中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年半年度报告

2018年06月30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08月27日

重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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2018年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

目录

§ 1	重要提示及目录	. 2
	.1 重要提示 .2 目录	
§ 2	基金简介	11
2 2 2	.1 基金基本情况	11 11 11
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	11
3	.1 主要会计数据和财务指标	11
4 4 4 4 4	.1 基金管理人及基金经理情况	12 12 12 12 12 13
§ 5	托管人报告	13
5	.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
§ 6	半年度财务会计报告(未经审计)	13
6 6	.1 资产负债表	13 14
§ 7	投资组合报告	22
7 7 7 7	.1 期末基金资产组合情况	22 22 23 23 23

	7. 9 ¹ 7. 10 7. 11	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	23 23 24
§	8 基金	金份额持有人信息	25
	8. 2 3	期末基金份额持有人户数及持有人结构期末上市基金前十名持有人期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况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情况	25 25
§	9 开	放式基金份额变动	25
§	10 重	大事件揭示	25
	10. 2 10. 3 10. 4 10. 5 10. 6 10. 7	基金份额持有人大会决议 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 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 基金投资策略的改变 为基金进行审计的会计师事务所情况 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 基金租用证券公司交易单元的有关情况 其他重大事件	25 25 26 26 26 26
§	11 景	响投资者决策的其他重要信息	26
		10 = 10 = 10 = 10 = 10 = 10 = 10 = 10 =	26 26
§	12 备	·查文件目录	26
	12. 2		26 26 27

基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 500ETF
场内简称	500ETF
基金主代码	510500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年2月6日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
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	4, 380, 667, 244. 00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013年3月15日

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

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
	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
投资策略	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。
	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
风险收益特征	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	
信自世電 名	姓名	常克川	贺倩	
信息披露负 责人	联系电话	0755-82763888	010-66060069	
贝八	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	北京市东城区建国门内大街 69 号	
		号免税商务大厦 31-33 层		
办公地址		深圳市福田区福田街道福华一路六	北京市西城区复兴门内大街 28 号	
		号免税商务大厦 31-33 层	凯晨世贸中心东座 F9	
邮政编码		518048	100031	
法定代表人		张海波	周慕冰	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位: 人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)
本期已实现收益	-280, 989, 603. 69
本期利润	-3, 697, 397, 032. 49
加权平均基金份额本期利润	-1. 0672
本期加权平均净值利润率	-17.07%
本期基金份额净值增长率	-16. 10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配利润	8, 586, 088, 690. 81
期末可供分配基金份额利润	1. 9600
期末基金资产净值	24, 213, 246, 851. 55
期末基金份额净值	5. 5273
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)
基金份额累计净值增长率	54.94%

- 注:1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 2. 期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数 (为期末余额,不是当期发生数)。
- 3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

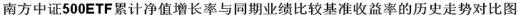
3.2 基金净值表现

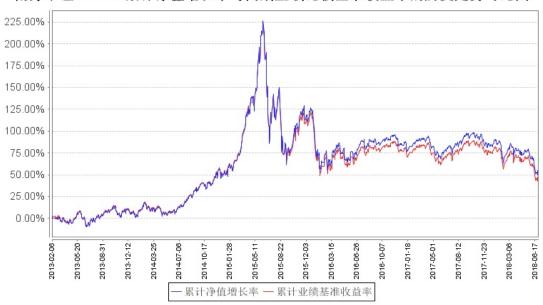
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 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	-9. 02%	1.87%	-9. 33%	1.86%	0. 31%	0. 01%
过去三个月	-14. 08%	1. 38%	-14. 67%	1. 38%	0. 59%	0.00%
过去六个月	-16. 10%	1. 44%	-16. 53%	1. 44%	0. 43%	0.00%
过去一年	-14. 40%	1. 22%	-14. 99%	1. 22%	0. 59%	0.00%
过去三年	-38. 20%	1. 90%	-41. 41%	1. 90%	3. 21%	0.00%
自基金合同 生效起至今	54. 94%	1. 76%	47. 21%	1. 77%	7. 73%	-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





§ 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)管理资产规模近7,800亿元,旗下管理167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

44 KZ	职务	任本基金的基金经理(助理) 期限		江光月北左阳	7,4,00	
姓名		任职日期	离任日期	证券从业年限	说明	
罗文杰	本基金基金经理	2013年4月22日		13	女,美国学业根从事008年,自身企业的人工,是一个企业,是一个企业的人工,是一个企业的人工,是一个企业的人工,是一个企业的人工,是一个企业的人工,是一个企业的人工,是一个企业的人工,是一个企业,是一个一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,也是一个企业,也是一个企业,也是一个企业,也是一个企业,也是一个企业,也是一个企业,也是一个企业,是一个企业,也是一个企业,也是一个企业,也是一个一个,也是一个一个,也是一个一个一个,也是一个一个,也是一个一个一个工,也是一个一个一个,也是一个一个一个工,也是一个一个工,也是一个一个一个工,也是一个一个工,也是一个一个工,也是一个一个工,也是一个一个工,也是一个	

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; 2018年2月至 今,任H股ETF、南 方 H 股 ETF 联接基金 经理: 2018年4月 至今,任 MSCI 基金 基金经理; 2018年 6月至今,任 MSCI 联接基金经理。

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《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

旗下管理的所有基金和投资组合。 公司每季度对旗下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,并且交易占优比也没有明显异常,未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 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均未超过该证券当日成交量的 5%。

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 16.53%。期间我们通过自建的"指数化交易系统"、"日内择时交易模型"、"跟踪误差归因分析系统"、"ETF 现金流精算系统"等,将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平,并通过严格的风险管理流程,确保了本基金的安全运作。 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) 报告期内,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

截至报告期末,本基金份额净值为 5.5273 元,报告期内,份额净值增长率为-16.10%,同期业绩基准增长率为-16.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年上半年,受到中美贸易战下经济下行的悲观预期和去杠杆持续紧张对企业经营造成的负面冲击等影响,市场出现了震荡探底走势,年初至今经历三波下跌后市场风险得到较为充分的释放。展望下半年市场,权益市场整体无论是指数的估值或是板块的业绩估值性价比均反映出市场内在价值已经到了较优的配置区间,投资价值凸显。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,当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时,可进行收益分配。基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%(期间如发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算);标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%(期间如发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算);本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值;在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;每一基金份额享有同等分配权;本基金收益分配采取现金分红方式;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。根据上述分配原则以及基金的实际运作情况,本报告期本基金未有分配事项。

4.8 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 第 11页 共 63页 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一南方基金管理股份有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 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,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日: 2018年6月30日

资产	附注号	本期末	上年度末	
页 厂	附在专	2018年6月30日	2017年12月31日	
资产:				
银行存款	6. 4. 4. 1	198, 004, 832. 67	26, 118, 832. 49	
结算备付金		767, 400, 045. 32	580, 061, 106. 48	
存出保证金		162, 208, 401. 01	165, 618, 344. 08	
交易性金融资产	6. 4. 4. 2	23, 115, 860, 892. 43	17, 765, 410, 536. 90	
其中: 股票投资		23, 107, 172, 229. 60	17, 746, 227, 463. 96	
基金投资		_	_	
债券投资		8, 688, 662. 83	19, 183, 072. 94	

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		47, 445, 032. 65	4, 976, 393. 94
应收利息	6. 4. 4. 5	421, 843. 51	325, 044. 28
应收股利		9, 601. 50	9, 601. 50
应收申购款		_	_
递延所得税资产		_	
其他资产	6. 4. 4. 6	_	
资产总计		24, 291, 350, 649. 09	18, 542, 519, 859. 67
在建筑的大型和光	745+ 口	本期末	上年度末
负债和所有者权益	附注号	2018年6月30日	2017年12月31日
负 债:			
短期借款		_	_
交易性金融负债		_	_
衍生金融负债	6. 4. 4. 3	_	_
卖出回购金融资产款		_	_
应付证券清算款		15, 883, 049. 40	1, 686, 037. 80
应付赎回款		_	_
应付管理人报酬		9, 462, 302. 94	7, 737, 109. 47
应付托管费		1, 892, 460. 59	1, 547, 421. 88
应付销售服务费		_	_
应付交易费用	6. 4. 4. 7	1, 072, 733. 69	756, 703. 35
应交税费		302. 79	_
应付利息		_	_
应付利润		_	_
递延所得税负债		_	_
其他负债	6. 4. 4. 8	49, 792, 948. 13	13, 659, 757. 61
负债合计		78, 103, 797. 54	25, 387, 030. 11
所有者权益:			
实收基金	6. 4. 4. 9	15, 627, 158, 160. 74	10, 026, 495, 762. 18
未分配利润	6. 4. 4. 10	8, 586, 088, 690. 81	8, 490, 637, 067. 38
所有者权益合计		24, 213, 246, 851. 55	18, 517, 132, 829. 56
负债和所有者权益总计		24, 291, 350, 649. 09	18, 542, 519, 859. 67

注: 报告截止日 2018 年 6 月 30 日,基金份额净值 5.5273 元,基金份额总额 4,380,667,244.00 份。

6.2 利润表

会计主体:中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2018年1月1日 至 2018年6月30日

			里位:人民巾兀
		本期	上年度可比期间
项 目	附注号	2018年1月1日至	2017年1月1日至
		2018年6月30日	2017年6月30日
一、收入		-3, 620, 599, 689. 27	-58, 843, 764. 79
1. 利息收入		7, 904, 780. 83	4, 471, 204. 38
其中: 存款利息收入	6. 4. 4. 11	7, 243, 737. 12	4, 049, 198. 24
债券利息收入		15, 248. 25	212. 07
资产支持证券利息收			
λ			_
买入返售金融资产收		CAE 70E AC	401 704 07
λ		645, 795. 46	421, 794. 07
其他利息收入		_	_
2. 投资收益(损失以"-		005 707 000 00	100 707 000 47
"填列)		-205, 797, 093. 08	-169, 727, 002. 47
其中: 股票投资收益	6. 4. 4. 12	-304, 968, 369. 08	-284, 350, 383. 36
基金投资收益		_	_
债券投资收益	6. 4. 4. 13	1, 278, 859. 28	155, 916. 93
资产支持证券投资收	0 4 4 10 1		
益	6. 4. 4. 13. 1	_	_
贵金属投资收益	6. 4. 4. 14	_	_
衍生工具收益	6. 4. 4. 15	-51, 717, 789. 73	15, 439, 463. 86
股利收益	6. 4. 4. 16	149, 610, 206. 45	99, 028, 000. 10
3. 公允价值变动收益(损失	2 1 1 1 5	0 440 405 400 00	110 ==0 100 00
以"-"号填列)	6. 4. 4. 17	-3, 416, 407, 428. 80	113, 776, 486. 83
4. 汇兑收益(损失以"-"号			
填列)		_	_
5. 其他收入(损失以"-"号	0 4 4 10	0,000,040,00	7,004,450,50
填列)	6. 4. 4. 18	-6, 299, 948. 22	-7, 364, 453. 53
减:二、费用		76, 797, 343. 22	61, 467, 045. 86
1. 管理人报酬	6. 4. 7. 2. 1	53, 552, 388. 58	43, 284, 728. 85
2. 托管费	6. 4. 7. 2. 2	10, 710, 477. 80	8, 656, 945. 78
3. 销售服务费	6. 4. 7. 2. 3	_	_
4. 交易费用	6. 4. 4. 19	9, 019, 406. 83	6, 637, 834. 63
5. 利息支出		_	_
其中: 卖出回购金融资产支			
出		_	_
6. 税金及附加		12, 076. 31	_
7. 其他费用	6. 4. 4. 20	3, 502, 993. 70	2, 887, 536. 60
三、利润总额(亏损总额以"-			
"号填列)		-3, 697, 397, 032. 49	-120, 310, 810. 65
减: 所得税费用		_	_
四、净利润(净亏损以"-		0.007.007.000	100 010 010 0
"号填列)		-3, 697, 397, 032. 49	-120, 310, 810. 65

