

# 中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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

送出日期：2016 年 8 月 29 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。本半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2016年8月25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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
7.6 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.....	50
7.7 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.....	50
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	51
7.9 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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	54
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>54</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
10.2 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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>57</b>
11.1 备查文件目录.....	57
11.2 存放地点.....	57
11.3 查阅方式.....	57

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 500ETF
场内简称	500ETF
基金主代码	510500
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 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	2,860,667,244.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 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“500ETF”

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的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。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 指数。
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。本基金采用完全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	林葛
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-68121816
注册地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-	北京东城区建国门内大街 69 号

	33 层	
办公地址	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 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	周慕冰

## 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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,788,355,852.93
本期利润	-3,634,517,922.94
加权平均基金份额本期利润	-1.2664
本期加权平均净值利润率	-20.49%
本期基金份额净值增长率	-18.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	8,111,859,710.86
期末可供分配基金份额利润	2.8357
期末基金资产净值	18,316,720,519.57
期末基金份额净值	6.4030
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	79.49%

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。

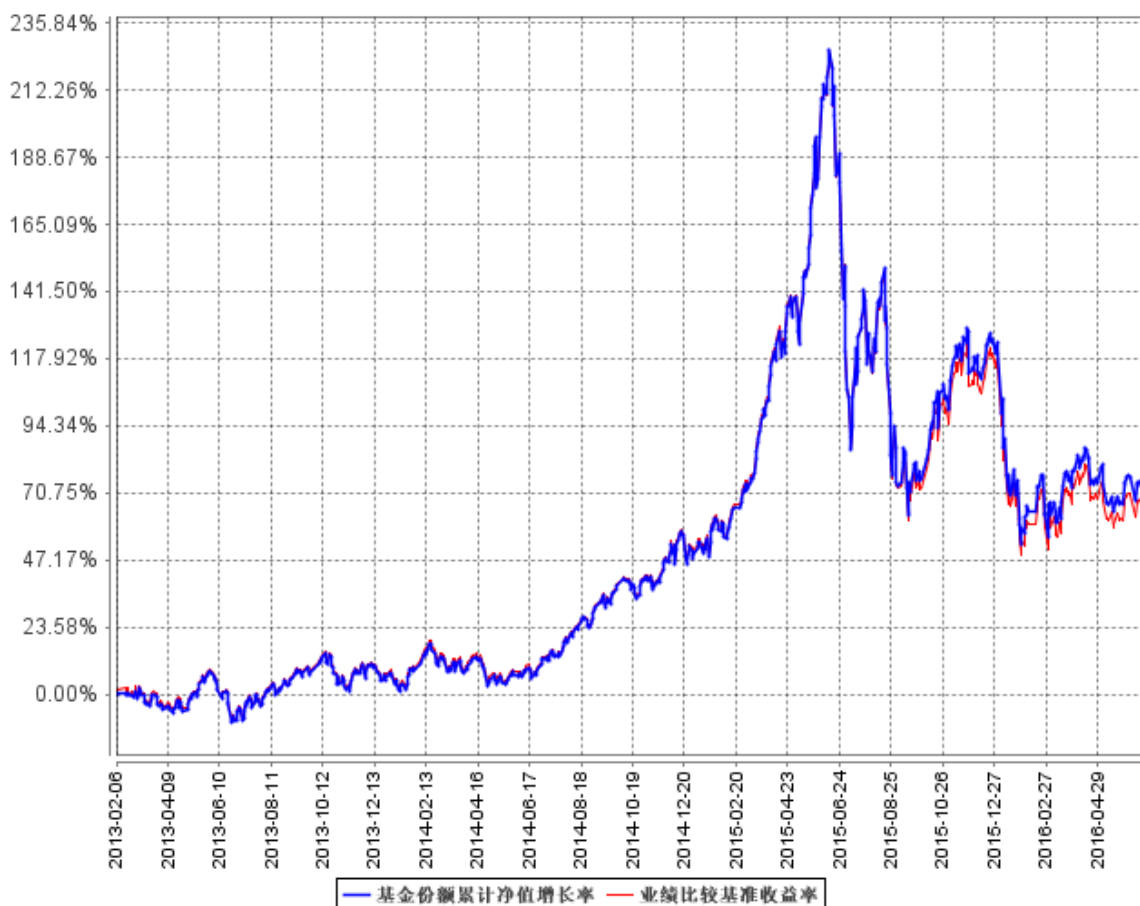
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去一个月	3.28%	1.54%	2.96%	1.55%	0.32%	-0.01%
过去三个月	0.15%	1.65%	-0.53%	1.65%	0.68%	0.00%
过去六个月	-18.46%	2.55%	-19.61%	2.56%	1.15%	-0.01%
过去一年	-28.41%	2.92%	-31.24%	2.92%	2.83%	0.00%
过去三年	97.35%	2.13%	89.23%	2.13%	8.12%	0.00%
自基金合同生效起至今	79.49%	2.07%	72.77%	2.07%	6.72%	0.00%

### 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



## §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

1998年3月6日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

南方基金总部设在深圳，注册资本3亿元人民币。股东结构为：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%）；兴业证券股份有限公司（10%）。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模超过5,600亿元，旗下



管理 96 只开放式基金，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		
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日	-	11 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有中国基金从业资格。曾先后任职于美国 Open Link Financial 公司、摩根斯坦利公司，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金量化投资部基金经理助理，现任量化投资部总监助理；2013 年 5 月至 2015 年 6 月，任南方策略基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500 基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方 300 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2014 年 10 月至今，任 500 医药基金经理；2015 年 2 月至今，任南方恒生 ETF 基金经理。

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，对此后的非首任基金经理，“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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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，没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 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。

公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占优比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次，是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致。

### 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

报告期内，中证500指数跌19.61%。

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”、“ETF现金流精算系统”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归因分析如下：

- ①大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- ②报告期内指数成份股（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；
- ③股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；
- ④6月中，我们根据指数每半年度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

自本基金建仓完毕至报告期末年化跟踪误差为0.566%，较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过2%的投资目标。

截至报告期末，本基金份额净值为6.4030元，报告期内，份额净值增长率为-18.46%，同期业绩基准增长率为-19.61%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济结构转型、产业升级的继续推进，潜在增速将放缓，预期利率水

平仍持续走低，宽松货币政策逻辑不变，投资方面将导致资产配置荒。

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。

#### 4.6 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，组成人员包括副总经理、研究部总监、量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等等。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。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 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：当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，可进行收益分配。基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定。若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配采取现金分红方式；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## §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

在托管本基金的过程中，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》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，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 托管人对本半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本基金半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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.4.1	59,158,424.52	32,810,834.58
结算备付金		565,799,947.71	472,886,806.89
存出保证金		139,684,568.18	56,424,595.26
交易性金融资产	6.4.4.2	17,623,119,321.13	20,044,833,519.70
其中：股票投资		17,620,486,821.13	20,044,833,519.70
基金投资		-	-
债券投资		2,632,500.00	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		866,383.52	226,131.04
应收利息	6.4.4.5	259,960.18	185,277.10
应收股利		9,601.50	9,601.50
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		18,388,898,206.74	20,607,376,766.07
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		41,203,567.69	93,860,509.94
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,326,471.92	8,829,132.59
应付托管费		1,465,294.37	1,765,826.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	1,018,269.76	1,460,781.09
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	21,164,083.43	25,548,030.79
负债合计		72,177,687.17	131,464,280.93
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.4.9	10,204,860,808.71	9,301,620,223.72
未分配利润	6.4.4.10	8,111,859,710.86	11,174,292,261.42
所有者权益合计		18,316,720,519.57	20,475,912,485.14
负债和所有者权益总计		18,388,898,206.74	20,607,376,766.07

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 6.4030 元，基金份额总额

2,860,667,244.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
<b>一、收入</b>		-3,566,135,939.28	3,320,650,695.23
1.利息收入		4,214,769.90	586,209.13
其中：存款利息收入	6.4.4.11	4,100,917.96	586,209.13
债券利息收入		2,185.27	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		111,666.67	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,711,646,527.25	3,607,008,609.55
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-1,803,775,753.61	3,643,882,656.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	2,424,484.56	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.4.14	-3,662,593.56	-58,047,932.42
股利收益	6.4.4.15	93,367,335.36	21,173,885.72
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.16	-1,846,162,070.01	-271,545,810.83
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.17	-12,542,111.92	-15,398,312.62
<b>减：二、费用</b>		68,381,983.66	34,884,518.77
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	44,217,551.49	15,242,490.96
2. 托管费	6.4.7.2.2	8,843,510.28	3,048,498.16
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.4.18	12,374,268.64	15,418,485.69
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.4.19	2,946,653.25	1,175,043.96
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-3,634,517,922.94	3,285,766,176.46
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-3,634,517,922.94	3,285,766,176.46

