

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 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 03 月 29 日

重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方中证 500ETF 联接 (LOF)	
场内简称	南方 500	
基金主代码	160119	
前端交易代码	160119	
后端交易代码	160120	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2009 年 9 月 25 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
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	2,767,041,393.43 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	2,697,875,756.00 份	69,165,637.43 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”。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510500

基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 日
基金管理人名称	南方基金管理股份有限公司
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	本基金采用被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,以实现对标指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金,原则上采用指数复制法,按照成份股在中证 500 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。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,并辅之以金融衍生产品投资管理等,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%,年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	常克川	贺倩
	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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指 标	报告期(2017年01月01日 -2017年12月31日)		报告期(2016年01月01日 -2016年12月31日)		报告期(2015年01月01日 -2015年12月31日)	
	南方中证 500ETF 联接 (LOF)A	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C	南方中证 500ETF 联接 (LOF)A	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C	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	142,482,136 .41	906,967.45	98,556,570. 65	0.00	1,821,105,3 99.31	0.00
本期利	99,576,763.	4,985,881.3	-	0	1,995,258,2	0.00

润	49	0	857,843,518 .26		55.72	
加权平均基金份额本期利润	0.0355	0.1640	-0.2838	0	0.7542	0.0000
本期基金份额净值增长率	0.64%	-1.90%	-15.19%	0.00%	44.14%	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2017年12月31日)		报告期(2016年12月31日)		报告期(2015年12月31日)	
期末可供分配基金份额利润	0.5411	0.5433	0.5313	0	0.7922	0.0000
期末基金资产净值	4,157,669,0 22.60	106,746,526 .53	4,102,521,3 14.05	0	5,701,544,8 56.19	0.00
期末基金份额净值	1.5411	1.5433	1.5313	0	1.8055	0.0000

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、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	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

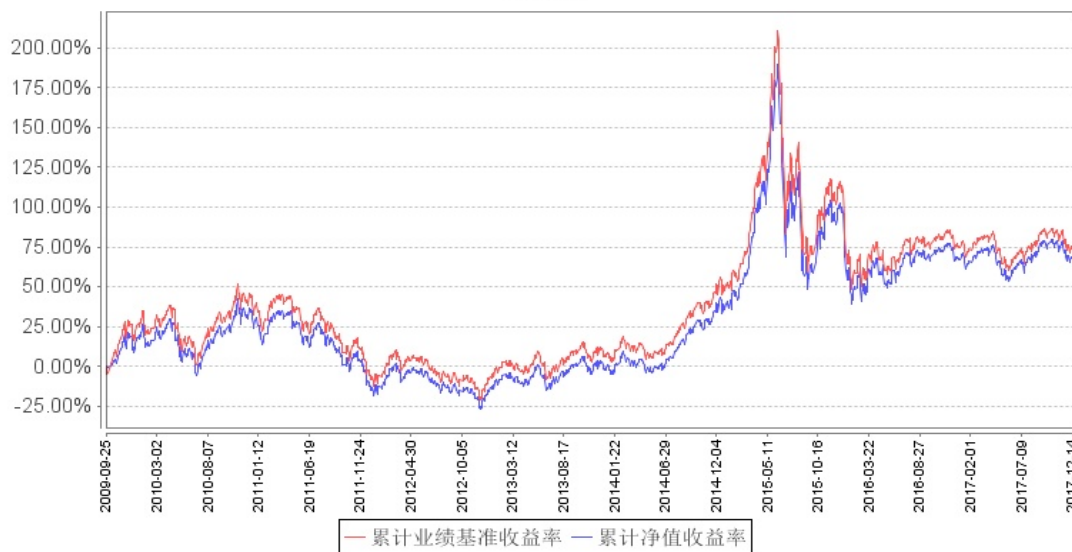
	①	标准差②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	-5.00%	0.93%	-5.06%	0.93%	0.06%	0.00%
过去六个月	2.03%	0.91%	1.78%	0.91%	0.25%	0.00%
过去一年	0.64%	0.88%	-0.13%	0.88%	0.77%	0.00%
过去三年	23.03%	1.94%	17.42%	1.93%	5.61%	0.01%
过去五年	94.60%	1.71%	86.68%	1.70%	7.92%	0.01%
自基金合同 修改起至今	68.15%	1.65%	74.60%	1.65%	-6.45%	0.00%

