

中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 06 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：2017 年 08 月 28 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 2017 年 8 月 22 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录

- 1.1 重要提示
- 1.2 目录

§ 2 基金简介

- 2.1 基金基本情况
- 2.2 基金产品说明
- 2.3 基金管理人和基金托管人
- 2.4 信息披露方式
- 2.5 其他相关资料

§ 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
- 3.2 基金净值表现
- 3.3 其他指标

§ 4 管理人报告

- 4.1 基金管理人及基金经理情况
- 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明
- 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
- 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
- 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
- 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
- 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
- 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

§ 5 托管人报告

- 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明
- 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
- 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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

- 6.1 资产负债表
- 6.2 利润表
- 6.3 所有者权益（基金净值）变动表
- 6.4 报表附注

§ 7 投资组合报告

- 7.1 期末基金资产组合情况
- 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
- 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
- 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

- 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
- 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
- 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
- 7.8 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
- 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
- 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- 7.12 投资组合报告附注

§ 8 基金份额持有人信息

- 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
- 8.2 期末上市基金前十名持有人
- 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
- 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
- 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

§ 9 开放式基金份额变动

§ 10 重大事件揭示

- 10.1 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
- 10.3 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
- 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
- 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
- 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
- 10.8 其他重大事件

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

- 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况
- 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

§ 12 备查文件目录

- 12.1 备查文件目录
- 12.2 存放地点
- 12.3 查阅方式

§ 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	2,869,467,244.00 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	北京东城区建国门内大街 69 号

	六号免税商务大厦 31-33 层	
办公地址	深圳市福田区福田街道福华一路 六号免税商务大厦 31-33 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518048	100031
法定代表人	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（2017 年 1 月 1 日-2017 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-234,087,297.48
本期利润	-120,310,810.65
加权平均基金份额本期利润	-0.0449
本期加权平均净值利润率	-0.69%
本期基金份额净值增长率	-1.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	8,292,430,514.84
期末可供分配基金份额利润	2.8899
期末基金资产净值	18,528,683,569.47
期末基金份额净值	6.4572
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2017 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	81.01%

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

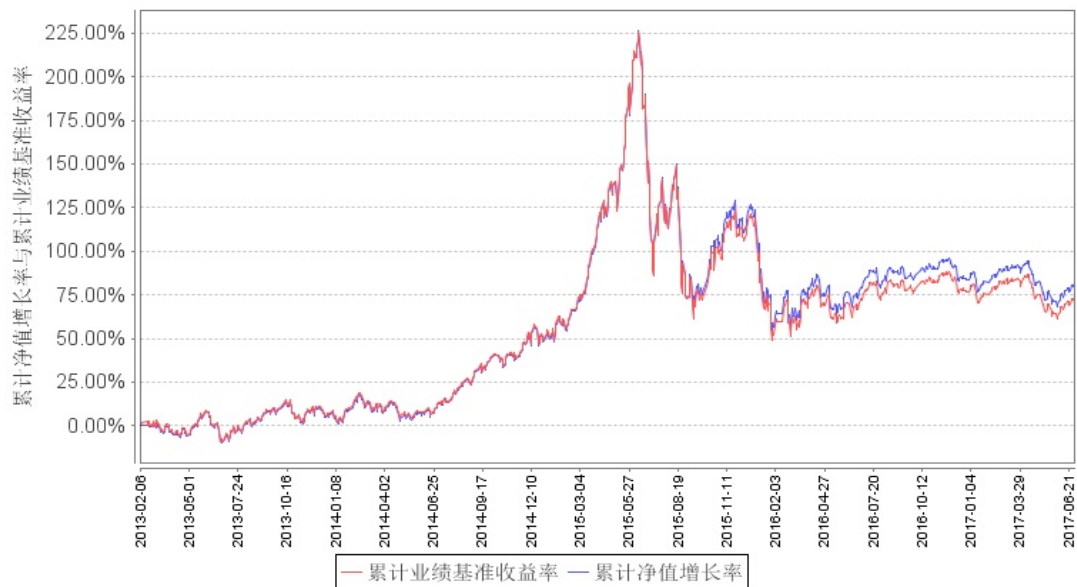
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基准收	①-③	②-④
----	------	-------	-------	---------	-----	-----

	率① (%)	标准差② (%)	准收益率③ (%)	益率标准差④ (%)	(%)	(%)
过去一个月	5.72	0.93	5.39	0.93	0.33	0.00
过去三个月	-3.66	1.02	-4.12	1.02	0.46	0.00
过去六个月	-1.50	0.90	-2.00	0.90	0.50	0.00
过去一年	0.85	0.91	0.24	0.91	0.61	0.00
过去三年	64.30	2.06	56.39	2.06	7.91	0.00
自基金合同生效起至今	81.01	1.87	73.18	1.87	7.83	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

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6,500亿元，旗下管理134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		12	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，现任指数投资部、数量化投资部负责人；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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。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。

4.3.2 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 2 次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数型基金成份股调整所致。

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 2%。

期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”、“ETF 现金流精算系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本 ETF 基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

- ①大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- ②报告期内指数成份股（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；
- ③股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；
- ④6 月中，我们根据指数每半年度成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自本基金建仓完毕至报告期末年化跟踪误差为 0.511%，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 6.4572 元，报告期内， 份额净值增长率为-1.50%，同期业绩基准增长率为-2.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内，经济面稳增长力度开始重新回升，地方债发行增速转正，特别是中长期信贷支持经济增长的力度加大，三四线房地产销售连续超预期，对下半年经济或有支撑。海外来看，美国经济复苏预期回落，美元指数偏弱，年内人民币贬值压力迅速减小，给国内的货币政策创造了较大的回旋空间。经济回落、通胀压力不大，将给权益市场带来一定的转机。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总经理、权益研究部总监、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：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的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次

数最多为 12 次，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配采取现金分红方式；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，南方基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.4.1	52,423,456.82	10,570,147.07
结算备付金		324,540,636.67	579,437,772.31
存出保证金		107,160,802.68	142,866,719.64
交易性金融资产	6.4.4.2	18,078,796,377.69	16,012,429,203.87
其中：股票投资		18,078,796,377.69	16,012,429,203.87
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	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		2,416,780.20	3,444,542.92
应收利息	6.4.4.5	175,134.92	250,385.74
应收股利		9,601.50	9,601.50
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		18,565,522,790.48	16,749,008,373.05
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016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		6,880,472.43	993,781.45
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,477,844.47	7,181,749.77
应付托管费		1,495,568.89	1,436,349.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	778,320.77	670,118.16
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	20,207,014.45	10,289,319.37
负债合计		36,839,221.01	20,571,318.73
所有者权益：			
实收基金	6.4.4.9	10,236,253,054.63	9,103,278,292.64
未分配利润	6.4.4.10	8,292,430,514.84	7,625,158,761.68
所有者权益合计		18,528,683,569.47	16,728,437,054.32
负债和所有者权益总计		18,565,522,790.48	16,749,008,373.05

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 6.4572 元，基金份额总额 28,694,672,440.00

份。

6.2 利润表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-58,843,764.79	-3,566,135,939.28
1. 利息收入		4,471,204.38	4,214,769.90
其中：存款利息收入	6.4.4.11	4,049,198.24	4,100,917.96
债券利息收入		212.07	2,185.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		421,794.07	111,666.67
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-169,727,002.47	-1,711,646,527.25
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-284,350,383.36	-1,803,775,753.61
基金投资收益	6.4.4.13	-	-
债券投资收益	6.4.4.14	155,916.93	2,424,484.56
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.4.15	-	-
衍生工具收益	6.4.4.16	15,439,463.86	-3,662,593.56
股利收益	6.4.4.17	99,028,000.10	93,367,335.36
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	113,776,486.83	-1,846,162,070.01
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.19	-7,364,453.53	-12,542,111.92
减：二、费用		61,467,045.86	68,381,983.66
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	43,284,728.85	44,217,551.49
2. 托管费	6.4.7.2.2	8,656,945.78	8,843,510.28
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.4.20	6,637,834.63	12,374,268.64
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 其他费用	6.4.4.21	2,887,536.60	2,946,653.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-120,310,810.65	-3,634,517,922.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-120,310,810.65	-3,634,517,922.94