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2018年1月1日 至 2018年6月30日

			中世: 八八市九	
	本期			
项目	2018 年	1月1日至 2018年6月	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	10 000 405 700 10	0 400 607 067 00	10 515 100 000 50	
(基金净值)	10, 026, 495, 762. 18	8, 490, 637, 067. 38	18, 517, 132, 829. 56	
二、本期经营活动产生				
的基金净值变动数(本	_	-3, 697, 397, 032. 49	-3, 697, 397, 032. 49	
期利润)				
三、本期基金份额交易				
产生的基金净值变动数	E 600 669 200 E6	2 702 040 655 02	0 202 E11 0E4 40	
(净值减少以"-"号	5, 600, 662, 398. 56	3, 792, 848, 655. 92	9, 393, 511, 054. 48	
填列)				
其中: 1. 基金申购款	8, 598, 622, 067. 42	6, 078, 886, 600. 29	14, 677, 508, 667. 71	
2. 基金赎回款	-2, 997, 959, 668. 86	-2, 286, 037, 944. 37	-5, 283, 997, 613. 23	
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	15 697 159 160 74	0 506 000 600 01	94 919 946 9E1 EE	
(基金净值)	15, 627, 158, 160. 74	8, 586, 088, 690. 81	24, 213, 246, 851. 55	
	上年度可比期间			
项目	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	9, 103, 278, 292. 64	7, 625, 158, 761. 68	16, 728, 437, 054. 32	
(基金净值)	, ,	, , ,		
二、本期经营活动产生				
的基金净值变动数(本	_	-120, 310, 810. 65	-120, 310, 810. 65	
期利润)				
三、本期基金份额交易				
产生的基金净值变动数	1, 132, 974, 761. 99	787, 582, 563. 81	1, 920, 557, 325. 80	
(净值减少以"-"号				
填列)	0.400.070.000.70	0.050.005.005	0.000 =10 =05 :0	
其中: 1. 基金申购款	3, 406, 058, 889. 58		6, 082, 712, 585. 46	
2. 基金赎回款	-2, 273, 084, 127. 59	-1, 889, 071, 132. 07	-4, 162, 155, 259. 66	
四、本期向基金份额持	_	_	_	
有人分配利润产生的基				

金净值变动(净值减少 以"-"号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	10, 236, 253, 054. 63	8, 292, 430, 514. 84	18, 528, 683, 569. 47

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:

 極小松
 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 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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》、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》、财税 [2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(a) 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。 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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以

2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017年12月31日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以 2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

- (b) 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。
- (c) 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。
- (d) 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。
- (e) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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

	- 一点・プログルフロ
项目	本期末
-AH	2018年6月30日
活期存款	198, 004, 832. 67
定期存款	_
其中: 存款期限1个月以内	_
存款期限 1-3 个月	_
存款期限3个月及以上	_
其他存款	_
合计	198, 004, 832. 67

6.4.4.2 交易性金融资产

		本期末	
项目		2018年6月30日_	
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		26, 844, 827, 237. 20	23, 107, 172, 229. 60	-3, 737, 655, 007. 60
贵金属	属投资-金交所			
黄金台	合约	-	_	_
	交易所市场	9, 619, 400. 00	8, 688, 662. 83	-930, 737. 17
(主 半	银行间市场	_	_	_
债券	_	-	-	_
	合计	9, 619, 400. 00	8, 688, 662. 83	-930, 737. 17
资产支	支持证券	-	-	_
基金		-	-	_
其他		-	-	_
	合计	26, 854, 446, 637. 20	23, 115, 860, 892. 43	-3, 738, 585, 744. 77

注:于 2018 年 6 月 30 日,股票投资的公允价值和公允价值变动中包含的可退替代款的估值增值为 9,961.78 元

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

单位: 人民币元

	本期末			
伍日	2018年6月30日			
项目	合同/名义	公允	价值	备注
	金额	资产	负债)
利率衍生				
工具	_		_	
	_	_	_	_
货币衍生				
工具	_		_	
_	_	_	_	_
权益衍生 工具	868, 382, 007. 62	_	_	_
_	_	_	_	_
其他衍生				
工具	_	_	_	
合计	868, 382, 007. 62	_	_	_

注: 衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下,结算准备金已包括 所持股指期货合约产生的持仓损益,则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款 (结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.4.4 买入返售金融资产

注:无。

6.4.4.5 应收利息

项目 本期末

	2018年6月30日
应收活期存款利息	43, 679. 62
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	369, 933. 22
应收债券利息	6, 561. 98
应收资产支持证券利息	_
应收买入返售证券利息	_
应收申购款利息	_
应收黄金合约拆借孳息	_
其他	1, 668. 69
合计	421, 843. 51

6.4.4.6 其他资产

注:无。

6.4.4.7 应付交易费用

单位: 人民币元

	1 12. 7 (7 (7).)3
项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1, 072, 733. 69
银行间市场应付交易费用	_
_	_
合计	1, 072, 733. 69

6.4.4.8 其他负债

单位: 人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	_
应付赎回费	-
应退替代款	32, 296, 239. 38
预提费用	260, 341. 35
应付指数使用费	1, 695, 638. 81
可退替代款	15, 540, 728. 59
合计	49, 792, 948. 13

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

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

6.4.4.9 实收基金

金额单位: 人民币元

项目	本期
----	----

	2018年1月1日 至 2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2, 810, 667, 244. 00	10, 026, 495, 762. 18
本期申购	2, 410, 400, 000. 00	8, 598, 622, 067. 42
本期赎回(以"-"号填列)	-840, 400, 000. 00	-2, 997, 959, 668. 86
- 基金拆分/份额折算前	_	-
基金拆分/份额折算调整	_	_
本期申购	_	_
本期赎回(以"-"号填列)	_	_
本期末	4, 380, 667, 244. 00	15, 627, 158, 160. 74

注:: 申购含红利再投、转换入份额, 赎回含转换出份额

6.4.4.10 未分配利润

单位: 人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13, 789, 218, 702. 90	-5, 298, 581, 635. 52	8, 490, 637, 067. 38
本期利润	-280, 989, 603. 69	-3, 416, 407, 428. 80	-3, 697, 397, 032. 49
本期基金份额交易产 生的变动数	7, 631, 688, 629. 50	-3, 838, 839, 973. 58	3, 792, 848, 655. 92
其中:基金申购款	11, 717, 989, 985. 74	-5, 639, 103, 385. 45	6, 078, 886, 600. 29
基金赎回款	-4, 086, 301, 356. 24	1, 800, 263, 411. 87	-2, 286, 037, 944. 37
本期已分配利润	_		_
本期末	21, 139, 917, 728. 71	-12, 553, 829, 037. 90	8, 586, 088, 690. 81

6.4.4.11 存款利息收入

单位: 人民币元

	1 12. /(1/1/10
项目	本期
	2018年1月1日至 2018年6月30日
活期存款利息收入	422, 247. 50
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	6, 789, 130. 25
其他	32, 359. 37
合计	7, 243, 737. 12

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

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-212, 717, 862. 27
股票投资收益——赎回差价收入	-92, 250, 506. 81

股票投资收益——申购差价收入	_
合计	-304, 968, 369. 08

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

塔口	本期
项目	2018年1月1日至 2018年6月30日
卖出股票成交总额	5, 675, 069, 281. 15
减: 卖出股票成本总额	5, 887, 787, 143. 42
买卖股票差价收入	-212, 717, 862. 27

6.4.4.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位: 人民币元

塔日	本期
项目	2018年1月1日 至 2018年6月30日
赎回基金份额对价总额	5, 283, 997, 613. 23
减: 现金支付赎回款总额	2, 905, 498, 306. 23
减: 赎回股票成本总额	2, 470, 749, 813. 81
赎回差价收入	-92, 250, 506. 81

注:-

6.4.4.13 债券投资收益

单位: 人民币元

	1 2. 700,170
项目	本期
以 日 	2018年1月1日 至 2018年6月30日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总	05,000,550,00
额	27, 009, 579. 30
减: 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成	05 710 500 00
本总额	25, 718, 500. 00
减: 应收利息总额	12, 220. 02
买卖债券差价收入	1, 278, 859. 28

6.4.4.13.1 资产支持证券投资收益

注:无。

6.4.4.14 贵金属投资收益

注:无。

6.4.4.15 衍生工具收益

项目	本期收益金额
----	--------

	2018年1月1日至 2018年6月30日
股指期货-投资收益	-51, 717, 789. 73

6.4.4.16 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	149, 610, 206. 45
基金投资产生的股利收益	-
合计	149, 610, 206. 45

6.4.4.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

五日 夕 初	本期		
项目名称	2018年1月1日至 2018年6月30日		
1. 交易性金融资产	-3, 332, 397, 136. 23		
股票投资	-3, 331, 176, 326. 12		
债券投资	-1, 220, 810. 11		
资产支持证券投资	_		
基金投资	_		
贵金属投资	_		
其他	_		
2. 衍生工具	-84, 010, 292. 57		
权证投资	_		
期货	-84, 010, 292. 57		
3. 其他	_		
减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增			
值税	_		
合计	-3, 416, 407, 428. 80		

6.4.4.18 其他收入

单位: 人民币元

	1 = 7 7 7 7 7 7 7	
项目	本期	
	2018年1月1日至 2018年6月30日	
基金赎回费收入	_	
替代损益	-6, 299, 948. 22	
合计	-6, 299, 948. 22	

注:本基金场内部分的赎回费率为 0.50%,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。

6.4.4.19 交易费用

	1 = 7 + 1 + 1 + 1	
项目	本期	
次日	2018年1月1日至 2018年6月30日	
交易所市场交易费用	9, 019, 406. 83	

银行间市场交易费用	_
-	_
合计	9, 019, 406. 83

6.4.4.20 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期	
以 日	2018年1月1日至 2018年6月30日	
审计费用	81, 821. 05	
信息披露费	148, 767. 52	
指数使用费	3, 213, 143. 33	
银行费用	29, 509. 02	
上市费	29, 752. 78	
合计	3, 502, 993. 70	

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

6.4.4.21 分部报告

无。

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

截止财务报表报出日,本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

6.4.6 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基	本基金的基金管理人管理的其他基金
金联接基金(LOF)("南方中证 500ETF 联接	
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" 第 23页 共 63页 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。

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 2018年1月1日至 2018年6月 30日		上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年6月30日		
大联刀石柳		占当期股票		占当期股票	
	成交金额	成交总额的比例	成交金额	成交总额的比例	
		(%)		(%)	
华泰证券	0.00	0.00	4, 957, 958, 722. 96	47. 58	

6.4.7.1.2 债券交易

注:无。

6.4.7.1.3 债券回购交易

注:无。

6.4.7.1.4 权证交易

注:无。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位: 人民币元

	亚帆干压: 八八八 171				
	本期				
		2018年1月1日 至 2018年6月30日			
关联方名称	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	0.00	0.00	_	-	
	上年度可比期间				
	2017年1月1日 至 2017年6月30日				
关联方名称	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)	

