

南方中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 (LOF) 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

§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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
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.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	33
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.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
7.7 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.....	45
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	45
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.....	45
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	45
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46

7.13 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	48
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	50
§11 备查文件目录.....	52
11.1 备查文件目录.....	52
11.2 存放地点.....	52
11.3 查阅方式.....	52

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)
基金简称	南方中证 500ETF 联接(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	2,869,345,269.20 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”。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
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
基金管理人名称	南方基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“500ETF”

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、非成份股、新股、权证、债券资产、资产支持证券、固定收益类资产、现金资产、货币市场工具、衍生工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。

	在正常市场情况下，本基金力争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×95%+银行活期存款利率（税后）×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。

2.2.1 目标基金产品说明

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 31-33 层	北京东城区建国门内大街 69 号
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	http://www.nffund.com
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	22,717,357.16
本期利润	-985,150,421.84
加权平均基金份额本期利润	-0.2985
本期加权平均净值利润率	-20.77%
本期基金份额净值增长率	-17.30%
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	1,414,733,486.22
期末可供分配基金份额利润	0.4931
期末基金资产净值	4,284,078,755.42
期末基金份额净值	1.4931
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	62.91%

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。

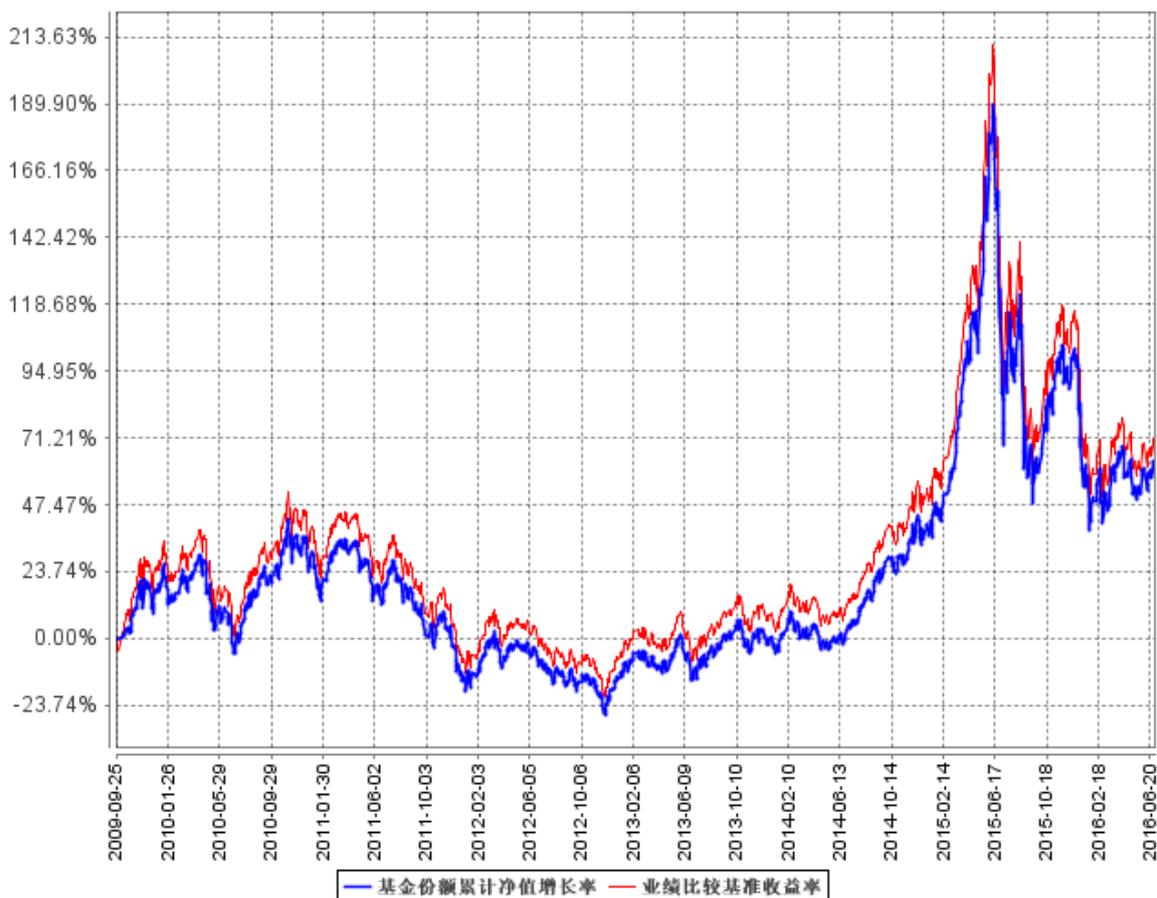
3.2 基金净值表现

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	3.27%	1.47%	2.82%	1.47%	0.45%	0.00%
过去三个月	0.59%	1.58%	-0.46%	1.57%	1.05%	0.01%
过去六个月	-17.30%	2.45%	-18.57%	2.43%	1.27%	0.02%
过去一年	-27.38%	2.78%	-29.57%	2.77%	2.19%	0.01%
过去三年	90.03%	2.04%	84.89%	2.03%	5.14%	0.01%
自基金合同生效起至今	62.91%	1.78%	71.04%	1.78%	-8.13%	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，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理，现任数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，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别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》等有关法律法规、中国证监会和《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)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，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 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，两两组合同单日、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”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本基金大额换购目标 ETF 所带来的成份股权重偏离，对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行应对；

③报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）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；

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 0.681%，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。

截至报告期末，本基金份额净值为 1.4931 元，报告期内，份额净值增长率为-17.30%，同期业绩基准增长率为-18.57%。

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、数量化投资部总监、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：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。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期末有收益分配事项。