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
过去三个月	-5.10%	0.93%	-5.06%	0.93%	-0.04%	0.00%
过去六个月	1.82%	0.91%	1.78%	0.91%	0.04%	0.00%
自基金合同 修改起至今	-1.90%	0.89%	-2.89%	0.90%	0.99%	-0.01%

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



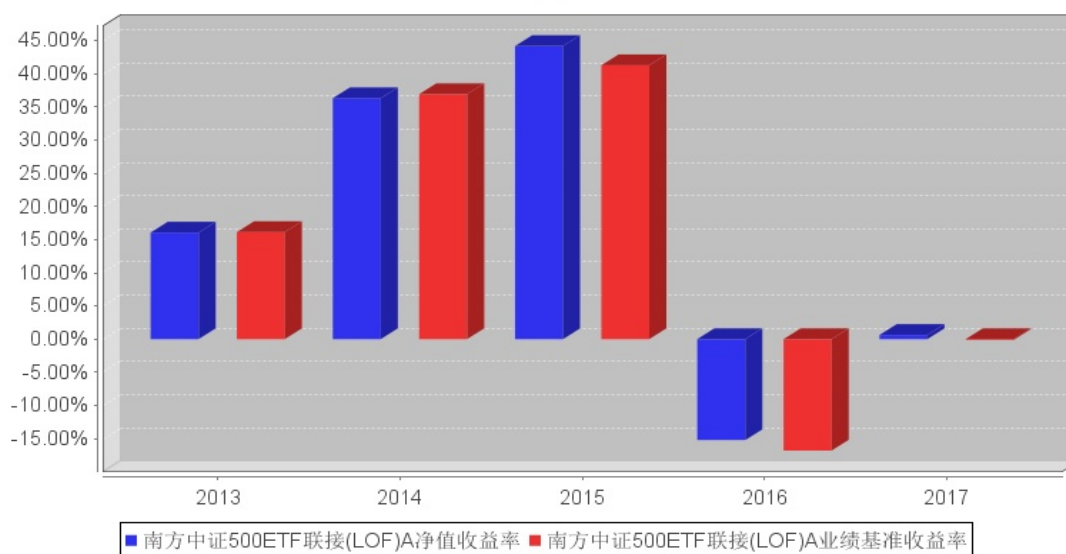
南方中证500ETF联接(LOF)C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



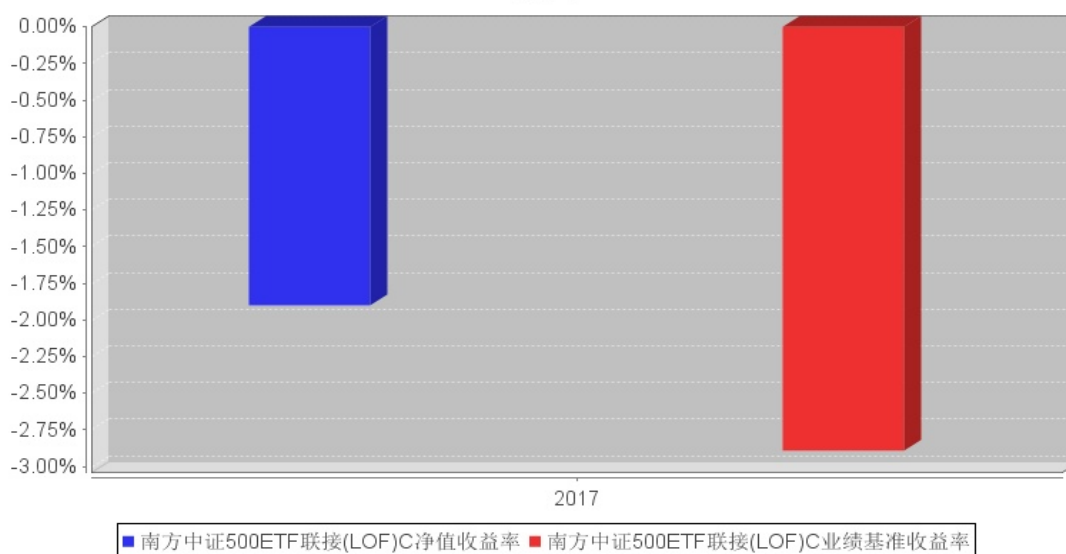
注：本基金 2017 年 2 月 20 日发布公告，增加 C 类收费模式，原有收费模式称为 A 类。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方中证500ETF联接(LOF)A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