华泰证券 493, 332. 60 47. 45 418, 361. 43 53. 75
--

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

	本期	上年度可比期间	
项目	2018年1月1日至 2018年	2017年1月1日至	
	6月30日	2017年6月30日	
当期发生的基金应支付的管理费	53, 552, 388. 58	43, 284, 728. 85	
其中: 支付销售机构的客户维护费	115, 180. 09	1, 161, 924. 75	

注: 支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为: 日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.5% / 当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

	本期	上年度可比期间
项目	2018年1月1日至 2018年	2017年1月1日至
	6月30日	2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10, 710, 477. 80	8, 656, 945. 78

注: 支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为: 日托管费=前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

6.4.7.2.3 销售服务费

注:无。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易注:无。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:无。

6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末	
			2017年12月31日	
关联方名称	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例(%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
南方中证				
500ETF联接基	926, 973, 402. 00	21. 16	585, 773, 402. 00	20. 84
金				
华泰证券股份	10 000 00	0.00		
有限公司	19, 800. 00	0. 00	_	
兴业证券股份				
有限公司融券	26, 200. 00	0.00	65, 200. 00	0.00
专用证券账户				
华泰证券股份	_	_		
有限公司融券	3, 055, 494. 00	0.07	_	_
专用证券账户				

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

6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

	本	期	上年度可比期间			
关联方名称	2018年1月1日至	至 2018年6月30日	2017年1月1日 至 2	2017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	198, 004, 832. 67	422, 247. 50	52, 423, 456. 82	300, 408. 90		

注:本基金的银行存款由基金托管人 中国农业银行 保管,按银行同业利率计息。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 利润分配情况

注:无。

6.4.9 期末(2018年06月30日)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.	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	口 治 油 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		
603105	芯能 科技	2018-06-29	2018-07-09	新股认 购	4. 83	4. 83	3, 410	16, 470. 30	16, 470. 30	_		
603706	东方 环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股认购	13. 09	13. 09	1, 765	23, 103. 85	23, 103. 85	_		

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
000008	神州高铁	2018-06-06	重大事项	4. 96	2018-08-07	4. 46	10, 298, 890	56, 592, 491. 79	51, 082, 494. 40	_
000426	兴业矿业	2018-06-18	重大事项	7. 21	-	-	4, 390, 237	38, 001, 308. 23	31, 653, 608. 77	_
000566	海南海	2017-11-22	重大资	12. 89	2018-07-09	11. 43	3, 380, 797	45, 034, 986. 97	43, 578, 473. 33	_

	药		产重											
			组											Ш
000587	金洲慈航	2018-06-15	重大事项	4. 96	2018-0	07-02	4. 46	5, 955	5, 610	43, 085,	666. 93	29, 53 ⁶	9, 825. 60) –
000669	金鸿	2018-05-18	重大资	7. 25	2018-0	08-06	6. 53	2, 666	5, 863	30, 664,	137. 69	19, 33	4, 756. 75	-
000693	*ST 华 泽	2018-04-30	未及时披	3. 31	-		-	988	3, 187	18, 114,	538. 23	3, 27	0, 898. 97	
000825	太钢不锈	2018-04-16	重大资产重组	6. 00	-		-	11, 878	3, 900	58, 871,	582. 01	71, 27	3, 400. 00	. –
000939	*ST 凯 迪	2017–11–16	实行退市风	4. 99	2018-0	07-02	4. 74	6, 643	3, 788	34, 738,	746. 06	33, 15	2, 502. 12	_
002005	德豪润达	2018-01-01	重大资产重组	4. 36	2018-0	07-02	3. 92	4, 432	2, 942	26, 796,	753. 71	19, 32	7, 627. 12	. –

002011	盾安环境	2018-	-04-;	重大资产重组	6.	40	-		_	2,	922, 243	28, 307,	803. 71	18, 702, 355. 2	20 –
002051	中工国际	2018-	-04-(重大资产重组	15.	27	_		-	3,	011, 591	54, 045,	048. 39	45, 986, 994. 5	57 –
002147	新光圆成	2018-	-01-1	重大资产重组	14.	76	-		_	2,	196, 500	27, 077,	114. 77	32, 420, 340. 0	00 -
002359	北讯集团	2018-	-05-2	北	() () () ()	58	2018-08-	-21	17. 62	2,	927, 689	68, 142,	873. 09	57, 324, 150. <i>6</i>	32 –
002408	齐翔腾达	2018-	-06-1	重组	12.	28	-		_	5,	229, 032	57, 790,	675. 14	64, 212, 512. 9	96 -
002426	胜利精密	2018-	-06-1	北披露重大事项 18	3.	60	2018-07-	-03	3. 26	11,	953, 850	50, 350,	377. 34	43, 033, 860. C	00 -
002431	棕榈股份	2018-	-05-3	邛	6.	71	-		_	5,	926, 735	53, 229,	582. 35	39, 768, 391. 8	35 -
002437	誉衡	2018-	-06-	[1] 基 大	16	20	2018-08-	-13	5. 57	4,	806, 508	36, 987,	287. 98	29, 800, 349. 6	50 –

	药业				资产重组							
002477	雏鹰农牧	2018-	-06-	14	重大事项	3. 31	ι –	_	11, 136, 197	49, 707, 567. 49	36, 860, 812. 07	_
002512	达华智能	2018-	-06-	18	拟披露重大事项	9. 70) –	_	3, 912, 707	56, 741, 551. 95	37, 953, 257. 90	_
002573	清新环境	2018-	-06-	18	拟披露	11. 55	5 -	-	3, 828, 350	66, 593, 330. 71	44, 217, 442. 50	_
002665	首航节能	2018-	-05-	29	重大资产重组	5. 80) –	_	7, 104, 895	54, 334, 825. 86	41, 208, 391. 00	_
002699	美盛文化	2018-	-02-	05	重大资产重组	18. 76	52018-07-0	2 16. 88	1, 336, 800	24, 559, 302. 86	25, 078, 368. 00	_
300146	汤臣倍健	2018-	-01-	31	重大资产重组	16. 60)2018-07-3	1 16. 5	3, 462, 000	44, 407, 405. 99	57, 469, 200. 00	_
300197	铁汉生态	2018-	-05-	28	重大资产	5. 37	7 –	_	7, 763, 521	58, 503, 733. 54	41, 690, 107. 77	_

			重组							
300266	兴源环境	2018-02-05	重大资	19. 99	2018-07-02	11. 96	2, 962, 962	77, 185, 237. 32	59, 229, 610. 38	_
300324	旋极信息	2018-05-30	重大资产重组	9. 49	_	_	5, 043, 102	60, 229, 331. 33	47, 859, 037. 98	_
600022	山东钢铁	2018-03-27	重大资产重组	2. 02	2018-08-16	1.83	34, 284, 310	72, 670, 685. 43	69, 254, 306. 20	_
600086	东方金钰	2018-01-19	重大资产重组	10. 04	1		2, 814, 455	30, 284, 449. 51	28, 257, 128. 20	_
600122	宏图高科	2018-06-18	拟筹划重大资产重组	7. 40	l		5, 387, 364	57, 641, 213. 93	39, 866, 493. 60	
600158	中体产业	2018-03-27	拟筹划重大资产重组	11. 64	2018-07-16	11. 59	3, 492, 119	53, 543, 907. 53	40, 648, 265. 16	

600687	刚泰控股	2018-06-11	重要事项未公告	9. 0	92018-08-20	8. 18	2, 675, 280	34, 259, 408. 62	24, 318, 295. 20	_
600750	江中药业	2018-04-30	重组	17. 7	52018-08-01	16. 12	1, 321, 922	28, 120, 307. 34	23, 464, 115. 50	_
600751	天海投资	2018-01-12	拟筹划重大资产重组	6. 4	9 –	_	5, 389, 607	42 , 666, 318. 53	34, 978, 549. 43	_
600759	洲际油气	2018-03-27	重大资产重组	3. 9	4 –	-	6, 047, 886	39, 098, 598. 48	23, 828, 670. 84	_
600811	XD 东方集	2018-05-30	重要事项未公告	4. 3	0 –	_	16, 758, 228	81, 727, 974. 94	72, 060, 380. 40	_
600848	上海临港	2018-06-15	拟筹划重大资产重组	21. 6	7 –	_	1, 827, 475	40, 549, 201. 02	39, 601, 383. 25	_

600335	国 机 汽 车	重 大 事 项	-	-2,	,250,910.00	25,825,938.90	23,476,991.30	-
--------	------------------	------------------	---	-----	-------------	---------------	---------------	---

注:本基金截至2018年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金,紧密跟踪中证 500 指数,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法,跟踪中证 500 指数,以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代,力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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

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

6.4.10.2 信用风险

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

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

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

于 2018 年 6 月 30 日,本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.04%。

6.4.10.3 流动性风险

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

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性 比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变 现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本 基金所持证券均在证券交易所上市,因此除附注 6. 4. 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。

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

于 2018 年 6 月 30 日,本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式,流动性风险相对较低。

6.4.10.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》 及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的 要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集 中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进 行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6. 4. 9。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

注:流动性受限资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

6.4.10.4 市场风险

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

6.4.10.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

					平位: 八尺巾儿
本期末					
2018年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
6月30日					
资产					
银行存款	198, 004, 832. 67	-	_	_	198, 004, 832. 67
结算备付金	767, 400, 045. 32	_		_	767, 400, 045. 32
存出保证金	4, 120, 193. 01	_	_	158, 088, 208. 00	162, 208, 401. 01
交易性金融	0 400 440 00			00 105 150 000 00	00 115 000 000 10
资产	8, 688, 662. 83	_	=	23, 107, 172, 229. 60 	23, 115, 860, 892. 43
买入返售金					
融资产	_	_	_	_	_
应收利息	_	_	_	421, 843. 51	421, 843. 51
应收股利	_	_	_	9, 601. 50	9, 601. 50
应收申购款	_	_	_	_	_
应收证券清				47, 445, 000, 65	45, 445, 000, 65
算款	_	_	_	47, 445, 032. 65	47, 445, 032. 65
其他资产	_	_	_	_	_
资产总计	978, 213, 733. 83	_	_	23, 313, 136, 915. 26	24, 291, 350, 649. 09
负债					
应付赎回款	_	_	_	_	_
应付管理人					0 400 000 04
报酬	_	=	_	9, 462, 302. 94	9, 462, 302. 94
应付托管费	_	_	_	1, 892, 460. 59	1, 892, 460. 59
应付证券清				15 000 040 40	
算款	_	_	_	15, 883, 049. 40	15, 883, 049. 40
卖出回购金					
融资产款	_		_	_	_
应付销售服				_	_
			<u> </u>		-

