

## 深证成份交易型开放式指数证券投资基金

### 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:中国工商银行股份有限公司  
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自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 南方深证成份ETF  
场内简称 深证成分  
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04日

报告期末基金份额总额 397,154,607.00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 本基金为完全复制式指数基金,跟踪、复制完全复制法,控制成份股在标的指数基金资产净值中的权重,并采用完全复制法,控制成份股在基金资产净值中的权重。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

风险收益特征 本基金股票型基金,预期风险高于混合基金,债券基金与货币市场基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的品种。

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

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“深证成分”。

#### §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(2017年7月01日—2017年09月30日)

1.本期已实现收益 12,620,493.41

2.本期公允价值变动收益 26,572,762.58

3.本期投资净收益 1,000.00

4.本期基金份额净值 477.03,156.00

5.本期基金份额净值 1,301.11

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)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。

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的比较

报告期 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 ①-③ ②-④

过去三个月 1.07% 0.07% 0.02% 0.03% 0.05% 0.04%

3.2.2 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“深证成分”。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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

#### §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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,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,投资者在做出投资决策前

应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。

#### §2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金名称 中证500交易型开放式指数证券投资基金

基金运作方式 交易型开放式

基金合同生效日 2016年04月06日

报告期末基金份额总额 122,467,794.00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 本基金为完全复制式指数基金,跟踪、复制完全复制法,控制成份股在标的指数基金资产净值中的权重,并采用完全复制法,控制成份股在基金资产净值中的权重。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

风险收益特征 本基金股票型基金,预期风险高于混合基金,债券基金与货币市场基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的品种。

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

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“中证500”。

#### §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(2017年07月01日—2017年09月30日)

1.本期已实现收益 36,000,643.27

2.本期公允价值变动收益 12,020,493.41

3.本期投资净收益 1,000.00

4.本期基金份额净值 813.97,328.00

5.本期基金份额净值 1,558.11

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)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。

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的比较

报告期 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 ①-③ ②-④

过去三个月 1.07% 0.07% 0.02% 0.03% -1.20% 0.21%

3.2.2 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

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

#### §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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自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 中证500ETF

场内简称 500ETF

交易代码 510210

基金运作方式 交易型开放式

基金合同生效日 2016年04月06日

报告期末基金份额总额 117,889,000.00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 本基金为完全复制式指数基金,跟踪、复制完全复制法,控制成份股在标的指数基金资产净值中的权重,并采用完全复制法,控制成份股在基金资产净值中的权重。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

风险收益特征 本基金股票型基金,预期风险高于混合基金,债券基金与货币市场基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的品种。

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

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“500ETF”。

#### §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(2017年07月01日—2017年09月30日)

1.本期已实现收益 -1,753,241.82

2.本期公允价值变动收益 4,960,368.00

3.本期投资净收益 0.0004

4.本期基金份额净值 84.98,122.00

5.本期基金份额净值 1,260.00

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)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。

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的比较

报告期 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 ①-③ ②-④

过去三个月 0.70% 0.03% 0.00% 0.00% -0.02% -0.02%

3.2.2 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

姓名 职务 在本基金的基金经理任期自 截至任期

孙伟 本基金基金经理 2016年01月15日 7年

注:1.对基金的前任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据基金合同规定确定的解聘日期;对此后的非前任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据基金合同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基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,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《深圳证券交易所开放式证券投资基金业务规则》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,未发生损害基金份额持有人利益、损害基金资产净值的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种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和投资组合。

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0次,是由于投资组合接受投资者申购后被动增持仓位以及指数型基金成份股调整所致。

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

3季度新能源、上游(有色金属、煤炭)周期性行业、以及电子通信、食品饮料表现突出。主要因素是这些行业的基本面增长强劲,在各行业中较为突出。展观四季上游行业价格价格上涨的态势趋强,持平概率较大,电子通信和食品饮料行业的持续性较强,仍然看好。其中我们相对看好5G的发展方向和中低端消费电子市场的高成长性。

对经济的前景更为乐观,从上市公司表现反映出的情况,上游、中游、下游的行情均环比改善,说明经济自身的潜力在释放。之前担忧的政策拉动效应以及杠杆

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期

曹蔚 本基金基金经理 2016年12月24日 0年

注:1.对基金的前任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据基金合同规定确定的解聘日期;对此后的非前任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据基金合同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基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,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《中国证券投资基金业协会证券投资基金业务规则》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。本报告期内,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、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种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和投资组合。

