655.69 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“500 信息联接”。

2.1.1 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（ETF）
基金合同生效日	2015-06-29
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015-07-20
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“500 信息 ETF”。

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	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。

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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川	贺倩
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-68121816
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	北京东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		张海波	周慕冰

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	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理股份有限公司	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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 01 月 01 日-2018 年 06 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
本期已实现收益	-52,039.58	1,665.19
本期利润	-12,918,607.23	-1,636,560.94
加权平均基金份额本期利润	-0.1212	-0.1873
本期加权平均净值利润率	-13.48%	-20.85%
本期基金份额净值增长率	-13.16%	-13.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018 年 06 月 30 日 ）	
期末可供分配利润	-22,410,545.97	-2,642,877.60
期末可供分配基金份额利润	-0.1935	-0.1958
期末基金资产净值	93,414,271.05	10,855,778.09
期末基金份额净值	0.8065	0.8042
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2018 年 06 月 30 日 ）	
基金份额累计净值增长率	-19.35%	-14.26%

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。

4.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 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	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	-6.87%	2.48%	-7.01%	2.50%	0.14%	-0.02%
过去三个月	-16.78%	1.93%	-17.38%	1.94%	0.60%	-0.01%
过去六个月	-13.16%	2.00%	-13.93%	2.00%	0.77%	0.00%
过去一年	-11.01%	1.66%	-12.68%	1.66%	1.67%	0.00%
自基金合同	-19.35%	1.39%	-24.55%	1.40%	5.20%	-0.01%

南方 500 信息 ETF 发起式联接 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	-6.91%	2.48%	-7.01%	2.50%	0.10%	-0.02%
过去三个月	-16.86%	1.93%	-17.38%	1.94%	0.52%	-0.01%
过去六个月	-13.32%	1.99%	-13.93%	2.00%	0.61%	-0.01%
过去一年	-11.37%	1.66%	-12.68%	1.66%	1.31%	0.00%
自基金合同	-14.26%	1.52%	-16.51%	1.53%	2.25%	-0.01%

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

注：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。

§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,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。

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		
孙伟	本基金基金经理	2016 年 8 月 17 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；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。

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 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》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。

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

本报告期中证 500 信息指数下跌 14.73%。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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 份额本报告期取得了超越业绩基准 0.77%的跟踪正偏离，较为理想地实现了投资目标。

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 0.8065 元，报告期内，份额净值增长率为-13.16%，同期业绩基准增长率为-13.93%；本基金 C 份额净值为 0.8042 元，报告期内，份额净值增长率为-13.32%，同期业绩基准增长率为-13.93%。

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 500 一级行业指数系列于 13 年 11 月发布，500 信息指数是其中成长性良好、历史表现优秀的行业指数，兼具中证 500 的中盘蓝筹属性和信息技术行业的新兴成长特性。自 15 年 6 月高点至本报告期末，指数估值已跌去近八成，最新市盈率已逼近历史最低水平。展望后市，500 信息指数有望在估值及业绩间找到新的平衡点。

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；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别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

无。

§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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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 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

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
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	4,165,703.20	4,605,964.72
结算备付金		16,000.86	35,859.00
存出保证金		11,239.46	13,893.01
交易性金融资产	6.4.7.2	100,871,138.68	83,885,625.00
其中：股票投资		4,122,164.68	1,279,447.00
基金投资		93,737,574.00	82,605,978.00
债券投资		3,011,400.00	200.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		67,547.79	-
应收利息	6.4.7.5	27,268.42	997.67
应收股利		-	-
应收申购款		311,578.76	118,122.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	38,093.40	28,133.30

