

# 南方中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 (LOF) 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细
- 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- 7.13 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	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	
基金简称	南方中证 500ETF 联接 (LOF)	
场内简称	南方 500	
基金主代码	160119	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2009 年 9 月 25 日	
基金管理人	南方基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,908,318,251.54 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2009 年 11 月 11 日	
下属分级基金的基金简称	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C
下属分级基金的场内简称	南方 500	
下属分级基金的交易代码	160119	004348
下属分级基金的前端交易代码	160119	
下属分级基金的后端交易代码	160120	
报告期末下属分级基金的份额总额	2,907,529,150.16 份	789,101.38 份

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

### 目标基金基本情况

基金名称	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日

基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 日
基金管理人名称	南方基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

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

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，以中证 500ETF 作为其主要投资标的。为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，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。

### 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	鲍文革	林葛
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-68121816
注册地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码	518048	100031
法定代表人	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	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日	2017 年 01 月 01 日 至 2017 年 06 月 30 日
	南方中证 500ETF 联接 (LOF)A	南方中证 500ETF 联 接 (LOF)C
本期已实现收益	89,609,609.74	61.78
本期利润	-677,342.23	13,708.38
加权平均基金份额本期利润	-0.0002	0.0771
本期加权平均净值利润率	-0.02%	5.20%
本期基金份额净值增长率	-1.36%	-3.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2017 年 06 月 30 日)	报告期末 (2017 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	1,484,309,817.21	406,936.87
期末可供分配基金份额利润	0.5105	0.5157
期末基金资产净值	4,391,838,967.37	1,196,038.25
期末基金份额净值	1.5105	1.5157
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2017 年 06 月 30 日)	报告期末 (2017 年 06 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	64.81%	-3.65%
-------------	--------	--------

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

南方中证 500ETF 联接 (LOF) A						
阶段	净值增长率 ① (%)	净值增长率 标准差 ② (%)	业绩比较基 准收益率 ③ (%)	业绩比较基 准收益率标 准差 ④ (%)	①— ③ (%)	②— ④ (%)
过去一个月	5.43	0.88	5.12	0.89	0.31	-0.01
过去三个月	-3.41	0.97	-3.90	0.97	0.49	0.00
过去六个月	-1.36	0.85	-1.87	0.85	0.51	0.00
过去一年	1.17	0.86	0.29	0.86	0.88	0.00
过去三年	61.16	1.97	54.18	1.96	6.98	0.01
自基金合同生效 起至今	64.81	1.69	71.54	1.69	-6.73	0.00
南方中证 500ETF 联接 (LOF) C						
阶段	净值增长率 ① (%)	净值增长率 标准差 ② (%)	业绩比较基 准收益率 ③ (%)	业绩比较基 准收益率标 准差 ④ (%)	①— ③ (%)	②— ④ (%)
过去一个月	5.42	0.88	5.12	0.89	0.30	-0.01

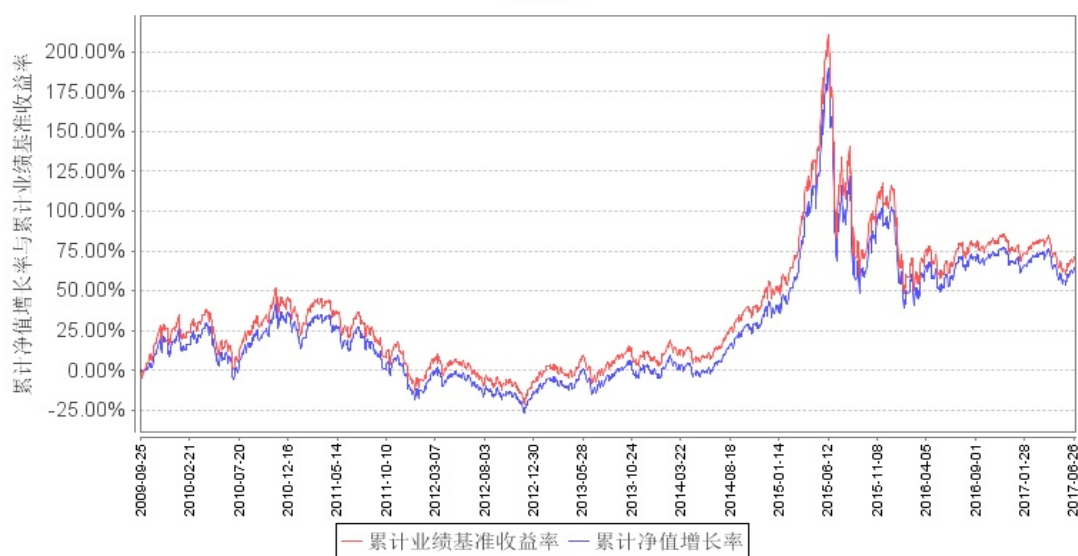


过去三个月	-3.27	0.96	-3.90	0.97	0.63	-0.01
自基金合同生效起至今	-3.65	0.87	-4.59	0.88	0.94	-0.01

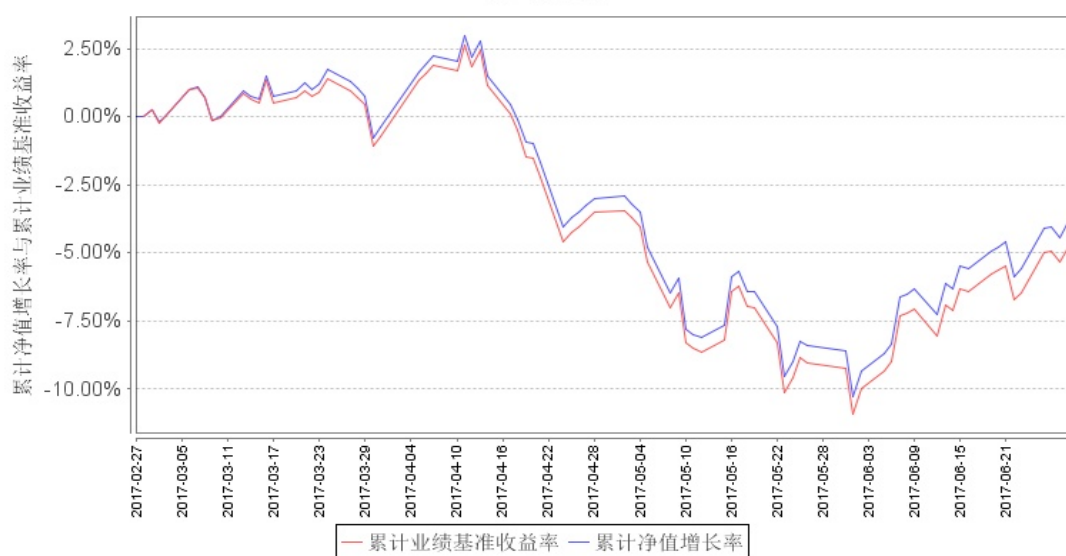
注：本基金 2017 年 2 月 20 日发布公告，增加 C 类收费模式，原收费模式成为 A 类。

### 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

南方中证500ETF联接(LOF)A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



南方中证500ETF联接(LOF)C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



注：本基金 2017 年 2 月 20 日发布公告，增加 C 类收费模式，原收费模式成为 A 类。

## § 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《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金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”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

- ①接受申购赎回所带来的股票仓位偏离，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- ②本基金大额换购目标 ETF 所带来的成份股权重偏离，对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行应对；
- ③报告期内指数成份股（包括调出指数成分股）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；

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 0.642%（按 A 类份额计），较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过 4% 的投资目标。

截至报告期末，本基金 A 类份额净值为 1.5105 元，报告期内，份额净值增长率为-1.36%，同期业绩基准增长率为-1.87%。本基金 C 类份额净值为 1.5157 元，报告期内，份额净值增长率为-3.65%，同期业绩基准增长率为-4.59%。