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0次,是由于投资组合接受投资者申购后被动增持仓位以及指数型基金成份股调整所致。

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

3季度新能源、上游(有色金属、煤炭)周期性行业、以及电子通信、食品饮料表现突出。主要因素是这些行业的基本面增长强劲,在各行业中较为突出。展观四季上游行业价格价格上涨的态势趋强,持平概率较大,电子通信和食品饮料行业的持续性较强,仍然看好。其中我们相对看好5G的发展方向和中低端消费电子市场的高成长性。

对经济的前景更为乐观,从上市公司表现反映出的情况,上游、中游、下游的行情均环比改善,说明经济自身的潜力在释放。之前担忧的政策拉动效应以及杠杆

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期

周旋 本基金基金经理 2016年01月21日 0年

注:1.对基金的前任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据基金合同规定确定的解聘日期;对此后的非前任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据基金合同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基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,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指数交易型开放式证券投资基金业务规则》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。本报告期内,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、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种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和投资组合。

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0次,是由于投资组合接受投资者申购后被动增持仓位以及指数型基金成份股调整所致。

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

3季度新能源、上游(有色金属、煤炭)周期性行业、以及电子通信、食品饮料表现突出。主要因素是这些行业的基本面增长强劲,在各行业中较为突出。展观四季上游行业价格价格上涨的态势趋强,持平概率较大,电子通信和食品饮料行业的持续性较强,仍然看好。其中我们相对看好5G的发展方向和中低端消费电子市场的高成长性。

对经济的前景更为乐观,从上市公司表现反映出的情况,上游、中游、下游的行情均环比改善,说明经济自身的潜力在释放。之前担忧的政策拉动效应以及杠杆

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期

周旋 本基金基金经理 2016年01月21日 0年

注:1.对基金的前任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据基金合同规定确定的解聘日期;对此后的非前任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据基金合同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基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,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指数交易型开放式证券投资基金业务规则》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。本报告期内,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、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种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和投资组合。

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0次,是由于投资组合接受投资者申购后被动增持仓位以及指数型基金成份股调整所致。

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

3季度新能源、上游(有色金属、煤炭)周期性行业、以及电子通信、食品饮料表现突出。主要因素是这些行业的基本面增长强劲,在各行业中较为突出。展观四季上游行业价格价格上涨的态势趋强,持平概率较大,电子通信和食品饮料行业的持续性较强,仍然看好。其中我们相对看好5G的发展方向和中低端消费电子市场的高成长性。

对经济的前景更为乐观,从上市公司表现反映出的情况,上游、中游、下游的行情均环比改善,说明经济自身的潜力在释放。之前担忧的政策拉动效应以及杠杆

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期

周旋 本基金基金经理 2016年01月21日 0年

注:1.对基金的前任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据基金合同规定确定的解聘日期;对此后的非前任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据基金合同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基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,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指数交易型开放式证券投资基金业务规则》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。本报告期内,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、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种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和投资组合。

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0次,是由于投资组合接受投资者申购后被动增持仓位以及指数型基金成份股调整所致。

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

3季度新能源、上游(有色金属、煤炭)周期性行业、以及电子通信、食品饮料表现突出。主要因素是这些行业的基本面增长强劲,在各行业中较为突出。展观四季上游行业价格价格上涨的态势趋强,持平概率较大,电子通信和食品饮料行业的持续性较强,仍然看好。其中我们相对看好5G的发展方向和中低端消费电子市场的高成长性。

对经济的前景更为乐观,从上市公司表现反映出的情况,上游、中游、下游的行情均环比改善,说明经济自身的潜力在释放。之前担忧的政策拉动效应以及杠杆

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期

周旋 本基金基金经理 2016年01月21日 0年

注:1.对基金的前任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据基金合同规定确定的解聘日期;对此后的非前任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据基金合同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基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,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指数交易型开放式证券投资基金业务规则》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。本报告期内,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、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种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和投资组合。

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0次,是由于投资组合接受投资者申购后被动增持仓位以及指数型基金成份股调整所致。