

南方创业板交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(2018年第4号)

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
截止日:2018年05月13日

或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是,还应对相关事务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,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1.11.2 报告期内基金投资的前十名证券是否属于基金合同规定的备选股票库。如是,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股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

1.11.1 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	6,152,173
2	应收证券清算款	3,084,225
3	应收利息	-
4	应收股利	-447,29
5	应收申购款	-
6	预缴税款	-
7	其他资产	-
8	合计	10,789,099

1.11.1 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

期末积极投资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	期末公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况
1	002091	招商证券	11,062,20	0.00	新增上市

基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证投资最低收益。

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

1.2 报告期内基金资产组合情况

本报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	29,390,674.14	6.39
B	采矿业	-	-
C	制造业	222,781,099.58	48.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,989,828.75	1.74
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	121,974,639.89	26.53
I	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,135,706.82	0.90
M	科学研究和技术服务业	4,842,471.00	1.05
N	水利、环境和公共设施服务业	19,391,456.78	4.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	17,543,529.70	3.82
R	文化、体育和娱乐业	25,284,783.00	5.50
S	综合	453,334,919.66	98.61

1.2.1 报告期内基金资产组合的境内股票投资组合

本报告期末按行业分类的境内股票投资组合(指数投资部分)

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	68,658.42	0.01
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	36,659.82	0.01
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	34,203.96	0.01
J	房地产业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施服务业	-	-
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	139,522.00	0.03

1.2.2 报告期末按行业分类的港股投资资产组合

注:本基金本报告期末未持有港股投资资产。

1.2.3 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	300498	蓝黛股份	1,808,949	29,206,674.14	6.39
2	300059	东方财富	1,123,468	19,020,312.24	4.14
3	300124	汇川技术	398,294	14,043,675.82	3.06
4	300003	普华永道	345,576	11,655,824.71	2.53
5	300136	信维通信	300,920	11,227,325.20	2.44
6	300072	三泰电子	577,819	10,925,200.20	2.38
7	300070	大华股份	339,208	9,596,320.28	2.20
8	300408	三环集团	411,829	9,037,433.77	2.16
9	300024	华谊集团	468,800	9,793,232.00	2.13
10	300142	济丰新材	449,500	9,668,745.00	2.10

1.2.4 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股指期货合约

注:本基金本报告期末未持有股指期货合约。

1.2.5 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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

1.2.6 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资产支持证券明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.2.7 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

1.2.8 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货合约。

1.2.9 报告期末本基金投资的远期合约持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有远期合约。

1.2.10 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有期权投资。

1.2.11 报告期末本基金投资的互换合约持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有互换合约。

1.2.12 报告期末本基金投资的结构性衍生品持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有结构性衍生品投资。

1.2.13 报告期末本基金投资的贵金属持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

1.2.14 报告期末本基金投资的收益互换合约持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有收益互换合约。

1.2.15 报告期末本基金投资的信用衍生品持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有信用衍生品投资。

1.2.16 报告期末本基金投资的资产支持证券持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.2.17 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货合约。

1.2.18 报告期末本基金投资的远期合约持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有远期合约。

1.2.19 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有期权投资。

1.2.20 报告期末本基金投资的互换合约持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有互换合约。

1.2.21 报告期末本基金投资的结构性衍生品持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有结构性衍生品投资。

1.2.22 报告期末本基金投资的贵金属持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

1.2.23 报告期末本基金投资的收益互换合约持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有收益互换合约。

1.2.24 报告期末本基金投资的信用衍生品持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有信用衍生品投资。

1.2.25 报告期末本基金投资的资产支持证券持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.2.26 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货合约。

1.2.27 报告期末本基金投资的远期合约持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有远期合约。

1.2.28 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有期权投资。

1.2.29 报告期末本基金投资的互换合约持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有互换合约。

1.2.30 报告期末本基金投资的结构性衍生品持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有结构性衍生品投资。

1.2.31 报告期末本基金投资的贵金属持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

1.2.32 报告期末本基金投资的收益互换合约持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有收益互换合约。

1.2.33 报告期末本基金投资的信用衍生品持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有信用衍生品投资。

1.2.34 报告期末本基金投资的资产支持证券持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.2.35 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货合约。

1.2.36 报告期末本基金投资的远期合约持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有远期合约。

1.2.37 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有期权投资。

1.2.38 报告期末本基金投资的互换合约持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有互换合约。

1.2.39 报告期末本基金投资的结构性衍生品持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有结构性衍生品投资。

1.2.40 报告期末本基金投资的贵金属持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

1.2.41 报告期末本基金投资的收益互换合约持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有收益互换合约。

1.2.42 报告期末本基金投资的信用衍生品持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有信用衍生品投资。

1.2.43 报告期末本基金投资的资产支持证券持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

重要提示

本基金经中国证监会2016年3月18日证监许可[2016]559号文注册募集,本基金基金合同于2016年5月13日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但不表明基金管理人保证基金募集成功,并不表明其对基金的价值和收益做出实质性判断或承诺,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,并自行承担投资风险。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,并自行承担投资风险。