

南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2011 年年度报告

2011 年 12 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

送出日期：2012 年 3 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2012 年 3 月 20 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及其更新。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| 3.3 其他指标..... | 9 |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况..... | 9 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 15 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 15 |
| §5 托管人报告 | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 16 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 16 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 16 |
| §6 审计报告 | 17 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 17 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 17 |
| §7 年度财务报表 | 18 |
| 7.1 资产负债表..... | 18 |
| 7.2 利润表..... | 20 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 21 |
| 7.4 报表附注..... | 22 |
| §8 投资组合报告 | 39 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 39 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 39 |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 40 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 53 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 55 |
| 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细..... | 55 |

| | |
|---------------------------------------|-----------|
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 | 55 |
| 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 | 55 |
| 8.9 投资组合报告附注 | 55 |
| §9 基金份额持有人信息 | 56 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 56 |
| 9.2 期末上市基金前十名持有人 | 56 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 | 57 |
| §10 开放式基金份额变动 | 57 |
| §11 重大事件揭示 | 57 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 57 |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 57 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 57 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 58 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 58 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 58 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 58 |
| 11.8 其他重大事件 | 59 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息 | 64 |
| §13 备查文件目录 | 65 |
| 13.1 备查文件目录 | 65 |
| 13.2 存放地点 | 65 |
| 13.3 查阅方式 | 65 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|-------------------------|
| 基金名称 | 南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) |
| 基金简称 | 南方中证 500 指数 (LOF) |
| 场内简称 | 南方 500 |
| 基金主代码 | 160119 |
| 前端交易代码 | 160119 |
| 后端交易代码 | 160120 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式 (LOF) |
| 基金合同生效日 | 2009 年 9 月 25 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 4,956,039,677.38 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2009 年 11 月 11 日 |

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“南方 500”。

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金采用被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，以实现对标指数的有效跟踪。 |
| 投资策略 | 本基金为完全被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在中证 500 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。 |
| 业绩比较基准 | 中证 500 指数收益率 \times 95% + 银行活期存款利率 (税后) \times 5% |
| 风险收益特征 | 本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |

2.3 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 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 鲍文革 | 李芳菲 |
| | 联系电话 | 0755-82763888 | 010-63201510 |
| | 电子邮箱 | manager@southernfund.com | lifangfei@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-889-8899 | 95599 |
| 传真 | | 0755-82763889 | 010-63201816 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层 | 北京市东城区建国门内大街 69 号 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层 | 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 |
| 邮政编码 | | 518048 | 100031 |
| 法定代表人 | | 吴万善 | 项俊波 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.nffund.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人的办公地址 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------------|-------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所有限公司 | 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

§ 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 期间数据和指标 | 2011 年 | 2010 年 | 2009 年 9 月 25 日 - 2009 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------|-------------------|------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 11, 100, 370. 73 | 382, 178, 312. 08 | 179, 466, 602. 40 |

| | | | |
|----------------------|-------------------|------------------|------------------|
| 本期利润 | -1,751,917,639.63 | 462,616,870.73 | 522,613,376.93 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.4512 | 0.1374 | 0.1740 |
| 本期加权平均净值利润率 | -41.31% | 11.97% | 15.81% |
| 本期基金份额净值增长率 | -32.72% | 9.40% | 17.60% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2011 年末 | 2010 年末 | 2009 年末 |
| 期末可供分配利润 | -922,461,505.14 | 433,775,707.02 | 195,517,917.54 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1861 | 0.1459 | 0.0678 |
| 期末基金资产净值 | 4,033,578,172.24 | 3,658,934,810.92 | 3,391,413,066.60 |
| 期末基金份额净值 | 0.8139 | 1.2310 | 1.1760 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2011 年末 | 2010 年末 | 2009 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | -13.44% | 28.66% | 17.60% |

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. 期末可供分配利润, 采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额, 不是当期发生数)。

3. 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。

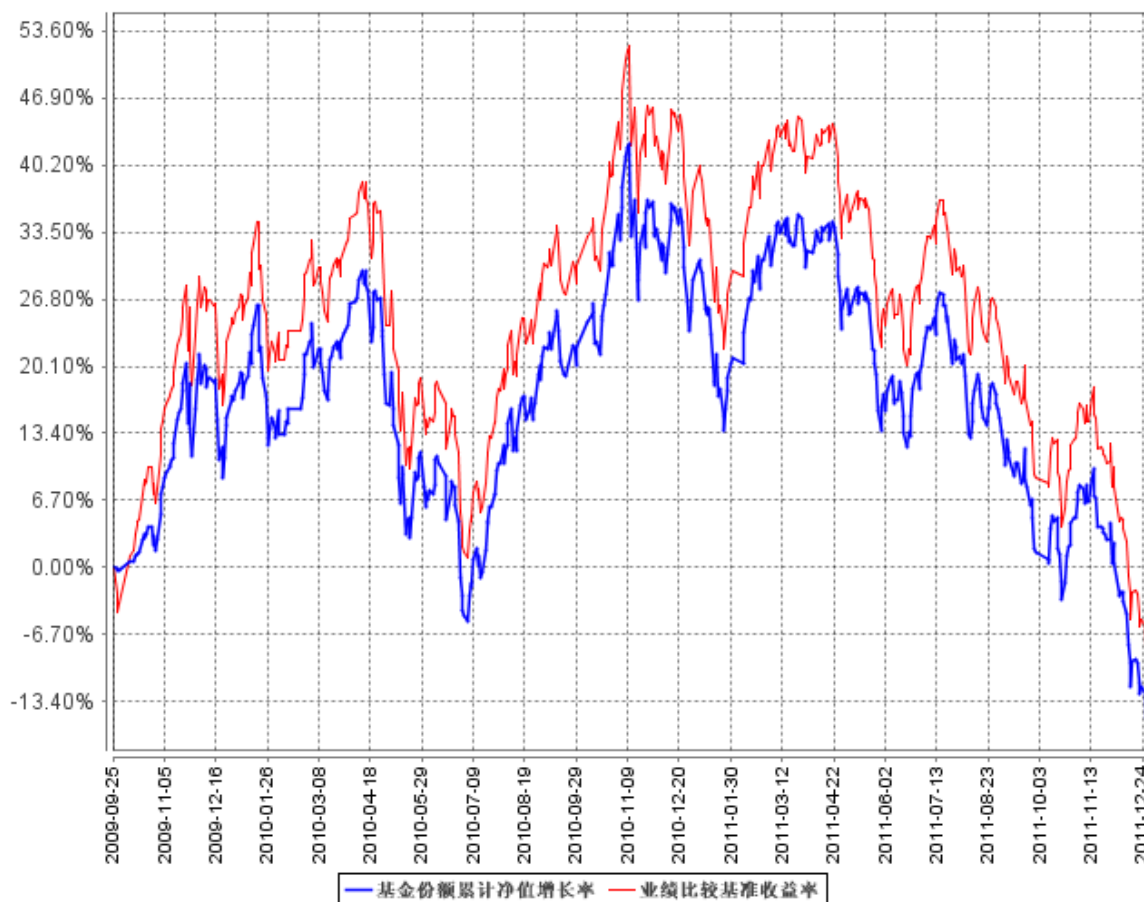
3.2 基金净值表现

3.2.1 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

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -14.69% | 1.62% | -14.55% | 1.62% | -0.14% | 0.00% |
| 过去六个月 | -27.58% | 1.52% | -27.38% | 1.52% | -0.20% | 0.00% |
| 过去一年 | -32.72% | 1.45% | -32.34% | 1.45% | -0.38% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | -13.44% | 1.60% | -6.86% | 1.63% | -6.58% | -0.03% |

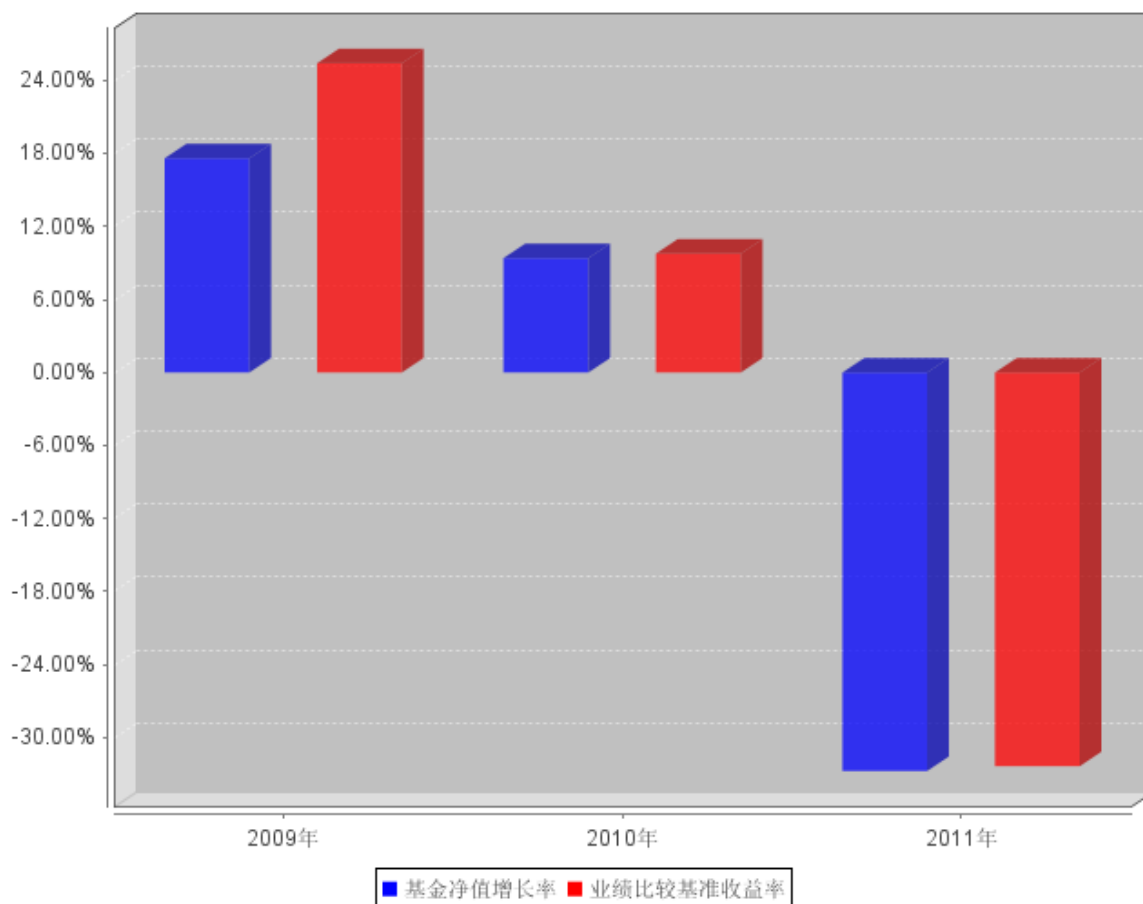
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|------|-------------|----------------|---------------|----------------|----|
| 2011 | 0.2000 | 47,591,055.34 | 32,229,449.82 | 79,820,505.16 | |
| 2010 | 0.5000 | 116,331,049.37 | 55,660,508.35 | 171,991,557.72 | |
| 2009 | - | - | - | - | |
| 合计 | 0.7000 | 163,922,104.71 | 87,889,958.17 | 251,812,062.88 | |

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[1998]4号文批准,由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000年,经中国证监会证监基金字[2000]78号文批准进行了增资扩股,注册资本达到1亿元人民币。2005年,经中国证监会证监基金字[2005]201号文批准进行增资扩股,注册资本达1.5亿元人民币。2010年,经证监许可[2010]1073号文核准深圳市机场(集团)有限公司将其持有的30%股权转让给深圳市投资控股有限公司。目前股权结构:华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。

截至报告期末,公司管理资产规模达1,700多亿元,管理2只封闭式基金——基金开元、基金天元;30只开放式基金——南方稳健成长基金、南方宝元债券型基金、南方避险增值基金、南方现金增利基金、南方积极配置基金、南方高增长基金、南方多利增强债券型基金、南方稳健成长贰号基金、南方绩优成长基金、南方成份精选基金、南方隆元产业主题基金、南方全球精选配置基金(QDII基金)、南方盛元红利股票型基金、南方优选价值股票型基金、南方恒元保本混合型基金、南方沪深300指数基金、南方中证500指数基金、深证成份交易型开放式指数基金、南方深证成份交易型开放式指数基金联接基金、南方策略优化股票型基金、中证南方小康产业交易型开放式指数基金、中证南方小康产业交易型开放式指数基金联接基金、南方广利回报债券型基金、南方金砖四国指数基金(QDII基金)、南方优选成长混合型基金、南方中证50债券指数基金、南方保本混合型基金、上证380交易型开放式指数基金、南方上证380交易型开放式指数基金联接基金和南方中国中小盘基金(QDII基金);以及多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|--------|-----------------|------|--------|----------------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张原 | 本基金的基金 | 2009年9月25日 | - | 5 | 美国密歇根大学经济学硕士学位,具有基金从 |

| | | | | | |
|-----|------------|-----------------|---|----|--|
| | 经理 | | | | 业资格。2006 年 4 月加入南方基金，曾担任南方基金研究部机械及电力设备行业高级研究员，南方高增及南方隆元基金经理助理，2009 年 9 月至今，任南方 500 基金经理；2010 年 2 月至今，任南方绩优基金经理；2011 年 2 月至今，任南方高增基金经理。 |
| 潘海宁 | 本基金的基金经理 | 2011 年 2 月 17 日 | - | 10 | 会计学学士，具有基金从业资格。曾先后任职于兴业证券股份有限公司、富国基金管理有限公司。2003 年 3 月加入南方基金，历任行业研究员、基金开元基金经理助理、投资部总监助理、量化投资部总监助理等职务。2009 年 3 月至今，任南方 300 指数基金经理；2009 年 12 月至今，任南方深成 ETF 及联接基金基金经理；2011 年 2 月至今，任南方 500 基金经理。 |
| 罗文杰 | 本基金的基金经理助理 | 2011 年 2 月 28 日 | - | 6 | 美国加州大学计算机专业和金融数学专业双硕士。曾任职于美国 Open Link Financial 公司、美国摩根斯坦利公司，参与利率及衍生品定价模型的相关工作。2008 年加盟南方基金，现任量化投资部金融工程研究员；2011 年 2 月至今，任南方小康及小康 ETF、南方 300、南方 500、深成 ETF 及南方深成基金经理助理。 |

