

中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2014 第二季度 报告

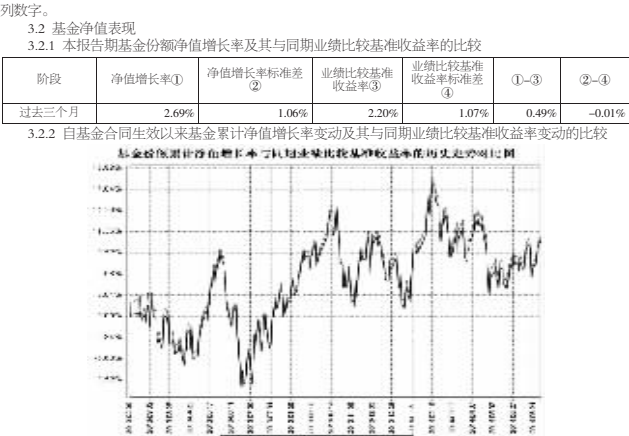
2014年6月30日

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
报告送出日期:2014年7月19日

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2014年7月16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预示其未来表现。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。
本报告财务资料未经审计。
本报告期自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

Table with 2 columns: 基金简称 (Fund Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Type), etc.

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators), 报告期末 (Report End), 本报告期 (This Period), etc.



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。

Table with 2 columns: 阶段 (Period), 净值增长率 (Net Value Growth Rate), 业绩比较基准 (Benchmark), etc.

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
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》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规及基金合同的规定,严格按照《中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的各项规定,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与标的指数相近的收益。报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的有关规定。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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
本基金于报告期内不存在异常交易行为。报告期内本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未超过该证券当日成交量的5%的交易次数为3次,是由于指数基金根据标的指数的构成成份股被动调仓所致。
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
报告期内,我国经济增长力度有所放缓,但整体保持在平稳状态。中证500指数涨2.20%,期间收益率为1.06%。本基金管理人秉承“跟踪误差最小化”、“跟踪误差主动分析系统”、“ETF现金流管理系统”等,将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平,并通过严格的风险管理流程,确保了本ETF基金的安全运作。
我们对本基金报告期内跟踪误差原因分析如下:
(1) 大额申购赎回带来的成份权重偏差,对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化;
(2) 申购赎回对成份股权重稀释,引起的成份权重偏差及基金整体仓位波动;
(3) 申购、赎回期间跟踪误差半年度成份股调整进行了基金调仓,申购我们提前了详细的调仓方案,在实施过程中引入多方数据模型进行风险评估,从实施效果来看,效果良好,跟踪误差控制在管理范围内。
4.4.2 报告期内基金的投资表现
自本基金建仓完毕至本报告期末跟踪误差率为0.374%,较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差率不超过2%的投资目标。
截至报告期末,本基金份额净值为1.1017元,报告期内,份额净值增长率为2.69%,同期业绩基准增长率为2.20%。

Table with 2 columns: 基金简称 (Fund Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Type), etc.

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2014年7月16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预示其未来表现。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。
本报告财务资料未经审计。
本报告期自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

Table with 2 columns: 基金简称 (Fund Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Type), etc.

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators), 报告期末 (Report End), 本报告期 (This Period), etc.

Table with 2 columns: 阶段 (Period), 净值增长率 (Net Value Growth Rate), 业绩比较基准 (Benchmark), etc.

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。

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage).

注:上表的股票投资组合可替代估值市值,而5.2的合计项中不可替代估值市值。

Table with 4 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

5.3.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.3.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.4 报告期末按资产类别分类的债券投资组合

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

5.11 其他资产构成

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

注:本基金本报告期末前十名股票中除上述股票外不存在流通受限情况。

5.6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 报告期初基金份额总额 (Report Start Total Shares), 报告期末基金份额总额 (Report End Total Shares), etc.

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1.中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同。
2.中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议。
3.中证500交易型开放式指数证券投资基金2014年第二季度报告原文。
8.2 存放地点
深圳市福田区福华一路6号免税商务大厦31-33楼
8.3 查阅方式
网站:http://www.nfnd.com

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (End Date), 说明 (Remarks).

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”为根据基金合同约定确定的解聘日期。

5.4 管理人报告

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.4 报告期末按资产类别分类的债券投资组合

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

5.11 其他资产构成

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

注:本基金本报告期末前十名股票中除上述股票外不存在流通受限情况。

5.6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 报告期初基金份额总额 (Report Start Total Shares), 报告期末基金份额总额 (Report End Total Shares), etc.

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1.南方中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同。
2.南方中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议。
3.南方中证500交易型开放式指数证券投资基金2014年2季度报告原文。
8.2 存放地点
深圳市福田区福华一路6号免税商务大厦31-33楼
8.3 查阅方式
网站:http://www.nfnd.com

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (End Date), 说明 (Remarks).