资产总计		105,508,570.57	88,688,595.35
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2018 年 6 月 30 日**	**上年度末 2017 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		909,400.65	-
应付赎回款		136,207.23	301,574.27
应付管理人报酬		3,413.44	2,452.72
应付托管费		682.68	490.52
应付销售服务费		3,569.49	610.22
应付交易费用	6.4.7.7	1,758.12	2,454.30
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	183,489.82	365,122.47
负债合计		1,238,521.43	672,704.50
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	129,323,472.71	94,777,395.66
未分配利润	6.4.7.10	-25,053,423.57	-6,761,504.81
所有者权益合计		104,270,049.14	88,015,890.85
负债和所有者权益总计		105,508,570.57	88,688,595.35

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额 129,323,472.71 份，其中 A 类基金份额总额为 115,824,817.02 份，基金份额净值为 0.8065 元；C 类基金份额总额为 13,498,655.69 份，基金份额净值为 0.8042 元。

6.2 利润表

会计主体：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

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 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-14,319,907.28	-2,104,159.19
1.利息收入		69,279.13	75,087.01
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,512.48	15,568.33
债券利息收入		56,766.65	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	59,518.68

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-33,675.27	-931,721.97
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-49,309.03	-130,939.08
基金投资收益	6.4.7.13	-	-803,401.44
债券投资收益	6.4.7.14.1	5,228.90	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	10,404.86	2,618.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-14,504,793.78	-1,276,867.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	149,282.64	29,343.27
减：二、费用		235,260.89	220,412.57
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	22,062.09	20,836.67
2．托管费	6.4.10.2.2	4,412.40	4,167.37
3．销售服务费	6.4.10.2.3	15,261.23	614.88
4．交易费用	6.4.7.20	18,488.59	12,892.94
5．利息支出		54.12	-
其中：卖出回购金融资产支出		54.12	-
6．税金及附加		-	-
7．其他费用	6.4.7.20	174,982.46	181,900.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,555,168.17	-2,324,571.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,555,168.17	-2,324,571.76

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

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）	94,777,395.66	-6,761,504.81	88,015,890.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-14,555,168.17	-14,555,168.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值	34,546,077.05	-3,736,750.59	30,809,326.46

变动数 （净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	124,203,110.41	-11,702,167.68	112,500,942.73
2.基金赎回款	-89,657,033.36	7,965,417.09	-81,691,616.27
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）	129,323,472.71	-25,053,423.57	104,270,049.14
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 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）	150,743,156.12	-11,564,990.55	139,178,165.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,324,571.76	-2,324,571.76
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）	-15,203,401.58	1,192,766.31	-14,010,635.27
其中：1.基金申购款	10,323,550.32	-931,968.80	9,391,581.52
2.基金赎回款	-25,526,951.90	2,124,735.11	-23,402,216.79
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）	135,539,754.54	-12,696,796.00	122,842,958.54

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 基金基本情况

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(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可证监许可[2016]1193 号《关于准予南方中证 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注册的批复》核准，由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司，已于 2018 年 1 月 4 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 189,381,387.99 元，业经普华永道中

天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1053 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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》于 2016 年 8 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 189,486,112.63 份基金份额，其中认购资金利息折合 104,724.64 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《关于南方中证 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新增 C 类基金份额并修改基金合同的公告》以及更新的《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招募说明书》的有关规定，自 2017 年 2 月 23 日起，本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

本基金为中证 500 信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对中证 500 信息技术指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争控制本基金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%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定，本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。本基金可少量投资于非成份股、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%(已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内)。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称

“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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完全一致。

6.4.5 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。

6.4.6 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开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的转让收入免征增值税，对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，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c)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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	4,165,703.20
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	4,165,703.20

6.4.7.2 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		4,297,076.34	4,122,164.68	-174,911.66
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	3,005,200.20	3,011,400.00	6,199.80
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,005,200.20	3,011,400.00	6,199.80
资产支持证券		-	-	-
基金		114,517,033.83	93,737,574.00	-20,779,459.83
其他		-	-	-
合计		121,819,310.37	100,871,138.68	-20,948,171.69

