

# 中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 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.....	17
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19

6.2 审计报告的基本内容.....	19
<b>§7 年度财务报表.....</b>	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	26
<b>§8 投资组合报告.....</b>	<b>58</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	58
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	58
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	80
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	82
8.6 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.....	82
8.7 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.....	82
8.8 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.....	82
8.9 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.....	82
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	82
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	83
8.12 投资组合报告附注.....	83
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>85</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	85
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	85
9.3 期末上市基金前十名持有人.....	85
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	86
9.5 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.....	86
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>87</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>88</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	88
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	88
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	88

---

11.4 基金投资策略的改变.....	88
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	88
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	88
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	89
11.8 其他重大事件.....	91
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>92</b>
12.1 备查文件目录.....	92
12.2 存放地点.....	92
12.3 查阅方式.....	92

## §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
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	2,551,867,244.00 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 31-33 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		张海波	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>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

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



## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-1,630,839,025.84	3,707,520,523.16	1,062,923,895.73
本期利润	-3,091,968,996.85	3,810,362,825.44	1,743,928,258.76
加权平均基金份额本期利润	-1.1215	1.6657	0.4024
本期加权平均净值利润率	-17.42%	30.09%	33.69%
本期基金份额净值增长率	-16.52%	47.56%	39.20%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	7,625,158,761.68	11,174,292,261.42	955,373,192.91
期末可供分配基金份额利润	2.9881	4.2855	0.3018
期末基金资产净值	16,728,437,054.32	20,475,912,485.14	4,723,287,249.13
期末基金份额净值	6.5554	7.8528	1.4918
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	83.40%	120.13%	49.18%

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	业绩比较 基准收益	业绩比较基 准收益率标	①—③	②—④

		准差②	率③	准差④		
过去三个月	-1.11%	0.82%	-1.02%	0.83%	-0.09%	-0.01%
过去六个月	2.38%	0.92%	2.29%	0.92%	0.09%	0.00%
过去一年	-16.52%	1.90%	-17.78%	1.90%	1.26%	0.00%
过去三年	71.47%	2.09%	63.58%	2.09%	7.89%	0.00%
自基金合同 生效起至今	83.40%	1.96%	76.72%	1.96%	6.68%	0.00%

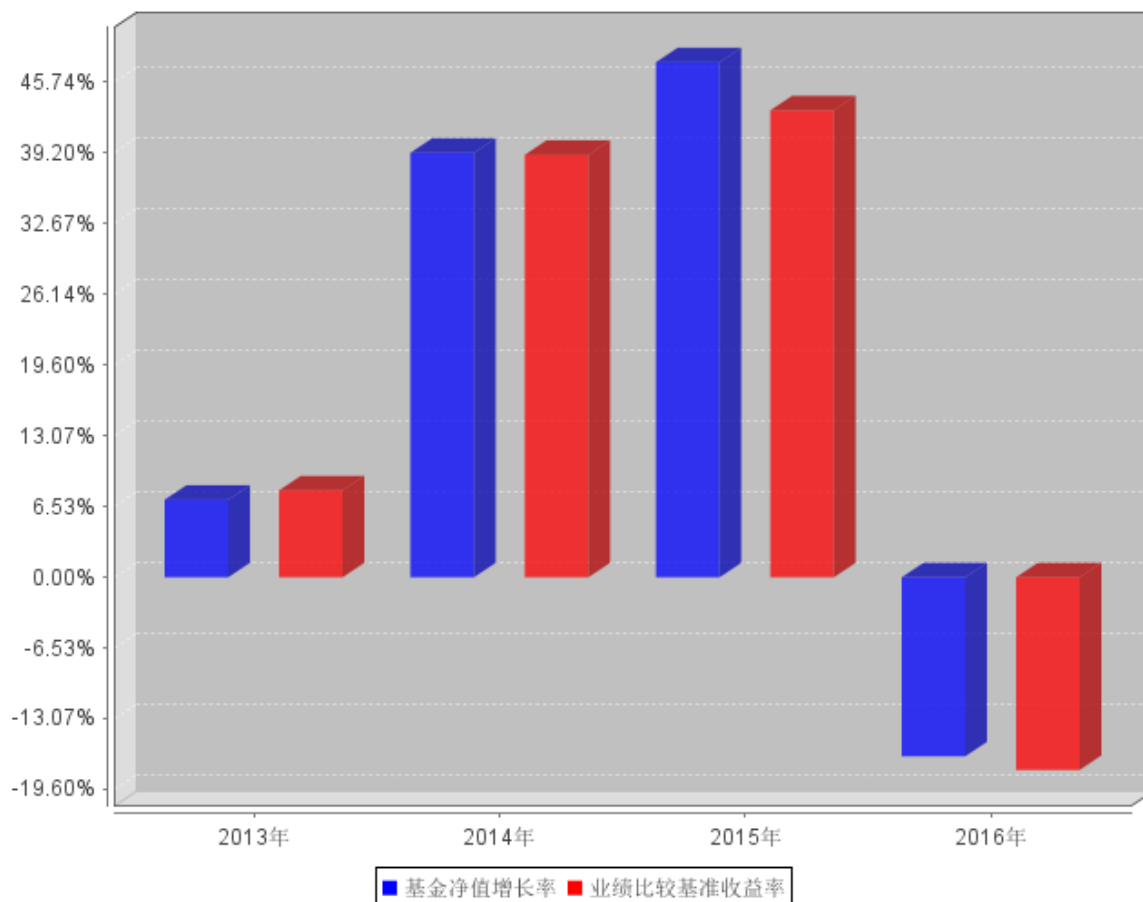
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金成立于 2013 年 2 月 6 日，基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

## §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）管理资产规模近 6,500 亿元，旗下管理 116 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；2016 年 12 月至今，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理。
--	--	--	--	--	--

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《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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

### 4.3.2 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。

公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，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、卖出溢价率、交易占优比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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，相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

## 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 17.78%。

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；
- 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；
- ④ 6 月中和 12 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 0.537%，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 6.5554 元，报告期内，份额净值增长率为-16.52%，同期业绩基准增长率为-17.78%。

#### 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 2017 年，国内经济阶段企稳、通胀压力有所回升，货币政策将更加中性，综合看，权益市场预期将有一个较好的表现。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展情况，围绕重合规守底线、抓规范促发展，坚持从保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，积极推动主动合规风控管理，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展情况，不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，并开展了互联网金融相关业务风险自查、信息技术专项自查等多项内控自查工作，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，推动公司合规、内控体系的健全完善；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，持续完善投资合规风控制度流程和系统，积极配合各类新产品、新业务，重点加强内幕交易防控以及对高风险品种和业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，有效确保投研交易业务的合规开展；针对新出台的法律法规和监管要求，积极组织了多项法律法规、职业道德培训以及合规考试，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况，督促落实销售适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保

证所披露信息的真实性、准确性和完整性；深入贯彻风险为本的反洗钱工作原则，优化反洗钱资源配置，加大反洗钱投入力度，购置外部专业机构制裁名单数据库，积极推进符合基金业务特征的可疑交易监控模型和方法，健全创新业务洗钱风险评估机制，各项反洗钱工作进一步完善；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：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。

#### **4.9 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 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，南方基金管理有限公司在本基金的投资运作、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年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 21481 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人:
引言段	我们审计了后附的中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 (以下简称“中证 500ETF 基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益 (基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是中证 500ETF 基金 的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露

	<p>的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述中证 500ETF 基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了中证 500ETF 基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	薛竞   陈熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国 · 上海市
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	10,570,147.07	32,810,834.58
结算备付金		579,437,772.31	472,886,806.89
存出保证金		142,866,719.64	56,424,595.26
交易性金融资产	7.4.7.2	16,012,429,203.87	20,044,833,519.70
其中：股票投资		16,012,429,203.87	20,044,833,519.70
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,444,542.92	226,131.04
应收利息	7.4.7.5	250,385.74	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	7.4.7.6	-	-
资产总计		16,749,008,373.05	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 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		993,781.45	93,860,509.94
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,181,749.77	8,829,132.59
应付托管费		1,436,349.98	1,765,826.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	670,118.16	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	7.4.7.8	10,289,319.37	25,548,030.79
负债合计		20,571,318.73	131,464,280.93
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	9,103,278,292.64	9,301,620,223.72
未分配利润	7.4.7.10	7,625,158,761.68	11,174,292,261.42
所有者权益合计		16,728,437,054.32	20,475,912,485.14
负债和所有者权益总计		16,749,008,373.05	20,607,376,766.07

