

南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金 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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	45

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细	45
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	45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	48
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	48
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金	
基金简称	南方中证 500 增强	
交易代码	002906	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 23 日	
基金管理人	南方基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	214,293,253.46 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方中证 500 增强 A	南方中证 500 增强 C
下属分级基金的交易代码	002906	002907
报告期末下属分级基金的份额总额	192,850,572.42 份	21,442,681.04 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“500 量化增强”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金利用量化投资模型，在控制组合跟踪误差的基础上，力求投资收益能够超越目标指数。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+1%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	鲍文革	张建春
	联系电话	0755-82763888	010-63639180
	电子邮箱	manager@southernfund.com	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		400-889-8899	95595

传真	0755-82763889	010-63639132
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	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
邮政编码	518048	100033
法定代表人	张海波	唐双宁

注：-

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	南方基金管理有限公司	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

§ 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 500 增强 A	南方中证 500 增强 C
本期已实现收益	-3,501,805.75	-1,837,119.34
本期利润	475,003.50	-1,454,078.52
加权平均基金份额本期利润	0.0026	-0.0445
本期加权平均净值利润率	0.26%	-4.59%
本期基金份额净值增长率	0.20%	0.00%
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	-3,791,203.48	-346,097.37
期末可供分配基金份额利润	-0.0197	-0.0161
期末基金资产净值	189,514,242.56	21,145,647.71

期末基金份额净值	0.983	0.986
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	-1.70%	-1.40%

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 500 增强 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	5.36%	0.92%	5.21%	0.89%	0.15%	0.03%
过去三个月	-1.70%	0.99%	-3.66%	0.97%	1.96%	0.02%
过去六个月	0.20%	0.90%	-1.39%	0.85%	1.59%	0.05%
自基金合同生效 起至今	-1.70%	0.90%	-6.49%	0.86%	4.79%	0.04%

南方中证 500 增强 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	5.34%	0.90%	5.21%	0.89%	0.13%	0.01%
过去三个月	-1.79%	0.98%	-3.66%	0.97%	1.87%	0.01%

过去六个月	0.00%	0.89%	-1.39%	0.85%	1.39%	0.04%
自基金合同生效起至今	-1.40%	0.89%	-6.49%	0.86%	5.09%	0.03%

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500增强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500增强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：基金合同生效日至本报告期末不满一年。本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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		
李佳亮	本基金基金 经理	2016 年 11 月 23 日		4	美国南加州大学金融工程 硕士，注册金融分析师 (CFA)，具有基金从业 资格。2012 年 8 月加入 南方基金，任量化投资 部研究员；2015 年 5 月 至 2016 年 8 月，任量化 投资经理助理；2016 年 8 月至今，任南方消费基 金经理；2016 年 11 月 至今，任南方中证 500 增 强基金经理；2016 年 12 月至今，任南方绝对收益 基金经理；2017 年 4 月 至今，任南方荣优基金经 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

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 量化增强股票型发起式证券投资基金》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

2017 年上半年中证 500 指数略有回落，整体上先跌后涨，但仍处于区间震荡阶段。本基金此季度投资以指数增强策略股票投资为主，辅以网下新股申购及少量中证 500 期货多头持有。

指数增强股票投资部分：指数增强股票投资策略以南方基金量化指数增强投资模型为主，充分借助南方大数据量化平台的研究成果，根据多因子模型，风格模型及风险模型生成投资组合进行股票投资，有效获取了相对指数的超额收益。网下新股申购部分：享受公募基金网下新股申购的优势，获取稳定可观的新股申购增强收益。期货多头持有部分：持有少量中证 500 期货多头，获取稳定的基差收敛带来的相对指数的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 级份额净值为 0.983 元，报告期内，份额净值增长率为 0.20%，同期业绩基准增长率为-1.39%；本基金 C 级份额净值为 0.986 元，报告期内，份额净值增长率为 0.00%，同期业绩基准增长率为-1.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年，中国经济仍面临比较大的下行压力，经济运行略低预期，名义增长率表现更弱，盈利也大概率将比上半年转弱，但也无需过度悲观。无风险利率回归到中性合理位置，继续大幅上升概率逐渐减小。金融去杠杆的节奏将有所放缓，海外因素也在改变。总体上，叠加经济回落、通胀压力不大，市场总体预计仍将处于区间震荡。经过上半年以“漂亮 50”为代表的一线白马蓝筹的上涨行情，目前一线白马蓝筹股的投资性价比、风险收益比已然降低。下半年随着市场资金风险偏好回升，二线白马蓝筹个股中报业绩亮眼，二线白马蓝筹未来有望接棒“漂亮 50”成为下阶段主力。