注:基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按估值日目标 ETF 的份额净值确定公允价值。本

基金可采用股票组合申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 份额的买卖。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注:无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注:无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注:无。

6.4.7.5 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	538.45
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	6.48
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	4.59
合计	27,268.42

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	-
可收退补款	38,093.40
合计	38,093.40

6.4.7.7 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	1,758.12
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,758.12

6.4.7.8 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	362.80
预提费用	183,127.02
合计	183,489.82

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

南方 500 信息 ETF 发起式联接 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	92,703,729.50	92,703,729.50
本期申购	94,318,727.40	94,318,727.40
本期赎回（以“-”号填列）	-71,197,639.88	-71,197,639.88
-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	115,824,817.02	115,824,817.02

南方 500 信息 ETF 发起式联接 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	2,073,666.16	2,073,666.16
本期申购	29,884,383.01	29,884,383.01
本期赎回（以“-”号填列）	-18,459,393.48	-18,459,393.48
-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	13,498,655.69	13,498,655.69

注:申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

南方 500 信息 ETF 发起式联接 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,295,191.53	-5,316,624.90	-6,611,816.43
本期利润	-52,039.58	-12,866,567.65	-12,918,607.23
本期基金份额交易产生的变动数	-354,409.59	-2,525,712.72	-2,880,122.31
其中：基金申购款	-1,463,487.23	-7,773,485.79	-9,236,973.02
基金赎回款	1,109,077.64	5,247,773.07	6,356,850.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,701,640.70	-20,708,905.27	-22,410,545.97
南方 500 信息 ETF 发起式联接 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-30,871.00	-118,817.38	-149,688.38
本期利润	1,665.19	-1,638,226.13	-1,636,560.94
本期基金份额交易产生的变动数	-204,680.00	-651,948.28	-856,628.28
其中：基金申购款	-526,463.50	-1,938,731.16	-2,465,194.66
基金赎回款	321,783.50	1,286,782.88	1,608,566.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-233,885.81	-2,408,991.79	-2,642,877.60

6.4.7.11 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	12,015.64
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	327.06
其他	169.78
合计	12,512.48

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 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	-71,747.86
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	22,438.83

合计	-49,309.03

6.4.7.12.2 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	12,018,266.47
减：卖出股票成本总额	12,090,014.33
买卖股票差价收入	-71,747.86

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
赎回基金份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回股票成本总额	-
赎回差价收入	-

6.4.7.12.4 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	25,499,200.00
减：现金支付申购款总额	19,157,432.28
减：申购股票成本总额	6,319,328.89
申购差价收入	22,438.83

6.4.7.13 基金投资收益

注:无。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,724,409.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,594,980.00
减：应收利息总额	124,200.10
买卖债券差价收入	5,228.90

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

注:无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注:无。

6.4.7.16 衍生工具收益

注:无。

6.4.7.17 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	10,404.86
基金投资产生的股利收益	-
合计	10,404.86

6.4.7.18 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	-14,504,793.78
股票投资	-101,616.55
债券投资	6,199.80
资产支持证券投资	-
基金投资	-14,409,377.03
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	-14,504,793.78

6.4.7.19 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	126,345.64
补差费归资产	22,937.00
合计	149,282.64

注:1.本基金的赎回费率按持有期间递减，其中，A 类份额将不低于赎回费总额的 25%归入基金资产，C 类份额将赎回费收入全额归入基金资产。

2.本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中，A 类份额将不低于赎回费总额的 25%归入基金资产，C 类份额将赎回费收入全额归入基金资产。

6.4.7.20 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	18,391.80
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	96.79
其中：申购费	-
赎回费	-
其他	96.79
合计	18,488.59

6.4.7.21 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	26,778.95
信息披露费	146,339.67
银行费用	1,863.84
合计	174,982.46

6.4.7.22 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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 500 信息技术指数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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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1月1日 至 2017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	21,419,155.81	64.21	9,211,263.53	66.20