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 6.5554 元，基金份额总额 2,551,867,244.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-2,958,321,370.26	3,920,695,794.45
1.利息收入		10,062,642.23	16,988,491.97
其中：存款利息收入	7.4.7.11	9,670,662.01	16,988,491.97
债券利息收入		3,115.87	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		388,864.35	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,501,304,963.37	3,813,116,507.52
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,733,676,572.15	3,990,221,708.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,814,952.67	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	109,805,163.71	-225,594,600.00
股利收益	7.4.7.15	118,751,492.40	48,489,399.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-1,461,129,971.01	102,842,302.28
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-5,949,078.11	-12,251,507.32
<b>减：二、费用</b>		133,647,626.59	110,332,969.01
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	88,804,150.13	62,270,991.47
2. 托管费	7.4.10.2.2	17,760,830.08	12,454,198.30
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	7.4.7.18	21,179,860.53	31,293,615.80
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	5,902,785.85	4,314,163.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,091,968,996.85	3,810,362,825.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,091,968,996.85	3,810,362,825.44

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	-3,091,968,996.85	-3,091,968,996.85
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）	-198,341,931.08	-457,164,502.89	-655,506,433.97
其中：1.基金申购款	10,029,823,186.55	7,582,143,222.78	17,611,966,409.33
2.基金赎回款	-10,228,165,117.63	-8,039,307,725.67	-18,267,472,843.30
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）	9,103,278,292.64	7,625,158,761.68	16,728,437,054.32
项目	上年度可比期间		
	2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	3,810,362,825.44	3,810,362,825.44
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）	6,135,526,382.72	5,806,736,027.85	11,942,262,410.57
其中：1. 基金申购款	17,193,484,879.30	20,110,746,234.95	37,304,231,114.25
2. 基金赎回款	-11,057,958,496.58	-14,304,010,207.10	-25,361,968,703.68
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）	9,301,620,223.72	11,174,292,261.42	20,475,912,485.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1727 号《关于核准中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,147,543,632.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 075 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 2 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,147,553,216.00 份,其中通过基金管理人进行网下现金认购部分的认购资金利息折合 9,584.00 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2013]第 83 号文审核同意,本基金 4,616,093,841.00 份基金份额于 2013 年 3 月 15 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证 500 指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化;主要投资范围为标的指数的成份股和备选成份股;此外,本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%,权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。在正常市场情况下,力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。

本基金的基金管理人南方基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，根据《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的约定，于 2013 年 2 月 22 日将管理的南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)变更为南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)（以下简称“南方中证 500ETF 联接基金”）。南方中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 2017 年 3 月 24 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为股指期货)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

#### (2) 金融负债的分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为股指期货)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但

最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

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

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

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

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

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

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

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

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

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。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。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。收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

无。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》、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。对证券投资基金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，对国债、地方政府债以及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，股票的股息、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，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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
活期存款	10,570,147.07	32,810,834.58
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	10,570,147.07	32,810,834.58

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	16,522,989,250.07	16,012,429,203.87	-510,560,046.20
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	16,522,989,250.07	16,012,429,203.87	-510,560,046.20



项目	上年度末		
	2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	19,098,819,198.60	20,044,833,519.70	946,014,321.10
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	19,098,819,198.60	20,044,833,519.70	946,014,321.10

注：于 2016 年 12 月 31 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 1,427.00 元(2015 年 12 月 31 日：-2,974.00 元)。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末			备注
	2016 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		
资产		负债		
利率衍生工具	-	-	-	
无	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
无	-	-	-	
权益衍生工具	702,744,643.71	-	-	
股指期货	702,744,643.71	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	702,744,643.71	-	-	

项目	上年度末			
	2015 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
资产		负债		
利率衍生工具	-	-	-	
无	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
无	-	-	-	
权益衍生工具	192,993,200.00	-	-	
股指期货	192,993,200.00	-	-	注：-
其他衍生工具	-	-	-	
合计	192,993,200.00	-	-	

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 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

#### 股指期货投资

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC1701	IC1701	561	697,569,840.00	-5,174,803.71
减：可抵销期货暂收款				-5,174,803.71
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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日

应收活期存款利息	4,904.45	22,459.28
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	243,972.49	154,740.42
应收债券利息	-	-
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	1,508.80	8,077.40
合计	250,385.74	185,277.10

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	670,118.16	1,460,781.09
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	670,118.16	1,460,781.09

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	1,766,296.23	1,651,202.24

应退替代款	5,177,347.66	19,196,633.19
可退替代款	3,345,675.48	4,700,195.36
合计	10,289,319.37	25,548,030.79

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。

#### 7.4.7.9 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12月31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	2,811,600,000.00	10,029,823,186.55
本期赎回(以“-”号填列)	-2,867,200,000.00	-10,228,165,117.63
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	2,551,867,244.00	9,103,278,292.64

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,089,318,295.81	-2,915,026,034.39	11,174,292,261.42
本期利润	-1,630,839,025.84	-1,461,129,971.01	-3,091,968,996.85
本期基金份额交易产生的变动数	-106,426,867.64	-350,737,635.25	-457,164,502.89

其中：基金申购款	14,123,968,750.69	-6,541,825,527.91	7,582,143,222.78
基金赎回款	-14,230,395,618.33	6,191,087,892.66	-8,039,307,725.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,352,052,402.33	-4,726,893,640.65	7,625,158,761.68

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	1,105,872.30	2,134,751.56
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	8,463,676.16	14,759,535.23
其他	101,113.55	94,205.18
合计	9,670,662.01	16,988,491.97

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-866,578,545.02	2,457,599,629.59
股票投资收益——赎回差价收入	-867,098,027.13	1,532,622,078.51
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-1,733,676,572.15	3,990,221,708.10

## 7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
卖出股票成交总额	14,993,809,256.68	17,300,646,326.11
减：卖出股票成本总额	15,860,387,801.70	14,843,046,696.52
买卖股票差价收入	-866,578,545.02	2,457,599,629.59

## 7.4.7.12.3 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
赎回基金份额对价总额	18,267,472,843.30	25,361,968,703.68
减：现金支付赎回款总额	9,867,320,118.30	13,656,639,757.68
减：赎回股票成本总额	9,267,250,752.13	10,172,706,867.49
赎回差价收入	-867,098,027.13	1,532,622,078.51

## 7.4.7.13 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 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	27,327,568.54	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总	23,509,500.00	-

额		
减：应收利息总额	3,115.87	-
买卖债券差价收入	3,814,952.67	-

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间收益金额 2015年1月1日至2015年12月 31日
权证投资收益	-	-
股指期货-投资收益	109,805,163.71	-225,594,600.00

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
股票投资产生的股利收益	118,751,492.40	48,489,399.42
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	118,751,492.40	48,489,399.42

#### 7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
1. 交易性金融资产	-1,456,574,367.30	103,461,502.28
——股票投资	-1,456,574,367.30	103,461,502.28

——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-4,555,603.71	-619,200.00
——权证投资	-	-
股指期货	-4,555,603.71	-619,200.00
3. 其他	-	-
合计	-1,461,129,971.01	102,842,302.28

注：本基金本期公允价值变动收益-股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动收益

4,401.00 元(2015 年 12 月 31 日：-1,774.00 元)。

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-5,949,078.11	-12,251,507.32
合计	-5,949,078.11	-12,251,507.32

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。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	21,179,860.53	31,293,615.80



银行间市场交易费用	-	-
合计	21,179,860.53	31,293,615.80

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
审计费用	155,000.00	156,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
上市费	60,000.00	60,000.00
银行汇划费	59,336.84	61,703.97
账户维护费	200.00	200.00
指数使用费	5,328,249.01	3,736,259.45
其他	-	0.02
合计	5,902,785.85	4,314,163.44

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。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自2016年5月1日起执行。

根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题

的补充通知》(财税[2017]2号), 2017年7月1日(含)以后, 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人, 按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法, 由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人
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
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司
南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)(“南方中证 500ETF 联接基金”)	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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日

	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
华泰证券	19,880,885,861.07	66.80%	26,118,575,469.12	61.31%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券	1,988,370.55	66.80%	400,199.62	59.72%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券	5,626,663.52	60.16%	446,583.32	30.57%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	88,804,150.13	62,270,991.47
其中：支付销售机构的客户维护费	14,416.79	-

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 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。

#### 7.4.10.2.2 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 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	17,760,830.08	12,454,198.30

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 0.1% 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 0.1% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 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 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
南方中证 500ETF 联接 基金	571, 773, 402. 00	22. 4100%	675, 473, 402. 00	25. 9100%
华泰证券	-	-	2, 415, 700. 00	0. 0900%