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	9,103,278,292.64	7,625,158,761.68	16,728,437,054.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-120,310,810.65	-120,310,810.65
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,132,974,761.99	787,582,563.81	1,920,557,325.80
其中：1. 基金申购款	3,406,058,889.58	2,676,653,695.88	6,082,712,585.46
2. 基金赎回款	-2,273,084,127.59	-1,889,071,132.07	-4,162,155,259.66
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	10,236,253,054.63	8,292,430,514.84	18,528,683,569.47
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	9,301,620,223.72	11,174,292,261.42	20,475,912,485.14
二、本期经营活动	-	-3,634,517,922.94	-3,634,517,922.94

产生的基金净值变动数(本期净利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	903,240,584.99	572,085,372.38	1,475,325,957.37
其中:1.基金申购款	7,449,951,181.69	5,367,337,114.66	12,817,288,296.35
2.基金赎回款	-6,546,710,596.70	-4,795,251,742.28	-11,341,962,338.98
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	10,204,860,808.71	8,111,859,710.86	18,316,720,519.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

杨小松

徐超

徐超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

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 2017年6月30日
活期存款	52,423,456.82
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
存款期限1个月以内	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	52,423,456.82

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	18,495,865,673.20	18,078,796,377.69	-417,069,295.51
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	18,495,865,673.20	18,078,796,377.69	-417,069,295.51

注：于2017年6月30日，股票投资的公允价值和公允价值变动中包含的可退替代款的估值增值为6,980.60元

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
权益衍生工具	510,967,667.57	-	-	-
股指期货	510,967,667.57	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	510,967,667.57	-	-	-

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2017年6月30日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

股指期货投资				
代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC1707	IC1707	431.00	526,078,600.00	15,110,932.43
减：可抵销期货暂收款				15,110,932.43
股指期货投资净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.4.4 买入返售金融资产

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。

6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	15,542.28
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	158,804.87
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	787.77
合计	175,134.92

6.4.4.6 其他资产

注：无。

6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	778,320.77
银行间市场应付交易费用	-
合计	778,320.77

6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	262,821.05
应付指数使用费	1,308,159.54
应退替代款	13,990,807.22
可退替代款	4,645,226.64
合计	20,207,014.45

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

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

乘以替代数量的金额。

6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,551,867,244.00	9,103,278,292.64
本期申购	954,800,000.00	3,406,058,889.58
本期赎回（以“-”号填列）	-637,200,000.00	-2,273,084,127.59
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,869,467,244.00	10,236,253,054.63

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	12,352,052,402.33	-4,726,893,640.65	7,625,158,761.68
本期利润	-234,087,297.48	113,776,486.83	-120,310,810.65
本期基金份额交易产生的变动数	1,537,029,465.07	-749,446,901.26	787,582,563.81
其中：基金申购款	4,602,354,363.73	-1,925,700,667.85	2,676,653,695.88
基金赎回款	-3,065,324,898.66	1,176,253,766.59	-1,889,071,132.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,654,994,569.92	-5,362,564,055.08	8,292,430,514.84

6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	活期存款利息收入	300,408.90
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	3,730,052.69	
其他	18,736.65	
合计	4,049,198.24	

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 2017年1月1日至2017年6月30日

股票投资收益——买卖股票差价收入	-245,173,731.20
股票投资收益——赎回差价收入	-39,176,652.16
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-284,350,383.36

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
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	4,492,477,743.77
减：卖出股票成本总额	4,737,651,474.97
买卖股票差价收入	-245,173,731.20

6.4.4.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
赎回基金份额对价总额	4,162,155,259.66
减：现金支付赎回款总额	2,255,075,622.66
减：赎回股票成本总额	1,946,256,289.16
赎回差价收入	-39,176,652.16

6.4.4.13 基金投资收益

注：无。

6.4.4.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,622,129.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,466,000.00
减：应收利息总额	212.07
买卖债券差价收入	155,916.93

6.4.4.15 贵金属投资收益

注：无。

6.4.4.16 衍生工具收益

6.4.4.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.4.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2017年1月1日至2017年6月30日
股指期货-投资收益	15,439,463.86

6.4.4.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	99,028,000.10
基金投资产生的股利收益	-
合计	99,028,000.10

6.4.4.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	93,490,750.69
股票投资	93,490,750.69
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	20,285,736.14
权证投资	-
股指期货	20,285,736.14
其他	-
合计	113,776,486.83

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5,553.60元。

6.4.4.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-7,364,453.53
合计	-7,364,453.53

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

6.4.4.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	6,637,834.63
银行间市场交易费用	-
合计	6,637,834.63

6.4.4.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	84,300.75
信息披露费	148,767.52
账户维护费	100.00
指数使用费	2,597,083.73
银行费用	27,531.82
上市费	29,752.78
合计	2,887,536.60

注：：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的0.03%的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币50,000元。

6.4.4.22 分部报告

无。

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

截止财务报表报出日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

6.4.6 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
南方中证500交易型开放式指数证券投资基金	本基金的基金管理人管理的其他基金

联接基金(LOF) (“南方中证 500ETF 联接基金”)

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	4,957,958,722.96	47.58	11,421,856,394.09	62.76

6.4.7.1.2 权证交易

注：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 2017年1月1日至2017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	493,332.60	47.45	418,361.43	53.75
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例(%)	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金 总额的比例(%)
华泰证券	1,142,377.29	62.77	500,603.54	49.16

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

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

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至 2017年6月30日	2016年1月1日至 2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	43,284,728.85	44,217,551.49
其中：支付销售机构的客户维护费	1,161,924.75	3,027.08

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。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至 2017年6月30日	2016年1月1日至 2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	8,656,945.78	8,843,510.28

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。

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

注：无。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：人民币元

关联方名称	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016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	641,173,402.00	21.40	571,773,402.00	22.41
----------------	----------------	-------	----------------	-------

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

6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
中国农业银行股份有限公司	52,423,456.82	300,408.90	59,158,424.52	801,237.20

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

注：无。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 利润分配情况

注：无。

6.4.9 期末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：)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新股认购	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新股认购	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新股认购	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新股认购	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新股认购	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新股认购	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新股认购	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
--------	------	------------	------------	------	-------	-------	-----	-----------	-----------	---

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。

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
000656	金科股份	2017-05-05	重大资产重组	6.54	2017-7-5	5.92	16,095,269	78,000,406.32	105,263,059.26	-
600643	爱建集团	2017-04-17	重大资产重组	14.98	2017-8-2	16.48	5,715,054	71,886,701.27	85,611,508.92	-
002168	深圳惠程	2017-01-23	重大资产重组	16.99	-	-	3,435,299	42,006,398.16	58,365,730.01	-
300088	长信科技	2016-09-12	重大资产重组	15.75	-	-	3,427,002	42,624,978.05	53,975,281.50	-
600673	东阳光科	2016-11-15	重大资产重组	7.29	-	-	7,204,900	54,331,720.97	52,523,721.00	-
600655	豫园商城	2016-12-20	重大资产重组	11.32	-	-	4,046,523	54,007,852.11	45,806,640.36	-
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项	10.33	2017-8-2	11.36	4,297,798	43,538,882.85	44,396,253.34	-
002127	南极电商	2017-06-29	重大事项	12.08	2017-7-6	12.61	3,451,464	40,828,008.24	41,693,685.12	-
300134	大富科技	2017-02-09	重大资产重组	23.36	-	-	1,692,850	46,199,668.52	39,544,976.00	-
002399	海普瑞	2017-04-28	重大事项	20.23	-	-	1,610,100	30,202,382.06	32,572,323.00	-
601717	XD郑煤机	2017-04-24	重大资产重组	7.79	-	-	3,853,033	27,433,438.25	30,015,127.07	-
000061	农产品	2017-06-28	重大资产重组	9.06	-	-	3,056,219	27,092,626.46	27,689,344.14	-
600545	新疆城建	2017-06-22	重要事项未公告	11.96	2017-7-3	12.44	2,414,890	25,607,169.42	28,882,084.40	-
002358	森源电气	2017-05-12	重大资产重组	17.02	2017-7-12	16.68	1,643,727	28,612,916.25	27,976,233.54	-
002025	航天电器	2016-09-12	重大事项	24.95	2017-7-4	22.46	1,083,543	24,232,342.48	27,034,397.85	-
60027	亿利	2017-	重大资	7.83	-	-	3,364,8	22,119,901.03	26,346,384.00	-