6.4.10.1.2 基金交易

注:无。

6.4.10.1.3 权证交易

注:无。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	2,141.92	64.21	1,228.24	69.86
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017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	921.16	66.20	399.14	22.62

注:1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	22,062.09	20,836.67
其中：支付销售机构的客户维护费	74,830.63	102,367.44

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) X 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 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 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,412.40	4,167.37

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农业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） X 0.10% /当年天数。

6.4.10.2.3 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 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 500 信息 ETF 发起式联接 A	南方 500 信息 ETF 发起式联接 C	合计
华泰证券		73.92	73.92
南方基金		5,383.13	5,383.13
合计	-	5,457.05	5,457.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方 500 信息 ETF 发起式联接 A	南方 500 信息 ETF 发起式联接 C	合计
南方基金	0.00	507.07	507.07
合计	-	507.07	507.07

注: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 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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 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

基金合同生效日（ 2016 年 8 月 17 日）持有的基金份额	30,006,916.66	-
期初持有的基金份额	11,006,916.66	-
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	11,006,916.66	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.5031%	-
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 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
基金合同生效日（ 2016 年 8 月 17 日）持有的基金份额	30,006,916.66	-
期初持有的基金份额	30,006,916.66	-
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	30,006,916.66	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	22.1388%	-

注:1.期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

6.4.10.4.2 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

注:无。

6.4.10.5 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 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017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
中国农业银行股份有限公司	4,165,703.20	12,015.64	2,695,611.29	13,187.04

注:本基金由基金托管人中国农业银行保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 132,510,000.00 份目标 ETF 基金份额，占其份额的比例为 80.22%(于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有 101,010,000.00 份目标 ETF 基金份额，占其份额的比例为 82.00%)。

6.4.10.7.2 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 1 月 1 日 至 2017 年 6 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）	-	-
当期交易基金产生的其他费用（元）	96.79	39.13
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）	233,717.97	306,154.74
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	46,743.59	61,230.95

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。

6.4.11 利润分配情况

注:无。

6.4.12 期末(2018 年 06 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位： 人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300324	旋极信息	2018-05-30	重大事项	9.49	-	-	1,402	14,062.03	13,304.98	-

注:本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注:无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。本基金为被动式指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和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，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的建设，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。

6.4.13.2 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农业银行，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 0.00%(2017 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(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。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流动性风险管理规定》第四十条。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 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	4,165,703.20	-	-	-	4,165,703.20
结算备付金	16,000.86	-	-	-	16,000.86
存出保证金	11,239.46	-	-	-	11,239.46
交易性金融资产	3,011,400.00	-	-	97,859,738.68	100,871,138.68
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	27,268.42	27,268.42
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	311,578.76	311,578.76
应收证券清算款	-	-	-	67,547.79	67,547.79
其他资产	-	-	-	38,093.40	38,093.40
资产总计	7,204,343.52	-	-	98,304,227.05	105,508,570.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	136,207.23	136,207.23
应付管理人报酬	-	-	-	3,413.44	3,413.44
应付托管费	-	-	-	682.68	682.68
应付证券清算款	-	-	-	909,400.65	909,400.65
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	3,569.49	3,569.49
应付交易费用	-	-	-	1,758.12	1,758.12
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	183,489.82	183,489.82
负债总计	-	-	-	1,238,521.43	1,238,521.43
利率敏感度缺口	7,204,343.52	-	-	97,065,705.62	104,270,049.14
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	4,605,964.72	-	-	-	4,605,964.72
结算备付金	35,859.00	-	-	-	35,859.00
存出保证金	13,893.01	-	-	-	13,893.01
交易性金融资产	-	-	200.00	83,885,425.00	83,885,625.00