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30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)	9,301,620,223.72	11,174,292,261.42	20,475,912,485.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,634,517,922.94	-3,634,517,922.94
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)	903,240,584.99	572,085,372.38	1,475,325,957.37
其中：1.基金申购款	7,449,951,181.69	5,367,337,114.66	12,817,288,296.35
2.基金赎回款	-6,546,710,596.70	-4,795,251,742.28	-11,341,962,338.98
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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	10,204,860,808.71	8,111,859,710.86	18,316,720,519.57
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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)	3,166,093,841.00	1,557,193,408.13	4,723,287,249.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,285,766,176.46	3,285,766,176.46
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)	-688,006,761.61	-1,107,873,705.16	-1,795,880,466.77
其中：1.基金申购款	6,063,459,841.66	5,894,918,497.88	11,958,378,339.54
2.基金赎回款	-6,751,466,603.27	-7,002,792,203.04	-13,754,258,806.31
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)	-	-	-

五、期末所有者权益 (基金净值)	2,478,087,079.39	3,735,085,879.43	6,213,172,958.82
---------------------	------------------	------------------	------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 杨小松	_____ 徐超	_____ 徐超
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

### 6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.2.2 会计估计变更的说明

本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.3 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《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。



(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(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。

#### 6.4.4 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	59,158,424.52
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	59,158,424.52

##### 6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	18,544,990,043.60	17,620,486,821.13	-924,503,222.47
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,632,500.00	2,632,500.00
	银行间市场	-	-
	合计	2,632,500.00	2,632,500.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	18,547,622,543.60	17,623,119,321.13	-924,503,222.47

注：于 2016 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值和公允价值变动中包含的可退替代款的估值增值为 57,163.28 元。

#### 6.4.4.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	648,289,806.44	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	648,289,806.44	-	-	

注：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

股指期货投资

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC1607	IC1607	556.00	672,026,080.00	23,736,273.56
减：可抵销期货暂收款				23,736,273.56
股指期货投资净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 6.4.4.4 买入返售金融资产

无。

#### 6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	12,265.66
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	244,892.86
应收债券利息	663.53
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2,138.13
合计	259,960.18

#### 6.4.4.6 其他资产

无。

#### 6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,018,269.76
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,018,269.76

#### 6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	2,916,603.65
应退替代款	14,693,265.69
可退替代款	3,554,214.09
合计	21,164,083.43

注：1. 应退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

2. 可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

#### 6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,607,467,244.00	9,301,620,223.72
本期申购	2,088,400,000.00	7,449,951,181.69
本期赎回(以“-”号填列)	-1,835,200,000.00	-6,546,710,596.70

本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	2,860,667,244.00	10,204,860,808.71

#### 6.4.4.10 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	14,089,318,295.81	-2,915,026,034.39	11,174,292,261.42
本期利润	-1,788,355,852.93	-1,846,162,070.01	-3,634,517,922.94
本期基金份额交易产生的变动数	1,374,229,667.45	-802,144,295.07	572,085,372.38
其中：基金申购款	10,649,227,409.92	-5,281,890,295.26	5,367,337,114.66
基金赎回款	-9,274,997,742.47	4,479,746,000.19	-4,795,251,742.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,675,192,110.33	-5,563,332,399.47	8,111,859,710.86

#### 6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	801,237.20
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	3,227,710.09
其他	71,970.67
合计	4,100,917.96

#### 6.4.4.12 股票投资收益

##### 6.4.4.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-976,134,154.60
股票投资收益——赎回差价收入	-827,641,599.01
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-1,803,775,753.61

#### 6.4.4.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	8,720,553,649.62
减：卖出股票成本总额	9,696,687,804.22
买卖股票差价收入	-976,134,154.60

#### 6.4.4.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
赎回基金份额对价总额	11,341,962,338.98
减：现金支付赎回款总额	6,140,078,929.98
减：赎回股票成本总额	6,029,525,008.01
赎回差价收入	-827,641,599.01

#### 6.4.4.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券、债转股及债券到期兑付成交总额	19,347,006.30
减：卖出债券、债转股及债券到期兑付成本总额	16,921,000.00
减：应收利息总额	1,521.74
买卖债券差价收入	2,424,484.56

#### 6.4.4.14 衍生工具收益

##### 6.4.4.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.4.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016年1月1日至2016年6月30日
权证投资收益	-
股指期货-投资收益	-3,662,593.56

#### 6.4.4.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	93,367,335.36
基金投资产生的股利收益	-
合计	93,367,335.36

#### 6.4.4.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,870,517,543.57
——股票投资	-1,870,517,543.57
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	24,355,473.56
——权证投资	-
股指期货	24,355,473.56
3. 其他	-
合计	-1,846,162,070.01

注：本基金本年度公允价值变动收益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益60,137.28元。

#### 6.4.4.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
替代损益	-12,542,111.92
合计	-12,542,111.92

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 6.4.4.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日

交易所市场交易费用	12,374,268.64
银行间市场交易费用	-
合计	12,374,268.64

#### 6.4.4.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	84,535.36
信息披露费	149,179.94
上市费	29,835.26
银行汇划费	29,949.60
账户维护费	100.00
指数使用费	2,653,053.09
其他	-
合计	2,946,653.25

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

0.03%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度(自然季度)人民币50,000元。

#### 6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.5.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须做披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.6 关联方关系

##### 6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金公司”)	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
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

南方中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 (LOF) (500 联接)	本基金的联接基金
--	----------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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	11,421,856,394.09	62.76%	9,242,180,594.12	67.76%

#### 6.4.7.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30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	1,142,377.29	62.77%	500,603.54	49.16%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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	3,938,802.01	60.23%	2,463,783.47	51.74%

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。



## 6.4.7.2 关联方报酬

### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	44,217,551.49	15,242,490.96
其中：支付销售机构的客户维护费	3,027.08	-

注：支付基金管理人南方基金管理公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.5%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 X 0.5% / 当年天数。

### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	8,843,510.28	3,048,498.16

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0.10%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 X 0.10% / 当年天数

### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

#### 6.4.7.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份

		额的比例		额的比例
南方中证500ETF联接基金	635,073,402.00	22.2000%	675,473,402.00	25.9100%

注：南方中证500ETF联接基金投资本基金相关的费用按基金合同和更新的招募说明书的有关规定以及与券商约定的席位佣金费率支付。

#### 6.4.7.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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	59,158,424.52	801,237.20	299,428,576.15	376,454.58

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。

#### 6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.8 利润分配情况

无。

#### 6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

		29日								
--	--	-----	--	--	--	--	--	--	--	--

#### 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127003	海印转债	2016年6月8日	2016年7月1日	新债流通受限	100.00	100.00	26,325	2,632,500.00	2,632,500.00	-

#### 6.4.9.2 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
000718	苏宁环球	2016年1月4日	重大事项	13.09	2016年7月18日	11.78	5,678,436	57,262,399.91	74,330,727.24	-
600654	中安消	2016年5月19日	重大资产重组	18.54	2016年8月8日	20.39	3,736,561	116,272,371.12	69,275,840.94	-
600166	福田汽车	2016年6月30日	重大事项	5.52	2016年7月1日	5.62	10,943,001	60,352,896.54	60,405,365.52	-
601168	西部矿业	2016年2月1日	重大资产重组	5.93	2016年7月22日	6.52	9,560,043	66,825,730.52	56,691,054.99	-
000547	航天发展	2016年4月19日	重大资产重组	15.36	-	-	3,596,242	64,992,468.78	55,238,277.12	-
000511	*ST烯碳	2016年4月26日	重大事项	8.92	-	-	5,884,448	52,230,779.50	52,489,276.16	-
002512	达华智能	2016年6月21日	重大资产重组	20.28	2016年7月21日	19.38	2,051,800	40,606,528.42	41,610,504.00	-
600511	国药股份	2016年2月18日	重大资产重组	27.42	2016年8月4日	30.16	1,475,549	49,142,785.63	40,459,553.58	-
600759	洲际油气	2016年6月27日	重大资产重组	7.58	2016年7月11日	8.10	5,334,286	49,051,775.40	40,433,887.88	-
000975	银泰资源	2016年4月19日	重大资产重组	15.00	-	-	2,618,403	33,848,300.04	39,276,045.00	-