#### 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、量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：每一基金份额享有同等分配权；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益

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

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期末有收益分配事项。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理有限公司 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：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)

报告截止日：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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.4.1	240,144,230.23	227,730,372.51
结算备付金		759,601.84	67,344.58
存出保证金		377,493.63	390,712.97
交易性金融资产	6.4.4.2	4,159,031,231.71	3,890,046,070.01
其中：股票投资		193,190,740.32	141,785,533.20
基金投资		3,965,840,491.39	3,748,260,536.81
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		678,733.21	-
应收利息	6.4.4.5	43,773.13	41,066.53
应收股利		1,691.14	1,691.14
应收申购款		3,902,206.99	4,376,105.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	691,575.50	1,357,532.42
资产总计		4,405,630,537.38	4,124,010,896.03
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	13,316,293.47
应付赎回款		12,011,361.98	7,536,613.81
应付管理人报酬		174,618.78	128,959.19
应付托管费		34,923.77	25,791.84
应付销售服务费		197.88	-
应付交易费用	6.4.4.7	96,633.95	48,525.43
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	277,795.40	433,398.24
负债合计		12,595,531.76	21,489,581.98
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.4.9	2,908,318,251.54	2,679,131,874.38
未分配利润	6.4.4.10	1,484,716,754.08	1,423,389,439.67
所有者权益合计		4,393,035,005.62	4,102,521,314.05
负债和所有者权益总计		4,405,630,537.38	4,124,010,896.03

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金 A 份额净值 1.5105 元，基金份额总额

2,907,529,150.16 份；基金 C 份额净值 1.5157 元，基金份额总额 789,101.38 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)

本报告期：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
<b>一、收入</b>		1,709,346.33	-981,017,040.08
1. 利息收入		1,006,801.08	1,091,837.01
其中：存款利息收入	6.4.4.11	877,721.47	1,091,827.94
债券利息收入		1.88	9.07
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		129,077.73	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		89,416,689.43	21,901,882.90
其中：股票投资收益	6.4.4.12	10,832,445.97	-29,556,605.45
基金投资收益	6.4.4.13	77,487,169.22	51,215,826.60
债券投资收益	6.4.4.14	1,382.62	10,444.74
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资收益	6.4.4.15	-	-
衍生工具收益	6.4.4.16	-	-
股利收益	6.4.4.17	1,095,691.62	232,217.01
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	-90,273,305.37	-1,007,867,779.00
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	1, 559, 161. 19	3, 857, 019. 01
<b>减: 二、费用</b>		2, 372, 980. 18	4, 133, 381. 76
1. 管理人报酬	6. 4. 7. 2. 1	1, 051, 831. 51	904, 293. 48
2. 托管费	6. 4. 7. 2. 2	210, 366. 29	180, 858. 69
3. 销售服务费		347. 80	-
4. 交易费用	6. 4. 4. 20	867, 104. 01	2, 792, 978. 97
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	243, 330. 57	255, 250. 62
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		-663, 633. 85	-985, 150, 421. 84
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		-663, 633. 85	-985, 150, 421. 84

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)

本报告期: 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)	2, 679, 131, 874. 38	1, 423, 389, 439. 67	4, 102, 521, 314. 05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期净利润)	-	-663, 633. 85	-663, 633. 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)	229, 186, 377. 16	61, 990, 948. 26	291, 177, 325. 42
其中: 1. 基金申购款	1, 196, 051, 911. 41	606, 430, 143. 85	1, 802, 482, 055. 26
2. 基金赎回款	-966, 865, 534. 25	-544, 439, 195. 59	-1, 511, 304, 729. 84
四、本期向基金	-	-	-



份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	2,908,318,251.54	1,484,716,754.08	4,393,035,005.62
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）	3,157,946,424.77	2,543,598,431.42	5,701,544,856.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-985,150,421.84	-985,150,421.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-288,601,155.57	-143,714,523.36	-432,315,678.93
其中：1. 基金申购款	1,905,817,932.95	826,121,958.29	2,731,939,891.24
2. 基金赎回款	-2,194,419,088.52	-969,836,481.65	-3,164,255,570.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,869,345,269.20	1,414,733,486.22	4,284,078,755.42

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

本报告期无会计政策变更。

#### 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

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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	240,144,230.23
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	240,144,230.23

##### 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	190,952,163.78	193,190,740.32	2,238,576.54
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	3,726,706,342.21	3,965,840,491.39	239,134,149.18
其他	-	-	-
合计	3,917,658,505.99	4,159,031,231.71	241,372,725.72

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按估值日目标 ETF 的份额净值确定公允价值。

本基金可采用股票组合申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 份额的买卖。

##### 6.4.4.3 衍生金融资产/负债

注：无。

**6.4.4.4 买入返售金融资产**

注：无。

**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	43,312.69
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	307.62
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	152.82
合计	43,773.13

**6.4.4.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	-
可收退补款	691,575.50
合计	691,575.50

**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	96,633.95
银行间市场应付交易费用	-
合计	96,633.95

**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	44,727.13

预提费用		233,068.27
合计		277,795.40

#### 6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

南方中证 500ETF 联接 (LOF) A		
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	2,679,131,874.38	2,679,131,874.38
本期申购	1,195,092,734.40	1,195,092,734.40
本期赎回 (以“-”号填列)	-966,695,458.62	-966,695,458.62
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	2,907,529,150.16	2,907,529,150.16
南方中证 500ETF 联接 (LOF) C		
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	-	-
本期申购	959,177.01	959,177.01
本期赎回 (以“-”号填列)	-170,075.63	-170,075.63
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	789,101.38	789,101.38

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、本基金 2017 年 2 月 20 日发布公告，增加 C 类收费模式，原收费模式成为 A 类。

#### 6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

南方中证 500ETF 联接 (LOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,217,377,614.53	-793,988,174.86	1,423,389,439.67
本期利润	89,609,609.74	-90,286,951.97	-677,342.23
本期基金份额交易产生的变动数	187,718,473.03	-126,120,753.26	61,597,719.77
其中：基金申购款	1,005,676,594.82	-399,723,081.12	605,953,513.70
基金赎回款	-817,958,121.79	273,602,327.86	-544,355,793.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,494,705,697.30	-1,010,395,880.09	1,484,309,817.21
南方中证 500ETF 联接 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	-	-	-
本期利润	61.78	13,646.60	13,708.38
本期基金份额交易产生的变动数	681,150.91	-287,922.42	393,228.49
其中：基金申购款	827,900.86	-351,270.71	476,630.15
基金赎回款	-146,749.95	63,348.29	-83,401.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	681,212.69	-274,275.82	406,936.87

#### 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	818,740.80	
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	14,745.09	
其他	44,235.58	
合计	877,721.47	

#### 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	13,055,540.23	
股票投资收益——赎回差价收入	-	
股票投资收益——申购差价收入	-2,223,094.26	
合计	10,832,445.97	

##### 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	583,155,372.70	
减：卖出股票成本总额	570,099,832.47	
买卖股票差价收入	13,055,540.23	

## 6.4.4.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日
申购基金份额对价总额	969,499,960.00
减：现金支付申购款总额	530,914,029.12
减：申购股票成本总额	440,809,025.14
申购差价收入	-2,223,094.26

## 6.4.4.13 基金投资收益

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/赎回基金成交总额	736,262,095.61
减：卖出/赎回基金成本总额	658,774,926.39
基金投资收益	77,487,169.22

## 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	14,384.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	13,000.00
减：应收利息总额	1.88
买卖债券差价收入	1,382.62

## 6.4.4.15 贵金属投资收益

注：无。

## 6.4.4.16 衍生工具收益

注：无。

## 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	1,095,691.62
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,095,691.62

