南方中证全指房地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

2018 第二季度 报告

2018年6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
报告送出日期:2018年7月18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2018年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	南方房地产ETF发起联接	
基金主代码	004642	
交易代码	004642	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年8月24日	
报告期末基金份额总额	27,617,335.04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。	
业绩比较基准	本基金的标的指数为中证全指房地产指数。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	本基金的目标ETF为股票型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为ETF联接基金,通过投资于目标ETF跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	南方房地产联接A	南方房地产联接C
下属分级基金的交易代码	004642	004643
报告期末下属分级基金的份额总额	16,478,694.38份	11,138,640.66份

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下,可简称为“南方房地产联接”。

2.2 目标基金基本情况

基金名称	南方中证全指房地产交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512200
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017年8月25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9月25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

2.3 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金,采用完全复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率,本基金标的指数为中证全指房地产指数。
风险收益特征	本基金属股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数,以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日—2018年6月30日)	
	南方房地产联接A	南方房地产联接C
1.本期已实现收益	-77,133.60	-54,278.84
2.本期利润	-2,770,041.68	-1,601,780.48
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1644	-0.1696
4.期末基金资产净值	13,724,685.21	9,246,393.85
5.期末基金份额净值	0.8329	0.8301

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

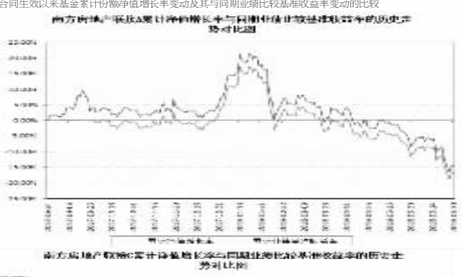
南方房地产联接A

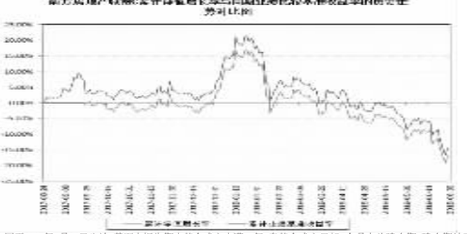
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-16.52%	1.33%	-17.23%	1.34%	0.71%	-0.01%

南方房地产联接C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-16.61%	1.33%	-17.23%	1.34%	0.62%	-0.01%

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

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗文杰	本基金基金经理	2017年8月24日	-	13	女,美国南加州大学数学金融硕士,美国加州大学计算机科学硕士,具有基金从业资格,曾任职于摩根士丹利投资银行,从事量化分析工作。2008年9月加入南方基金,任南方基金数量化投资部基金经理助理。2013年4月起担任数量化投资部基金经理,现任指数投资部、数量化投资部总经理。2013年5月至2015年6月,任南方策略基金经理;2013年4月至今,任南方300、南方500ETF基金经理;2013年5月至今,任南方300、南方开元沪深300ETF基金经理;2014年10月至今,任500医药基金经理;2015年2月至今,任南方恒生ETF基金经理;2016年12月至今,任南方安享绝对收益、南方卓然绝对收益基金经理;2017年7月至今,任恒生联接基金经理;2017年8月至今,任南方房地产联接、南方房地产ETF基金经理;2017年11月至今,任南方策略、南方量化混合基金经理;2018年2月至今,任4股ETF、南方4股ETF联接基金经理;2018年4月至今,任MSCI基金基金经理;2018年6月至今,任MSCI联接基金经理。

注:1、本基金百任基金经理的任职日期为本基金合同生效日,后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告(生效)日期;
2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,全指地产指数跌18.08%。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”、“ETF现金流精算系统”等,将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平,并通过严格的风险管理流程,确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下:

(1) 大额申购赎回带来的成份股权重偏差,对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化;
(2) 报告期内指数成份股(包括调出指数成分股)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;
(3) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离;
(4) 报告期内,我们根据指数每半年度成份股调整进行了基金调仓,事前我们制定了详细的调仓方案,在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生,从实施结果来看,效果良好,跟踪误差控制在理想范围内。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A份额净值为0.8329元,报告期内,份额净值增长率为-16.52%,同期业绩基准增长率为-17.23%;本基金C份额净值为0.8301元,报告期内,份额净值增长率为-16.61%,同期业绩基准增长率为-17.23%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

不适用。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	632,286.30	2.67
	其中:股票	632,286.30	2.67
2	基金投资	21,187,387.96	89.63
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	1,721,369.14	7.28
8	其他资产	97,618.92	0.41
9	合计	23,638,662.32	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	-	-
C	制造业	4,320.00	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,834.00	0.04
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	701.00	0.00
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	607,227.90	2.64
L	租赁和商务服务业	3,419.00	0.01
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	7,784.40	0.03
	合计	632,286.30	2.75

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600048	保利地产	5,500	67,100.00	0.29
2	000002	万 科A	2,700	66,420.00	0.29
3	001979	招商蛇口	1,800	34,290.00	0.15
4	600340	华夏幸福	900	23,175.00	0.10
5	601155	新城控股	700	21,679.00	0.09
6	600606	绿地控股	2,800	18,312.00	0.08
7	000069	华侨城A	2,500	18,075.00	0.08
8	600383	金地集团	1,700	17,323.00	0.08
9	600208	新湖中宝	3,300	12,606.00	0.05
10	002146	荣盛发展	1,300	11,349.00	0.05

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	南方中证全指房地产ETF	股票型	交易型开放式	南方基金管理股份有限公司	21,187,387.96	92.24

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货合约。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。如是,还应对相关证券的投资决策程序做出说明

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。

5.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是,还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,368.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	285.85
5	应收申购款	89,362.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	1,601.40
9	合计	97,618.92