600497	驰宏 锌锗	2016年 6月 13日	重大事项	9.97	2016年 7月11日	10.97	3,932,610	39,854,723.03	39,208,121.70	-
002266	浙富 控股	2016年 5月 25日	重大事项	5.35	-	-	6,800,376	49,840,179.00	36,382,011.60	-
300166	东方 国信	2016年 6月8日	重大资产 重组	27.47	-	-	1,295,194	34,995,206.16	35,578,979.18	-
002373	千方 科技	2016年 5月 12日	重大资产 重组	14.94	2016年 8月16日	16.43	2,269,038	41,479,749.08	33,899,427.72	-
002672	东江 环保	2016年 5月 23日	重大事项	17.33	2016年 7月15日	19.06	1,896,495	32,511,473.35	32,866,258.35	-
300032	金龙 机电	2016年 6月 28日	重大事项	20.10	2016年 7月7日	19.80	1,581,900	28,880,291.85	31,796,190.00	-
002190	成飞 集成	2016年 4月 21日	重大事项	35.44	2016年 7月12日	39.98	861,150	33,323,222.46	30,519,156.00	-
000401	冀东 水泥	2016年 4月6日	重大资产 重组	10.90	2016年 7月14日	11.32	2,718,862	28,355,480.99	29,635,595.80	-
600773	西藏 城投	2016年 6月 30日	重大资产 重组	15.67	-	-	1,848,598	27,642,185.85	28,967,530.66	-
002663	普邦 园林	2016年 4月 28日	重大事项	7.36	-	-	3,603,766	25,735,911.39	26,523,717.76	-
000636	风华 高科	2016年 3月 15日	重大资产 重组	8.84	2016年 7月13日	9.72	2,974,616	27,501,737.02	26,295,605.44	-
601005	重庆 钢铁	2016年 6月2日	重大资产 重组	2.52	-	-	9,373,100	30,519,194.80	23,620,212.00	-
600614	鼎立 股份	2016年 4月 26日	重大资产 重组	8.14	-	-	2,897,294	30,445,248.17	23,583,973.16	-
600545	新疆 城建	2016年 5月 31日	重大资产 重组	6.91	-	-	2,650,528	26,011,378.41	18,315,148.48	-
600640	号百 控股	2016年 4月 18日	重大资产 重组	16.79	2016年 8月22日	18.44	1,036,675	19,140,442.28	17,405,773.25	-
000693	ST华 泽	2016年 3月1日	重大事项	12.50	-	-	1,391,501	25,507,720.76	17,393,762.50	-

000517	荣安地产	2016年6月14日	重大资产重组	4.84	2016年7月14日	4.98	2,965,100	15,041,538.18	14,351,084.00	-
002249	大洋电机	2016年6月8日	重大资产重组	11.97	2016年7月28日	10.77	1,048,158	10,478,967.85	12,546,451.26	-
600751	天海投资	2016年2月15日	重大资产重组	6.11	2016年7月26日	6.72	1,697,907	15,281,859.91	10,374,211.77	-
000582	北部湾港	2016年2月29日	重大资产重组	16.32	-	-	507,606	9,251,096.67	8,284,129.92	-
601611	中国核建	2016年6月30日	股票价格异常波动	20.92	2016年7月1日	23.01	37,059	128,594.73	775,274.28	-

注：本基金截至2016年6月30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。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.10 金融工具风险及管理

#### 6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证500指数，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，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证500指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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内。

#### **6.4.10.2 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约责任，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，因而与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2016年6月30日，持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.01%。

#### **6.4.10.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

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 6.4.9 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，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的投资股指期货，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不付息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

#### 6.4.10.4 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。

##### 6.4.10.4.1 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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

##### 6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	59,158,424.52	-	-	-	59,158,424.52
结算备付金	565,799,947.71	-	-	-	565,799,947.71
存出保证金	5,279,352.18	-	-	134,405,216.00	139,684,568.18
交易性金融资产	2,632,500.00	-	-	17,620,486,821.13	17,623,119,321.13
应收证券清算款	-	-	-	866,383.52	866,383.52
应收利息	-	-	-	259,960.18	259,960.18
应收股利	-	-	-	9,601.50	9,601.50
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	632,870,224.41	-	-	17,756,027,982.33	18,388,898,206.74
负债					
应付证券清算款	-	-	-	41,203,567.69	41,203,567.69
应付管理人报酬	-	-	-	7,326,471.92	7,326,471.92
应付托管费	-	-	-	1,465,294.37	1,465,294.37
应付交易费用	-	-	-	1,018,269.76	1,018,269.76
其他负债	-	-	-	21,164,083.43	21,164,083.43
负债总计	-	-	-	72,177,687.17	72,177,687.17
利率敏感度缺口	632,870,224.41	-	-	17,683,850,295.16	18,316,720,519.57
上年度末 2015年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	32,810,834.58	-	-	-	32,810,834.58
结算备付金	472,886,806.89	-	-	-	472,886,806.89
存出保证金	17,949,795.26	-	-	38,474,800.00	56,424,595.26
交易性金融资产	-	-	-	20,044,833,519.70	20,044,833,519.70
应收证券清算款	-	-	-	226,131.04	226,131.04
应收利息	-	-	-	185,277.10	185,277.10
应收股利	-	-	-	9,601.50	9,601.50
资产总计	523,647,436.73	-	-	20,083,729,329.34	20,607,376,766.07
负债					
应付证券清算款	-	-	-	93,860,509.94	93,860,509.94
应付管理人报酬	-	-	-	8,829,132.59	8,829,132.59
应付托管费	-	-	-	1,765,826.52	1,765,826.52
应付交易费用	-	-	-	1,460,781.09	1,460,781.09
其他负债	-	-	-	25,548,030.79	25,548,030.79
负债总计	-	-	-	131,464,280.93	131,464,280.93
利率敏感度缺口	523,647,436.73	-	-	19,952,265,048.41	20,475,912,485.14

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。



#### 6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券投资占基金资产净值的比例为 0.01%，市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.4.3 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交易的股票，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。

本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，中证 500 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%。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，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。

##### 6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	17,620,486,821.13	96.20	20,044,833,519.70	97.89
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,632,500.00	0.01	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	17,623,119,321.13	96.21	20,044,833,519.70	97.89

#### 6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	增长 91,302.00	增长 102,956.00
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少 91,302.00	减少 102,956.00

#### 6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §7 投资组合报告

### 7.1 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	17,620,486,821.13	95.82
	其中：股票	17,620,486,821.13	95.82
2	固定收益投资	2,632,500.00	0.01
	其中：债券	2,632,500.00	0.01
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	624,958,372.23	3.40
7	其他各项资产	140,820,513.38	0.77
8	合计	18,388,898,206.74	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	336,210,408.48	1.84
B	采矿业	741,785,828.09	4.05

C	制造业	10,439,345,292.28	56.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	491,195,246.18	2.68
E	建筑业	527,139,188.77	2.88
F	批发和零售业	1,008,339,944.04	5.51
G	交通运输、仓储和邮政业	477,522,897.54	2.61
H	住宿和餐饮业	30,568,788.32	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,238,437,940.50	6.76
J	金融业	84,831,881.38	0.46
K	房地产业	1,224,146,649.78	6.68
L	租赁和商务服务业	251,021,387.31	1.37
M	科学研究和技术服务业	76,906,012.12	0.42
N	水利、环境和公共设施管理业	115,497,340.33	0.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	50,751,602.80	0.28
R	文化、体育和娱乐业	314,561,941.74	1.72
S	综合	210,171,797.59	1.15
	合计	17,618,434,147.25	96.19

## 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,083,401.07	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	775,274.28	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,492.40	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	66,342.85	0.00
N	水利、环境和公共设施管理	-	-

