

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月25日

基金管理人的董事、监事及高级管理人员不存在虚假记载、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。
基金托管人对本基金的财务状况、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。

本报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。
§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金名称 南方成份证券ETF

场内简称 液态ETF

交易代码 159903

基金运作方式 交易型开放式

基金合同生效日 2009年12月01日

报告期末基金份额总额 307,164,307.07份

投资目标 调整资产的配置,追求跟踪指数的长期资本增值。

本基金为全市场主动管理的股票型基金,通过科学严谨的量化分析方法,精选具有较好成长性的股票,构建投资组合,力争实现超越业绩基准的投资回报。

投资策略 2.从过往业绩来看,本基金的业绩表现较为稳定,整体表现好于同类基金,且波动率较低,适合长期持有。

本基金的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将低于所示数据。

3.主要财务指标

单位:人民币元

报告期初总资产 -14,522,846.23

本期期间损益 26,672,771.56

本期期末总资产 477,090,295.81

报告期初总负债 -1,011,111.01

本期期间费用 -0.02%

本期期末总负债 -0.02%

报告期初所有者权益 477,090,295.81

本期期间利润 -0.02%

本期期末所有者权益 477,090,295.81

注:本基金在交易所行情系统净值揭示及其他信息披露场下,可简称为“成份ETF”。

§ 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

报告期初总资产 -14,522,846.23

本期期间损益 26,672,771.56

本期期末总资产 477,090,295.81

报告期初总负债 -1,011,111.01

本期期间费用 -0.02%

本期期末总负债 -0.02%

报告期初所有者权益 477,090,295.81

本期期间利润 -0.02%

本期期末所有者权益 477,090,295.81

注:本基金在交易所行情系统净值揭示及其他信息披露场下,可简称为“成份ETF”。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

基金经理 中国梦灵活配置混合型证券投资基金

基金代码 000664

基金运作方式 封闭式

基金合同生效日 2014年09月01日

报告期末基金份额总额 522,461,300.00份

注:本基金在交易所行情系统净值揭示及其他信息披露场下,可简称为“中国梦基金”。

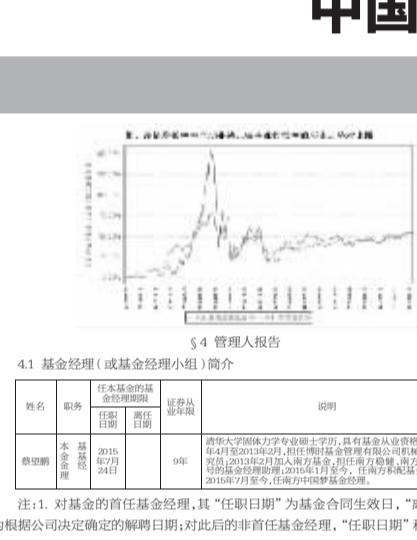
4.2 基金净值表现

4.2.1 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 累计净值 业绩比较基准 收益率差额 ①-③ ②-④

过去三个月 -0.2% 6.30% -0.02% 0.41% 0.00%

4.2.2 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



注:本基金合同中关于基金收益比例的约定,本基金将全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现,正常情况下,本基金的收益比例低于基金资产净值的5%。

§ 5 管理人报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.1.1 报告期内基金资产组合报告

序号 项目 金额(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 470,320,030.97 99.73

2 固定收益 470,320,030.97 99.73

3 衍生工具 0.00 0.00

4 其他资产 0.00 0.00

合计 470,320,030.97 100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农林、牧、渔业 - -

2 制造业 310,760,000 66.00

3 信息传输、软件和信息技术服务业 260,387,740.00 54.00

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 7,341,223.00 1.54

5 建筑业 9,299,248.00 1.96

6 银行业 32,600,196.14 6.64

7 交通运输、仓储和邮政业 2,090,387,740.00 43.60

8 房地产业 23,797,173.00 4.99

9 公用事业 7,206,646.02 1.51

10 采矿业 9,299,248.00 1.96

11 食品、饮料和烟草制造业 0.00 0.00

12 仪器仪表制造业 0.00 0.00

13 电子通信设备制造业 0.00 0.00

14 交通运输设备制造业 0.00 0.00

15 化工纤维制造业 0.00 0.00

16 电气机械和器材制造业 0.00 0.00

17 通用设备制造业 0.00 0.00

18 专用设备制造业 0.00 0.00

19 汽车制造业 0.00 0.00

20 家用电器制造业 0.00 0.00

21 仪器仪表制造业 0.00 0.00

22 金属制品、机械和设备制造业 0.00 0.00

23 金属、非金属矿及采选业 0.00 0.00

24 电力、热力生产和供应业 0.00 0.00

25 建筑装饰业 0.00 0.00

26 建筑安装业 0.00 0.00

27 建筑园林绿化业 0.00 0.00

28 其他制造业 0.00 0.00

29 其他专业、管理、修理和其他服务业 0.00 0.00

30 其他批发和零售业 0.00 0.00

31 其他住宿和餐饮业 0.00 0.00

32 其他金融业 0.00 0.00

33 其他房地产业 0.00 0.00

34 其他服务业 0.00 0.00

35 其他社会福利业 0.00 0.00

36 其他卫生和社会工作业 0.00 0.00

37 其他文化、体育和娱乐业 0.00 0.00

38 其他居民服务和其他服务业 0.00 0.00

39 其他租赁业 0.00 0.00

40 其他商务服务业 0.00 0.00

41 其他物业管理业 0.00 0.00

42 其他专业技术服务业 0.00 0.00

43 其他金融业 0.00 0.00

44 其他房地产业 0.00 0.00

45 其他服务业 0.00 0.00

46 其他居民服务和其他服务业 0.00 0.00

47 其他租赁业 0.00 0.00

48 其他商务服务业 0.00 0.00

49 其他物业管理业 0.00 0.00

50 其他专业技术服务业 0.00 0.00

51 其他金融业 0.00 0.00

52 其他房地产业 0.00 0.00

53 其他服务业 0.00 0.00

54 其他居民服务和其他服务业 0.00 0.00

55 其他租赁业 0.00 0.00

56 其他商务服务业 0.00 0.00

57 其他物业管理业 0.00 0.00

58 其他专业技术服务业 0.00 0.00

59 其他金融业 0.00 0.00

60 其他房地产业 0.00 0.00

61 其他服务业 0.00 0.00

62 其他居民服务和其他服务业 0.00 0.00

63 其他租赁业 0.00 0.00

64 其他商务服务业 0.00 0.00

65 其他物业管理业 0.00 0.00

66 其他专业技术服务业 0.00 0.00

67 其他金融业 0.00 0.00

68 其他房地产业 0.00 0.00

69 其他服务业 0.00 0.00

70 其他居民服务和其他服务业 0.00 0.00

71 其他租赁业 0.00 0.00

72 其他商务服务业 0.00 0.00

73 其他物业管理业 0.00 0.00

74 其他专业技术服务业 0.00 0.00

75 其他金融业 0.00 0.00

76 其他房地产业 0.00 0.00

77 其他服务业 0.00 0.00

78 其他居民服务和其他服务业 0.00 0.00

79 其他租赁业 0.00 0.00

80 其他商务服务业 0.0