南方中证500ETF联接(LOF)C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日,经中国证监会批准,南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立,成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司，注册资本金 3 亿元人民币。目前股权结构：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%及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，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超 7,200 亿元，旗下管理 153 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、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， 现任指数投资部兼数量化投资部总经理；2013 年 5 月至 2015 年 6 月，任南方策略基金经理； 2013 年 4 月至今，任南方 500 基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月 至今，任南方 300 基金经理；2013 年 5 月至今， 任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2014 年 10 月 至今，任 500 医药基金经理；2015 年 2 月至今， 任南方恒生 ETF 基金经理；2016 年 12 月至今，任 南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理； 2017 年 7 月至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月至今，任南方房地产联接、南方房地产 ETF 基 金经理；2017 年 11 月至今，任南方策略、南方量 化混合基金经理。

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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为5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，相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，中证500指数跌0.2%。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) 大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- (2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；
- (3) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；
- (4) 期间，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

本报告期基金 A 级净值增长率为 0.64%，同期业绩比较基准收益率为-0.13%。本报告期基金 C 级净值增长率为-1.90%，同期业绩比较基准收益率为-2.89%。

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 2018 年，国内经济阶段企稳、结构转型将带来更高质量的盈利，综合看，权益市场预期将有一个较好的表现。

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

4.6 管理人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。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。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：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，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；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；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人、登记机构可在法律法规允许的前提下，按照监管部门要求履行适当程序后，经与基金托管人协商一致酌情调整以上基金收益分配原则，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

本基金 2017 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计, 注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2018)第 22854 号“标准无保留意见的审计报告”, 投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	157,996,155.57	227,730,372.51
结算备付金		201,396.65	67,344.58
存出保证金		155,266.33	390,712.97
交易性金融资产	7.4.7.2	4,118,418,847.97	3,890,046,070.01
其中: 股票投资		180,974,094.94	141,785,533.20
基金投资		3,859,192,327.06	3,748,260,536.81
债券投资		78,252,425.97	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,069.47	-
应收利息	7.4.7.5	1,948,818.65	41,066.53
应收股利		1,691.14	1,691.14
应收申购款		9,607,622.47	4,376,105.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	93,471.20	1,357,532.42
资产总计		4,288,426,339.45	4,124,010,896.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		14,048,777.45	13,316,293.47
应付赎回款		9,269,575.99	7,536,613.81
应付管理人报酬		166,641.91	128,959.19
应付托管费		33,328.37	25,791.84
应付销售服务费		34,475.88	-
应付交易费用	7.4.7.7	17,524.16	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	7.4.7.8	440,466.56	433,398.24
负债合计		24,010,790.32	21,489,581.98
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,767,041,393.43	2,679,131,874.38
未分配利润	7.4.7.10	1,497,374,155.70	1,423,389,439.67
所有者权益合计		4,264,415,549.13	4,102,521,314.05
负债和所有者权益总计		4,288,426,339.45	4,124,010,896.03

注:报告截止日 2017 年 12 月 31 日, 基金份额总额 2,767,041,393.43 份, 其中南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) A 类基金份额总额 2,697,875,756.00 份, 基金份额净值为 1.5411 元; 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 类基金份额 69,165,637.43 份, 基金份额净值为 1.5433 元。

7.2 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 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		108,845,216.81	-852,023,229.58
1. 利息收入		1,874,464.05	1,993,500.96
其中: 存款利息收入	7.4.7.11	1,718,356.96	1,937,197.86
债券利息收入		27,029.36	9.13
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		129,077.73	56,293.97
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		143,011,870.26	96,658,060.63
其中: 股票投资收益	7.4.7.12	24,359,071.36	-9,435,918.77
基金投资收益	7.4.7.13	117,214,049.74	105,815,502.11