## 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	-90,273,305.37
股票投资	4,229,306.08
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-94,502,611.45
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
其他	-
合计	-90,273,305.37

## 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	1,559,161.19
合计	1,559,161.19

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

## 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	867,104.01
银行间市场交易费用	-
合计	867,104.01

## 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	54,547.97
信息披露费	148,767.52
账户维护费	100.00
银行费用	10,162.30



上市费	29,752.78
合计	243,330.57

#### 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

无。

#### 6.4.6 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司	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
中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（“目标 ETF”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	443,607,740.85	34.17	641,932,659.26	29.55

### 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	44,365.41	34.17	11,170.20	13.07
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	64,199.72	4.69	32,306.27	5.80

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,051,831.51	904,293.48
其中：支付销售机构的客户维护费	1,242,108.66	1,969,196.01

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.5% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = (前一日基金资产净值 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产)

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 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
当期发生的基金应支付的托管费	210,366.29	180,858.69

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.1% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产})$$

$$\times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

## 6.4.7.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	合计
南方基金	-	346.86	346.86
合计	-	346.86	346.86

注：支付销售机构的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值  $\times$  0.40% / 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：本基金本报告期内无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

## 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C
基金合同生效日 ( 2009 年 9 月 25 日 ) 持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	52,873,972.73	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减: 期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	52,873,972.73	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.8200%	-%
项目	上年度可比期间 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 06 月 30 日
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C
基金合同生效日 ( 2009 年 9 月 25 日 ) 持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	52,873,972.73	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减: 期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	52,873,972.73	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.8400%	-%

#### 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

注: 无。

#### 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	240,144,230.23	818,740.80	233,166,258.45	1,007,632.85

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.8 利润分配情况

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年06月05日	2017-07-07	新股认购	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年06月15日	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年06月27日	2017-07-05	新股认购	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603305	旭升股份	2017年06月30日	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年06月27日	2017-07-05	新股认购	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017年06月23日	2017-07-03	新股认购	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
60393	睿能科	2017年	2017-	新股认	20.20	20.20	857	17,311.4	17,311.4	-

3	技	06 月 28 日	07-06	购				0	0
---	---	--------------	-------	---	--	--	--	---	---

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
002168	深圳惠程	2017-01-23	重大资产重组	16.99		-	84,400	1,330,387.22	1,433,956.00	
000656	金科股份	2017-05-05	重大资产重组	6.54	2017-07-05	5.92	219,100	1,226,947.31	1,432,914.00	
600643	爱建集团	2017-04-17	重大资产重组	14.98	2017-08-02	16.48	48,194	669,615.98	721,946.12	
600657	信达地产	2017-02-20	重大资产重组	5.76	2017-08-10	6.19	123,600	724,367.12	711,936.00	
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项	10.24	2017-08-02	11.36	52,222	608,713.28	534,753.28	
002127	南极电商	2017-06-29	重大事项	12.08	2017-07-06	12.61	38,500	477,490.94	465,080.00	
002399	海普瑞	2017-04-28	重大事项	20.23		-	21,900	426,509.64	443,037.00	
002358	森源电气	2017-05-12	重大资产重组	17.02	2017-07-12	16.68	20,158	381,766.33	343,089.16	
300134	大富科技	2017-02-09	重大资产重组	23.36		-	13,600	324,505.48	317,696.00	
000061	农产品	2017-06-28	重大资产重组	9.06			34,200	311,158.59	309,852.00	
600545	新疆城建	2017-06-22	重要事项未公	11.96	2017-07-03	12.44	24,900	286,065.40	297,804.00	

			告							
000099	中信海直	2017-05-04	重大资产重组	11.26			-	24,800	292,085.68	279,248.00
002642	荣之联	2017-04-10	重大事项	25.06	2017-07-07		22.54	10,400	209,537.52	260,624.00
002681	奋达科技	2017-06-22	重大事项	12.59	2017-07-03		12.70	20,300	271,055.76	255,577.00
002122	天马股份	2017-04-24	重大资产重组	9.67	2017-07-24		11.15	24,700	266,400.42	238,849.00
300291	华录百纳	2017-04-19	重大资产重组	20.02			-	10,900	218,656.80	218,218.00
000693	ST 华泽	2016-03-01	重大事项	12.50			-	16,900	250,450.70	211,250.00
002505	大康农业	2017-03-13	重大资产重组	3.50			-	59,300	204,907.43	207,550.00
601001	大同煤业	2017-06-22	重要事项未公告	5.25	2017-07-21		5.78	39,000	202,515.51	204,750.00
002128	露天煤业	2017-03-17	重大资产重组	8.70	2017-08-14		9.57	23,100	198,846.35	200,970.00
600277	亿利洁能	2017-03-06	重大资产重组	7.83			-	22,600	176,300.19	176,958.00
300088	长信科技	2016-09-12	重大资产重组	15.75	2017-08-09		14.50	11,100	162,532.25	174,825.00
002025	航天电器	2016-09-12	重大事项	24.95	2017-07-04		22.46	3,500	83,850.27	87,325.00
600460	士兰微	2017-05-12	重大资产重组	6.07	2017-08-15		6.68	5,100	32,281.53	30,957.00
600468	百利电气	2017-05-16	重大资产重组	6.50			-	3,600	29,050.31	23,400.00
002049	紫光国芯	2017-02-20	重大资产重组	30.82	2017-07-17		27.74	60	2,145.25	1,849.20
603501	韦尔	2017-	重大	20.15			-	57	400.14	1,148.55

	股份	06-05	资产 重组						
002856	美芝 股份	2017- 06-19	重大 资产 重组	31.86	-	30	348.30	955.80	-

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

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为被动式指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资的金融工具主要包括基金投资和股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”的风险收益目标。

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

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



#### 6.4.10.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持目标 ETF 份额能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出，所持股票均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 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。

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，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合

约到期现金流量。

#### 6.4.10.4 市场风险

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

##### 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 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	240,144,230.23	-	-	-	240,144,230.23
结算备付金	759,601.84	-	-	-	759,601.84
存出保证金	377,493.63	-	-	-	377,493.63
交易性金融资产	-	-	-	4,159,031,231.71	4,159,031,231.71
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	43,773.13	43,773.13
应收股利	-	-	-	1,691.14	1,691.14
应收申购款	933,631.91	-	-	-2,968,575.08	3,902,206.99
应收证券清算款	-	-	-	678,733.21	678,733.21
其他资产	-	-	-	691,575.50	691,575.50
资产总计	242,214,957.61	-	-	4,163,415,579.77	4,405,630,537.38
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,011,361.98	12,011,361.98

应付管理人报酬	-	-	-	174,618.78	174,618.78
应付托管费	-	-	-	34,923.77	34,923.77
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	197.88	197.88
应付交易费用	-	-	-	96,633.95	96,633.95
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	277,795.40	277,795.40
负债总计	-	-	-	12,595,531.76	12,595,531.76
利率敏感度缺口	242,214,957.61	-	-	4,150,820,048.01	4,393,035,005.62
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	227,730,372.51	-	-	-	227,730,372.51
结算备付金	67,344.58	-	-	-	67,344.58
存出保证金	390,712.97	-	-	-	390,712.97
交易性金融资产	-	-	-	3,890,046,070.01	3,890,046,070.01
应收利息	-	-	-	41,066.53	41,066.53
应收股利	-	-	-	1,691.14	1,691.14
应收申购款	860,312.87	-	-	-3,515,793.00	4,376,105.87
其他资产	-	-	-	-1,357,532.42	1,357,532.42
资产总计	229,048,742.93	-	-	3,894,962,153.10	4,124,010,896.03
负债					
应付证券清算款	-	-	-	13,316,293.47	13,316,293.47
应付赎回款	-	-	-	-7,536,613.81	7,536,613.81
应付管理人报酬	-	-	-	128,959.19	128,959.19
应付托管费	-	-	-	25,791.84	25,791.84
应付交易费用	-	-	-	48,525.43	48,525.43
其他负债	-	-	-	433,398.24	433,398.24
负债总计	-	-	-	21,489,581.98	21,489,581.98
利率敏感度缺口	229,048,742.93	-	-	3,873,472,571.12	4,102,521,314.05