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	997.67	997.67
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	118,122.65	118,122.65
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	28,133.30	28,133.30
资产总计	4,655,716.73	-	200.00	84,032,678.62	88,688,595.35
负债					
应付赎回款	-	-	-	301,574.27	301,574.27
应付管理人报酬	-	-	-	2,452.72	2,452.72
应付托管费	-	-	-	490.52	490.52
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	610.22	610.22
应付交易费用	-	-	-	2,454.30	2,454.30
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	365,122.47	365,122.47
负债总计	-	-	-	672,704.50	672,704.50
利率敏感度缺口	4,655,716.73	-	200.00	83,359,974.12	88,015,890.85

注:表中所示为本基金资产及负债的账面价值,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。

6.4.13.4.1.2 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 2.89%(2017 年 12 月 31 日：0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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或银行间同业市场交易的股票和债券，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、标的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。

6.4.13.4.3.1 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	4,122,164.68	3.95	1,279,447.00	1.45
交易性金融资产－基金投资	93,737,574.00	89.90	82,605,978.00	93.85
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	97,859,738.68	93.85	83,885,425.00	95.31

注:交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标 ETF 份额。

6.4.13.4.3.2 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）	
		本期末 （2018 年 6 月 30 日）	上年度末 （2017 年 12 月 31 日 ）
分析	业绩比较基准上升 5%	4,848,607.05	4,140,161.39
	业绩比较基准下降 5%	-4,848,607.05	-4,140,161.39

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注:无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	4,122,164.68	3.91
	其中：股票	4,122,164.68	3.91
2	基金投资	93,737,574.00	88.84
3	固定收益投资	3,011,400.00	2.85
	其中：债券	3,011,400.00	2.85
	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	4,181,704.06	3.96
8	其他各项资产	455,727.83	0.43
	合计	105,508,570.57	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	2,229,467.10	2.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	0.00	0.00
F	批发和零售业	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,874,391.58	1.80
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	0.00	0.00

L	租赁和商务服务业	18,306.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
S	综合	0.00	0.00
	合计	4,122,164.68	3.95

7.2.2 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。

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	002410	广联达	5,100	141,423.00	0.14
2	002049	紫光国微	3,200	141,184.00	0.14
3	000977	浪潮信息	5,900	140,715.00	0.13
4	002179	中航光电	3,030	118,170.00	0.11
5	603019	中科曙光	2,500	114,675.00	0.11
6	300383	光环新网	7,700	103,257.00	0.10
7	002268	卫 士 通	4,480	97,798.40	0.09
8	000066	中国长城	13,400	95,274.00	0.09
9	600584	长电科技	5,400	91,476.00	0.09
10	300315	掌趣科技	20,900	87,362.00	0.08
11	002439	启明星辰	4,100	87,002.00	0.08
12	002195	二三四五	20,150	86,242.00	0.08
13	000636	风华高科	5,400	85,752.00	0.08
14	000997	新 大 陆	5,400	85,050.00	0.08
15	300418	昆仑万维	4,400	83,072.00	0.08
16	300166	东方国信	5,540	81,604.20	0.08
17	300088	长信科技	13,900	80,620.00	0.08
18	002384	东山精密	3,200	76,800.00	0.07
19	002373	千方科技	5,600	73,080.00	0.07
20	002371	北方华创	1,400	69,538.00	0.07
21	002273	水晶光电	5,270	67,824.90	0.07
22	002174	游族网络	3,400	67,660.00	0.06
23	600718	东软集团	5,100	66,606.00	0.06
24	000988	华工科技	4,600	66,470.00	0.06