注：南方中证 500ETF 联接基金和华泰证券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。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	10, 570, 147. 07	1, 105, 872. 30	32, 810, 834. 58	2, 134, 751. 56

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国农业银行 保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股未上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股未上市	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股未上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 6 日	新股未上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股未上市	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股未上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股未上市	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股未上市	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 3 日	新股未上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股未上市	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新	2016 年	2017 年	新股未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-

	材	12月 26日	1月4日	上市						
300591	万里马	2016年 12月 30日	2017年 1月 10日	新股未 上市	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信 息	2016年 12月 27日	2017年 1月5日	新股未 上市	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000887	中鼎股份	2016年 11月 18日	重大资产重组	25.94	2017年 2月 15日	23.99	2,608,736	57,953,387.99	67,670,611.84	-
601168	西部矿业	2016年 12月 19日	重大资产重组	7.83	-	-	7,608,943	54,046,429.27	59,578,023.69	-
002602	世纪华通	2016年 12月 15日	重大事项	46.89	2017年 1月 9日	50.00	1,241,420	32,864,247.25	58,210,183.80	-
000748	长城信息	2016年 11月 1日	重大资产重组	20.31	注1	注1	2,834,968	63,967,096.57	57,578,200.08	-
000547	航天发展	2016年 4月 19日	重大资产重组	15.36	2017年 1月 3日	16.90	3,596,242	64,992,468.78	55,238,277.12	-

002400	省广股份	2016年11月28日	重大事项	13.79	-	-	3,977,169	63,505,660.49	54,845,160.51	-
300088	长信科技	2016年9月12日	重大资产重组	15.80	-	-	3,427,002	42,624,978.05	54,146,631.60	-
600673	东阳光科	2016年11月15日	重大资产重组	7.29	-	-	7,144,200	54,047,929.12	52,081,218.00	-
600655	豫园商城	2016年12月20日	重大事项未公告	11.42	-	-	4,023,523	53,846,332.62	45,948,632.66	-
000697	炼石有色	2016年11月17日	重大资产重组	23.51	-	-	1,920,436	42,209,214.91	45,149,450.36	-
000050	深天马A	2016年9月12日	重大资产重组	18.82	2017年3月23日	20.70	2,386,319	46,952,980.81	44,910,523.58	-
002491	通鼎互联	2016年12月22日	重大事项	15.54	2017年1月3日	15.89	2,877,500	47,477,774.60	44,716,350.00	-
600161	天坛生物	2016年12月6日	重大资产重组	39.40	2017年3月24日	43.34	1,029,959	31,981,805.95	40,580,384.60	-
600687	刚泰控股	2016年7月25日	重大资产重组	16.42	2017年1月18日	16.38	2,455,300	40,381,235.36	40,316,026.00	-
000563	陕国投A	2016年10月14日	重大资产重组	7.48	2017年1月18日	6.73	5,341,420	30,723,593.75	39,953,821.60	-
600151	航天机电	2016年11月11日	重大资产重组	10.97	-	-	3,605,190	40,701,397.08	39,548,934.30	-



000727	华东科技	2016年11月17日	重大资产重组	3.37	2017年2月15日	3.47	11,569,800	39,556,575.97	38,990,226.00	-
002440	闰土股份	2016年10月24日	重大资产重组	16.34	2017年1月12日	15.22	1,997,008	35,146,411.32	32,631,110.72	-
600645	中源协和	2016年12月13日	重大资产重组	26.80	-	-	1,215,748	51,534,881.03	32,582,046.40	-
600171	上海贝岭	2016年12月14日	重大事项未公告	14.05	2017年2月16日	14.90	2,142,968	34,340,004.50	30,108,700.40	-
000829	天音控股	2016年9月29日	重大事项	11.28	-	-	2,486,635	29,432,685.26	28,049,242.80	-
002396	星网锐捷	2016年9月12日	重大事项未公告	19.70	2017年2月21日	18.35	1,397,030	27,695,053.03	27,521,491.00	-
002025	航天电器	2016年9月12日	重大资产重组	25.20	-	-	1,083,543	24,232,342.48	27,305,283.60	-
002635	安洁科技	2016年11月8日	重大资产重组	36.40	2017年2月8日	33.50	676,690	17,701,621.80	24,631,516.00	-
600537	亿晶光电	2016年12月27日	重大事项未公告	7.43	2017年1月13日	8.17	3,305,122	23,758,987.38	24,557,056.46	-
600859	王府井	2016年9月27日	重大资产重组	16.28	-	-	1,433,657	24,646,691.71	23,339,935.96	-
601005	重庆钢铁	2016年6月2日	重大资产重组	2.52	-	-	9,241,300	30,047,108.25	23,288,076.00	-

002727	一心堂	2016年12月28日	重大事项	21.20	2017年1月5日	21.66	1,022,200	24,310,080.75	21,670,640.00	-
002681	奋达科技	2016年12月19日	重大资产重组	12.93	-	-	1,504,730	24,053,840.51	19,456,158.90	-
600551	时代出版	2016年11月28日	重大资产重组	20.32	-	-	875,211	16,540,670.23	17,784,287.52	-
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	-
603169	兰石重装	2016年11月24日	重大资产重组	13.36	2017年3月21日	14.32	1,187,978	16,882,715.05	15,871,386.08	-
603555	贵人鸟	2016年12月12日	重大资产重组	30.76	-	-	496,240	14,282,101.62	15,264,342.40	-
002745	木林森	2016年7月18日	重大资产重组	36.49	-	-	264,856	8,563,739.24	9,664,595.44	-

注：1. 根据长城信息产业股份有限公司(以下简称“长城信息”)于2016年10月25日公布的《关于中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并公司事宜的提示性公告》和中国长城计算机深圳股份有限公司(以下简称“长城电脑”)于2017年1月20日公布的《中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并长城信息产业股份有限公司及重大资产置换和发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易报告书(修订稿)》，长城电脑将向长城信息全体股东发行A股股票，以换股比例1:0.5424取得长城信息股东持有的长城信息全部股票，吸收合并长城信息；长城信息自2016年11月1日起连续停牌。换股合并后新增的长城电脑股票于2017年1月18日上市流通，当日开盘单价为10.63元。长城信息人民币普通股股票自2017年1月18日起终止上市并摘牌。

2. 本基金截至2016年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，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。

### 7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2016 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2015 年 12 月 31 日：同)。

### 7.4.13.3 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 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余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 12 月 31 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。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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	10,570,147.07	-	-	-	10,570,147.07
结算备付金	579,437,772.31	-	-	-	579,437,772.31
存出保证金	3,352,751.64	-	-	139,513,968.00	142,866,719.64
交易性金融资产	-	-	-	16,012,429,203.87	16,012,429,203.87
应收证券清算款	-	-	-	3,444,542.92	3,444,542.92
应收利息	-	-	-	250,385.74	250,385.74
应收股利	-	-	-	9,601.50	9,601.50
资产总计	593,360,671.02	-	-	16,155,647,702.03	16,749,008,373.05
负债					

应付证券清算款	-	-	-	993,781.45	993,781.45
应付管理人报酬	-	-	-	7,181,749.77	7,181,749.77
应付托管费	-	-	-	1,436,349.98	1,436,349.98
应付交易费用	-	-	-	670,118.16	670,118.16
其他负债	-	-	-	10,289,319.37	10,289,319.37
负债总计	-	-	-	20,571,318.73	20,571,318.73
利率敏感度缺口	593,360,671.02	-	-	16,135,076,383.30	16,728,437,054.32
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，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2015 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	16,012,429,203.87	95.72	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	—	—	—	—
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	16,012,429,203.87	95.72	20,044,833,519.70	97.89

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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12月31日)	上年度末(2015年12月31日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 82,710.00	增加约 102,956.00
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 82,710.00	减少约 102,956.00	

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2016 年度, 本基金申购基金份额的对价总额为 17,611,966,409.33 元(2015 年度: 37,304,231,114.25 元), 其中包括以股票支付的申购款 7,762,471,037.58 元和以现金支付的申购款 9,849,495,371.75 元(2015 年度: 其中包括以股票支付的申购款 14,933,584,726.16 元和以现金支付的申购款 22,370,646,388.09 元)。

##### (2) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。



(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 14,781,377,521.62 元，属于第二层次的余额为 1,231,051,682.25 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 18,299,477,912.96 元，第二层次 1,745,355,606.74 元，无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(3)除基金申购款和公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	16,012,429,203.87	95.60
	其中：股票	16,012,429,203.87	95.60
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	590,007,919.38	3.52
7	其他各项资产	146,571,249.80	0.88
8	合计	16,749,008,373.05	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	203,634,730.32	1.22
B	采矿业	631,267,880.73	3.77
C	制造业	9,916,490,847.46	59.28

