

## 中证500工业指数交易型开放式指数证券投资基金

# 【2015】第二季度报告

基金管理人:南方基金管理有限公司  
基金托管人:中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期:2015年7月18日

### §1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金服务机构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。  
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年07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,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告财务数据未经审计。

本报告自2015年04月08日起至2015年06月30日止。

### §2 基金产品概况

基金简称	南方中证500工业ETF
场内简称	500工业
交易代码	512210
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年4月8日
报告期末基金份额总额	284,889,000.00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组合进行投资管理,并根据标的指数的成份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的。本基金标的指数为中证500工业指数。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要投资于中证500工业指数成份股及具有类似风险收益特征的证券,其风险(不含公允价值变动收益)和预期相关费用后的余额,与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场的风险收益特征相似。
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

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“500工业ETF”。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月8日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	76,963,191.92
2.本期利润	78,036,029.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.1261
4.期末基金资产净值	289,302,372.44
5.期末基金份额净值	1.0432

注:1.本基金合同于2015年4月8日成立,至报告期末不足一个季度;

2.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;

3.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。

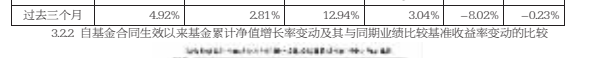
### §2 基金净值表现

3.2.1 本报告期末基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的对比

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 ①-③ ②-④

过去三个月 4.92% 2.01% 12.94% 3.03% -8.02% -0.23%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:本基金合同生效日至本报告期末不满一年。本基金建仓期为三个月,截至报告日本基金建仓尚未结束。

### §4 管理人报告

#### 4.1 基金运作情况(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理任期起始日期	证券从业年限	说明
雷斌	本基金基金经理	2015年4月8日	7年	北京大学工学硕士,具有基金从业资格,2008年7月加入南方基金,历任信息技术部系统研究员、量化投资部高级研究员,2014年12月至今,任南方中证500工业ETF基金经理;2015年4月至今,任南方中证500工业ETF基金经理;2015年4月至今,任南方中证500工业ETF基金经理;2015年4月至今,任南方中证500工业ETF基金经理。
孙伟	本基金基金经理	2015年5月22日	5年	管理学学士,具有基金从业资格、金融分析师(CFA)资格,注册会计师(CPA)资格。曾任鹏华基金管理有限公司投资部助理、德意志华水证券事务助理等职,2010年12月加入南方基金,历任证券部助理研究员、数量化投资部高级研究员,2014年12月至2015年6月,担任南方中证500工业ETF基金经理;2015年6月至今,任南方中证500工业ETF基金经理;2015年6月至今,任南方中证500工业ETF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”为根据合同约定确定解聘日期;对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据中国证监会相关规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 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明

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《中证500工业指数交易型开放式指数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。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约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人公平交易管理制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为4次,其中3次是由于指数型基金跟踪标的指数成份股结构被调仓所致,1次是由于投资组合的投资策略需要,相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

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

本基金自6月18日上市,市场波动较大,尤其是6月中旬开始出现了快速回调走势,500工业指数也随之先后后抑,截止报告期末相对上证综指的跟踪误差达到了73.23%。

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《中证500工业指数交易型开放式指数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。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约定。

4.4.2 报告期内基金业绩表现说明

截至报告期末,本基金基金份额净值为1.0492元,报告期内,份额净值增长率为4.92%,同期业绩基准增长率为12.94%。

4.5 报告期内基金持有人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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	288,122,304.26	98.88
	其中:股票	288,122,304.26	98.88
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,074,966.36	1.02
7	其他资产	310,467.57	0.10
8	合计	301,507,737.18	100.00

注:上表中权益投资公允价值占基金资产净值比例,不含股指期货公允价值。

### §2 基金产品概况

基金简称	南方中证500原材料ETF
场内简称	500原料
交易代码	512240
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年6月16日
报告期末基金份额总额	219,724,000.00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组合进行投资管理,并根据标的指数的成份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的。本基金标的指数为中证500原材料指数。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要投资于中证500原材料指数成份股及具有类似风险收益特征的证券,其风险(不含公允价值变动收益)和预期相关费用后的余额,与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场的风险收益特征相似。
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

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“500原料ETF”。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月16日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	99,824,941.70
2.本期利润	94,562,203.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.1510
4.期末基金资产净值	232,310,131.28
5.期末基金份额净值	1.0672

注:1.本基金合同于2015年4月16日成立,至报告期末不足一个季度;

2.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;

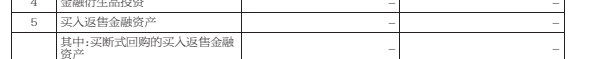
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### §2 基金净值表现

3.2.1 本报告期末基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的对比

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 ①-③ ②-④

过去三个月 5.72% 2.76% 6.07% 3.10% -1.15% -0.32%



注:本基金合同生效日至本报告期末不满一年。本基金的建仓期为三个月,截至报告日本基金建仓尚未结束。

### §4 管理人报告

#### 4.1 基金运作情况(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理任期起始日期	证券从业年限	说明
雷斌	本基金基金经理	2015年4月16日	7年	北京大学工学硕士,具有基金从业资格,2008年7月加入南方基金,历任信息技术部系统研究员、量化投资部高级研究员,2014年12月至今,任南方中证500工业ETF基金经理;2015年4月至今,任南方中证500工业ETF基金经理;2015年4月至今,任南方中证500工业ETF基金经理;2015年4月至今,任南方中证500工业ETF基金经理。
孙伟	本基金基金经理	2015年5月22日	5年	管理学学士,具有基金从业资格、金融分析师(CFA)资格,注册会计师(CPA)资格。曾任鹏华基金管理有限公司投资部助理、德意志华水证券事务助理等职,2010年12月加入南方基金,历任证券部助理研究员、数量化投资部高级研究员,2014年12月至2015年6月,担任南方中证500工业ETF基金经理;2015年6月至今,任南方中证500工业ETF基金经理;2015年6月至今,任南方中证500工业ETF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”为根据合同约定确定解聘日期;对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据中国证监会相关规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 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明

