南方成份精选混合型证券投资基金

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
报告送出日期:2018年07月18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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,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,投资者在做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2018年6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	南方成份精选混合
基金主代码	202005
前端交易代码	202005
后端交易代码	202006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年05月14日
报告期末基金份额总额	4,302,896,968.58份
投资目标	本基金在保持公司一贯投资理念基础上,通过对宏观经济和上市公司基本面的深入研究,采取定量和定性相结合方法,精选成份股,寻找驱动力型的领先上市公司,在控制风险的前提下追求获取超额收益。
投资策略	本基金在保持公司一贯投资理念的基础上,紧密把握和跟踪中国宏观经济周期,行业增长周期和企业成长周期,通过对行业的深入分析和上市公司基本面的研究,主要投资两类企业:1.驱动力型增长行业:通过对中国宏观经济的把握,根据社会上下游行业运行态势与利益分配等因素的观察,考量行业增长周期,以确定对国民经济起主要驱动作用或作出重大贡献的行业/产业,从中优选代表性企业重点投资。2.行业领先型成长企业:强调处于企业成长生命周期的上升期,或面临重大的发展机遇,具备超常规增长潜力的上市公司。通过投资此两类公司,进而为本基金获取中长期稳健的资产增值。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×上证国债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金,货币市场基金。
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

注: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“南方成份”。

§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(2018年04月01日 - 2018年06月30日)
1.本期已实现收益	-58,208,777.44
2.本期利润	-423,322,614.65
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0948
4.期末基金资产净值	3,671,760,058.27
5.期末基金份额净值	0.8533

注:1.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;2.所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。

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	净值增长率①	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	-9.98%	0.87%	-7.70%	0.91%	-2.28%	-0.04%

3.2.2 自基金转型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

注:本基金转型日为2007年05月14日。

§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		
黄春逢	本基金基金经理	2015年12月30日		6年	上海交通大学金融学硕士,具有基金从业资格。2011年7月至2014年12月:任职于国泰君安证券股份有限公司,担任银行业分析师;2015年4月加入南方基金研究部,任金融行业高级研究员;2015年4月至2015年12月:任南方利丰混合、南方恒本、南方利瑞的基金经理助理;2015年5月至2015年12月:任南方利鑫的基金经理助理;2015年6月至2015年12月:任南方利丰的基金经理助理;2015年12月至今:任南方恒利瑞的基金经理;2017年7月至今:任南方平衡配置基金经理;2017年6月至今:任南方金融混合基金经理。
张原	本基金基金经理	2015年12月30日		12年	英国密歇根大学经济学硕士学位,具有基金从业资格。2006年4月加入南方基金,曾担任南方基金研究部机械及电力设备行业高级研究员,南方高增及南方隆元基金经理助理;现任权益投资部总经理,境内权益投资决策委员会委员;2009年9月至2013年4月:任南方500基金经理;2010年2月至2016年10月:任南方稳健基金经理;2011年2月至今:任南方高增基金经理;2015年12月至今:任南方成份基金经理;2017年1月至今:任南方表有股票基金经理;2017年11月至今:任南方双歧混合基金经理。

注:1. 对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

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《南方成份精选混合型证券投资基金基金合同》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最大利益。本报告期内,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同日反向交易成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年二季度,中国宏观经济依然展现出了较好的韧性,但也出现了一些细微的变化。从经济运行来看,6月份 PMI 51.5%依然位于荣枯线之上,但新出口订单已下滑至49.8%的荣枯线以下。从物价来看,猪肉价格仍处于下行通道,6月CPI维持在1.8%的温和水平。海外市场,美联储在6月如期加息,中国央行并未同步上调公开市场操作逆回购利率。同时,央行在二季度进一步实施了降准措施。我们认为货币政策或已发生实质性边际变化。 回顾二季度组合的操作,我们整体上将股票仓位由中性仓位降低至低位。但由于市场在二季度出现系统性回调,组合净值依然受到了一定的影响。二季度中美贸易摩擦对市场整体风险偏好形成了一定程度的抑制,而相对偏弱的社融数据则影响了市场对于未来的经济增长预期。因此,我们在二季度加大了偏防御板块的配置力度,提升了消费和医药等弱周期板块的配置比例。展望三季度,我们对市场的看法相比二季度则更加乐观。一方面市场系统性的调整后许多板块的估值已落入历史的底部区间,风险收益比正在持续提升;另一方面市场利率中枢相较年初已显著回落,随着中报陆续披露,行业景气度较高,业绩持续稳健成长的优质个股将有望迎来估值和业绩的共振。从行业配置上看,我们认为低估值蓝筹和部分景气度较高的周期品有望迎来一波估值修复行情,同时,也将密切关注诸如消费电子等新兴成长方向的投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期间,南方成份精选基金期间净值增长率为-9.98%,同期业绩比较基准增长率为-7.70%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	2,271,990,959.86	59.19
	其中:股票	2,271,990,959.86	59.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	300,427,000.00	7.83
	其中:债券	300,427,000.00	7.83
	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	850,000,000.00	22.15
	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	394,662,874.20	10.28
8	其他资产	21,231,590.28	0.55
9	合计	3,838,312,424.34	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