债券投资收益	7.4.7.14	28,714.77	11,335.35
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	1,410,034.39	267,141.94
3. 公允价值变动收益	7.4.7.18	-38,826,459.07	-956,400,088.91
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.19	2,785,341.57	5,725,297.74
减：二、费用		4,282,572.02	5,820,288.68
1. 管理人报酬		1,989,169.30	1,605,369.35
2. 托管费		397,833.80	321,073.85
3. 销售服务费		159,393.80	-
4. 交易费用	7.4.7.20	1,248,118.84	3,404,100.05
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	488,056.28	489,745.43
三、利润总额		104,562,644.79	-857,843,518.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润		104,562,644.79	-857,843,518.26

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	104,562,644.79	104,562,644.79
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）	87,909,519.05	-30,577,928.76	57,331,590.29
其中：1. 基金申购款	1,967,081,112.30	1,042,607,601.79	3,009,688,714.09
2. 基金赎回	-1,879,171,593.25	-1,073,185,530.55	-2,952,357,123.80

款			
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）	2,767,041,393.43	1,497,374,155.70	4,264,415,549.13
项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	-857,843,518.26	-857,843,518.26
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）	-478,814,550.39	-262,365,473.49	-741,180,023.88
其中：1. 基金申购款	2,766,051,667.81	1,304,293,694.49	4,070,345,362.30
2. 基金赎回款	-3,244,866,218.20	-1,566,659,167.98	-4,811,525,386.18
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）	2,679,131,874.38	1,423,389,439.67	4,102,521,314.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

杨小松

徐超

徐超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，本基金自2017年12月25日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.2 税项

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

- (1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。
- (2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计

入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司
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:1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》，公司名称由“南方基金管理有限公司”变更为“南方基金管理股份有限公司”，公司股权结构等事项未发生变化，并已于 2018 年 1 月 4 日在深圳市市场监督管理局完成相应变更登记手续。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华泰证券	556,808,366.02	31.90	949,374,048.64	31.91

7.4.4.1.2 基金交易

注:无。

7.4.4.1.3 权证交易

注:无。

7.4.4.1.4 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12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	55,686.23	31.90	4,958.77	28.30
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	94,947.24	6.56	20,414.27	42.07

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。

7.4.4.2 关联方报酬**7.4.4.2.1 基金管理费**

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,989,169.30	1,605,369.35
其中: 支付销售机构的客户维护费	5,267,170.87	4,475,515.23

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。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	397,833.80	321,073.85

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：

$$\text{日托管费} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产}) \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

7.4.4.2.3 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 12 月 31 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	-	158,922.99	158,922.99
华泰证券	-	0.38	0.38
合计	-	158,923.37	158,923.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 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	-	-	-
华泰证券	-	-	-
合计	-	-	-

注：本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取销售服务费，支付 C 类基金份额销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的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 0.40% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 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 12月31日	本期 2017年01月01日至2017年 12月31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	13,000,000.00	-
期末持有的基金份额	39,873,972.73	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.48%	-
项目	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年 12月31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	1.97%	-

注: 基金管理人南方基金在本年度赎回本基金的交易委托华泰证券办理, 适用费率按照本基金招募说明书的规定执行。。

7.4.4.4.2 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。

7.4.4.5 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12月 31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	157,996,155.57	1,643,058.23	227,730,372.51	1,814,907.00

注:本基金由基金托管人中国农业银行保管的银行存款,按银行约定利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末,本基金持有 585,773,402 份目标 ETF 基金份额(于 2016 年 12 月 31 日: 571,773,402 份),占其份额的比例为 20.84%(于 2016 年 12 月 31 日: 22.41%)。

7.4.5 期末本基金持有的流通受限证券**7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
7.4.12.1.2 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:)	期末成本总额	期末估值总额	备注