7	洁能	03-06	产重组				00			
300291	华录百纳	2017-04-19	重大资产重组	20.02	-	-	1,315,789	34,802,734.37	26,342,095.78	-
002642	荣之联	2017-04-10	重大事项	25.06	2017-7-7	22.54	1,031,109	28,695,401.86	25,839,591.54	-
002122	天马股份	2017-04-24	重大资产重组	10.30	2017-7-24	11.15	2,466,228	19,928,898.43	25,402,148.40	-
002505	大康农业	2017-03-13	重大资产重组	3.50	-	-	6,845,367	24,659,951.65	23,958,784.50	-
002128	露天煤业	2017-03-17	重大资产重组	8.70	-	-	2,702,054	23,255,396.76	23,507,869.80	-
002681	奋达科技	2017-06-22	重大事项	12.59	2017-7-3	12.70	1,709,530	26,240,904.50	21,522,982.70	-
600460	士兰微	2017-05-12	重大资产重组	6.07	-	-	3,415,910	22,660,471.84	20,734,573.70	-
000099	中信海直	2017-05-04	重大资产重组	11.26	-	-	1,828,159	23,644,214.19	20,585,070.34	-
600289	XD 亿阳信	2017-05-10	重要事项未公告	10.94	-	-	1,872,908	26,743,041.95	20,489,613.52	-
601001	大同煤业	2017-06-22	重要事项未公告	5.25	2017-7-21	5.78	3,762,787	22,639,582.96	19,754,631.75	-
000693	*ST 华泽	2016-03-01	重大事项	12.50	-	-	1,391,501	25,507,720.76	17,393,762.50	-
600657	信达地产	2017-02-20	重大资产重组	5.76	-	-	3,018,742	17,636,558.93	17,387,953.92	-
600468	百利电气	2017-05-16	重大资产重组	6.50	-	-	1,386,272	13,518,559.53	9,010,768.00	-
000662	天夏智慧	2017-06-05	重大资产重组	16.00	-	-	395,000	6,283,726.18	6,320,000.00	-
603501	韦尔股份	2017-06-05	重大资产重组	20.15	-	-	57	400.14	1,148.55	-

注：：本基金截至 2017 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

无。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证 500 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数

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

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

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

6.4.10.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，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 2017 年 6 月 30 日，本基金无债券投资。

6.4.10.3 流动性风险

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 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 2017 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。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.10.4 市场风险

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

6.4.10.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2017年6月30日					
资产					
银行存款	52,423,456.82	-	-	-	52,423,456.82
结算备付金	324,540,636.67	-	-	-	324,540,636.67
存出保证金	1,945,082.68	-	-	105,215,720.00	107,160,802.68
交易性金融资产	-	-	-	18,078,796.377.69	18,078,796,377.69
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	175,134.92	175,134.92
应收股利	-	-	-	9,601.50	9,601.50
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-2,416,780.20	2,416,780.20
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	378,909,176.17	-	-	18,186,613,614.31	18,565,522,790.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-7,477,844.47	7,477,844.47
应付托管费	-	-	-	-1,495,568.89	1,495,568.89
应付证券清算款	-	-	-	-6,880,472.43	6,880,472.43
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-778,320.77	778,320.77
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	20,207,014.45	20,207,014.45
负债总计	-	-	-	36,839,221.01	36,839,221.01
利率敏感度缺口	378,909,176.17	-	-	18,149,774,393.30	18,528,683,569.47
上年度末 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	-	-	-	-16,012,429,203.8	16,012,429,203.8

				03.87	7
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

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

6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此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 其他价格风险

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

本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，中证 500 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.10.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016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	18,078,796,377.69	97.57	16,012,429,203.87	95.72
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	18,078,796,377.69	97.57	16,012,429,203.87	95.72

6.4.10.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	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(2017年 6月30日)	上年度末(2016 年12月31日)
分析	1. 中证500指数上升5%	增加94,359.00	增加82,710.00
	2. 中证500指数下降5%	减少94,359.00	减少82,710.00

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《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》的规定:(1)金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益),不征收增值税;(2)纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期,不属于金融商品转让;(3)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。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外,根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1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。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 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	18,078,796,377.69	97.38
	其中：股票	18,078,796,377.69	97.38
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	376,964,093.49	2.03
-	-	-	-
-	其他各项资产	109,762,319.30	0.59
-	合计	18,565,522,790.48	100.00

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

7.2 报告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

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（指数投资部分）

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	226,223,813.97	1.22
B	采矿业	566,342,331.74	3.06
C	制造业	11,153,127,064.81	60.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	620,946,554.93	3.35
E	建筑业	408,439,058.08	2.20
F	批发和零售业	938,251,480.85	5.06
G	交通运输、仓储和邮政业	479,902,583.62	2.59
H	住宿和餐饮业	19,568,639.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,238,939,476.25	6.69
J	金融业	264,202,478.48	1.43
K	房地产业	1,120,728,812.34	6.05

L	租赁和商务服务业	338,406,149.41	1.83
M	科学研究和技术服务业	43,855,787.59	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	157,236,516.56	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	21,272,181.00	0.11
Q	卫生和社会工作	46,553,690.04	0.25
R	文化、体育和娱乐业	206,742,264.79	1.12
S	综合	83,343,252.45	0.45
	合计	17,934,082,135.91	96.79

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	17,393,762.50	0.09
C	制造业	127,305,859.06	0.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	144,707,261.18	0.78

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300136	信维通信	3,550,478	142,090,129.56	0.77
2	002460	赣锋锂业	2,384,800	110,297,000.00	0.60
3	600487	亨通光电	3,914,845	109,811,402.25	0.59
4	000656	金科股份	16,095,269	105,263,059.26	0.57
5	002572	索菲亚	2,494,326	102,267,366.00	0.55
6	600201	生物股份	2,765,602	98,372,463.14	0.53
7	601012	隆基股份	5,399,372	92,329,261.20	0.50
8	300156	神雾环保	2,733,350	89,544,546.00	0.48
9	002271	东方雨虹	2,395,298	88,865,555.80	0.48
10	600176	中国巨石	7,898,595	86,726,573.10	0.47
11	600643	爱建集团	5,715,054	85,611,508.92	0.46
12	600219	南山铝业	25,039,070	84,882,447.30	0.46
13	603799	华友钴业	1,335,600	81,177,768.00	0.44
14	600525	长园集团	5,936,513	80,677,211.67	0.44
15	002405	四维图新	4,049,880	80,025,628.80	0.43
16	600079	人福医药	4,055,096	79,560,983.52	0.43
17	600315	上海家化	2,436,700	79,070,915.00	0.43
18	000661	长春高新	611,783	78,987,303.13	0.43
19	000050	深天马 A	3,797,419	78,112,908.83	0.42
20	600642	申能股份	12,316,400	77,593,320.00	0.42
21	000998	隆平高科	3,397,436	74,811,540.72	0.40
22	002092	中泰化学	5,817,556	73,882,961.20	0.40
23	002340	格林美	12,058,235	72,952,321.75	0.39
24	000066	长城电脑	7,979,952	71,899,367.52	0.39
25	300115	长盈精密	2,438,062	71,142,649.16	0.38
26	300266	兴源环境	2,298,702	70,616,125.44	0.38
27	600584	长电科技	4,399,053	70,604,800.65	0.38
28	300296	利亚德	3,678,712	69,159,785.60	0.37
29	000997	新大陆	2,967,427	67,330,918.63	0.36
30	002050	三花智控	4,060,180	66,262,137.60	0.36
31	601168	西部矿业	8,607,543	66,192,005.67	0.36
32	600516	方大炭素	4,649,224	66,111,965.28	0.36
33	600291	西水股份	2,962,500	65,175,000.00	0.35
34	600879	航天电子	7,364,692	64,735,642.68	0.35

