

中证500医药卫生指数交易型开放式指数证券投资基金

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
基金合同生效日期:2017年3月30日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、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的法律责任。本基金报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由基金经理签章。

基金管理人:中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月2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。投资人投资于本基金前，请认真阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称 中证500医药卫生指数交易型开放式指数证券投资基金

基金简称 南方中证500医药卫生ETF

场内简称 500医药

基金主代码 512000

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2014年10月31日

基金管理人 南方基金管理有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

报告期起始日 2016年1月1日

报告期截止日 2016年12月31日

2.2 基金产品说明

投资目标 在紧密跟踪标的指数的基础上,追求跟踪误差最小化。

投资策略 本基金为指数型基金,采用完全复制法,按照行业权重的调整规则构建股票池,并定期对股票池进行调整,以确保基金净值与标的指数的表现尽可能地一致。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为中证500医药卫生指数。

风险收益特征 本基金属股票型基金,风险收益特征与股票型基金相似,具有较高的预期收益,以及较高的预期风险。

本基金可以投资于境外证券市场,具体投资品种将根据法律法规和监管机构的规定,适时调整。

基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 南方基金管理有限公司 中国农业银行股份有限公司

姓名 楼继华 林强

信息披露负责人 0706-82760088 010-66000000

电子邮箱 manager@sfund.com tpxg@abcchina.com

客户服务电话 400-889-8899 95599

传真 0756-82763889 010-81211616

2.4 信息披露方式

基金管理人在正刊栏登载的互联网网址 http://www.sfund.com

基金管理人在各地报纸登载的公告 南方基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 近期数据和指标

2016年末 2015年末 上年度可比期间(2015年1月1日至2015年12月31日)

本期末利润 -5,060,644.14 130,112,360.27 -5,798,470.20

本期利润 -10,-724,018.01 106,960,470.74 -56,964,201.00

加权平均基金份额本期利润 -0.2080 0.0911 -0.0600

本期期末总资产收益率 -23.20% 77.00% -6.10%

本期期末基金份额净值 -0.9776 1.4272 -0.7078

本期期末基金份额申购费率 10.00% 43.86% -10.00%

本期期末赎回费费率 20.00% 22.15% 16.76%

3.1.2 自基金合同生效以来基金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

图例: 基金份额净值增长率=基金净值增长率-同期业绩比较基准收益率

图例: 基金份额净值增长率=基金净值增长率-同期业绩比较基准收益率