

# 南方中证 1000 交易型开放式指数证券 投资基金发起式联接基金 2021 年第 4 季 度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 1 月 24 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 20 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 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 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 1000ETF 发起式联接
基金主代码	011860
交易代码	011860
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 27 日
报告期末基金份额总额	127,313,936.49 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	本基金为完全被动式指数基金，主要投资于目标 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%。主要投资策略包括：资产配置策略、目标 ETF 投资策略、成份股、备选成份股投资策略、金融衍生品投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略等以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金的目标 ETF 为股票型基金，一般而言，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	南方中证 1000ETF 发起式联接 A	南方中证 1000ETF 发起式联接 C
下属分级基金的交易代码	011860	011861
报告期末下属分级基金的份额总额	64,636,551.97 份	62,677,384.52 份

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“南方中证 1000ETF 发起式联接”。

## 2.2 目标基金基本情况

基金名称	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512100
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2016 年 9 月 29 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016 年 11 月 4 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	招商银行股份有限公司

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“1000ETF”或“中证 1000ETF”。

## 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	中证 1000 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。

## § 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（2021 年 10 月 1 日—2021 年 12 月 31 日）	
	南方中证 1000ETF 发起式联接 A	南方中证 1000ETF 发起式联接 C
1.本期已实现收益	755,467.78	753,222.79
2.本期利润	5,294,739.29	3,633,017.44
3.加权平均基金份额本期利润	0.0676	0.0493
4.期末基金资产净值	69,048,289.92	66,937,825.36
5.期末基金份额净值	1.0683	1.0680

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

南方中证 1000ETF 发起式联接 A

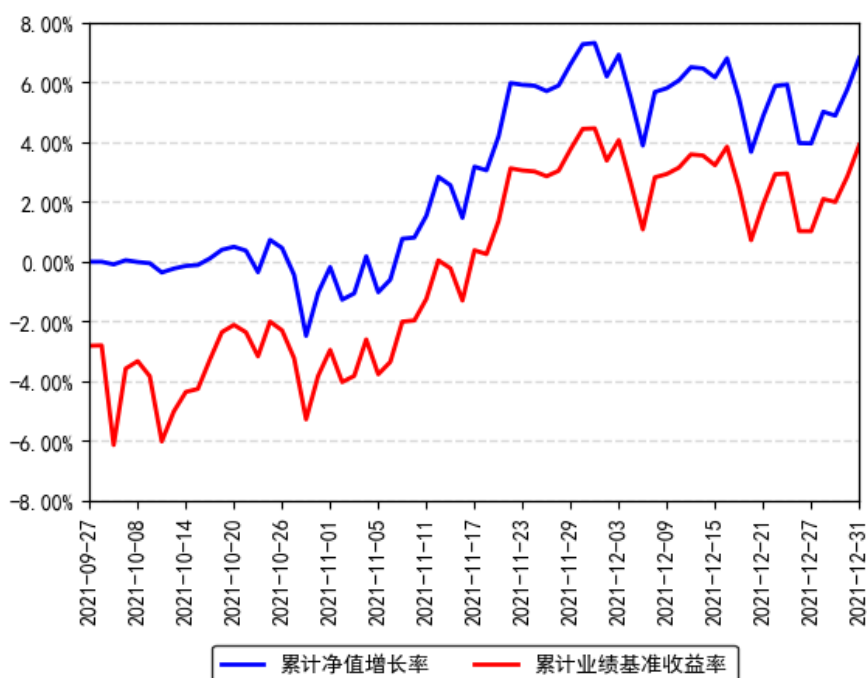
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.78%	0.90%	7.77%	1.00%	-0.99%	-0.10%
自基金合同生效起至今	6.83%	0.88%	3.91%	1.17%	2.92%	-0.29%

南方中证 1000ETF 发起式联接 C

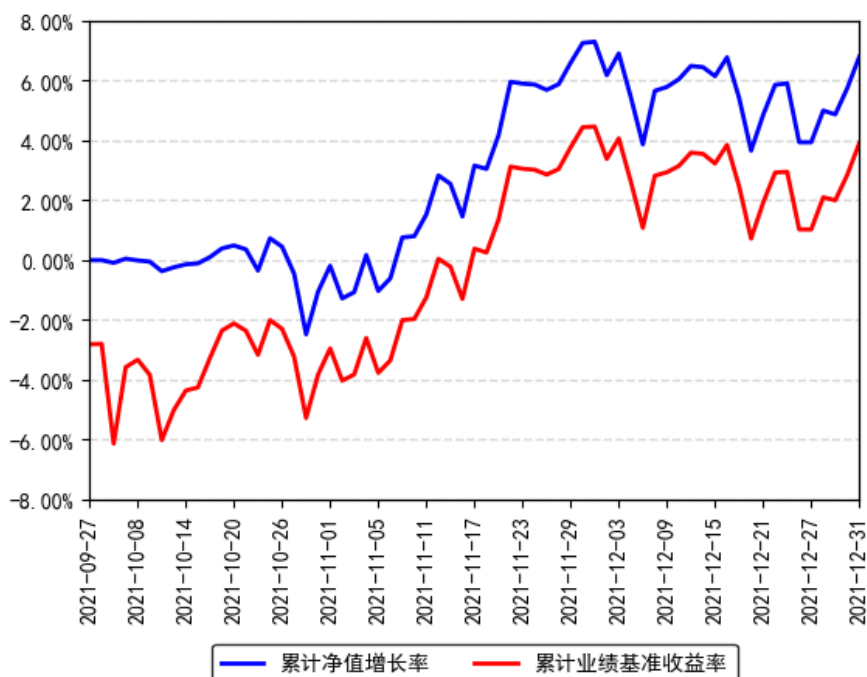
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.75%	0.90%	7.77%	1.00%	-1.02%	-0.10%
自基金合同生效起至今	6.80%	0.87%	3.91%	1.17%	2.89%	-0.30%