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”为根据基金合同约定确定的解聘日期。

5.4 管理人报告

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.4 报告期末按资产类别分类的债券投资组合

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

5.11 其他资产构成

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

注:本基金本报告期末前十名股票中除上述股票外不存在流通受限情况。

南方中证 50 债券指数证券投资基金

2014 第二季度 报告

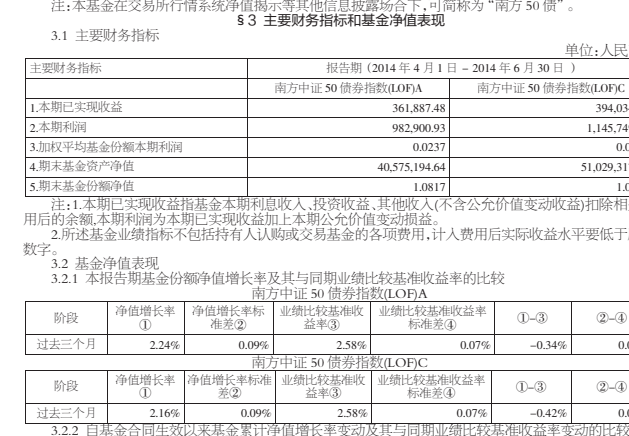
2014年6月30日

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:2014年7月19日

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2014年7月15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预示其未来表现。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。
本报告财务资料未经审计。
本报告期自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

Table with 2 columns: 基金简称 (Fund Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Type), etc.

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators), 报告期末 (Report End), 本报告期 (This Period), etc.



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损益。
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。

Table with 2 columns: 阶段 (Period), 净值增长率 (Net Value Growth Rate), 业绩比较基准 (Benchmark), etc.

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
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》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规及基金合同的规定,严格按照《南方中证50债券指数证券投资基金基金合同》的各项规定,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与标的指数相近的收益。报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的有关规定。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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
本基金于报告期内不存在异常交易行为。报告期内本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未超过该证券当日成交量的5%的交易次数为3次,是由于指数基金根据标的指数的构成成份股被动调仓所致。

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

报告期内,我国经济增长力度有所放缓,但整体保持在平稳状态。中证500指数涨2.20%,期间收益率为1.06%。本基金管理人秉承“跟踪误差最小化”、“跟踪误差主动分析系统”、“ETF现金流管理系统”等,将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平,并通过严格的风险管理流程,确保了本ETF基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差原因分析如下:
(1) 大额申购赎回带来的成份权重偏差,对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化;
(2) 申购赎回对成份股权重稀释,引起的成份权重偏差及基金整体仓位波动;
(3) 申购、赎回期间跟踪误差半年度成份股调整进行了基金调仓,申购我们提前了详细的调仓方案,在实施过程中引入多方数据模型进行风险评估,从实施效果来看,效果良好,跟踪误差控制在管理范围内。
4.4.2 报告期内基金的投资表现
自本基金建仓完毕至本报告期末跟踪误差率为0.374%,较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差率不超过2%的投资目标。
截至报告期末,本基金份额净值为1.1017元,报告期内,份额净值增长率为2.69%,同期业绩基准增长率为2.20%。

Table with 2 columns: 基金简称 (Fund Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Type), etc.

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2014年7月15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预示其未来表现。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。
本报告财务资料未经审计。
本报告期自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

Table with 2 columns: 基金简称 (Fund Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Type), etc.

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators), 报告期末 (Report End), 本报告期 (This Period), etc.

Table with 2 columns: 阶段 (Period), 净值增长率 (Net Value Growth Rate), 业绩比较基准 (Benchmark), etc.

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损益。
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。

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2014年7月15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预示其未来表现。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。
本报告财务资料未经审计。
本报告期自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

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2014年7月15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预示其未来表现。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。
本报告财务资料未经审计。
本报告期自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

Table with 2 columns: 基金简称 (Fund Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Type), etc.

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators), 报告期末 (Report End), 本报告期 (This Period), etc.



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损益。
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。

Table with 2 columns: 阶段 (Period), 净值增长率 (Net Value Growth Rate), 业绩比较基准 (Benchmark), etc.

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
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》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规及基金合同的规定,严格按照《南方中证50债券指数证券投资基金基金合同》的各项规定,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与标的指数相近的收益。报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的有关规定。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
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
本基金于报告期内不存在异常交易行为。报告期内本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未超过该证券当日成交量的5%的交易次数为3次,是由于指数基金根据标的指数的构成成份股被动调仓所致。

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

报告期内,我国经济增长力度有所放缓,但整体保持在平稳状态。中证500指数涨2.20%,期间收益率为1.06%。本基金管理人秉承“跟踪误差最小化”、“跟踪误差主动分析系统”、“ETF现金流管理系统”等,将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平,并通过严格的风险管理流程,确保了本ETF基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差原因分析如下:
(1) 大额申购赎回带来的成份权重偏差,对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化;
(2) 申购赎回对成份股权重稀释,引起的成份权重偏差及基金整体仓位波动;
(3) 申购、赎回期间跟踪误差半年度成份股调整进行了基金调仓,申购我们提前了详细的调仓方案,在实施过程中引入多方数据模型进行风险评估,从实施效果来看,效果良好,跟踪误差控制在管理范围内。
4.4.2 报告期内基金的投资表现
自本基金建仓完毕至本报告期末跟踪误差率为0.374%,较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差率不超过2%的投资目标。
截至报告期末,本基金份额净值为1.1017元,报告期内,份额净值增长率为2.69%,同期业绩基准增长率为2.20%。

Table with 2 columns: 基金简称 (Fund Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Type), etc.

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2014年7月15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预示其未来表现。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。
本报告财务资料未经审计。
本报告期自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

Table with 2 columns: 基金简称 (Fund Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Type), etc.

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators), 报告期末 (Report End), 本报告期 (This Period), etc.

Table with 2 columns: 阶段 (Period), 净值增长率 (Net Value Growth Rate), 业绩比较基准 (Benchmark), etc.

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损益。
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。