

信息披露disclosure

南方中证500信息技术指数交易型
开放式指数证券投资基金发起式联接基金

2018年第四季度报告

与的交易所公开竞价时间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3次,是由于投资组合接受投资者申购后被动调仓仓位所致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
本季度中证500信息技术指数下跌15.37%。

期间我们通过对链接的“指数化交易系统”,“日内实时交易系统”,“跟踪误差分析并系统”等,将本基金的投资流程控制在较好水平,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成因分析如下:
(1) 接受申购赎回所带来的仓位偏离,对此我们通过对日内择时交易争取跟踪误差最小化;

(2) 本基金换回目标ETF所带来的成份权重偏离,对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行应对;

(3) 报告期内成份股(包括调出指数或分股)的长期停牌,引起的成份权重偏离及基金仓位变化的较大影响;

(4) 根据跟踪半年度成份股调整进行的大调仓,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。

4.5 报告期内基金的投资业绩
截至报告期末,本基金份额净值为0.6365元,报告期内,份额净值增长率为-1.459%,同期业绩基准增长率为-14.65%;本基金份额净值为0.6364元,报告期内,份额净值增长率为-14.68%,同期业绩基准增长率为-14.65%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值摘要
不适用。

§ 5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,133,269.72	4.28
2	其中:股票	4,133,269.72	4.28
3	固定收益投资	3,013,200.00	3.12
4	其中:债券	3,013,200.00	3.12
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其他资产	-	-
10	合计	7,146,469.72	7.40

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	医药生物	-	-
C	制造业	1,042,094.08	2.03
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	26,289.92	0.03
H	信息技术、传媒业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,164,303.92	3.27
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	采矿业	-	-
M	科学仪器和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育、体育、娱乐业	-	-
P	文化、体育、娱乐业	-	-
R	卫生、医药业	-	-
S	综合	-	-
合计		4,133,269.72	4.33

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
无。

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组合
无。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合
无。

5.5 投资组合报告附注
无。

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
无。

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
无。

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
无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。

5.11 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
无。

5.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。

5.13 本期国债期货投资评价
无。

5.14 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。

5.15 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
无。

5.16 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组合
无。

5.17 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票投资组合
无。

5.18 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票投资组合
无。

5.19 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票投资组合
无。

5.20 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票投资组合
无。

5.21 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票投资组合
无。

5.22 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票投资组合
无。

5.23 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票投资组合
无。

5.24 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票投资组合
无。

5.25 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票投资组合
无。

5.26 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票投资组合
无。

5.27 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票投资组合
无。

5.28 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票投资组合
无。

5.29 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票投资组合
无。

5.30 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票投资组合
无。

5.31 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票投资组合
无。

5.32 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票投资组合
无。

5.33 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票投资组合
无。

5.34 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票投资组合
无。

5.35 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票投资组合
无。

5.36 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票投资组合
无。

5.37 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票投资组合
无。

5.38 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票投资组合
无。

5.39 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票投资组合
无。

5.40 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票投资组合
无。

5.41 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票投资组合
无。

5.42 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票投资组合
无。

5.43 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票投资组合
无。

5.44 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票投资组合
无。

5.45 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票投资组合
无。

5.46 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票投资组合
无。

5.47 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票投资组合
无。

5.48 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票投资组合
无。

5.49 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票投资组合
无。

5.50 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票投资组合
无。

5.51 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票投资组合
无。

5.52 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票投资组合
无。

5.53 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票投资组合
无。

5.54 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票投资组合
无。

5.55 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票投资组合
无。

5.56 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票投资组合
无。

5.57 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票投资组合
无。

5.58 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票投资组合
无。

5.59 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票投资组合
无。

5.60 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票投资组合
无。

5.61 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票投资组合
无。

5.62 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票投资组合
无。

5.63 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票投资组合
无。

5.64 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票投资组合
无。

5.65 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票投资组合
无。

5.66 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票投资组合
无。

5.67 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票投资组合
无。

5.68 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票投资组合
无。

5.69 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票投资组合
无。

5.70 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票投资组合
无。

5.71 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票投资组合
无。

5.72 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票投资组合
无。

5.73 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票投资组合
无。

5.74 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票投资组合
无。

5.75 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票投资组合
无。

5.76 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票投资组合
无。

5.77 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票投资组合
无。

5.78 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票投资组合
无。

5.79 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票投资组合
无。

5.80 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票投资组合
无。

5.81 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票投资组合
无。

5.82 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票投资组合
无。

5.83 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票投资组合
无。

5.84 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票投资组合
无。

5.85 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票投资组合
无。

5.86 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票投资组合
无。

5.87 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票投资组合
无。

5.88 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票投资组合
无。

5.89 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票投资组合
无。

5.90 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票投资组合
无。

5.91 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票投资组合
无。

5.92 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票投资组合
无。

5.93 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票投资组合
无。

5.94 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票投资组合
无。

5.95 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票投资组合
无。

5.96 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票投资组合
无。

5.97 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票投资组合
无。

5.98 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票投资组合
无。

5.99 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票投资组合
无。

5.100 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票投资组合
无。

5.101 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票投资组合
无。

5.102 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票投资组合
无。

5.103 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票投资组合
无。

5.104 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票投资组合
无。

5.105 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票投资组合
无。

5.106 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票投资组合
无。

5.107 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票投资组合
无。

5.108 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票投资组合
无。

5.109 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票投资组合
无。

5.110 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票投资组合
无。

5.111 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票投资组合
无。

5.112 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票投资组合
无。

5.113 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票投资组合
无。

5.114 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票投资组合
无。

5.115 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票投资组合
无。

5.116 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票投资组合
无。

5.117 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票投资组合
无。

5.118 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票投资组合
无。

5.119 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票投资组合
无。

5.120 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票投资组合
无。

5.121 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票投资组合
无。

5.122 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票投资组合
无。

5.123 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票投资组合
无。

5.124 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票投资组合
无。

5.125 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票投资组合
无。

5.126 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票投资组合
无。

5.127 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票投资组合
无。

5.128 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票投资组合
无。

5.129 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票投资组合
无。

5.130 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票投资组合
无。

5.131 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票投资组合
无。

5.132 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票投资组合
无。

5.133 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票投资组合
无。

5.134 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票投资组合
无。

5.135 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票投资组合
无。

5.136 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票投资组合
无。

5.137 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票投资组合
无。

5.138 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票投资组合
无。

5.139 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票投资组合
无。

5.140 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票投资组合
无。

5.141 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票投资组合
无。

5.142 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票投资组合
无。

5.143 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票投资组合
无。

5.144 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票投资组合
无。

5.145 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票投资组合
无。

5.146 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票投资组合
无。

5.147 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票投资组合
无。

5.148 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票投资组合
无。

5.149 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票投资组合
无。

5.150 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票投资组合
无。

5.151 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票投资组合
无。

5.152 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票投资组合
无。

5.153 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票投资组合
无。

5.154 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票投资组合
无。

5.155 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票投资组合
无。

5.156 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票投资组合
无。

5.157 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票投资组合
无。

5.158 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票投资组合
无。

5.159 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票投资组合
无。

5.160 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票投资组合
无。

5.161 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票投资组合
无。

5.162 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票投资组合
无。

5.163 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票投资组合
无。

5.164 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票投资组合
无。

5.165 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票投资组合
无。

5.166 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票投资组合
无。