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：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

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
资产：			
银行存款	6.4.4.1	233,166,258.45	312,791,396.95
结算备付金		2,579,272.44	5,734,853.96
存出保证金		938,926.84	2,001,495.02
交易性金融资产	6.4.4.2	4,083,593,199.70	5,408,919,840.57
其中：股票投资		17,212,606.69	104,562,309.34
基金投资		4,066,374,993.01	5,304,357,531.23
债券投资		5,600.00	-
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		550.90	534,124.80
应收利息	6.4.45	38,133.22	60,591.71
应收股利		1,691.14	1,691.14
应收申购款		3,226,466.70	20,143,076.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	1,494,569.22	9,310,637.34
资产总计		4,325,039,068.61	5,759,497,708.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
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		-	30,657,468.08
应付赎回款		39,871,541.48	24,812,569.23
应付管理人报酬		110,646.46	184,258.05
应付托管费		22,129.29	36,851.62
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.4.7	556,544.36	2,067,139.53
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	399,451.60	194,565.54
负债合计		40,960,313.19	57,952,852.05
所有者权益:			
实收基金	6.4.4.9	2,869,345,269.20	3,157,946,424.77
未分配利润	6.4.4.10	1,414,733,486.22	2,543,598,431.42
所有者权益合计		4,284,078,755.42	5,701,544,856.19
负债和所有者权益总计		4,325,039,068.61	5,759,497,708.24

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4931 元，基金份额总额

2,869,345,269.20 份。

6.2 利润表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

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
一、收入		-981,017,040.08	2,325,917,756.63
1.利息收入		1,091,837.01	805,084.47
其中：存款利息收入	6.4.4.11	1,091,827.94	805,084.47
债券利息收入		9.07	-
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）		21,901,882.90	1,262,458,830.82
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-29,556,605.45	80,619,439.75
基金投资收益	6.4.4.13	51,215,826.60	1,181,490,128.92
债券投资收益	6.4.4.14	10,444.74	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.4.15	-	-
股利收益	6.4.4.16	232,217.01	349,262.15
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.17	-1,007,867,779.00	1,058,034,129.66
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	3,857,019.01	4,619,711.68

减：二、费用		4,133,381.76	4,628,537.12
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	904,293.48	715,505.85
2. 托管费	6.4.7.2.2	180,858.69	143,101.18
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.4.19	2,792,978.97	3,518,589.43
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.4.20	255,250.62	251,340.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-985,150,421.84	2,321,289,219.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-985,150,421.84	2,321,289,219.51

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

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）	3,157,946,424.77	2,543,598,431.42	5,701,544,856.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-985,150,421.84	-985,150,421.84
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）	-288,601,155.57	-143,714,523.36	-432,315,678.93
其中：1. 基金申购款	1,905,817,932.95	826,121,958.29	2,731,939,891.24
2. 基金赎回款	-2,194,419,088.52	-969,836,481.65	-3,164,255,570.17
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）	2,869,345,269.20	1,414,733,486.22	4,284,078,755.42

6.4.2.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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	233,166,258.45
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	233,166,258.45

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	15,399,226.41	17,212,606.69	1,813,380.28
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,600.00	-
	银行间市场	-	-
	合计	5,600.00	-
资产支持证券	-	-	-
基金	3,788,010,032.29	4,066,374,993.01	278,364,960.72
其他	-	-	-
合计	3,803,414,858.70	4,083,593,199.70	280,178,341.00

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.4.4 买入返售金融资产

6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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	36,707.02
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	1,044.54
应收债券利息	1.41
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	380.25
合计	38,133.22

6.4.4.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	-
应收目标ETF可退替代款	1,494,569.22
应收目标ETF应退替代款	-
合计	1,494,569.22

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	556,544.36
银行间市场应付交易费用	-
合计	556,544.36

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	158,277.94
预提费用	241,173.66
合计	399,451.60

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	3,157,946,424.77	3,157,946,424.77
本期申购	1,905,817,932.95	1,905,817,932.95
本期赎回(以“-”号填列)	-2,194,419,088.52	-2,194,419,088.52
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	2,869,345,269.20	2,869,345,269.20

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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	2,501,740,805.17	41,857,626.25	2,543,598,431.42
本期利润	22,717,357.16	-1,007,867,779.00	-985,150,421.84
本期基金份额交易产生的变动数	-229,610,088.67	85,895,565.31	-143,714,523.36
其中：基金申购款	1,503,110,692.53	-676,988,734.24	826,121,958.29
基金赎回款	-1,732,720,781.20	762,884,299.55	-969,836,481.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,294,848,073.66	-880,114,587.44	1,414,733,486.22

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
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	18,436.29
其他	65,758.80
合计	1,091,827.94

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

股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-19,587,187.99
合计	-29,556,605.45

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	1,189,838,923.63
减：卖出股票成本总额	1,199,808,341.09
买卖股票差价收入	-9,969,417.46

6.4.4.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
申购基金份额总额	940,927,760.00
减：现金支付申购款总额	521,752,156.79
减：申购股票成本总额	438,762,791.20
申购差价收入	-19,587,187.99

6.4.4.13 基金投资收益

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/赎回基金成交总额	1,221,434,204.17
减：卖出/赎回基金成本总额	1,170,218,377.57
基金投资收益	51,215,826.60

6.4.4.14 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	92,452.40
减：卖出债券、债转股及债券到期兑付成本总额	82,000.00
减：应收利息总额	7.66
买卖债券差价收入	10,444.74

