

## 南方中证500信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

## 2017年第三季度报告

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:2017年10月25日

§ 1 重要提示

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，并声明对本报告书中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，承诺并保证对中国银行业股份有限公司披露的基金合同规定，于2017年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等信息，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人声明该基金的管理费按日计提、按季收取。基金管理人不承担基金一定比例的管理费。

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。

本基金的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。

本报告期自2017年1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500信息ETF发起式联接基金

基金代码 002900

基金运作方式 上市契约型开放式

基金合同生效日 2016年01月17日

报告期末基金资产总额 137,304,126.02

投资目标 本基金的目标ETF为跟踪中证500信息技术指数，追求与业绩比较基准相似的收益。

投资策略 本基金主要通过投资于标的ETF，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的收益。

业绩比较基准 本基金的目标ETF为主要投资标的，具体特征为：定期持有的客户普遍选择投资于股票型基金，但大部分客户选择长期持有，且持有时间较长，平均持有期限超过20年，持有客户数占45%，如果根据客户持有期限和持有数量将客户分为三类，即短期客户（持有期限在一年以内）、中期客户（持有期限在一年以上至五年以下）和长期客户（持有期限在五年以上），则长期客户比例最高，达到45%；如果根据客户持有金额将客户分为三类，则长期客户比例最高，达到45%。

风险收益特征 本基金为股票型基金，其长期风险和预期收益水平高于债券型基金，低于股票型基金，风险收益特征与标的指数相似，即追求与业绩比较基准相似的收益。

基金经理 南方基金管理有限公司

基金经理人 中国农银农银银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 南方500信息ETF发起式联接C

下属分级基金的交易代码 002900

下属分级基金的交易代码 004347

报告期末下属分级基金的份额总额 134,527,901.41份

报告期末下属分级基金的份额总额 3,326,162.76份

注:本基金在交易所行情系统揭示显示等其他信息披露场合下,可简称为“500信息联基”。

2.2 基金基本情况

基金名称 中证500信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金

基金代码 512300

基金运作方式 上市契约型开放式

基金合同生效日 2015-06-29

报告期末基金资产总额 10,000,344.07

报告期末基金份额总额 6,076,280.07

报告期末基金份额净值 0.0751

报告期末基金份额 3,123,163.24份

报告期末基金份额净值 0.0623

注:1.本期实现的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;

2.所列财务指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计费用后实际收益水平要低于所有财务数据。

3.2 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年01月01日 - 2017年09月30日)

南方500信息ETF发起式联接 南方500信息ETF发起式联接C

1.本期已实现收益 -3,006,197.20 -4,102.20

2.本期利润 10,000,344.07 74,116.77

3.期初未折溢价百分比 0.0751 0.0623

4.期末未折溢价百分比 132,163.24份 3,123,163.24份

5.期末基金份额净值 0.0623

注:1.本期实现的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;

2.所列财务指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计费用后实际收益水平要低于所有财务数据。

5.3 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(2017年01月01日 - 2017年09月30日)

南方500信息ETF发起式联接 南方500信息ETF发起式联接C

1.本期已实现收益 -3,006,197.20 -4,102.20

2.本期利润 10,000,344.07 74,116.77

3.期初未折溢价百分比 0.0751 0.0623

4.期末未折溢价百分比 132,163.24份 3,123,163.24份

5.期末基金份额净值 0.0623

注:1.本期实现的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;

2.所列财务指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计费用后实际收益水平要低于所有财务数据。

2.1 基金基本情况

基金名称 南方中证高铁产业指数分级证券投资基金

基金代码 160236

基金运作方式 上市契约型开放式

基金合同生效日 2016年09月10日

报告期末基金资产总额 273,022,506.07

投资目标 本基金通过行业分类化投资,紧密跟踪标的指数,追求与业绩比较基准相似的收益。

投资策略 本基金主要通过投资于标的ETF,紧密跟踪标的指数,追求与业绩比较基准相似的收益。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准:其长期目标是:定期持有的客户普遍选择投资于股票型基金,但大部分客户选择长期持有,且持有时间较长,平均持有期限超过20年,持有客户数占45%,如果根据客户持有期限和持有数量将客户分为三类,即短期客户(持有期限在一年以内)、中期客户(持有期限在一年以上至五年以下)和长期客户(持有期限在五年以上),则长期客户比例最高,达到45%;如果根据客户持有金额将客户分为三类,则长期客户比例最高,达到45%。