35	002422	科伦药业	3,893,071	64,313,532.92	0.35
36	000786	北新建材	4,032,411	63,873,390.24	0.34
37	600325	华发股份	7,638,849	63,784,389.15	0.34
38	600056	中国医药	2,419,122	62,776,215.90	0.34
39	002407	多氟多	2,833,200	62,302,068.00	0.34
40	600266	北京城建	4,243,100	61,694,674.00	0.33
41	000039	中集集团	3,415,900	61,588,677.00	0.33
42	600022	山东钢铁	29,599,710	60,975,402.60	0.33
43	000778	新兴铸管	9,006,001	60,340,206.70	0.33
44	600839	四川长虹	16,658,822	60,304,935.64	0.33
45	600426	华鲁恒升	5,124,429	60,160,796.46	0.32
46	600166	福田汽车	21,069,802	59,838,237.68	0.32
47	600388	龙净环保	3,852,222	59,825,007.66	0.32
48	600521	华海药业	2,822,759	59,390,849.36	0.32
49	000581	威孚高科	2,270,097	58,795,512.30	0.32
50	600161	天坛生物	1,512,043	58,682,388.83	0.32
51	600435	北方导航	4,026,336	57,616,868.16	0.31
52	600528	中铁工业	4,005,543	57,239,209.47	0.31
53	002410	广联达	3,035,236	57,062,436.80	0.31
54	000970	中科三环	3,837,173	56,713,416.94	0.31
55	000999	华润三九	1,757,880	55,812,690.00	0.30
56	002217	合力泰	5,643,920	55,761,929.60	0.30
57	002179	中航光电	1,778,664	55,476,530.16	0.30
58	600699	均胜电子	1,721,591	55,245,855.19	0.30
59	600600	青岛啤酒	1,573,314	55,223,321.40	0.30
60	600138	中青旅	2,609,099	54,947,624.94	0.30
61	002366	台海核电	1,169,347	54,854,067.77	0.30
62	000028	国药一致	673,373	54,475,875.70	0.29
63	002573	清新环境	2,886,806	54,329,688.92	0.29
64	300088	长信科技	3,427,002	53,975,281.50	0.29
65	002038	双鹭药业	1,846,815	53,834,657.25	0.29
66	600978	宜华生活	5,347,726	53,744,646.30	0.29
67	601000	唐山港	10,279,141	53,657,116.02	0.29
68	002223	鱼跃医疗	2,265,030	53,635,910.40	0.29
69	300383	光环新网	3,911,400	53,038,584.00	0.29
70	600673	东阳光科	7,204,900	52,523,721.00	0.28
71	600614	鹏起科技	4,771,427	52,485,697.00	0.28
72	603589	口子窖	1,352,671	52,470,108.09	0.28
73	002311	海大集团	2,858,087	52,217,249.49	0.28
74	600158	中体产业	3,052,219	52,192,944.90	0.28
75	000488	晨鸣纸业	4,015,384	51,798,453.60	0.28
76	300002	神州泰岳	6,194,806	51,664,682.04	0.28

77	002583	海能达	3,144,900	50,601,441.00	0.27
78	000878	云南铜业	3,833,487	50,563,693.53	0.27
79	002078	太阳纸业	6,859,620	50,418,207.00	0.27
80	300113	顺网科技	1,872,203	50,362,260.70	0.27
81	002004	华邦健康	6,430,065	50,347,408.95	0.27
82	600260	凯乐科技	1,986,133	50,328,610.22	0.27
83	300055	万邦达	2,731,643	50,262,231.20	0.27
84	600511	国药股份	1,383,849	50,150,687.76	0.27
85	600503	华丽家族	7,236,000	50,000,760.00	0.27
86	002030	达安基因	2,293,600	49,977,544.00	0.27
87	002019	亿帆医药	2,983,969	49,772,602.92	0.27
88	002273	水晶光电	2,400,649	49,525,388.87	0.27
89	603019	中科曙光	1,742,650	49,038,171.00	0.26
90	000400	许继电气	2,728,700	49,007,452.00	0.26
91	002244	滨江集团	7,013,396	48,532,700.32	0.26
92	600392	盛和资源	3,655,901	48,221,334.19	0.26
93	000566	海南海药	3,621,197	48,017,072.22	0.26
94	600298	安琪酵母	1,854,501	47,975,940.87	0.26
95	600755	厦门国贸	5,250,243	47,882,216.16	0.26
96	600808	马钢股份	13,468,049	47,676,893.46	0.26
97	002384	东山精密	1,929,973	47,670,333.10	0.26
98	600635	大众公用	8,726,126	47,557,386.70	0.26
99	002001	新和成	2,449,000	47,535,090.00	0.26
100	600717	天津港	3,785,800	47,284,642.00	0.26
101	000547	航天发展	4,523,780	47,273,501.00	0.26
102	300324	旋极信息	2,589,279	47,228,448.96	0.25
103	000930	中粮生化	4,354,901	46,945,832.78	0.25
104	000401	冀东水泥	3,046,862	46,891,206.18	0.25
105	000418	小天鹅 A	1,001,863	46,877,169.77	0.25
106	600240	华业资本	5,145,557	46,618,746.42	0.25
107	300244	迪安诊断	1,479,774	46,553,690.04	0.25
108	601231	环旭电子	2,948,159	46,315,577.89	0.25
109	600122	宏图高科	4,165,044	46,231,988.40	0.25
110	002176	江特电机	5,296,100	46,181,992.00	0.25
111	600160	巨化股份	3,819,368	45,946,997.04	0.25
112	600872	中炬高新	2,510,588	45,943,760.40	0.25
113	002491	通鼎互联	3,414,500	45,890,880.00	0.25
114	600655	豫园商城	4,046,523	45,806,640.36	0.25
115	300146	汤臣倍健	3,314,800	45,545,352.00	0.25
116	600633	浙数文化	2,354,700	45,492,804.00	0.25
117	000598	兴蓉环境	8,079,000	45,403,980.00	0.25
118	300058	蓝色光标	5,803,900	45,386,498.00	0.24