6.4.4.15 衍生工具收益

无。

6.4.4.16 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	232,217.01
基金投资产生的股利收益	-
合计	232,217.01

6.4.4.17 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	-1,007,867,779.00
——股票投资	3,235,904.40
——债券投资	-
——基金投资	-1,011,103,683.40
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,007,867,779.00

6.4.4.18 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
基金赎回费收入	3,857,019.01
其他	-
替代损益	-
合计	3,857,019.01

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。

6.4.4.19 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	2,792,978.97
银行间市场交易费用	-
合计	2,792,978.97

6.4.4.20 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	62,158.46
信息披露费	149,179.94
上市费	29,835.26
银行汇划费	13,976.96
账户维护费	100.00
指数使用费	-
合计	255,250.62

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

无。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

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、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(“目标 ETF”)	本基金的基金管理人管理的其他基金
-----------------------------------	------------------

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	641,932,659.26	29.55%	654,831,191.18	30.00%

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	64,199.72	4.69%	32,306.27	5.80%
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	383,800.52	21.62%	272,738.40	19.97%

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	904,293.48	715,505.85
其中：支付销售机构的客户维护费	1,969,196.01	2,885,870.63

注：本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付基金管理人南方基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.5% 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 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 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 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
当期发生的基金应支付的托管费	180,858.69	143,101.18

注：本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.1% 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 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 0.1% / 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

本基金本报告期内无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

份额单位：份

项目	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
基金合同生效日（2009 年 9 月 25 日）持有的基金份额	-	-

期初持有的基金份额	52,873,972.73	38,304,604.00
期间申购/买入总份额	-	14,869,173.42
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	52,873,972.73	53,173,777.42
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.8400%	2.4600%

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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		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	
	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	233,166,258.45	1,007,632.85	134,998,291.30	785,557.10

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

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 635,073,402.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 22.20%。

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	2016年	2016	新股流	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-

	泰	6月 23日	2016年 7月 1日	通受限						
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 29日	2016 年7月 7日	新股流 通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

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	56	5,600.00	5,600.00	-

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
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	78,100	1,471,756.47	1,447,974.00	-
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	223,000	1,360,283.11	1,322,390.00	-
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	40,242	1,134,292.44	1,103,435.64	-
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	-
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	44,000	738,431.70	738,760.00	-
600614	鼎立股份	2016年 4月 26日	重大资 产重组	8.14	-	-	50,200	404,852.00	408,628.00	-
000718	苏宁环球	2016年 1月4日	重大事 项	13.09	2016年 7月	11.78	29,340	387,855.16	384,060.60	-

					18 日						
601005	重庆钢铁	2016 年 6 月 2 日	重大资 产重组	2.52	-	-	114,731	290,268.92	289,122.12	-	
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	36,100	223,890.71	220,571.00	-	
000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大事 项	12.50	-	-	16,900	250,450.70	211,250.00	-	
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	5,600	105,289.00	113,568.00	-	
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	14,400	112,838.00	109,152.00	-	
000511	*ST 烯碳	2016 年 4 月 26 日	重大事 项	8.92	-	-	12,000	105,240.00	107,040.00	-	
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	7,000	113,872.00	104,580.00	-	
000582	北部湾港	2016 年 2 月 29 日	重大资 产重组	16.32	-	-	5,300	91,526.63	86,496.00	-	
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	4,300	71,492.00	86,430.00	-	
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	10,700	56,496.00	59,064.00	-	
002663	普邦园林	2016 年 4 月 28 日	重大事 项	7.36	-	-	7,100	47,357.00	52,256.00	-	
600773	西藏城投	2016 年 6 月 30 日	重大资 产重组	15.67	-	-	2,000	30,280.00	31,340.00	-	
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	2,100	22,680.00	25,137.00	-	
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	97	934.40	967.09	-	
000401	冀东水泥	2016 年 4 月 6 日	重大事 项	10.90	2016 年 7 月 14 日	11.32	60	582.56	654.00	-	

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

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金
与货币市场基金。本基金为被动式指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和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
基金投资的金融工具主要包括基金投资和股票投资。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“紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”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，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 0.0001%。

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。本基金所持目标 ETF 份额能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出，所持股票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，以合理价格适时变现。

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

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。

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	233,166,258.45	-	-	-	233,166,258.45
结算备付金	2,579,272.44	-	-	-	2,579,272.44
存出保证金	938,926.84	-	-	-	938,926.84
交易性金融资产	5,600.00	-	-	4,083,587,599.70	4,083,593,199.70
应收证券清算款	-	-	-	550.90	550.90
应收利息	-	-	-	38,133.22	38,133.22
应收股利	-	-	-	1,691.14	1,691.14
应收申购款	1,287,431.76	-	-	1,939,034.94	3,226,466.70
其他资产	-	-	-	1,494,569.22	1,494,569.22
资产总计	237,977,489.49	-	-	4,087,061,579.12	4,325,039,068.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	39,871,541.48	39,871,541.48
应付管理人报酬	-	-	-	110,646.46	110,646.46
应付托管费	-	-	-	22,129.29	22,129.29

