

## 中证500原材料指数交易型开放式指数证券投资基金

[2015] 第三季度报告

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10月27日

§ 1 重要提示  
基金管理人的董事会及董事保证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10月22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信息，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
基金销售代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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务数据未经审计。

本报告期自2015年07月01日起至2015年09月30日止。

1.2 基金产品概况

基金简称:中证500原材料ETF

场内简称:500原材

交易代码:612340

基金运作方式:交易型开放式

基金合同生效日:2015年1月16日

报告期末基金份额总额:149,724,000.00份

投资目标:本基金通过投资于中证500原材料指数成分股，追求超越标的指数的收益最小化。

投资策略:本基金将被动地跟踪中证500原材料指数，通过定期调整股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应的调整。

业绩比较基准:本基金的业绩比较基准为沪深300指数。

风险收益特征:本基金为股票型基金，具有较高的风险和预期收益。

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净值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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期:2015年7月1日 - 2015年9月30日

1.本期已实现收益 -32,200,664.10

2.本期利润 -66,563,236.24

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0308

4.期末基金份额净值 106,528,653.63

5.期末基金资产净值 0.7048

注:1.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)和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；

2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金份额的费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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变动的比较

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -33.3% 3.4% -21.8% 4.08% -1.1% -0.6%

3.2.2 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

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 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -33.3% 3.4% -21.8% 4.08% -1.1% -0.6%

3.2.3 本报告期内基金的利润分配情况

本报告期内，本基金未进行利润分配。

3.2.4 基金净值表现的说明

本基金通过投资于中证500原材料指数成分股，追求超越标的指数的收益最小化。

(1) 大额申购赎回时点的成份股重仓比例，对我们通过日内涨幅交易限制规避误差最小化。

(2) 报告期内指数成分股(包括调出指数成分股)的长期停牌，引起的成份股重偏离及基金整体仓位的偏离。

4.2.5 期间内基金的业绩表现

本基金的份额净值为0.7048元，报告期内，份额净值增长率为-33.3%，同期业绩基准增长率为-32.18%。

4.2.6 报告期内基金持有或基金份额净值预告说明

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位:人民币元

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 104,991,894.07 99.18

2 固定收益投资 104,991,894.07 99.18

3 货币市场基金 - -

4 银行存款和结算备付金 - -

5 其他资产 - -

6 银行存款和结算备付金合计 434,367,033 0.041

7 其他资产 436,663.48 0.041

8 合计 106,262,906.38 100.00

注:本基金在交易所行情系统净值净值等其他信息披露场合下，可简称为“南方500原料ETF”。

5.2 报告期末投资按行业分类的股票投资组合

5.2.1 基金产品概况

基金简称:南方500原料ETF

场内简称:500原材

交易代码:612340

基金运作方式:交易型开放式

基金合同生效日:2015年1月16日

报告期末基金份额总额:894,326,688.70

5.2.2 基金合同生效以来基金的各类型基金的份额及其对应的份额净值、申购赎回费用、赎回金额

5.2.3 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金份额的费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

5.3 主要财务指标

5.3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期:2015年7月1日 - 2015年9月30日

1.本期已实现收益 -106,651,196.18

2.本期利润 -433,450,579.74

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0308

4.期末基金资产净值 894,326,688.70

5.期末基金份额净值 0.7033

注:1.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)抵扣相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金份额的费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

5.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 离任日期 证券从业年限 说明

雷俊 本基金基金经理 2015年4月16日 - 7年 北京大学工学硕士，历任基金管理公司信息技术部高级工程师、数据挖掘项目经理，2014年12月至至今，任南方基金管理有限公司基金经理。2013年1月至今，任南方500原料ETF基金经理。2014年6月至今，任南方500原料ETF基金经理。2015年4月至今，任南方500原料ETF基金经理。2015年6月至今，任南方500原料ETF基金经理。2015年7月至今，任南方500原料ETF基金经理。

孙伟 本基金基金经理 2015年5月22日 - 5年 财经学学士，先后在基金业工作，历任分析师(CFA)、研究员(CFA)、高级分析师(CFA)、投资经理(CFA)、基金经理助理(CFA)、基金经理(CFA)。2015年5月至今，任南方基金管理有限公司基金经理。2015年6月至今，任南方500原料ETF基金经理。2015年7月至今，任南方500原料ETF基金经理。2015年8月至今，任南方500原料ETF基金经理。2015年9月至今，任南方500原料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”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；对之后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.管理人的名称从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的有关规定。

3.本报告期内，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和自律组织的行业规范履行职责，严格遵守基金合同，公平对待所有投资人，保护基金份额持有人的合法权益，不存在损害基金份额持有人利益的情况，不存在不公平对待不同类别基金份额持有人的情况，不存在变相歧视基金份额持有人的情况，不存在不公平对待基金份额持有人与基金管理人的情况。

4.2.1 管理人声明

4.2.2 本报告期内基金管理人未出现违法违规行为。

4.2.3 本报告期内基金管理人未出现重大关联交易。

4.2.4 本报告期内基金管理人未受到行政处罚。

4.2.5 本报告期内基金管理人未受到行政调查。

4.2.6 本报告期内基金管理人未涉及诉讼。

4.2.7 本报告期内基金管理人未支付托管费。

4.2.8 本报告期内基金管理人未支付基金销售服务费。

4.2.9 本报告期内基金管理人未支付信息披露费。

4.2.10 本报告期内基金管理人未支付审计费用。

4.2.11 本报告期内基金管理人未支付律师费用。

4.2.12 本报告期内基金管理人未支付会计师费用。

4.2.13 本报告期内基金管理人未支付评估费。

4.2.14 本报告期内基金管理人未支付交易费用。

4.2.15 本报告期内基金管理人未支付信息技术费。

4.2.16 本报告期内基金管理人未支付上市费。

4.2.17 本报告期内基金管理人未支付常年顾问费。

4.2.18 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.19 本报告期内基金管理人未支付其他与基金运作相关的费用。

4.2.20 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.21 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.22 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.23 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.24 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.25 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.26 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.27 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.28 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.29 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.30 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.31 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.32 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.33 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.34 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.35 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.36 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.37 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.38 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.39 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.40 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.41 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.42 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.43 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.44 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.45 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.46 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.47 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.48 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.49 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.50 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.51 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.52 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.53 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

4.2.54 本报告期内基金管理人未支付其他费用。

</