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。本基金主要投资于能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出的目标 ETF 份额以及证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.10.4.2.1 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	193,190,740.32	4.40	141,785,533.20	3.46
交易性金融资产—基金投资	3,965,840,491.39	90.28	3,748,260,536.81	91.36
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	4,159,031,231.71	94.67	3,890,046,070.01	94.82

注：交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标 ETF 份额。

#### 6.4.10.4.2.2 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	业绩比较基准上升 5%	增加约 21,679.00	增加约 20,275.00
	业绩比较基准下降 5%	减少约 21,679.00	减少约 20,275.00

#### 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	193,190,740.32	4.39
	其中：股票	193,190,740.32	4.39
2	基金投资	3,965,840,491.39	90.02
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	240,903,832.07	5.47
-	-	-	-
-	其他各项资产	5,695,473.60	0.13
-	合计	4,405,630,537.38	100.00

## 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

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	2,432,846.00	0.06
B	采矿业	6,220,634.56	0.14
C	制造业	120,773,183.06	2.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,683,410.41	0.15
E	建筑业	4,422,288.13	0.10
F	批发和零售业	9,150,048.98	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	5,032,155.84	0.11
H	住宿和餐饮业	205,960.00	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,364,759.00	0.30
J	金融业	2,624,601.12	0.06
K	房地产业	12,779,689.66	0.29
L	租赁和商务服务业	3,637,750.59	0.08
M	科学研究和技术服务业	445,049.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	1,716,794.02	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	214,263.00	-
Q	卫生和社会工作	518,366.42	0.01
R	文化、体育和娱乐业	2,111,435.83	0.05
S	综合	857,504.70	0.02
	合计	193,190,740.32	4.40

## 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	39,400	1,576,788.00	0.04
2	002168	深圳惠程	84,400	1,433,956.00	0.03
3	000656	金科股份	219,100	1,432,914.00	0.03
4	002460	赣锋锂业	26,600	1,230,250.00	0.03
5	600487	亨通光电	40,300	1,130,415.00	0.03
6	002572	索菲亚	27,500	1,127,500.00	0.03
7	600201	生物股份	28,650	1,019,080.50	0.02
8	300156	神雾环保	30,300	992,628.00	0.02
9	002271	东方雨虹	26,712	991,015.20	0.02
10	601012	隆基股份	55,877	955,496.70	0.02
11	600176	中国巨石	82,391	904,653.18	0.02
12	002405	四维图新	44,896	887,144.96	0.02
13	600219	南山铝业	259,950	881,230.50	0.02
14	000661	长春高新	6,780	875,365.80	0.02
15	000050	深天马 A	42,365	871,448.05	0.02
16	603799	华友钴业	13,800	838,764.00	0.02
17	600315	上海家化	25,700	833,965.00	0.02
18	600525	长园集团	61,216	831,925.44	0.02
19	000998	隆平高科	37,700	830,154.00	0.02
20	600079	人福医药	42,012	824,275.44	0.02
21	002092	中泰化学	64,700	821,690.00	0.02
22	002340	格林美	135,194	817,923.70	0.02
23	600642	申能股份	127,600	803,880.00	0.02
24	000066	长城电脑	88,632	798,574.32	0.02
25	300115	长盈精密	27,190	793,404.20	0.02
26	600584	长电科技	49,225	790,061.25	0.02
27	300266	兴源环境	25,680	788,889.60	0.02
28	300296	利亚德	40,950	769,860.00	0.02
29	000997	新大陆	33,040	749,677.60	0.02
30	002050	三花智控	45,000	734,400.00	0.02
31	600643	爱建集团	48,194	721,946.12	0.02
32	600657	信达地产	123,600	711,936.00	0.02
33	002422	科伦药业	43,063	711,400.76	0.02

34	000786	北新建材	44,650	707,256.00	0.02
35	002407	多氟多	31,450	691,585.50	0.02
36	000039	中集集团	37,900	683,337.00	0.02
37	600291	西水股份	31,000	682,000.00	0.02
38	601168	西部矿业	88,300	679,027.00	0.02
39	600516	方大炭素	47,300	672,606.00	0.02
40	000778	新兴铸管	99,900	669,330.00	0.02
41	600325	华发股份	79,368	662,722.80	0.02
42	600056	中国医药	25,473	661,024.35	0.02
43	600879	航天电子	74,800	657,492.00	0.01
44	000581	威孚高科	25,300	655,270.00	0.01
45	002410	广联达	33,800	635,440.00	0.01
46	600022	山东钢铁	307,660	633,779.60	0.01
47	600266	北京城建	43,500	632,490.00	0.01
48	000970	中科三环	42,400	626,672.00	0.01
49	600839	四川长虹	172,900	625,898.00	0.01
50	000999	华润三九	19,700	625,475.00	0.01
51	002217	合力泰	62,738	619,851.44	0.01
52	600426	华鲁恒升	52,670	618,345.80	0.01
53	600521	华海药业	29,388	618,323.52	0.01
54	002179	中航光电	19,747	615,908.93	0.01
55	002366	台海核电	13,100	614,521.00	0.01
56	000028	国药一致	7,575	612,817.50	0.01
57	600166	福田汽车	215,700	612,588.00	0.01
58	600161	天坛生物	15,633	606,716.73	0.01
59	600388	龙净环保	39,015	605,902.95	0.01
60	002573	清新环境	32,108	604,272.56	0.01
61	002223	鱼跃医疗	25,216	597,114.88	0.01
62	600435	北方导航	41,600	595,296.00	0.01
63	002038	双鹭药业	20,400	594,660.00	0.01
64	300383	光环新网	43,300	587,148.00	0.01
65	600528	中铁工业	40,800	583,032.00	0.01
66	600600	青岛啤酒	16,562	581,326.20	0.01
67	002311	海大集团	31,760	580,255.20	0.01
68	600699	均胜电子	17,940	575,694.60	0.01
69	000878	云南铜业	43,600	575,084.00	0.01
70	000488	晨鸣纸业	44,446	573,353.40	0.01
71	300002	神州泰岳	68,700	572,958.00	0.01
72	002030	达安基因	26,024	567,062.96	0.01
73	002078	太阳纸业	76,100	559,335.00	0.01
74	002004	华邦健康	71,400	559,062.00	0.01
75	002583	海能达	34,700	558,323.00	0.01