应付交易费用	-	-	-	556,544.36	556,544.36
其他负债	-	-	-	399,451.60	399,451.60
负债总计	-	-	-	40,960,313.19	40,960,313.19
利率敏感度缺口	237,977,489.49	-	-	-4,046,101,265.93	4,284,078,755.42
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	312,791,396.95	-	-	-	312,791,396.95
结算备付金	5,734,853.96	-	-	-	5,734,853.96
存出保证金	2,001,495.02	-	-	-	2,001,495.02
交易性金融资产	-	-	-	-5,408,919,840.57	5,408,919,840.57
应收证券清算款	-	-	-	534,124.80	534,124.80
应收利息	-	-	-	60,591.71	60,591.71
应收股利	-	-	-	1,691.14	1,691.14
应收申购款	18,663,416.49	-	-	1,479,660.26	20,143,076.75
其他资产	-	-	-	9,310,637.34	9,310,637.34
资产总计	339,191,162.42	-	-	-5,420,306,545.82	5,759,497,708.24
负债					
应付证券清算款	-	-	-	30,657,468.08	30,657,468.08
应付赎回款	-	-	-	24,812,569.23	24,812,569.23
应付管理人报酬	-	-	-	184,258.05	184,258.05
应付托管费	-	-	-	36,851.62	36,851.62
应付交易费用	-	-	-	2,067,139.53	2,067,139.53
其他负债	-	-	-	194,565.54	194,565.54
负债总计	-	-	-	57,952,852.05	57,952,852.05
利率敏感度缺口	339,191,162.42	-	-	-5,362,353,693.77	5,701,544,856.19

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。

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 0.0001%，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。本基金主要投资于能通过股票组合赎回或二级市场交

易卖出的目标 ETF 份额以及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。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。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	17,212,606.69	0.40	104,562,309.34	1.83
交易性金融资产-基金投资	4,066,374,993.01	94.92	5,304,357,531.23	93.03
交易性金融资产-债券投资	5,600.00	0.00	-	-
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	4,083,593,199.70	95.32	5,408,919,840.57	94.86

注：交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标 ETF 份额。

6.4.10.4.3.2 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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	1. 中证 500 指数上升 5%		增加 20,505.00
2. 中证 500 指数下降 5%		减少 20,505.00	减少 27,203.00

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	17,212,606.69	0.40
	其中：股票	17,212,606.69	0.40
2	基金投资	4,066,374,993.01	94.02
3	固定收益投资	5,600.00	0.00
	其中：债券	5,600.00	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	235,745,530.89	5.45
8	其他各项资产	5,700,338.02	0.13
9	合计	4,325,039,068.61	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 报告期末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	36,057.12	0.00
B	采矿业	1,850,387.33	0.04
C	制造业	7,102,011.72	0.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	202,178.93	0.00
E	建筑业	974,376.76	0.02
F	批发和零售业	2,088,256.78	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	688,611.40	0.02
H	住宿和餐饮业	30,114.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,825,351.85	0.04

J	金融业	51,781.00	0.00
K	房地产业	1,059,444.29	0.02
L	租赁和商务服务业	810,148.08	0.02
M	科学研究和技术服务业	103,055.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	32,181.36	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,539.46	0.00
R	文化、体育和娱乐业	168,495.15	0.00
S	综合	187,616.36	0.00
	合计	17,212,606.69	0.40

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

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	600654	中安消	78,100	1,447,974.00	0.03
2	601168	西部矿业	223,000	1,322,390.00	0.03
3	600511	国药股份	40,242	1,103,435.64	0.03
4	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.02
5	600640	号百控股	44,000	738,760.00	0.02
6	600120	浙江东方	22,200	481,962.00	0.01
7	600614	鼎立股份	50,200	408,628.00	0.01
8	000718	苏宁环球	29,340	384,060.60	0.01
9	601005	重庆钢铁	114,731	289,122.12	0.01
10	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
11	600751	天海投资	36,100	220,571.00	0.01
12	000693	ST 华泽	16,900	211,250.00	0.00
13	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.00
14	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.00
15	600219	南山铝业	25,200	186,480.00	0.00
16	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.00
17	600435	北方导航	9,400	125,114.00	0.00
18	002512	达华智能	5,600	113,568.00	0.00
19	600759	洲际油气	14,400	109,152.00	0.00
20	000511	*ST 烯碳	12,000	107,040.00	0.00

21	002373	千方科技	7,000	104,580.00	0.00
22	000021	深科技	9,300	102,393.00	0.00
23	600584	长电科技	4,800	97,392.00	0.00
24	000582	北部湾港	5,300	86,496.00	0.00
25	300032	金龙机电	4,300	86,430.00	0.00
26	600522	DR 中天科	8,500	83,300.00	0.00
27	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
28	600201	生物股份	2,650	72,424.50	0.00
29	600521	华海药业	2,858	69,506.56	0.00
30	600079	人福医药	4,112	68,958.24	0.00
31	600503	华丽家族	7,400	67,858.00	0.00
32	600525	长园集团	4,833	66,937.05	0.00
33	600682	南京新百	2,300	65,481.00	0.00
34	601012	隆基股份	4,900	63,945.00	0.00
35	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
36	600436	片仔癀	1,400	63,014.00	0.00
37	600699	均胜电子	1,600	61,280.00	0.00
38	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
39	600978	宜华生活	5,400	60,156.00	0.00
40	600879	航天电子	3,800	59,204.00	0.00
41	600166	福田汽车	10,700	59,064.00	0.00
42	600482	中国动力	1,800	58,986.00	0.00
43	600498	烽火通信	2,380	57,786.40	0.00
44	000748	长城信息	2,932	57,525.84	0.00
45	600664	哈药股份	6,921	57,375.09	0.00
46	603019	中科曙光	1,400	55,748.00	0.00
47	600158	中体产业	3,100	55,025.00	0.00
48	600635	大众公用	9,100	54,873.00	0.00
49	600478	科力远	4,500	54,315.00	0.00
50	600266	北京城建	4,300	53,707.00	0.00
51	600143	金发科技	8,200	52,808.00	0.00
52	600645	中源协和	1,500	52,710.00	0.00
53	002663	普邦园林	7,100	52,256.00	0.00
54	600643	爱建集团	5,300	51,781.00	0.00
55	600138	中青旅	2,639	50,985.48	0.00
56	600418	江淮汽车	4,000	50,720.00	0.00
57	600487	亨通光电	4,000	50,320.00	0.00
58	600388	龙净环保	4,000	50,240.00	0.00
59	600655	豫园商城	4,600	49,864.00	0.00