务费					
应付交易费	_	_	_	1, 072, 733. 69	1, 072, 733. 69
用 应付利息	_		_		
应付利润	_	_		_	_
应交税费	_	_	_	202.70	202.70
其他负债	_	_	_	302. 79	i e
负债总计	_	_	_	49, 792, 948. 13	
利率敏感度	_	_	_	78, 103, 797. 54	78, 103, 797. 54
利	978, 213, 733. 83	-	_	23, 235, 033, 117. 72	24, 213, 246, 851. 55
上年度末					
2017年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	 不计息	合计
12月31日	1 401	104	3 7 0 1	١٠١١ اټ	
资产					
银行存款	26, 118, 832. 49	_	_	_	26, 118, 832. 49
, , , , , , , , , , , , , , , , , , ,	580, 061, 106. 48		_	_	580, 061, 106. 48
存出保证金	3, 124, 320. 08		_	162, 494, 024. 00	
交易性金融	3, 124, 320. 00			102, 434, 024. 00	103, 010, 344. 00
资产	_	4, 154, 690. 00	15, 028, 382. 94	17, 746, 227, 463. 96	17, 765, 410, 536. 90
买入返售金					
融资产	_	-	_	_	_
应收利息	_	_	_	325, 044. 28	325, 044. 28
应收股利	_		_	9, 601. 50	
应收申购款	_		_		_
应收证券清					
算款	_	_	_	4, 976, 393. 94	4, 976, 393. 94
其他资产	_	_	_	_	_
资产总计	609, 304, 259. 05	4, 154, 690. 00	15, 028, 382. 94	17, 914, 032, 527. 68	18, 542, 519, 859. 67
负债					
应付赎回款	_	_	_	_	_
应付管理人				7 707 100 45	7 707 100 47
报酬	_	_	=	7, 737, 109. 47	7, 737, 109. 47
应付托管费	_	l		1, 547, 421. 88	1, 547, 421. 88
应付证券清				1 000 007 00	1 000 007 00
算款	_	_		1, 686, 037. 80	1, 686, 037. 80
卖出回购金					
融资产款	_	_		_	
应付销售服					
务费	_	_	_	_	_
应付交易费	_	_	_	756, 703. 35	756, 703. 35
用	_			100, 100, 30	100, 100, 30
应付利息	_	=	=	_	_
应付利润	_	_	_	_	_
其他负债	_	_	_	13, 659, 757. 61	13, 659, 757. 61

负债总计	_	_	_	25, 387, 030. 11	25, 387, 030. 11
利率敏感度					
缺口	609, 304, 259. 05	4, 154, 690. 00	15, 028, 382. 94	17, 888, 645, 497. 57	18, 517, 132, 829. 56

注:表中所示为本基金资产及负债的公允价值,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 2018 年 6 月 30 日本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.04%(2017 年 12 月 31 日: 0.10%),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2017 年 12 月 31 日: 同)。

6.4.10.4.2 外汇风险

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

6.4.10.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

	本期末		上年度末	
	2018年6月30日		2017年12月31日	
项目		占基金资产		占基金资
	公允价值	净值比例	公允价值	产净值比
		(%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	23, 107, 172, 229. 60	95. 43	17, 746, 227, 463. 96	95. 84

六月 44 人 54 次 立				
交易性金融资产-基金投资	_	_	_	_
交易性金融资产一债券投资	_	_	_	_
交易性金融资产一贵金属投				
资			_	_
衍生金融资产一权证投资	_	_	_	_
其他	_	-	_	_
合计	23, 107, 172, 229. 60	95. 43	17, 746, 227, 463. 96	95.84

6.4.10.4.3.2 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			
			基金资产净值的 位:人民币元)	
	相关风险变量的变动	本期末 (2018年	上年度末 (2017年	
		6月30日)	12月31日)	
	1. 业绩比较基准(附注	1 070 564 500 40	055 005 007 00	
分析	7.4.1)上升 5%	1, 070, 564, 530. 43	955, 225, 207. 22	
万切	2. 业绩比较基准(附注	1 050 504 500 40	075 005 007 00	
	7.4.1)下降 5%	-1, 070, 564, 530. 43	-955, 225, 207. 22	

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	23, 107, 172, 229. 60	95. 13
	其中: 股票	23, 107, 172, 229. 60	95. 13
2	基金投资	_	_
3	固定收益投资	8, 688, 662. 83	0.04
	其中:债券	8, 688, 662. 83	0.04
	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	965, 404, 877. 99	3. 97
_	_	_	_
8	其他各项资产	210, 084, 878. 67	0.86
9	合计	24, 291, 350, 649. 09	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	242, 963, 317. 33	1.00
В	采矿业	725, 027, 103. 55	2.99
С	制造业	13, 655, 342, 382. 71	56. 40
D	电力、热力、燃气及 水生产和供应业	684, 194, 325. 39	2.83
Е	建筑业	376, 334, 562. 18	1.55
F	批发和零售业	1, 244, 684, 856. 32	5. 14
G	交通运输、仓储和邮 政业	815, 218, 163. 94	3. 37
Н	住宿和餐饮业	125, 794, 766. 90	0. 52
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1, 993, 523, 847. 78	8. 23
Ј	金融业	565, 412, 383. 33	2. 34
K	房地产业	1, 238, 515, 854. 70	5. 12
L	租赁和商务服务业	429, 656, 107. 07	1.77
M	科学研究和技术服务 业	39, 132, 641. 34	0. 16
N	水利、环境和公共设 施管理业	178, 309, 957. 92	0.74
0	居民服务、修理和其 他服务业	_	_
Р	教育	15, 764, 208. 50	0.07
Q	卫生和社会工作	35, 174, 678. 25	0. 15
R	文化、体育和娱乐业	461, 279, 636. 57	1. 91
S	综合	187, 827, 085. 40	0. 78
	合计	23, 014, 155, 879. 18	95.05

7.2.2 报告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	行业类别 公允价值(元) 占基	
A	农、林、牧、渔业	_	_
В	采矿业	3, 270, 898. 97	0.01
С	制造业	19, 523, 708. 29	0.08

	电力、热力、燃气及		
D	水生产和供应业	52, 510, 362. 72	0. 22
E	建筑业	146, 671. 70	
F	批发和零售业	110, 011.10	_
	交通运输、仓储和邮		
G	政业	_	_
Н	住宿和餐饮业	_	_
	信息传输、软件和信		
I	息技术服务业	_	_
J	金融业	1, 293. 90	_
K	房地产业	_	_
L	租赁和商务服务业	_	=
M	科学研究和技术服务		
IVI	<u>11</u> F	616. 50	_
N	水利、环境和公共设		
	施管理业	81, 226. 14	_
0	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	17, 471, 610. 42	0.07
S	综合	_	_
	合计	93, 006, 388. 64	0.38

7.2.3 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所有股票投资明细

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

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	000661	长春高新	914, 283	208, 182, 239. 10	0.86
2	603019	中科曙光	2, 989, 550	137, 130, 658. 50	0. 57
3	600521	华海药业	4, 985, 365	133, 059, 391. 85	0. 55
4	600201	生物股份	7, 738, 339	132, 248, 213. 51	0. 55
5	600426	华鲁恒升	7, 500, 152	131, 927, 673. 68	0. 54
6	002049	紫光国微	2, 821, 178	124, 470, 373. 36	0. 51
7	002410	广联达	4, 439, 011	123, 093, 775. 03	0. 51
8	603589	口子窖	1, 991, 858	122, 399, 674. 10	0. 51
9	000977	浪潮信息	5, 112, 410	121, 930, 978. 50	0.50
10	600298	安琪酵母	3, 251, 740	116, 022, 083. 20	0.48
11	000830	鲁西化工	6, 650, 498	113, 590, 505. 84	0. 47

10	000702	恒逸石化	7 502 445	111 651 961 60	0.46
12	000703		7, 503, 445	111, 651, 261. 60	0.46
13	600256	广汇能源	26, 800, 750	109, 615, 067, 50	0. 45
14	600584	长电科技	6, 345, 553	107, 493, 667. 82	0.44
15	002340	格林美	17, 615, 053	106, 571, 070. 65	0. 44
16	002038	双鹭药业	2, 780, 715	105, 639, 362. 85	0. 44
17	601233	桐昆股份	6, 092, 465	104, 912, 247. 30	0. 43
18	600673	东阳光科 中 标 京	10, 125, 744	104, 598, 935. 52	0. 43
19	600872	中炬高新	3, 613, 688	101, 183, 264. 00	0.42
20	600879	航天电子	14, 282, 826	100, 408, 266. 78	0. 41
21	600760	中航黑豹	2, 765, 017	99, 651, 212. 68	0.41
22	002078	太阳纸业	10, 272, 405	99, 539, 604. 45	0.41
23	600600	青岛啤酒	2, 248, 695	98, 560, 301. 85	0.41
24	002179	中航光电	2, 518, 124	98, 206, 836. 00	0.41
25	000860	顺鑫农业	2, 569, 238	96, 346, 425. 00	0.40
26	002589	瑞康医药	6, 961, 850	94, 959, 634. 00	0. 39
27	000418	小天鹅A	1, 364, 263	94, 611, 639. 05	0. 39
28	002129	中环股份	11, 921, 900	93, 348, 477. 00	0. 39
29	300253	卫宁健康	7, 386, 280	91, 516, 009. 20	0.38
30	600525	长园集团	8, 620, 904	91, 122, 955. 28	0. 38
31	600642	申能股份	18, 121, 431	90, 969, 583. 62	0. 38
32	600885	宏发股份	2, 997, 981	89, 699, 591. 52	0. 37
33	300383	光环新网	6, 662, 500	89, 344, 125. 00	0. 37
34	600004	白云机场	6, 724, 891	88, 028, 823. 19	0. 36
35	600315	上海家化	2, 209, 377	87, 557, 610. 51	0. 36
36	600392	盛和资源	5, 394, 201	87, 547, 882. 23	0. 36
37	600325	华发股份	11, 207, 949	86, 637, 445. 77	0.36
38	600258	首旅酒店	3, 161, 050	85, 885, 728. 50	0.35
39	000656	金科股份	17, 875, 669	85, 803, 211. 20	0.35
40	000581	威孚高科	3, 878, 049	85, 743, 663. 39	0.35
41	002268	卫士通	3, 869, 517	84, 471, 556. 11	0. 35
42	002465	海格通信	10, 449, 982	83, 913, 355. 46	0. 35
43	600079	人福医药	6, 327, 096	83, 644, 209. 12	0. 35
44	000066	中国长城	11, 721, 952	83, 343, 078. 72	0. 34
45	002092	中泰化学	8, 545, 156	82, 375, 303. 84	0.34
46	000690	宝新能源	11, 613, 512	80, 830, 043. 52	0. 33
47	600884	杉杉股份	3, 632, 261	80, 272, 968. 10	0. 33
48	601168	西部矿业	12, 701, 343	79, 764, 434. 04	0. 33
49	000513	丽珠集团	1, 798, 863	79, 060, 028. 85	0. 33
50	002223	鱼跃医疗	3, 991, 438	77, 793, 126. 62	0. 32
51	600138	中青旅	3, 866, 764	77, 064, 606. 52	0. 32
52	002127	南极电商	8, 177, 396	76, 785, 748. 44	0. 32
53	000488	晨鸣纸业	5, 922, 067	76, 513, 105. 64	0. 32