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，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》和其他有关法律法规的规定, 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, 没有损害基金持有人利益。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规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人没有管理与本基金投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年以来, 随着政策紧缩的不断加码, 实体经济逐步回落, 企业盈利也受到较大负面影响。中证 500 指数呈现持续下跌走势, 并创出了近两年多的调整新低, 全年下跌幅度为-33.83%。

期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”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, 确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下:

①接受申购赎回所带来的股票仓位偏离, 对此我们通过日内择时交易争取跟踪误

差最小化;

②报告期内个别长期停牌证券,引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离;

③年中、年末,我们根据指数每半年的成份股调整进行了基金调仓,事前我们制定了详细的调仓方案,在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生,从实施结果来看,效果良好,跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自本基金建仓完成至报告期末年化跟踪误差为 0.329%,今年初至报告期末年化跟踪误差为 0.191%,较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过 4%的投资目标,并保持业内同类领先。

截至报告期末,本基金份额净值为 0.8139 元,报告期内,份额净值增长率为-32.72%,同期业绩基准增长率为-32.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在持续一年宏观调控和经济增速下滑的双重作用下,我国经济的通胀压力明显减弱。整体来看,通胀回落已经是大势所趋,控通胀成效进一步显现,政策已没有进一步紧缩的必要。到了明年,随着经济增速的回落和基数的增加,通胀也许不再是问题。经济增速回落加快将逐渐取代通胀成为市场首要担心的问题。目前,货币政策面临着从偏紧到适度放松的转向,预调微调成为主基调。考虑到 09 年过度宽松政策带来了一系列负面影响,尤其是物价和房价大幅上涨,目前房地产调控处在关键时期,放松的可能性小。但在通胀下行趋势确立的情况下,货币政策和财政政策的放松力度可能超出预期。

虽然股市精确底部难以测算,但根据 A 股市场在 2005 年 11 月(资金供求极端恶化)和 2008 年 10 月(经济极端恶化)形成的两个大底的标准来看,目前市场已进入底部区域。随着政策的逐渐转向,A 股有望通过反复震荡,逐步完成筑底过程。

本基金为指数基金,作为基金管理人,我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨,实现对标的指数的有效跟踪,为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格,借助投资本基金参与市场。

对于没有太多精力专注于股市的投资者，我们认为通过本基金进行定期定投，不失为一种较为省心省力且长期效果不俗的投资方式。而对于那些股市经验丰富的投资者，我们建议在主动配置个股的同时，可根据自己对大盘的判断，用部分仓位通过指数基金进行快速加减仓的波段操作，这也是目前较多专业机构投资者的惯用方法。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 进一步完善公司各项内部管理制度

本年度监察稽核部加强公司各项内部管理制度的制订、修订工作，对公司各业务部门的内部控制制度提出修改意见和建议，并关注制度的健全性和有效性，进一步完善了公司内控制度，达到更好地防范风险的目的。

(2) 内部审计和开展 SAS70 国际专项认证工作

按照证监会的要求对公司投资、研究、交易、信息技术、基金会计、注册登记、人力资源、基金销售等主要业务进行定期稽核工作。同时，对投资研究、信息技术、基金直销、后台运营等相关业务开展了专项稽核工作，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性等。经过一年多的努力，SAS70 项目圆满完成，普华永道会计师事务所于 2011 年 3 月 15 日出具了无保留意见的 SAS70 内部控制报告。

(3) 采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强了对日常投资运作的管理和监控，保证投资遵循既定的投资决策程序与业务流程，基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

(4) 继续做好反商业贿赂工作，从源头上控制销售风险

本年度，我公司积极开展反商业贿赂工作，对公司旗下基金的代销、直销业务进行自查，此项工作有利于更好地控制销售风险。

(5) 对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训

本年度，我公司采取外聘专家和内部专业人士相结合的方式，对各业务部门

进行了相关法律法规培训和职业道德培训, 进一步提高了我司从业人员的合规素质和职业道德修养。

(6) 全面参与新产品设计、新业务拓展工作, 负责日常合同审查, 监督客户投诉处理。积极参与证监会新规定出台前的讨论并提出修改建议。

(7) 信息披露和投资者关系管理工作

完成各基金及公司的各项信息披露工作, 保证所披露信息的真实性、准确性和完整性; 重视媒体监督和投资者关系管理工作。

通过以上工作的开展, 在本报告期内本基金运作过程中未发生禁止性关联交易、内幕交易, 也不存在本基金管理人管理的各基金之间的违规交叉交易, 基金运作整体合法合规。在今后的工作中, 本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性, 努力防范各种风险, 为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定, 本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定, 对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中, 本基金管理人为了确保估值工作的合规开展, 建立了负责估值工作决策和执行的专门机构, 组成人员包括督察长、数量化投资部总监、监察稽核总监及基金会计负责人等。其中, 超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验, 且具有风控、合规、会计方面的专业经验。同时, 根据基金管理公司制订的相关制度, 负责估值工作决策和执行的机构成员中不包括基金经理。本报告期内, 参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定, 本基金的收益分配原则为: 每一基金份额享有同等分配权; 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配; 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值, 即: 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值, 基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日; 在符合有

关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多 6 次，每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则，在符合分红条件的情况下，本基金于 2011 年 8 月 2 日向基金份额持有人每 10 份派 0.20 元。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定以及《南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》、《南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》的约定，对南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 管理人—南方基金管理有限公司 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，南方基金管理有限公司在南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，南方基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务

会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 普华永道中天审字(2012)第 20572 号 |

6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题 | 审计报告 |
|--------------|---|
| 审计报告收件人 | 南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人； |
| 引言段 | 我们审计了后附的南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“南方中证 500 指数基金”) 的财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年度的利润表和所有者权益 (基金净值) 变动表以及财务报表附注。 |
| 管理层对财务报表的责任段 | 编制和公允列报财务报表是南方中证 500 指数基金的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 |
| 注册会计师的责任段 | 我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 |
| 审计意见段 | 我们认为，上述南方中证 500 指数基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国 |

| | |
|-----------|--|
| | 证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了南方中证 500 指数基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。 |
| 注册会计师的姓名 | 薛竞 徐振晨 |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所有限公司 |
| 会计师事务所的地址 | 中国 · 上海市 |
| 审计报告日期 | 2011 年 3 月 21 日 |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2011 年 12 月 31 日 | 上年度末 2010 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 220,681,198.52 | 187,051,646.55 |
| 结算备付金 | | 4,084,350.08 | 2,444,946.61 |
| 存出保证金 | | 1,072,000.86 | 717,981.47 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 3,804,627,867.53 | 3,474,189,896.70 |
| 其中：股票投资 | | 3,804,627,867.53 | 3,474,189,896.70 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 45,626.84 | 40,735.14 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 25,432,664.28 | 10,686,452.57 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 4,055,943,708.11 | 3,675,131,659.04 |

| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2011 年 12 月 31 日 | 上年度末 2010 年 12 月 31 日 |
|-------------------|----------|-------------------------|--------------------------|
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 8,814,509.31 |
| 应付赎回款 | | 17,121,087.36 | 2,820,991.50 |
| 应付管理人报酬 | | 2,208,748.16 | 1,840,818.45 |
| 应付托管费 | | 441,749.65 | 368,163.68 |
| 应付销售服务费 | | | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 909,767.02 | 1,449,688.64 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 1,684,183.68 | 902,676.54 |
| 负债合计 | | 22,365,535.87 | 16,196,848.12 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 4,956,039,677.38 | 2,972,289,432.83 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | -922,461,505.14 | 686,645,378.09 |
| 所有者权益合计 | | 4,033,578,172.24 | 3,658,934,810.92 |
| 负债和所有者权益总计 | | 4,055,943,708.11 | 3,675,131,659.04 |

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8139 元，基金份额总额 4,956,039,677.38 份。

7.2 利润表

会计主体：南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------------------|----------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| | | 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |
| 一、收入 | | -1,712,056,557.10 | 503,902,598.98 |
| 1. 利息收入 | | 1,658,175.11 | 1,726,169.83 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 1,657,346.64 | 1,725,795.58 |
| 债券利息收入 | | 828.47 | 374.25 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益(损失以“-”填列) | | 46,421,133.47 | 412,433,038.82 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 25,633,631.20 | 395,460,548.10 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 177,298.19 | 148,280.55 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 20,610,204.08 | 16,824,210.17 |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 7.4.7.16 | -1,763,018,010.36 | 80,438,558.65 |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列) | 7.4.7.17 | 2,882,144.68 | 9,304,831.68 |
| 减：二、费用 | | 39,861,082.53 | 41,285,728.25 |
| 1. 管理人报酬 | | 25,353,558.63 | 23,255,071.82 |
| 2. 托管费 | | 5,070,711.78 | 4,651,014.34 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.18 | 8,098,225.10 | 12,096,286.15 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.19 | 1,338,587.02 | 1,283,355.94 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | -1,751,917,639.63 | 462,616,870.73 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | -1,751,917,639.63 | 462,616,870.73 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)

本报告期: 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | | |
|--|---|-------------------|-------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 2,972,289,432.83 | 686,645,378.09 | 3,658,934,810.92 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -1,751,917,639.63 | -1,751,917,639.63 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 1,983,750,244.55 | 222,631,261.56 | 2,206,381,506.11 |
| 其中: 1.基金申购款 | 4,172,769,994.16 | 476,116,732.96 | 4,648,886,727.12 |
| 2.基金赎回款 | -2,189,019,749.61 | -253,485,471.40 | -2,442,505,221.01 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | -79,820,505.16 | -79,820,505.16 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 4,956,039,677.38 | -922,461,505.14 | 4,033,578,172.24 |
| 项目 | 上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 2,882,661,867.84 | 508,751,198.76 | 3,391,413,066.60 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 462,616,870.73 | 462,616,870.73 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 89,627,564.99 | -112,731,133.68 | -23,103,568.69 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 6,367,804,733.77 | 1,147,089,613.98 | 7,514,894,347.75 |
| 2. 基金赎回款 | -6,278,177,168.78 | -1,259,820,747.66 | -7,537,997,916.44 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | -171,991,557.72 | -171,991,557.72 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 2,972,289,432.83 | 686,645,378.09 | 3,658,934,810.92 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署

| | | |
|-----------|------------|----------|
| 高良玉 | 鲍文革 | 鲍文革 |
| 基金管理人负责人: | 主管会计工作负责人: | 会计机构负责人: |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]755 号《关于核准南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,222,521,419.53 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 187 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2009 年 9 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,223,217,818.45 份基金份额,其中认购资金利息折合 696,398.92 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2009]第 147 号文审核同意,本基金 581,411,748.00 份基金份额于 2009 年 11 月 11 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证 500 指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中,中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,权证及其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金力争净值增长率与业绩比较基准间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%,年跟踪误差不得超过 4%。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 \times 95% + 银行活期存款利率(税后) \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 2011 年 3 月 21 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的

重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差

异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2011 年 12 月 31 日 | 上年度末 2010 年 12 月 31 日 |
|------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 220,681,198.52 | 187,051,646.55 |
| 定期存款 | - | - |
| 其他存款 | - | - |
| 合计 | 220,681,198.52 | 187,051,646.55 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2011 年 12 月 31 日 | | |
|--------|--------------------------|------------------|-------------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 5,144,060,544.71 | 3,804,627,867.53 | -1,339,432,677.18 |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 5,144,060,544.71 | 3,804,627,867.53 | -1,339,432,677.18 |
| 项目 | 上年度末 2010 年 12 月 31 日 | | |
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 3,050,604,563.52 | 3,474,189,896.70 | 423,585,333.18 |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |

| | | | |
|----|------------------|------------------|----------------|
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 3,050,604,563.52 | 3,474,189,896.70 | 423,585,333.18 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2011 年 12 月 31 日 | 上年度末 2010 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息 | 43,788.84 | 39,879.44 |
| 应收定期存款利息 | - | - |
| 应收其他存款利息 | - | - |
| 应收结算备付金利息 | 1,838.00 | 855.70 |
| 应收债券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | - | - |
| 应收申购款利息 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 45,626.84 | 40,735.14 |