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	-	-
B	采矿业	301,785,880.87	8.22
C	制造业	1,348,034,227.00	36.71
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	38,160,000.00	1.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	49,320,000.00	1.34
G	交通运输,仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输,软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	479,567,546.72	13.06
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	55,123,305.27	1.50
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利,环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
	合计	2,271,990,959.86	61.88

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

5.3 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	600028	中国石化	46,500,061	301,785,395.89	8.22
2	600309	万华化学	4,000,034	181,681,544.28	4.95
3	002008	大族激光	3,000,045	159,572,393.55	4.35
4	600703	三安光电	7,000,002	134,540,038.44	3.66
5	601012	隆基股份	8,000,015	133,520,250.35	3.64
6	600036	招商银行	5,000,216	132,205,711.04	3.60
7	601166	兴业银行	9,000,010	129,600,144.00	3.53
8	000538	云南白药	1,099,946	117,650,224.16	3.20
9	000333	美的集团	2,200,083	114,888,334.26	3.13
10	000895	双汇发展	4,200,000	110,922,000.00	3.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	300,427,000.00	8.18
	其中:政策性金融债	300,427,000.00	8.18
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	300,427,000.00	8.18

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	180301	18进出01	800,000	80,232,000.00	2.19
2	170410	17农发10	800,000	80,024,000.00	2.18
3	170311	17进出11	600,000	60,102,000.00	1.64
4	170207	17国开07	500,000	50,000,000.00	1.36
5	170413	17农发13	300,000	30,069,000.00	0.82

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注: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

注: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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体除招商银行(600036)、兴业银行(601166)以外,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。

根据2018年5月4日中国银行保险监督委员会执行处罚信息公开表(银监罚决字(2018)1号),对招商银行股份有限公司(下称招商银行,股票代码:600036)内控管理严重违反审慎经营规则、违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等十四项违规事实执行处罚决定,罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。

根据2018年5月4日中国银行保险监督委员会执行处罚信息公开表(银保监银罚决字(2018)1号),对兴业银行股份有限公司(下称兴业银行,股票代码:601166)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产等十二项违规事实罚款5870万元。

基金管理人对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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	1,305,282.06
2	应收证券清算款	9,031,037.87
3	应收股利	-
4	应收利息	8,537,114.29
5	应收申购款	2,358,156.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,231,590.28

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	4,900,397,835.07
报告期期间基金总申购份额	220,061,470.51
减:报告期期间基金总赎回份额	817,562,337.00
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	4,302,896,968.58

§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

注:本报告期间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

注: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

注: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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《南方成份精选混合型证券投资基金基金合同》。

2、《南方成份精选混合型证券投资基金托管协议》。

3、南方成份精选混合型证券投资基金2018年2季度报告原文。

9.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层。

9.3 查阅方式

网站:http://www.nffund.com

南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金

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
报告送出日期:2018年07月18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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,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,投资者在做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。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	南方创新经济灵活配置混合
基金主代码	001053
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年03月24日
报告期末基金份额总额	1,025,090,933.13份
投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下,通过专业化研究分析,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例,调整原则和调整范围,在保持在体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金,高于债券基金、货币市场基金。
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

注: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“南方创新经济”。

§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(2018年04月01日 - 2018年06月30日)
1.本期已实现收益	-26,732,261.33
2.本期利润	-9,459,823.01
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0087
4.期末基金资产净值	1,247,188,108.39
5.期末基金份额净值	1.217

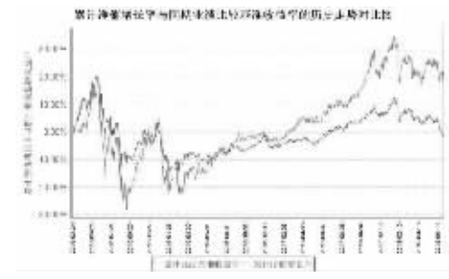
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。 2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	净值增长率①	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	-0.73%	1.18%	-5.43%	0.68%	4.70%	0.50%