第 42页 共 63页

54	600260	凯乐科技	2, 849, 449	76, 479, 211. 16	0.32
55	000039	中集集团	5, 741, 403	76, 245, 831. 84	0. 31
56	603369	今世缘	3, 279, 900	74, 880, 117. 00	0. 31
57	002176	江特电机	7, 674, 000	74, 591, 280. 00	0. 31
58	300315	掌趣科技	17, 833, 600	74, 544, 448. 00	0. 31
59	600528	中铁工业	7, 283, 592	74, 438, 310. 24	0. 31
60	002195	二三四五	17, 076, 813	73, 088, 759. 64	0. 30
61	000636	风华高科	4, 600, 332	73, 053, 272. 16	0. 30
62	002439	启明星辰	3, 428, 090	72, 744, 069. 80	0. 30
63	300166	东方国信	4, 932, 150	72, 650, 569. 50	0. 30
64	600718	东软集团	5, 557, 744	72, 584, 136. 64	0. 30
65	600811	东方集团	16, 758, 228	72, 060, 380. 40	0. 30
66	002013	中航机电	9, 469, 647	71, 685, 227. 79	0. 30
67	600808	马钢股份	19, 916, 449	71, 500, 051. 91	0. 30
68	300418	昆仑万维	3, 784, 489	71, 451, 152. 32	0. 30
69	000997	新大陆	4, 534, 327	71, 415, 650. 25	0. 29
70	300088	长信科技	12, 292, 004	71, 293, 623. 20	0. 29
71	600062	华润双鹤	2, 903, 496	71, 280, 826. 80	0. 29
72	000825	太钢不锈	11, 878, 900	71, 273, 400. 00	0. 29
73	000887	中鼎股份	4, 926, 615	70, 992, 522. 15	0. 29
74	002019	亿帆医药	4, 002, 969	70, 652, 402. 85	0. 29
75	600060	海信电器	5, 260, 021	70, 431, 681. 19	0. 29
76	600643	爱建集团	7, 487, 854	70, 385, 827. 60	0. 29
77	000596	古井贡酒	790, 952	70, 220, 718. 56	0. 29
78	600839	四川长虹	24, 532, 921	70, 164, 154. 06	0. 29
79	600967	内蒙一机	5, 485, 348	69, 883, 333. 52	0. 29
80	002110	三钢闽光	4, 332, 243	69, 445, 855. 29	0. 29
81	002384	东山精密	2, 891, 353	69, 392, 472. 00	0. 29
82	600022	山东钢铁	34, 284, 310	69, 254, 306. 20	0. 29
83	000009	中国宝安	14, 088, 083	69, 031, 606. 70	0. 29
84	000750	国海证券	19, 274, 120	68, 808, 608. 40	0. 28
85	000999	华润三九	2, 444, 580	68, 032, 661. 40	0. 28
86	000778	新兴铸管	15, 716, 201	67, 265, 340. 28	0. 28
87	600160	巨化股份	9, 187, 118	67, 249, 703. 76	0. 28
88	000960	锡业股份	5, 456, 656	65, 534, 438. 56	0. 27
89	000930	中粮生化	6, 354, 296	65, 449, 248. 80	0. 27
90	600282	南钢股份	14, 735, 879	65, 132, 585. 18	0. 27
91	002373	千方科技	4, 976, 924	64, 948, 858. 20	0. 27
92	002183	怡 亚 通	9, 727, 053	64, 684, 902. 45	0. 27
93	000681	视觉中国	2, 252, 276	64, 640, 321. 20	0. 27
94	300182	捷成股份	8, 502, 100	64, 445, 918. 00	0. 27
95	000975	银泰资源	6, 353, 424	64, 423, 719. 36	0. 27

第 43页 共 63页

96	600183	生益科技	7, 023, 963	64, 339, 501. 08	0. 27
97	002408	齐翔腾达	5, 229, 032	64, 212, 512. 96	0. 27
98	600388	龙净环保	4, 992, 776	63, 807, 677. 28	0. 26
99	000729	燕京啤酒	9, 451, 366	63, 607, 693. 18	0. 26
100	002506	协鑫集成	13, 585, 872	63, 581, 880. 96	0. 26
101	603816	顾家家居	863, 057	63, 443, 320. 07	0. 26
102	000732	泰禾集团	3, 260, 641	63, 419, 467. 45	0. 26
103	600166	福田汽车	31, 209, 002	63, 354, 274. 06	0. 26
104	600410	华胜天成	7, 226, 193	63, 229, 188. 75	0. 26
105	002221	东华能源	6, 469, 796	63, 209, 906. 92	0. 26
106	600143	金发科技	12, 008, 063	62, 682, 088. 86	0. 26
107	600380	健康元	5, 262, 462	62, 412, 799. 32	0. 26
108	600056	中国医药	3, 412, 161	62, 340, 181. 47	0. 26
109	600460	士兰微	5, 102, 610	62, 251, 842. 00	0. 26
110	600655	豫园股份	6, 571, 222	62, 098, 047. 90	0. 26
111	600755	厦门国贸	8, 356, 212	60, 916, 785. 48	0. 25
112	600572	康恩贝	8, 408, 763	60, 290, 830. 71	0. 25
113	600094	大名城	10, 445, 697	60, 167, 214. 72	0. 25
114	603077	和邦生物	34, 681, 963	59, 999, 795. 99	0. 25
115	002407	多氟多	4, 273, 600	59, 915, 872. 00	0. 25
116	002640	跨境通	3, 952, 958	59, 373, 429. 16	0. 25
117	300274	阳光电源	6, 607, 304	59, 267, 516. 88	0. 24
118	300266	兴源环境	2, 962, 962	59, 229, 610. 38	0. 24
119	600266	北京城建	6, 297, 300	59, 194, 620. 00	0. 24
120	000686	东北证券	9, 231, 428	59, 173, 453. 48	0. 24
121	000988	华工科技	4, 053, 793	58, 577, 308. 85	0. 24
122	600895	张江高科	5, 092, 431	58, 562, 956. 50	0. 24
123	601098	中南传媒	4, 631, 419	58, 541, 136. 16	0. 24
124	002174	游族网络	2, 940, 351	58, 512, 984. 90	0. 24
125	600499	科达洁能	8, 435, 443	57, 867, 138. 98	0. 24
126	603899	晨光文具	1, 823, 326	57, 781, 200. 94	0. 24
127	600291	西水股份	4, 314, 000	57, 635, 040. 00	0. 24
128	600348	阳泉煤业	8, 057, 165	57, 608, 729. 75	0. 24
129	300146	汤臣倍健	3, 462, 000	57, 469, 200. 00	0. 24
130	002371	北方华创	1, 154, 342	57, 336, 167. 14	0. 24
131	002359	北讯集团	2, 927, 689	57, 324, 150. 62	0. 24
132	002028	思源电气	3, 403, 709	57, 148, 274. 11	0. 24
133	002273	水晶光电	4, 431, 774	57, 036, 931. 38	0. 24
134	600787	中储股份	7, 355, 841	56, 934, 209. 34	0. 24
135	002491	通鼎互联	5, 142, 590	56, 928, 471. 30	0. 24
136	600418	江淮汽车	8, 701, 889	56, 649, 297. 39	0. 23
137	600409	三友化工	6, 576, 817	56, 626, 394. 37	0. 23

138	000528	柳工	5, 270, 568	56, 447, 783. 28	0. 23
139	600267	海正药业	3, 868, 817	56, 252, 599. 18	0. 23
140	002670	国盛金控	5, 212, 038	56, 133, 649. 26	0. 23
141	000401	冀东水泥	6, 306, 439	55, 938, 113. 93	0. 23
142	600511	国药股份	2, 074, 349	55, 903, 705. 55	0. 23
143	002603	以岭药业	3, 984, 458	55, 702, 722. 84	0. 23
144	600161	天坛生物	2, 875, 896	55, 648, 587. 60	0. 23
145	300010	立思辰	4, 531, 982	55, 471, 459. 68	0. 23
146	002030	达安基因	3, 596, 970	55, 465, 277. 40	0. 23
147	600875	东方电气	7, 485, 074	55, 464, 398. 34	0. 23
148	600729	重庆百货	1, 677, 432	55, 271, 384. 40	0. 23
149	600240	华业资本	7, 522, 139	55, 137, 278. 87	0. 23
150	002244	滨江集团	10, 449, 596	54, 337, 899. 20	0. 22
151	300287	飞利信	7, 510, 900	54, 003, 371. 00	0. 22
152	002440	闰土股份	4, 610, 762	53, 899, 807. 78	0. 22
153	000807	云铝股份	10, 244, 830	53, 068, 219. 40	0. 22
154	603885	吉祥航空	3, 441, 420	53, 032, 282. 20	0. 22
155	600827	百联股份	5, 193, 682	52, 975, 556. 40	0. 22
156	600978	宜华生活	7, 747, 252	52, 913, 731. 16	0. 22
157	002281	光迅科技	2, 492, 547	52, 841, 996. 40	0. 22
158	603883	老百姓	635, 075	52, 812, 837. 00	0. 22
159	000878	云南铜业	5, 527, 187	52, 729, 363. 98	0. 22
160	002399	海普瑞	2, 376, 999	52, 626, 757. 86	0. 22
161	002353	杰瑞股份	3, 192, 806	51, 883, 097. 50	0. 21
162	603658	安图生物	628, 735	51, 845, 488. 10	0. 21
163	600125	铁龙物流	6, 193, 724	51, 841, 469. 88	0. 21
164	000970	中科三环	5, 536, 573	51, 766, 957. 55	0. 21
165	000547	航天发展	6, 617, 680	51, 684, 080. 80	0. 21
166	000008	神州高铁	10, 298, 890	51, 082, 494. 40	0. 21
167	002517	恺英网络	7, 085, 000	50, 941, 150. 00	0. 21
168	000078	海王生物	10, 582, 675	50, 902, 666. 75	0. 21
169	000089	深圳机场	6, 653, 800	50, 901, 570. 00	0. 21
170	002299	圣农发展	3, 247, 620	50, 305, 633. 80	0. 21
171	600737	中粮糖业	6, 655, 200	50, 180, 208. 00	0. 21
172	000028	国药一致	1, 003, 473	50, 073, 302. 70	0. 21
173	601872	招商轮船	13, 847, 690	49, 990, 160. 90	0. 21
174	600179	安通控股	4, 933, 945	49, 980, 862. 85	0. 21
175	600435	北方导航	6, 102, 516	49, 796, 530. 56	0. 21
176	002368	太极股份	1, 705, 447	49, 577, 344. 29	
177	300058	蓝色光标	8, 679, 950	49, 475, 715. 00	
178	600216	浙江医药	3, 868, 756	49, 404, 014. 12	
179	002583	海能达	5, 900, 800	49, 271, 680. 00	