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2011 年 12 月 31 日 | 上年度末 2010 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 909,767.02 | 1,449,688.64 |
| 银行间市场应付交易费用 | - | - |
| 合计 | 909,767.02 | 1,449,688.64 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2011 年 12 月 31 日 | 上年度末 2010 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 750,000.00 | 500,000.00 |
| 应付赎回费 | 74,439.21 | 16,075.55 |
| 预提费用 | 859,744.47 | 386,600.99 |

| | | |
|----|--------------|------------|
| 合计 | 1,684,183.68 | 902,676.54 |
|----|--------------|------------|

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | |
|---------------|--|-------------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 2,972,289,432.83 | 2,972,289,432.83 |
| 本期申购 | 4,172,769,994.16 | 4,172,769,994.16 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -2,189,019,749.61 | -2,189,019,749.61 |
| 本期末 | 4,956,039,677.38 | 4,956,039,677.38 |

注：

1. 申购含红利再投份额。

2. 截至 2011 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 151,394,437.00 份(2010 年 12 月 31 日：156,118,599.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 4,804,645,240.38 份(2010 年 12 月 31 日：2,816,170,833.83 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|-------------------|------------------|
| 上年度末 | 433,775,707.02 | 252,869,671.07 | 686,645,378.09 |
| 本期利润 | 9,110,762.65 | -1,761,028,402.28 | 1,751,917,639.63 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 325,185,604.28 | -102,554,342.72 | 222,631,261.56 |
| 其中：基金申购款 | 674,986,547.22 | -198,869,814.26 | 476,116,732.96 |
| 基金赎回款 | -349,800,942.94 | 96,315,471.54 | 253,485,471.40 |
| 本期已分配利润 | -79,820,505.16 | - | 79,820,505.16 |
| 本期末 | 688,251,568.79 | -1,610,713,073.93 | 922,461,505.14 |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |
|-----------|---|--|
| 活期存款利息收入 | 1,576,763.80 | 1,658,079.47 |
| 定期存款利息收入 | - | - |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 50,454.11 | 44,749.68 |
| 其他 | 30,128.73 | 22,966.43 |

| | | |
|----|--------------|--------------|
| 合计 | 1,657,346.64 | 1,725,795.58 |
|----|--------------|--------------|

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2011年1月1日至 2011年12月31日 | 上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日 |
|------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 1,956,130,350.88 | 3,816,267,375.89 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,930,496,719.68 | 3,420,806,827.79 |
| 买卖股票差价收入 | 25,633,631.20 | 395,460,548.10 |

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2011年1月1日至 2011年12月31日 | 上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日 |
|----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券成交金额 | 2,584,626.66 | 1,062,454.80 |
| 减：卖出成本总额 | 2,406,500.00 | 913,800.00 |
| 减：应收利息总额 | 828.47 | 374.25 |
| 债券投资收益 | 177,298.19 | 148,280.55 |

7.4.7.14 衍生工具收益

无发生额。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2011年1月1日至 2011年12月31日 | 上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日 |
|-------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 20,610,204.08 | 16,824,210.17 |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 20,610,204.08 | 16,824,210.17 |

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2011年1月1日至 2011年12月31日 | 上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日 |
|------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 1.交易性金融资产 | -1,763,018,010.36 | 80,438,558.65 |
| ——股票投资 | -1,763,018,010.36 | 80,438,558.65 |
| ——债券投资 | - | - |
| ——资产支持证券投资 | - | - |
| ——基金投资 | - | - |
| 2.衍生工具 | - | - |

| | | |
|--------|-------------------|---------------|
| ——权证投资 | - | - |
| 3.其他 | - | - |
| 合计 | -1,763,018,010.36 | 80,438,558.65 |

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2011年1月1日至 2011年12月31日 | 上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 2,882,144.68 | 9,304,831.68 |
| 合计 | 2,882,144.68 | 9,304,831.68 |

注：本基金的场内部分的赎回费率为 0.5%，场外部分的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2011年1月1日至 2011年12月31日 | 上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日 |
|-----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 8,098,225.10 | 12,096,286.15 |
| 银行间市场交易费用 | - | - |
| 合计 | 8,098,225.10 | 12,096,286.15 |

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2011年1月1日至 2011年12月31日 | 上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 审计费用 | 102,000.00 | 102,000.00 |
| 信息披露费 | 300,000.00 | 300,000.00 |
| 指数使用费 | 845,118.66 | 783,990.16 |
| 上市年费 | 60,000.00 | 60,000.00 |
| 银行划款手续费 | 31,268.36 | 37,265.78 |
| 账户维护费 | 200.00 | 100.00 |
| 合计 | 1,338,587.02 | 1,283,355.94 |

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季(自然季度)人民币 50,000.00 元。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|------------------------|
| 南方基金管理有限公司(“南方基金”) | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”) | 基金托管人、基金代销机构 |
| 华泰证券股份有限公司(“华泰证券”) | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 兴业证券股份有限公司(“兴业证券”) | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 厦门国际信托有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 深圳市投资控股有限公司(i) | 基金管理人的股东(2010年9月10日起) |
| 深圳市机场(集团)有限公司(i) | 基金管理人的原股东(2010年9月10日前) |

注：

(i)根据基金管理人南方基金 2009 年第一次临时股东会会议决议以及中国证监会证监许可[2010]1073 号《关于核准南方基金管理有限公司变更股权的批复》核准，深圳市投资控股有限公司受让深圳市机场(集团)有限公司持有的南方基金 30%的股权，南方基金于 2010 年 9 月 10 日完成了工商登记变更手续。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2011年1月1日至 2011年12月31日 | | 上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日 | |
|-------|---------------------------------|----------------------|--------------------------------------|----------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的 比例 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的 比例 |
| 华泰证券 | 853,280,794.60 | 14.28% | 1,703,148,092.83 | 21.67% |

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2011年1月1日至2011年12月31日 |
|-------|-----------------------------|
| | |

| | 当期 佣金 | 占当期佣金总量 的比例 | 期末应付佣金 余额 | 占期末应付佣金 总额的比例 |
|-------|---|----------------|--------------|------------------|
| 华泰证券 | 693,302.28 | 13.94% | 58,900.95 | 6.47% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 | | | |
| | 当期 佣金 | 占当期佣金总量 的比例 | 期末应付佣金 余额 | 占期末应付佣金 总额的比例 |
| 华泰证券 | 1,383,827.33 | 21.12% | 442,471.35 | 30.52% |

注:

1.上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |
|-----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 25,353,558.63 | 23,255,071.82 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 5,983,230.72 | 5,011,291.82 |

注:支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.6%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X0.6%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |
|----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,070,711.78 | 4,651,014.34 |

注:支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.12%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X0.12%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

| 项目 | 本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|---|--|
| 期初持有的基金份额 | - | 49,996,750.00 |
| 期间申购/总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回总份额 | - | 49,996,750.00 |
| 期末持有的基金份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | - | - |

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方 名称 | 本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 | |
|-----------|---|--------------|--|--------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行 | 220,681,198.52 | 1,576,763.80 | 187,051,646.55 | 1,658,079.47 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

| 序号 | 权益 登记日 | 除息日(场内) | 除息日(场外) | 每 10 份 基金份额分 红数 | 现金形式 发放总额 | 再投资形式 发放总额 | 本期利润分配 合计 | 备注 |
|----|------------|------------|------------|-----------------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 1 | 2011/08/02 | 2011/08/03 | 2011/08/02 | 0.200 | 47,591,055.34 | 32,229,449.82 | 79,820,505.16 | |
| 合计 | | | | 0.200 | 47,591,055.34 | 32,229,449.82 | 79,820,505.16 | |

7.4.12 期末(2011 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|-------|------------|--------|--------|------------|--------|--------------|----------------|----------------|----|
| 000816 | 江淮动力 | 2011/11/07 | 重大资产重组 | 7.04 | 2012/02/27 | 6.51 | 2,280,779.00 | 14,513,454.40 | 16,056,684.16 | |
| 002051 | 中工国际 | 2011/12/08 | 重大资产重组 | 27.97 | 2012/03/19 | 30.00 | 476,742 | 11,477,069.78 | 13,334,473.74 | |
| 000655 | 金岭矿业 | 2011/12/12 | 公告重大事项 | 14.80 | 2012/02/07 | 16.28 | 806,510 | 17,179,247.77 | 11,936,348.00 | |
| 600820 | 隧道股份 | 2011/12/27 | 重大资产重组 | 7.87 | 2012/01/04 | 8.15 | 1,384,648 | 14,610,160.24 | 10,897,179.76 | |
| 000522 | 白云山 A | 2011/11/07 | 重大资产重组 | 12.16 | 未知 | 未知 | 859,779 | 11,825,555.01 | 10,454,912.64 | |
| 600963 | 岳阳林纸 | 2011/12/27 | 公告重大事项 | 4.68 | 2012/01/04 | 4.92 | 1,818,991 | 15,536,178.76 | 8,512,877.88 | |
| 600991 | 广汽长丰 | 2011/12/29 | 公告重大事项 | 14.72 | 2012/01/04 | 15.11 | 564,648 | 7,119,510.30 | 8,311,618.56 | |
| 600332 | 广州药业 | 2011/11/07 | 重大资产重组 | 13.14 | 未知 | 未知 | 619,029 | 8,753,046.72 | 8,134,041.06 | |
| 600121 | 郑州煤电 | 2011/10/10 | 重大资产重组 | 10.43 | 2012/01/13 | 11.47 | 777,542 | 8,732,570.86 | 8,109,763.06 | |
| 600056 | 中国医药 | 2011/11/16 | 重大资产重组 | 20.24 | 未知 | 未知 | 339,074 | 6,771,336.46 | 6,862,857.76 | |
| 000677 | ST 海龙 | 2011/08/22 | 公告重大事项 | 4.82 | 未知 | 未知 | 1,185,013 | 7,763,981.55 | 5,711,762.66 | |
| 000005 | 世纪星源 | 2011/05/03 | 公告重大事项 | 3.86 | 未知 | 未知 | 1,350,681 | 6,277,734.31 | 5,213,628.66 | |
| 合计 | | | | | | | | 130,559,846.16 | 113,536,147.94 | |

注：本基金截至 2011 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现。本基金投资的金融工具主要为股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主

要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内,使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会,负责制定风险管理的宏观政策,审议通过风险控制的总体措施等;在管理层层面设立风险控制委员会,讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施;在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司总经理负责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围之内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行,与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主,外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险,以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外,本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级,通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制,通过分散化投资以分散信用风险。于 2011 年 12 月 31 日,本基金未持有信用类债券(2010 年 12 月 31 日:同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请

的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所上市,因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余金融资产均能以合理价格适时变现。

于 2011 年 12 月 31 日,本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金等,其余金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

| 本期末 2011 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1 至 5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------------|-----------------------|---------|-------|-------------------------|-------------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 220,681,198.52 | - | - | - | 220,681,198.52 |
| 结算备付金 | 4,084,350.08 | - | - | - | 4,084,350.08 |
| 存出保证金 | - | - | - | 1,072,000.86 | 1,072,000.86 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 3,804,627,867.53 | 3,804,627,867.53 |
| 应收利息 | - | - | - | 45,626.84 | 45,626.84 |
| 应收申购款 | 23,311,191.36 | - | - | 2,121,472.92 | 25,432,664.28 |
| 资产总计 | 248,076,739.96 | - | - | 3,807,866,968.15 | 4,055,943,708.11 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 17,121,087.36 | 17,121,087.36 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 2,208,748.16 | 2,208,748.16 |
| 应付托管费 | - | - | - | 441,749.65 | 441,749.65 |

| | | | | | |
|----------------|-----------------------|---|---|-------------------------|-------------------------|
| 应付交易费用 | - | - | - | 909,767.02 | 909,767.02 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,684,183.68 | 1,684,183.68 |
| 负债总计 | - | - | - | 22,365,535.87 | 22,365,535.87 |
| 利率敏感度缺口 | 248,076,739.96 | - | - | 3,785,501,432.28 | 4,033,578,172.24 |

| 上年度末 2010 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1 至 5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|--------------------------|-----------------------|---------|-------|-------------------------|-------------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 187,051,646.55 | - | - | - | 187,051,646.55 |
| 结算备付金 | 2,444,946.61 | - | - | - | 2,444,946.61 |
| 存出保证金 | - | - | - | 717,981.47 | 717,981.47 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 3,474,189,896.70 | 3,474,189,896.70 |
| 应收利息 | - | - | - | 40,735.14 | 40,735.14 |
| 应收申购款 | - | - | - | 10,686,452.57 | 10,686,452.57 |
| 资产总计 | 189,496,593.16 | - | - | 3,485,635,065.88 | 3,675,131,659.04 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 8,814,509.31 | 8,814,509.31 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 2,820,991.50 | 2,820,991.50 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,840,818.45 | 1,840,818.45 |
| 应付托管费 | - | - | - | 368,163.68 | 368,163.68 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 1,449,688.64 | 1,449,688.64 |
| 其他负债 | - | - | - | 902,676.54 | 902,676.54 |
| 负债总计 | - | - | - | 16,196,848.12 | 16,196,848.12 |
| 利率敏感度缺口 | 189,496,593.16 | - | - | 3,469,438,217.76 | 3,658,934,810.92 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2010 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为完全被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在中证 500 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应