	业		
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,995,510.60	0.01

### 7.3 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

#### 7.3.1 期末指数投资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	002466	天齐锂业	2,772,620	118,363,147.80	0.65
2	002405	四维图新	4,015,151	98,772,714.60	0.54
3	600584	长电科技	4,864,053	98,691,635.37	0.54
4	600522	DR 中天科	8,591,593	84,197,611.40	0.46
5	002340	格林美	9,572,958	83,954,841.66	0.46
6	300072	三聚环保	2,784,291	76,957,803.24	0.42
7	002049	同方国芯	1,708,985	75,109,890.75	0.41
8	000718	苏宁环球	5,678,436	74,330,727.24	0.41
9	600201	生物股份	2,693,353	73,609,337.49	0.40
10	002085	万丰奥威	4,245,972	72,988,258.68	0.40
11	300113	顺网科技	1,918,935	72,842,772.60	0.40
12	600079	人福医药	4,236,575	71,047,362.75	0.39
13	600521	华海药业	2,911,356	70,804,177.92	0.39
14	600654	中安消	3,736,561	69,275,840.94	0.38
15	600219	南山铝业	9,360,528	69,267,907.20	0.38
16	600503	华丽家族	7,524,300	68,997,831.00	0.38
17	600525	长园集团	4,964,293	68,755,458.05	0.38
18	002572	索菲亚	1,221,549	68,431,174.98	0.37
19	000661	长春高新	640,383	68,316,058.44	0.37
20	002426	胜利精密	6,843,300	67,406,505.00	0.37
21	600682	南京新百	2,330,700	66,355,029.00	0.36
22	002030	达安基因	2,375,100	66,027,780.00	0.36
23	300253	卫宁健康	2,671,363	65,982,666.10	0.36
24	601012	隆基股份	5,007,892	65,352,990.60	0.36

25	600436	片仔癀	1,419,164	63,876,571.64	0.35
26	002439	启明星辰	2,451,490	63,321,986.70	0.35
27	000887	中鼎股份	2,855,836	63,142,533.96	0.34
28	002508	老板电器	1,713,072	62,989,657.44	0.34
29	002400	省广股份	4,399,769	62,168,735.97	0.34
30	600699	均胜电子	1,622,147	62,128,230.10	0.34
31	600978	宜华生活	5,556,726	61,901,927.64	0.34
32	000997	新大陆	3,082,527	61,773,841.08	0.34
33	002179	中航光电	1,409,772	61,071,323.04	0.33
34	600879	航天电子	3,918,146	61,044,714.68	0.33
35	002004	华邦健康	6,682,065	61,007,253.45	0.33
36	002131	利欧股份	3,541,300	60,520,817.00	0.33
37	600166	福田汽车	10,943,001	60,405,365.52	0.33
38	002273	水晶光电	2,156,749	60,367,404.51	0.33
39	000983	西山煤电	7,394,200	60,262,730.00	0.33
40	000748	长城信息	3,060,968	60,056,192.16	0.33
41	600498	烽火通信	2,458,158	59,684,076.24	0.33
42	600482	中国动力	1,811,452	59,361,282.04	0.32
43	000988	华工科技	2,937,030	58,887,451.50	0.32
44	002701	奥瑞金	6,648,786	58,708,780.38	0.32
45	600664	哈药股份	7,047,231	58,421,544.99	0.32
46	002038	双鹭药业	1,928,515	58,202,582.70	0.32
47	000970	中科三环	4,002,473	58,075,883.23	0.32
48	600478	科力远	4,808,447	58,037,955.29	0.32
49	600122	宏图高科	4,275,044	57,200,088.72	0.31
50	601168	西部矿业	9,560,043	56,691,054.99	0.31
51	002310	东方园林	2,365,900	56,592,328.00	0.31
52	300088	长信科技	3,803,002	56,550,639.74	0.31
53	600158	中体产业	3,180,721	56,457,797.75	0.31
54	000998	隆平高科	2,957,036	56,124,543.28	0.31
55	603019	中科曙光	1,408,350	56,080,497.00	0.31
56	600635	大众公用	9,297,616	56,064,624.48	0.31
57	000547	航天发展	3,596,242	55,238,277.12	0.30
58	600266	北京城建	4,411,300	55,097,137.00	0.30
59	000050	深天马A	2,636,519	55,024,151.53	0.30
60	600143	金发科技	8,415,373	54,195,002.12	0.30
61	002001	新和成	2,538,900	53,646,957.00	0.29
62	002299	圣农发展	2,063,086	53,433,927.40	0.29
63	000656	金科股份	13,965,769	53,349,237.58	0.29

64	600643	爱建集团	5,417,654	52,930,479.58	0.29
65	600138	中青旅	2,726,662	52,679,109.84	0.29
66	002276	万马股份	2,654,442	52,584,496.02	0.29
67	000511	*ST 烯碳	5,884,448	52,489,276.16	0.29
68	000078	海王生物	7,042,175	52,323,360.25	0.29
69	600418	江淮汽车	4,106,669	52,072,562.92	0.28
70	002191	劲嘉股份	4,472,802	51,839,775.18	0.28
71	300055	万邦达	2,843,834	51,786,217.14	0.28
72	002168	深圳惠程	3,675,199	51,746,801.92	0.28
73	600655	豫园商城	4,741,437	51,397,177.08	0.28
74	600487	亨通光电	4,070,045	51,201,166.10	0.28
75	600673	东阳光科	8,145,200	50,907,500.00	0.28
76	300244	迪安诊断	1,538,860	50,751,602.80	0.28
77	002573	清新环境	2,997,406	50,716,109.52	0.28
78	600388	龙净环保	4,031,152	50,631,269.12	0.28
79	600312	平高电气	3,219,328	50,414,676.48	0.28
80	600198	大唐电信	2,497,162	49,643,580.56	0.27
81	000012	南玻 A	4,329,518	49,616,276.28	0.27
82	000930	中粮生化	4,509,401	49,513,222.98	0.27
83	002714	牧原股份	969,125	48,969,886.25	0.27
84	600200	江苏吴中	2,527,999	48,967,340.63	0.27
85	002074	国轩高科	1,234,000	48,705,980.00	0.27
86	600094	大名城	5,116,600	48,607,700.00	0.27
87	600645	中源协和	1,381,733	48,554,097.62	0.27
88	000762	西藏矿业	1,962,599	48,515,447.28	0.26
89	000031	中粮地产	5,113,290	48,218,324.70	0.26
90	000697	炼石有色	2,105,136	48,102,357.60	0.26
91	002223	鱼跃医疗	1,515,987	48,087,107.64	0.26
92	002595	豪迈科技	2,246,188	48,001,037.56	0.26
93	600594	益佰制药	2,988,971	47,763,756.58	0.26
94	002221	东华能源	3,917,238	47,751,131.22	0.26
95	600410	华胜天成	4,237,612	47,546,006.64	0.26
96	000581	威孚高科	2,354,642	47,469,582.72	0.26
97	600240	华业资本	4,682,357	46,917,217.14	0.26
98	600435	北方导航	3,514,336	46,775,812.16	0.26
99	600151	航天机电	4,120,990	46,567,187.00	0.25
100	600851	海欣股份	3,470,569	46,193,273.39	0.25
101	600770	综艺股份	3,679,033	45,840,751.18	0.25
102	002048	宁波华翔	1,997,575	45,684,540.25	0.25

103	002311	海大集团	2,896,261	45,674,035.97	0.25
104	600884	杉杉股份	2,645,082	45,521,861.22	0.25
105	600687	刚泰控股	2,794,100	45,432,066.00	0.25
106	600160	巨化股份	4,267,168	45,359,995.84	0.25
107	300274	阳光电源	1,858,080	45,337,152.00	0.25
108	002308	威创股份	2,754,407	45,254,907.01	0.25
109	000671	阳光城	7,595,915	45,119,735.10	0.25
110	300010	立思辰	2,150,200	45,111,196.00	0.25
111	600499	科达洁能	2,657,683	44,941,419.53	0.25
112	000860	顺鑫农业	1,882,854	44,774,268.12	0.24
113	000566	海南海药	4,082,418	44,539,180.38	0.24
114	600516	方大炭素	4,867,224	44,486,427.36	0.24
115	002410	广联达	3,105,770	44,412,511.00	0.24
116	000598	兴蓉环境	8,407,500	44,391,600.00	0.24
117	600811	东方集团	6,656,640	44,333,222.40	0.24
118	600500	中化国际	4,898,700	44,284,248.00	0.24
119	600601	方正科技	10,280,796	44,207,422.80	0.24
120	002477	雏鹰农牧	7,381,397	44,066,940.09	0.24
121	600171	上海贝岭	2,536,768	44,063,660.16	0.24
122	600366	宁波韵升	1,837,894	43,870,529.78	0.24
123	000400	许继电气	2,838,800	43,831,072.00	0.24
124	002665	首航节能	5,547,560	43,770,248.40	0.24
125	002657	中科金财	793,056	43,570,496.64	0.24
126	600755	厦门国贸	5,479,538	43,562,327.10	0.24
127	002268	卫士通	1,218,200	43,538,468.00	0.24
128	000979	中弘股份	15,848,804	43,425,722.96	0.24
129	600392	盛和资源	2,650,902	43,421,774.76	0.24
130	300115	长盈精密	2,107,110	43,406,466.00	0.24
131	600176	中国巨石	4,532,429	43,375,345.53	0.24
132	002353	杰瑞股份	2,247,100	43,324,088.00	0.24
133	000758	中色股份	5,557,630	43,071,632.50	0.24
134	002051	中工国际	2,181,886	42,917,697.62	0.23
135	600565	迪马股份	6,605,900	42,674,114.00	0.23
136	300273	和佳股份	2,223,069	42,571,771.35	0.23
137	300199	翰宇药业	2,081,335	42,355,167.25	0.23
138	000008	神州高铁	3,882,900	42,284,781.00	0.23
139	600259	广晟有色	738,293	42,274,657.18	0.23
140	002092	中泰化学	4,996,656	42,271,709.76	0.23
141	000727	华东科技	12,750,400	42,076,320.00	0.23