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、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，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。基金管理人对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》。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。本基金收益分配采取现金分红方式。每一基金份额享有同等分配权。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

2017 年上半年度，中国光大银行在南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全托管了基金的全部资产，对南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

2017 年上半年度，中国光大银行依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——南方基金管理有限责任公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求；各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际情况进行处理。

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

中国光大银行依法对基金管理人——南方基金管理有限责任公司编制的“南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金 2017 年半年度报告”进行了复核，报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确的。

§ 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 量化增强股票型发起式证券投资基金

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	6.4.7.1	2,336,597.00	156,777,098.93
结算备付金		4,236,169.11	1,131,363.64
存出保证金		1,845,624.66	-
交易性金融资产	6.4.7.2	190,533,588.00	187,220,514.56
其中：股票投资		190,533,588.00	187,220,514.56
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		13,159,063.20	-
应收利息	6.4.7.5	-1,672.78	4,759.18
应收股利		-	-
应收申购款		617,168.79	79,556.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		212,726,537.98	345,213,292.57
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		58,474.56	136,137,739.11
应付赎回款		429,780.77	77,318.75
应付管理人报酬		177,891.35	61,564.56
应付托管费		35,578.26	12,312.91
应付销售服务费		11,317.55	12,294.82
应付交易费用	6.4.7.7	1,159,309.71	246,536.27
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	194,295.51	4,260.02
负债合计		2,066,647.71	136,552,026.44
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	214,293,253.46	212,594,444.71
未分配利润	6.4.7.10	-3,633,363.19	-3,933,178.58
所有者权益合计		210,659,890.27	208,661,266.13

负债和所有者权益总计		212,726,537.98	345,213,292.57
------------	--	----------------	----------------

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额总额 214,293,253.46 份，其中 A 类基金份额总额为 192,850,572.42 份，基金份额净值为 0.983 元；C 类基金份额总额为 21,442,681.04，基金份额净值为 0.986 元。

2、本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间和 2016 年 11 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金

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
一、收入		2,458,176.74
1. 利息收入		124,640.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	97,282.01
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		27,358.92
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,087,800.44
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,252,328.44
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	27,365.00
股利收益	6.4.7.17	2,137,163.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	4,359,850.07
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	61,486.18
减：二、费用		3,437,251.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,052,090.89
2. 托管费	6.4.10.2.2	210,418.15
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	61,929.53
4. 交易费用	6.4.7.20	1,909,335.30

5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.21	203,477.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-979,075.02
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-979,075.02

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金

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）	212,594,444.71	-3,933,178.58	208,661,266.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-979,075.02	-979,075.02
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）	1,698,808.75	1,278,890.41	2,977,699.16
其中：1. 基金申购款	74,055,939.64	-228,248.98	73,827,690.66
2. 基金赎回款	-72,357,130.89	1,507,139.39	-70,849,991.50
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）	214,293,253.46	-3,633,363.19	210,659,890.27

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：

<u>杨小松</u>	<u>徐超</u>	<u>徐超</u>
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 基金基本情况

南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1138 号文《关于准予南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 82,675,811.77 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1457 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 82,689,142.28 份,其中认购资金利息折合 13,330.51 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用的基金份额,称为 A 类;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,股票资产投资比例不低于基金资产的 90%,投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;本基金在每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的

业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 \times 95%+1%。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 2017 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、C 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：(1) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	2,336,597.00
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	2,336,597.00

6.4.7.2 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	187,688,984.45	190,533,588.00	2,844,603.55
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	187,688,984.45	190,533,588.00	2,844,603.55

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 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	2,890.03
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,790.65
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-6,418.08
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	64.62
合计	-1,672.78

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 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	1,159,309.71
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,159,309.71

6.4.7.8 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	817.62
预提费用	183,477.89
其他	-
应付指数使用费	10,000.00
合计	194,295.51

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

南方中证 500 增强 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	180,749,139.40	180,749,139.40
本期申购	24,079,245.64	24,079,245.64
本期赎回（以“-”号填列）	-11,977,812.62	-11,977,812.62
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	192,850,572.42	192,850,572.42