调整。本基金通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 500 指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中，中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2011 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2010 年 12 月 31 日 | |
|--------------|-------------------------|--------------|--------------------------|--------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 3,804,627,867.53 | 94.32 | 3,474,189,896.70 | 94.95 |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 3,804,627,867.53 | 94.32 | 3,474,189,896.70 | 94.95 |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除中证 500 指数以外的其他市场变量保持不变 | | |
|-------------------|-------------------------|------------------------------|--------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币万元) | |
| | | 本期末 2011 年 12 月 31 日 | 上年度末 2010 年 12 月 31 日 |
| | 1. 中证 500 指数上升 5% | 增加约 20,168 | 增加约 18,115 |
| 2. 中证 500 指数下降 5% | 减少约 20,168 | 减少约 18,115 | |

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可

观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于2011年12月31日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为3,704,681,292.07元, 属于第二层级的余额为99,946,575.46元, 无属于第三层级的余额(2010年12月31日: 第一层级3,415,518,834.55元, 第二层级58,671,062.15元, 无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况, 本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------------------|------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 3,804,627,867.53 | 93.80 |
| | 其中: 股票 | 3,804,627,867.53 | 93.80 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中: 债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中: 买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 224,765,548.60 | 5.54 |
| 6 | 其他各项资产 | 26,550,291.98 | 0.65 |
| 7 | 合计 | 4,055,943,708.11 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位: 人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|-----|----------------|------------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 69,286,721.91 | 1.72 |
| B | 采掘业 | 104,468,366.93 | 2.59 |
| C | 制造业 | 2,196,510,337.59 | 54.46 |
| C0 | 食品、饮料 | 186,982,132.98 | 4.64 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 89,707,696.93 | 2.22 |
| C2 | 木材、家具 | 15,964,908.62 | 0.40 |
| C3 | 造纸、印刷 | 92,676,330.25 | 2.30 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 405,948,968.37 | 10.06 |
| C5 | 电子 | 273,276,843.56 | 6.78 |
| C6 | 金属、非金属 | 282,790,954.59 | 7.01 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 568,554,998.33 | 14.10 |
| C8 | 医药、生物制品 | 268,121,823.69 | 6.65 |
| C99 | 其他制造业 | 12,485,680.27 | 0.31 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 113,192,943.27 | 2.81 |
| E | 建筑业 | 114,512,884.11 | 2.84 |
| F | 交通运输、仓储业 | 143,195,661.56 | 3.55 |
| G | 信息技术业 | 230,029,530.99 | 5.70 |
| H | 批发和零售贸易 | 324,827,140.60 | 8.05 |
| I | 金融、保险业 | 31,711,288.85 | 0.79 |
| J | 房地产业 | 282,403,990.31 | 7.00 |
| K | 社会服务业 | 138,681,795.95 | 3.44 |
| L | 传播与文化产业 | 45,063,892.46 | 1.12 |
| M | 综合类 | 10,743,313.00 | 0.27 |
| | 合计 | 3,804,627,867.53 | 94.32 |