119	002439	启明星辰	2,436,090	45,311,274.00	0.24
120	000960	锡业股份	3,317,856	45,156,020.16	0.24
121	600418	江淮汽车	4,272,579	45,075,708.45	0.24
122	002601	佰利联	2,751,100	45,063,018.00	0.24
123	600062	华润双鹤	1,638,981	44,957,248.83	0.24
124	600500	中化国际	4,695,169	44,885,815.64	0.24
125	000825	太钢不锈	10,277,400	44,706,690.00	0.24
126	300159	新研股份	3,359,972	44,486,029.28	0.24
127	600409	三友化工	4,415,017	44,459,221.19	0.24
128	002013	中航机电	4,297,798	44,396,253.34	0.24
129	002408	齐翔腾达	4,001,532	44,336,974.56	0.24
130	600143	金发科技	7,347,873	44,307,674.19	0.24
131	002400	省广股份	5,504,900	44,204,347.00	0.24
132	000685	中山公用	3,988,047	43,669,114.65	0.24
133	600594	益佰制药	2,859,671	43,638,579.46	0.24
134	002354	天神娱乐	2,028,987	43,623,220.50	0.24
135	000078	海王生物	7,175,175	43,266,305.25	0.23
136	000089	深圳机场	4,621,700	43,212,895.00	0.23
137	000513	丽珠集团	630,512	42,937,867.20	0.23
138	000729	燕京啤酒	6,363,200	42,760,704.00	0.23
139	000979	中弘股份	16,231,004	42,525,230.48	0.23
140	601699	潞安环能	5,394,800	42,187,336.00	0.23
141	600312	平高电气	3,068,428	42,160,200.72	0.23
142	600811	东方集团	6,451,040	42,060,780.80	0.23
143	000926	福星股份	3,423,840	41,770,848.00	0.23
144	002127	南极电商	3,451,464	41,693,685.12	0.23
145	600967	内蒙一机	3,056,425	41,659,072.75	0.22
146	600884	杉杉股份	2,527,682	41,630,922.54	0.22
147	002051	中工国际	2,006,783	41,600,611.59	0.22
148	300122	智飞生物	2,167,346	41,417,982.06	0.22
149	600566	济川药业	1,089,056	41,416,799.68	0.22
150	000697	炼石有色	2,018,936	41,327,619.92	0.22
151	601880	大连港	13,954,037	41,303,949.52	0.22
152	600970	中材国际	4,746,034	41,243,035.46	0.22
153	002431	棕榈股份	3,734,635	41,155,677.70	0.22
154	002640	跨境通	1,934,800	41,114,500.00	0.22
155	000690	宝新能源	6,869,612	41,080,279.76	0.22
156	000988	华工科技	2,815,130	41,072,746.70	0.22
157	600026	中远海能	6,169,750	40,905,442.50	0.22
158	002373	千方科技	2,993,784	40,835,213.76	0.22
159	600120	浙江东方	1,517,803	40,798,544.64	0.22
160	002701	奥瑞金	6,378,242	40,756,966.38	0.22

161	600809	山西汾酒	1,167,551	40,502,344.19	0.22
162	600499	科达洁能	5,100,643	40,499,105.42	0.22
163	600307	酒钢宏兴	14,134,300	40,282,755.00	0.22
164	600183	生益科技	3,263,792	40,275,193.28	0.22
165	000806	银河生物	2,981,500	40,250,250.00	0.22
166	002390	信邦制药	4,608,680	40,141,602.80	0.22
167	600664	哈药股份	6,877,011	39,955,433.91	0.22
168	002221	东华能源	3,658,128	39,910,176.48	0.22
169	002048	宁波华翔	1,909,875	39,839,992.50	0.22
170	002512	达华智能	2,463,900	39,791,985.00	0.21
171	000600	建投能源	3,228,666	39,615,731.82	0.21
172	300134	大富科技	1,692,850	39,544,976.00	0.21
173	300253	卫宁健康	5,053,880	39,470,802.80	0.21
174	600881	亚泰集团	7,767,913	39,460,998.04	0.21
175	600094	大名城	5,142,648	39,444,110.16	0.21
176	600863	内蒙华电	13,097,900	39,424,679.00	0.21
177	600787	中储股份	4,963,841	39,263,982.31	0.21
178	600572	康恩贝	5,665,313	39,203,965.96	0.21
179	000012	南玻 A	4,145,654	38,678,951.82	0.21
180	002191	劲嘉股份	4,124,002	38,600,658.72	0.21
181	000592	平潭发展	6,969,602	38,472,203.04	0.21
182	300026	红日药业	8,154,801	38,409,112.71	0.21
183	002028	思源电气	2,409,109	38,401,197.46	0.21
184	002665	首航节能	5,331,695	38,388,204.00	0.21
185	600874	创业环保	1,958,883	38,335,340.31	0.21
186	000667	美好置业	11,543,197	38,207,982.07	0.21
187	000816	智慧农业	5,128,010	38,152,394.40	0.21
188	300166	东方国信	2,840,070	38,142,140.10	0.21
189	002635	安洁科技	1,051,335	38,079,353.70	0.21
190	002603	以岭药业	2,175,954	37,992,156.84	0.21
191	002444	巨星科技	2,434,388	37,927,765.04	0.20
192	600478	科力远	4,397,447	37,862,018.67	0.20
193	300001	特锐德	2,253,700	37,772,012.00	0.20
194	002477	雏鹰农牧	8,486,497	37,595,181.71	0.20
195	000006	深振业 A	4,265,554	37,579,530.74	0.20
196	000732	泰禾集团	2,250,341	37,535,687.88	0.20
197	600017	日照港	8,324,722	37,461,249.00	0.20
198	000758	中色股份	5,326,830	37,341,078.30	0.20
199	000975	银泰资源	2,931,003	37,018,567.89	0.20
200	000031	中粮地产	4,910,890	36,979,001.70	0.20
201	600125	铁龙物流	4,121,724	36,930,647.04	0.20
202	603077	和邦生物	7,245,256	36,878,353.04	0.20

203	600064	南京高科	2,438,451	36,820,610.10	0.20
204	600348	阳泉煤业	5,421,265	36,756,176.70	0.20
205	002672	东江环保	2,171,495	36,676,550.55	0.20
206	000158	常山股份	2,298,800	36,321,040.00	0.20
207	600565	迪马股份	6,579,700	36,254,147.00	0.20
208	000939	凯迪生态	7,094,788	36,183,418.80	0.20
209	000027	深圳能源	5,364,042	36,100,002.66	0.19
210	000563	陕国投 A	6,968,820	36,028,799.40	0.19
211	000860	顺鑫农业	1,796,754	35,953,047.54	0.19
212	002250	联化科技	2,501,161	35,766,602.30	0.19
213	300287	飞利信	3,880,800	35,625,744.00	0.19
214	600198	大唐电信	2,785,762	35,574,180.74	0.19
215	600597	光明乳业	2,775,812	35,391,603.00	0.19
216	300274	阳光电源	3,185,004	35,321,694.36	0.19
217	600410	华胜天成	3,982,465	35,284,639.90	0.19
218	002261	拓维信息	3,012,557	35,277,042.47	0.19
219	300116	坚瑞消防	3,279,943	35,259,387.25	0.19
220	000877	天山股份	2,779,690	35,218,672.30	0.19
221	002468	艾迪西	1,381,743	35,110,089.63	0.19
222	600416	湘电股份	2,555,769	35,014,035.30	0.19
223	002308	威创股份	2,672,407	34,874,911.35	0.19
224	002266	浙富控股	7,145,526	34,870,166.88	0.19
225	000727	华东科技	12,257,100	34,687,593.00	0.19
226	603766	隆鑫通用	4,763,943	34,681,505.04	0.19
227	600687	刚泰控股	2,684,500	34,576,360.00	0.19
228	002517	恺英网络	977,600	34,401,744.00	0.19
229	600200	江苏吴中	2,599,799	34,317,346.80	0.19
230	600582	XD 天地科	7,463,800	34,258,842.00	0.18
231	002002	鸿达兴业	4,372,660	34,237,927.80	0.18
232	002353	杰瑞股份	2,158,300	34,144,306.00	0.18
233	601929	吉视传媒	9,827,205	34,002,129.30	0.18
234	600039	四川路桥	8,170,284	33,988,381.44	0.18
235	601928	凤凰传媒	3,443,400	33,607,584.00	0.18
236	600557	康缘药业	2,017,120	33,504,363.20	0.18
237	600466	蓝光发展	3,846,664	33,196,710.32	0.18
238	000712	锦龙股份	2,027,788	33,194,889.56	0.18
239	601689	拓普集团	990,342	33,166,553.58	0.18
240	600282	南钢股份	8,934,979	33,148,772.09	0.18
241	002396	星网锐捷	1,708,830	33,065,860.50	0.18
242	600751	天海投资	5,811,107	33,065,198.83	0.18
243	600086	东方金钰	3,052,255	32,994,876.55	0.18
244	603000	人民网	2,487,500	32,760,375.00	0.18