第 45页 共 63页

180	002563	森马服饰	3, 436, 600	49, 143, 380. 00	0.20
181	601966	玲珑轮胎	3, 108, 225	49, 016, 708. 25	0. 20
182	000813	德展健康	5, 927, 627	48, 843, 646. 48	0. 20
183	002280	联络互动	8, 537, 000	48, 831, 640. 00	0. 20
184	600466	蓝光发展	7, 855, 330	48, 703, 046. 00	0. 20
185	002004	华邦健康	9, 565, 765	48, 594, 086. 20	0. 20
186	002152	广电运通	8, 239, 926	48, 450, 764. 88	0. 20
187	002366	台海核电	3, 393, 394	48, 389, 798. 44	0. 20
188	600649	城投控股	7, 906, 633	48, 388, 593. 96	0. 20
189	600801	华新水泥	3, 218, 967	48, 381, 074. 01	0. 20
190	300133	华策影视	4, 539, 967	48, 350, 648. 55	0. 20
191	000598	兴蓉环境	11, 836, 300	48, 055, 378. 00	0. 20
192	002745	木林森	2, 697, 900	47, 995, 641. 00	0. 20
193	300113	顺网科技	2, 753, 198	47, 933, 177. 18	0. 20
194	600970	中材国际	7, 171, 534	47, 905, 847. 12	0. 20
195	300324	旋极信息	5, 043, 102	47, 859, 037. 98	0. 20
196	600635	大众公用	12, 820, 726	47, 693, 100. 72	0. 20
197	600500	中化国际	6, 990, 814	47, 677, 351. 48	0. 20
198	600575	皖江物流	12, 817, 700	47, 553, 667. 00	0. 20
199	000685	中山公用	5, 964, 147	47, 534, 251. 59	0. 20
200	600270	外运发展	2, 257, 990	47, 327, 470. 40	0. 20
201	000553	沙隆达A	2, 973, 962	47, 018, 339. 22	0. 19
202	002358	森源电气	3, 123, 767	47, 012, 693. 35	0. 19
203	300055	万邦达	4, 030, 643	46, 312, 088. 07	0. 19
204	002051	中工国际	3, 011, 591	45, 986, 994. 57	0. 19
205	601000	唐山港	19, 564, 233	45, 975, 947. 55	0. 19
206	600037	歌华有线	4, 430, 540	45, 723, 172. 80	0. 19
207	002191	劲嘉股份	6, 118, 502	45, 705, 209. 94	0. 19
208	600277	亿利洁能	8, 714, 700	45, 665, 028. 00	0. 19
209	002131	利欧股份	21, 731, 662	45, 636, 490. 20	0. 19
210	601179	中国西电	13, 269, 494	45, 381, 669. 48	0. 19
211	600563	法拉电子	912, 125	45, 141, 066. 25	0. 19
212	300199	翰宇药业	3, 151, 563	45, 004, 319. 64	0. 19
213	300115	长盈精密	3, 447, 762	44, 717, 473. 14	0. 18
214	601678	滨化股份	7, 210, 366	44, 560, 061. 88	0. 18
215	002573	清新环境	3, 828, 350	44, 217, 442. 50	0. 18
216	000979	中弘股份	43, 601, 324	44, 037, 337. 24	0. 18
217	002600	领益智造	8, 468, 976	43, 953, 985. 44	0. 18
218	600307	酒钢宏兴	20, 865, 900	43, 818, 390. 00	0. 18
219	600863	内蒙华电	19, 249, 900	43, 697, 273. 00	0. 18
220	000566	海南海药	3, 380, 797	43, 578, 473. 33	0. 18
221	002690	美亚光电	1, 824, 719	43, 501, 300. 96	0. 18

第 46页 共 63页

222	600536	中国软件	2, 011, 099	43, 500, 071. 37	0.18
223	300026	红日药业	11, 897, 301	43, 425, 148. 65	0.18
224	600859	王府井	2, 027, 350	43, 121, 734. 50	0. 18
225	002426	胜利精密	11, 953, 850	43, 033, 860. 00	0. 18
226	600648	外高桥	2, 352, 500	43, 003, 700. 00	0. 18
227	300159	新研股份	6, 023, 272	42, 644, 765. 76	0. 18
228	600021	上海电力	6, 308, 099	42, 516, 587. 26	0. 18
229	000031	中粮地产	7, 292, 990	42, 153, 482. 20	0. 17
230	002709	天赐材料	1, 093, 700	42, 151, 198. 00	0. 17
231	002701	奥瑞金	7, 706, 940	42, 079, 892. 40	0. 17
232	600598	北大荒	4, 581, 500	41, 966, 540. 00	0. 17
233	300197	铁汉生态	7, 763, 521	41, 690, 107. 77	0. 17
234	600503	华丽家族	10, 640, 300	41, 603, 573. 00	0. 17
235	601128	常熟银行	7, 271, 677	41, 593, 992. 44	0. 17
236	002285	世联行	6, 632, 329	41, 584, 702. 83	0. 17
237	000848	承德露露	3, 912, 354	41, 431, 828. 86	0. 17
238	002665	首航节能	7, 104, 895	41, 208, 391. 00	0. 17
239	600717	天津港	5, 468, 000	41, 174, 040. 00	0. 17
240	600823	世茂股份	9, 838, 044	41, 123, 023. 92	0. 17
241	600597	光明乳业	4, 138, 622	40, 848, 199. 14	0. 17
242	600064	南京高科	5, 544, 642	40, 697, 672. 28	0. 17
243	600158	中体产业	3, 492, 119	40, 648, 265. 16	0. 17
244	002390	信邦制药	5, 537, 266	40, 532, 787. 12	0. 17
245	002831	裕同科技	810, 599	40, 529, 950. 00	0. 17
246	600614	鹏起科技	7, 085, 642	40, 459, 015. 82	0. 17
247	600835	上海机电	2, 139, 593	40, 352, 723. 98	0. 17
248	002317	众生药业	3, 799, 085	40, 156, 328. 45	0. 17
249	000758	中色股份	8, 920, 068	40, 140, 306. 00	0. 17
250	300308	中际旭创	668, 200	40, 118, 728. 00	0. 17
251	600881	亚泰集团	10, 733, 613	40, 036, 376. 49	0. 17
252	600754	锦江股份	1, 079, 790	39, 909, 038. 40	0. 16
253	601880	大连港	20, 564, 737	39, 895, 589. 78	0. 16
254	600122	宏图高科	5, 387, 364	39, 866, 493. 60	0. 16
255	000738	航发控制	2, 987, 404	39, 822, 095. 32	0. 16
256	600664	哈药股份	10, 022, 451	39, 789, 130. 47	0. 16
257	600171	上海贝岭	3, 435, 568	39, 783, 877. 44	0. 16
258	002431	棕榈股份	5, 926, 735	39, 768, 391. 85	0. 16
259	600582	天地科技	10, 814, 467	39, 689, 093. 89	0.16
260	002266	浙富控股	10, 570, 116	39, 637, 935. 00	0. 16
261	600848	上海临港	1, 827, 475	39, 601, 383. 25	0.16
262	600017	日照港	12, 327, 222	39, 570, 382. 62	0.16
263	002128	露天煤业	4, 345, 954	39, 374, 343. 24	0. 16

第 47页 共 63页

004	000070	左江环 伊	0.000.505	20 146 000 55	0.10
264	002672	东江环保	2, 990, 595	39, 146, 888. 55	0. 16
265	600645	中源协和	2, 031, 809	39, 132, 641. 34	0. 16
266	600039	四川路桥	11, 896, 984	39, 022, 107. 52	0. 16
267	603766	隆鑫通用	7, 184, 893	39, 013, 968. 99	0. 16
268	000027	深圳能源	7, 892, 842	38, 990, 639. 48	0. 16
269	600026	中远海能	9, 192, 533	38, 976, 339. 92	0. 16
270	600120	浙江东方	2, 857, 942	38, 725, 114. 10	0. 16
271	300002	神州泰岳	9, 257, 608	38, 604, 225. 36	0. 16
272	002916	深南电路	605, 135	38, 432, 123. 85	0. 16
273	002056	横店东磁	5, 417, 816	37, 978, 890. 16	0. 16
274	002512	达华智能	3, 912, 707	37, 953, 257. 90	0. 16
275	002505	大康农业	17, 720, 257	37, 921, 349. 98	0. 16
276	002332	仙琚制药	4, 333, 237	37, 915, 823. 75	0. 16
277	600594	益佰制药	4, 229, 671	37, 897, 852. 16	0. 16
278	603515	欧普照明	807, 317	37, 733, 996. 58	0. 16
279	002444	巨星科技	3, 426, 488	37, 725, 632. 88	0. 16
280	002242	九阳股份	2, 106, 619	37, 266, 090. 11	0. 15
281	002400	省广集团	11, 500, 603	37, 146, 947. 69	0. 15
282	300001	特锐德	3, 268, 500	37, 130, 160. 00	0. 15
283	000926	福星股份	5, 149, 440	37, 024, 473. 60	0. 15
284	600557	康缘药业	2, 991, 831	36, 949, 112. 85	0. 15
285	002477	雏鹰农牧	11, 136, 197	36, 860, 812. 07	0. 15
286	600908	无锡银行	6, 233, 100	36, 712, 959. 00	0. 15
287	000006	深振业A	6, 260, 354	36, 685, 674. 44	0. 15
288	002839	张家港行	5, 969, 000	36, 351, 210. 00	0. 15
289	000156	华数传媒	3, 768, 418	36, 327, 549. 52	0. 15
290	600936	广西广电	7, 631, 017	36, 323, 640. 92	0. 15
291	000667	美好置业	17, 020, 997	36, 254, 723. 61	0. 15
292	002233	塔牌集团	3, 168, 472	36, 247, 319. 68	0. 15
293	600329	中新药业	1, 905, 856	36, 211, 264. 00	0. 15
294	000012	南玻A	7, 295, 745	36, 113, 937. 75	0. 15
295	002180	纳思达	1, 314, 508	36, 096, 389. 68	0. 15
296	600623	华谊集团	3, 609, 124	36, 019, 057. 52	0. 15
297	601717	郑煤机	6, 174, 772	35, 875, 425. 32	0. 15
298	601200	上海环境	2, 256, 916	35, 726, 980. 28	0. 15
299	000718	苏宁环球			
300	000718	湖南黄金	9, 707, 690 5, 186, 716	35, 627, 222. 30	0. 15
		陝国投A		35, 477, 137. 44	0. 15
301	000563	马应龙	10, 412, 520	35, 402, 568. 00	0. 15
302	600993		2, 080, 399	35, 387, 586. 99	0. 15
303	600633	浙数文化	4, 236, 506	35, 332, 460. 04	0. 15
304	002635	安洁科技	2, 048, 353	35, 231, 671. 60	0. 15
305	300244	迪安诊断	1, 850, 325	35, 174, 678. 25	0. 15

第 48页 共 63页

306	002250	联化科技	3, 981, 061	35, 112, 958. 02	0. 15
307	600751	天海投资	5, 389, 607	34, 978, 549. 43	0. 14
308	600098	广州发展	5, 394, 600	34, 795, 170. 00	0. 14
309	300257	开山股份	2, 267, 565	34, 671, 068. 85	0. 14
310	000727	华东科技	18, 340, 700	34, 480, 516. 00	0. 14
311	600478	科力远	6, 609, 130	33, 706, 563. 00	0. 14
312	002212	南洋股份	2, 830, 891	33, 659, 293. 99	0. 14
313	002807	江阴银行	5, 980, 300	33, 609, 286. 00	0. 14
314	600280	中央商场	3, 840, 998	33, 493, 502. 56	0. 14
315	000021	深科技	4, 899, 064	33, 411, 616. 48	0. 14
316	002249	大洋电机	7, 730, 358	33, 317, 842. 98	0. 14
317	300376	易事特	6, 167, 100	33, 117, 327. 00	0. 14
318	600580	卧龙电气	4, 345, 845	33, 115, 338. 90	0. 14
319	002022	科华生物	2, 773, 644	32, 867, 681. 40	0. 14
320	300297	蓝盾股份	4, 038, 600	32, 753, 046. 00	0.14
321	601311	骆驼股份	2, 841, 712	32, 594, 436. 64	0. 13
322	002254	泰和新材	2, 862, 026	32, 569, 855. 88	0.13
323	000543	皖能电力	7, 366, 756	32, 487, 393. 96	0.13
324	002147	新光圆成	2, 196, 500	32, 420, 340. 00	0.13
325	600141	兴发集团	2, 773, 358	32, 309, 620. 70	0.13
326	000519	中兵红箭	4, 148, 886	32, 236, 844. 22	0. 13
327	000400	许继电气	4, 110, 700	32, 104, 567. 00	0.13
328	002064	华峰氨纶	7, 772, 566	32, 100, 697. 58	0. 13
329	600694	大商股份	984, 650	32, 010, 971. 50	0. 13
330	002424	贵州百灵	2, 814, 232	31, 969, 675. 52	0. 13
331	002707	众信旅游	3, 324, 400	31, 914, 240. 00	0. 13
332	601928	凤凰传媒	5, 242, 300	31, 873, 184. 00	0. 13
333	600545	卓郎智能	4, 011, 783	31, 853, 557. 02	0. 13
334	601016	节能风电	11, 062, 600	31, 749, 662. 00	0. 13
335	000426	兴业矿业	4, 390, 237	31, 653, 608. 77	0. 13
336	603659	璞泰来	495, 242	31, 641, 011. 38	0. 13
337	600195	中牧股份	1, 623, 213	31, 571, 492. 85	0. 13
338	600416	湘电股份	4, 341, 469	31, 215, 162. 11	0. 13
339	600770	综艺股份	5, 239, 458	30, 912, 802. 20	0. 13
340	000090	天健集团	4, 956, 133	30, 728, 024. 60	0. 13
341	600108	亚盛集团	10, 623, 100	30, 700, 759. 00	0. 13
342	002354	天神娱乐	3, 313, 726	30, 685, 102. 76	0. 13
343	000612	焦作万方	5, 837, 543	30, 647, 100. 75	0. 13
344	000712	锦龙股份	3, 060, 988	30, 548, 660. 24	0. 13
345	600259	广晟有色	1, 039, 893	30, 448, 067. 04	0. 13
346	002434	万里扬	3, 429, 200	30, 108, 376. 00	0. 12
347	002277	友阿股份	6, 514, 880	30, 033, 596. 80	0.12

