

南方上证380交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2019年第一季度报告

报告期内通过自建“指数化交易系统”、“日内实时交易系统”、“跟踪误差分析系统”等, 对本基金的跟踪误差控制保持在较好水平, 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分析如下:
1. 我们受申购赎回带来的仓位波动, 对我们通过日内择时交易收敛跟踪误差最小化;

(2) 本基金换购目标ETF所带来的成份股权重偏差, 对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行对冲;

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1.4167元, 报告期内, 份额净值增长率为20.20%, 同期业绩基准增长率为20.25%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值披露说明
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。

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	000497	罗莱家纺	2,100	44,562.00	0.02
2	000688	攀钢钒钛	1,100	34,981.00	0.02
3	000251	顺鑫农牧	1,996	34,096.48	0.02
4	000022	中孚实业	900	32,522.00	0.02
5	000759	广药集团	2,000	29,940.00	0.02
6	000526	广汇能源	6,500	28,275.00	0.01
7	000026	华发股份	3,000	27,840.00	0.01
8	000536	中国软件	500	27,760.00	0.01
9	000628	华明转债	1,790	27,260.10	0.01
10	000022	深发展	2,576	26,316.00	0.01

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	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,600,560.00	2.84
4	企业债券	6,600,560.00	2.84
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债(可交换债)	6,182.00	0.00
8	资产支持证券	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,606,742.00	2.84

5.5 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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	3,083,096.23	2.01
2	其中:股票	3,083,096.23	2.01
3	基金投资	162,380.00	0.10
3.1	固定收益投资	6,606,742.00	4.23
3.2	其中:债券	6,606,742.00	4.23
4	资产支持证券	-	-
4.1	资产支持证券	-	-
5	银行存款及现金	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行承兑票据及备付金合计	4,002,000.00	2.48
8	其他资产	197,730,489.89	126.26
9	合计	487,203,468.12	300.00

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	13,262.00	0.01
B	采矿业	397,440.14	0.10
C	制造业	3,150,703.88	8.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	227,138.70	0.17
E	建筑业	14,172.08	0.03
F	交通运输、仓储和邮政业	297,220.88	0.07
G	信息传输、软件和信息技术服务业	238,303.60	0.13
H	批发和零售业	34,062.00	0.02
I	房地产业	197,179.88	0.14
K	金融业	227,138.70	0.17
K.1	银行、证券和非银行金融机构	227,138.70	0.17
K.2	其他金融业	-	-
L	综合类	188,000.71	0.13
M	科学、技术和艺术业	60,914.48	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	38,124.00	0.01
O	国防军工	38,040.00	0.01
P	其他	18,854.00	0.01
Q	其他	6,823.00	0.00
R	其他	27,000.00	0.01
R.1	文化、体育和娱乐业	27,000.00	0.01
R.2	其他	-	-
S	合计	60,942.00	0.01
T	合计	3,083,096.23	2.01

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
5.2.3 报告期末按行业分类的内地股票投资组合
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	13,262.00	0.01
B	采矿业	397,440.14	0.10
C	制造业	3,150,703.88	8.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	227,138.70	0.17
E	建筑业	14,172.08	0.03
F	交通运输、仓储和邮政业	297,220.88	0.07
G	信息传输、软件和信息技术服务业	238,303.60	0.13
H	批发和零售业	34,062.00	0.02
I	房地产业	197,179.88	0.14
K	金融业	227,138.70	0.17
K.1	银行、证券和非银行金融机构	227,138.70	0.17
K.2	其他金融业	-	-
L	综合类	188,000.71	0.13
M	科学、技术和艺术业	60,914.48	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	38,124.00	0.01
O	国防军工	38,040.00	0.01
P	其他	18,854.00	0.01
Q	其他	6,823.00	0.00
R	其他	27,000.00	0.01
R.1	文化、体育和娱乐业	27,000.00	0.01
R.2	其他	-	-
S	合计	60,942.00	0.01
T	合计	3,083,096.23	2.01