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《中证500原材料指数交易型开放式指数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。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约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人公平交易管理制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为4次,其中3次是由于指数型基金跟踪标的指数成份股结构被调仓所致,1次是由于投资组合的投资策略需要,相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

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

本基金自6月16日上市,市场波动较大,尤其是6月中旬开始出现了快速回调走势,500原材料指数也随之先后后抑,截止报告期末相对上证综指的跟踪误差达到了73.01%。

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《中证500原材料指数交易型开放式指数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。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约定。

4.4.2 报告期内基金业绩表现说明

截至报告期末,本基金基金份额净值为1.0672元,报告期内,份额净值增长率为5.72%,同期业绩基准增长率为6.07%。

4.5 报告期内基金持有人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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	229,400,604.12	97.21
	其中:股票	229,400,604.12	97.21
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,997,202.23	2.54
7	其他资产	337,772.56	0.14
8	合计	235,735,669.93	100.00

注:上表中权益投资公允价值占基金资产净值比例,不含股指期货公允价值。

### §2 基金产品概况

基金简称	南方中证500医药ETF
场内简称	500医药
交易代码	512200
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年4月16日
报告期末基金份额总额	126,117,083.00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组合进行投资管理,并根据标的指数的成份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的。本基金标的指数为中证500医药指数。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要投资于中证500医药指数成份股及具有类似风险收益特征的证券,其风险(不含公允价值变动收益)和预期相关费用后的余额,与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场的风险收益特征相似。
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

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“500医药ETF”。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月16日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	89,146,280.65
2.本期利润	68,391,380.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.4941
4.期末基金资产净值	212,516,034.76
5.期末基金份额净值	1.6851

注:1.本基金合同于2015年4月16日成立,至报告期末不足一个季度;

2.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;

3.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。

### §2 基金净值表现

3.2.1 本报告期末基金份额净值增长及其与同期业绩比较基准收益率的对比

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 ①-③ ②-④

过去三个月 5.72% 2.76% 6.07% 3.10% -1.15% -0.32%



注:本基金合同生效日至本报告期末不满一年。本基金的建仓期为三个月,截至报告日本基金建仓尚未结束。

### §4 管理人报告

#### 4.1 基金运作情况(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理任期起始日期	证券从业年限	说明
雷斌	本基金基金经理	2015年4月16日	7年	北京大学工学硕士,具有基金从业资格,2008年7月加入南方基金,历任信息技术部系统研究员、量化投资部高级研究员,2014年12月至今,任南方中证500工业ETF基金经理;2015年4月至今,任南方中证500工业ETF基金经理;2015年4月至今,任南方中证500工业ETF基金经理;2015年4月至今,任南方中证500工业ETF基金经理。
孙伟	本基金基金经理	2015年5月22日	5年	管理学学士,具有基金从业资格、金融分析师(CFA)资格,注册会计师(CPA)资格。曾任鹏华基金管理有限公司投资部助理、德意志华水证券事务助理等职,2010年12月加入南方基金,历任证券部助理研究员、数量化投资部高级研究员,2014年12月至2015年6月,担任南方中证500工业ETF基金经理;2015年6月至今,任南方中证500工业ETF基金经理;2015年6月至今,任南方中证500工业ETF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”为根据合同约定确定解聘日期;对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据中国证监会相关规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 管理人对于报告期内本基金投资运作情况的说明

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《中证500医药指数交易型开放式指数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。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约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人公平交易管理制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为4次,其中3次是由于指数型基金跟踪标的指数成份股结构被调仓所致,1次是由于投资组合的投资策略需要,相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

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

本基金自4月16日上市,市场波动较大,尤其是6月中旬开始出现了快速回调走势,500医药指数也随之先后后抑,截止报告期末相对上证综指的跟踪误差达到了73.01%。

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《中证500医药指数交易型开放式指数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。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约定。

4.4.2 报告期内基金业绩表现说明

截至报告期末,本基金基金份额净值为1.6851元,报告期内,份额净值增长率为5.72%,同期业绩基准增长率为6.07%。

4.5 报告期内基金持有人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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	229,400,604.12	97.21
	其中:股票	229,400,604.12	97.21
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,997,202.23	2.54
7	其他资产	337,772.56	0.14
8	合计	235,735,669.93	100.00

注:上表中权益投资公允价值占基金资产净值比例,不含股指期货公允价值。

### §2 基金产品概况

基金简称	南方中证500医药ETF
场内简称	500医药
交易代码	512200
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年4月16日
报告期末基金份额总额	126,117,083.00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组合进行投资管理,并根据标的指数的成份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的。本基金标的指数为中证500医药指数。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要投资于中证500医药指数成份股及具有类似风险收益特征的证券,其风险(不含公允价值变动收益)