245	300257	开山股份	1,551,665	32,709,098.20	0.18
246	002544	杰赛科技	1,432,901	32,670,142.80	0.18
247	600380	XD 健康元	3,579,282	32,499,880.56	0.18
248	002375	亚厦股份	3,630,600	32,348,646.00	0.17
249	000501	鄂武商 A	1,747,620	32,261,065.20	0.17
250	002670	国盛金控	2,022,624	32,159,721.60	0.17
251	002022	科华生物	1,845,544	32,057,099.28	0.17
252	600151	航天机电	3,876,490	31,903,512.70	0.17
253	000830	鲁西化工	4,621,798	31,890,406.20	0.17
254	000519	江南红箭	2,528,086	31,853,883.60	0.17
255	300199	翰宇药业	2,071,463	31,776,242.42	0.17
256	002268	卫士通	1,887,480	31,747,413.60	0.17
257	002440	闰土股份	2,076,208	31,682,934.08	0.17
258	002281	光迅科技	1,419,447	31,540,112.34	0.17
259	002589	瑞康医药	2,035,758	31,350,673.20	0.17
260	002489	浙江永强	4,909,189	31,320,625.82	0.17
261	600648	外高桥	1,690,000	31,298,800.00	0.17
262	000703	恒逸石化	2,194,711	31,252,684.64	0.17
263	600169	太原重工	8,091,792	31,234,317.12	0.17
264	600611	大众交通	5,643,599	31,152,666.48	0.17
265	600316	洪都航空	1,938,251	31,147,693.57	0.17
266	002155	湖南黄金	3,249,716	31,099,782.12	0.17
267	600694	大商股份	797,035	31,060,453.95	0.17
268	600270	外运发展	1,638,790	31,022,294.70	0.17
269	600759	洲际油气	5,112,486	30,981,665.16	0.17
270	002368	太极股份	1,118,047	30,958,721.43	0.17
271	600366	宁波韵升	1,754,194	30,943,982.16	0.17
272	600835	上海机电	1,456,563	30,791,741.82	0.17
273	000528	柳工	3,555,468	30,719,243.52	0.17
274	002657	中科金财	1,058,056	30,673,043.44	0.17
275	002342	巨力索具	3,036,968	30,582,267.76	0.17
276	600267	海正药业	2,610,204	30,487,182.72	0.16
277	000612	焦作万方	3,772,743	30,370,581.15	0.16
278	600108	亚盛集团	7,027,900	30,290,249.00	0.16
279	002709	天赐材料	734,400	30,235,248.00	0.16
280	300273	和佳股份	2,482,469	30,186,823.04	0.16
281	600187	国中水务	5,963,318	30,114,755.90	0.16
282	601717	XD 郑煤机	3,853,033	30,015,127.07	0.16
283	600563	法拉电子	607,316	30,007,483.56	0.16
284	000090	天健集团	2,700,611	29,976,782.10	0.16
285	600645	中源协和	1,393,513	29,862,983.59	0.16
286	601678	滨化股份	4,289,789	29,814,033.55	0.16

287	002503	搜于特	4,229,946	29,736,520.38	0.16
288	600993	马应龙	1,360,699	29,636,024.22	0.16
289	002285	世联行	3,694,929	29,633,330.58	0.16
290	600848	上海临港	1,369,875	29,534,505.00	0.16
291	600729	重庆百货	1,094,677	29,381,130.68	0.16
292	000937	冀中能源	4,781,300	29,261,556.00	0.16
293	600098	广州发展	3,693,800	29,217,958.00	0.16
294	600765	中航重机	2,106,290	29,024,676.20	0.16
295	600545	新疆城建	2,414,890	28,882,084.40	0.16
296	002437	誉衡药业	3,963,383	28,853,428.24	0.16
297	002325	洪涛股份	3,925,801	28,658,347.30	0.15
298	000049	德赛电池	553,112	28,656,732.72	0.15
299	000587	金洲慈航	1,913,155	28,506,009.50	0.15
300	000021	深科技	3,315,964	28,450,971.12	0.15
301	000810	创维数字	2,338,800	28,369,644.00	0.15
302	600073	上海梅林	2,964,837	28,314,193.35	0.15
303	600750	江中药业	814,351	28,298,697.25	0.15
304	300376	易事特	3,117,900	28,279,353.00	0.15
305	000543	皖能电力	4,846,456	28,254,838.48	0.15
306	600422	昆药集团	2,484,878	28,178,516.52	0.15
307	600300	维维股份	5,274,387	28,165,226.58	0.15
308	002018	华信国际	4,111,192	28,161,665.20	0.15
309	002249	大洋电机	4,278,258	28,150,937.64	0.15
310	002011	盾安环境	2,476,043	28,103,088.05	0.15
311	603444	吉比特	99,000	28,049,670.00	0.15
312	000829	天音控股	2,596,335	28,040,418.00	0.15
313	002358	森源电气	1,643,727	27,976,233.54	0.15
314	000669	金鸿能源	1,537,902	27,882,163.26	0.15
315	600639	浦东金桥	1,537,157	27,853,284.84	0.15
316	002056	横店东磁	3,712,416	27,843,120.00	0.15
317	000766	通化金马	1,734,512	27,717,501.76	0.15
318	000061	农产品	3,056,219	27,689,344.14	0.15
319	000777	中核科技	1,383,864	27,621,925.44	0.15
320	601016	节能风电	7,485,300	27,545,904.00	0.15
321	000897	津滨发展	5,844,804	27,470,578.80	0.15
322	000636	风华高科	3,225,516	27,449,141.16	0.15
323	002317	众生药业	2,208,196	27,425,794.32	0.15
324	603188	亚邦股份	1,562,438	27,248,918.72	0.15
325	002242	九阳股份	1,385,219	27,247,257.73	0.15
326	601311	骆驼股份	1,910,267	27,049,380.72	0.15
327	000572	海马汽车	5,202,583	26,897,354.11	0.15
328	600284	浦东建设	2,495,706	26,753,968.32	0.14

329	000762	西藏矿业	1,875,861	26,580,950.37	0.14
330	600259	广晟有色	680,493	26,566,446.72	0.14
331	600651	飞乐音响	3,134,746	26,551,298.62	0.14
332	000848	承德露露	2,647,254	26,419,594.92	0.14
333	600770	综艺股份	3,519,633	26,397,247.50	0.14
334	600277	亿利洁能	3,364,800	26,346,384.00	0.14
335	300291	华录百纳	1,315,789	26,342,095.78	0.14
336	600496	精工钢构	5,448,204	26,314,825.32	0.14
337	000596	古井贡酒	515,934	26,286,837.30	0.14
338	600587	新华医疗	1,468,354	26,107,334.12	0.14
339	000062	深圳华强	981,931	26,050,629.43	0.14
340	002123	梦网荣信	2,337,688	25,971,713.68	0.14
341	002642	荣之联	1,031,109	25,839,591.54	0.14
342	600216	浙江医药	2,602,736	25,793,113.76	0.14
343	002106	莱宝高科	2,543,119	25,761,795.47	0.14
344	002479	富春环保	2,157,235	25,671,096.50	0.14
345	600536	中国软件	1,337,699	25,630,312.84	0.14
346	002254	泰和新材	1,926,159	25,617,914.70	0.14
347	002276	万马股份	2,537,742	25,605,816.78	0.14
348	002064	华峰氨纶	5,289,366	25,494,744.12	0.14
349	300010	立思辰	1,965,080	25,447,786.00	0.14
350	002122	天马股份	2,466,228	25,402,148.40	0.14
351	002428	云南锗业	2,363,191	25,238,879.88	0.14
352	002073	软控股份	2,968,282	25,171,031.36	0.14
353	002482	广田集团	2,798,542	25,158,892.58	0.14
354	002707	众信旅游	1,899,400	24,939,122.00	0.13
355	002332	仙琚制药	2,895,837	24,904,198.20	0.13
356	600458	时代新材	2,174,786	24,901,299.70	0.13
357	600171	上海贝岭	2,436,368	24,777,862.56	0.13
358	000652	泰达股份	4,656,306	24,678,421.80	0.13
359	000680	山推股份	4,486,540	24,451,643.00	0.13
360	000620	新华联	3,422,026	24,330,604.86	0.13
361	000969	安泰科技	2,777,154	24,244,554.42	0.13
362	000541	佛山照明	2,648,669	24,129,374.59	0.13
363	600428	中远海特	3,867,754	24,057,429.88	0.13
364	002463	沪电股份	5,282,158	24,033,818.90	0.13
365	000726	鲁泰A	2,021,083	23,970,044.38	0.13
366	600058	五矿发展	1,931,297	23,967,395.77	0.13
367	002505	大康农业	6,845,367	23,958,784.50	0.13
368	001696	宗申动力	3,107,879	23,526,644.03	0.13
369	002128	露天煤业	2,702,054	23,507,869.80	0.13
370	002690	美亚光电	1,216,719	23,336,670.42	0.13