							张)			
110041	蒙电 转债	2017-12-22	2018-01-09	新债 未上 市	100.00	100.00	400	40,000.00	40,000.00	-
128029	太阳 转债	2017-12-22	2018-01-16	新债 未上 市	100.00	100.00	311	31,100.00	31,100.00	-
123004	铁汉 转债	2017-12-18	2018-01-26	新债 未上 市	100.00	100.00	284	28,400.00	28,400.00	-
128027	崇达 转债	2017-12-15	2018-01-22	新债 未上 市	100.00	100.00	43	4,300.00	4,300.00	-

7.4.5.2 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	2017-12-19	拟披露重大事项	13.76	-	-	84,400	1,330,387.22	1,161,344.00	
600525	长园集团	2017-12-25	重大事项未公告	15.79	2018-1-10	17.3	56,816	1,041,679.33	897,124.64	
300156	神雾环保	2017-07-17	重大资产重组	24.16	2018-1-17	21.74	33,100	954,642.21	799,696.00	
002366	台海核电	2017-12-06	重大资产重组	26.45	-	-	20,100	516,655.96	531,645.00	
600614	鹏起科技	2017-12-26	重大事项未公告	10.16	-	-	45,695	542,719.46	464,261.20	
002745	木林森	2017-12-28	重大事项	45.50	2018-1-5	46.5	9,100	424,337.00	414,050.00	
002004	华邦健康	2017-12-14	重大事项	6.73	2018-3-14	7.30	61,500	488,671.36	413,895.00	
000806	银河生物	2017-07-18	重大资产重组	10.76	2018-1-18	10.01	36,600	474,402.94	393,816.00	
000930	中粮生化	2017-10-24	重大资产重组	13.34	-	-	29,200	365,949.84	389,528.00	
600664	哈药股份	2017-09-28	重大资产重组	5.81	2018-2-27	6.00	66,301	385,753.87	385,208.81	
002512	达华智能	2017-12-06	拟披露重大事项	18.07	2018-3-6	16.26	21,100	346,450.94	381,277.00	

600645	中源协和	2017-10-09	重大资产重组	28.40	2018-1-19	25.56	13,400	348,407.66	380,560.00
000006	深振业A	2017-09-11	重大资产重组	9.85	2018-3-8	8.87	36,300	310,810.71	357,555.00
000926	福星股份	2017-12-26	重大事项	10.89	2018-1-10	11.98	32,800	399,582.36	357,192.00
000979	中弘股份	2017-09-07	重大资产重组	1.94	2018-2-14	1.75	182,248	342,875.91	353,561.12
300383	光环新网	2017-11-07	拟披露重大事项	13.19	2018-3-19	14.51	26,400	330,372.31	348,216.00
600187	国中水务	2017-11-09	重大资产重组	4.68	2018-3-20	4.21	72,500	338,704.16	339,300.00
000031	中粮地产	2017-07-24	重大资产重组	8.00	-	-	41,500	349,469.10	332,000.00
000592	平潭发展	2017-08-09	重大资产重组	5.75	2018-1-29	5.7	57,400	340,918.62	330,050.00
300116	坚瑞沃能	2017-12-18	重大资产重组	7.62	-	-	42,000	378,904.20	320,040.00
000566	海南海药	2017-11-22	重大资产重组	12.89	-	-	24,290	316,470.04	313,098.10
000547	航天发展	2017-10-30	重大事项	10.26	-	-	30,361	436,664.79	311,503.86
000401	冀东水泥	2017-11-21	重大资产重组	13.79	2018-1-15	15.17	20,460	320,698.89	282,143.40
000156	华数传媒	2017-12-26	重大事项	11.40	-	-	24,700	320,443.00	281,580.00
300134	大富科技	2017-12-18	拟披露重大事项	16.45	2018-3-19	14.81	16,600	357,162.08	273,070.00
002122	天马股份	2017-12-19	重大事项	8.49	-	-	30,800	325,515.55	261,492.00
000939	凯迪生态	2017-11-16	重大资产重组	4.99	-	-	47,600	271,806.05	237,524.00
300159	新研股份	2017-11-23	重大资产重组	10.40	2018-3-22	9.36	22,600	323,107.33	235,040.00
002358	森源电气	2017-12-07	重大资产重组	14.86	2018-3-7	15.05	14,358	257,667.88	213,359.88
000693	*ST华泽	2016-03-01	重大事项	12.50	2018-3-21	11.88	16,900	250,450.70	211,250.00
002345	潮宏基	2017-12-20	重大事项	10.75	-	-	18,840	204,643.03	202,530.00
000766	通化金马	2017/11/24	重大资产重组	13.60	-	-	13,100	219,515.20	178,160.00
300032	金龙机电	2017-	拟披露重	13.8	-	-	11,000	161,269.54	152,790.00