60	600673	东阳光科	7,900	49,375.00	0.00
61	600312	平高电气	3,100	48,546.00	0.00
62	600200	江苏吴中	2,500	48,425.00	0.00
63	600198	大唐电信	2,400	47,712.00	0.00
64	600094	大名城	5,000	47,500.00	0.00
65	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
66	600594	益佰制药	2,900	46,342.00	0.00
67	600151	航天机电	4,100	46,330.00	0.00
68	600240	华业资本	4,572	45,811.44	0.00
69	600410	华胜天成	4,080	45,777.60	0.00
70	600851	海欣股份	3,400	45,254.00	0.00
71	600770	综艺股份	3,600	44,856.00	0.00
72	600160	巨化股份	4,200	44,646.00	0.00
73	600499	科达洁能	2,600	43,966.00	0.00
74	600687	刚泰控股	2,700	43,902.00	0.00
75	600516	方大炭素	4,800	43,872.00	0.00
76	600601	方正科技	10,100	43,430.00	0.00
77	600171	上海贝岭	2,500	43,425.00	0.00
78	600500	中化国际	4,800	43,392.00	0.00
79	600811	东方集团	6,512	43,369.92	0.00
80	600884	杉杉股份	2,500	43,025.00	0.00
81	600366	宁波韵升	1,800	42,966.00	0.00
82	600392	盛和资源	2,600	42,588.00	0.00
83	600176	中国巨石	4,426	42,356.82	0.00
84	600755	厦门国贸	5,300	42,135.00	0.00
85	600565	迪马股份	6,500	41,990.00	0.00
86	600633	浙报传媒	2,700	40,608.00	0.00
87	600651	飞乐音响	3,200	40,512.00	0.00
88	601929	吉视传媒	10,000	40,300.00	0.00
89	600259	广晟有色	700	40,082.00	0.00
90	600881	亚泰集团	8,300	40,006.00	0.00
91	601311	骆驼股份	2,000	39,700.00	0.00
92	600216	浙江医药	3,000	39,570.00	0.00
93	000066	长城电脑	3,100	39,525.00	0.00
94	600528	中铁二局	3,400	39,474.00	0.00
95	600316	洪都航空	2,000	39,020.00	0.00
96	600611	大众交通	5,700	38,817.00	0.00
97	601155	新城控股	4,100	37,966.00	0.00
98	600787	中储股份	5,100	37,893.00	0.00

99	600572	康恩贝	5,800	37,584.00	0.00
100	600058	五矿发展	2,000	37,540.00	0.00
101	603766	隆鑫通用	1,850	37,407.00	0.00
102	600026	中海发展	6,300	37,170.00	0.00
103	601880	大连港	6,200	36,642.00	0.00
104	600056	中国医药	2,273	36,049.78	0.00
105	600260	凯乐科技	2,200	35,992.00	0.00
106	601699	潞安环能	5,500	35,970.00	0.00
107	600064	南京高科	2,400	35,880.00	0.00
108	600108	亚盛集团	7,100	35,855.00	0.00
109	600597	光明乳业	2,821	35,770.28	0.00
110	600426	华鲁恒升	4,050	35,680.50	0.00
111	600422	昆药集团	2,584	35,245.76	0.00
112	600325	华发股份	3,171	35,102.97	0.00
113	600348	阳泉煤业	5,500	35,035.00	0.00
114	601777	力帆股份	2,962	34,862.74	0.00
115	600067	冠城大通	4,800	34,608.00	0.00
116	600017	日照港	8,500	34,425.00	0.00
117	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
118	600073	上海梅林	3,000	34,350.00	0.00
119	600298	安琪酵母	1,900	33,896.00	0.00
120	600717	天津港	3,900	33,891.00	0.00
121	600580	卧龙电气	3,000	33,630.00	0.00
122	600808	马钢股份	13,801	33,260.41	0.00
123	600380	健康元	3,600	33,048.00	0.00
124	600557	康缘药业	2,020	32,986.60	0.00
125	600039	四川路桥	8,340	32,859.60	0.00
126	600006	XD 东风汽	3,700	32,819.00	0.00
127	600320	振华重工	7,614	32,359.50	0.00
128	600872	中炬高新	2,600	32,084.00	0.00
129	600765	中航重机	2,200	32,076.00	0.00
130	600967	北方创业	3,000	31,890.00	0.00
131	600267	海正药业	2,600	31,590.00	0.00
132	600773	西藏城投	2,000	31,340.00	0.00
133	600062	华润双鹤	1,700	30,974.00	0.00
134	600970	中材国际	4,900	30,870.00	0.00
135	600694	大商股份	800	30,816.00	0.00
136	601010	XD 文峰股	5,900	30,621.00	0.00
137	600183	生益科技	3,300	30,591.00	0.00