348	000937	冀中能源	7, 303, 700	30, 018, 207. 00	0. 12
349	000766	通化金马	2, 520, 177	29, 939, 702. 76	0. 12
350	002437	誉衡药业	4, 806, 508	29, 800, 349. 60	0. 12
351	600611	大众交通	7, 470, 467	29, 732, 458. 66	0. 12
352	601801	皖新传媒	3, 900, 600	29, 683, 566. 00	0. 12
353	002544	杰赛科技	2, 167, 901	29, 678, 564. 69	0. 12
354	000587	金洲慈航	5, 955, 610	29, 539, 825. 60	0. 12
355	603000	人民网	3, 553, 613	29, 494, 987. 90	0. 12
356	000592	平潭发展	10, 376, 802	29, 470, 117. 68	0. 12
357	000501	鄂武商 A	2, 392, 920	29, 408, 986. 80	0. 12
358	603228	景旺电子	593, 374	29, 336, 410. 56	0. 12
359	600777	新潮能源	13, 388, 000	29, 319, 720. 00	0. 12
360	600073	上海梅林	4, 399, 337	29, 211, 597. 68	0. 12
361	002048	宁波华翔	2, 368, 175	29, 199, 597. 75	0. 12
362	000158	常山北明	4, 235, 895	29, 100, 598. 65	0. 12
363	002002	鸿达兴业	6, 304, 060	29, 061, 716. 60	0. 12
364	002463	沪电股份	7, 765, 958	29, 044, 682. 92	0. 12
365	002308	威创股份	3, 473, 536	28, 830, 348. 80	0. 12
366	600317	营口港	12, 755, 696	28, 827, 872. 96	0. 12
367	600565	迪马股份	9, 635, 000	28, 423, 250. 00	0. 12
368	000877	天山股份	4, 208, 390	28, 406, 632. 50	0. 12
369	600874	创业环保	3, 035, 308	28, 349, 776. 72	0. 12
370	600086	东方金钰	2, 814, 455	28, 257, 128. 20	0. 12
371	000762	西藏矿业	2, 931, 361	28, 229, 006. 43	0. 12
372	600316	洪都航空	3, 020, 185	28, 148, 124. 20	0. 12
373	600169	太原重工	12, 013, 592	28, 111, 805. 28	0. 12
374	600578	京能电力	8, 981, 500	28, 022, 280. 00	0. 12
375	600312	平高电气	4, 904, 929	27, 663, 799. 56	0. 11
376	600869	智慧能源	5, 836, 460	27, 548, 091. 20	0. 11
377	601001	大同煤业	5, 545, 587	27, 506, 111. 52	0. 11
378	600422	昆药集团	3, 539, 614	27, 432, 008. 50	0. 11
379	000600	建投能源	4, 913, 566	27, 368, 562. 62	0. 11
380	600366	宁波韵升	4, 458, 499	27, 196, 843. 90	0. 11
381	601608	中信重工	10, 426, 641	27, 109, 266. 60	0. 11
382	603198	迎驾贡酒	1, 473, 284	27, 064, 227. 08	0. 11
383	600395	盘江股份	4, 424, 157	26, 854, 632. 99	0. 11
384	600151	航天机电	6, 564, 490	26, 651, 829. 40	0. 11
385	002489	浙江永强	7, 316, 089	26, 630, 563. 96	0. 11
386	000541	佛山照明	4, 424, 826	26, 504, 707. 74	0. 11
387	000572	海马汽车	7, 714, 683	26, 461, 362. 69	0. 11
388	000980	众泰汽车	3, 709, 800	26, 376, 678. 00	0. 11
389	000969	安泰科技	4, 216, 854	26, 355, 337. 50	0. 11

第 50页 共 63页

390	002503	搜于特	7, 517, 746	26, 312, 111. 00	0. 11
391	300156	神雾环保	3, 935, 900	26, 252, 453. 00	0.11
392	002345	潮宏基	3, 038, 873	26, 134, 307. 80	0.11
393	002428	云南锗业	3, 368, 091	26, 001, 662. 52	0. 11
394	002073	软控股份	4, 514, 982	25, 961, 146. 50	0. 11
395	600338	西藏珠峰	1, 251, 078	25, 922, 336. 16	0. 11
396	002657	中科金财	1, 630, 656	25, 829, 591. 04	0. 11
397	002815	崇达技术	1, 589, 973	25, 598, 565. 30	0. 11
398	000062	深圳华强	1, 305, 731	25, 592, 327. 60	0. 11
399	600765	中航重机	3, 427, 440	25, 500, 153. 60	0. 11
400	002509	天广中茂	8, 752, 600	25, 470, 066. 00	0. 11
401	601689	拓普集团	1, 302, 662	25, 323, 749. 28	0. 10
402	600300	维维股份	7, 755, 889	25, 284, 198. 14	0. 10
403	002681	奋达科技	2, 911, 027	25, 209, 493. 82	0. 10
404	000829	天音控股	3, 433, 935	25, 170, 743. 55	0.10
405	002251	步步高	2, 211, 387	25, 165, 584. 06	0. 10
406	002699	美盛文化	1, 336, 800	25, 078, 368. 00	0.10
407	600058	五矿发展	3, 010, 897	25, 020, 554. 07	0. 10
408	603568	伟明环保	980, 413	24, 804, 448. 90	0. 10
409	002482	广田集团	4, 153, 142	24, 794, 257. 74	0. 10
410	002276	万马股份	4, 236, 642	24, 741, 989. 28	0. 10
411	300039	上海凯宝	4, 261, 124	24, 714, 519. 20	0. 10
412	600187	国中水务	8, 689, 868	24, 679, 225. 12	0. 10
413	000552	靖远煤电	7, 544, 905	24, 671, 839. 35	0. 10
414	603188	亚邦股份	2, 406, 638	24, 547, 707. 60	0. 10
415	600687	刚泰控股	2, 675, 280	24, 318, 295. 20	0. 10
416	002118	紫鑫药业	3, 390, 722	24, 243, 662. 30	0. 10
417	600155	宝硕股份	3, 365, 589	24, 198, 584. 91	0. 10
418	002841	视源股份	451, 020	24, 088, 978. 20	0. 10
419	002302	西部建设	2, 229, 072	24, 007, 105. 44	0. 10
420	300273	和佳股份	3, 536, 569	23, 977, 937. 82	0.10
421	000061	农产品	4, 416, 019	23, 846, 502. 60	0. 10
422	600759	洲际油气	6, 047, 886	23, 828, 670. 84	0. 10
423	000049	德赛电池	843, 912	23, 815, 196. 64	0.10
424	600971	恒源煤电	3, 329, 880	23, 775, 343. 20	0.10
425	600757	长江传媒	4, 176, 461	23, 764, 063. 09	0. 10
426	000990	诚志股份	1, 697, 100	23, 759, 400. 00	0. 10
427	002818	富森美	898, 400	23, 699, 792. 00	0.10
428	002375	亚厦股份	4, 436, 685	23, 691, 897. 90	0. 10
429	600335	国机汽车	2, 250, 910	23, 476, 991. 30	0. 10
430	600750	江中药业	1, 321, 922	23, 464, 115. 50	0. 10
431	002093	国脉科技	2, 959, 160	22, 815, 123. 60	0.09

第 51页 共 63页

432	600639	浦东金桥	1, 805, 955	22, 538, 318. 40	0. 09
433	001696	宗申动力	4, 597, 779	22, 529, 117. 10	0.09
434	000536	华映科技	8, 146, 687	22, 403, 389. 25	0.09
435	601777	力帆股份	4, 271, 843	22, 341, 738. 89	0.09
436	600657	信达地产	5, 235, 062	22, 249, 013. 50	0.09
437	603328	依顿电子	2, 041, 076	22, 145, 674. 60	0.09
438	600006	东风汽车	5, 406, 805	22, 113, 832. 45	0.09
439	600393	粤泰股份	6, 097, 900	22, 074, 398. 00	0.09
440	603888	新华网	1, 299, 445	21, 908, 642. 70	0.09
441	300134	大富科技	2, 415, 611	21, 595, 562. 34	0.09
442	002663	普邦股份	7, 247, 066	21, 523, 786. 02	0.09
443	600773	西藏城投	3, 051, 793	21, 118, 407. 56	0.09
444	002588	史丹利	4, 060, 686	21, 034, 353. 48	0.09
445	603556	海兴电力	1, 154, 500	20, 977, 265. 00	0.09
446	603444	吉比特	164, 120	20, 972, 894. 80	0.09
447	002642	荣之联	2, 268, 865	20, 850, 869. 35	0.09
448	002920	德赛西威	688, 629	20, 590, 007. 10	0.09
449	300291	华录百纳	2, 916, 389	20, 560, 542. 45	0.08
450	002414	高德红外	1, 523, 905	20, 481, 283. 20	0.08
451	603868	飞科电器	423, 158	20, 468, 152. 46	0.08
452	002261	拓维信息	4, 446, 857	20, 455, 542. 20	0.08
453	600458	时代新材	2, 738, 116	20, 152, 533. 76	0.08
454	601127	小康股份	1, 159, 195	20, 042, 481. 55	0.08
455	600428	中远海特	5, 631, 954	19, 993, 436. 70	0.08
456	603056	德邦股份	725, 891	19, 882, 154. 49	0.08
457	002190	成飞集成	1, 144, 650	19, 562, 068. 50	0.08
458	000806	银河生物	4, 482, 000	19, 407, 060. 00	0.08
459	300202	聚龙股份	1, 849, 844	19, 293, 872. 92	0.08
460	600640	号百控股	1, 845, 639	18, 770, 148. 63	0.08
461	002011	盾安环境	2, 922, 243	18, 702, 355. 20	0.08
462	603355	莱克电气	607, 304	18, 249, 485. 20	0.08
463	600748	上实发展	3, 617, 650	18, 232, 956. 00	0.08
464	600862	中航高科	2, 961, 813	18, 215, 149. 95	0.08
465	300116	坚瑞沃能	6, 446, 043	17, 791, 078. 68	0.07
466	002344	海宁皮城	3, 635, 409	17, 668, 087. 74	0.07
467	300032	金龙机电	3, 110, 182	17, 448, 121. 02	0.07
468	600651	飞乐音响	4, 462, 046	17, 401, 979. 40	0.07
469	300043	星辉娱乐	4, 243, 603	16, 974, 412. 00	0.07
470	002342	巨力索具	4, 470, 068	16, 941, 557. 72	0. 07
471	002479	富春环保	2, 972, 575	16, 795, 048. 75	0.07
472	600481	双良节能	5, 453, 924	16, 689, 007. 44	0.07
473	600517	置信电气	4, 498, 235	16, 643, 469. 50	0.07