南方中证 500 增强 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	31,845,305.31	31,845,305.31
本期申购	49,976,694.00	49,976,694.00
本期赎回（以“-”号填列）	-60,379,318.27	-60,379,318.27
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	21,442,681.04	21,442,681.04

注：： 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

南方中证 500 增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-357,434.92	-3,121,278.84	-3,478,713.76
本期利润	-3,501,805.75	3,976,809.25	475,003.50
本期基金份额交易产生的变动数	68,037.19	-400,656.79	-332,619.60
其中：基金申购款	73,833.03	-528,366.48	-454,533.45
基金赎回款	-5,795.84	127,709.69	121,913.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,791,203.48	454,873.62	-3,336,329.86
南方中证 500 增强 C			

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	99,728.49	-554,193.31	-454,464.82
本期利润	-1,837,119.34	383,040.82	-1,454,078.52
本期基金份额交易产生的变动数	1,391,293.48	220,216.53	1,611,510.01
其中：基金申购款	855,548.39	-629,263.92	226,284.47
基金赎回款	535,745.09	849,480.45	1,385,225.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-346,097.37	49,064.04	-297,033.33

6.4.7.11 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	58,363.25
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	32,756.79
其他	6,161.97
合计	97,282.01

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 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	635,730,589.37
减：卖出股票成本总额	639,982,917.81
买卖股票差价收入	-4,252,328.44

6.4.7.13 基金投资收益

注：无。

6.4.7.14 债券投资收益

注：无。

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 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
IC1709 CFX	27,365.00

6.4.7.17 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	2,137,163.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,137,163.00

6.4.7.18 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	3,891,935.07
股票投资	3,891,935.07
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	467,915.00
权证投资	-

期货	467,915.00
3、其他	-
合计	4,359,850.07

6.4.7.19 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	55,869.56
补差费归资产	5,616.62
合计	61,486.18

注：1、本基金赎回费率最高不超过 1.5%，随申请份额持有时间增加而递减。

2、对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于 30 日（含）但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 75% 归入基金财产；对于持有期长于 3 个月（含）但小于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 50% 归入基金财产；对于持有期长于 6 个月（含）的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 25% 归入基金财产。

6.4.7.20 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	1,909,335.30
银行间市场交易费用	-
合计	1,909,335.30

6.4.7.21 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	34,712.18
信息披露费	148,765.71
指数使用费	20,000.00
合计	203,477.89

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 0.016% 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 10,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司（“南方基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人、基金销售机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 基金交易

注：无。

6.4.10.1.5 权证交易

注：无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,052,090.89
其中：支付销售机构的客户维护费	29,811.30

注：支付基金管理人南方基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 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 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	210,418.15

注：支付基金托管人中国光大银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 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 500 增强 A	南方中证 500 增强 C	合计
南方基金	-	32,128.63	32,128.63
光大银行	-	40.53	40.53
华泰证券	-	24.88	24.88
合计	-	32,194.04	32,194.04

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期内无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自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 500 增强 A	南方中证 500 增强 C
基金合同生效日(2016年11月23日)持有的基金份额	30,006,916.66	-
期初持有的基金份额	30,006,916.66	-
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	30,006,916.66	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	15.5597%	-%

6.4.10.4.2 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:本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	2,336,597.00	58,363.25

注：本基金的银行活期存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

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	2017-07-05	新股认购	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-

		27 日								
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	-
603933	睿能科技	2017 年 06 月 28 日	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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601313	江南嘉捷	2017-06-12	重大事项	8.79	-	-	94,900	762,918.19	834,171.00	-
600289	XD 亿阳信	2017-05-10	重大事项	10.94	-	-	71,000	887,848.85	776,740.00	-
600603	广汇物流	2017-06-15	重大事项	11.81	-	-	48,500	580,079.97	572,785.00	-
002128	露天煤业	2017-03-17	重大事项	8.70	-	-	40,100	351,335.14	348,870.00	-
300492	山鼎设计	2017-06-06	重大事项	46.03	-	-	2,200	99,082.00	101,266.00	-
600655	豫园商城	2016-12-20	重大事项	11.32	-	-	5,700	63,381.72	64,524.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因股票交易异常波动而实施暂时停牌的股票，该股票将在核查后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金本股票资产跟踪的标的指数为中证 500 指数。本基金主要通过量化投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在控制组合跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。本基金使用基于南方量化平台开发的量化选股模型进行多模型融合，由核心模型和卫星模型构成。目前包括了多因子股票模型、合理价格成长股票模型、相对价值股票模型和短期综合股票模型。

