

南方基金南方东英沙特阿拉伯交易型 开放式指数证券投资基金（QDII）2024 年第3季度报告

2024年09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：2024年10月25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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 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 2024 年 7 月 5 日（基金合同生效日）起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 南方基金南方东英沙特阿拉伯 ETF（QDII） |
| 场内简称 | 沙特 ETF |
| 基金主代码 | 159329 |
| 交易代码 | 159329 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2024 年 7 月 5 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 504,689,188.00 份 |
| 投资目标 | 本基金主要通过投资于标的 ETF，力求紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金以标的 ETF 作为其主要投资标的，方便投资人通过本基金投资标的 ETF。本基金并不参与标的 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、标的 ETF 投资策略、标的指数成份股/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、境内融资及转融通证券出借业务投资策略、境内存托凭证投资策略、境外市场基金 |

| | |
|---------|---|
| | 投资策略、境外回购交易及证券借贷交易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 | 本基金的业绩比较基准为经汇率调整后的标的指数收益率。本基金标的指数为富时沙特阿拉伯指数。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，一般而言，其长期平均风险与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。本基金主要通过投资于标的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境外证券市场相似的风险收益特征。 本基金主要通过投资香港证券市场上市的ETF投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 |
| 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 |
| 境外资产托管人 | 英文名称：Citibank N.A. |
| | 中文名称：美国花旗银行有限公司 |

§ 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 | 2024年7月5日(基金合同生效日)-2024年9月30日 |
|----------------|-------------------------------|
| 1.本期已实现收益 | -8,207,220.79 |
| 2.本期利润 | 451,452.71 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0006 |
| 4.期末基金资产净值 | 507,878,638.95 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0063 |

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、本基金合同于2024年7月5日生效，截至本报告期末基金成立未满一季度。

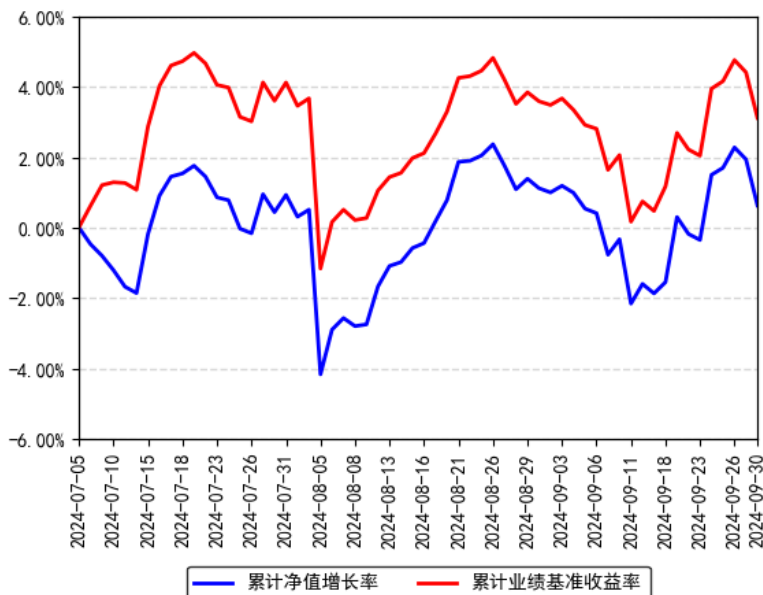
3.2 基金净值表现

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 | 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 0.63% | 0.94% | 3.12% | 0.92% | -2.49% | 0.02% |