138	600161	天坛生物	1,100	30,569.00	0.00
139	600175	美都能源	6,500	30,550.00	0.00
140	000519	江南红箭	2,400	30,504.00	0.00
141	600169	太原重工	7,800	30,420.00	0.00
142	600433	冠豪高新	3,500	30,240.00	0.00
143	600736	苏州高新	3,300	30,129.00	0.00
144	600754	锦江股份	900	30,114.00	0.00
145	600587	新华医疗	1,300	30,017.00	0.00
146	600086	东方金钰	3,100	30,008.00	0.00
147	600639	浦东金桥	1,200	29,976.00	0.00
148	600416	湘电股份	2,400	29,928.00	0.00
149	600536	中国软件	1,200	29,904.00	0.00
150	600187	国中水务	6,700	29,882.00	0.00
151	600869	智慧能源	2,900	29,870.00	0.00
152	600880	博瑞传播	3,500	29,785.00	0.00
153	600270	外运发展	1,700	29,733.00	0.00
154	600220	江苏阳光	6,500	29,640.00	0.00
155	600517	置信电气	3,100	29,481.00	0.00
156	600537	亿晶光电	3,800	29,298.00	0.00
157	600993	马应龙	1,395	29,057.85	0.00
158	601000	唐山港	7,480	29,022.40	0.00
159	600575	皖江物流	6,700	29,011.00	0.00
160	600409	三友化工	4,300	28,982.00	0.00
161	600835	上海机电	1,500	28,785.00	0.00
162	600277	亿利洁能	4,800	28,560.00	0.00
163	600458	时代新材	1,800	28,044.00	0.00
164	600289	亿阳信通	2,000	27,980.00	0.00
165	600805	悦达投资	3,202	27,793.36	0.00
166	600460	士兰微	3,500	27,755.00	0.00
167	600563	法拉电子	600	27,312.00	0.00
168	600729	重庆百货	1,100	27,280.00	0.00
169	603188	亚邦股份	1,500	26,940.00	0.00
170	600284	浦东建设	2,573	26,862.12	0.00
171	600125	铁龙物流	4,200	26,754.00	0.00
172	600894	广日股份	2,000	26,660.00	0.00
173	600809	山西汾酒	1,200	26,616.00	0.00
174	600826	兰生股份	1,000	26,180.00	0.00
175	600850	华东电脑	910	26,107.90	0.00
176	600004	白云机场	2,100	25,746.00	0.00

177	600351	亚宝药业	2,564	25,716.92	0.00
178	600112	天成控股	2,300	25,668.00	0.00
179	601717	郑煤机	4,500	25,650.00	0.00
180	600395	盘江股份	3,100	25,606.00	0.00
181	600859	王府井	1,680	25,603.20	0.00
182	600823	世茂股份	3,748	25,448.92	0.00
183	600750	江中药业	800	25,440.00	0.00
184	002249	大洋电机	2,100	25,137.00	0.00
185	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
186	600496	精工钢构	5,560	23,685.60	0.00
187	600059	古越龙山	2,300	23,667.00	0.00
188	600757	长江传媒	2,800	23,492.00	0.00
189	600831	广电网络	1,800	23,328.00	0.00
190	600300	维维股份	3,900	23,166.00	0.00
191	600812	华北制药	3,700	22,977.00	0.00
192	600236	桂冠电力	3,400	22,848.00	0.00
193	600292	远达环保	1,800	22,806.00	0.00
194	603077	和邦生物	4,600	22,632.00	0.00
195	600628	新世界	1,913	22,573.40	0.00
196	600428	中远航运	4,000	22,440.00	0.00
197	601666	平煤股份	5,400	22,086.00	0.00
198	601886	江河集团	2,100	21,567.00	0.00
199	600282	南钢股份	9,100	21,385.00	0.00
200	600509	天富能源	2,900	21,315.00	0.00
201	600481	双良节能	3,700	21,201.00	0.00
202	600180	瑞茂通	1,400	21,154.00	0.00
203	601001	大同煤业	3,900	20,943.00	0.00
204	600053	九鼎投资	600	20,778.00	0.00
205	601908	京运通	2,700	20,709.00	0.00
206	603328	依顿电子	700	20,678.00	0.00
207	600586	金晶科技	4,700	20,210.00	0.00
208	600761	安徽合力	2,000	20,180.00	0.00
209	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
210	600456	宝钛股份	1,000	20,120.00	0.00
211	601126	四方股份	1,900	20,007.00	0.00
212	600551	时代出版	1,000	19,960.00	0.00
213	600790	轻纺城	3,400	19,958.00	0.00
214	600720	祁连山	2,900	19,459.00	0.00
215	600825	新华传媒	2,437	19,374.15	0.00

216	601678	滨化股份	3,800	19,342.00	0.00
217	600748	上实发展	2,000	19,280.00	0.00
218	601369	陕鼓动力	3,000	19,140.00	0.00
218	601002	晋亿实业	2,200	19,140.00	0.00
219	601801	皖新传媒	1,600	18,672.00	0.00
220	601233	桐昆股份	1,700	18,462.00	0.00
221	600776	东方通信	2,200	18,458.00	0.00
222	600195	中牧股份	1,000	18,300.00	0.00
223	600280	中央商场	2,700	18,252.00	0.00
224	600596	新安股份	2,500	18,225.00	0.00
225	603699	纽威股份	1,000	17,740.00	0.00
226	603169	兰石重装	1,400	17,444.00	0.00
227	600657	信达地产	3,500	17,430.00	0.00
228	600141	兴发集团	1,500	17,280.00	0.00
229	600329	中新药业	1,000	17,270.00	0.00
230	600466	蓝光发展	2,000	17,120.00	0.00
231	601515	东风股份	1,494	16,882.20	0.00
232	600864	哈投股份	1,500	16,845.00	0.00
233	600251	XD 冠农股	2,100	16,800.00	0.00
234	600132	XD 重庆啤	1,100	16,709.00	0.00
235	600088	中视传媒	700	16,604.00	0.00
236	603698	航天工程	600	16,464.00	0.00
237	601965	中国汽研	1,700	16,337.00	0.00
238	600425	青松建化	3,800	16,150.00	0.00
239	600483	福能股份	1,400	15,890.00	0.00
240	600184	光电股份	700	15,848.00	0.00
241	603806	福斯特	300	15,657.00	0.00
242	600743	华远地产	3,300	15,609.00	0.00
243	600874	创业环保	1,969	15,299.13	0.00
244	603567	珍宝岛	700	15,295.00	0.00
245	603005	晶方科技	400	15,148.00	0.00
246	603555	贵人鸟	600	14,958.00	0.00
247	603883	老百姓	300	14,922.00	0.00
248	600617	国新能源	1,300	14,898.00	0.00
249	603001	奥康国际	700	14,882.00	0.00
250	600335	国机汽车	1,313	14,718.73	0.00
251	600801	华新水泥	2,300	14,513.00	0.00
252	600468	百利电气	1,000	14,150.00	0.00
253	600397	安源煤业	3,200	14,144.00	0.00