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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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光大银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所

进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.9 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 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	2,336,597.00	-	-	-	2,336,597.00
结算备付金	4,236,169.11	-	-	-	4,236,169.11
存出保证金	159,520.66	-	-	-1,686,104.00	1,845,624.66
交易性金融资产	-	-	-	190,533,588.00	190,533,588.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-1,672.78	-1,672.78
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	74,161.97	-	-	543,006.82	617,168.79
应收证券清算款	-	-	-	13,159,063.20	13,159,063.20
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,806,448.74	-	-	205,920,089.24	212,726,537.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	429,780.77	429,780.77
应付管理人报酬	-	-	-	177,891.35	177,891.35
应付托管费	-	-	-	35,578.26	35,578.26
应付证券清算款	-	-	-	58,474.56	58,474.56
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	11,317.55	11,317.55
应付交易费用	-	-	-	-1,159,309.71	1,159,309.71
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	194,295.51	194,295.51
负债总计	-	-	-	-2,066,647.71	2,066,647.71
利率敏感度缺口	6,806,448.74	-	-	203,853,441.53	210,659,890.27
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	156,777,098.93	0.00	0.00	0.00	156,777,098.93
结算备付金	1,131,363.64	0.00	0.00	0.00	1,131,363.64
交易性金融资产	0.00	0.00	0.00	187,220,514.56	187,220,514.56
应收利息	0.00	0.00	0.00	4,759.18	4,759.18
资产总计	307,948,697.76	-	-	37,264,594.81	345,213,292.57

负债					
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	136,137,739.11	136,137,739.11
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	77,318.75	77,318.75
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	61,564.56	61,564.56
应付托管费	0.00	0.00	0.00	12,312.91	12,312.91
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	12,294.82	12,294.82
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	246,536.27	246,536.27
其他负债	0.00	0.00	0.00	4,260.02	4,260.02
负债总计	0.00	0.00	0.00	136,552,026.44	136,552,026.44
利率敏感度缺口	307,948,697.76	0.00	0.00	99,287,431.63	208,661,266.13

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。

6.4.13.4.1.2 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（2016 年 12 月 31 日同）。

6.4.13.4.2 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。

本基金股票资产跟踪的标的指数为中证 500 指数，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制。本基金投资组合中，投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。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。

6.4.13.4.2.1 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	190,533,588.00	90.45	187,220,514.56	89.72
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	190,533,588.00	90.45	187,220,514.56	89.72

6.4.13.4.2.2 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%	11,000,000.00	-
	业绩比较基准下降 5%	-11,000,000.00	-

6.4.14 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	190,533,588.00	89.57
	其中：股票	190,533,588.00	89.57
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	6,572,766.11	3.09
8	其他各项资产	15,620,183.87	7.34
	合计	212,726,537.98	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

期末指数投资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	227,259.00	0.11
B	采矿业	5,824,397.08	2.76
C	制造业	104,284,915.30	49.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,026,258.00	0.96
E	建筑业	4,484,394.48	2.13
F	批发和零售业	4,937,207.09	2.34
G	交通运输、仓储和邮政业	3,156,578.52	1.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,515,767.43	6.89
J	金融业	-	-
K	房地产业	19,742,160.62	9.37
L	租赁和商务服务业	1,131,520.00	0.54
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,186,938.00	0.56
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	2,558,435.00	1.21
S	综合	1,142,190.00	0.54
	合计	165,218,020.52	78.43

注：-

期末积极投资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	600,745.40	0.29
B	采矿业	770,170.45	0.37
C	制造业	14,884,213.53	7.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,374,914.76	2.08
E	建筑业	1,271,754.62	0.60
F	批发和零售业	1,177,927.10	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	482,846.29	0.23
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	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	587,471.55	0.28
L	租赁和商务服务业	483,833.16	0.23
M	科学研究和技术服务业	101,266.00	0.05
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	572,785.00	0.27
	合计	25,315,567.48	12.02