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	南方房地产联接A	南方房地产联接C
报告期期初基金份额总额	16,936,151.61	8,366,993.22
报告期期间基金总申购份额	2,246,840.74	8,501,167.28
减:报告期期间基金总赎回份额	2,704,297.97	5,729,519.84
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	16,478,694.38	11,138,640.66

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

项目	份额
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,002,111.32
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期末管理人持有的本基金份额	10,002,111.32
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	36.22

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,111.32	36.22	10,002,111.32	36.22	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	50,228.01	0.18	0.00	0.00	-
基金管理人股东					-
其他					-
合计	10,052,339.33	36.40	10,002,111.32	36.22	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180401-20180630	10,002,111.32	0.00	0.00	10,002,111.32	36.22%
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、《南方中证全指房地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》;
2、《南方中证全指房地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》;
3、南方中证全指房地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金2018年2季度报告原文。

10.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层。

10.3 查阅方式

网站:http://www.nffund.com

南方中证全指房地产交易型开放式指数证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6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
报告送出日期:2018年7月18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2018年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	南方中证全指房地产ETF
场内简称	房地产
基金主代码	512200
交易代码	512200
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017年8月25日
报告期末基金份额总额	52,376,000.00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全指房地产指数。
风险收益特征	本基金属股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型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	南方基金管理股份有限公司
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“房地产”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日-2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-3,616,500.63
2.本期利润	-8,312,619.90
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1637
4.期末基金资产净值	41,659,086.32
5.期末基金份额净值	0.7954

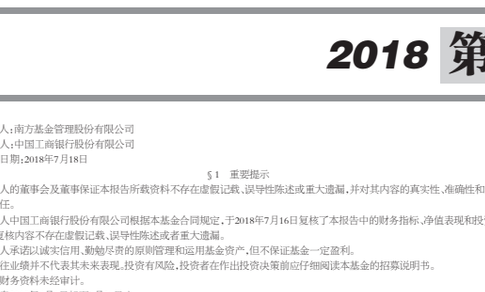
注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-17.11%	1.46%	-18.08%	1.41%	0.97%	-0.01%

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:本基金合同于2017年8月25日生效,截至本报告期末基金成立未满一年;自基金成立日起3个月内为建仓期,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗文杰	本基金基金经理	2017年8月25日	-	13	女,美国南加州大学数学金融硕士,美国加州大学计算机科学硕士,具有基金从业资格,曾任职于摩根士丹利投资银行,从事量化分析工作。2008年9月加入南方基金,任南方基金数量化投资部基金经理助理。2013年4月起担任数量化投资部基金经理,现任指数投资部、数量化投资部总经理。2013年5月至2015年6月,任南方策略基金经理;2013年4月至今,任南方300、南方500ETF基金经理;2013年5月至今,任南方300、南方开元沪深300ETF基金经理;2014年10月至今,任500医药基金经理;2015年2月至今,任南方恒生ETF基金经理;2016年12月至今,任南方安享绝对收益、南方卓然绝对收益基金经理;2017年7月至今,任恒生联接基金经理;2017年8月至今,任南方房地产联接、南方房地产ETF基金经理;2017年11月至今,任南方策略、南方量化混合基金经理;2018年2月至今,任4股ETF、南方4股ETF联接基金经理;2018年4月至今,任MSCI基金基金经理;2018年6月至今,任MSCI联接基金经理。

注:1、本基金百任基金经理的任职日期为本基金合同生效日,后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告(生效)日期;
2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,全指地产指数跌18.08%。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”、“ETF现金流精算系统”等,将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平,并通过严格的风险管理流程,确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下:

(1) 大额申购赎回带来的成份股权重偏差,对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化;
(2) 报告期内指数成份股(包括调出指数成分股)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;
(3) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离;
(4) 报告期内,我们根据指数每半年度成份股调整进行了基金调仓,事前我们制定了详细的调仓方案,在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生,从实施结果来看,效果良好,跟踪误差控制在理想范围内。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.7954元,报告期内,份额净值增长率为-17.11%,同期业绩基准增长率为-18.08%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,2018年4月10日至2018年6月29日,已出现连续56个交易日基金资产净值低于五千万人民币的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	39,458,202.12	94.05
	其中:股票	39,458,202.12	94.05
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	2,478,013.61	5.91
8	其他资产	19,862.57	0.05
9	合计	41,956,078.30	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 报告期末按指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	274,560.00	0.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	569,162.00	1.37
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	84,120.00	0.20
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	37,744,846.72	90.60
L	租赁和商务服务业	210,137.00	0.50
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	529,869.20	1.27
	合计	39,412,694.92	94.61

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
K	房地产业	45,506.00	0.11
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	45,506.00	0.11

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600048	保利地产	346,011	4,221,334.20	10.13
2	000002	万 科A	167,842	4,128,913.20	9.91
3	001979	招商蛇口	115,300	2,196,465.00	5.27
4	600340	华夏幸福	57,500	1,480,625.00	3.55
5	601155	新城控股	43,900	1,359,583.00	3.26
6	600606	绿地控股	177,500	1,160,850.00	2.79
7	000069	华侨城A	159,600	1,153,908.00	2.77
8	600383	金地集团	109,800	1,118,862.00	2.69
9	600208	新湖中宝	209,100	798,762.00	1.92
10	002146	荣盛发展	84,600	738,558.00	1.77

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600052	浙江广厦	12,200	45,506.00	0.11

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

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

5.10.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是,还应对相关证券的投资决策程序做出说明。

本基金投资的前十名证券的发行主体(除兴业银行601166)以外,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。

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。

基金管理人对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

5.11.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是,还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	19,350.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	512.38
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,862.57

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600052	浙江广厦	45,506.00	0.11	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	52,376,000.00
报告期期间基金总申购份额	54,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	54,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	52,376,000.00

§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

本报告期末,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

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