142	002155	湖南黄金	3,192,116	42,040,167.72	0.23
143	600633	浙报传媒	2,788,000	41,931,520.00	0.23
144	002512	达华智能	2,051,800	41,610,504.00	0.23
145	601929	吉视传媒	10,266,105	41,372,403.15	0.23
146	300182	捷成股份	2,415,539	41,329,872.29	0.23
147	600881	亚泰集团	8,571,376	41,314,032.32	0.23
148	002444	巨星科技	2,027,788	41,204,652.16	0.23
149	000690	宝新能源	6,068,982	41,147,697.96	0.22
150	600651	飞乐音响	3,248,905	41,131,137.30	0.22
151	002022	科华生物	1,929,688	41,121,651.28	0.22
152	002217	合力泰	2,679,110	40,990,383.00	0.22
153	300026	红日药业	2,355,067	40,954,615.13	0.22
154	002366	台海核电	766,249	40,848,734.19	0.22
155	300001	特锐德	1,881,100	40,801,059.00	0.22
156	002013	中航机电	3,026,599	40,798,554.52	0.22
157	600216	浙江医药	3,092,236	40,786,592.84	0.22
158	000878	云南铜业	3,988,487	40,602,797.66	0.22
159	002489	浙江永强	5,116,089	40,519,424.88	0.22
160	002271	东方雨虹	2,348,208	40,459,623.84	0.22
161	600511	国药股份	1,475,549	40,459,553.58	0.22
162	600759	洲际油气	5,334,286	40,433,887.88	0.22
163	600611	大众交通	5,896,048	40,152,086.88	0.22
164	603766	隆鑫通用	1,970,169	39,836,817.18	0.22
165	000066	长城电脑	3,123,923	39,830,018.25	0.22
166	600528	中铁二局	3,430,043	39,822,799.23	0.22
167	601311	骆驼股份	1,996,767	39,635,824.95	0.22
168	600316	洪都航空	2,027,650	39,559,451.50	0.22
169	002250	联化科技	2,751,869	39,406,764.08	0.22
170	000975	银泰资源	2,618,403	39,276,045.00	0.21
171	600497	驰宏锌锗	3,932,610	39,208,121.70	0.21
172	300043	互动娱乐	2,763,903	39,164,505.51	0.21
173	300291	华录百纳	1,650,813	38,843,629.89	0.21
174	601155	新城控股	4,167,750	38,593,365.00	0.21
175	600787	中储股份	5,165,937	38,382,911.91	0.21
176	002624	完美环球	1,013,550	38,261,512.50	0.21
177	600064	南京高科	2,548,851	38,105,322.45	0.21
178	000973	佛塑科技	3,642,839	38,031,239.16	0.21
179	600026	中海发展	6,434,950	37,966,205.00	0.21
180	000021	深科技	3,447,564	37,957,679.64	0.21



181	600058	五矿发展	2,019,135	37,899,163.95	0.21
182	600056	中国医药	2,385,722	37,837,550.92	0.21
183	000028	国药一致	581,002	37,823,230.20	0.21
184	601880	大连港	6,373,742	37,668,815.22	0.21
185	002431	棕榈股份	3,250,235	37,377,702.50	0.20
186	002073	软控股份	3,100,182	37,357,193.10	0.20
187	600108	亚盛集团	7,336,100	37,047,305.00	0.20
188	000592	平潭发展	5,445,102	36,917,791.56	0.20
189	002428	云南锗业	2,146,291	36,873,279.38	0.20
190	300134	大富科技	1,227,250	36,768,410.00	0.20
191	601699	潞安环能	5,614,600	36,719,484.00	0.20
192	600597	光明乳业	2,895,562	36,715,726.16	0.20
193	600325	华发股份	3,304,327	36,578,899.89	0.20
194	600426	华鲁恒升	4,134,160	36,421,949.60	0.20
195	002266	浙富控股	6,800,376	36,382,011.60	0.20
196	002161	远望谷	2,438,899	36,315,206.11	0.20
197	600348	阳泉煤业	5,696,965	36,289,667.05	0.20
198	002325	洪涛股份	3,948,701	36,288,562.19	0.20
199	000829	天音控股	2,710,735	36,188,312.25	0.20
200	600572	康恩贝	5,574,681	36,123,932.88	0.20
201	300287	飞利信	2,694,200	36,102,280.00	0.20
202	000543	皖能电力	5,047,184	36,036,893.76	0.20
203	002437	誉衡药业	4,136,183	35,984,792.10	0.20
204	002354	天神娱乐	411,900	35,950,632.00	0.20
205	600260	凯乐科技	2,196,921	35,941,627.56	0.20
206	000616	海航投资	6,730,140	35,938,947.60	0.20
207	600422	昆药集团	2,615,378	35,673,755.92	0.19
208	300166	东方国信	1,295,194	35,578,979.18	0.19
209	002375	亚厦股份	3,140,600	35,488,780.00	0.19
210	600067	冠城大通	4,898,292	35,316,685.32	0.19
211	600073	上海梅林	3,083,037	35,300,773.65	0.19
212	001696	宗申动力	3,228,379	35,253,898.68	0.19
213	600017	日照港	8,684,722	35,173,124.10	0.19
214	002371	七星电子	839,166	35,093,922.12	0.19
215	002699	美盛文化	1,047,400	34,972,686.00	0.19
216	600298	安琪酵母	1,950,423	34,795,546.32	0.19
217	600536	中国软件	1,394,599	34,753,407.08	0.19
218	601777	力帆股份	2,947,643	34,693,758.11	0.19
219	000786	北新建材	3,816,311	34,652,103.88	0.19

220	002368	太极股份	975,290	34,652,053.70	0.19
221	000667	美好集团	9,636,297	34,401,580.29	0.19
222	002063	远光软件	2,221,907	34,328,463.15	0.19
223	002002	鸿达兴业	1,825,200	34,313,760.00	0.19
224	600380	健康元	3,732,622	34,265,469.96	0.19
225	600717	天津港	3,930,100	34,152,569.00	0.19
226	600808	马钢股份	14,135,549	34,066,673.09	0.19
227	000418	小天鹅A	1,043,049	34,024,258.38	0.19
228	000777	中核科技	1,442,964	33,996,231.84	0.19
229	002373	千方科技	2,269,038	33,899,427.72	0.19
230	000810	创维数字	1,874,600	33,874,022.00	0.18
231	600039	四川路桥	8,583,084	33,817,350.96	0.18
232	600161	天坛生物	1,215,079	33,767,045.41	0.18
233	002603	以岭药业	2,118,002	33,697,411.82	0.18
234	002505	大康农业	8,599,367	33,537,531.30	0.18
235	600006	XD 东风汽	3,776,005	33,493,164.35	0.18
236	000969	安泰科技	2,386,954	33,488,964.62	0.18
237	000488	晨鸣纸业	4,213,684	33,456,650.96	0.18
238	600320	振华重工	7,866,866	33,434,180.50	0.18
239	600557	康缘药业	2,043,280	33,366,762.40	0.18
240	002056	横店东磁	1,951,604	33,177,268.00	0.18
241	600267	海正药业	2,727,190	33,135,358.50	0.18
242	002050	三花股份	3,415,680	32,961,312.00	0.18
243	000848	承德露露	2,757,354	32,950,380.30	0.18
244	600967	北方创业	3,097,925	32,930,942.75	0.18
245	002672	东江环保	1,896,495	32,866,258.35	0.18
246	000006	深振业A	4,442,654	32,742,359.98	0.18
247	600872	中炬高新	2,627,588	32,424,435.92	0.18
248	000685	中山公用	3,104,845	32,228,291.10	0.18
249	002440	闰土股份	2,162,908	32,119,183.80	0.18
250	300147	香雪制药	2,176,346	32,057,576.58	0.18
251	002640	跨境通	1,815,900	31,996,158.00	0.17
252	600694	大商股份	830,329	31,984,273.08	0.17
253	000563	陕国投A	5,810,820	31,901,401.80	0.17
254	300032	金龙机电	1,581,900	31,796,190.00	0.17
255	000939	凯迪生态	3,547,449	31,749,668.55	0.17
256	300202	聚龙股份	1,310,344	31,723,428.24	0.17
257	002384	东山精密	1,592,073	31,618,569.78	0.17
258	000612	焦作万方	4,425,403	31,597,377.42	0.17

