

南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2019年半年度报告摘要

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2019年8月23日

§1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金服务机构不存在虚假记载、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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
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2019年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2019年1月1日起至6月30日止。
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况	
基金名称	南方创业板ETF联接
基金代码	003666
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5月31日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,792,036,942.63份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称	南方创业板ETF联接E 南方创业板ETF联接C
下属分级基金的交易代码	003666 004343
报告期末下属分级基金的份额总额	1,530,149,762.23份 261,887,180.40份

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“南方创业板”。

2.1.1 目标基金基本情况	
基金名称	南方创业板交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	159949
基金运作方式	契约型开放式(ETF)
基金合同生效日	2016年5月31日
基金在深圳证券交易所上市日期	2016年5月31日
基金管理人名称	南方基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

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“创业板ETF”。

2.2 基金产品说明	
投资目标	本基金通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求与业绩比较基准相近的回报。
投资策略	本基金以目标ETF作为主要投资标的,为特定的客户提供通过本基金投资目标ETF,本基金并不参与目标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年度偏差率不超过2.0%,在极端市场情况下不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人有权合理调整跟踪偏离度和跟踪误差,并予以公告。
业绩比较基准	创业板指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为ETF联接型基金,通过投资于目标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市场相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明	
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设置为标的指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人及基金托管人			
项目	基金管理人	基金托管人	
名称	南方基金管理有限公司	中国银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	常克川	王永民
	联系电话	0755-82763888	010-66604966
	电子邮箱	manager@southern-fund.com	cc@bankofchina.com
	客户服务电话	400-889-8899	95566
传真	0755-82763889	010-66049492	

2.4 信息披露方式	
投资者半年度报告正文的置备管理人和互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

1、南方创业板ETF联接		金额单位：人民币元
3.1 期间数据和指标	报告期末2019年1月1日 - 2019年6月30日	
本期已实现收益	13,008,037.94	
本期利润	102,702,462.32	
加权平均基金份额本期利润	0.0081	
本期基金份额净值增长率	10.662%	
3.12 期末数据和指标	报告期末2019年6月30日	
期末可供分配基金份额利润	-0.2543	
期末基金资产净值	1,141,064,229.82	
期末基金份额净值	0.7407	

3.1.1 期间数据和指标	报告期末2019年1月1日至2019年6月30日
本期已实现收益	13,068,037.94
本期公允价值变动损益	102,702,462.22
加权平均基金份额本期利润	0.0881
期末基金份额净值增长率	20.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2469
期末基金资产净值	1,141,054,229.53
期末基金份额净值	0.7467

收益=本期已实现收益扣除基金本期利息收入、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；					
3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中的未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；					
4、本基金从2017年2月23日起新增C类份额，C类份额自2017年2月27日起存续。					
3.2.1 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					
南方创业板ETF联接					
阶段	份额净值增长率	业绩比较基准增长率	业绩比较基准差	①、③	②、④

3.1.1 期间数据和指标	报告期末2019年1月1日至2019年6月30日
本期已实现收益	2,542,693.82
本期公允价值变动损益	24,034,397.89
加权平均基金份额本期利润	0.0180
期末基金份额净值增长率	20.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2469
期末基金资产净值	197,403,946.78
期末基金份额净值	0.7541

过去三个月	-0.76%	1.84%	-10.19%	1.89%	0.44%	-0.01%
过去六个月	20.29%	1.88%	19.87%	1.89%	0.62%	-0.01%
过去一年	-4.63%	1.77%	-5.43%	1.78%	0.80%	-0.01%
自基金合同生效以来	-17.26%	1.56%	-20.29%	1.51%	3.03%	-0.01%

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

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图