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量 (股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|---------------|
| 1 | 000581 | 威孚高科 | 980,134 | 35,177,009.26 | 0.87 |
| 2 | 000917 | 电广传媒 | 880,500 | 22,355,895.00 | 0.55 |
| 3 | 000970 | 中科三环 | 1,099,868 | 21,986,361.32 | 0.55 |
| 4 | 600079 | 人福医药 | 1,069,126 | 20,602,058.02 | 0.51 |
| 5 | 002038 | 双鹭药业 | 618,697 | 20,324,196.45 | 0.50 |
| 6 | 600160 | 巨化股份 | 959,399 | 19,235,949.95 | 0.48 |
| 7 | 600770 | 综艺股份 | 1,196,674 | 19,063,016.82 | 0.47 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|-----------|---------------|------|
| 8 | 002065 | 东华软件 | 862,471 | 19,026,110.26 | 0.47 |
| 9 | 000939 | 凯迪电力 | 1,788,434 | 18,957,400.40 | 0.47 |
| 10 | 600805 | 悦达投资 | 1,536,360 | 18,881,864.40 | 0.47 |
| 11 | 002236 | 大华股份 | 377,900 | 18,743,840.00 | 0.46 |
| 12 | 600637 | 百视通 | 1,206,582 | 18,159,059.10 | 0.45 |
| 13 | 002123 | 荣信股份 | 1,092,050 | 17,833,176.50 | 0.44 |
| 14 | 002353 | 杰瑞股份 | 248,775 | 17,414,250.00 | 0.43 |
| 15 | 600138 | 中青旅 | 1,124,927 | 16,941,400.62 | 0.42 |
| 16 | 000826 | 桑德环境 | 671,685 | 16,926,462.00 | 0.42 |
| 17 | 600060 | 海信电器 | 1,411,922 | 16,773,633.36 | 0.42 |
| 18 | 600570 | 恒生电子 | 1,351,489 | 16,542,225.36 | 0.41 |
| 19 | 000816 | 江淮动力 | 2,280,779 | 16,056,684.16 | 0.40 |
| 20 | 600601 | 方正科技 | 5,944,700 | 15,991,243.00 | 0.40 |
| 21 | 000400 | 许继电气 | 819,648 | 15,860,188.80 | 0.39 |
| 22 | 600199 | 金种子酒 | 1,053,700 | 15,700,130.00 | 0.39 |
| 23 | 000963 | 华东医药 | 587,823 | 15,647,848.26 | 0.39 |
| 24 | 000759 | 中百集团 | 1,844,497 | 15,585,999.65 | 0.39 |
| 25 | 000998 | 隆平高科 | 600,616 | 15,501,898.96 | 0.38 |
| 26 | 002008 | 大族激光 | 2,262,927 | 14,844,801.12 | 0.37 |
| 27 | 600880 | 博瑞传播 | 1,190,625 | 14,763,750.00 | 0.37 |
| 28 | 600750 | 江中药业 | 505,639 | 14,663,531.00 | 0.36 |
| 29 | 600366 | 宁波韵升 | 975,441 | 14,465,790.03 | 0.36 |
| 30 | 600311 | 荣华实业 | 1,802,729 | 14,295,640.97 | 0.35 |
| 31 | 600643 | 爱建股份 | 2,222,018 | 14,220,915.20 | 0.35 |
| 32 | 600436 | 片仔癀 | 189,549 | 14,053,162.86 | 0.35 |
| 33 | 000541 | 佛山照明 | 1,428,240 | 13,925,340.00 | 0.35 |
| 34 | 002344 | 海宁皮城 | 606,692 | 13,729,439.96 | 0.34 |
| 35 | 002022 | 科华生物 | 1,333,305 | 13,666,376.25 | 0.34 |
| 36 | 600522 | 中天科技 | 848,072 | 13,552,190.56 | 0.34 |
| 37 | 000877 | 天山股份 | 632,097 | 13,400,456.40 | 0.33 |
| 38 | 000596 | 古井贡酒 | 155,830 | 13,398,263.40 | 0.33 |
| 39 | 002051 | 中工国际 | 476,742 | 13,334,473.74 | 0.33 |
| 40 | 000540 | 中天城投 | 2,078,108 | 13,237,547.96 | 0.33 |
| 41 | 600298 | 安琪酵母 | 446,426 | 13,129,388.66 | 0.33 |
| 42 | 600259 | 广晟有色 | 337,700 | 12,876,501.00 | 0.32 |
| 43 | 600594 | 益佰制药 | 764,310 | 12,825,121.80 | 0.32 |
| 44 | 600325 | 华发股份 | 1,770,300 | 12,799,269.00 | 0.32 |
| 45 | 000930 | 中粮生化 | 2,089,580 | 12,621,063.20 | 0.31 |
| 46 | 000501 | 鄂武商 A | 824,295 | 12,570,498.75 | 0.31 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------------|------------------|-------|
| 47 | 600210 | 紫江企业 | 3, 113, 000 | 12, 483, 130. 00 | 0. 31 |
| 48 | 000799 | 酒鬼酒 | 527, 991 | 12, 413, 068. 41 | 0. 31 |
| 49 | 600867 | 通化东宝 | 1, 471, 635 | 12, 317, 584. 95 | 0. 31 |
| 50 | 000650 | 仁和药业 | 1, 024, 225 | 12, 300, 942. 25 | 0. 30 |
| 51 | 002250 | 联化科技 | 645, 150 | 12, 180, 432. 00 | 0. 30 |
| 52 | 600584 | 长电科技 | 2, 310, 687 | 12, 177, 320. 49 | 0. 30 |
| 53 | 000762 | 西藏矿业 | 601, 605 | 12, 020, 067. 90 | 0. 30 |
| 54 | 600072 | 中船股份 | 777, 434 | 12, 011, 355. 30 | 0. 30 |
| 55 | 002230 | 科大讯飞 | 342, 203 | 11, 977, 105. 00 | 0. 30 |
| 56 | 000503 | 海虹控股 | 1, 952, 354 | 11, 967, 930. 02 | 0. 30 |
| 57 | 000417 | 合肥百货 | 844, 942 | 11, 939, 030. 46 | 0. 30 |
| 58 | 000655 | 金岭矿业 | 806, 510 | 11, 936, 348. 00 | 0. 30 |
| 59 | 600110 | 中科英华 | 3, 115, 527 | 11, 932, 468. 41 | 0. 30 |
| 60 | 600141 | 兴发集团 | 692, 941 | 11, 842, 361. 69 | 0. 29 |
| 61 | 600557 | 康缘药业 | 802, 440 | 11, 803, 892. 40 | 0. 29 |
| 62 | 000830 | 鲁西化工 | 1, 983, 687 | 11, 802, 937. 65 | 0. 29 |
| 63 | 601588 | 北辰实业 | 4, 322, 600 | 11, 800, 698. 00 | 0. 29 |
| 64 | 600653 | 申华控股 | 4, 729, 951 | 11, 682, 978. 97 | 0. 29 |
| 65 | 600022 | 济南钢铁 | 3, 380, 600 | 11, 663, 070. 00 | 0. 29 |
| 66 | 000636 | 风华高科 | 1, 817, 211 | 11, 611, 978. 29 | 0. 29 |
| 67 | 600816 | 安信信托 | 860, 900 | 11, 579, 105. 00 | 0. 29 |
| 68 | 600797 | 浙大网新 | 2, 280, 502 | 11, 539, 340. 12 | 0. 29 |
| 69 | 002233 | 塔牌集团 | 1, 211, 538 | 11, 388, 457. 20 | 0. 28 |
| 70 | 600844 | 丹化科技 | 950, 337 | 11, 347, 023. 78 | 0. 28 |
| 71 | 002154 | 报喜鸟 | 954, 754 | 11, 304, 287. 36 | 0. 28 |
| 72 | 000488 | 晨鸣纸业 | 2, 412, 185 | 11, 289, 025. 80 | 0. 28 |
| 73 | 002140 | 东华科技 | 483, 172 | 11, 112, 956. 00 | 0. 28 |
| 74 | 600651 | 飞乐音响 | 1, 668, 056 | 11, 059, 211. 28 | 0. 27 |
| 75 | 600747 | 大连控股 | 2, 306, 147 | 11, 023, 382. 66 | 0. 27 |
| 76 | 600586 | 金晶科技 | 2, 311, 950 | 11, 004, 882. 00 | 0. 27 |
| 77 | 600499 | 科达机电 | 1, 198, 264 | 10, 976, 098. 24 | 0. 27 |
| 78 | 600787 | 中储股份 | 1, 365, 174 | 10, 975, 998. 96 | 0. 27 |
| 79 | 000926 | 福星股份 | 1, 543, 487 | 10, 927, 887. 96 | 0. 27 |
| 80 | 002041 | 登海种业 | 381, 362 | 10, 914, 580. 44 | 0. 27 |
| 81 | 600820 | 隧道股份 | 1, 384, 648 | 10, 897, 179. 76 | 0. 27 |
| 82 | 600059 | 古越龙山 | 1, 031, 712 | 10, 832, 976. 00 | 0. 27 |
| 83 | 600458 | 时代新材 | 980, 827 | 10, 808, 713. 54 | 0. 27 |
| 84 | 600858 | 银座股份 | 547, 765 | 10, 747, 149. 30 | 0. 27 |
| 85 | 600831 | 广电网络 | 1, 068, 224 | 10, 671, 557. 76 | 0. 26 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-----------|---------------|------|
| 86 | 600388 | 龙净环保 | 463,258 | 10,668,831.74 | 0.26 |
| 87 | 600702 | 沱牌舍得 | 639,510 | 10,635,051.30 | 0.26 |
| 88 | 000667 | 名流置业 | 4,852,700 | 10,578,886.00 | 0.26 |
| 89 | 600351 | 亚宝药业 | 1,714,303 | 10,474,391.33 | 0.26 |
| 90 | 000522 | 白云山 A | 859,779 | 10,454,912.64 | 0.26 |
| 91 | 600410 | 华胜天成 | 1,030,832 | 10,452,636.48 | 0.26 |
| 92 | 002161 | 远望谷 | 601,089 | 10,446,926.82 | 0.26 |
| 93 | 600783 | 鲁信创投 | 604,826 | 10,390,910.68 | 0.26 |
| 94 | 000598 | 兴蓉投资 | 1,249,700 | 10,335,019.00 | 0.26 |
| 95 | 000616 | 亿城股份 | 3,228,041 | 10,329,731.20 | 0.26 |
| 96 | 000571 | 新大洲 A | 1,993,572 | 10,286,831.52 | 0.26 |
| 97 | 600158 | 中体产业 | 1,828,148 | 10,237,628.80 | 0.25 |
| 98 | 000962 | 东方钽业 | 716,420 | 10,208,985.00 | 0.25 |
| 99 | 600851 | 海欣股份 | 1,599,458 | 10,188,547.46 | 0.25 |
| 100 | 600597 | 光明乳业 | 1,136,700 | 10,173,465.00 | 0.25 |
| 101 | 001696 | 宗申动力 | 1,659,280 | 10,088,422.40 | 0.25 |
| 102 | 000860 | 顺鑫农业 | 712,693 | 9,970,575.07 | 0.25 |
| 103 | 600409 | 三友化工 | 1,434,848 | 9,957,845.12 | 0.25 |
| 104 | 600439 | 瑞贝卡 | 1,490,370 | 9,910,960.50 | 0.25 |
| 105 | 600755 | 厦门国贸 | 2,523,101 | 9,865,324.91 | 0.24 |
| 106 | 000735 | 罗牛山 | 2,383,757 | 9,821,078.84 | 0.24 |
| 107 | 002097 | 山河智能 | 1,138,737 | 9,804,525.57 | 0.24 |
| 108 | 600704 | 物产中大 | 1,248,905 | 9,791,415.20 | 0.24 |
| 109 | 600426 | 华鲁恒升 | 1,291,442 | 9,750,387.10 | 0.24 |
| 110 | 600017 | 日照港 | 3,562,400 | 9,618,480.00 | 0.24 |
| 111 | 600478 | 科力远 | 596,857 | 9,609,397.70 | 0.24 |
| 112 | 600575 | 芜湖港 | 1,134,100 | 9,594,486.00 | 0.24 |
| 113 | 000726 | 鲁泰 A | 1,226,855 | 9,594,006.10 | 0.24 |
| 114 | 000683 | 远兴能源 | 1,663,658 | 9,566,033.50 | 0.24 |
| 115 | 600884 | 杉杉股份 | 778,986 | 9,565,948.08 | 0.24 |
| 116 | 600596 | 新安股份 | 1,471,600 | 9,565,400.00 | 0.24 |
| 117 | 000900 | 现代投资 | 756,800 | 9,520,544.00 | 0.24 |
| 118 | 600330 | 天通股份 | 1,275,861 | 9,517,923.06 | 0.24 |
| 119 | 600069 | 银鸽投资 | 1,564,777 | 9,482,548.62 | 0.24 |
| 120 | 600765 | 中航重机 | 1,056,174 | 9,452,757.30 | 0.23 |
| 121 | 600236 | 桂冠电力 | 2,470,608 | 9,363,604.32 | 0.23 |
| 122 | 600720 | 祁连山 | 1,028,973 | 9,353,364.57 | 0.23 |
| 123 | 600511 | 国药股份 | 778,086 | 9,329,251.14 | 0.23 |
| 124 | 600993 | 马应龙 | 538,848 | 9,316,681.92 | 0.23 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 125 | 000988 | 华工科技 | 724,070 | 9,311,540.20 | 0.23 |
| 126 | 600425 | 青松建化 | 777,882 | 9,217,901.70 | 0.23 |
| 127 | 000973 | 佛塑科技 | 1,327,210 | 9,184,293.20 | 0.23 |
| 128 | 600195 | 中牧股份 | 528,165 | 9,158,381.10 | 0.23 |
| 129 | 600251 | 冠农股份 | 490,323 | 9,154,330.41 | 0.23 |
| 130 | 002056 | 横店东磁 | 576,744 | 9,141,392.40 | 0.23 |
| 131 | 600467 | 好当家 | 989,204 | 9,140,244.96 | 0.23 |
| 132 | 600240 | 华业地产 | 1,222,851 | 9,122,468.46 | 0.23 |
| 133 | 000078 | 海王生物 | 1,413,767 | 9,104,659.48 | 0.23 |
| 134 | 000887 | 中鼎股份 | 806,824 | 9,100,974.72 | 0.23 |
| 135 | 600496 | 精工钢构 | 1,112,055 | 9,029,886.60 | 0.22 |
| 136 | 600872 | 中炬高新 | 2,157,603 | 8,997,204.51 | 0.22 |
| 137 | 000997 | 新大陆 | 829,214 | 8,972,095.48 | 0.22 |
| 138 | 600087 | 长航油运 | 4,596,400 | 8,962,980.00 | 0.22 |
| 139 | 000066 | 长城电脑 | 1,792,373 | 8,908,093.81 | 0.22 |
| 140 | 600033 | 福建高速 | 3,716,500 | 8,845,270.00 | 0.22 |
| 141 | 600064 | 南京高科 | 978,723 | 8,837,868.69 | 0.22 |
| 142 | 002078 | 太阳纸业 | 1,088,590 | 8,828,464.90 | 0.22 |
| 143 | 002277 | 友阿股份 | 567,495 | 8,796,172.50 | 0.22 |
| 144 | 600261 | 阳光照明 | 507,354 | 8,741,709.42 | 0.22 |
| 145 | 600611 | 大众交通 | 1,693,650 | 8,722,297.50 | 0.22 |
| 146 | 600723 | 首商股份 | 891,613 | 8,702,142.88 | 0.22 |
| 147 | 600835 | 上海机电 | 1,094,870 | 8,682,319.10 | 0.22 |
| 148 | 600326 | 西藏天路 | 1,037,463 | 8,621,317.53 | 0.21 |
| 149 | 600529 | 山东药玻 | 697,051 | 8,594,638.83 | 0.21 |
| 150 | 600685 | 广船国际 | 593,801 | 8,586,362.46 | 0.21 |
| 151 | 600815 | 厦工股份 | 1,055,850 | 8,573,502.00 | 0.21 |
| 152 | 600491 | 龙元建设 | 1,539,854 | 8,561,588.24 | 0.21 |
| 153 | 000717 | 韶钢松山 | 3,165,245 | 8,546,161.50 | 0.21 |
| 154 | 600289 | 亿阳信通 | 1,251,414 | 8,534,643.48 | 0.21 |
| 155 | 600654 | 飞乐股份 | 2,044,924 | 8,527,333.08 | 0.21 |
| 156 | 600963 | 岳阳林纸 | 1,818,991 | 8,512,877.88 | 0.21 |
| 157 | 000786 | 北新建材 | 778,915 | 8,505,751.80 | 0.21 |
| 158 | 000751 | 锌业股份 | 2,104,667 | 8,502,854.68 | 0.21 |
| 159 | 600067 | 冠城大通 | 1,394,389 | 8,491,829.01 | 0.21 |
| 160 | 002254 | 泰和新材 | 742,322 | 8,462,470.80 | 0.21 |
| 161 | 002311 | 海大集团 | 473,232 | 8,423,529.60 | 0.21 |
| 162 | 600628 | 新世界 | 1,152,226 | 8,411,249.80 | 0.21 |
| 163 | 000659 | 珠海中富 | 2,437,577 | 8,409,640.65 | 0.21 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 164 | 600754 | 锦江股份 | 484,495 | 8,386,608.45 | 0.21 |
| 165 | 000848 | 承德露露 | 593,107 | 8,380,601.91 | 0.21 |
| 166 | 000594 | 国恒铁路 | 4,045,776 | 8,374,756.32 | 0.21 |
| 167 | 000682 | 东方电子 | 2,649,227 | 8,371,557.32 | 0.21 |
| 168 | 002292 | 奥飞动漫 | 332,840 | 8,364,269.20 | 0.21 |
| 169 | 600509 | 天富热电 | 1,065,495 | 8,364,135.75 | 0.21 |
| 170 | 000627 | 天茂集团 | 2,932,853 | 8,358,631.05 | 0.21 |
| 171 | 000850 | 华茂股份 | 1,533,490 | 8,357,520.50 | 0.21 |
| 172 | 600525 | 长园集团 | 1,169,342 | 8,349,101.88 | 0.21 |
| 173 | 600991 | 广汽长丰 | 564,648 | 8,311,618.56 | 0.21 |
| 174 | 000510 | 金路集团 | 1,649,933 | 8,299,162.99 | 0.21 |
| 175 | 000897 | 津滨发展 | 3,504,160 | 8,269,817.60 | 0.21 |
| 176 | 600761 | 安徽合力 | 812,059 | 8,266,760.62 | 0.20 |
| 177 | 600021 | 上海电力 | 1,738,580 | 8,223,483.40 | 0.20 |
| 178 | 000601 | 韶能股份 | 2,506,795 | 8,197,219.65 | 0.20 |
| 179 | 600176 | 中国玻纤 | 630,293 | 8,181,203.14 | 0.20 |
| 180 | 002129 | 中环股份 | 784,663 | 8,160,495.20 | 0.20 |
| 181 | 000088 | 盐田港 | 1,618,541 | 8,141,261.23 | 0.20 |
| 182 | 600332 | 广州药业 | 619,029 | 8,134,041.06 | 0.20 |
| 183 | 600121 | 郑州煤电 | 777,542 | 8,109,763.06 | 0.20 |
| 184 | 000028 | 一致药业 | 379,073 | 8,093,208.55 | 0.20 |
| 185 | 600978 | 宜华木业 | 2,181,689 | 8,072,249.30 | 0.20 |
| 186 | 002011 | 盾安环境 | 907,834 | 8,070,644.26 | 0.20 |
| 187 | 600227 | 赤天化 | 2,059,255 | 8,031,094.50 | 0.20 |
| 188 | 600521 | 华海药业 | 729,390 | 8,023,290.00 | 0.20 |
| 189 | 600038 | 哈飞股份 | 456,813 | 7,957,682.46 | 0.20 |
| 190 | 600888 | 新疆众和 | 556,657 | 7,949,061.96 | 0.20 |
| 191 | 600416 | 湘电股份 | 1,153,608 | 7,936,823.04 | 0.20 |
| 192 | 600295 | 鄂尔多斯 | 664,680 | 7,869,811.20 | 0.20 |
| 193 | 600545 | 新疆城建 | 1,464,247 | 7,863,006.39 | 0.19 |
| 194 | 600308 | 华泰股份 | 2,213,611 | 7,858,319.05 | 0.19 |
| 195 | 600117 | 西宁特钢 | 1,204,535 | 7,841,522.85 | 0.19 |
| 196 | 002083 | 孚日股份 | 1,525,102 | 7,823,773.26 | 0.19 |
| 197 | 601002 | 晋亿实业 | 800,069 | 7,816,674.13 | 0.19 |
| 198 | 600780 | 通宝能源 | 1,242,045 | 7,800,042.60 | 0.19 |
| 199 | 600616 | 金枫酒业 | 831,676 | 7,792,804.12 | 0.19 |
| 200 | 002249 | 大洋电机 | 517,107 | 7,730,749.65 | 0.19 |
| 201 | 600122 | 宏图高科 | 1,840,810 | 7,694,585.80 | 0.19 |
| 202 | 600322 | 天房发展 | 2,395,751 | 7,690,360.71 | 0.19 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-----------|--------------|------|
| 203 | 000006 | 深振业 A | 1,875,000 | 7,687,500.00 | 0.19 |
| 204 | 600163 | 福建南纸 | 1,367,708 | 7,686,518.96 | 0.19 |
| 205 | 000987 | 广州友谊 | 486,129 | 7,671,115.62 | 0.19 |
| 206 | 600435 | 中兵光电 | 1,008,451 | 7,664,227.60 | 0.19 |
| 207 | 600449 | 宁夏建材 | 388,665 | 7,641,153.90 | 0.19 |
| 208 | 600387 | 海越股份 | 836,611 | 7,638,258.43 | 0.19 |
| 209 | 000525 | 红太阳 | 549,572 | 7,622,563.64 | 0.19 |
| 210 | 600408 | 安泰集团 | 1,908,788 | 7,616,064.12 | 0.19 |
| 211 | 600790 | 轻纺城 | 1,340,720 | 7,615,289.60 | 0.19 |
| 212 | 000089 | 深圳机场 | 1,831,194 | 7,599,455.10 | 0.19 |
| 213 | 600581 | 八一钢铁 | 1,037,907 | 7,587,100.17 | 0.19 |
| 214 | 600531 | 豫光金铅 | 479,831 | 7,552,539.94 | 0.19 |
| 215 | 600736 | 苏州高新 | 1,719,133 | 7,546,993.87 | 0.19 |
| 216 | 002431 | 棕榈园林 | 312,032 | 7,544,933.76 | 0.19 |
| 217 | 002237 | 恒邦股份 | 246,624 | 7,524,498.24 | 0.19 |
| 218 | 600078 | 澄星股份 | 1,076,129 | 7,457,573.97 | 0.18 |
| 219 | 600086 | 东方金钰 | 572,453 | 7,436,164.47 | 0.18 |
| 220 | 600662 | 强生控股 | 1,711,746 | 7,428,977.64 | 0.18 |
| 221 | 600337 | 美克股份 | 858,910 | 7,412,393.30 | 0.18 |
| 222 | 000159 | 国际实业 | 912,156 | 7,406,706.72 | 0.18 |
| 223 | 002475 | 立讯精密 | 211,820 | 7,392,518.00 | 0.18 |
| 224 | 000861 | 海印股份 | 533,187 | 7,373,976.21 | 0.18 |
| 225 | 600112 | 长征电气 | 689,544 | 7,364,329.92 | 0.18 |
| 226 | 002430 | 杭氧股份 | 325,792 | 7,300,998.72 | 0.18 |
| 227 | 002181 | 粤传媒 | 663,855 | 7,255,935.15 | 0.18 |
| 228 | 002410 | 广联达 | 219,365 | 7,245,625.95 | 0.18 |
| 229 | 600103 | 青山纸业 | 2,300,730 | 7,224,292.20 | 0.18 |
| 230 | 002308 | 威创股份 | 694,840 | 7,205,490.80 | 0.18 |
| 231 | 000554 | 泰山石油 | 1,041,785 | 7,177,898.65 | 0.18 |
| 232 | 002179 | 中航光电 | 435,112 | 7,135,836.80 | 0.18 |
| 233 | 600995 | 文山电力 | 1,036,794 | 7,091,670.96 | 0.18 |
| 234 | 600773 | 西藏城投 | 623,700 | 7,078,995.00 | 0.18 |
| 235 | 600339 | 天利高新 | 1,096,076 | 7,058,729.44 | 0.17 |
| 236 | 600127 | 金健米业 | 1,474,629 | 7,048,726.62 | 0.17 |
| 237 | 002281 | 光迅科技 | 216,629 | 7,005,781.86 | 0.17 |
| 238 | 600198 | 大唐电信 | 832,293 | 6,991,261.20 | 0.17 |
| 239 | 600824 | 益民集团 | 1,387,744 | 6,966,474.88 | 0.17 |
| 240 | 002223 | 鱼跃医疗 | 332,230 | 6,960,218.50 | 0.17 |
| 241 | 600468 | 百利电气 | 494,227 | 6,958,716.16 | 0.17 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 242 | 000698 | 沈阳化工 | 1,253,017 | 6,954,244.35 | 0.17 |
| 243 | 600482 | 风帆股份 | 874,020 | 6,930,978.60 | 0.17 |
| 244 | 600874 | 创业环保 | 1,177,889 | 6,925,987.32 | 0.17 |
| 245 | 600569 | 安阳钢铁 | 2,593,229 | 6,923,921.43 | 0.17 |
| 246 | 002408 | 齐翔腾达 | 379,593 | 6,919,980.39 | 0.17 |
| 247 | 600292 | 九龙电力 | 554,560 | 6,915,363.20 | 0.17 |
| 248 | 002025 | 航天电器 | 536,260 | 6,907,028.80 | 0.17 |
| 249 | 600056 | 中国医药 | 339,074 | 6,862,857.76 | 0.17 |
| 250 | 600106 | 重庆路桥 | 983,440 | 6,844,742.40 | 0.17 |
| 251 | 600589 | 广东榕泰 | 1,140,829 | 6,833,565.71 | 0.17 |
| 252 | 600006 | 东风汽车 | 2,166,700 | 6,803,438.00 | 0.17 |
| 253 | 600284 | 浦东建设 | 899,654 | 6,801,384.24 | 0.17 |
| 254 | 000407 | 胜利股份 | 1,758,395 | 6,717,068.90 | 0.17 |