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	600808	马钢股份	2,500,298	8,851,054.92	4.20
2	002147	新光圆成	393,400	6,113,436.00	2.90
3	600801	华新水泥	499,708	4,762,217.24	2.26
4	600466	蓝光发展	541,500	4,673,145.00	2.22
5	002315	焦点科技	155,800	3,885,652.00	1.84

6	000528	柳工	441,753	3,816,745.92	1.81
7	600312	平高电气	264,400	3,632,856.00	1.72
8	600219	南山铝业	1,051,976	3,566,198.64	1.69
9	601012	隆基股份	191,500	3,274,650.00	1.55
10	600380	XD 健康元	339,500	3,082,660.00	1.46
11	600325	华发股份	366,622	3,061,293.70	1.45
12	002048	宁波华翔	142,210	2,966,500.60	1.41
13	002078	太阳纸业	383,600	2,819,460.00	1.34
14	600348	阳泉煤业	415,506	2,817,130.68	1.34
15	002092	中泰化学	221,300	2,810,510.00	1.33
16	000541	佛山照明	308,000	2,805,880.00	1.33
17	603567	珍宝岛	159,600	2,686,068.00	1.28
18	601233	桐昆股份	188,486	2,612,415.96	1.24
19	000703	恒逸石化	175,200	2,494,848.00	1.18
20	300039	上海凯宝	325,820	2,368,711.40	1.12
21	600862	中航高科	235,891	2,285,783.79	1.09
22	002437	誉衡药业	281,100	2,046,408.00	0.97
23	002468	艾迪西	79,908	2,030,462.28	0.96
24	002244	滨江集团	286,760	1,984,379.20	0.94
25	600720	祁连山	252,800	1,979,424.00	0.94
26	603806	福斯特	60,862	1,948,192.62	0.92
27	002063	远光软件	185,100	1,928,742.00	0.92
28	000418	小天鹅 A	40,491	1,894,573.89	0.90
29	300324	旋极信息	103,312	1,884,410.88	0.89
30	600694	大商股份	48,197	1,878,237.09	0.89
31	600537	亿晶光电	365,693	1,821,151.14	0.86
32	600026	中远海能	269,500	1,786,785.00	0.85
33	300296	利亚德	89,599	1,684,461.20	0.80
34	600240	华业资本	183,500	1,662,510.00	0.79
35	002001	新和成	84,860	1,647,132.60	0.78
36	600039	四川路桥	393,628	1,637,492.48	0.78
37	300113	顺网科技	60,500	1,627,450.00	0.77
38	300115	长盈精密	54,289	1,584,153.02	0.75
39	600517	置信电气	208,800	1,580,616.00	0.75
40	600971	恒源煤电	193,300	1,571,529.00	0.75
41	600201	生物股份	43,500	1,547,295.00	0.73
42	000488	晨鸣纸业	119,100	1,536,390.00	0.73
43	600978	宜华生活	151,338	1,520,946.90	0.72
44	603025	大豪科技	56,900	1,502,160.00	0.71
45	603766	隆鑫通用	204,700	1,490,216.00	0.71
46	000090	天健集团	128,900	1,430,790.00	0.68
47	600284	浦东建设	132,100	1,416,112.00	0.67