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	492,163,333.66	2.94
E	建筑业	454,827,619.41	2.72
F	批发和零售业	955,320,737.22	5.71
G	交通运输、仓储和邮政业	451,995,552.72	2.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	956,223,905.09	5.72
J	金融业	136,570,672.74	0.82
K	房地产业	1,017,820,723.95	6.08
L	租赁和商务服务业	241,190,974.66	1.44
M	科学研究和技术服务业	46,361,016.61	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	77,346,346.58	0.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	8,142,629.00	0.05
Q	卫生和社会工作	42,603,520.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	236,964,139.40	1.42
S	综合	142,089,979.50	0.85
	合计	16,011,014,609.05	95.71

### 8.2.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,001,727.05	0.01

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	241,692.20	0.00
J	金融业	106,780.00	0.00
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,413,167.82	0.01

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 8.3.1 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	000656	金科股份	15,083,169	79,035,805.56	0.47
2	600201	生物股份	2,470,453	78,041,610.27	0.47

3	600522	中天科技	7,364,236	77,545,405.08	0.46
4	300136	信维通信	2,718,078	77,465,223.00	0.46
5	600682	南京新百	2,009,500	74,894,065.00	0.45
6	600584	长电科技	4,175,553	73,698,510.45	0.44
7	600079	人福医药	3,627,475	72,368,126.25	0.43
8	600525	长园集团	5,174,113	72,178,876.35	0.43
9	600643	爱建集团	5,792,754	71,888,077.14	0.43
10	600219	南山铝业	22,418,770	69,273,999.30	0.41
11	000887	中鼎股份	2,608,736	67,670,611.84	0.40
12	002405	四维图新	3,440,051	66,564,986.85	0.40
13	600487	亨通光电	3,502,745	65,361,221.70	0.39
14	601012	隆基股份	4,797,892	64,243,773.88	0.38
15	600158	中体产业	2,717,221	64,044,898.97	0.38
16	002092	中泰化学	5,192,256	62,826,297.60	0.38
17	000661	长春高新	549,083	61,414,933.55	0.37
18	300156	神雾环保	2,440,050	61,025,650.50	0.36
19	002572	索菲亚	1,123,549	60,851,413.84	0.36
20	601168	西部矿业	7,608,943	59,578,023.69	0.36
21	600315	上海家化	2,174,700	58,956,117.00	0.35
22	002602	世纪华通	1,241,420	58,210,183.80	0.35
23	600166	福田汽车	18,817,902	58,147,317.18	0.35
24	000748	长城信息	2,834,968	57,578,200.08	0.34
25	300115	长盈精密	2,169,062	56,525,755.72	0.34
26	002460	赣锋锂业	2,127,300	56,394,723.00	0.34
27	300266	兴源环境	1,025,651	56,287,726.88	0.34
28	002366	台海核电	1,049,347	56,265,986.14	0.34
29	600143	金发科技	7,220,273	56,173,723.94	0.34
30	002422	科伦药业	3,481,171	56,116,476.52	0.34

31	600436	片仔癀	1,215,589	55,661,820.31	0.33
32	600521	华海药业	2,521,067	55,539,106.01	0.33
33	002407	多氟多	2,030,500	55,412,345.00	0.33
34	300296	利亚德	1,641,100	55,337,892.00	0.33
35	000547	航天发展	3,596,242	55,238,277.12	0.33
36	600699	均胜电子	1,667,481	55,176,946.29	0.33
37	002400	省广股份	3,977,169	54,845,160.51	0.33
38	000998	隆平高科	2,529,836	54,214,385.48	0.32
39	300088	长信科技	3,427,002	54,146,631.60	0.32
40	002508	老板电器	1,469,972	54,094,969.60	0.32
41	002340	格林美	8,213,258	53,796,839.90	0.32
42	600503	华丽家族	6,458,400	53,540,136.00	0.32
43	000581	威孚高科	2,359,742	52,952,610.48	0.32
44	600879	航天电子	3,466,046	52,822,541.04	0.32
45	600664	哈药股份	6,143,111	52,707,892.38	0.32
46	300026	红日药业	9,705,501	52,700,870.43	0.32
47	000930	中粮生化	3,884,401	52,206,349.44	0.31
48	002168	深圳惠程	3,286,899	52,130,218.14	0.31
49	600673	东阳光科	7,144,200	52,081,218.00	0.31
50	002004	华邦健康	5,737,565	52,039,714.55	0.31
51	000997	新大陆	2,645,027	51,392,874.61	0.31
52	002439	启明星辰	2,450,690	50,949,845.10	0.30
53	600978	宜华生活	4,781,826	50,926,446.90	0.30
54	600266	北京城建	3,787,800	50,491,374.00	0.30
55	600614	鼎立股份	4,262,327	49,869,225.90	0.30
56	002701	奥瑞金	5,692,786	49,185,671.04	0.29
57	600138	中青旅	2,334,362	48,951,571.14	0.29
58	600500	中化国际	4,197,069	48,937,824.54	0.29

59	002176	江特电机	4,094,500	48,847,385.00	0.29
60	600497	驰宏锌锗	6,944,620	48,820,678.60	0.29
61	000690	宝新能源	5,263,882	48,796,186.14	0.29
62	000961	中南建设	4,616,662	48,013,284.80	0.29
63	600122	宏图高科	3,879,444	47,406,805.68	0.28
64	002030	达安基因	2,041,700	47,367,440.00	0.28
65	002013	中航机电	2,583,599	47,254,025.71	0.28
66	600635	大众公用	7,814,816	46,967,044.16	0.28
67	002311	海大集团	3,109,007	46,790,555.35	0.28
68	600426	华鲁恒升	3,518,160	46,615,620.00	0.28
69	002271	东方雨虹	2,138,308	46,379,900.52	0.28
70	600655	豫园商城	4,023,523	45,948,632.66	0.27
71	000970	中科三环	3,436,173	45,872,909.55	0.27
72	000697	炼石有色	1,920,436	45,149,450.36	0.27
73	600759	洲际油气	4,584,886	45,023,580.52	0.27
74	002573	清新环境	2,574,906	44,983,607.82	0.27
75	300253	卫宁健康	2,293,363	44,926,981.17	0.27
76	000050	深天马 A	2,386,319	44,910,523.58	0.27
77	300324	旋极信息	2,317,000	44,787,610.00	0.27
78	002491	通鼎互联	2,877,500	44,716,350.00	0.27
79	300113	顺网科技	1,649,635	44,358,685.15	0.27
80	002038	双鹭药业	1,657,515	44,272,225.65	0.26
81	000400	许继电气	2,438,100	44,251,515.00	0.26
82	600418	江淮汽车	3,820,169	44,161,153.64	0.26
83	002179	中航光电	1,213,972	44,055,043.88	0.26
84	600751	天海投资	5,215,607	43,602,474.52	0.26
85	600565	迪马股份	5,855,600	43,448,552.00	0.26
86	600240	华业资本	4,021,457	43,190,448.18	0.26

87	002001	新和成	2,196,400	43,049,440.00	0.26
88	600312	平高电气	2,736,828	42,749,253.36	0.26
89	600388	龙净环保	3,448,922	42,663,165.14	0.25
90	300244	迪安诊断	1,331,360	42,603,520.00	0.25
91	002273	水晶光电	2,139,249	42,571,055.10	0.25
92	600594	益佰制药	2,551,571	42,483,657.15	0.25
93	600633	浙报传媒	2,391,600	42,235,656.00	0.25
94	000012	南玻 A	3,702,118	41,982,018.12	0.25
95	000959	首钢股份	6,313,300	41,794,046.00	0.25
96	002665	首航节能	4,767,760	41,765,577.60	0.25
97	002223	鱼跃医疗	1,345,287	41,730,802.74	0.25
98	000598	兴蓉环境	7,221,100	41,593,536.00	0.25
99	000806	银河生物	2,624,600	41,573,664.00	0.25
100	600811	东方集团	5,756,640	41,159,976.00	0.25
101	002217	合力泰	2,293,810	41,059,199.00	0.25
102	000566	海南海药	3,228,618	41,035,734.78	0.25
103	600094	大名城	4,594,400	40,890,160.00	0.24
104	600056	中国医药	2,145,522	40,829,283.66	0.24
105	300159	新研股份	3,001,572	40,761,347.76	0.24
106	000939	凯迪生态	3,166,449	40,752,198.63	0.24
107	600601	方正科技	8,849,296	40,706,761.60	0.24
108	000078	海王生物	6,448,075	40,622,872.50	0.24
109	600161	天坛生物	1,029,959	40,580,384.60	0.24
110	000975	银泰资源	2,591,503	40,531,106.92	0.24
111	000878	云南铜业	3,427,187	40,475,078.47	0.24
112	600528	中铁二局	2,940,643	40,463,247.68	0.24
113	002221	东华能源	3,261,728	40,412,809.92	0.24
114	600687	刚泰控股	2,455,300	40,316,026.00	0.24