76	300055	万邦达	30,300	557,520.00	0.01
77	600138	中青旅	26,457	557,184.42	0.01
78	300113	顺网科技	20,700	556,830.00	0.01
79	002019	亿帆医药	33,200	553,776.00	0.01
80	000400	许继电气	30,800	553,168.00	0.01
81	002273	水晶光电	26,800	552,884.00	0.01
82	601000	唐山港	104,942	547,797.24	0.01
83	600260	凯乐科技	21,600	547,344.00	0.01
84	600158	中体产业	32,000	547,200.00	0.01
85	600978	宜华生活	54,400	546,720.00	0.01
86	000566	海南海药	40,990	543,527.40	0.01
87	002244	滨江集团	77,900	539,068.00	0.01
88	600614	鹏起科技	48,700	535,700.00	0.01
89	000547	航天发展	51,261	535,677.45	0.01
90	603589	口子窖	13,800	535,302.00	0.01
91	002013	中航机电	52,222	534,753.28	0.01
92	000418	小天鹅 A	11,428	534,716.12	0.01
93	002001	新和成	27,500	533,775.00	0.01
94	000401	冀东水泥	34,560	531,878.40	0.01
95	000930	中粮生化	49,300	531,454.00	0.01
96	002384	东山精密	21,500	531,050.00	0.01
97	300324	旋极信息	28,600	521,664.00	0.01
98	600511	国药股份	14,342	519,754.08	0.01
99	002491	通鼎互联	38,600	518,784.00	0.01
100	300244	迪安诊断	16,477	518,366.42	0.01
101	600503	华丽家族	74,300	513,413.00	0.01
102	000598	兴蓉环境	91,200	512,544.00	0.01
103	002176	江特电机	58,700	511,864.00	0.01
104	000960	锡业股份	37,400	509,014.00	0.01
105	002439	启明星辰	27,168	505,324.80	0.01
106	000825	太钢不锈	116,100	505,035.00	0.01
107	300058	蓝色光标	64,500	504,390.00	0.01
108	300146	汤臣倍健	36,700	504,258.00	0.01
109	600392	盛和资源	38,200	503,858.00	0.01
110	002408	齐翔腾达	45,120	499,929.60	0.01
111	002601	佰利联	30,500	499,590.00	0.01
112	603019	中科曙光	17,600	495,264.00	0.01
113	300159	新研股份	37,200	492,528.00	0.01
114	000078	海王生物	81,207	489,678.21	0.01
115	600808	马钢股份	138,001	488,523.54	0.01
116	600717	天津港	39,100	488,359.00	0.01
117	000089	深圳机场	52,100	487,135.00	0.01

118	600240	华业资本	53,761	487,074.66	0.01
119	600755	厦门国贸	53,300	486,096.00	0.01
120	600635	大众公用	89,000	485,050.00	0.01
121	002400	省广股份	60,220	483,566.60	0.01
122	000685	中山公用	44,160	483,552.00	0.01
123	002354	天神娱乐	22,460	482,890.00	0.01
124	600298	安琪酵母	18,657	482,656.59	0.01
125	600122	宏图高科	43,272	480,319.20	0.01
126	601231	环旭电子	30,400	477,584.00	0.01
127	000729	燕京啤酒	70,600	474,432.00	0.01
128	600160	巨化股份	39,400	473,982.00	0.01
129	000513	丽珠集团	6,940	472,614.00	0.01
130	600633	浙数文化	24,400	471,408.00	0.01
131	002051	中工国际	22,668	469,907.64	0.01
132	300122	智飞生物	24,500	468,195.00	0.01
133	600062	华润双鹤	17,058	467,900.94	0.01
134	000697	炼石有色	22,800	466,716.00	0.01
135	000979	中弘股份	177,720	465,626.40	0.01
136	002127	南极电商	38,500	465,080.00	0.01
137	600872	中炬高新	25,360	464,088.00	0.01
138	000988	华工科技	31,800	463,962.00	0.01
139	000926	福星股份	38,000	463,600.00	0.01
140	002640	跨境通	21,800	463,250.00	0.01
141	600418	江淮汽车	43,800	462,090.00	0.01
142	002701	奥瑞金	72,200	461,358.00	0.01
143	002431	棕榈股份	41,500	457,330.00	0.01
144	600500	XD 中化国	47,819	457,149.64	0.01
145	000806	银河生物	33,800	456,300.00	0.01
146	000690	宝新能源	76,200	455,676.00	0.01
147	002373	千方科技	33,300	454,212.00	0.01
148	002221	东华能源	41,400	451,674.00	0.01
149	600143	金发科技	74,800	451,044.00	0.01
150	002048	宁波华翔	21,500	448,490.00	0.01
151	600594	益佰制药	29,334	447,636.84	0.01
152	000600	建投能源	36,400	446,628.00	0.01
153	002390	信邦制药	51,000	444,210.00	0.01
154	002399	海普瑞	21,900	443,037.00	0.01
155	002512	达华智能	27,200	439,280.00	0.01
156	000012	南玻 A	46,900	437,577.00	0.01
157	600312	平高电气	31,700	435,558.00	0.01
158	002665	首航节能	60,200	433,440.00	0.01
159	000816	智慧农业	58,100	432,264.00	0.01

160	002028	思源电气	27,118	432,260.92	0.01
161	002444	巨星科技	27,718	431,846.44	0.01
162	000667	美好置业	130,400	431,624.00	0.01
163	600811	东方集团	66,189	431,552.28	0.01
164	300253	卫宁健康	55,172	430,893.32	0.01
165	600967	内蒙一机	31,600	430,708.00	0.01
166	601699	潞安环能	55,000	430,100.00	0.01
167	002603	以岭药业	24,600	429,516.00	0.01
168	600881	亚泰集团	84,300	428,244.00	0.01
169	002191	劲嘉股份	45,700	427,752.00	0.01
170	000592	平潭发展	77,400	427,248.00	0.01
171	000563	陕国投 A	82,400	426,008.00	0.01
172	000006	深振业 A	48,300	425,523.00	0.01
173	300026	红日药业	90,300	425,313.00	0.01
174	300166	东方国信	31,599	424,374.57	0.01
175	601880	大连港	142,860	422,865.60	0.01
176	000758	中色股份	60,100	421,301.00	0.01
177	600970	中材国际	48,400	420,596.00	0.01
178	300001	特锐德	25,088	420,474.88	0.01
179	600884	杉杉股份	25,500	419,985.00	0.01
180	600409	三友化工	41,700	419,919.00	0.01
181	000975	银泰资源	33,200	419,316.00	0.01
182	000031	中粮地产	55,500	417,915.00	0.01
183	002477	雏鹰农牧	94,300	417,749.00	0.01
184	600026	中远海能	63,000	417,690.00	0.01
185	000732	泰禾集团	25,000	417,000.00	0.01
186	600499	科达洁能	52,400	416,056.00	0.01
187	600183	生益科技	33,700	415,858.00	0.01
188	002672	东江环保	24,600	415,494.00	0.01
189	002635	安洁科技	11,450	414,719.00	0.01
190	600566	济川药业	10,900	414,527.00	0.01
191	600307	酒钢宏兴	144,800	412,680.00	0.01
192	000158	常山股份	26,100	412,380.00	0.01
193	000939	凯迪生态	80,200	409,020.00	0.01
194	600664	哈药股份	70,201	407,867.81	0.01
195	600809	山西汾酒	11,700	405,873.00	0.01
196	600094	大名城	52,900	405,743.00	0.01
197	000860	顺鑫农业	20,184	403,881.84	0.01
198	600863	内蒙华电	133,800	402,738.00	0.01
199	600787	中储股份	50,900	402,619.00	0.01
200	600572	康恩贝	58,100	402,052.00	0.01
201	002261	拓维信息	34,200	400,482.00	0.01

