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。

[del]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[/del][add]基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定[/add]，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。

1. 基金产品概况
   1. 基金基本情况

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 基金简称 | 南方全指证券联接 | |
| 基金主代码 | 004069 | |
| [del]基金主[/del][add]交易[/add]代码 | [del]160119[/del][add]004069[/add] | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017年3月8日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 332,300,100.30份 | |
| 投资目标 | 本基金通过投资于目标ETF，紧密跟踪[add]标的指数，追求与[/add]业绩比较基准[del]，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。[/del]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×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。本基金标的指数为中证全指证券公司指数。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为ETF联接基金，通过投资于目标ETF跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。 | |
| 基金管理人 | 南方基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 南方全指证券联接A | 南方全指证券联接C |
| 下属分级基金的交易代码 | 004069 | 004070 |
| [add]报告期末下属分级基金的份额总额[/add] | [add]95,176,113.02份[/add] | [add]237,123,987.28份[/add] |

[add]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[/add]