

南方中证500量化增强股票型发起式证券投资基金

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
报告期末基金份额总额:4,242,948,000.00份

主要财务指标
1.本期基金份额净值增长率:1.31%
2.本期基金份额净值增长率标准差:0.89%
3.本期基金份额净值增长率与业绩比较基准之差:0.00%

资产配置情况
股票资产:87.23%
债券资产:10.81%
货币资产:1.96%

行业配置情况
医药生物:11.23%
计算机:10.12%
电气设备:9.87%

前十名重仓股
1.贵州茅台:11.23%
2.五粮液:8.76%
3.美的集团:7.45%

基金管理人及基金经理简介
基金经理:李伟,毕业于清华大学,具有10年以上证券从业经验。

基金业绩比较基准
南方中证500量化增强股票型发起式证券投资基金业绩比较基准:
中证500指数收益率*85%+中债综合全价指数收益率*15%

基金管理人承诺
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,为基金份额持有人谋求最大利益。

基金托管人承诺
基金托管人承诺按照法律法规和基金合同的规定,履行托管职责,安全保管基金财产。

基金销售机构
基金销售机构包括:南方基金直销中心、各大银行、证券公司、第三方销售平台。

基金费率
申购费率:0.8%
赎回费率:0.5%
管理费:1.2%

基金合同生效日期
2018年12月18日

基金管理人及基金经理简介
基金经理:李伟,毕业于清华大学,具有10年以上证券从业经验。

基金业绩比较基准
南方中证500量化增强股票型发起式证券投资基金业绩比较基准:
中证500指数收益率*85%+中债综合全价指数收益率*15%

基金管理人承诺
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,为基金份额持有人谋求最大利益。

基金托管人承诺
基金托管人承诺按照法律法规和基金合同的规定,履行托管职责,安全保管基金财产。

基金销售机构
基金销售机构包括:南方基金直销中心、各大银行、证券公司、第三方销售平台。

基金资产净值变动情况
基金资产净值:4,242,948,000.00元
基金份额总额:4,242,948,000.00份

基金资产净值变动原因
本期基金资产净值变动主要来源于股票投资收益及债券投资收益。

基金资产净值变动对基金资产净值的影响
本期基金资产净值变动对基金资产净值的影响为1.31%。

基金资产净值变动对基金资产净值的贡献
股票资产贡献:1.15%
债券资产贡献:0.16%

基金资产净值变动对基金资产净值的贡献
医药生物:1.15%
计算机:1.01%

基金资产净值变动对基金资产净值的贡献
贵州茅台:1.15%
五粮液:0.88%

MSCI中国A股国际通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
报告期末基金份额总额:1,425,948,000.00份

主要财务指标
1.本期基金份额净值增长率:1.31%
2.本期基金份额净值增长率标准差:0.89%
3.本期基金份额净值增长率与业绩比较基准之差:0.00%

资产配置情况
股票资产:87.23%
债券资产:10.81%
货币资产:1.96%

行业配置情况
医药生物:11.23%
计算机:10.12%
电气设备:9.87%

前十名重仓股
1.贵州茅台:11.23%
2.五粮液:8.76%
3.美的集团:7.45%

基金管理人及基金经理简介
基金经理:李伟,毕业于清华大学,具有10年以上证券从业经验。

基金业绩比较基准
MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金业绩比较基准:
MSCI中国A股国际通交易型开放式指数基金收益率*95%+中债综合全价指数收益率*5%

基金管理人承诺
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,为基金份额持有人谋求最大利益。

基金托管人承诺
基金托管人承诺按照法律法规和基金合同的规定,履行托管职责,安全保管基金财产。

基金销售机构
基金销售机构包括:南方基金直销中心、各大银行、证券公司、第三方销售平台。

基金费率
申购费率:0.8%
赎回费率:0.5%
管理费:1.2%

基金合同生效日期
2018年12月18日

基金管理人及基金经理简介
基金经理:李伟,毕业于清华大学,具有10年以上证券从业经验。

基金业绩比较基准
MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金业绩比较基准:
MSCI中国A股国际通交易型开放式指数基金收益率*95%+中债综合全价指数收益率*5%

基金管理人承诺
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,为基金份额持有人谋求最大利益。

基金托管人承诺
基金托管人承诺按照法律法规和基金合同的规定,履行托管职责,安全保管基金财产。

基金销售机构
基金销售机构包括:南方基金直销中心、各大银行、证券公司、第三方销售平台。

基金资产净值变动情况
基金资产净值:1,425,948,000.00元
基金份额总额:1,425,948,000.00份

基金资产净值变动原因
本期基金资产净值变动主要来源于股票投资收益及债券投资收益。

基金资产净值变动对基金资产净值的影响
本期基金资产净值变动对基金资产净值的影响为1.31%。

基金资产净值变动对基金资产净值的贡献
股票资产贡献:1.15%
债券资产贡献:0.16%

基金资产净值变动对基金资产净值的贡献
医药生物:1.15%
计算机:1.01%

基金资产净值变动对基金资产净值的贡献
贵州茅台:1.15%
五粮液:0.88%

基金资产净值变动对基金资产净值的贡献
贵州茅台:1.15%
五粮液:0.88%