115	600787	中储股份	4,431,837	40,196,761.59	0.24
116	600881	亚泰集团	7,333,376	40,113,566.72	0.24
117	300055	万邦达	2,440,543	39,976,094.34	0.24
118	000563	陕国投 A	5,341,420	39,953,821.60	0.24
119	002410	广联达	2,727,070	39,815,222.00	0.24
120	600151	航天机电	3,605,190	39,548,934.30	0.24
121	600198	大唐电信	2,487,762	39,480,782.94	0.24
122	002408	齐翔腾达	3,577,152	39,348,672.00	0.24
123	000988	华工科技	2,512,630	39,322,659.50	0.24
124	300134	大富科技	1,549,550	39,296,588.00	0.23
125	600200	江苏吴中	2,034,099	39,278,451.69	0.23
126	600478	科力远	3,921,747	39,217,470.00	0.23
127	002353	杰瑞股份	1,928,800	39,154,640.00	0.23
128	600435	北方导航	3,000,736	39,129,597.44	0.23
129	000031	中粮地产	4,384,290	39,107,866.80	0.23
130	002048	宁波华翔	1,763,475	39,043,336.50	0.23
131	000727	华东科技	11,569,800	38,990,226.00	0.23
132	000612	焦作万方	3,365,603	38,872,714.65	0.23
133	603589	口子窖	1,208,571	38,831,386.23	0.23
134	601699	潞安环能	4,822,600	38,821,930.00	0.23
135	600410	华胜天成	3,561,952	38,718,418.24	0.23
136	002191	劲嘉股份	3,710,102	38,622,161.82	0.23
137	000999	华润三九	1,559,000	38,554,070.00	0.23
138	600176	中国巨石	3,917,629	38,549,469.36	0.23
139	600549	厦门钨业	1,750,200	38,539,404.00	0.23
140	600516	方大炭素	4,159,224	38,514,414.24	0.23
141	600755	厦门国贸	4,695,943	38,506,732.60	0.23
142	600851	海欣股份	2,975,769	38,476,693.17	0.23

143	000960	锡业股份	2,930,300	38,445,536.00	0.23
144	000979	中弘股份	14,491,604	38,257,834.56	0.23
145	002250	联化科技	2,354,861	38,101,650.98	0.23
146	000758	中色股份	4,763,130	38,057,408.70	0.23
147	000667	美好置业	10,313,197	38,055,696.93	0.23
148	300273	和佳股份	2,218,869	37,853,905.14	0.23
149	600026	中远海能	5,512,750	37,541,827.50	0.22
150	002018	华信国际	3,677,700	37,402,209.00	0.22
151	000488	晨鸣纸业	3,588,984	37,181,874.24	0.22
152	000786	北新建材	3,609,811	37,144,955.19	0.22
153	600572	康恩贝	5,066,013	37,032,555.03	0.22
154	601929	吉视传媒	8,776,305	36,772,717.95	0.22
155	600098	广州发展	3,260,400	36,581,688.00	0.22
156	600064	南京高科	2,182,151	36,551,029.25	0.22
157	000825	太钢不锈	9,196,800	36,235,392.00	0.22
158	600325	华发股份	2,829,427	36,216,665.60	0.22
159	600160	巨化股份	3,406,368	36,039,373.44	0.22
160	603019	中科曙光	1,294,850	36,022,727.00	0.22
161	600863	内蒙华电	11,689,300	36,003,044.00	0.22
162	600967	北方创业	2,651,525	35,981,194.25	0.22
163	000006	深振业 A	3,805,454	35,961,540.30	0.22
164	600575	皖江物流	6,253,389	35,956,986.75	0.21
165	600108	亚盛集团	6,275,600	35,896,432.00	0.21
166	000860	顺鑫农业	1,611,554	35,454,188.00	0.21
167	603766	隆鑫通用	1,702,969	35,387,695.82	0.21
168	002657	中科金财	814,056	35,134,656.96	0.21
169	600120	浙江东方	1,213,803	35,103,182.76	0.21
170	002544	杰赛科技	1,246,001	35,062,468.14	0.21

171	600409	三友化工	3,727,017	34,996,689.63	0.21
172	601880	大连港	12,470,937	34,918,623.60	0.21
173	601000	唐山港	8,694,741	34,865,911.41	0.21
174	600511	国药股份	1,158,149	34,860,284.90	0.21
175	600039	四川路桥	7,302,084	34,611,878.16	0.21
176	600307	酒钢宏兴	12,638,900	34,504,197.00	0.21
177	600499	科达洁能	4,553,728	34,426,183.68	0.21
178	300287	飞利信	2,892,600	34,421,940.00	0.21
179	002375	亚厦股份	3,237,300	34,250,634.00	0.20
180	002051	中工国际	1,492,986	34,219,239.12	0.20
181	002276	万马股份	2,271,842	34,145,785.26	0.20
182	002078	太阳纸业	5,107,120	34,115,561.60	0.20
183	600316	洪都航空	1,734,751	34,105,204.66	0.20
184	002672	东江环保	1,937,695	34,103,432.00	0.20
185	600022	山东钢铁	13,622,600	34,056,500.00	0.20
186	600717	天津港	3,377,200	34,042,176.00	0.20
187	600808	马钢股份	12,026,449	34,034,850.67	0.20
188	002390	信邦制药	3,436,880	33,990,743.20	0.20
189	002019	亿帆医药	2,222,069	33,975,435.01	0.20
190	002595	豪迈科技	1,613,907	33,972,742.35	0.20
191	002444	巨星科技	2,168,188	33,823,732.80	0.20
192	002640	跨境通	1,846,900	33,798,270.00	0.20
193	000513	丽珠集团	565,512	33,647,964.00	0.20
194	002384	东山精密	1,707,473	33,483,545.53	0.20
195	000028	国药一致	499,702	33,430,063.80	0.20
196	300199	翰宇药业	1,857,035	33,389,489.30	0.20
197	600466	蓝光发展	3,448,664	33,348,580.88	0.20
198	002155	湖南黄金	2,911,416	33,335,713.20	0.20

199	002489	浙江永强	4,382,389	33,174,684.73	0.20
200	000066	长城电脑	2,665,523	33,159,106.12	0.20
201	600416	湘电股份	2,251,669	33,122,050.99	0.20
202	600611	大众交通	5,037,748	33,098,004.36	0.20
203	002022	科华生物	1,653,988	33,079,760.00	0.20
204	600600	青岛啤酒	1,123,614	33,079,196.16	0.20
205	600587	新华医疗	1,316,254	33,051,137.94	0.20
206	000543	皖能电力	4,328,384	32,939,002.24	0.20
207	002268	卫士通	1,048,200	32,934,444.00	0.20
208	002281	光迅科技	418,649	32,863,946.50	0.20
209	002440	闰土股份	1,997,008	32,631,110.72	0.20
210	600348	阳泉煤业	4,846,465	32,616,709.45	0.20
211	000089	深圳机场	4,073,900	32,591,200.00	0.19
212	600645	中源协和	1,215,748	32,582,046.40	0.19
213	600770	综艺股份	3,142,833	32,528,321.55	0.19
214	000685	中山公用	2,914,147	32,434,456.11	0.19
215	600062	华润双鹤	1,457,770	32,406,227.10	0.19
216	600597	光明乳业	2,478,962	32,375,243.72	0.19
217	000401	冀东水泥	2,712,262	32,275,917.80	0.19
218	002266	浙富控股	5,581,976	32,152,181.76	0.19
219	002050	三花智控	2,905,580	32,077,603.20	0.19
220	002261	拓维信息	2,683,400	31,986,128.00	0.19
221	600183	生益科技	2,898,192	31,880,112.00	0.19
222	600884	杉杉股份	2,263,982	31,876,866.56	0.19
223	300122	智飞生物	1,932,146	31,822,444.62	0.19
224	600380	健康元	3,195,446	31,730,778.78	0.19
225	002477	雏鹰农牧	6,316,297	31,707,810.94	0.19
226	600872	中炬高新	2,249,088	31,667,159.04	0.19