371	300297	蓝盾股份	2,122,200	23,238,090.00	0.13
372	603883	老百姓	477,620	23,236,213.00	0.13
373	600517	置信电气	3,066,635	23,214,426.95	0.13
374	600329	中新药业	1,281,056	23,199,924.16	0.13
375	601233	桐昆股份	1,672,825	23,185,354.50	0.13
376	300043	星辉娱乐	2,805,603	23,034,000.63	0.12
377	600894	广日股份	1,936,833	22,932,102.72	0.12
378	600736	苏州高新	3,227,869	22,821,033.83	0.12
379	601777	力帆股份	2,834,943	22,792,941.72	0.12
380	000426	兴业矿业	2,524,292	22,769,113.84	0.12
381	002063	远光软件	2,172,007	22,632,312.94	0.12
382	600805	悦达投资	3,078,729	22,628,658.15	0.12
383	600859	王府井	1,401,037	22,626,747.55	0.12
384	600880	博瑞传播	3,452,217	22,542,977.01	0.12
385	603369	今世缘	1,706,000	22,519,200.00	0.12
386	600586	金晶科技	4,601,896	22,503,271.44	0.12
387	600790	轻纺城	3,302,918	22,492,871.58	0.12
388	603888	新华网	691,700	22,404,163.00	0.12
389	603556	海兴电力	509,400	22,357,566.00	0.12
390	600338	西藏珠峰	587,100	22,303,929.00	0.12
391	000616	海航投资	5,170,140	22,231,602.00	0.12
392	000552	靖远煤电	6,189,828	22,097,685.96	0.12
393	600220	江苏阳光	6,441,465	22,094,224.95	0.12
394	002663	普邦股份	4,050,366	21,993,487.38	0.12
395	600720	祁连山	2,802,070	21,940,208.10	0.12
396	600395	盘江股份	2,990,658	21,921,523.14	0.12
397	002005	德豪润达	4,591,942	21,903,563.34	0.12
398	600773	西藏城投	1,971,593	21,825,534.51	0.12
399	002727	一心堂	1,170,200	21,531,680.00	0.12
400	002681	奋达科技	1,709,530	21,522,982.70	0.12
401	300147	香雪制药	2,089,246	21,456,556.42	0.12
402	603816	顾家家居	363,739	21,380,578.42	0.12
403	601886	江河集团	2,082,451	21,345,122.75	0.12
404	603377	东方时尚	565,900	21,272,181.00	0.11
405	002269	美邦服饰	5,670,217	21,149,909.41	0.11
406	600006	东风汽车	3,612,205	21,131,399.25	0.11
407	300039	上海凯宝	2,903,024	21,104,984.48	0.11
408	002041	登海种业	1,592,140	21,095,855.00	0.11
409	600801	华新水泥	2,196,556	20,933,178.68	0.11
410	002190	成飞集成	780,450	20,916,060.00	0.11
411	002120	新海股份	404,200	20,856,720.00	0.11
412	603355	莱克电气	354,060	20,808,106.20	0.11

413	600460	士兰微	3,415,910	20,734,573.70	0.11
414	002345	潮宏基	1,903,046	20,686,110.02	0.11
415	600596	新安股份	2,444,693	20,657,655.85	0.11
416	002277	友阿股份	3,192,080	20,588,916.00	0.11
417	000099	中信海直	1,828,159	20,585,070.34	0.11
418	300032	金龙机电	1,470,800	20,517,660.00	0.11
419	600280	中央商场	2,586,488	20,510,849.84	0.11
420	600289	XD 亿阳信	1,872,908	20,489,613.52	0.11
421	603198	迎驾贡酒	1,076,684	20,489,296.52	0.11
422	600757	长江传媒	2,736,745	20,443,485.15	0.11
423	600053	九鼎投资	584,650	20,439,364.00	0.11
424	300202	聚龙股份	1,236,744	20,431,010.88	0.11
425	000417	合肥百货	2,456,907	20,269,482.75	0.11
426	600059	古越龙山	2,190,553	20,262,615.25	0.11
427	600869	智慧能源	3,008,060	20,244,243.80	0.11
428	600628	新世界	1,744,358	20,147,334.90	0.11
429	600141	兴发集团	1,622,172	20,066,267.64	0.11
430	002588	史丹利	2,606,676	20,045,338.44	0.11
431	600580	卧龙电气	2,909,845	19,845,142.90	0.11
432	002371	七星电子	829,242	19,835,468.64	0.11
433	000681	视觉中国	1,261,976	19,762,544.16	0.11
434	601001	大同煤业	3,762,787	19,754,631.75	0.11
435	002233	塔牌集团	1,619,072	19,704,106.24	0.11
436	002147	新光圆成	1,263,000	19,627,020.00	0.11
437	600754	锦江股份	722,090	19,568,639.00	0.11
438	600481	双良节能	3,658,824	19,428,355.44	0.10
439	002344	海宁皮城	2,319,705	19,299,945.60	0.10
440	600292	远达环保	1,754,828	18,917,045.84	0.10
441	600195	中牧股份	974,913	18,903,563.07	0.10
442	601002	晋亿实业	2,146,871	18,570,434.15	0.10
443	600537	亿晶光电	3,721,322	18,532,183.56	0.10
444	600971	恒源煤电	2,259,380	18,368,759.40	0.10
445	600862	中航高科	1,881,425	18,231,008.25	0.10
446	002309	中利科技	1,448,102	18,115,756.02	0.10
447	600640	号百控股	1,070,674	18,094,390.60	0.10
448	600748	上实发展	2,490,810	17,933,832.00	0.10
449	600743	华远地产	4,234,775	17,870,750.50	0.10
450	600657	信达地产	3,018,742	17,387,953.92	0.09
451	600184	光电股份	922,289	17,302,141.64	0.09
452	600826	兰生股份	954,482	17,276,124.20	0.09
453	002699	美盛文化	1,228,100	16,947,780.00	0.09
454	600251	冠农股份	2,125,216	16,937,971.52	0.09