259	600970	中材国际	5,007,234	31,545,574.20	0.17
260	000816	智慧农业	5,331,910	31,511,588.10	0.17
261	002642	荣之联	1,194,509	31,427,531.79	0.17
262	600765	中航重机	2,153,590	31,399,342.20	0.17
263	000926	福星股份	2,675,440	31,382,911.20	0.17
264	600183	生益科技	3,380,150	31,333,990.50	0.17
265	000587	金洲慈航	2,025,055	31,246,598.65	0.17
266	600736	苏州高新	3,419,307	31,218,272.91	0.17
267	600086	东方金钰	3,223,325	31,201,786.00	0.17
268	000681	视觉中国	1,316,576	31,137,022.40	0.17
269	600169	太原重工	7,979,561	31,120,287.90	0.17
270	600062	华润双鹤	1,705,970	31,082,773.40	0.17
271	600220	江苏阳光	6,807,565	31,042,496.40	0.17
272	600433	冠豪高新	3,588,573	31,005,270.72	0.17
273	600580	卧龙电气	2,760,958	30,950,339.18	0.17
274	002414	高德红外	1,147,419	30,945,890.43	0.17
275	600587	新华医疗	1,339,810	30,936,212.90	0.17
276	000519	江南红箭	2,431,086	30,899,103.06	0.17
277	600187	国中水务	6,896,169	30,756,913.74	0.17
278	600880	博瑞传播	3,600,817	30,642,952.67	0.17
279	600175	美都能源	6,510,682	30,600,205.40	0.17
280	601010	XD 文峰股	5,891,561	30,577,201.59	0.17
281	600754	锦江股份	913,592	30,568,788.32	0.17
282	002190	成飞集成	861,150	30,519,156.00	0.17
283	002589	瑞康医药	993,673	30,515,697.83	0.17
284	600869	智慧能源	2,954,260	30,428,878.00	0.17
285	600517	置信电气	3,198,933	30,421,852.83	0.17
286	600289	亿阳信通	2,158,992	30,204,298.08	0.16
287	002396	星网锐捷	1,525,630	30,054,911.00	0.16
288	600270	外运发展	1,716,965	30,029,717.85	0.16
289	600993	马应龙	1,437,499	29,943,104.17	0.16
290	002025	航天电器	1,212,343	29,932,748.67	0.16
291	600458	时代新材	1,916,886	29,865,083.88	0.16
292	601000	唐山港	7,685,641	29,820,287.08	0.16
293	600537	亿晶光电	3,867,322	29,817,052.62	0.16
294	600409	三友化工	4,418,717	29,782,152.58	0.16
295	002390	信邦制药	3,207,580	29,638,039.20	0.16
296	000401	冀东水泥	2,718,862	29,635,595.80	0.16
297	000600	建投能源	3,391,866	29,610,990.18	0.16

298	002011	盾安环境	2,624,263	29,601,686.64	0.16
299	600120	浙江东方	1,363,503	29,601,650.13	0.16
300	600416	湘电股份	2,371,209	29,568,976.23	0.16
301	002681	奋达科技	1,745,930	29,471,298.40	0.16
302	002285	世联行	3,774,129	29,400,464.91	0.16
303	002244	滨江集团	4,385,196	29,380,813.20	0.16
304	000961	中南建设	5,233,762	29,361,404.82	0.16
305	600563	法拉电子	644,565	29,340,598.80	0.16
306	600639	浦东金桥	1,168,436	29,187,531.28	0.16
307	600277	亿利洁能	4,902,600	29,170,470.00	0.16
308	600835	上海机电	1,517,036	29,111,920.84	0.16
309	603188	亚邦股份	1,619,437	29,085,088.52	0.16
310	002078	太阳纸业	5,950,120	29,036,585.60	0.16
311	002281	光迅科技	451,949	29,015,125.80	0.16
312	600773	西藏城投	1,848,598	28,967,530.66	0.16
313	002261	拓维信息	2,091,700	28,928,211.00	0.16
314	000541	佛山照明	2,781,969	28,626,461.01	0.16
315	002635	安洁科技	743,490	28,535,146.20	0.16
316	600729	重庆百货	1,148,827	28,490,909.60	0.16
317	600460	士兰微	3,568,610	28,299,077.30	0.15
318	600805	悦达投资	3,249,629	28,206,779.72	0.15
319	600850	华东电脑	983,040	28,203,417.60	0.15
320	000572	海马汽车	5,420,883	28,134,382.77	0.15
321	600284	浦东建设	2,646,455	27,628,990.20	0.15
322	002254	泰和新材	2,013,259	27,621,913.48	0.15
323	002106	莱宝高科	2,321,919	27,584,397.72	0.15
324	002498	汉缆股份	6,348,810	27,553,835.40	0.15
325	002005	德豪润达	4,661,242	27,547,940.22	0.15
326	000062	深圳华强	1,017,131	27,462,537.00	0.15
327	002588	史丹利	2,221,076	27,430,288.60	0.15
328	000513	丽珠集团	591,922	27,293,523.42	0.15
329	600750	江中药业	857,501	27,268,531.80	0.15
330	600809	山西汾酒	1,225,850	27,189,353.00	0.15
331	002028	思源电气	2,479,729	27,153,032.55	0.15
332	600894	广日股份	2,032,155	27,088,626.15	0.15
333	600004	白云机场	2,198,346	26,951,721.96	0.15
334	600125	铁龙物流	4,196,614	26,732,431.18	0.15
335	600112	天成控股	2,392,326	26,698,358.16	0.15
336	600575	皖江物流	6,159,389	26,670,154.37	0.15

337	000669	金鸿能源	1,595,033	26,637,051.10	0.15
338	002242	九阳股份	1,462,319	26,584,959.42	0.15
339	300257	开山股份	1,607,665	26,558,625.80	0.15
340	002663	普邦园林	3,603,766	26,523,717.76	0.14
341	002269	美邦服饰	6,021,517	26,494,674.80	0.14
342	000861	海印股份	5,363,036	26,493,397.84	0.14
343	000937	冀中能源	4,973,900	26,461,148.00	0.14
344	000636	风华高科	2,974,616	26,295,605.44	0.14
345	600395	盘江股份	3,162,840	26,125,058.40	0.14
346	002041	登海种业	1,680,340	26,112,483.60	0.14
347	000596	古井贡酒	543,834	26,076,840.30	0.14
348	000869	张裕A	648,901	26,072,842.18	0.14
349	002344	海宁皮城	2,669,605	26,028,648.75	0.14
350	600826	兰生股份	990,682	25,936,054.76	0.14
351	601717	郑煤机	4,543,879	25,900,110.30	0.14
352	600823	世茂股份	3,812,945	25,889,896.55	0.14
353	000099	中信海直	1,988,359	25,848,667.00	0.14
354	002358	森源电气	1,671,527	25,791,661.61	0.14
355	600351	亚宝药业	2,524,014	25,315,860.42	0.14
356	002479	富春环保	2,246,631	25,229,666.13	0.14
357	002463	沪电股份	4,761,058	25,138,386.24	0.14
358	000090	天健集团	2,840,611	24,997,376.80	0.14
359	002727	一心堂	999,600	24,990,000.00	0.14
360	000620	新华联	2,720,026	24,888,237.90	0.14
361	000158	常山股份	1,790,500	24,870,045.00	0.14
362	600859	王府井	1,627,657	24,805,492.68	0.14
363	000049	德赛电池	588,312	24,673,805.28	0.13
364	002551	尚荣医疗	1,050,680	24,564,898.40	0.13
365	600831	广电网络	1,889,426	24,486,960.96	0.13
366	000528	柳工	3,769,068	24,423,560.64	0.13
367	002093	国脉科技	1,966,760	24,407,491.60	0.13
368	600757	长江传媒	2,893,211	24,274,040.29	0.13
369	002317	众生药业	2,013,696	24,144,215.04	0.13
370	002503	搜于特	1,938,523	24,076,455.66	0.13
371	600059	古越龙山	2,332,253	23,998,883.37	0.13
372	600812	华北制药	3,863,638	23,993,191.98	0.13
373	000550	江铃汽车	982,799	23,940,983.64	0.13
374	000897	津滨发展	6,172,304	23,886,816.48	0.13
375	600300	维维股份	4,008,767	23,812,075.98	0.13