227	600187	国中水务	5,868,918	31,633,468.02	0.19
228	000592	平潭发展	4,672,702	31,587,465.52	0.19
229	600300	维维股份	4,716,067	31,503,327.56	0.19
230	002603	以岭药业	1,818,002	31,342,354.48	0.19
231	600366	宁波韵升	1,574,794	31,007,693.86	0.19
232	000519	江南红箭	2,080,386	30,997,751.40	0.19
233	002373	千方科技	2,226,838	30,730,364.40	0.18
234	600267	海正药业	2,335,990	30,718,268.50	0.18
235	002431	棕榈股份	3,331,935	30,520,524.60	0.18
236	002122	天马股份	2,394,228	30,382,753.32	0.18
237	600392	盛和资源	2,277,202	30,355,102.66	0.18
238	600073	上海梅林	2,644,337	30,277,658.65	0.18
239	002308	威创股份	2,047,007	30,172,883.18	0.18
240	600067	冠城大通	4,211,892	30,157,146.72	0.18
241	600017	日照港	7,436,822	30,119,129.10	0.18
242	600171	上海贝岭	2,142,968	30,108,700.40	0.18
243	600422	昆药集团	2,227,078	30,087,823.78	0.18
244	600970	中材国际	4,241,534	30,072,476.06	0.18
245	002073	软控股份	2,648,082	30,055,730.70	0.18
246	300274	阳光电源	2,836,204	29,893,590.16	0.18
247	600125	铁龙物流	3,681,524	29,746,713.92	0.18
248	600298	安琪酵母	1,662,209	29,620,564.38	0.18
249	600086	东方金钰	2,719,325	29,586,256.00	0.18
250	600216	浙江医药	2,329,236	29,534,712.48	0.18
251	600284	浦东建设	2,236,555	29,500,160.45	0.18
252	600651	飞乐音响	2,801,402	29,498,763.06	0.18
253	000703	恒逸石化	1,961,147	29,476,039.41	0.18
254	600557	康缘药业	1,739,680	29,452,782.40	0.18

255	002437	誉衡药业	3,544,083	29,309,566.41	0.18
256	000810	创维数字	2,082,200	29,296,554.00	0.18
257	000926	福星股份	2,296,140	29,252,823.60	0.17
258	300010	立思辰	1,755,000	29,168,100.00	0.17
259	300291	华录百纳	1,308,713	29,158,125.64	0.17
260	600260	凯乐科技	1,880,633	29,112,198.84	0.17
261	000816	智慧农业	4,576,410	29,105,967.60	0.17
262	002512	达华智能	1,767,000	28,855,110.00	0.17
263	000937	冀中能源	4,271,700	28,791,258.00	0.17
264	600536	中国软件	1,195,899	28,773,329.94	0.17
265	002358	森源电气	1,496,127	28,695,715.86	0.17
266	000762	西藏矿业	1,680,399	28,617,194.97	0.17
267	000418	小天鹅 A	885,049	28,604,783.68	0.17
268	002002	鸿达兴业	3,894,860	28,588,272.40	0.17
269	002479	富春环保	1,924,131	28,515,621.42	0.17
270	600175	美都能源	5,760,182	28,512,900.90	0.17
271	600694	大商股份	708,929	28,307,534.97	0.17
272	601801	皖新传媒	1,605,938	28,216,330.66	0.17
273	601231	环旭电子	2,626,159	28,126,162.89	0.17
274	000829	天音控股	2,486,635	28,049,242.80	0.17
275	002028	思源电气	2,126,129	28,022,380.22	0.17
276	000021	深科技	2,964,364	27,953,952.52	0.17
277	601311	骆驼股份	1,710,767	27,936,825.11	0.17
278	300001	特锐德	1,610,400	27,924,336.00	0.17
279	000777	中核科技	1,236,064	27,663,112.32	0.17
280	600169	太原重工	6,839,761	27,564,236.83	0.16
281	002399	海普瑞	1,510,700	27,524,954.00	0.16
282	002396	星网锐捷	1,397,030	27,521,491.00	0.16

283	300166	东方国信	1,321,394	27,471,781.26	0.16
284	601010	文峰股份	5,200,161	27,352,846.86	0.16
285	601717	郑煤机	3,884,433	27,307,563.99	0.16
286	002025	航天电器	1,083,543	27,305,283.60	0.16
287	300202	聚龙股份	1,108,044	27,257,882.40	0.16
288	002325	洪涛股份	3,392,101	27,170,729.01	0.16
289	600880	博瑞传播	3,083,417	27,010,732.92	0.16
290	600765	中航重机	1,880,290	26,944,555.70	0.16
291	002503	搜于特	1,872,323	26,942,727.97	0.16
292	002041	登海种业	1,416,640	26,746,163.20	0.16
293	600517	置信电气	2,734,733	26,608,952.09	0.16
294	600545	新疆城建	2,180,590	26,515,974.40	0.16
295	000848	承德露露	2,366,054	26,476,144.26	0.16
296	002707	众信旅游	1,699,700	26,430,335.00	0.16
297	600058	五矿发展	1,728,976	26,332,304.48	0.16
298	600809	山西汾酒	1,049,151	26,249,758.02	0.16
299	002244	滨江集团	3,760,296	26,246,866.08	0.16
300	600736	苏州高新	2,889,869	26,095,517.07	0.16
301	001696	宗申动力	2,773,079	26,066,942.60	0.16
302	000620	新华联	3,057,426	25,926,972.48	0.16
303	002581	未名医药	1,067,189	25,900,677.03	0.15
304	600259	广晟有色	607,993	25,833,622.57	0.15
305	002063	远光软件	1,954,807	25,686,163.98	0.15
306	000600	建投能源	2,889,466	25,658,458.08	0.15
307	002106	莱宝高科	2,279,519	25,621,793.56	0.15
308	002589	瑞康医药	789,073	25,605,418.85	0.15
309	000158	常山股份	2,047,500	25,593,750.00	0.15
310	002368	太极股份	834,793	25,553,013.73	0.15

311	002344	海宁皮城	2,253,705	25,511,940.60	0.15
312	002269	美邦服饰	5,087,117	25,486,456.17	0.15
313	000587	金洲慈航	1,712,755	25,485,794.40	0.15
314	002123	梦网荣信	1,694,104	25,411,560.00	0.15
315	600639	浦东金桥	1,369,157	25,411,553.92	0.15
316	600835	上海机电	1,299,036	25,357,182.72	0.15
317	002285	世联行	3,310,129	25,156,980.40	0.15
318	600220	江苏阳光	5,744,165	24,929,676.10	0.15
319	603077	和邦生物	4,860,156	24,883,998.72	0.15
320	000572	海马汽车	4,642,183	24,882,100.88	0.15
321	600481	双良节能	3,306,624	24,865,812.48	0.15
322	603188	亚邦股份	1,390,837	24,840,348.82	0.15
323	600282	南钢股份	7,984,279	24,751,264.90	0.15
324	600291	西水股份	1,289,300	24,728,774.00	0.15
325	000062	深圳华强	868,931	24,686,329.71	0.15
326	600433	冠豪高新	3,073,473	24,649,253.46	0.15
327	600053	九鼎投资	534,950	24,639,797.00	0.15
328	000636	风华高科	2,524,416	24,638,300.16	0.15
329	002635	安洁科技	676,690	24,631,516.00	0.15
330	002482	广田集团	2,655,042	24,559,138.50	0.15
331	600537	亿晶光电	3,305,122	24,557,056.46	0.15
332	002354	天神娱乐	354,200	24,496,472.00	0.15
333	002161	远望谷	2,122,299	24,470,107.47	0.15
334	601678	滨化股份	3,354,689	24,455,682.81	0.15
335	600993	马应龙	1,215,799	24,279,506.03	0.15
336	601777	力帆股份	2,530,243	24,189,123.08	0.14
337	600270	外运发展	1,456,090	24,083,728.60	0.14
338	002317	众生药业	1,949,796	24,079,980.60	0.14