202	000027	深圳能源	59,400	399,762.00	0.01
203	000877	天山股份	31,400	397,838.00	0.01
204	300274	阳光电源	35,660	395,469.40	0.01
205	300287	飞利信	42,882	393,656.76	0.01
206	002250	联化科技	27,427	392,206.10	0.01
207	000727	华东科技	138,500	391,955.00	0.01
208	300116	坚瑞消防	36,400	391,300.00	0.01
209	600478	科力远	45,200	389,172.00	0.01
210	600874	创业环保	19,869	388,836.33	0.01
211	002468	艾迪西	15,300	388,773.00	0.01
212	002353	杰瑞股份	24,500	387,590.00	0.01
213	002002	鸿达兴业	49,500	387,585.00	0.01
214	002266	浙富控股	79,400	387,472.00	0.01
215	002517	恺英网络	11,000	387,090.00	0.01
216	002308	威创股份	29,600	386,280.00	0.01
217	603077	和邦生物	75,600	384,804.00	0.01
218	600017	日照港	85,100	382,950.00	0.01
219	600125	铁龙物流	42,100	377,216.00	0.01
220	600120	浙江东方	14,000	376,320.00	0.01
221	600348	阳泉煤业	55,300	374,934.00	0.01
222	600565	迪马股份	67,400	371,374.00	0.01
223	300257	开山股份	17,600	371,008.00	0.01
224	002396	星网锐捷	19,150	370,552.50	0.01
225	600064	南京高科	24,500	369,950.00	0.01
226	000501	鄂武商 A	19,930	367,907.80	0.01
227	002375	亚厦股份	41,100	366,201.00	0.01
228	600198	大唐电信	28,500	363,945.00	0.01
229	600597	光明乳业	28,421	362,367.75	0.01
230	002544	杰赛科技	15,800	360,240.00	0.01
231	000830	鲁西化工	52,110	359,559.00	0.01
232	002022	科华生物	20,700	359,559.00	0.01
233	000519	江南红箭	28,500	359,100.00	0.01
234	300199	翰宇药业	23,400	358,956.00	0.01
235	600410	华胜天成	40,460	358,475.60	0.01
236	002440	闰土股份	23,450	357,847.00	0.01
237	002281	光迅科技	16,100	357,742.00	0.01
238	002268	卫士通	21,254	357,492.28	0.01
239	002670	国盛金控	22,420	356,478.00	0.01
240	600416	湘电股份	25,900	354,830.00	0.01
241	600582	天地科技	77,300	354,807.00	0.01
242	000703	恒逸石化	24,900	354,576.00	0.01
243	002489	浙江永强	55,550	354,409.00	0.01

244	600200	江苏吴中	26,800	353,760.00	0.01
245	603766	隆鑫通用	48,575	353,626.00	0.01
246	002589	瑞康医药	22,880	352,352.00	0.01
247	601689	拓普集团	10,500	351,645.00	0.01
248	600687	刚泰控股	27,300	351,624.00	0.01
249	002155	湖南黄金	36,600	350,262.00	0.01
250	601928	凤凰传媒	35,700	348,432.00	0.01
251	601929	吉视传媒	100,600	348,076.00	0.01
252	000528	柳工	40,255	347,803.20	0.01
253	002342	巨力索具	34,500	347,415.00	0.01
254	600039	四川路桥	83,340	346,694.40	0.01
255	000612	焦作万方	42,800	344,540.00	0.01
256	002358	森源电气	20,158	343,089.16	0.01
257	600086	东方金钰	31,500	340,515.00	0.01
258	600751	天海投资	59,700	339,693.00	0.01
259	002368	太极股份	12,262	339,534.78	0.01
260	300273	和佳股份	27,892	339,166.72	0.01
261	600282	南钢股份	91,200	338,352.00	0.01
262	000090	天健集团	30,460	338,106.00	0.01
263	002709	天赐材料	8,200	337,594.00	0.01
264	600466	蓝光发展	39,000	336,570.00	0.01
265	002657	中科金财	11,600	336,284.00	0.01
266	002285	世联行	41,900	336,038.00	0.01
267	603000	人民网	25,500	335,835.00	0.01
268	600380	健康元	36,800	334,144.00	0.01
269	002503	搜于特	47,300	332,519.00	0.01
270	000937	冀中能源	54,000	330,480.00	0.01
271	600151	航天机电	39,900	328,377.00	0.01
272	600557	康缘药业	19,680	326,884.80	0.01
273	002437	誉衡药业	44,700	325,416.00	0.01
274	600270	外运发展	17,100	323,703.00	0.01
275	600694	大商股份	8,300	323,451.00	0.01
276	000810	创维数字	26,572	322,318.36	0.01
277	000049	德赛电池	6,207	321,584.67	0.01
278	000021	深科技	37,400	320,892.00	0.01
279	000587	金洲慈航	21,500	320,350.00	0.01
280	000543	皖能电力	54,820	319,600.60	0.01
281	600611	大众交通	57,800	319,056.00	0.01
282	600759	洲际油气	52,600	318,756.00	0.01
283	600169	太原重工	82,400	318,064.00	0.01
284	002018	华信国际	46,400	317,840.00	0.01
285	300134	大富科技	13,600	317,696.00	0.01

286	000669	金鸿能源	17,496	317,202.48	0.01
287	600835	上海机电	15,000	317,100.00	0.01
288	002011	盾安环境	27,900	316,665.00	0.01
289	600316	洪都航空	19,685	316,337.95	0.01
290	002056	横店东磁	42,100	315,750.00	0.01
291	300376	易事特	34,800	315,636.00	0.01
292	000829	天音控股	29,200	315,360.00	0.01
293	002249	大洋电机	47,500	312,550.00	0.01
294	603444	吉比特	1,100	311,663.00	0.01
295	000777	中核科技	15,600	311,376.00	0.01
296	000897	津滨发展	66,200	311,140.00	0.01
297	002325	洪涛股份	42,610	311,053.00	0.01
298	601678	滨化股份	44,700	310,665.00	0.01
299	002317	众生药业	25,000	310,500.00	0.01
300	600108	亚盛集团	72,000	310,320.00	0.01
301	000061	农产品	34,200	309,852.00	0.01
302	600267	海正药业	26,500	309,520.00	0.01
303	002242	九阳股份	15,700	308,819.00	0.01
304	600366	宁波韵升	17,500	308,700.00	0.01
305	600645	中源协和	14,300	306,449.00	0.01
306	600187	国中水务	60,600	306,030.00	0.01
307	000766	通化金马	19,100	305,218.00	0.01
308	000572	海马汽车	58,991	304,983.47	0.01
309	000636	风华高科	35,700	303,807.00	0.01
310	000712	锦龙股份	18,500	302,845.00	0.01
311	600848	上海临港	14,000	301,840.00	0.01
312	600993	马应龙	13,855	301,761.90	0.01
313	600563	法拉电子	6,100	301,401.00	0.01
314	600098	广州发展	38,000	300,580.00	0.01
315	000762	西藏矿业	21,100	298,987.00	0.01
316	000848	承德露露	29,860	298,002.80	0.01
317	600545	新疆城建	24,900	297,804.00	0.01
318	000062	深圳华强	11,200	297,136.00	0.01
319	600765	中航重机	21,519	296,531.82	0.01
320	600750	江中药业	8,444	293,429.00	0.01
321	600073	上海梅林	30,500	291,275.00	0.01
322	000596	古井贡酒	5,700	290,415.00	0.01
323	002479	富春环保	24,400	290,360.00	0.01
324	002123	梦网荣信	26,100	289,971.00	0.01
325	002106	莱宝高科	28,620	289,920.60	0.01
326	600729	重庆百货	10,800	289,872.00	0.01
327	002254	泰和新材	21,700	288,610.00	0.01