25	300010	立思辰	5,300	64,872.00	0.06
26	300287	飞利信	8,700	62,553.00	0.06
27	600260	凯乐科技	2,300	61,732.00	0.06
28	000970	中科三环	6,500	60,775.00	0.06
29	002517	恺英网络	8,100	58,239.00	0.06
30	600183	生益科技	6,225	57,021.00	0.05
31	002280	联络互动	9,900	56,628.00	0.05
32	300113	顺网科技	3,200	55,712.00	0.05
33	002368	太极股份	1,900	55,233.00	0.05
34	600460	士兰微	4,500	54,900.00	0.05
35	600410	华胜天成	6,200	54,250.00	0.05
36	002152	广电运通	9,200	54,096.00	0.05
37	002600	领益智造	10,300	53,457.00	0.05
38	300115	长盈精密	4,100	53,177.00	0.05
39	002745	木林森	2,800	49,812.00	0.05
40	002690	美亚光电	2,000	47,680.00	0.05
41	002180	纳思达	1,600	43,936.00	0.04
42	300002	神州泰岳	10,400	43,368.00	0.04
43	300308	中际旭创	700	42,028.00	0.04
44	002354	天神娱乐	4,300	39,818.00	0.04
45	000727	华东科技	20,600	38,728.00	0.04
46	002635	安洁科技	2,250	38,700.00	0.04
47	600171	上海贝岭	3,300	38,214.00	0.04
48	000021	深科技	5,600	38,192.00	0.04
49	002916	深南电路	600	38,106.00	0.04
50	300297	蓝盾股份	4,400	35,684.00	0.03
51	002544	杰赛科技	2,600	35,594.00	0.03
52	600563	法拉电子	700	34,643.00	0.03
53	600536	中国软件	1,600	34,608.00	0.03
54	002308	威创股份	4,100	34,030.00	0.03
55	002463	沪电股份	8,900	33,286.00	0.03
56	002657	中科金财	2,000	31,680.00	0.03
57	002815	崇达技术	1,900	30,590.00	0.03
58	002093	国脉科技	3,800	29,298.00	0.03
59	000536	华映科技	10,500	28,875.00	0.03
60	002642	荣之联	3,000	27,570.00	0.03
61	603000	人民网	3,300	27,390.00	0.03
62	002841	视源股份	500	26,705.00	0.03
63	603444	吉比特	200	25,558.00	0.02
64	002414	高德红外	1,900	25,536.00	0.02
65	002261	拓维信息	5,000	23,000.00	0.02
66	300202	聚龙股份	2,100	21,903.00	0.02

67	603888	新华网	1,250	21,075.00	0.02
68	300032	金龙机电	3,600	20,196.00	0.02
69	300043	星辉娱乐	4,700	18,800.00	0.02
70	603328	依顿电子	1,700	18,445.00	0.02
71	600640	号百控股	1,800	18,306.00	0.02
72	600651	飞乐音响	4,100	15,990.00	0.02
73	603228	景旺电子	315	15,573.60	0.01
74	300324	旋极信息	1,402	13,304.98	0.01
75	603025	大豪科技	240	4,641.60	-

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	603019	中科曙光	1,257,869.04	1.43
2	600584	长电科技	1,137,296.72	1.29
3	600260	凯乐科技	822,066.35	0.93
4	600460	士兰微	708,782.00	0.81
5	600183	生益科技	704,569.60	0.80
6	600718	东软集团	688,248.61	0.78
7	600410	华胜天成	554,236.00	0.63
8	002405	四维图新	530,014.86	0.60
9	601231	环旭电子	458,893.00	0.52
10	002049	紫光国微	452,537.00	0.51
11	002410	广联达	434,832.00	0.49
12	600171	上海贝岭	413,324.00	0.47
13	000977	浪潮信息	399,917.00	0.45
14	600563	法拉电子	390,912.00	0.44
15	002179	中航光电	383,191.00	0.44
16	000066	中国长城	344,713.00	0.39
17	000997	新 大 陆	328,770.00	0.37
18	603000	人民网	325,726.00	0.37
19	002268	卫 士 通	319,441.00	0.36
20	002439	启明星辰	319,355.00	0.36