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
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五名债券投资明细
5.5 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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	397,772,346.71	83.17
1.1	其中:股票	397,772,346.71	83.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,466,345.68	6.31
3.1	其中:债券	30,466,345.68	6.31
4	资产支持证券	-	-
4.1	资产支持证券	-	-
5	银行存款及现金	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行承兑票据及备付金合计	22,340,963.14	4.64
8	其他资产	5,465,407.42	1.16
9	合计	346,044,662.93	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	124.48	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	261,175,805.58	76.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,103.06	0.00
E	建筑业	54,008.48	0.02
F	交通运输、仓储和邮政业	1,669.28	0.00
G	信息传输、软件和信息技术服务业	306,336.00	0.09
H	批发和零售业	26,100,081.31	7.55
I	房地产业	296,165.60	0.09
K	金融业	172,363.00	0.05
M	科学、技术和艺术业	6,671.18	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	67,116.28	0.02
O	国防军工	-	-
P	教育	-	-
Q	其他	-	-
R	其他	601,714.00	0.02
R.1	文化、体育和娱乐业	6,272,000.00	1.82
R.2	其他	-	-
S	合计	267,772,346.71	84.32

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
5.2.3 报告期末按行业分类的内地股票投资组合
金额单位:人民币元

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	000333	润达医疗	589,488	21,105,316.42	6.18
2	000013	宝通软件	1,600,010	20,448,127.00	5.89
3	300068	南都电源	1,000,000	16,360,000.00	4.59
4	000022	中远海运	600,000	14,652,000.00	4.20
5	000300	大洋有色	256,000	12,474,220.00	3.46
6	000410	广联达	399,918	11,021,656.88	3.09
7	000700	中航光电	240,000	11,005,012.00	3.12
8	001788	华信新材	1,200,000	10,300,000.00	2.92
9	000841	毅昌股份	120,100	10,300,200.00	2.92
10	000765	立讯精密	389,360	9,471,120.00	2.63

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
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五名债券投资明细
5.5 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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	397,772,346.71	83.17
1.1	其中:股票	397,772,346.71	83.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,466,345.68	6.31
3.1	其中:债券	30,466,345.68	6.31
4	资产支持证券	-	-
4.1	资产支持证券	-	-
5	银行存款及现金	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行承兑票据及备付金合计	22,340,963.14	4.64
8	其他资产	5,465,407.42	1.16
9	合计	346,044,662.93	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	124.48	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	261,175,805.58	76.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,103.06	0.00
E	建筑业	54,008.48	0.02
F	交通运输、仓储和邮政业	1,669.28	0.00
G	信息传输、软件和信息技术服务业	306,336.00	0.09
H	批发和零售业	26,100,081.31	7.55
I	房地产业	296,165.60	0.09
K	金融业	172,363.00	0.05
M	科学、技术和艺术业	6,671.18	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	67,116.28	0.02
O	国防军工	-	-
P	教育	-	-
Q	其他	-	-
R	其他	601,714.00	0.02
R.1	文化、体育和娱乐业	6,272,000.00	1.82
R.2	其他	-	-
S	合计	267,772,346.71	84.32

5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
5.2.3 报告期末按行业分类的内地股票投资组合
金额单位:人民币元

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	000827	华信新材	1,000,000	20,110,000.00	5.69
2	000811	华信新材	3,000,000	20,448,127.00	5.69
3	000013	宝通软件	900,000	16,360,000.00	4.53
4	000022	中远海运	600,000	14,652,000.00	4.07
5	000300	大洋有色	256,000	12,474,220.00	3.43
6	000410	广联达	399,918	11,021,656.88	3.03
7	000700	中航光电	240,000	11,005,012.00	3.02
8	001788	华信新材	1,200,000	10,300,000.00	2.83
9	000841	毅昌股份	120,100	10,300,200.00	2.83
10	000765	立讯精密	389,360	9,471,120.00	2.63

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
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五名债券投资明细
5.5 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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	536,415,547.97	26.80
1.1	其中:股票	536,415,547.97	26.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,260,000,003.98	62.87
3.1	其中:债券	1,260,000,003.98	62.87
4	资产支持证券	-	-
4.1	资产支持证券	-	-
5	银行存款及现金	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行承兑票据及备付金合计	40,000,000.00	2.00
8	其他资产	2,001,824,597.72	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	15,227,500.00	0.82
B	采矿业	-	-
C	制造业	381,060,814.53	22.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,300,000.00	0.16
E	建筑业	18,300,000.00	0.10
F	交通运输、仓储和邮政业	29,229,221.70	1.70
G	信息传输、软件和信息技术服务业	20,460,000.00	1.17
H	批发和零售业	25,011,097.20	1.46
I	房地产业	-	-
K	金融业	10,342,000.00	0.59
M	科学、技术和艺术业	6,300,000.00	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工	-	-
P	教育	-	-
Q	其他	-	-
R	其他	601,714.00	0.03