	电	11-27	大事项	9					
300010	立思辰	2017-11-17	拟披露重大事项	11.17	2018-2-22	10.05	13,265	204,070.52	148,170.05
002344	海宁皮城	2017-11-01	拟披露重大事项	7.93	2018-1-31	7.44	15,600	156,720.75	123,708.00
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项	41.55	2018-1-2	45.71	821	6,863.56	34,112.55
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项	35.26	2018-1-2	38.79	821	10,311.76	28,948.46

注:本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注:无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	180,974,094.94	4.22
	其中:股票	180,974,094.94	4.22
2	基金投资	3,859,192,327.06	89.99
3	固定收益投资	78,252,425.97	1.82
	其中:债券	78,252,425.97	1.82
	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	158,197,552.22	3.69
8	其他各项资产	11,809,939.26	0.28
9	合计	4,288,426,339.45	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,973,068.00	0.07
B	采矿业	6,330,903.16	0.15
C	制造业	108,205,139.83	2.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,664,400.69	0.13
E	建筑业	4,125,510.58	0.10
F	批发和零售业	9,595,614.82	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	5,934,283.98	0.14
H	住宿和餐饮业	216,343.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,733,861.84	0.35
J	金融业	3,376,301.52	0.08
K	房地产业	10,576,853.58	0.25
L	租赁和商务服务业	3,026,905.36	0.07
M	科学研究和技术服务业	380,560.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	2,005,463.49	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	215,892.00	0.01
Q	卫生和社会工作	334,860.74	0.01
R	文化、体育和娱乐业	2,351,791.35	0.06
S	综合	926,341.00	0.02
	合计	180,974,094.94	4.22

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600516	方大炭素	46,300	1,337,144.00	0.03
2	600201	生物股份	38,810	1,231,829.40	0.03
3	600176	中国巨石	75,591	1,231,377.39	0.03
4	002405	四维图新	44,296	1,168,971.44	0.03
5	002168	深圳惠程	84,400	1,161,344.00	0.03
6	000661	长春高新	5,880	1,076,040.00	0.03
7	002422	科伦药业	37,263	927,848.70	0.02
8	002271	东方雨虹	22,812	911,567.52	0.02
9	600525	长园集团	56,816	897,124.64	0.02

10	002001	新和成	23,500	894,410.00	0.02
----	--------	-----	--------	------------	------

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于

<http://www.nffund.com> 的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600201	生物股份	6,689,345.00	0.16
2	601012	隆基股份	6,304,040.54	0.15
3	600487	亨通光电	6,279,119.43	0.15
4	600525	长园集团	6,233,138.44	0.15
5	600219	南山铝业	5,963,980.50	0.15
6	600584	长电科技	5,898,932.05	0.14
7	600079	人福医药	5,694,954.90	0.14
8	600522	中天科技	5,604,151.04	0.14
9	600315	上海家化	5,319,185.57	0.13
10	600166	福田汽车	4,972,741.00	0.12
11	600879	航天电子	4,796,371.75	0.12
12	600682	南京新百	4,629,414.38	0.11
13	600521	华海药业	4,348,005.33	0.11
14	600643	爱建集团	4,296,924.76	0.10
15	600176	中国巨石	4,262,315.20	0.10
16	600056	中国医药	4,187,655.00	0.10
17	600266	北京城建	4,185,843.57	0.10
18	600138	中青旅	4,118,184.84	0.10
19	600699	均胜电子	4,100,992.90	0.10
20	600516	方大炭素	4,041,695.00	0.10