328	002276	万马股份	28,600	288,574.00	0.01
329	600639	浦东金桥	15,900	288,108.00	0.01
330	300010	立思辰	22,165	287,036.75	0.01
331	600300	维维股份	53,600	286,224.00	0.01
332	601016	节能风电	77,600	285,568.00	0.01
333	002073	软控股份	33,663	285,462.24	0.01
334	002482	广田集团	31,627	284,326.73	0.01
335	600422	昆药集团	25,041	283,964.94	0.01
336	603188	亚邦股份	16,200	282,528.00	0.01
337	002064	华峰氨纶	58,600	282,452.00	0.01
338	002428	云南锗业	26,343	281,343.24	0.01
339	002707	众信旅游	21,349	280,312.37	0.01
340	000099	中信海直	24,800	279,248.00	0.01
341	000652	泰达股份	52,510	278,303.00	0.01
342	000680	山推股份	50,900	277,405.00	0.01
343	002332	仙琚制药	32,150	276,490.00	0.01
344	000620	新华联	38,700	275,157.00	0.01
345	601311	XD 骆驼股	19,300	273,288.00	0.01
346	000541	佛山照明	29,900	272,389.00	0.01
347	000726	鲁泰 A	22,900	271,594.00	0.01
348	002463	沪电股份	59,600	271,180.00	0.01
349	600651	飞乐音响	32,000	271,040.00	0.01
350	600770	综艺股份	36,000	270,000.00	0.01
351	600284	浦东建设	25,173	269,854.56	0.01
352	600259	广晟有色	6,900	269,376.00	0.01
353	000969	安泰科技	30,800	268,884.00	0.01
354	600496	精工钢构	55,600	268,548.00	0.01
355	600587	新华医疗	15,100	268,478.00	0.01
356	001696	宗申动力	35,300	267,221.00	0.01
357	300297	蓝盾股份	24,000	262,800.00	0.01
358	002690	美亚光电	13,700	262,766.00	0.01
359	600216	浙江医药	26,400	261,624.00	0.01
360	002642	荣之联	10,400	260,624.00	0.01
361	600536	中国软件	13,600	260,576.00	0.01
362	600458	时代新材	22,666	259,525.70	0.01
363	002063	远光软件	24,863	259,072.46	0.01
364	300043	星辉娱乐	31,150	255,741.50	0.01
365	002681	奋达科技	20,300	255,577.00	0.01
366	600171	上海贝岭	24,900	253,233.00	0.01
367	000616	海航投资	58,600	251,980.00	0.01
368	000426	兴业矿业	27,900	251,658.00	0.01
369	000552	靖远煤电	69,900	249,543.00	0.01

370	601233	桐昆股份	17,700	245,322.00	0.01
371	600428	中远海特	39,200	243,824.00	0.01
372	600058	五矿发展	19,600	243,236.00	0.01
373	300147	香雪制药	23,610	242,474.70	0.01
374	002727	一心堂	13,100	241,040.00	0.01
375	300039	上海凯宝	33,130	240,855.10	0.01
376	002269	美邦服饰	64,550	240,771.50	0.01
377	600517	置信电气	31,700	239,969.00	0.01
378	002041	登海种业	18,100	239,825.00	0.01
379	002122	天马股份	24,700	238,849.00	0.01
380	002005	德豪润达	50,040	238,690.80	0.01
381	002190	成飞集成	8,900	238,520.00	0.01
382	002663	普邦股份	43,400	235,662.00	0.01
383	603369	今世缘	17,852	235,646.40	0.01
384	603888	新华网	7,250	234,827.50	0.01
385	600329	中新药业	12,925	234,071.75	0.01
386	600805	XD 悦达投	31,802	233,744.70	0.01
387	601777	力帆股份	29,062	233,658.48	0.01
388	002345	潮宏基	21,440	233,052.80	0.01
389	300032	金龙机电	16,700	232,965.00	0.01
390	600894	广日股份	19,600	232,064.00	0.01
391	600736	苏州高新	32,700	231,189.00	0.01
392	600859	王府井	14,300	230,945.00	0.01
393	600880	博瑞传播	35,300	230,509.00	0.01
394	300202	聚龙股份	13,868	229,099.36	0.01
395	600790	轻纺城	33,600	228,816.00	0.01
396	600586	金晶科技	46,700	228,363.00	0.01
397	000417	合肥百货	27,600	227,700.00	0.01
398	002277	友阿股份	35,300	227,685.00	0.01
399	002120	新海股份	4,400	227,040.00	0.01
400	603883	老百姓	4,663	226,854.95	0.01
401	600220	江苏阳光	66,100	226,723.00	0.01
402	600395	盘江股份	30,800	225,764.00	0.01
403	002371	七星电子	9,400	224,848.00	0.01
404	600720	祁连山	28,700	224,721.00	0.01
405	600338	西藏珠峰	5,900	224,141.00	0.01
406	002233	塔牌集团	18,400	223,928.00	0.01
407	603556	海兴电力	5,100	223,839.00	0.01
408	000681	视觉中国	14,200	222,372.00	0.01
409	002588	史丹利	28,854	221,887.26	0.01
410	600773	西藏城投	20,000	221,400.00	0.01
411	002344	海宁皮城	26,300	218,816.00	0.00



412	601886	江河集团	21,300	218,325.00	0.00
413	300291	华录百纳	10,900	218,218.00	0.00
414	002147	新光圆成	14,000	217,560.00	0.00
415	600006	东风汽车	37,100	217,035.00	0.00
416	600801	华新水泥	22,600	215,378.00	0.00
417	603377	东方时尚	5,700	214,263.00	0.00
418	600141	兴发集团	17,100	211,527.00	0.00
419	000693	ST 华泽	16,900	211,250.00	0.00
420	600869	智慧能源	31,000	208,630.00	0.00
421	600757	长江传媒	27,889	208,330.83	0.00
422	600059	古越龙山	22,500	208,125.00	0.00
423	600596	新安股份	24,600	207,870.00	0.00
424	600280	中央商场	26,200	207,766.00	0.00
425	002505	大康农业	59,300	207,550.00	0.00
426	600754	锦江股份	7,600	205,960.00	0.00
427	601001	大同煤业	39,000	204,750.00	0.00
428	600580	卧龙电气	29,900	203,918.00	0.00
429	600053	九鼎投资	5,800	202,768.00	0.00
430	603198	迎驾贡酒	10,600	201,718.00	0.00
431	002309	中利科技	16,092	201,310.92	0.00
432	600628	新世界	17,415	201,143.25	0.00
433	002128	露天煤业	23,100	200,970.00	0.00
434	603816	顾家家居	3,400	199,852.00	0.00
435	600195	中牧股份	10,300	199,717.00	0.00
436	600481	双良节能	37,600	199,656.00	0.00
437	600971	恒源煤电	23,612	191,965.56	0.00
438	600537	亿晶光电	38,300	190,734.00	0.00
439	601002	晋亿实业	22,000	190,300.00	0.00
440	600292	远达环保	17,587	189,587.86	0.00
441	603355	莱克电气	3,200	188,064.00	0.00
442	002699	美盛文化	13,580	187,404.00	0.00
443	600184	光电股份	9,860	184,973.60	0.00
444	600862	中航高科	19,000	184,110.00	0.00
445	002551	尚荣医疗	11,379	183,543.27	0.00
446	600743	华远地产	43,390	183,105.80	0.00
447	600826	兰生股份	10,105	182,900.50	0.00
448	600748	上实发展	25,100	180,720.00	0.00
449	600640	号百控股	10,538	178,092.20	0.00
450	600277	亿利洁能	22,600	176,958.00	0.00
451	600251	冠农股份	22,100	176,137.00	0.00
452	002093	国脉科技	20,000	176,000.00	0.00
453	600996	贵广网络	14,700	175,959.00	0.00