风险收益特征 本基金为股票型基金,其长期风险和预期收益水平高于债券型基金,低于股票型基金,风险收益特征与标的指数相似,即追求与业绩比较基准相似的收益。

基金经理 南方基金管理有限公司

基金经理人 中国农银农银银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 南方中证高铁产业指数

下属分级基金的交易代码 160236

下属分级基金的交易代码 160236

报告期末下属分级基金的份额总额 294,081,973.09份 4,470,260.00份 4,470,260.00份

注:本基金在交易所行情系统揭示显示等其他信息披露场合下,可简称为“高铁基金”。

5.3 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(2017年01月01日 - 2017年09月30日)

南方中证高铁产业指数 南方中证高铁产业指数C

1.本期已实现收益 -16,789,201.27 -9,611,241.14

2.本期利润 9,611,241.14 0.02%

3.期初未折溢价百分比 0.02%

4.期末未折溢价百分比 100.00%

5.期末基金份额净值 1.0064

注:1.本期实现的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;

2.所列财务指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计费用后实际收益水平要低于所有财务数据。

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年01月01日 - 2017年09月30日)

南方中证高铁产业指数 南方中证高铁产业指数C

1.本期已实现收益 -16,789,201.27 -9,611,241.14

2.本期利润 9,611,241.14 0.02%

3.期初未折溢价百分比 0.02%

4.期末未折溢价百分比 100.00%

5.期末基金份额净值 1.0064

注:1.本期实现的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;

2.所列财务指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计费用后实际收益水平要低于所有财务数据。

2.2 基金基本情况

基金名称 南方中证国有企业改革指数分级证券投资基金

基金代码 160235

基金运作方式 上市契约型开放式

基金合同生效日 2016年09月10日

报告期末基金资产总额 311,701,759.08份

投资目标 本基金通过行业分类化投资,紧密跟踪标的指数,追求与业绩比较基准相似的收益。

投资策略 本基金主要通过投资于标的ETF,紧密跟踪标的指数,追求与业绩比较基准相似的收益。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准:其长期目标是:定期持有的客户普遍选择投资于股票型基金,但大部分客户选择长期持有,且持有时间较长,平均持有期限超过20年,持有客户数占45%,如果根据客户持有期限和持有数量将客户分为三类,即短期客户(持有期限在一年以内)、中期客户(持有期限在一年以上至五年以下)和长期客户(持有期限在五年以上),则长期客户比例最高,达到45%;如果根据客户持有金额将客户分为三类,则长期客户比例最高,达到45%。

风险收益特征 本基金为股票型基金,其长期风险和预期收益水平高于债券型基金,低于股票型基金,风险收益特征与标的指数相似,即追求与业绩比较基准相似的收益。

基金经理人 南方基金管理有限公司

基金经理人 中国农银农银银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 南方中证国有企业改革指数

下属分级基金的交易代码 160235

下属分级基金的交易代码 160235

报告期末下属分级基金的份额总额 211,081,419.89份 50,306,600.00份 50,306,600.00份

注:本基金在交易所行情系统揭示显示等其他信息披露场合下,可简称为“改革基金”。

5.3 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(2017年01月01日 - 2017年09月30日)

南方中证国有企业改革指数 南方中证国有企业改革指数C

1.本期已实现收益 -16,789,201.27 -9,611,241.14

2.本期利润 9,611,241.14 0.02%

3.期初未折溢价百分比 0.02%

4.期末未折溢价百分比 100.00%

5.期末基金份额净值 1.0064

注:1.本期实现的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;

2.所列财务指标不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计费用后实际收益水平要低于所有财务数据。

2.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年01月01日 - 2017年09月30日)

南方中证国有企业改革指数 南方中证国有企业改革指数C

1.本期已实现收益 -16,789,201.27 -9,611,241.14

2.本期利润 9,611,241.14 0.02%

3.期初未折溢价百分比