376	601001	大同煤业	4,433,187	23,806,214.19	0.13
377	000726	鲁泰 A	2,141,283	23,789,654.13	0.13
378	000088	盐田港	3,675,621	23,670,999.24	0.13
379	601005	重庆钢铁	9,373,100	23,620,212.00	0.13
380	600614	鼎立股份	2,897,294	23,583,973.16	0.13
381	600292	远达环保	1,852,528	23,471,529.76	0.13
382	603077	和邦生物	4,754,656	23,392,907.52	0.13
383	000680	山推股份	4,731,040	23,324,027.20	0.13
384	002309	中利科技	1,302,202	23,322,437.82	0.13
385	600236	桂冠电力	3,470,367	23,320,866.24	0.13
386	601666	平煤股份	5,654,298	23,126,078.82	0.13
387	300039	上海凯宝	2,267,734	23,062,854.78	0.13
388	002064	华峰氨纶	4,783,766	22,962,076.80	0.13
389	600428	中远航运	4,087,454	22,930,616.94	0.13
390	600628	新世界	1,941,858	22,913,924.40	0.13
391	601886	江河集团	2,200,301	22,597,091.27	0.12
392	000652	泰达股份	4,887,406	22,482,067.60	0.12
393	000900	现代投资	3,331,488	22,454,229.12	0.12
394	600282	南钢股份	9,488,079	22,296,985.65	0.12
395	000830	鲁西化工	4,909,598	22,191,382.96	0.12
396	002482	广田股份	2,915,142	22,096,776.36	0.12
397	600180	瑞茂通	1,457,461	22,022,235.71	0.12
398	002029	七匹狼	2,165,693	21,981,783.95	0.12
399	002277	友阿股份	1,901,990	21,910,924.80	0.12
400	601908	京运通	2,838,323	21,769,937.41	0.12
401	000426	兴业矿业	2,887,792	21,716,195.84	0.12
402	600481	双良节能	3,774,424	21,627,449.52	0.12
403	000501	鄂武商 A	1,375,508	21,581,720.52	0.12
404	002128	露天煤业	2,870,654	21,558,611.54	0.12
405	600496	精工钢构	5,053,344	21,527,245.44	0.12
406	600053	九鼎投资	610,450	21,139,883.50	0.12
407	000417	合肥百货	2,612,007	21,131,136.63	0.12
408	600586	金晶科技	4,880,296	20,985,272.80	0.11
409	600761	安徽合力	2,066,240	20,848,361.60	0.11
410	600509	天富能源	2,830,583	20,804,785.05	0.11
411	000552	靖远煤电	5,897,228	20,758,242.56	0.11
412	600456	宝钛股份	1,029,403	20,711,588.36	0.11
413	000931	中关村	2,583,345	20,615,093.10	0.11
414	600790	轻纺城	3,505,818	20,579,151.66	0.11

415	601126	四方股份	1,946,936	20,501,236.08	0.11
416	603328	依顿电子	686,918	20,291,557.72	0.11
417	601801	皖新传媒	1,736,038	20,259,563.46	0.11
418	601233	桐昆股份	1,851,725	20,109,733.50	0.11
419	601678	滨化股份	3,938,589	20,047,418.01	0.11
420	600720	祁连山	2,984,343	20,024,941.53	0.11
421	600825	新华传媒	2,504,639	19,911,880.05	0.11
422	601002	晋亿实业	2,284,171	19,872,287.70	0.11
423	002345	潮宏基	2,020,746	19,762,895.88	0.11
424	002118	紫鑫药业	1,342,261	19,731,236.70	0.11
425	600748	上实发展	2,037,066	19,637,316.24	0.11
426	002332	仙琚制药	1,750,825	19,609,240.00	0.11
427	002251	步步高	1,503,568	19,501,276.96	0.11
428	002267	陕天然气	1,839,668	19,316,514.00	0.11
429	603699	纽威股份	1,085,040	19,248,609.60	0.11
430	601369	陕鼓动力	3,012,289	19,218,403.82	0.10
431	600551	时代出版	961,259	19,186,729.64	0.10
432	603883	老百姓	381,700	18,985,758.00	0.10
433	600596	新安股份	2,602,593	18,972,902.97	0.10
434	000919	金陵药业	1,440,375	18,854,508.75	0.10
435	002698	博实股份	978,246	18,841,017.96	0.10
436	002342	巨力索具	3,236,668	18,772,674.40	0.10
437	600329	中新药业	1,080,156	18,654,294.12	0.10
438	600195	中牧股份	1,018,191	18,632,895.30	0.10
439	600280	中央商场	2,747,388	18,572,342.88	0.10
440	000703	恒逸石化	1,870,138	18,458,262.06	0.10
441	002293	罗莱生活	1,345,196	18,429,185.20	0.10
442	002408	齐翔腾达	3,339,652	18,334,689.48	0.10
443	600545	新疆城建	2,650,528	18,315,148.48	0.10
444	002181	粤传媒	2,217,300	18,204,033.00	0.10
445	000877	天山股份	2,925,490	18,079,528.20	0.10
446	601515	东风股份	1,592,858	17,999,295.40	0.10
447	600657	信达地产	3,610,642	17,980,997.16	0.10
448	600251	XD冠农股	2,243,316	17,946,528.00	0.10
449	002602	世纪华通	963,200	17,848,096.00	0.10
450	600864	哈投股份	1,584,004	17,788,364.92	0.10
451	603806	福斯特	338,800	17,681,972.00	0.10
452	002646	青青稞酒	855,792	17,637,873.12	0.10
453	603567	珍宝岛	805,850	17,607,822.50	0.10

454	002122	天马股份	2,808,928	17,471,532.16	0.10
455	600141	兴发集团	1,515,472	17,458,237.44	0.10
456	600132	XD 重庆啤酒	1,147,307	17,427,593.33	0.10
457	600640	号百控股	1,036,675	17,405,773.25	0.10
458	000693	ST 华泽	1,391,501	17,393,762.50	0.10
459	002327	富安娜	2,009,428	17,100,232.28	0.09
460	000030	富奥股份	2,383,171	17,087,336.07	0.09
461	601965	中国汽研	1,775,788	17,065,322.68	0.09
462	600425	青松建化	3,987,161	16,945,434.25	0.09
463	000631	顺发恒业	3,477,443	16,935,147.41	0.09
464	600184	光电股份	742,689	16,814,478.96	0.09
465	600776	东方通信	2,000,641	16,785,377.99	0.09
466	603005	晶方科技	436,318	16,523,362.66	0.09
467	600617	国新能源	1,412,941	16,192,303.86	0.09
468	600874	创业环保	2,075,883	16,129,610.91	0.09
469	600743	华远地产	3,404,658	16,104,032.34	0.09
470	600466	蓝光发展	1,852,900	15,860,824.00	0.09
471	603169	兰石重装	1,215,578	15,146,101.88	0.08
472	600088	中视传媒	638,297	15,140,404.84	0.08
473	600335	国机汽车	1,347,495	15,105,418.95	0.08
474	600483	福能股份	1,324,792	15,036,389.20	0.08
475	601226	华电重工	1,626,450	14,914,546.50	0.08
476	600397	安源煤业	3,341,947	14,771,405.74	0.08
477	603555	贵人鸟	587,077	14,635,829.61	0.08
478	002315	焦点科技	214,100	14,443,186.00	0.08
479	000517	荣安地产	2,965,100	14,351,084.00	0.08
480	600618	氯碱化工	1,077,752	14,150,883.76	0.08
481	600468	百利电气	999,597	14,144,297.55	0.08
482	002392	北京利尔	2,853,897	14,098,251.18	0.08
483	002233	塔牌集团	1,693,572	13,599,383.16	0.07
484	603001	奥康国际	633,437	13,466,870.62	0.07
485	603698	航天工程	489,700	13,437,368.00	0.07
486	600801	华新水泥	2,107,656	13,299,309.36	0.07
487	002216	三全食品	1,534,624	13,197,766.40	0.07
488	600971	恒源煤电	2,388,380	13,183,857.60	0.07
489	002194	武汉凡谷	1,026,223	13,115,129.94	0.07
490	600510	黑牡丹	1,497,957	13,062,185.04	0.07
491	002249	大洋电机	1,048,158	12,546,451.26	0.07
492	600507	方大特钢	2,513,434	12,064,483.20	0.07