339	000616	海航投资	4,612,640	24,077,980.80	0.14
340	300147	香雪制药	1,865,246	24,061,673.40	0.14
341	002277	友阿股份	1,673,290	24,028,444.40	0.14
342	600277	亿利洁能	3,373,100	23,982,741.00	0.14
343	300257	开山股份	1,381,765	23,711,087.40	0.14
344	600894	广日股份	1,733,833	23,701,497.11	0.14
345	300297	蓝盾股份	1,892,800	23,546,432.00	0.14
346	000669	金鸿能源	1,369,833	23,492,635.95	0.14
347	002505	大康农业	6,633,467	23,482,473.18	0.14
348	000973	佛塑科技	3,117,739	23,383,042.50	0.14
349	600859	王府井	1,433,657	23,339,935.96	0.14
350	002428	云南锗业	1,841,791	23,335,491.97	0.14
351	600805	悦达投资	2,746,429	23,317,182.21	0.14
352	000541	佛山照明	2,369,169	23,312,622.96	0.14
353	000090	天健集团	2,413,311	23,312,584.26	0.14
354	601005	重庆钢铁	9,241,300	23,288,076.00	0.14
355	000501	鄂武商 A	1,193,008	23,287,516.16	0.14
356	000726	鲁泰 A	1,811,983	23,211,502.23	0.14
357	000528	柳工	3,172,568	23,191,472.08	0.14
358	000830	鲁西化工	4,133,998	23,109,048.82	0.14
359	600580	卧龙电气	2,537,958	23,095,417.80	0.14
360	600826	兰生股份	844,982	23,084,908.24	0.14
361	600729	重庆百货	984,777	23,073,325.11	0.14
362	002690	美亚光电	1,090,319	23,071,150.04	0.14
363	600289	亿阳信通	1,781,323	23,068,132.85	0.14
364	002498	汉缆股份	5,363,510	23,063,093.00	0.14
365	002056	横店东磁	1,657,704	23,058,662.64	0.14
366	000652	泰达股份	4,163,906	22,984,761.12	0.14

367	600458	时代新材	1,619,586	22,917,141.90	0.14
368	600112	天成控股	2,076,526	22,800,255.48	0.14
369	600823	世茂股份	3,238,702	22,735,688.04	0.14
370	002128	露天煤业	2,638,454	22,690,704.40	0.14
371	002005	德豪润达	3,942,142	22,667,316.50	0.14
372	002463	沪电股份	4,730,558	22,612,067.24	0.14
373	601689	拓普集团	764,542	22,492,825.64	0.13
374	600596	新安股份	2,192,693	22,453,176.32	0.13
375	000897	津滨发展	5,217,704	22,331,773.12	0.13
376	600750	江中药业	724,201	22,319,874.82	0.13
377	002242	九阳股份	1,236,919	22,301,649.57	0.13
378	002064	华峰氨纶	4,055,566	22,265,057.34	0.13
379	002190	成飞集成	694,750	22,218,105.00	0.13
380	600006	东风汽车	3,224,505	22,184,594.40	0.13
381	600628	新世界	1,567,558	22,149,594.54	0.13
382	000680	山推股份	4,002,140	22,131,834.20	0.13
383	600141	兴发集团	1,446,672	22,003,881.12	0.13
384	000861	海印股份	4,531,336	21,976,979.60	0.13
385	600773	西藏城投	1,835,898	21,902,263.14	0.13
386	600351	亚宝药业	2,215,514	21,889,278.32	0.13
387	000969	安泰科技	2,075,654	21,877,393.16	0.13
388	002727	一心堂	1,022,200	21,670,640.00	0.13
389	000681	视觉中国	1,130,876	21,554,496.56	0.13
390	600395	盘江股份	2,666,540	21,518,977.80	0.13
391	601233	桐昆股份	1,488,325	21,372,347.00	0.13
392	002254	泰和新材	1,724,959	21,320,493.24	0.13
393	002588	史丹利	1,877,876	21,313,892.60	0.13
394	000596	古井贡酒	468,134	21,300,097.00	0.13

395	600790	轻纺城	2,954,818	21,274,689.60	0.13
396	600428	中远海特	3,462,554	21,190,830.48	0.13
397	002011	盾安环境	2,219,363	21,128,335.76	0.13
398	300032	金龙机电	1,311,600	21,103,644.00	0.13
399	002663	普邦股份	3,466,266	21,040,234.62	0.13
400	000552	靖远煤电	5,538,628	20,991,400.12	0.13
401	603198	迎驾贡酒	973,684	20,982,890.20	0.13
402	000426	兴业矿业	2,400,692	20,934,034.24	0.13
403	000049	德赛电池	497,612	20,924,584.60	0.13
404	600496	精工钢构	4,875,844	20,868,612.32	0.12
405	300039	上海凯宝	2,038,934	20,858,294.82	0.12
406	600869	智慧能源	2,686,560	20,793,974.40	0.12
407	002642	荣之联	1,033,409	20,771,520.90	0.12
408	002699	美盛文化	611,400	20,665,320.00	0.12
409	601001	大同煤业	3,374,487	20,618,115.57	0.12
410	002345	潮宏基	1,703,546	20,578,835.68	0.12
411	600720	祁连山	2,501,070	20,433,741.90	0.12
412	300043	星辉娱乐	2,004,803	20,328,702.42	0.12
413	600757	长江传媒	2,446,045	20,326,633.95	0.12
414	600850	华东电脑	840,570	20,324,982.60	0.12
415	600862	中航高科	1,642,800	20,107,872.00	0.12
416	000099	中信海直	1,711,459	20,041,184.89	0.12
417	600059	古越龙山	1,953,853	20,007,454.72	0.12
418	600329	中新药业	1,146,656	19,997,680.64	0.12
419	600563	法拉电子	544,660	19,972,682.20	0.12
420	603369	今世缘	1,519,400	19,934,528.00	0.12
421	600280	中央商场	2,315,088	19,932,907.68	0.12
422	603883	老百姓	425,020	19,827,183.00	0.12

423	601886	江河集团	1,859,651	19,805,283.15	0.12
424	600460	士兰微	3,183,210	19,799,566.20	0.12
425	000869	张裕 A	548,901	19,760,436.00	0.12
426	002371	七星电子	737,166	19,608,615.60	0.12
427	600292	远达环保	1,576,528	19,501,651.36	0.12
428	002681	奋达科技	1,504,730	19,456,158.90	0.12
429	002093	国脉科技	1,738,360	19,243,645.20	0.12
430	600831	广电网络	1,461,226	19,083,611.56	0.11
431	600586	金晶科技	4,115,796	19,056,135.48	0.11
432	000417	合肥百货	2,201,607	18,999,868.41	0.11
433	002332	仙琚制药	1,475,825	18,993,867.75	0.11
434	600657	信达地产	3,071,142	18,733,966.20	0.11
435	002342	巨力索具	2,705,568	18,695,474.88	0.11
436	600195	中牧股份	879,191	18,682,808.75	0.11
437	002029	七匹狼	1,826,393	18,647,472.53	0.11
438	000931	中关村	2,178,645	18,453,123.15	0.11
439	600825	新华传媒	2,103,939	18,283,229.91	0.11
440	600748	上实发展	2,232,210	18,281,799.90	0.11
441	601002	晋亿实业	1,915,171	18,232,427.92	0.11
442	002416	爱施德	1,229,000	18,103,170.00	0.11
443	002551	尚荣医疗	898,980	17,898,691.80	0.11
444	002309	中利科技	1,257,002	17,861,998.42	0.11
445	600551	时代出版	875,211	17,784,287.52	0.11
446	600640	号百控股	876,575	17,513,968.50	0.10
447	000877	天山股份	2,482,390	17,500,849.50	0.10
448	002251	步步高	1,059,368	17,426,603.60	0.10
449	000693	ST 华泽	1,391,501	17,393,762.50	0.10
450	002414	高德红外	755,119	17,201,610.82	0.10

451	002698	博实股份	1,104,646	17,199,338.22	0.10
452	601908	京运通	2,414,723	17,192,827.76	0.10
453	600743	华远地产	3,780,475	16,823,113.75	0.10
454	600180	瑞茂通	1,228,861	16,638,777.94	0.10
455	600776	东方通信	1,928,871	16,511,135.76	0.10
456	000919	金陵药业	1,218,875	16,491,378.75	0.10
457	603528	多伦科技	247,000	16,141,450.00	0.10
458	603169	兰石重装	1,187,978	15,871,386.08	0.09
459	600425	青松建化	3,339,961	15,530,818.65	0.09
460	600251	冠农股份	1,897,016	15,384,799.76	0.09
461	603555	贵人鸟	496,240	15,264,342.40	0.09
462	603355	莱克电气	327,760	15,132,679.20	0.09
463	002327	富安娜	1,717,428	15,113,366.40	0.09
464	603806	福斯特	325,000	15,037,750.00	0.09
465	600338	西藏珠峰	514,400	14,907,312.00	0.09
466	600864	哈投股份	1,304,504	14,897,435.68	0.09
467	002118	紫鑫药业	2,063,322	14,855,918.40	0.09
468	603001	奥康国际	647,229	14,821,544.10	0.09
469	600801	华新水泥	1,876,556	14,543,309.00	0.09
470	600335	国机汽车	1,193,595	14,502,179.25	0.09
471	601016	节能风电	1,636,700	14,484,795.00	0.09
472	600397	安源煤业	2,793,947	14,416,766.52	0.09
473	000631	顺发恒业	2,940,343	14,407,680.70	0.09
474	002315	焦点科技	237,900	14,342,991.00	0.09
475	600874	创业环保	1,753,383	14,255,003.79	0.09
476	002646	青青稞酒	724,092	13,938,771.00	0.08
477	002392	北京利尔	2,415,997	13,916,142.72	0.08
478	600483	福能股份	1,252,492	13,865,086.44	0.08