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601012	隆基股份	8,720,793.70	0.21
2	600487	亨通光电	8,039,740.73	0.20
3	600219	南山铝业	6,793,232.00	0.17
4	600201	生物股份	6,527,887.56	0.16
5	600525	长园集团	6,318,298.40	0.15
6	600584	长电科技	5,792,714.36	0.14
7	600643	爱建集团	5,519,229.33	0.13
8	600079	人福医药	5,360,932.48	0.13

9	600516	方大炭素	5,330,375.20	0.13
10	600522	中天科技	5,154,760.96	0.13
11	600315	上海家化	4,954,163.00	0.12
12	600166	福田汽车	4,633,441.84	0.11
13	600699	均胜电子	4,411,885.03	0.11
14	600682	南京新百	4,402,625.98	0.11
15	600879	航天电子	4,219,964.80	0.10
16	600528	中铁工业	4,197,930.49	0.10
17	300136	信维通信	4,163,069.36	0.10
18	600614	鹏起科技	4,152,118.25	0.10
19	600176	中国巨石	4,079,668.80	0.10
20	600521	华海药业	4,031,791.58	0.10

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	886,315,299.33
卖出股票收入(成交)总额	866,588,965.77

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	78,072,162.54	1.83
	其中:政策性金融债	78,072,162.54	1.83
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	180,263.43	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	78,252,425.97	1.84

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	108601	国开 1703	782,443	78,072,162.54	1.83
2	110041	蒙电转债	400	40,000.00	0.00
3	128029	太阳转债	311	31,100.00	0.00
4	110040	生益转债	280	30,318.40	0.00
5	123004	铁汉转债	284	28,400.00	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 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	股票型	交易型开放式	南方基金管理股份有限公司	3,859,192,327.06	90.50

8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11.2 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。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。

8.12 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。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1

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

8.13.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.13.3 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	155,266.33
2	应收证券清算款	3,069.47
3	应收股利	1,691.14
4	应收利息	1,948,818.65
5	应收申购款	9,607,622.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	可收退补款	93,471.20
9	其他	-
10	合计	11,809,939.26

8.13.4 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。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002168	深圳惠程	1,161,344.00	0.03	拟披露重大事项
2	600525	长园集团	897,124.64	0.02	重要事项未公告

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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 500 联接 A	390,124	6,915.43	79,207,749.15	2.94	2,618,668,006.85	97.06
南方 500C	211	327,799.23	68,107,468.71	98.47	1,058,168.72	1.53
合计	390,335	7,088.89	147,315,217.86	5.32	2,619,726,175.57	94.68

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。

9.2 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	郑林祥	700,000.00	2.02
2	王少琴	555,053.00	1.60
3	姚红伟	529,900.00	1.53
4	牟小勇	515,900.00	1.49
5	薛宜平	459,570.00	1.33
6	张振华	300,000.00	0.87
7	姚坚	272,200.00	0.79
8	梁仿	269,900.00	0.78
9	翟建忠	268,502.00	0.78
10	李鹏	262,700.00	0.76

9.3 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	3,068,171.07	0.1137
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	1,214.74	0.0018
	合计	3,069,385.81	0.1109

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）。

9.4 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	0~10
	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	-
	合计	10~50

注：本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

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, 823, 244, 983. 05	143, 836, 129. 25
减：本报告期基金总赎回份额	1, 804, 501, 101. 43	74, 670, 491. 82
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	2, 697, 875, 756. 00	69, 165, 637. 43

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2017 年 1 月 23 日南方基金管理有限公司第七届董事会第二次会议，审议通过秦长奎因任期届满，工作调整的原因不再担任公司副总经理职务。2017 年 12 月 8 日南方基金管理股份有限公司（筹）第一届董事会第一次会议，审议通过聘任史博担任公司副总经理。

本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期未变更会计师事务所。本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 106,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 9 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	1,188,873,134.75	68.10%	118,887.83	68.10%	
华泰证券	1	556,808,366.02	31.90%	55,686.23	31.90%	

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
----	------	--------	------	------

名称	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	102,761.74	0.13	510,000,000.00	100.00	-	-	-	-
华泰证券	78,029,054.84	99.87	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注:无。