254	601226	华电重工	1,500	13,755.00	0.00
255	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
256	600618	氯碱化工	1,000	13,130.00	0.00
257	600971	恒源煤电	2,312	12,762.24	0.00
258	600510	黑牡丹	1,408	12,277.76	0.00
259	600507	方大特钢	2,400	11,520.00	0.00
260	603355	莱克电气	300	11,430.00	0.00
261	603589	口子窖	300	10,863.00	0.00
262	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
263	603568	伟明环保	400	9,240.00	0.00
264	600917	重庆燃气	800	7,960.00	0.00
265	600623	华谊集团	400	7,924.00	0.00
266	603198	迎驾贡酒	300	7,173.00	0.00
267	603025	大豪科技	200	6,714.00	0.00
268	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
269	002049	同方国芯	60	2,637.00	0.00
270	300244	迪安诊断	77	2,539.46	0.00
271	000028	国药一致	38	2,473.80	0.00
272	002368	太极股份	62	2,202.86	0.00
273	000860	顺鑫农业	84	1,997.52	0.00
274	300253	卫宁健康	80	1,976.00	0.00
275	300115	长盈精密	90	1,854.00	0.00
276	002551	尚荣医疗	79	1,847.02	0.00
277	000513	丽珠集团	40	1,844.40	0.00
278	002508	老板电器	50	1,838.50	0.00
279	002439	启明星辰	68	1,756.44	0.00
280	002309	中利科技	92	1,647.72	0.00
281	000669	金鸿能源	96	1,603.20	0.00
282	002051	中工国际	80	1,573.60	0.00
283	002223	鱼跃医疗	44	1,395.68	0.00
284	300072	三聚环保	50	1,382.00	0.00
285	000050	深天马 A	65	1,356.55	0.00
286	000919	金陵药业	94	1,230.46	0.00
287	300182	捷成股份	70	1,197.70	0.00
288	000550	江铃汽车	46	1,120.56	0.00
289	002396	星网锐捷	50	985.00	0.00
290	002063	远光软件	63	973.35	0.00
291	600497	驰宏锌锗	97	967.09	0.00
292	002311	海大集团	60	946.20	0.00

293	000418	小天鹅 A	28	913.36	0.00
294	002358	森源电气	58	894.94	0.00
295	002678	珠江钢琴	67	822.09	0.00
296	000997	新大陆	40	801.60	0.00
297	002251	步步高	59	765.23	0.00
298	002073	软控股份	63	759.15	0.00
299	002428	云南锗业	43	738.74	0.00
300	000848	承德露露	60	717.00	0.00
301	002030	达安基因	24	667.20	0.00
302	002588	史丹利	54	666.90	0.00
303	000401	冀东水泥	60	654.00	0.00
304	000685	中山公用	60	622.80	0.00
305	000090	天健集团	60	528.00	0.00
306	000572	海马汽车	91	472.29	0.00
307	000786	北新建材	50	454.00	0.00
308	000861	海印股份	90	444.60	0.00
309	002489	浙江永强	50	396.00	0.00
310	002345	潮宏基	40	391.20	0.00
311	002250	联化科技	27	386.64	0.00
312	000528	柳工	55	356.40	0.00
313	002340	格林美	34	298.18	0.00
314	000671	阳光城	50	297.00	0.00
315	000488	晨鸣纸业	30	238.20	0.00
316	002106	莱宝高科	20	237.60	0.00
317	002005	德豪润达	40	236.40	0.00
318	002269	美邦服饰	50	220.00	0.00
319	002271	东方雨虹	12	206.76	0.00
320	002482	广田股份	27	204.66	0.00
321	002013	中航机电	15	202.20	0.00
322	002714	牧原股份	4	202.12	0.00
323	002028	思源电气	18	197.10	0.00
324	000631	顺发恒业	40	194.80	0.00
325	002698	博实股份	10	192.60	0.00
326	300147	香雪制药	10	147.30	0.00
327	000543	皖能电力	20	142.80	0.00
328	002573	清新环境	8	135.36	0.00
329	002408	齐翔腾达	20	109.80	0.00
330	002325	洪涛股份	10	91.90	0.00
331	002085	万丰奥威	4	68.76	0.00