#### 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

南方中证1000ETF发起式联接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



南方中证1000ETF发起式联接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：本基金合同于2021年9月27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个月内为建仓期，截至报告期末建仓期尚未结束。

## § 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		
崔蕾	本基金基金经理	2021 年 9 月 27 日	-	6 年	女，康奈尔大学金融工程硕士，金融风险管理师（FRM），特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2015 年 2 月加入南方基金，历任数量化投资部助理研究员、研究员，指数投资部研究员；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 4 月 23 日，任南方小康 ETF、南方小康 ETF 联接基金经理；2018 年 11 月 8 日至今，任南方中证 500 增强基金经理；2019 年 6 月 12 日至今，任南方顶峰 TOPIX ETF（QDII）基金经理；2019 年 6 月 28 日至今，任大数据 300 基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任有色金属、南方有色金属联接、1000ETF 基金经理；2019 年 11 月 29 日至今，任南方粤港澳大湾区 ETF 基金经理；2020 年 1 月 17 日至今，任红利 50 基金经理；2020 年 1 月 21 日至今，任南方大盘红利 50 基金经理；2020 年 3 月 26 日至今，任南方粤港澳大湾区联接基金经理；2021 年 6 月 24 日至今，任南方中证科创创业 50ETF 基金经理；2021 年 8 月 19 日至今，任南方中证科创创业 50ETF 联接基金经理；2021 年 9 月 27 日至今，任南方中证 1000 联接基金经理；2021 年 12 月 29 日至今，任南方国证在线消费 ETF 基金经理。

注：1、本基金首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合规守信情况的说明

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利益。本报告期内，本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，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内中证 1000 指数上涨 8.17%。

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) 新股上市初期涨幅较大的影响；
- (2) 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；
- (3) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离；
- (4) 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。
- (5) 根据指数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。

## 4.5 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 1.0683 元，报告期内，份额净值增长率为 6.78%，同期业绩基准增长率为 7.77%；本基金 C 份额净值为 1.0680 元，报告期内，份额净值增长率为 6.75%，同期业绩基准增长率为 7.77%。

## 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	2,776,579.01	1.96
	其中：股票	2,776,579.01	1.96
2	基金投资	123,087,417.10	86.99
3	固定收益投资	5,001,500.00	3.53
	其中：债券	5,001,500.00	3.53
	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	8,766,628.41	6.20
8	其他资产	1,856,571.13	1.31
9	合计	141,488,695.65	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

金额单位：人民币元

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	16,228.00	0.01
B	采矿业	76,106.00	0.06
C	制造业	1,937,970.13	1.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	80,028.00	0.06
E	建筑业	60,391.00	0.04
F	批发和零售业	74,600.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	43,374.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	254,644.88	0.19
J	金融业	47,233.00	0.03
K	房地产业	51,644.00	0.04
L	租赁和商务服务业	15,688.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	40,983.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	43,771.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-



Q	卫生和社会工作	11,648.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	19,873.00	0.01
S	综合	2,397.00	0.00
	合计	2,776,579.01	2.04

### 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 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	600986	浙文互联	3,400	28,662.00	0.02
2	300012	华测检测	800	21,496.00	0.02
3	688122	西部超导	220	21,326.80	0.02
4	603026	石大胜华	100	19,799.00	0.01
5	002176	江特电机	800	16,608.00	0.01
6	600072	中船科技	1,100	16,115.00	0.01
7	002850	科达利	100	16,034.00	0.01
8	002326	永太科技	300	15,363.00	0.01
9	002756	永兴材料	100	14,802.00	0.01
10	601058	赛轮轮胎	1,000	14,790.00	0.01

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 5.4 报告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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	5,001,500.00	3.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	5,001,500.00	3.68

## 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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019654	21 国债 06	50,000	5,001,500.00	3.68

## 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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	南方中证 1000ETF	股票型	交易型开放式	南方基金管理股份有限公司	123,087,417.10	90.51

## 5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

## 5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2201	IC2201	2	2,951,120.00	35,540.00	-
公允价值变动总额合计（元）					35,540.00
股指期货投资本期收益（元）					142,854.37
股指期货投资本期公允价值变动（元）					35,540.00

## 5.10.2 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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。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。

## 5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

## 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

报告期内基金投资的前十名证券除江特电机（证券代码 002176）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。

江特电机 2021 年 12 月 10 日公告称，因未及时披露公司重大事项，中国证券监督管理委员会对公司立案调查。

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。

### 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

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	442,494.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	84,128.64
5	应收申购款	306,979.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	1,022,968.36

9	合计	1,856,571.13
---	----	--------------

#### 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

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	600072	中船科技	16,115.00	0.01	重大事项停牌

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方中证 1000ETF 发起式联接 A	南方中证 1000ETF 发起式联接 C
报告期期初基金份额总额	93,484,707.13	111,715,573.28
报告期期间基金总申购份额	4,991,548.66	58,727,865.55
减：报告期期间基金总赎回份额	33,839,703.82	107,766,054.31
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	64,636,551.97	62,677,384.52

## § 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	10,003,819.82
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,003,819.82
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	7.86

### 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	10,003,819.82	7.86	10,000,000.00	7.85	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	100,013.88	0.08	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,103,833.70	7.94	10,000,000.00	7.85	-

## § 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、《南方中证 1000 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 1000 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 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 2021 年 4 季度报告原文。

### 10.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

### 10.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>