479	603005	晶方科技	460,818	13,842,972.72	0.08
480	603698	航天工程	499,419	13,778,970.21	0.08
481	603567	珍宝岛	683,650	13,508,924.00	0.08
482	000517	荣安地产	2,566,200	13,498,212.00	0.08
483	002233	塔牌集团	1,439,772	13,461,868.20	0.08
484	600618	氯碱化工	916,161	13,366,788.99	0.08
485	600184	光电股份	614,689	13,264,988.62	0.08
486	603328	依顿电子	404,318	12,930,089.64	0.08
487	603568	伟明环保	551,978	12,861,087.40	0.08
488	600971	恒源煤电	2,012,780	12,620,130.60	0.08
489	002249	大洋电机	1,427,658	12,320,688.54	0.07
490	000723	美锦能源	806,000	12,186,720.00	0.07
491	000025	特力 A	216,100	11,943,847.00	0.07
492	002194	武汉凡谷	915,696	11,775,850.56	0.07
493	600088	中视传媒	535,097	11,729,326.24	0.07
494	600468	百利电气	861,497	11,216,690.94	0.07
495	002238	天威视讯	732,070	10,724,825.50	0.06
496	002745	木林森	264,856	9,664,595.44	0.06
497	600917	重庆燃气	704,600	9,293,674.00	0.06
498	603868	飞科电器	191,600	8,978,376.00	0.05
499	600981	汇鸿集团	972,500	8,256,525.00	0.05
500	603377	东方时尚	201,700	8,142,629.00	0.05
501	603866	桃李面包	180,901	7,941,553.90	0.05
502	603025	大豪科技	191,352	7,468,468.56	0.04
503	000761	本钢板材	1,184,300	6,371,534.00	0.04

**8.3.2 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	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.00
2	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.00
3	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.00
4	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
5	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	0.00
6	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.00
7	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.00
8	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
9	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.00
10	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.00
11	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
12	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
13	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
14	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00
15	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
16	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
17	603239	N 仙通	924	29,059.80	0.00
18	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
19	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
20	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
21	603929	N 亚翔	2,193	15,592.23	0.00
22	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
23	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
24	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00

25	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
26	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
27	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
28	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002466	天齐锂业	111,707,666.00	0.55
2	300113	顺网科技	105,926,051.09	0.52
3	000748	长城信息	104,268,477.63	0.51
4	002572	索菲亚	94,023,744.77	0.46
5	002426	胜利精密	88,286,765.63	0.43
6	002131	利欧股份	82,353,536.75	0.40
7	000661	长春高新	80,552,235.40	0.39
8	300072	三聚环保	80,054,547.48	0.39
9	002508	老板电器	79,079,028.20	0.39
10	002038	双鹭药业	78,458,947.93	0.38
11	000656	金科股份	78,394,307.80	0.38
12	002310	东方园林	77,925,469.72	0.38
13	000983	西山煤电	77,088,405.06	0.38
14	300136	信维通信	76,781,438.79	0.37
15	600978	宜华生活	72,925,232.20	0.36
16	002085	万丰奥威	72,375,017.05	0.35



17	002004	华邦健康	71,698,916.62	0.35
18	300253	卫宁健康	70,657,619.14	0.35
19	002340	格林美	70,005,082.54	0.34
20	002030	达安基因	69,890,134.25	0.34

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002466	天齐锂业	223,077,786.10	1.09
2	300072	三聚环保	211,287,972.00	1.03
3	002085	万丰奥威	157,490,476.57	0.77
4	002310	东方园林	108,914,607.16	0.53
5	002049	紫光国芯	108,764,346.68	0.53
6	002299	圣农发展	103,357,740.37	0.50
7	000983	西山煤电	98,525,287.80	0.48
8	300182	捷成股份	93,507,611.93	0.46
9	000671	阳光城	90,074,438.48	0.44
10	002508	老板电器	89,779,704.84	0.44
11	002426	胜利精密	88,208,044.82	0.43
12	002714	牧原股份	86,820,923.78	0.42
13	002131	利欧股份	84,526,300.28	0.41
14	000661	长春高新	84,326,079.55	0.41
15	002405	四维图新	84,089,009.70	0.41
16	002174	游族网络	82,774,935.52	0.40

17	000887	中鼎股份	82,714,893.37	0.40
18	300085	银之杰	81,823,322.91	0.40
19	000998	隆平高科	81,061,424.77	0.40
20	600654	中安消	79,904,441.75	0.39

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	14,789,337,567.72
卖出股票收入（成交）总额	14,993,809,256.68

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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
IC1701	IC1701	561	697,569,840.00	-5,174,803.71	-
公允价值变动总额合计 (元)					-5,174,803.71
股指期货投资本期收益 (元)					109,805,163.71
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-4,555,603.71

### 8.10.2 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。

## 8.11 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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	142,866,719.64
2	应收证券清算款	3,444,542.92
3	应收股利	9,601.50
4	应收利息	250,385.74
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	146,571,249.80

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 8.12.5.2 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 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601375	中原证券	106,780.00	0.00	新股未上市
2	603228	景旺电子	80,851.56	0.00	新股未上市

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 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
11,139	229,093.03	2,476,739,798.00	97.06%	75,127,446.00	2.94%

### 9.2 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)	571,773,402.00	22.41%

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。

### 9.3 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	67.73%
2	中国人寿保险股份有限公司	75,911,844.00	2.97%
3	台湾银行股份有限公司—自有资金	10,868,700.00	0.43%
4	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	10,102,000.00	0.40%

	产管理计划		
5	信达证券股份有限公司融券专用证 券账户	8,310,091.00	0.33%
6	中国人寿保险(集团)公司	7,550,193.00	0.30%
7	中泰证券股份有限公司融券专用证 券账户	5,694,900.00	0.22%
8	民生证券股份有限公司融券专用证 券账户	5,251,334.00	0.21%
9	中国平安人寿保险股份有限公司— 传统—银保账户	4,914,446.00	0.19%
10	国投信托有限公司—国投飞天·财 富宝证券投资集合资金信托计划	4,832,400.00	0.18%
	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)	571,773,402.00	22.41%

#### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、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。

#### 9.5 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

注：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。

**§10 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	2,811,600,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	2,867,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,551,867,244.00

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据南方基金管理有限公司第七届董事会第一次会议审议通过，并按规定向中国证券监督管理委员会深圳监管局备案，基金管理人于 2016 年 10 月 20 日发布公告，自 2016 年 10 月 18 日起，张海波先生担任本基金管理人董事长，吴万善先生不再担任本基金管理人董事长。

基金管理人于 2016 年 10 月 20 日发布公告，南方基金管理有限公司（以下简称“公司”）第六届董事会任期届满，根据《公司法》、《证券投资基金管理公司管理办法》等法律法规和《公司章程》的规定，公司股东会 2016 年第一次临时会议选举产生了公司第七届董事会。

根据南方基金管理有限公司第六届董事会第二十八次会议审议通过，并按规定向中国证券投资基金业协会报备，基金管理人于 2016 年 10 月 19 日发布公告，自 2016 年 10 月 17 日起，郑文祥先生不再担任本基金管理人副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 155,000 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 4 年。



## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	19,880,885,861.07	66.80%	1,988,370.55	66.80%	-
银河证券	2	4,172,529,438.28	14.02%	417,287.97	14.02%	-
申万宏源	2	3,393,161,585.54	11.40%	339,321.76	11.40%	-
东北证券	2	2,316,465,709.28	7.78%	231,664.52	7.78%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	27,327,568.54	100.00%	948,000,000.00	82.58%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	200,000,000.00	17.42%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金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
2	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
3	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
4	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
5	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
6	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
7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	南方基金关于旗下500ETF增加民族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9月30日
13	南方基金关于旗下500ETF增加万联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11月17日
14	南方基金关于旗下380ETF和500ETF增加大同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12月22日

## §12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 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

### 12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>