| 255 | 000886 | 海南高速 | 2,142,514 | 6,663,218.54 | 0.17 |
| 256 | 600866 | 星湖科技 | 1,192,519 | 6,654,256.02 | 0.16 |
| 257 | 600759 | 正和股份 | 991,350 | 6,632,131.50 | 0.16 |
| 258 | 000823 | 超声电子 | 835,054 | 6,630,328.76 | 0.16 |
| 259 | 600171 | 上海贝岭 | 1,459,924 | 6,628,054.96 | 0.16 |
| 260 | 600263 | 路桥建设 | 442,185 | 6,623,931.30 | 0.16 |
| 261 | 000713 | 丰乐种业 | 485,661 | 6,609,846.21 | 0.16 |
| 262 | 002191 | 劲嘉股份 | 695,570 | 6,594,003.60 | 0.16 |
| 263 | 600673 | 东阳光铝 | 896,426 | 6,588,731.10 | 0.16 |
| 264 | 600580 | 卧龙电气 | 1,303,863 | 6,584,508.15 | 0.16 |
| 265 | 000301 | 东方市场 | 2,309,646 | 6,582,491.10 | 0.16 |
| 266 | 600961 | 株冶集团 | 714,291 | 6,578,620.11 | 0.16 |
| 267 | 002332 | 仙琚制药 | 554,767 | 6,535,155.26 | 0.16 |
| 268 | 600825 | 新华传媒 | 1,132,007 | 6,497,720.18 | 0.16 |
| 269 | 000996 | 中国中期 | 498,306 | 6,487,944.12 | 0.16 |
| 270 | 002048 | 宁波华翔 | 898,939 | 6,472,360.80 | 0.16 |
| 271 | 000777 | 中核科技 | 346,126 | 6,462,172.42 | 0.16 |
| 272 | 600622 | 嘉宝集团 | 1,114,354 | 6,452,109.66 | 0.16 |
| 273 | 600693 | 东百集团 | 929,567 | 6,414,012.30 | 0.16 |
| 274 | 600602 | 广电电子 | 1,429,392 | 6,375,088.32 | 0.16 |
| 275 | 000931 | 中关村 | 1,279,405 | 6,320,260.70 | 0.16 |
| 276 | 002309 | 中利科技 | 325,424 | 6,287,191.68 | 0.16 |
| 277 | 600088 | 中视传媒 | 448,809 | 6,283,326.00 | 0.16 |
| 278 | 600801 | 华新水泥 | 493,458 | 6,281,720.34 | 0.16 |
| 279 | 600543 | 莫高股份 | 695,766 | 6,268,851.66 | 0.16 |
| 280 | 002465 | 海格通信 | 270,218 | 6,258,248.88 | 0.16 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-----------|--------------|------|
| 281 | 600877 | 中国嘉陵 | 1,489,202 | 6,254,648.40 | 0.16 |
| 282 | 000755 | 山西三维 | 889,721 | 6,236,944.21 | 0.15 |
| 283 | 600075 | 新疆天业 | 712,734 | 6,222,167.82 | 0.15 |
| 284 | 000511 | 银基发展 | 2,502,186 | 6,205,421.28 | 0.15 |
| 285 | 002091 | 江苏国泰 | 487,508 | 6,181,601.44 | 0.15 |
| 286 | 002482 | 广田股份 | 260,000 | 6,128,200.00 | 0.15 |
| 287 | 600327 | 大东方 | 847,763 | 6,120,848.86 | 0.15 |
| 288 | 000513 | 丽珠集团 | 298,617 | 6,109,703.82 | 0.15 |
| 289 | 000410 | 沈阳机床 | 886,393 | 6,098,383.84 | 0.15 |
| 290 | 600479 | 千金药业 | 577,950 | 6,097,372.50 | 0.15 |
| 291 | 000099 | 中信海直 | 834,628 | 6,051,053.00 | 0.15 |
| 292 | 601678 | 滨化股份 | 536,308 | 6,033,465.00 | 0.15 |
| 293 | 600361 | 华联综超 | 1,084,717 | 6,031,026.52 | 0.15 |
| 294 | 600748 | 上实发展 | 1,173,700 | 6,009,344.00 | 0.15 |
| 295 | 600231 | 凌钢股份 | 1,088,831 | 5,977,682.19 | 0.15 |
| 296 | 000426 | 兴业矿业 | 618,645 | 5,963,737.80 | 0.15 |
| 297 | 600555 | 九龙山 | 1,585,954 | 5,947,327.50 | 0.15 |
| 298 | 000537 | 广宇发展 | 1,110,952 | 5,943,593.20 | 0.15 |
| 299 | 600360 | 华微电子 | 1,469,267 | 5,935,838.68 | 0.15 |
| 300 | 600323 | 南海发展 | 704,833 | 5,934,693.86 | 0.15 |
| 301 | 000936 | 华西村 | 1,215,596 | 5,932,108.48 | 0.15 |
| 302 | 000090 | 深天健 | 865,718 | 5,930,168.30 | 0.15 |
| 303 | 000708 | 大冶特钢 | 608,637 | 5,915,951.64 | 0.15 |
| 304 | 600846 | 同济科技 | 1,353,719 | 5,915,752.03 | 0.15 |
| 305 | 000563 | 陕国投 A | 582,391 | 5,911,268.65 | 0.15 |
| 306 | 600686 | 金龙汽车 | 839,088 | 5,865,225.12 | 0.15 |
| 307 | 600120 | 浙江东方 | 821,428 | 5,856,781.64 | 0.15 |
| 308 | 000712 | 锦龙股份 | 577,574 | 5,845,048.88 | 0.14 |
| 309 | 600282 | 南钢股份 | 2,099,411 | 5,836,362.58 | 0.14 |
| 310 | 000975 | 科学城 | 1,181,016 | 5,834,219.04 | 0.14 |
| 311 | 600590 | 泰豪科技 | 863,291 | 5,801,315.52 | 0.14 |
| 312 | 600270 | 外运发展 | 980,970 | 5,777,913.30 | 0.14 |
| 313 | 600226 | 升华拜克 | 768,918 | 5,774,574.18 | 0.14 |
| 314 | 002506 | 超日太阳 | 428,400 | 5,749,128.00 | 0.14 |
| 315 | 600838 | 上海九百 | 1,085,794 | 5,743,850.26 | 0.14 |
| 316 | 000677 | ST 海龙 | 1,185,013 | 5,711,762.66 | 0.14 |
| 317 | 002064 | 华峰氨纶 | 1,199,912 | 5,699,582.00 | 0.14 |
| 318 | 600317 | 营口港 | 1,486,311 | 5,677,708.02 | 0.14 |
| 319 | 000837 | 秦川发展 | 755,606 | 5,614,152.58 | 0.14 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-----------|--------------|------|
| 320 | 600533 | 栖霞建设 | 1,706,350 | 5,596,828.00 | 0.14 |
| 321 | 002479 | 富春环保 | 347,800 | 5,554,366.00 | 0.14 |
| 322 | 600830 | 香溢融通 | 861,309 | 5,546,829.96 | 0.14 |
| 323 | 600776 | 东方通信 | 1,035,655 | 5,499,328.05 | 0.14 |
| 324 | 000016 | 深康佳 A | 1,734,069 | 5,479,658.04 | 0.14 |
| 325 | 600329 | 中新药业 | 584,227 | 5,462,522.45 | 0.14 |
| 326 | 000919 | 金陵药业 | 682,546 | 5,453,542.54 | 0.14 |
| 327 | 600507 | 方大特钢 | 1,408,909 | 5,452,477.83 | 0.14 |
| 328 | 600487 | 亨通光电 | 336,569 | 5,452,417.80 | 0.14 |
| 329 | 600197 | 伊力特 | 597,182 | 5,446,299.84 | 0.14 |
| 330 | 600139 | 西部资源 | 398,356 | 5,429,592.28 | 0.13 |
| 331 | 600710 | 常林股份 | 867,105 | 5,428,077.30 | 0.13 |
| 332 | 600789 | 鲁抗医药 | 1,102,641 | 5,413,967.31 | 0.13 |
| 333 | 600826 | 兰生股份 | 569,628 | 5,411,466.00 | 0.13 |
| 334 | 000911 | 南宁糖业 | 465,772 | 5,407,612.92 | 0.13 |
| 335 | 600475 | 华光股份 | 415,966 | 5,403,398.34 | 0.13 |
| 336 | 600782 | 新钢股份 | 1,132,182 | 5,389,186.32 | 0.13 |
| 337 | 000875 | 吉电股份 | 1,818,128 | 5,381,658.88 | 0.13 |
| 338 | 600102 | 莱钢股份 | 749,400 | 5,373,198.00 | 0.13 |
| 339 | 601801 | 皖新传媒 | 492,900 | 5,372,610.00 | 0.13 |
| 340 | 000738 | 中航动控 | 510,700 | 5,367,457.00 | 0.13 |
| 341 | 600864 | 哈投股份 | 887,885 | 5,362,825.40 | 0.13 |
| 342 | 000533 | 万家乐 | 1,122,630 | 5,332,492.50 | 0.13 |
| 343 | 002252 | 上海莱士 | 220,979 | 5,290,237.26 | 0.13 |
| 344 | 601126 | 四方股份 | 330,400 | 5,279,792.00 | 0.13 |
| 345 | 600246 | 万通地产 | 1,647,775 | 5,272,880.00 | 0.13 |
| 346 | 600162 | 香江控股 | 1,039,756 | 5,240,370.24 | 0.13 |
| 347 | 600107 | 美尔雅 | 780,036 | 5,234,041.56 | 0.13 |
| 348 | 000767 | 漳泽电力 | 1,437,640 | 5,233,009.60 | 0.13 |
| 349 | 600290 | 华仪电气 | 713,478 | 5,215,524.18 | 0.13 |
| 350 | 000903 | 云内动力 | 1,290,615 | 5,214,084.60 | 0.13 |
| 351 | 000005 | 世纪星源 | 1,350,681 | 5,213,628.66 | 0.13 |
| 352 | 601777 | 力帆股份 | 773,100 | 5,210,694.00 | 0.13 |
| 353 | 600398 | 凯诺科技 | 1,400,997 | 5,197,698.87 | 0.13 |
| 354 | 600618 | 氯碱化工 | 609,214 | 5,196,595.42 | 0.13 |
| 355 | 600644 | 乐山电力 | 619,003 | 5,143,914.93 | 0.13 |
| 356 | 600676 | 交运股份 | 1,188,542 | 5,134,501.44 | 0.13 |
| 357 | 600063 | 皖维高新 | 1,267,732 | 5,121,637.28 | 0.13 |
| 358 | 600707 | 彩虹股份 | 798,190 | 5,116,397.90 | 0.13 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-----------|--------------|------|
| 359 | 600268 | 国电南自 | 688,212 | 5,085,886.68 | 0.13 |
| 360 | 600054 | 黄山旅游 | 341,679 | 5,073,933.15 | 0.13 |
| 361 | 600223 | 鲁商置业 | 1,084,400 | 5,064,148.00 | 0.13 |
| 362 | 002345 | 潮宏基 | 194,962 | 5,049,515.80 | 0.13 |
| 363 | 002440 | 闰土股份 | 311,651 | 5,045,629.69 | 0.13 |
| 364 | 600966 | 博汇纸业 | 956,671 | 5,041,656.17 | 0.12 |
| 365 | 600429 | 三元股份 | 958,729 | 5,023,739.96 | 0.12 |
| 366 | 002052 | 同洲电子 | 647,380 | 5,023,668.80 | 0.12 |
| 367 | 600896 | 中海海盛 | 1,259,550 | 5,013,009.00 | 0.12 |
| 368 | 600501 | 航天晨光 | 632,654 | 5,010,619.68 | 0.12 |
| 369 | 002414 | 高德红外 | 243,775 | 4,970,572.25 | 0.12 |
| 370 | 600641 | 万业企业 | 1,091,745 | 4,956,522.30 | 0.12 |
| 371 | 002168 | 深圳惠程 | 512,625 | 4,951,957.50 | 0.12 |
| 372 | 002336 | 人人乐 | 325,050 | 4,934,259.00 | 0.12 |
| 373 | 600363 | 联创光电 | 805,436 | 4,888,996.52 | 0.12 |
| 374 | 600288 | 大恒科技 | 828,139 | 4,886,020.10 | 0.12 |
| 375 | 600667 | 太极实业 | 888,876 | 4,879,929.24 | 0.12 |
| 376 | 600563 | 法拉电子 | 304,715 | 4,878,487.15 | 0.12 |
| 377 | 000989 | 九芝堂 | 483,660 | 4,875,292.80 | 0.12 |
| 378 | 600052 | 浙江广厦 | 1,420,293 | 4,857,402.06 | 0.12 |
| 379 | 000050 | 深天马 A | 777,600 | 4,836,672.00 | 0.12 |
| 380 | 600810 | 神马股份 | 598,965 | 4,827,657.90 | 0.12 |
| 381 | 000428 | 华天酒店 | 1,168,256 | 4,824,897.28 | 0.12 |
| 382 | 002242 | 九阳股份 | 618,300 | 4,816,557.00 | 0.12 |
| 383 | 600639 | 浦东金桥 | 711,399 | 4,816,171.23 | 0.12 |
| 384 | 600423 | 柳化股份 | 757,152 | 4,815,486.72 | 0.12 |
| 385 | 600829 | 三精制药 | 471,211 | 4,811,064.31 | 0.12 |
| 386 | 600488 | 天药股份 | 882,237 | 4,808,191.65 | 0.12 |
| 387 | 600894 | 广钢股份 | 825,998 | 4,807,308.36 | 0.12 |
| 388 | 600480 | 凌云股份 | 587,779 | 4,796,276.64 | 0.12 |
| 389 | 002121 | 科陆电子 | 537,230 | 4,792,091.60 | 0.12 |
| 390 | 600328 | 兰太实业 | 583,607 | 4,727,216.70 | 0.12 |
| 391 | 600082 | 海泰发展 | 1,399,930 | 4,717,764.10 | 0.12 |
| 392 | 600291 | 西水股份 | 728,067 | 4,710,593.49 | 0.12 |
| 393 | 600683 | 京投银泰 | 1,003,194 | 4,704,979.86 | 0.12 |
| 394 | 000912 | 泸天化 | 792,197 | 4,697,728.21 | 0.12 |
| 395 | 600293 | 三峡新材 | 653,099 | 4,682,719.83 | 0.12 |
| 396 | 000608 | 阳光股份 | 1,218,650 | 4,667,429.50 | 0.12 |
| 397 | 000158 | 常山股份 | 1,168,196 | 4,661,102.04 | 0.12 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 398 | 600438 | 通威股份 | 931,054 | 4,645,959.46 | 0.12 |
| 399 | 600469 | 风神股份 | 609,301 | 4,636,780.61 | 0.11 |
| 400 | 600657 | 信达地产 | 1,238,500 | 4,619,605.00 | 0.11 |
| 401 | 002393 | 力生制药 | 148,280 | 4,608,542.40 | 0.11 |
| 402 | 600420 | 现代制药 | 467,557 | 4,596,085.31 | 0.11 |
| 403 | 002340 | 格林美 | 235,512 | 4,592,484.00 | 0.11 |
| 404 | 600073 | 上海梅林 | 540,175 | 4,569,880.50 | 0.11 |
| 405 | 002109 | 兴化股份 | 582,411 | 4,566,102.24 | 0.11 |
| 406 | 000687 | 保定天鹅 | 1,042,605 | 4,556,183.85 | 0.11 |
| 407 | 600836 | 界龙实业 | 679,404 | 4,538,418.72 | 0.11 |
| 408 | 600510 | 黑牡丹 | 861,866 | 4,507,559.18 | 0.11 |
| 409 | 000520 | 长航凤凰 | 1,372,601 | 4,488,405.27 | 0.11 |
| 410 | 002238 | 天威视讯 | 260,335 | 4,485,572.05 | 0.11 |
| 411 | 600202 | 哈空调 | 726,817 | 4,477,192.72 | 0.11 |
| 412 | 600650 | 锦江投资 | 528,895 | 4,453,295.90 | 0.11 |
| 413 | 002232 | 启明信息 | 553,270 | 4,448,290.80 | 0.11 |
| 414 | 002267 | 陕天然气 | 275,438 | 4,373,955.44 | 0.11 |
| 415 | 600565 | 迪马股份 | 1,365,063 | 4,354,550.97 | 0.11 |
| 416 | 002342 | 巨力索具 | 780,000 | 4,352,400.00 | 0.11 |
| 417 | 000949 | 新乡化纤 | 1,347,530 | 4,339,046.60 | 0.11 |
| 418 | 000572 | 海马汽车 | 1,336,353 | 4,289,693.13 | 0.11 |
| 419 | 600129 | 太极集团 | 693,675 | 4,286,911.50 | 0.11 |
| 420 | 002088 | 鲁阳股份 | 443,566 | 4,280,411.90 | 0.11 |
| 421 | 000733 | 振华科技 | 679,002 | 4,264,132.56 | 0.11 |
| 422 | 600333 | 长春燃气 | 625,020 | 4,250,136.00 | 0.11 |
| 423 | 600725 | 云维股份 | 834,540 | 4,239,463.20 | 0.11 |
| 424 | 000910 | 大亚科技 | 857,178 | 4,234,459.32 | 0.10 |
| 425 | 000543 | 皖能电力 | 837,458 | 4,229,162.90 | 0.10 |
| 426 | 000972 | 新中基 | 913,879 | 4,185,565.82 | 0.10 |
| 427 | 002218 | 拓日新能 | 397,889 | 4,181,813.39 | 0.10 |
| 428 | 600277 | 亿利能源 | 488,545 | 4,177,059.75 | 0.10 |
| 429 | 002183 | 怡亚通 | 903,645 | 4,174,839.90 | 0.10 |
| 430 | 600460 | 士兰微 | 470,248 | 4,166,397.28 | 0.10 |
| 431 | 600708 | 海博股份 | 967,633 | 4,160,821.90 | 0.10 |
| 432 | 000852 | 江钻股份 | 433,801 | 4,142,799.55 | 0.10 |
| 433 | 600168 | 武汉控股 | 598,957 | 4,108,845.02 | 0.10 |
| 434 | 002306 | 湘鄂情 | 270,890 | 4,063,350.00 | 0.10 |
| 435 | 002315 | 焦点科技 | 95,512 | 4,049,708.80 | 0.10 |
| 436 | 002320 | 海峡股份 | 266,225 | 4,038,633.25 | 0.10 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 437 | 002428 | 云南锆业 | 132,718 | 4,033,300.02 | 0.10 |
| 438 | 600983 | 合肥三洋 | 577,220 | 4,023,223.40 | 0.10 |
| 439 | 600386 | 北巴传媒 | 545,997 | 4,007,617.98 | 0.10 |
| 440 | 000584 | 友利控股 | 775,162 | 4,007,587.54 | 0.10 |
| 441 | 002285 | 世联地产 | 353,627 | 4,003,057.64 | 0.10 |
| 442 | 002276 | 万马电缆 | 467,535 | 3,997,424.25 | 0.10 |
| 443 | 600897 | 厦门空港 | 322,609 | 3,993,899.42 | 0.10 |
| 444 | 600012 | 皖通高速 | 947,050 | 3,968,139.50 | 0.10 |
| 445 | 600061 | 中纺投资 | 697,289 | 3,960,601.52 | 0.10 |
| 446 | 600640 | 中卫国脉 | 543,501 | 3,913,207.20 | 0.10 |
| 447 | 600178 | 东安动力 | 625,799 | 3,848,663.85 | 0.10 |
| 448 | 002437 | 誉衡药业 | 227,492 | 3,844,614.80 | 0.10 |
| 449 | 002444 | 巨星科技 | 411,930 | 3,830,949.00 | 0.09 |
| 450 | 600523 | 贵航股份 | 391,064 | 3,820,695.28 | 0.09 |
| 451 | 600191 | 华资实业 | 656,747 | 3,809,132.60 | 0.09 |
| 452 | 601000 | 唐山港 | 611,000 | 3,775,980.00 | 0.09 |
| 453 | 000905 | 厦门港务 | 719,107 | 3,775,311.75 | 0.09 |
| 454 | 002326 | 永太科技 | 260,371 | 3,772,775.79 | 0.09 |
| 455 | 600806 | 昆明机床 | 634,070 | 3,766,375.80 | 0.09 |
| 456 | 002225 | 濮耐股份 | 395,666 | 3,703,433.76 | 0.09 |
| 457 | 002489 | 浙江永强 | 195,000 | 3,658,200.00 | 0.09 |
| 458 | 600126 | 杭钢股份 | 908,914 | 3,617,477.72 | 0.09 |
| 459 | 002287 | 奇正藏药 | 219,941 | 3,607,032.40 | 0.09 |
| 460 | 600287 | 江苏舜天 | 591,503 | 3,602,253.27 | 0.09 |
| 461 | 002194 | 武汉凡谷 | 451,658 | 3,599,714.26 | 0.09 |
| 462 | 000899 | 赣能股份 | 875,731 | 3,572,982.48 | 0.09 |
| 463 | 000042 | 深长城 | 259,426 | 3,567,107.50 | 0.09 |
| 464 | 000990 | 诚志股份 | 482,647 | 3,552,281.92 | 0.09 |
| 465 | 000514 | 渝开发 | 755,510 | 3,498,011.30 | 0.09 |
| 466 | 601999 | 出版传媒 | 447,635 | 3,487,076.65 | 0.09 |
| 467 | 002386 | 天原集团 | 389,840 | 3,465,677.60 | 0.09 |
| 468 | 600743 | 华远地产 | 1,027,421 | 3,462,408.77 | 0.09 |
| 469 | 600035 | 楚天高速 | 1,009,322 | 3,381,228.70 | 0.08 |
| 470 | 002328 | 新朋股份 | 325,047 | 3,318,729.87 | 0.08 |
| 471 | 000597 | 东北制药 | 452,001 | 3,313,167.33 | 0.08 |
| 472 | 000925 | 众合机电 | 326,451 | 3,290,626.08 | 0.08 |
| 473 | 000631 | 顺发恒业 | 849,458 | 3,244,929.56 | 0.08 |
| 474 | 000619 | 海螺型材 | 585,014 | 3,240,977.56 | 0.08 |
| 475 | 600258 | 首旅股份 | 250,657 | 3,148,251.92 | 0.08 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 476 | 002383 | 合众思壮 | 116,957 | 3,146,143.30 | 0.08 |
| 477 | 600359 | 新农开发 | 434,707 | 3,142,931.61 | 0.08 |
| 478 | 600834 | 申通地铁 | 517,139 | 3,139,033.73 | 0.08 |
| 479 | 002314 | 雅致股份 | 314,172 | 3,135,436.56 | 0.08 |
| 480 | 000893 | 东凌粮油 | 240,530 | 3,110,052.90 | 0.08 |
| 481 | 002110 | 三钢闽光 | 434,444 | 3,088,896.84 | 0.08 |
| 482 | 002062 | 宏润建设 | 487,487 | 3,012,669.66 | 0.07 |
| 483 | 002384 | 东山精密 | 156,015 | 2,992,367.70 | 0.07 |
| 484 | 000979 | 中弘股份 | 548,200 | 2,987,690.00 | 0.07 |
| 485 | 002463 | 沪电股份 | 449,800 | 2,968,680.00 | 0.07 |
| 486 | 000517 | 荣安地产 | 574,891 | 2,937,693.01 | 0.07 |
| 487 | 002429 | 兆驰股份 | 383,971 | 2,937,378.15 | 0.07 |
| 488 | 000617 | 石油济柴 | 311,544 | 2,909,820.96 | 0.07 |
| 489 | 002480 | 新筑股份 | 227,500 | 2,821,000.00 | 0.07 |
| 490 | 002449 | 国星光电 | 175,093 | 2,810,242.65 | 0.07 |
| 491 | 000950 | 建峰化工 | 648,684 | 2,750,420.16 | 0.07 |
| 492 | 002362 | 汉王科技 | 232,000 | 2,691,200.00 | 0.07 |
| 493 | 002172 | 澳洋科技 | 753,266 | 2,659,028.98 | 0.07 |
| 494 | 600230 | 沧州大化 | 351,191 | 2,612,861.04 | 0.06 |
| 495 | 000883 | 湖北能源 | 520,200 | 2,496,960.00 | 0.06 |
| 496 | 000029 | 深深房 A | 724,519 | 2,361,931.94 | 0.06 |
| 497 | 600278 | 东方创业 | 326,382 | 2,317,312.20 | 0.06 |
| 498 | 600648 | 外高桥 | 205,400 | 1,912,274.00 | 0.05 |
| 499 | 600623 | 双钱股份 | 168,862 | 1,673,422.42 | 0.04 |
| 500 | 002534 | 杭锅股份 | 89,400 | 1,621,716.00 | 0.04 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 600311 | 荣华实业 | 36,670,818.12 | 1.00 |
| 2 | 600259 | 广晟有色 | 25,663,608.41 | 0.70 |
| 3 | 600643 | 爱建股份 | 25,346,030.57 | 0.69 |
| 4 | 600601 | 方正科技 | 23,025,229.63 | 0.63 |
| 5 | 000751 | 锌业股份 | 21,558,109.49 | 0.59 |
| 6 | 000581 | 威孚高科 | 21,444,973.48 | 0.59 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 7 | 000655 | 金岭矿业 | 21,034,592.17 | 0.57 |
| 8 | 600060 | 海信电器 | 20,984,207.78 | 0.57 |
| 9 | 600079 | 人福医药 | 20,917,589.66 | 0.57 |
| 10 | 000897 | 津滨发展 | 20,644,351.79 | 0.56 |
| 11 | 002081 | 金螳螂 | 20,621,749.38 | 0.56 |
| 12 | 000488 | 晨鸣纸业 | 20,573,851.00 | 0.56 |
| 13 | 600325 | 华发股份 | 20,572,063.00 | 0.56 |
| 14 | 600199 | 金种子酒 | 20,381,595.92 | 0.56 |
| 15 | 002353 | 杰瑞股份 | 20,348,906.31 | 0.56 |
| 16 | 600816 | 安信信托 | 20,149,774.75 | 0.55 |
| 17 | 600210 | 紫江企业 | 20,119,932.86 | 0.55 |
| 18 | 002123 | 荣信股份 | 19,643,719.41 | 0.54 |
| 19 | 600176 | 中国玻纤 | 19,528,534.76 | 0.53 |
| 20 | 000970 | 中科三环 | 18,992,424.81 | 0.52 |