3.2.2 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



§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		
章辉	本基金基金经理	2015年6月19日		8年	北京大学西方经济学硕士,具有基金从业资格,金融分析师 CFA 资格,2009年7月加入南方基金,担任研究部研究员,高级研究员;2014年2月至2015年5月,任南方新优享基金经理助理;2015年5月至今,任南方增长基金经理;2015年4月至今,任南方创新经济基金经理;2018年4月至今,任南方成长选股混合基金经理。

注:1. 对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

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《南方创新经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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最大利益。本报告期内,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同日反向交易成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

创业板指本季度下跌15.46%。 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)大额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;(2)报告期内指数成份股(包括调出指数成分股)的长期停牌,引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离;(3)根据指数季度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。

4.4.2 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1.6724元,报告期内,份额净值增长率为-14.99%,同期业绩基准增长率为-15.46%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	565,590,582.19	98.01
	其中:股票	565,590,582.19	98.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	5,000,000.00	0.87
	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	5,444,888.99	0.94
8	其他资产	1,053,762.71	0.18
9	合计	577,089,233.89	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2的合计项中不含可退替代款估值增值。

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

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	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农,林,牧,渔业	44,895,454.98	7.87
B	采矿业	-	-
C	制造业	264,288,816.44	46.32
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,200,027.93	1.26
F	批发和零售业	4,598,328.00	0.81
G	交通运输,仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输,软件和信息技术服务业	136,032,753.96	23.84
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,928,776.30	0.69
M	科学研究和技术服务业	2,281,696.20	0.40
N	水利,环境和公共设施管理业	20,080,754.17	3.52
O	居民服务,修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	28,512,893.11	5.00
R	文化,体育和娱乐业	30,734,699.32	5.39
S	综合	-	-
	合计	542,554,200.41	95.08

报告期末按行业分类的境内股票投资组合(积极投资部分)

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	15,191,069.78	2.66
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输,软件和信息技术服务业	7,845,312.00	1.37
J	金融业	-	-
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,环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
	合计	23,036,381.78	4.04

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

5.3 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投资明细

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	300498	温氏股份	2,038,849	44,895,454.98	7.87
2	300059	东方财富	2,091,938	27,571,742.84	4.83
3	300003	乐普医疗	489,376	17,950,311.68	3.15
4	300124	汇川技术	527,194	17,302,507.08	3.03
5	300015	爱尔眼科	444,109	14,340,279.61	2.51
6	300408	三环集团	579,929	13,628,331.50	2.39
7	300136	信维通信	424,520	13,045,499.60	2.29
8	300142	沃森生物	626,500	12,517,470.00	2.19
9	300070	碧水源	884,519	12,321,349.67	2.16
10	300024	机器人	659,900	11,482,260.00	2.01

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	300601	康泰生物	141,590	8,785,659.50	1.54
2	300188	美亚柏科	218,740	4,002,942.00	0.70
3	300226	上海钢联	64,200	3,842,370.00	0.67
4	300101	振芯科技	226,800	3,204,684.00	0.56
5	300373	扬杰科技	107,578	3,076,730.80	0.54

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注: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序的前十名资产支持证券投资明细

注: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

注: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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。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,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	7,350.69
2	应收证券清算款	1,047,003.15
3	应收股利	-
4	应收利息	-591.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,053,762.71

5.11.4 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。

5.11.5 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中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中不存在流通受限情况。

期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	233,697,720.00
报告期期间基金总申购份额	141,500,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	34,000,000.00
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	341,197,720.00

§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

注: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

注: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(%)
南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	20180401-20180630	201,910,178.00	96,500,000.00	0	298,410,178.00	87.46
产品持有风险							
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的份额折算。

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、南方创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同

2、南方创业板交易型开放式指数证券投资基金托管协议

3、南方创业板交易型开放式指数证券投资基金2018年第2季度报告原文

9.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层。

9.3 查阅方式

网站:http://www.nffund.com

南方创业板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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2018年07月18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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月17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,投资者在做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。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	南方创业板ETF
场内简称	创业板ETF
交易代码	159948
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2016年05月13日
报告期末基金份额总额	341,197,720.00份
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	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为创业板指数。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其长期平均风险与预期收益高于