48	000830	鲁西化工	203,607	1,404,888.30	0.67
49	600628	新世界	120,800	1,395,240.00	0.66
50	600611	大众交通	248,151	1,369,793.52	0.65
51	600757	长江传媒	180,400	1,347,588.00	0.64
52	002002	鸿达兴业	168,800	1,321,704.00	0.63
53	600409	三友化工	120,000	1,208,400.00	0.57
54	603568	伟明环保	54,900	1,186,938.00	0.56
55	300010	立思辰	90,200	1,168,090.00	0.55
56	600805	悦达投资	155,400	1,142,190.00	0.54
57	002344	海宁皮城	136,000	1,131,520.00	0.54
58	000501	鄂武商 A	60,800	1,122,368.00	0.53
59	600748	上实发展	155,500	1,119,600.00	0.53
60	000587	金洲慈航	74,400	1,108,560.00	0.53
61	600642	申能股份	174,200	1,097,460.00	0.52
62	300202	聚龙股份	61,200	1,011,024.00	0.48
63	000761	本钢板材	192,268	1,005,561.64	0.48
64	002317	众生药业	79,600	988,632.00	0.47
65	603005	晶方科技	34,700	971,253.00	0.46
66	601929	吉视传媒	262,500	908,250.00	0.43
67	002217	合力泰	88,794	877,284.72	0.42
68	002440	闰土股份	54,400	830,144.00	0.39
69	002120	新海股份	16,000	825,600.00	0.39
70	600289	XD 亿阳信	71,000	776,740.00	0.37
71	603198	迎驾贡酒	40,700	774,521.00	0.37
72	002093	国脉科技	85,877	755,717.60	0.36
73	601699	潞安环能	95,320	745,402.40	0.35
74	000598	兴蓉环境	132,600	745,212.00	0.35
75	002601	佰利联	44,200	723,996.00	0.34
76	002273	水晶光电	34,600	713,798.00	0.34
77	601928	凤凰传媒	67,600	659,776.00	0.31
78	600422	昆药集团	55,562	630,073.08	0.30
79	600831	广电网络	62,601	622,879.95	0.30
80	002354	天神娱乐	28,100	604,150.00	0.29
81	601311	骆驼股份	42,185	597,339.60	0.28
82	002106	莱宝高科	58,503	592,635.39	0.28
83	600053	九鼎投资	16,500	576,840.00	0.27
84	600582	XD 天地科	123,000	564,570.00	0.27
85	002019	亿帆医药	33,600	560,448.00	0.27
86	603188	亚邦股份	32,000	558,080.00	0.26
87	000860	顺鑫农业	27,700	554,277.00	0.26
88	600551	时代出版	34,900	551,071.00	0.26
89	600183	生益科技	41,800	515,812.00	0.24

90	600639	浦东金桥	28,406	514,716.72	0.24
91	600056	中国医药	17,700	459,315.00	0.22
92	600750	江中药业	12,300	427,425.00	0.20
93	600566	济川药业	11,100	422,133.00	0.20
94	600776	东方通信	60,200	408,156.00	0.19
95	603866	桃李面包	11,201	398,531.58	0.19
96	300026	红日药业	81,580	384,241.80	0.18
97	000825	太钢不锈	85,700	372,795.00	0.18
98	002727	一心堂	19,900	366,160.00	0.17
99	300297	蓝盾股份	32,300	353,685.00	0.17
100	002128	露天煤业	40,100	348,870.00	0.17
101	002646	青青稞酒	19,700	343,962.00	0.16
102	601020	华钰矿业	15,500	341,465.00	0.16
103	600894	广日股份	27,129	321,207.36	0.15
104	000726	鲁泰 A	25,033	296,891.38	0.14
105	600195	中牧股份	13,400	259,826.00	0.12
106	002477	雏鹰农牧	51,300	227,259.00	0.11
107	300136	信维通信	4,600	184,092.00	0.09
108	000690	宝新能源	30,700	183,586.00	0.09
109	000050	深天马 A	8,100	166,617.00	0.08
110	603369	今世缘	12,400	163,680.00	0.08
111	002073	软控股份	17,700	150,096.00	0.07
112	600499	科达洁能	16,900	134,186.00	0.06
113	600126	杭钢股份	17,700	121,422.00	0.06
114	000400	许继电气	6,737	120,996.52	0.06
115	002635	安洁科技	3,028	109,674.16	0.05
116	603883	老百姓	2,200	107,030.00	0.05
117	600655	豫园商城	5,700	64,524.00	0.03
118	601678	滨化股份	7,327	50,922.65	0.02
119	600064	南京高科	2,400	36,240.00	0.02
120	600755	厦门国贸	400	3,648.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601636	旗滨集团	753,388	3,397,779.88	1.61
2	600236	桂冠电力	519,000	2,958,300.00	1.40
3	000959	首钢股份	277,933	1,942,751.67	0.92
4	600438	通威股份	337,900	1,885,482.00	0.90
5	002587	奥拓电子	190,750	1,438,255.00	0.68