332	000979	中弘股份	20	54.80	0.00
333	000078	海王生物	7	52.01	0.00
334	000830	鲁西化工	10	45.20	0.00
335	002118	紫鑫药业	3	44.10	0.00
336	002461	珠江啤酒	1	11.62	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	600079	人福医药	7,276,616.15	0.13
2	600201	生物股份	7,137,246.73	0.13
3	600816	安信信托	6,500,195.50	0.11
4	600635	大众公用	6,014,331.52	0.11
5	600482	中国动力	5,907,635.74	0.10
6	601012	隆基股份	5,844,911.75	0.10
7	600522	中天科技	5,814,686.87	0.10
8	600673	东阳光科	5,789,860.87	0.10
9	600498	烽火通信	5,734,619.00	0.10
10	600160	巨化股份	5,555,696.07	0.10
11	600158	中体产业	5,458,949.10	0.10
12	600525	长园集团	5,376,760.49	0.09
13	600655	豫园商城	5,329,198.40	0.09
14	600503	华丽家族	5,130,357.46	0.09
15	600138	中青旅	5,110,774.52	0.09
16	600879	航天电子	5,088,666.75	0.09
17	600664	哈药股份	5,080,199.16	0.09
18	600643	爱建集团	5,077,515.60	0.09
19	600521	华海药业	5,044,535.23	0.09
20	600074	保千里	5,008,531.42	0.09

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。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600201	生物股份	8,762,660.59	0.15
2	600079	人福医药	8,446,160.74	0.15
3	600816	安信信托	7,448,916.02	0.13
4	600978	宜华生活	7,379,355.30	0.13
5	600522	中天科技	7,234,842.80	0.13
6	601012	隆基股份	7,205,751.39	0.13
7	600074	保千里	7,198,756.64	0.13
8	600482	中国动力	7,162,197.00	0.13
9	600673	东阳光科	7,093,527.89	0.12
10	600498	烽火通信	7,053,746.73	0.12
11	600635	大众公用	6,980,164.12	0.12
12	600158	中体产业	6,816,638.61	0.12
13	600525	长园集团	6,720,160.00	0.12
14	600521	华海药业	6,599,581.47	0.12
15	600655	豫园商城	6,472,040.74	0.11
16	600664	哈药股份	6,442,770.20	0.11
17	600879	航天电子	6,298,751.00	0.11
18	600503	华丽家族	6,276,141.00	0.11
19	600376	首开股份	6,113,908.30	0.11
20	600138	中青旅	6,094,383.76	0.11

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	984,557,745.24
卖出股票收入（成交）总额	1,189,838,923.63

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）	5,600.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,600.00	0.00

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	56	5,600.00	0.00

7.7 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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期内未投资贵金属。

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	500ETF	股票型	ETF	南方基金管理 有限公司	4,066,374,993.01	94.92

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.12 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。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

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。

7.13.2

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。

7.13.3 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	938,926.84
2	应收证券清算款	550.90
3	应收股利	1,691.14
4	应收利息	38,133.22
5	应收申购款	3,226,466.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	1,494,569.22
9	合计	5,700,338.02

7.13.4 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。

7.13.5 期末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	600654	中安消	1,447,974.00	0.03	重大资产重组
2	601168	西部矿业	1,322,390.00	0.03	重大资产重组
3	600511	国药股份	1,103,435.64	0.03	重大资产重组

4	601611	中国核建	775,274.28	0.02	股票价格异常波动
5	600640	号百控股	738,760.00	0.02	重大资产重组
6	600614	鼎立股份	408,628.00	0.01	重大资产重组
7	000718	苏宁环球	384,060.60	0.01	重大事项
8	601005	重庆钢铁	289,122.12	0.01	重大资产重组

§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

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
370,509	7,744.33	497,872,069.06	17.35%	2,371,473,200.14	82.65%

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	蔡胜兵	702,059.00	0.02%
2	徐兴耀	551,100.00	0.02%
3	姚红伟	529,900.00	0.02%
4	牟子豪	515,900.00	0.02%
5	王少琴	515,053.00	0.02%
6	李昌盛	500,000.00	0.02%
7	奚云芳	400,000.00	0.01%
8	薛宜平	387,120.00	0.01%
9	王湘伟	349,900.00	0.01%
10	栾荣华	300,000.00	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	3,740,286.10	0.1304%

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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§9 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	3,157,946,424.77
本报告期基金总申购份额	1,905,817,932.95
减：本报告期基金总赎回份额	2,194,419,088.52
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,869,345,269.20

§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，本基金管理人、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	
国泰君安	1	1,530,756,840.29	70.45%	1,303,596.60	95.31%	-
华泰证券	1	641,932,659.26	29.55%	64,199.72	4.69%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
日信证券	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。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安	92,452.40	100.00%	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	南方基金关于继续开展直销柜台部分指数型基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月30日
2	关于京东电子交易平台实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月30日
3	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行网	中国证券报、上海	2016年6月30日

	上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	证券报、证券时报	
4	南方基金关于南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 增加微众银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 6 月 28 日
5	南方基金关于南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 增加微众银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 6 月 28 日
6	南方基金关于旗下部分基金增加积木基金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 6 月 20 日
7	南方基金关于旗下部分基金增加厦门鑫鼎盛为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 6 月 6 日
8	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	2016 年 5 月 14 日
9	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
10	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	2016 年 3 月 31 日
11	南方基金关于继续开展直销柜台部分指数型基金赎回费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 30 日
12	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	2016 年 2 月 18 日
13	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
14	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	2016 年 1 月 29 日
15	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	2016 年 1 月 27 日
16	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
17	南方基金关于旗下部分基金增加中证金牛为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 26 日
18	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
19	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	2016 年 1 月 13 日
20	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	2016 年 1 月 12 日
21	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	2016 年 1 月 8 日
22	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

23	关于南方基金管理有限公司旗下部分基金净值揭示异常的提示	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日
24	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
25	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
26	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南方中证 500 指数证券投资基金的文件。
- 2、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同。
- 3、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）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>