493	002238	天威视讯	808,570	11,700,007.90	0.06
494	002461	珠江啤酒	983,894	11,432,848.28	0.06
495	002678	珠江钢琴	908,730	11,150,117.10	0.06
496	603589	口子窖	293,900	10,642,119.00	0.06
497	600751	天海投资	1,697,907	10,374,211.77	0.06
498	002745	木林森	283,956	9,651,664.44	0.05
499	603198	迎驾贡酒	376,200	8,994,942.00	0.05
500	600917	重庆燃气	879,700	8,753,015.00	0.05
501	603568	伟明环保	365,517	8,443,442.70	0.05
502	000582	北部湾港	507,606	8,284,129.92	0.05
503	603355	莱克电气	216,160	8,235,696.00	0.05
504	603025	大豪科技	242,952	8,155,898.64	0.04
505	600623	华谊集团	353,300	6,998,873.00	0.04
506	601388	怡球资源	25,568	548,944.96	0.00
507	002320	海峡股份	16,700	260,019.00	0.00

### 7.3.2 期末积极投资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	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.00
2	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.00
3	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.00
4	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.00
5	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.00
6	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
7	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
8	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
9	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
10	603959	百利科技	1,115	46,216.75	0.00
11	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
12	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
13	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
14	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
15	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
16	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	000748	长城信息	89,612,464.58	0.44
2	300113	顺网科技	85,346,728.79	0.42
3	002466	天齐锂业	83,907,898.30	0.41
4	600978	宜华生活	70,604,546.12	0.34
5	002426	胜利精密	70,449,832.53	0.34
6	002572	索菲亚	68,689,921.35	0.34
7	002131	利欧股份	62,975,882.27	0.31
8	600682	南京新百	62,747,608.02	0.31
9	600166	福田汽车	60,638,576.60	0.30
10	002038	双鹭药业	59,928,009.48	0.29
11	000661	长春高新	59,335,272.34	0.29
12	000983	西山煤电	58,869,332.03	0.29
13	002310	东方园林	57,930,752.95	0.28
14	002174	游族网络	57,697,056.12	0.28
15	002508	老板电器	57,163,105.67	0.28
16	002085	万丰奥威	54,296,212.56	0.27
17	002004	华邦健康	53,297,768.37	0.26
18	300072	三聚环保	53,074,400.63	0.26
19	600266	北京城建	52,599,444.25	0.26
20	300253	卫宁健康	52,546,514.43	0.26

### 7.4.2 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	002466	天齐锂业	89,331,342.01	0.44
2	002174	游族网络	82,774,935.52	0.40
3	300085	银之杰	81,823,322.91	0.40
4	600816	安信信托	77,943,579.46	0.38
5	300267	尔康制药	73,084,593.52	0.36

6	300122	智飞生物	71,861,416.41	0.35
7	600074	保千里	67,914,157.93	0.33
8	000732	泰禾集团	65,045,579.46	0.32
9	600376	首开股份	62,526,740.48	0.31
10	000887	中鼎股份	60,387,632.88	0.29
11	002508	老板电器	58,335,567.41	0.28
12	000998	隆平高科	56,728,065.77	0.28
13	002568	百润股份	56,101,175.69	0.27
14	002085	万丰奥威	54,733,396.52	0.27
15	002444	巨星科技	53,918,995.57	0.26
16	000650	仁和药业	53,808,537.40	0.26
17	000012	南玻 A	53,785,666.47	0.26
18	002143	印纪传媒	53,507,472.66	0.26
19	000661	长春高新	52,914,040.26	0.26
20	300072	三聚环保	52,851,526.50	0.26

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。

### 7.4.3 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	9,486,989,337.91
卖出股票收入（成交）总额	8,720,553,649.62

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。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,632,500.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,632,500.00	0.01

## 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127003	海印转债	26,325	2,632,500.00	0.01

## 7.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1607	IC1607	556	672,026,080.00	23,736,273.56	-
公允价值变动总额合计（元）					23,736,273.56
股指期货投资本期收益（元）					-3,662,593.56
股指期货投资本期公允价值变动（元）					24,355,473.56

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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	139,684,568.18
2	应收证券清算款	866,383.52
3	应收股利	9,601.50
4	应收利息	259,960.18
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	140,820,513.38

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000718	苏宁环球	74,330,727.24	0.41	重大事项

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	-------	----------

				净值比例 (%)	
1	601611	中国核建	775,274.28	0.00	股票价格异常波动
2	601966	玲珑轮胎	199,126.18	0.00	新股未上市

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 本基金的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
10,841	263,874.85	2,785,453,562.00	97.37%	75,213,682.00	2.63%

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
中国农业银行—南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	635,073,402.00	22.20%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国农业银行—南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

### 8.2 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	中央汇金投资有限责任公司	1,728,426,785.00	60.42%
2	中国农业银行股份有限公司—南方中证500指数证券投资基金(LOF)	635,073,402.00	22.20%
3	中国人寿保险股份有限公司	257,592,520.00	9.00%
4	恒大人寿保险有限公司—万能组合B	22,205,500.00	0.78%
5	光大证券股份有限公司	13,126,700.00	0.46%
6	台湾银行股份有限公司—自有资金	7,886,200.00	0.28%

7	华夏人寿保险股份有限公司—自有资金	7,149,390.00	0.25%
8	幸福人寿保险股份有限公司—中信证券—幸福人寿—邮储银行定向资产管理计划	6,051,400.00	0.21%
9	中国平安人寿保险股份有限公司—传统—银保账户	5,309,646.00	0.19%
10	台湾银行股份有限公司—自有资金	5,100,000.00	0.18%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额，本基金基金经理未持有本基金份额。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年2月6日）基金份额总额	1,147,553,216.00
本报告期期初基金份额总额	2,607,467,244.00
本报告期基金总申购份额	2,088,400,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,835,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	2,860,667,244.00

## §10 重大事件揭示

### 10.1 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。

## 10.2 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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

## 10.3 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。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

## 10.6 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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
华泰证券	2	11,421,856,394.09	62.77%	1,142,377.29	62.77%	-
银河证券	2	3,616,506,111.94	19.87%	361,678.71	19.87%	-
申万宏源	2	3,159,675,345.25	17.36%	315,971.93	17.36%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-



注：交易单元的选择标准和程序

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

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、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；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、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席位：

- 1、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；
- 2、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；
- 3、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。

### 10.7.2 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
华泰证券	19,347,006.30	100.00%	110,000,000.00	35.48%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	200,000,000.00	64.52%	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

东兴证券	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-

## 10.8 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 500ETF、理财金 H 增加相关券商为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 5 月 27 日
2	南方基金关于旗下 500ETF 增加华西证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 5 月 11 日
3	南方基金关于旗下 500ETF、理财金 H 增加相关券商为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 29 日
4	南方基金关于旗下 500ETF 增加相关券商为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 19 日
5	关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 12 日
6	南方基金关于临时暂停电子直销实时赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 4 日
7	南方基金管理有限公司电子交易赎回转认/申购业务规则	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 27 日
8	南方基金关于电子直销平台通过货币基金定投其他基金费率为 0 的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 15 日
9	南方基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 7 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 7 日
10	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 5 日
11	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 4 日
12	南方基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 4 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 4 日

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的文件。
- 2、中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同。
- 3、中证 500 交易型开放式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。

### 11.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

### 11.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>