6	600681	百川能源	190,750	1,330,573.00	0.68
7	300393	中来股份	190,750	1,182,715.00	0.68
8	000813	德展健康	190,750	1,137,434.00	0.68
9	002775	文科园林	190,750	1,125,179.62	0.68
10	002091	江苏国泰	190,750	984,815.10	0.68
11	300306	远方光电	190,750	942,665.35	0.68
12	601313	江南嘉捷	190,750	834,171.00	0.68
13	601225	陕西煤业	190,750	770,170.45	0.68
14	300360	炬华科技	190,750	637,201.95	0.68
15	002714	牧原股份	190,750	600,745.40	0.68
16	600052	浙江广厦	190,750	587,471.55	0.68
17	600603	广汇物流	190,750	572,785.00	0.68
18	000415	渤海金控	190,750	483,833.16	0.68
19	600035	楚天高速	190,750	430,766.29	0.68
20	300046	台基股份	190,750	426,360.00	0.68
21	300349	金卡股份	190,750	276,380.08	0.68
22	600051	宁波联合	190,750	193,112.00	0.68
23	300316	晶盛机电	190,750	171,175.45	0.68
24	600782	新钢股份	190,750	164,250.00	0.68
25	000498	山东路桥	190,750	146,575.00	0.68
26	300492	山鼎设计	190,750	101,266.00	0.68
27	000531	穗恒运 A	190,750	86,041.76	0.68
28	300228	富瑞特装	190,750	58,552.00	0.68
29	600350	山东高速	190,750	52,080.00	0.68
30	603801	志邦股份	190,750	47,522.80	0.68
31	603043	广州酒家	190,750	45,738.70	0.68
32	300666	江丰电子	190,750	43,448.84	0.68
33	603380	易德龙	190,750	35,370.50	0.68
34	600966	博汇纸业	190,750	32,178.00	0.68
35	002879	长缆科技	190,750	23,660.26	0.68
36	002881	美格智能	190,750	22,608.54	0.68
37	603679	华体科技	190,750	21,438.50	0.68
38	603938	三孚股份	190,750	20,932.80	0.68
39	002882	金龙羽	190,750	18,389.20	0.68
40	603933	睿能科技	190,750	17,311.40	0.68
41	603305	旭升股份	190,750	15,212.26	0.68
42	300669	沪宁股份	190,750	14,650.22	0.68
43	603286	日盈电子	190,750	13,528.00	0.68
44	603331	百达精工	190,750	9,620.37	0.68
45	300671	富满电子	190,750	7,639.62	0.68
46	603617	君禾股份	190,750	7,429.76	0.68

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	600325	华发股份	13,871,495.04	6.65
2	002366	台海核电	9,403,844.52	4.51
3	000959	首钢股份	9,396,364.61	4.50
4	600808	马钢股份	9,288,344.79	4.45
5	000703	恒逸石化	7,301,772.63	3.50
6	601233	桐昆股份	7,266,772.94	3.48
7	000960	锡业股份	7,000,715.12	3.36
8	600862	中航高科	6,952,726.53	3.33
9	600236	桂冠电力	6,941,098.18	3.33
10	601699	潞安环能	6,866,070.65	3.29
11	002477	雏鹰农牧	6,795,961.50	3.26
12	600380	健康元	6,499,486.62	3.11
13	002147	新光圆成	6,494,682.00	3.11
14	300324	旋极信息	6,480,368.40	3.11
15	600537	亿晶光电	5,576,269.96	2.67
16	600801	华新水泥	5,558,640.84	2.66
17	002001	新和成	5,423,389.35	2.60
18	002354	天神娱乐	5,241,185.47	2.51
19	000528	柳工	5,117,492.44	2.45
20	002118	紫鑫药业	5,107,876.73	2.45
21	002244	滨江集团	5,104,218.28	2.45
22	600231	凌钢股份	4,969,443.01	2.38
23	600466	蓝光发展	4,839,053.00	2.32
24	002357	富临运业	4,734,369.59	2.27
25	300115	长盈精密	4,720,650.74	2.26
26	600694	大商股份	4,686,965.62	2.25
27	000726	鲁泰 A	4,593,621.72	2.20
28	002315	焦点科技	4,579,917.90	2.19
29	601012	隆基股份	4,542,774.87	2.18
30	603567	珍宝岛	4,430,442.08	2.12
31	600312	平高电气	4,240,702.51	2.03