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 600252 | 中恒集团 | 38,156,218.18 | 1.04 |
| 2 | 002073 | 软控股份 | 37,126,150.13 | 1.01 |
| 3 | 002106 | 莱宝高科 | 25,889,102.35 | 0.71 |
| 4 | 002081 | 金螳螂 | 17,536,976.27 | 0.48 |
| 5 | 600971 | 恒源煤电 | 16,975,634.23 | 0.46 |
| 6 | 002152 | 广电运通 | 16,665,962.79 | 0.46 |
| 7 | 600267 | 海正药业 | 16,263,019.59 | 0.44 |
| 8 | 000559 | 万向钱潮 | 15,040,197.02 | 0.41 |
| 9 | 002092 | 中泰化学 | 15,030,298.78 | 0.41 |
| 10 | 600315 | 上海家化 | 14,296,173.83 | 0.39 |
| 11 | 002241 | 歌尔声学 | 13,208,314.87 | 0.36 |
| 12 | 600498 | 烽火通信 | 12,564,940.52 | 0.34 |
| 13 | 000829 | 天音控股 | 11,832,963.04 | 0.32 |
| 14 | 600060 | 海信电器 | 10,879,640.75 | 0.30 |
| 15 | 002069 | 獐子岛 | 10,384,176.89 | 0.28 |
| 16 | 002310 | 东方园林 | 10,044,571.91 | 0.27 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 17 | 000550 | 江铃汽车 | 10,018,138.48 | 0.27 |
| 18 | 000581 | 威孚高科 | 9,532,697.61 | 0.26 |
| 19 | 600963 | 岳阳林纸 | 9,389,974.36 | 0.26 |
| 20 | 000707 | 双环科技 | 9,305,669.47 | 0.25 |