455	603169	兰石重装	1,387,740	16,861,041.00	0.09
456	600996	贵广网络	1,407,200	16,844,184.00	0.09
457	600335	国机汽车	1,390,432	16,629,566.72	0.09
458	600831	广电网络	1,642,426	16,342,138.70	0.09
459	002551	尚荣医疗	1,008,880	16,273,234.40	0.09
460	002392	北京利尔	2,702,397	16,025,214.21	0.09
461	002093	国脉科技	1,813,160	15,955,808.00	0.09
462	002118	紫鑫药业	2,315,922	15,817,747.26	0.09
463	002414	高德红外	848,005	15,518,491.50	0.08
464	002416	爱施德	1,398,100	15,085,499.00	0.08
465	600776	东方通信	2,157,771	14,629,687.38	0.08
466	600551	时代出版	917,111	14,481,182.69	0.08
467	002251	步步高	1,165,068	14,435,192.52	0.08
468	000536	华映科技	2,483,227	14,427,548.87	0.08
469	002646	青青稞酒	814,456	14,220,401.76	0.08
470	603005	晶方科技	507,718	14,211,026.82	0.08
471	603698	航天工程	555,270	13,992,804.00	0.08
472	603001	奥康国际	724,154	13,606,853.66	0.07
473	603568	伟明环保	618,578	13,373,656.36	0.07
474	000517	荣安地产	2,874,900	13,368,285.00	0.07
475	603567	珍宝岛	767,650	12,919,549.50	0.07
476	603868	飞科电器	206,800	12,788,512.00	0.07
477	603328	依顿电子	903,136	12,779,374.40	0.07
478	000025	特力A	242,400	12,541,776.00	0.07
479	603528	多伦科技	851,300	12,233,181.00	0.07
480	600936	广西广电	1,505,900	12,152,613.00	0.07
481	002807	江阴银行	960,300	12,032,559.00	0.06
482	600126	杭钢股份	1,750,500	12,008,430.00	0.06
483	603806	福斯特	356,400	11,408,364.00	0.06
484	600618	氯碱化工	1,020,990	10,904,173.20	0.06
485	002315	焦点科技	418,800	10,444,872.00	0.06
486	601020	华钰矿业	467,800	10,305,634.00	0.06
487	603228	景旺电子	209,300	10,098,725.00	0.05
488	603515	欧普照明	277,346	10,017,737.52	0.05
489	603866	桃李面包	275,101	9,788,093.58	0.05
490	002194	武汉凡谷	1,027,296	9,091,569.60	0.05
491	603658	安图生物	177,300	7,641,630.00	0.04
492	002815	崇达技术	229,600	7,585,984.00	0.04
493	002818	富森美	186,800	7,372,996.00	0.04
494	600917	重庆燃气	773,763	7,296,585.09	0.04
495	601811	新华文轩	457,700	7,121,812.00	0.04
496	000761	本钢板材	1,357,300	7,098,679.00	0.04

497	603877	太平鸟	246,200	6,891,138.00	0.04
498	000662	天夏智慧	395,000	6,320,000.00	0.03
499	603569	长久物流	186,500	6,234,695.00	0.03
500	603025	大豪科技	212,652	5,614,012.80	0.03

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002168	深圳惠程	3,435,299	58,365,730.01	0.32
2	002399	海普瑞	1,610,100	32,572,323.00	0.18
3	002025	航天电器	1,083,543	27,034,397.85	0.15
4	000693	*ST 华泽	1,391,501	17,393,762.50	0.09
5	600468	百利电气	1,386,272	9,010,768.00	0.05
6	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
7	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
8	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
9	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
10	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
11	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
12	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
13	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
14	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
15	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
16	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
17	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
18	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
19	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
20	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
21	603501	韦尔股份	57	1,148.55	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 名的股票投资明细

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	600642	申能股份	76,801,117.44	0.46
2	000778	新兴铸管	66,816,917.37	0.40
3	000039	中集集团	61,170,465.43	0.37
4	603799	华友钴业	59,482,462.68	0.36
5	600839	四川长虹	58,763,942.58	0.35
6	300002	神州泰岳	55,224,469.92	0.33
7	300136	信维通信	53,684,314.54	0.32
8	300383	光环新网	50,889,229.63	0.30

9	002583	海能达	49,530,723.29	0.30
10	300058	蓝色光标	49,438,083.23	0.30
11	002601	佰利联	43,944,182.32	0.26
12	000729	燕京啤酒	43,546,596.21	0.26
13	002127	南极电商	43,073,605.39	0.26
14	300146	汤臣倍健	41,000,229.50	0.25
15	600566	济川药业	40,832,425.86	0.24
16	000732	泰禾集团	38,950,920.59	0.23
17	000027	深圳能源	38,047,096.28	0.23
18	002460	赣锋锂业	37,893,868.64	0.23
19	000566	海南海药	37,856,325.72	0.23
20	002572	索菲亚	36,326,258.03	0.22

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 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

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	002508	老板电器	111,624,753.13	0.67
2	600522	中天科技	101,069,049.90	0.60
3	600682	南京新百	87,057,974.74	0.52
4	600436	片仔癀	81,445,444.12	0.49
5	000887	中鼎股份	62,550,657.66	0.37
6	000959	首钢股份	61,091,185.18	0.37
7	002602	世纪华通	59,678,775.75	0.36
8	002595	豪迈科技	51,035,314.98	0.31
9	600497	驰宏锌锗	46,972,581.35	0.28
10	000961	中南建设	43,792,745.34	0.26
11	600549	厦门钨业	42,618,612.07	0.25
12	600601	方正科技	38,366,367.46	0.23
13	000566	海南海药	35,794,264.56	0.21
14	002581	未名医药	33,928,883.20	0.20
15	600067	冠城大通	32,591,096.09	0.19
16	600575	皖江物流	31,622,610.24	0.19
17	000973	佛塑科技	31,435,725.43	0.19
18	000066	长城电脑	29,907,915.04	0.18
19	600851	海欣股份	28,869,116.17	0.17
20	600175	美都能源	28,791,572.17	0.17

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	6,047,046,066.72
卖出股票收入（成交）总额	4,492,477,743.77

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IC1707	IC1707	431	526,078,600.00	15,110,932.43	-
公允价值变动总额合计（元）					15,110,932.43
股指期货投资本期收益（元）					15,439,463.86
股指期货投资本期公允价值变动（元）					20,285,736.14

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	107,160,802.68
2	应收证券清算款	2,416,780.20
3	应收股利	9,601.50
4	应收利息	175,134.92
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	其他	-
-	合计	109,762,319.30

7.12.4 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。

7.12.5 股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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	000656	金科股份	105,263,059.26	0.57	重大资产重组

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	公司名称	流通受限部分的公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002168	深圳惠程	58,365,730.01	0.32	重大资产重组
2	002399	海普瑞	32,572,323.00	0.18	重大事项
3	002025	航天电器	27,034,397.85	0.15	重大事项
4	000693	*ST 华泽	17,393,762.50	0.09	重大事项
5	600468	百利电气	9,010,768.00	0.05	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	户均持有	持有人结构
------	------	-------

数(户)	的基金份额	机构投资者		个人投资者		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)	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
20,746.00	138,314.24	2,738,957,760.00	95.45	130,509,484.00	4.55	614,173,402.00	21.40

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中央汇金投资有限责任公司	1,728,426,785.00	60.24
2	中国人寿保险股份有限公司	141,518,532.00	4.93
3	光大证券股份有限公司融券专用证券账户	28,419,163.00	0.99
4	中国人寿保险股份有限公司	19,899,924.00	0.69
5	财通证券股份有限公司	15,780,000.00	0.55
6	UBS AG	14,158,500.00	0.49
7	光大证券—光大银行—光大阳光基中宝(阳光 2 号二期)集合资产管理	11,000,000.00	0.38
8	安信证券股份有限公司	8,129,909.00	0.28
9	台湾银行股份有限公司—自有资金	7,922,700.00	0.28
10	平安资产—工商银行—平安资产如意 11 号保险资产管理产品	7,740,200.00	0.27
-	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)	614,173,402.00	21.40

8.3 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。

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

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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2013 年 2 月 6 日) 基金份额总额	1,147,553,216.00
本报告期期初基金份额总额	2,551,867,244.00
本报告期基金总申购份额	954,800,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	637,200,000.00
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	2,869,467,244.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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

南方基金管理有限公司第七届董事会第二次会议已于 2017 年 1 月 23 日审议通过了《公司关于聘任公司副总经理、督察长和财务负责人的议案》，秦长奎因任期届满，工作调整的原因不再担任公司副总经理职务。

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。

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，无涉及基金管理业务、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 (%)	
银河证券	2	5,273,476,362.26	50.61	527,420.58	50.73	-
华泰证券	2	4,957,958,722.96	47.58	493,332.60	47.45	-
申万宏源	2	188,502,830.87	1.81	18,851.27	1.81	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

英大证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

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

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

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

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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 (%)
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	840,800,000.00	26.77	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	3,087,863.92	100.00	2,299,700,000.00	73.23	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

注：： 无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20170101-20170630	1,728,426,785.00	-	-	1,728,426,785.00	60.24
南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	2	20170101-20170630	571,773,402.00	150,800,000.00	108,400,000.00	614,173,402.00	21.40
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 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>