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

南方基金南方东英沙特阿拉伯ETF（QDII）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2024年7月5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 | | |
| 罗文杰 | 本基金基金经理 | 2024年7月5日 | - | 19年 | 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 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理；现任指数投资部总经理。2013年5月17日至2015年6月16日，任南方策略基金经理；2017年11月9日至2019年1月18日，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016年12月30日至2019年4月18日，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2018年2月8日至2020年3月27日，任H股ETF基金经理；2018年2月12日至2020年3月27日，任南方H股联接基金经理；2014年10月30日至2020年12月23日，任500医药基金经理；2021年3月12日至2023年2月24日，任南方中证创新药产业ETF基金经理；2021年10月22日至2023年2月24日，任南方中证全指医疗保健ETF基金经理；2020年12月25日至2023年8月25日，任南方策略基金经理；2021年7月2日至2023年8月25日，任南方中证香港科技ETF（QDII）基金经理；2022年6月17日至2023年8月25日，任南方恒生香港上市生物科技ETF（QDII）基金经理；2023年5月30日至2024年7月5日，任南方恒生香港上市生物科技ETF发起联接（QDII）基金经理；2013年4月22日至今，任南方500、南方500ETF基金经理；2013年5月17日至今，任南方300、南方300联接基金经理；2015年2月16日至今，任南方恒生ETF基金经理；2017年7月21日至今，任恒生联接基金经理；2017年8月24日至今，任南方房地产联接基金经理；2017年8月25日至今，任南方房地产ETF基金经理；2018年4月3日至今，任MSCI基金基金经理；2018年6月8日至今，任MSCI联接基金经理；2020年7月24日至今，兼任投资经理；2024年6月26日至今，任南方中证国新港股通央企红利ETF基金经理；2024年7月5日至今，任南方基金南方东英沙特阿拉伯ETF（QDII）基金经理；2024年9月12日至今，任南方中证国新港股通央企红利ETF发起联接基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|

| | | | | |
|-----|---------|-----------|------|---|
| 潘水洋 | 本基金基金经理 | 2024年7月5日 | - 7年 | 北京大学金融学专业博士，具有基金从业资格。曾就职于深圳迈瑞生物医疗电子股份有限公司，任系统研究员。2017年7月加入南方基金，历任量化投资部量化研究员、宏观策略部策略研究员、指数投资部研究员；2021年6月4日至2024年3月7日，任投资经理；2024年3月7日至今，任南方中证全指计算机ETF基金经理；2024年3月13日至今，任南方中证机器人指数发起基金经理；2024年6月26日至今，任南方中证国新港股通央企红利ETF基金经理；2024年7月5日至今，任南方基金南方东英沙特阿拉伯ETF（QDII）基金经理；2024年7月23日至今，任南方中证全指计算机ETF发起联接基金经理；2024年9月3日至今，任南方中证全指汽车指数发起基金经理；2024年9月12日至今，任南方中证国新港股通央企红利ETF发起联接基金经理。 |
|-----|---------|-----------|------|---|

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中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值(元) | 任职时间 |
|-----|----------|---------|--------------------|-------------|
| 罗文杰 | 公募基金 | 13 | 156,204,052,690.85 | 2013年04月22日 |
| | 私募资产管理计划 | 8 | 2,589,852,336.63 | 2020年08月07日 |
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 21 | 158,793,905,027.48 | - |

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 11 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本产品跟踪富时沙特阿拉伯指数，富时沙特阿拉伯指数是代表沙特阿拉伯的市值加权指数，囊括富时全球指数中的具有沙特阿拉伯国籍的大型及中型上市公司。2024 年三季度，富时沙特阿拉伯指数上涨 2.31%。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 ETF 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）申购赎回过程中的港元汇率变动，实际换汇汇率与结算汇率的差异。

4.5.2 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 1.0063 元，报告期内，份额净值增长率为 0.63%，同期业绩基准增长率为 3.12%。

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，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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（人民币元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：普通股 | - | - |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 506,857,096.85 | 86.82 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中：远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 6,333,011.02 | 1.08 |
| 8 | 其他资产 | 70,632,453.75 | 12.10 |
| 9 | 合计 | 583,822,561.62 | 100.00 |

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票或存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有指数投资的股票或存托凭证。

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票或存托凭证。

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

5.4.1 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有指数投资的股票或存托凭证。

5.4.2 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票或存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 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。

5.8 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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 (人民币 元) | 占基金资 产净值比 例 (%) |
|----|-----------------------------|------|------------|-------------------------------------|--------------------|-----------------------|
| 1 | CSOP Saudi Arabia ETF | ETF | 交易型开 放式 | CSOP Asset Manageme nt Ltd | 506,857,09 6.85 | 99.80 |

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.3 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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 70,632,453.75 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 70,632,453.75 |

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 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

本基金本报告期末未持有指数投资的股票。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2024年7月5日)基金份额总额 | 633,689,188.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 407,500,000.00 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 536,500,000.00 |

| | |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 504,689,188.00 |

§ 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 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20240829-20240901; 20240925-20240929; 20240903-20240908 | - | 437,607,174.00 | 341,831,567.00 | 95,775,607.00 | 18.98% |
| 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《南方基金南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》；
- 2、《南方基金南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金(QDII)托管协议》；
- 3、南方基金南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2024 年 3 季度报告原文。

9.2 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。

9.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>