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 4,031,596,900.93 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,961,784,942.86 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,072,000.86 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 45,626.84 |

| | | |
|---|-------|---------------|
| 5 | 应收申购款 | 25,432,664.28 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 26,550,291.98 |

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：期末前十名股票中不存在流通受限情况

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|-----------|----------------|--------|------------------|--------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 411,583 | 12,041.41 | 784,440,498.77 | 15.83% | 4,171,599,178.61 | 84.17% |

9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额(份) | 占上市总份额比例 |
|----|---------------------|---------------|----------|
| 1 | 姜山 | 10,131,043.00 | 6.69% |
| 2 | 朝恒房地产(深圳)有限公司 | 8,000,000.00 | 5.28% |
| 3 | 项志英 | 1,500,000.00 | 0.99% |
| 4 | 吴彤 | 1,107,200.00 | 0.73% |
| 5 | 高琪 | 1,000,000.00 | 0.66% |
| 6 | 林家福 | 963,000.00 | 0.64% |
| 7 | 吕大贤 | 872,556.00 | 0.58% |
| 8 | 平安信托有限责任公司 一中惠万全 | 755,393.00 | 0.50% |
| 9 | 叶有容 | 750,000.00 | 0.50% |
| 10 | 彭冬梅 | 700,000.00 | 0.46% |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

| 项目 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 |
|----------------------|--------------|----------|
| 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | 2,736,812.41 | 0.0600% |

§ 10 开放式基金份额变动

单位: 份

| | |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日 (2009 年 9 月 25 日) 基金份额总额 | 3,223,217,818.45 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,972,289,432.83 |
| 本报告期基金总申购份额 | 4,172,769,994.16 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 2,189,019,749.61 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 4,956,039,677.38 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2011 年 8 月 16 日,基金管理人发布公告,聘任朱运东为公司副总经理。2011 年 1 月 21 日,中国证监会核准中国农业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格(证监许可[2011]116 号),张健任中国农业银行股份有限公司托管业务部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期未变更会计师事务所。本年度支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费用 102,000 元, 该审计机构已提供审计服务的连续年限为 3 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 英大证券 | 2 | 1,188,420,768.88 | 19.89% | 1,010,168.89 | 20.31% | - |
| 招商证券 | 1 | 875,991,202.63 | 14.66% | 711,753.25 | 14.31% | - |
| 华泰证券 | 1 | 853,280,794.60 | 14.28% | 693,302.28 | 13.94% | - |
| 江海证券 | 1 | 820,682,183.50 | 13.74% | 666,812.11 | 13.40% | - |
| 国泰君安 | 1 | 802,008,147.68 | 13.43% | 681,708.25 | 13.70% | - |
| 东方证券 | 1 | 780,513,268.60 | 13.07% | 663,440.28 | 13.34% | - |
| 东兴证券 | 1 | 360,613,738.41 | 6.04% | 306,523.74 | 6.16% | - |
| 日信证券 | 1 | 188,431,912.31 | 3.15% | 153,103.93 | 3.08% | - |
| 高华证券 | 1 | 103,706,498.88 | 1.74% | 88,150.99 | 1.77% | - |
| 中天证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注: 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定, 我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序:

A: 选择标准

- a、公司经营行为规范, 财务状况和经营状况良好;
- b、公司具有较强的研究能力, 能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行

业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；

c、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；

d、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B: 选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择交易单元：

a、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；

b、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；

c、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|--------------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 英大证券 | 690,615.70 | 26.72% | - | - | - | - |
| 招商证券 | 169,856.00 | 6.57% | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1,724,154.96 | 66.71% | - | - | - | - |
| 江海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 日信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中天证券 | - | - | - | - | - | - |

11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|------|--------|--------|
|----|------|--------|--------|

| | | | |
|----|---|--------------------------|------------------------|
| 1 | • 南方基金关于旗下部分基金参加中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 12 月 31 日 |
| 2 | • 南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行“2012 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 12 月 31 日 |
| 3 | • 南方基金关于旗下基金 2011 年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 12 月 31 日 |
| 4 | • 南方基金关于旗下部分基金参加东莞银行网上银行与定投申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 12 月 29 日 |
| 5 | • 南方基金关于旗下部分基金参加平安银行电子渠道与定投申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 12 月 29 日 |
| 6 | • 南方基金关于旗下部分基金参加深圳发展银行网上银行与定投申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 12 月 29 日 |
| 7 | • 南方基金关于旗下部分基金参加邮储银行网上银行申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 12 月 29 日 |
| 8 | • 南方基金关于旗下部分基金参加浙商银行网上银行与定投申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 12 月 29 日 |
| 9 | • 南方基金关于旗下部分基金增加中信万通证券为代销机构并开通定投及转换业务的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 12 月 22 日 |
| 10 | • 南方基金关于旗下部分基金参加江苏银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 | 2011 年 12 月 1 |

| | | | |
|----|---|--------------------------|------------------------|
| | | 证券时报 | 日 |
| 11 | • 南方基金关于旗下部分基金参加中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 12 月 1 日 |
| 12 | • 南方基金关于旗下部分基金参加华安证券网上申购费率及定投申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 11 月 7 日 |
| 13 | • 南方基金关于旗下南方积配等 6 只开放式证券投资基金增加广州银行为代销机构的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 10 月 27 日 |
| 14 | • 南方基金关于旗下南方积配等 6 只基金参加广州银行网上银行申购及定投申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 10 月 27 日 |
| 15 | • 南方基金关于旗下部分基金参加浙商证券电子渠道申购及定投申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 9 月 23 日 |
| 16 | • 南方基金关于旗下部分基金参加华宝证券网上交易系统网上委托申购及定投费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 9 月 7 日 |
| 17 | • 南方基金关于开展工行卡网上直销费率优惠的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 9 月 2 日 |
| 18 | • 南方基金关于开展农行卡网上直销费率优惠的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 9 月 2 日 |
| 19 | • 南方基金关于南方 500 基金增加上海银行为代销机构的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 8 月 25 日 |
| 20 | • 南方基金关于旗下基金在国都证券推出 | 中国证券报、 | 2011 年 |

| | | | |
|----|---|--------------------------|-----------------------|
| | 基金定期定额投资业务的公告 | 上海证券报、 证券时报 | 8 月 19 日 |
| 21 | • 南方基金关于旗下部分基金在长江证券推出基金定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 8 月 6 日 |
| 22 | • 南方基金关于旗下部分基金参加长江证券网上交易及手机证券交易申购 (含定投) 费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 8 月 6 日 |
| 23 | • 南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 分红公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 7 月 27 日 |
| 24 | • 南方基金关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 6 月 30 日 |
| 25 | • 南方基金关于旗下部分基金参加中信银行个人网银、移动银行基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 6 月 30 日 |
| 26 | • 南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加代销机构的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 6 月 22 日 |
| 27 | • 南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加乌鲁木齐市商业银行为代销机构的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 6 月 21 日 |
| 28 | • 南方基金关于开通网上直销赎回转认/申购业务的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 6 月 15 日 |
| 29 | • 南方基金关于暂停中国银行广东省分行银行卡网上直销业务的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 5 月 26 日 |

| | | | |
|----|---|--------------------------|-----------------------|
| 30 | • 南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加代销机构的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 5 月 11 日 |
| 31 | • 关于公司旗下基金持有停牌股票恢复使用收盘价估值的提示性公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 4 月 21 日 |
| 32 | • 南方基金关于旗下部分基金参加中国农业银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 4 月 6 日 |
| 33 | • 关于旗下部分基金参加华夏银行网上银行基金申购费率优惠活动的补充公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 4 月 2 日 |
| 34 | • 南方基金关于旗下部分基金参加东莞银行网上银行与定投申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 4 月 1 日 |
| 35 | • 南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 4 月 1 日 |
| 36 | • 南方基金关于旗下部分基金参加华夏银行延长基金定投申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 4 月 1 日 |
| 37 | • 南方基金关于旗下部分基金参加“华夏银行盈基金 2011”网上银行基金申购 4 折优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 4 月 1 日 |
| 38 | • 关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 3 月 22 日 |
| 39 | • 南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加重庆银行为代销机构的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 | 2011 年 3 月 21 |

| | | | |
|----|--------------------------------------|--------------------------|-----------------------|
| | | 证券时报 | 日 |
| 40 | • 南方基金关于旗下基金在天相投顾推出基金定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 3 月 15 日 |
| 41 | • 南方基金关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 3 月 11 日 |
| 42 | • 南方基金关于旗下部分基金参加浦发银行基金定投申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 3 月 1 日 |
| 43 | • 南方基金关于南方中证 500 指数 (LOF) 基金增聘基金经理公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 2 月 17 日 |
| 44 | • 南方基金关于南方高增长股票 (LOF) 基金增聘基金经理公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 2 月 17 日 |
| 45 | • 南方基金管理有限公司关于开通基金电话交易的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 1 月 28 日 |
| 46 | • 南方基金关于旗下部分基金在浙商证券推出基金定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、 上海证券报、 证券时报 | 2011 年 1 月 14 日 |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证 500 指数证券投资基金的文件。
- 2、南方中证 500 指数证券投资基金基金合同。
- 3、南方中证 500 指数证券投资基金基金托管协议。
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

13.2 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

13.3 查阅方式

网站: <http://www.nffund.com>