

中证500原材料指数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，并对其内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。
 基金托管人和中国农业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。

本报告期内自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

基金简称：南方500材料ETF

基金代码：560080

基金运作方式：交易型开放式

基金合同生效日：2016年4月21日

报告期末基金资产总额：6,731,000,000元

报告期末基金份额总额：13,993,675,526份

报告期末基金份额净值：1.0192

报告期末可供分配基金份额总额：61,122,924.84份

报告期末可供分配金额：1,019.20元

注：本基金在交易所进行系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“500材料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2017年07月01日 - 2017年09月30日

1.本期已实现收益 2,981,793.19

2.本期利润 13,993,675,526

3.期末基金资产净值 1.0192

4.期末可供分配基金份额总额 61,122,924.84

5.期末基金资产净值 1.0192

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将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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

报告期初基金份额净值 1.0000

报告期净值增长率 21.24%

净值增长率标准差 1.86%

①-③ 2.24%

②-④ -0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：本基金在交易所进行系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“500材料ETF”。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

注：上表中的股票投资组合可退避款估值增值得合项中不含可退避款估值增值得合项。

注：对本基金报告期内的股票投资组合归因分析如下：

1)单购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内对冲交易争取跟踪误差最小化。

2)报告期内的指数成份股（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离离散度较高的情况。

3)报告期内的行业表现。

截至报告期末，本基金份额净值为1.0061元，报告期内，份额净值增长率为20.17%，同期业绩基准增长率为21.24%。

4)报告期内的股票投资组合归因分析如下：

其中：沪深300成份股的买入和卖出金额较大。

5)报告期的股票投资组合。

6)报告期的债券投资。

7)报告期的权证投资。

8)报告期的股指期货投资。

9)报告期的国债期货投资。

注：上表中的股票投资组合可退避款估值增值得合项中不含可退避款估值增值得合项。

5.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合（股票投资部分）

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 002040 精艺股份 40,700 3,563,110.00 5.54

2 600516 大生农化 79,700 2,434,856.00 3.80

3 603759 华友钴业 22,300 2,039,761.00 3.10

4 002340 恒林股份 206,246 1,777,430.36 2.77

5 600219 山东钢铁 42,856 1,691,161.45 2.65

6 002271 东方锆业 40,066 1,576,047.34 2.46

7 600176 中国铝业 136,172 1,549,071.12 2.42

8 000902 中泰化学 90,000 1,629,350.00 2.39

9 601168 西部矿业 146,600 1,361,062.00 2.11

10 000488 银泰资源 69,700 1,347,207.00 2.10

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合（指数投资部分）

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农林、牧业、渔业 820,576.00 1.20

B 采掘业 5,639,547.12 8.64

C 制造业 57,056,016.00 80.14

D 电力、热力、燃气及水的生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 批发和零售业 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

J 金融业 - -

K 房地产 - -

L 相关服务和辅助服务业 - -

M 科学研究和技术服务业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 - -

S 综合 - -

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”

为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别为根据公司决定确定的解聘日期和解聘日期。2.证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员的从业资格认定，即取得基金从业资质证书，并持续符合基金从业资质认定条件的人员。

4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金不存在异常交易行为。

5.1 报告期内股票投资组合归因分析如下：

1)申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内对冲交易争取跟踪误差最小化。

2)报告期内的指数成份股（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离离散度较高的情况。

3)报告期内的行业表现。

截至报告期末，本基金份额净值为1.0061元，报告期内，份额净值增长率为20.17%，同期业绩基准增长率为21.24%。

4)报告期内的股票投资组合归因分析如下：

其中：沪深300成份股的买入和卖出金额较大。

5)报告期的股票投资组合。

6)报告期的债券投资。

7)报告期的权证投资。

8)报告期的股指期货投资。

9)报告期的国债期货投资。

注：上表中的股票投资组合可退避款估值增值得合项中不含可退避款估值增值得合项。

5.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合（股票投资部分）

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农林、牧业、渔业 820,576.00 1.20

B 采掘业 5,639,547.12 8.64

C 制造业 57,056,016.00 80.14

D 电力、热力、燃气及水的生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 批发和零售业 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

J 金融业 - -

K 房地产 - -

L 相关服务和辅助服务业 - -

M 科学研究和技术服务业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 - -

S 综合 - -

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”

为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别为根据公司决定确定的解聘日期和解聘日期。2.证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员的从业资格认定，即取得基金从业资质证书，并持续符合基金从业资质认定条件的人员。

4.3 公平交易专项说明

本报告期内，本基金不存在不公平交易行为。

5.2 报告期内按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农林、牧业、渔业 820,576.00 1.20

B 采掘业 5,639,547.12 8.64

C 制造业 57,056,016.00 80.14

D 电力、热力、燃气及水的生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 批发和零售业 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

J 金融业 - -

K 房地产 - -

L 相关服务和辅助服务业 - -

M 科学研究和技术服务业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 - -

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 - -

S 综合 - -

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”

为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别为根据公司决定确定的解聘日期和解聘日期。2.证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员的从业资格认定，即取得基金从业资质证书，并持续符合基金从业资质认定条件的人员。

4.4 报告期内基金投资组合和运作分析

截至报告期末，本基金份额净值为1.0061元，报告期内，份额净值增长率为20.17%，同期业绩基准增长率为21.24%。

4.5 报告期内基金持有或者买卖贵金属、期权、权证等金融工具的情况

注：本基金未持有贵金属、期权、权证等金融工具。

4.6 报告期内基金投资组合和资金头寸的变化情况

注：本基金未发生资金头寸的重大变化。

4.7 报告期内基金投资组合的偏离度