454	002392	北京利尔	29,600	175,528.00	0.00
455	300088	长信科技	11,100	174,825.00	0.00
456	002118	紫鑫药业	25,506	174,205.98	0.00
457	002414	高德红外	9,500	173,850.00	0.00
458	600335	国机汽车	14,513	173,575.48	0.00
459	600831	广电网络	17,400	173,130.00	0.00
460	603169	兰石重装	14,200	172,530.00	0.00
461	002416	爱施德	15,358	165,712.82	0.00
462	000536	华映科技	27,500	159,775.00	0.00
463	002646	青青稞酒	9,000	157,140.00	0.00
464	002251	步步高	12,659	156,845.01	0.00
465	600551	时代出版	9,800	154,742.00	0.00
466	600776	东方通信	22,471	152,353.38	0.00
467	000517	荣安地产	31,600	146,940.00	0.00
468	603001	奥康国际	7,535	141,582.65	0.00
469	603005	晶方科技	5,000	139,950.00	0.00
470	603698	航天工程	5,500	138,600.00	0.00
471	603567	珍宝岛	8,100	136,323.00	0.00
472	002807	江阴银行	10,800	135,324.00	0.00
473	603568	伟明环保	6,200	134,044.00	0.00
474	603328	依顿电子	9,400	133,010.00	0.00
475	603528	多伦科技	8,900	127,893.00	0.00
476	600936	广西广电	15,800	127,506.00	0.00
477	000025	特力 A	2,400	124,176.00	0.00
478	600126	杭钢股份	17,800	122,108.00	0.00
479	600618	氯碱化工	11,000	117,480.00	0.00
480	002315	焦点科技	4,500	112,230.00	0.00
481	603806	福斯特	3,200	102,432.00	0.00
482	601020	华钰矿业	4,600	101,338.00	0.00
483	002194	武汉凡谷	11,400	100,890.00	0.00
484	603868	飞科电器	1,600	98,944.00	0.00
485	002025	航天电器	3,500	87,325.00	0.00
486	603515	欧普照明	2,400	86,688.00	0.00
487	603866	桃李面包	2,400	85,392.00	0.00
488	000761	本钢板材	14,900	77,927.00	0.00
489	603228	景旺电子	1,600	77,200.00	0.00
490	600917	重庆燃气	8,100	76,383.00	0.00
491	002815	崇达技术	2,300	75,992.00	0.00
492	002818	富森美	1,800	71,046.00	0.00
493	601811	新华文轩	4,500	70,020.00	0.00
494	603877	太平鸟	2,000	55,980.00	0.00
495	603658	安图生物	1,200	51,720.00	0.00

496	603801	N 志邦	1,406	47,522.80	0.00
497	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
498	603569	长久物流	1,300	43,459.00	0.00
499	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
500	603025	大豪科技	1,600	42,240.00	0.00
501	600460	士兰微	5,100	30,957.00	0.00
502	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
503	600468	百利电气	3,600	23,400.00	0.00
504	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
505	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
506	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
507	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
508	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
509	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
510	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
511	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
512	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
513	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
514	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
515	002049	紫光国芯	60	1,849.20	0.00
516	603501	韦尔股份	57	1,148.55	0.00
517	002856	美芝股份	30	955.80	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

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	600522	中天科技	5,604,151.04	0.14
2	600201	生物股份	5,281,954.00	0.13
3	600525	长园集团	5,234,135.44	0.13
4	600487	亨通光电	5,192,268.43	0.13
5	600219	南山铝业	4,995,325.50	0.12
6	600584	长电科技	4,902,906.05	0.12
7	601012	隆基股份	4,873,052.54	0.12
8	600079	人福医药	4,788,536.98	0.12
9	600682	南京新百	4,629,414.38	0.11
10	600315	上海家化	4,407,213.86	0.11
11	600166	XD 福田汽	4,189,209.00	0.10
12	600436	片仔癀	4,000,285.50	0.10
13	600879	航天电子	3,884,078.75	0.09

14	600643	爱建集团	3,856,470.76	0.09
15	600699	均胜电子	3,576,306.90	0.09
16	600521	华海药业	3,517,742.21	0.09
17	600056	中国医药	3,480,035.00	0.08
18	600266	北京城建	3,410,286.00	0.08
19	600503	华丽家族	3,393,951.00	0.08
20	600138	XD 中青旅	3,384,418.84	0.08

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	600522	中天科技	5,154,760.96	0.13
2	600682	南京新百	4,402,625.98	0.11
3	600201	生物股份	4,130,693.54	0.10
4	600643	爱建集团	4,116,839.53	0.10
5	600525	长园集团	3,970,325.40	0.10
6	600584	长电科技	3,852,318.36	0.09
7	600487	亨通光电	3,828,093.73	0.09
8	600436	片仔癀	3,750,209.78	0.09
9	600219	南山铝业	3,722,156.00	0.09
10	600079	人福医药	3,625,237.48	0.09
11	601012	隆基股份	3,538,502.00	0.09
12	600315	上海家化	3,271,475.00	0.08
13	600166	XD 福田汽	3,163,604.00	0.08
14	600497	驰宏锌锗	3,070,989.08	0.07
15	600614	鹏起科技	2,742,156.00	0.07
16	600699	均胜电子	2,682,256.83	0.07
17	600879	航天电子	2,662,495.80	0.06
18	600978	宜华生活	2,646,607.00	0.06
19	600503	华丽家族	2,636,257.00	0.06
20	002508	老板电器	2,560,181.64	0.06

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	719,362,219.65
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	583,155,372.70
--------------	----------------

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	南方中证 500ETF	ETF	交易型 开放式	南方基金管理 有限公司	3,965,840,491.39	90.28

#### 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

#### 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 7.13 投资组合报告附注

##### 7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

##### 7.13.2 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。

## 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	377,493.63
2	应收证券清算款	678,733.21
3	应收股利	1,691.14
4	应收利息	43,773.13
5	应收申购款	3,902,206.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	691,575.50
-	合计	5,695,473.60

## 7.13.4 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。

## 7.13.5 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	002168	深圳惠程	1,433,956.00	0.03	重大资产重组
2	000656	金科股份	1,432,914.00	0.03	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

份额级别	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 (%)
南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	412,589	7,047.04	191,621,957.87	6.59	2,715,907,192.29	93.41
南方中证	70	11,272.88	-	-	789,101.38	100.00

500ETF 联接 (LOF)C						
合计	412,659	7,047.75	191,621,957.87	6.59	2,716,696,293.67	93.41

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

南方中证 500ETF 联接 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	徐兴耀	556,600.00	0.02
2	王少琴	555,053.00	0.02
3	姚红伟	529,900.00	0.02
4	牟子豪	515,900.00	0.02
5	薛宜平	454,988.00	0.02
6	郑林祥	370,600.00	0.01
7	张振华	300,000.00	0.01
8	王湘伟	280,000.00	0.01
9	徐梅	275,532.00	0.01
10	翟建忠	268,502.00	0.01

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所 有从业人员持 有本基金	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	3,137,424.17	0.1079
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	602.36	0.0763
	合计	3,138,026.53	0.1079

注：：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开 放式基金	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	>100
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	0
	合计	>100

本基金基金经理持有本开放式基金	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	10~50
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	0~10
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C
基金合同生效日 (2009 年 9 月 25 日) 基金份额总额	3, 223, 217, 818. 45	-
本报告期期初基金份额总额	2, 679, 131, 874. 38	-
本报告期基金总申购份额	1, 195, 092, 734. 40	959, 177. 01
减: 本报告期基金总赎回份额	966, 695, 458. 62	170, 075. 63
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	2, 907, 529, 150. 16	789, 101. 38

注: 本基金 2017 年 2 月 20 日发布公告, 增加 C 类收费模式, 原收费模式成为 A 类。

## § 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 (%)	
国泰君安	1	854,634,063.12	65.83	85,463.75	65.83	-
华泰证券	1	443,607,740.85	34.17	44,365.41	34.17	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	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。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于旗下部分基金增加肯特瑞财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 11 日
2	南方基金关于旗下部分基金增加新浪仓石为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 18 日
3	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) C 类份额开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 2 月 20 日
4	关于南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 增加 C 类份额并修改基金合同的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 2 月 20 日
5	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 2 月 23 日
6	南方基金关于继续开展直销柜台部分指数型基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 1 日
7	南方基金关于旗下部分基金增加华夏财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 15 日
8	南方基金关于旗下部分基金增加苏宁基金、大泰金石为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 10 日
9	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 23 日
10	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 5 日
11	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 5 月 24 日
12	南方基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低申购金额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 6 月 12 日
13	南方基金关于旗下部分基金参加浦发银行基金定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 6 月 30 日

## § 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

注：无。

### 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南方中证 500 指数证券投资基金的文件。
- 2、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金合同。
- 3、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 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>