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	600325	华发股份	12,558,830.75	6.02
2	600894	广日股份	8,903,655.99	4.27
3	002366	台海核电	8,573,093.25	4.11
4	000959	首钢股份	8,010,488.06	3.84
5	002477	雏鹰农牧	7,136,586.76	3.42
6	002309	中利科技	6,654,252.05	3.19
7	000960	锡业股份	6,567,507.03	3.15
8	600997	开滦股份	6,456,963.94	3.09
9	600755	厦门国贸	6,111,614.73	2.93
10	000919	金陵药业	5,821,576.66	2.79
11	601699	潞安环能	5,605,108.20	2.69
12	601233	桐昆股份	5,315,294.39	2.55
13	600231	凌钢股份	4,951,350.00	2.37
14	000600	建投能源	4,916,184.52	2.36
15	000703	恒逸石化	4,808,386.24	2.30
16	600291	西水股份	4,746,498.86	2.27
17	002354	天神娱乐	4,732,635.86	2.27
18	600750	江中药业	4,684,637.79	2.25
19	002118	紫鑫药业	4,682,927.92	2.24
20	601886	江河集团	4,546,521.77	2.18
21	000667	美好置业	4,533,303.00	2.17
22	002317	众生药业	4,450,878.07	2.13
23	600483	福能股份	4,442,260.67	2.13
24	000501	鄂武商 A	4,416,921.99	2.12
25	002244	滨江集团	4,343,303.20	2.08
26	601012	隆基股份	4,339,711.01	2.08
27	000726	鲁泰 A	4,268,175.27	2.05
28	300324	旋极信息	4,237,627.28	2.03
29	002001	新和成	4,205,518.19	2.02

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	636,411,496.06
卖出股票收入（成交）总额	635,730,589.37

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
IC1709	IC1709	7	8,430,520.00	467,915.00	-
公允价值变动总额合计（元）					467,915.00
股指期货投资本期收益（元）					27,365.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					467,915.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

多头套期保值策略

本基金为指数增强基金，当指数期货大幅贴水时，可采用多头套期保值策略，即卖出部分股票持仓并买入指数期货的期货替代现货策略。持有至基差收敛，赚取期货与现货指数的价差，增强指数。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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	1,845,624.66
2	应收证券清算款	13,159,063.20
3	应收股利	-
4	应收利息	-1,672.78
5	应收申购款	617,168.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	15,620,183.87

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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 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 500 增强 A	3,644	52,922.77	162,906,818.55	84.47	29,943,753.87	15.53
南方中证 500 增强 C	1,281	16,739.02	10,099,663.37	47.10	11,343,017.67	52.90
合计	4,925	43,511.32	173,006,481.92	80.73	41,286,771.54	19.27

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 500 增强 A	502,740.01	0.2607
	南方中证 500 增强 C	15,631.04	0.0729
	合计	518,371.05	0.2419

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）。

8.3 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 500 增强 A	-
	南方中证 500 增强 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	南方中证 500 增强 A	10~50
	南方中证 500 增强 C	-
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,639.15	4.67	9,900,000.00	4.62	自合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	105,022.16	0.05	100,000.00	0.05	自合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-

合计	10,107,661.31	4.72	10,000,000.00	4.67	自合同生效之日起不少于 3 年
----	---------------	------	---------------	------	-----------------

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方中证 500 增强 A	南方中证 500 增强 C
基金合同生效日（2016 年 11 月 23 日）基金份额总额	25,994,568.76	56,694,573.52
本报告期期初基金份额总额	180,749,139.40	31,845,305.31
本报告期基金总申购份额	24,079,245.64	49,976,694.00
减：本报告期基金总赎回份额	11,977,812.62	60,379,318.27
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	192,850,572.42	21,442,681.04

§ 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	
国联证券	2	1,272,142,085.43	100.00%	1,159,309.71	100.00%	-

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	成交金额	占当期债券回购成交总额	成交金额	占当期权证成交总额	成交金额	占当期基金成交总额

		的比例		的比例		的比例		的比例
国联证券	-	-%	83,500,000.00	100.00%	-	-%	-	-%

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
2	南方基金关于旗下部分基金增加北京银行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5月2日
3	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
4	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
5	南方基金关于旗下部分基金增加大河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4月6日
6	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
7	南方基金关于旗下部分基金增加萧山农商银行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6日
8	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
9	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
10	南方基金关于旗下部分基金增加金斧子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6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

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	152,904,179.40	-	-	152,904,179.40	71.35
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。

§ 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 量化增强股票型发起式证券投资基金的文件。
- 2、中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金基金合同。
- 3、中证 500 量化增强股票型发起式证券投资基金托管协议。
- 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>