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	002405	四维图新	570,414.54	0.65
2	002410	广联达	369,820.00	0.42
3	002049	紫光国微	360,750.00	0.41
4	000977	浪潮信息	333,067.00	0.38
5	603019	中科曙光	332,286.00	0.38
6	600584	长电科技	308,460.00	0.35
7	000050	深天马 A	305,752.14	0.35
8	002179	中航光电	298,276.00	0.34
9	000066	中国长城	281,110.00	0.32
10	300182	捷成股份	272,185.00	0.31
11	000997	新 大 陆	258,831.00	0.29
12	002439	启明星辰	256,468.00	0.29
13	002195	二三四五	252,608.00	0.29
14	300088	长信科技	245,941.00	0.28
15	002268	卫 士 通	241,978.00	0.27
16	300166	东方国信	215,281.00	0.24
17	002273	水晶光电	208,007.00	0.24
18	600718	东软集团	204,812.00	0.23
19	002373	千方科技	202,394.54	0.23
20	000970	中科三环	199,011.00	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	21,353,677.43
卖出股票收入（成交）总额	12,018,266.47

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	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	2.89
	其中：政策性金融债	3,011,400.00	2.89
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	2.89

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	2.89

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

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 500 信息技术指数 ETF	ETF	交易型开发式	南方基金管理股份有限公司	93,737,574.00	89.90

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

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11.2 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。

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

7.13.1

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。

7.13.2

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。

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
1	存出保证金	11,239.46
2	应收证券清算款	67,547.79
3	应收股利	-
4	应收利息	27,268.42
5	应收申购款	311,578.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	可收退补款	38,093.40
9	其他	-
	合计	455,727.83

7.13.4 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。

7.13.5 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
500 信息联接 A	9,300	12,454.28	11,304,041.35	9.76	104,520,775.67	90.24
500 信息联接 C	578	23,354.08	1,236,603.46	9.16	12,262,052.23	90.84
合计	9,878	13,092.07	12,540,644.81	9.70	116,782,827.90	90.30

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（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方 500 信息 ETF 发起式联接 A	95,736.62	0.0827
	南方 500 信息 ETF 发起式联接 C	-	-
	合计	95,736.62	0.0740

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 500 信息 ETF 发起式联接 A	-
	南方 500 信息 ETF 发起式联接 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	南方 500 信息 ETF 发起式联接 A	0~10
	南方 500 信息 ETF 发起式联接 C	-
	合计	0~10

8.4 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	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

		比例(%)		(%)	
基金管理人固有资金	11,006,916.66	8.51	10,000,000.00	7.73	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	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	11,006,916.66	8.51	10,000,000.00	7.73	自合同生效之日起不少于 3 年

§9 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
基金合同生效日（2016 年 8 月 17 日）基金份额总额	189,486,112.63	-
本报告期期初基金份额总额	92,703,729.50	2,073,666.16
本报告期基金总申购份额	94,318,727.40	29,884,383.01
减：本报告期基金总赎回份额	71,197,639.88	18,459,393.48
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	115,824,817.02	13,498,655.69

§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，基金管理人没有发生重大人事变动。

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

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	1	21,419,155.81	64.21%	2,141.92	64.21%	-
国泰君安	1	11,939,018.09	35.79%	1,193.99	35.79%	-

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
国泰君安	3,005,200.20	45.53%	-	-	-	-	-	-
华泰证券	3,594,989.00	54.47%	500,000.00	100.00%	-	-	-	-

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	南方基金管理有限公司关于东海期货有限责任公司终止代理销售本公司旗下基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 01 月 05 日
2	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 01 月 06 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招募说明书（更新）摘要（2018 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 03 月 23 日
5	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招募说明书（更新）（2018 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 03 月 23 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	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续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 31 日
9	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
10	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
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参加交通银行手机	中国证券报、上海证	2018 年 03 月 31 日

	银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	券报、证券时报	
14	南方基金关于旗下部分基金增加南京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 01 月 25 日
15	南方基金关于旗下部分基金增加万得基金、挖财基金、众禄基金、好买基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 04 日

§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

注：无。

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 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的文件。

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基金合同。

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。

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