474	603806	福斯特	747, 033	16, 442, 196. 33	0. 07
475	600743	华远地产	6, 391, 745	16, 426, 784. 65	0. 07
476	600053	九鼎投资	943, 627	16, 202, 075. 59	0. 07
477	603877	太平鸟	480, 296	16, 008, 265. 68	0. 07
478	600184	光电股份	1, 277, 252	15, 825, 152. 28	0.07
479	600996	贵广网络	2, 126, 800	15, 780, 856. 00	0.07
480	603377	东方时尚	1, 138, 210	15, 764, 208. 50	0.07
481	002041	登海种业	2, 307, 640	15, 738, 104. 80	0.06
482	600350	山东高速	3, 851, 710	15, 599, 425. 50	0.06
483	603225	新凤鸣	768, 685	15, 350, 639. 45	0.06
484	000025	特 力A	469, 200	15, 094, 164. 00	0.06
485	600939	重庆建工	3, 018, 433	14, 911, 059. 02	0.06
486	000987	越秀金控	1, 890, 400	14, 858, 544. 00	0.06
487	601020	华钰矿业	1, 062, 348	14, 649, 778. 92	0.06
488	002416	爱施德	2, 483, 240	14, 576, 618. 80	0.06
489	600126	杭钢股份	2, 436, 700	14, 547, 099. 00	0.06
490	600292	远达环保	2, 441, 478	14, 331, 475. 86	0.06
491	601019	山东出版	1, 551, 200	12, 425, 112. 00	0.05
492	603169	兰石重装	2, 446, 040	12, 254, 660. 40	0.05
493	000761	本钢板材	3, 000, 100	12, 120, 404. 00	0.05
494	600167	联美控股	1, 195, 100	11, 951, 000. 00	0.05
495	600618	氯碱化工	1, 372, 890	11, 683, 293. 90	0.05
496	601969	海南矿业	2, 019, 300	11, 065, 764. 00	0.05
497	603025	大豪科技	550, 200	10, 640, 868. 00	0.04
498	601811	新华文轩	1, 055, 223	10, 256, 767. 56	0.04
499	603569	长久物流	602, 200	8, 599, 416. 00	0.04
500	600917	重庆燃气	1, 132, 063	7, 709, 349. 03	0.03

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

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	000939	*ST 凯迪	6, 643, 788	33, 152, 502. 1 2	0. 14
2	000669	金鸿控股	2, 666, 863	19, 334, 756. 7 5	0.08
3	002005	德豪润达	4, 432, 942	19, 327, 627. 1	0.08
4	600880	博瑞传播	4, 101, 317	17, 471, 610. 4	0.07
5	000693	*ST 华泽	988, 187	3, 270, 898. 97	0.01
6	002325	洪涛股份	39, 641	146, 671. 70	0.00

7	300747	锐科激光	1, 543	123, 995. 48	0.00
8	601330	绿色动力	4, 971	81, 226. 14	0.00
9	603650	彤程新材	2, 376	50, 988. 96	0.00
10	603706	东方环宇	1, 765	23, 103. 85	0.00
11	603105	芯能科技	3, 410	16, 470. 30	0.00
12	603486	科沃斯	39	2, 506. 53	0.00
13	603587	地素时尚	42	1, 735. 02	0.00
14	601066	中信建投	90	968.40	0.00
15	300746	汉嘉设计	18	616.50	0.00
16	300745	欣锐科技	4	328.32	0.00
17	601990	南京证券	30	325. 50	0.00
18	002122	*ST 天马	28	56. 56	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	000661	长春高新	113, 376, 383. 63	0.61
2	002129	中环股份	105, 580, 907. 36	0. 57
3	002465	海格通信	100, 945, 104. 65	0. 55
4	300315	掌趣科技	89, 951, 328. 94	0.49
5	600760	中航黑豹	83, 504, 320. 45	0.45
6	000703	恒逸石化	80, 741, 004. 62	0. 44
7	300418	昆仑万维	78, 648, 511. 58	0. 42
8	002049	紫光国微	78, 384, 769. 13	0.42
9	000750	国海证券	76, 652, 852. 53	0.41
10	600258	首旅酒店	75, 346, 438. 48	0.41
11	002268	卫士通	70, 857, 795. 82	0.38
12	600528	中铁工业	69, 991, 169. 55	0.38
13	000830	鲁西化工	68, 796, 387. 32	0.37
14	002340	格林美	67, 958, 623. 48	0.37
15	002038	双鹭药业	67, 305, 142. 13	0.36
16	000686	东北证券	67, 258, 480. 95	0.36
17	002589	瑞康医药	67, 050, 404. 63	0. 36
18	002110	三钢闽光	66, 941, 688. 40	0.36
19	002410	广联达	65, 868, 099. 79	0.36
20	002078	太阳纸业	65, 137, 802. 32	0.35

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 名的股票明细

金额单位: 人民币元

				立
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	002422	科伦药业	191, 757, 439. 54	1. 04
2	600516	方大炭素	170, 222, 479. 10	0. 92
3	002405	四维图新	161, 788, 385. 04	0.87
4	600176	中国巨石	148, 941, 875. 00	0.80
5	000786	北新建材	143, 765, 456. 35	0. 78
6	002271	东方雨虹	131, 352, 751. 13	0.71
7	002001	新 和 成	122, 248, 671. 03	0. 66
8	000998	隆平高科	117, 028, 064. 21	0. 63
9	002311	海大集团	106, 515, 611. 64	0. 58
10	002050	三花智控	101, 791, 901. 93	0. 55
11	000050	深天马A	93, 819, 145. 57	0. 51
12	600438	通威股份	88, 628, 376. 06	0. 48
13	600346	恒力股份	81, 363, 830. 48	0. 44
14	600566	济川药业	80, 596, 593. 33	0. 44
15	000981	银亿股份	79, 505, 752. 99	0. 43
16	601699	潞安环能	69, 696, 660. 84	0. 38
17	002032	苏 泊 尔	58, 264, 013. 97	0. 31
18	000661	长春高新	49, 313, 672. 73	0. 27
19	300156	神雾环保	46, 667, 163. 50	0. 25
20	002410	广联达	43, 776, 121. 87	0. 24

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	10, 971, 240, 103. 01
卖出股票收入(成交)总额	5, 675, 069, 281. 15

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

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	_	_
	其中: 政策性金融债	_	_

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)	8, 688, 662. 83	0.04
8	同业存单	_	-
9	其他	_	-
10	合计	8, 688, 662. 83	0.04

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

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	128038	利欧转债	64, 899	5, 664, 384. 72	0.02
2	113508	新凤转债	17, 290	1, 686, 466. 60	0.01
3	113018	常熟转债	13, 980	1, 335, 090. 00	0.01
4	128029	太阳转债	13	1, 575. 47	0.00
5	128020	水晶转债	6	551. 10	0.00

- 7.7 **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。
- 7.8 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。
- 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		
IC1809	IC1809	342	349, 701, 840.	-38, 391, 327. 62	_		
			00				
IC1812	IC1812	440	440, 739, 200.	-39, 549, 640. 00	_		
			00				
公允价值变	动总额合计((元)			-77, 940, 967. 62		
股指期货投	-51, 717, 789. 73						
股指期货投	股指期货投资本期公允价值变动 (元) -84,010,292.5						

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	162, 208, 401. 01
2	应收证券清算款	47, 445, 032. 65
3	应收股利	9, 601. 50
4	应收利息	421, 843. 51
5	应收申购款	_
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	210, 084, 878. 67

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	123004	铁汉转债	365. 16	0.00
2	128027	崇达转债	229. 78	0.00
3	128029	太阳转债	1, 575. 47	0.00
4	128020	水晶转债	551.10	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位: 人民币元

당 다.	肌 無 仏 石	八司友轮	流通受限部分的公允	占基金资产净值	流通受限情况
序号	股票代码 公司名称		价值(人民币元)	比例 (%)	说明
1	000939	*ST 凯迪	33, 152, 502. 12	0.14	实行退市风险警
1	000939	13100	33, 132, 302. 12	0. 14	示公告
2	000669	金鸿控股	19, 334, 756. 75	0.08	重大资产重组
3	002005	德豪润达	19, 327, 627. 12	0.08	重大资产重组
4	000000	*ST 华泽	2 070 000 07	0.01	未及时披露定期
4	000693	*31 宇佳	3, 270, 898. 97	0.01	报告

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

				持有人结构	持有人结构			
							中国农业银行股	份有限公
	1-1		 机构投资者	<u>.</u>	个人 切次	- ¥-	司-南方中证 500 交易	
	持有人	户均持有	初知到又页有 		一个汉页	个人投资者		投资基金
,	尸数(尸)	的基金份					联接基金(I	LOF)
		额		占总份		占总份	持有份额	占总份
			持有份额	额比例	持有份额	额比例		额比例
				(%)		(%)		(%)
	64, 894	67, 504. 97	2, 953, 856, 191. 00	67. 43	499, 837, 651. 00	11. 41	926, 973, 402. 00	21. 16

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

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	中央汇金投资有限责任 公司	1, 728, 426, 785. 00	39. 46
_	中国人民财产保险股份 有限公司一传统一普通	175, 491, 200. 00	4. 01

	保险产品-008C-		
	CT001 沪		
3	中国人民人寿保险股份	118, 310, 400. 00	2.70
	有限公司一分红一个险		
	分红		
4	中国人寿保险股份有限	63, 521, 906. 00	1.45
	公司		
5	中国人寿保险股份有限	47, 497, 149. 00	1.08
	公司		
6	中泰证券股份有限公司	44, 444, 500. 00	1.01
7	中国人民人寿保险股份	39, 488, 000. 00	0. 90
	有限公司一万能一个险		
	万能		
8	财通证券股份有限公司	30, 266, 667. 00	0. 69
9	中国人民健康保险股份	26, 265, 983. 00	0. 60
	有限公司一传统一普通		
	保险产品		
10	工银安盛人寿保险有限	26, 060, 200. 00	0. 59
	公司		
	中国农业银行股份有限	926, 973, 402. 00	21. 16
	公司一南方中证 500 指		
	数证券投资基金(L0F)联		
	接基金		

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位: 份

基金合同生效日(2013年2月6日)基	
金份额总额	1, 147, 553, 216. 00
本报告期期初基金份额总额	2, 810, 667, 244. 00
-基金总申购份额	2, 410, 400, 000. 00
减: -基金总赎回份额	840, 400, 000. 00

-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	4, 380, 667, 244. 00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,基金管理人、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、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

	六月出元	股票交易		应支付该券	商的佣金	
券商名称	交易单元 数量	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	备注
平安证券	2	12, 382, 272, 47	74. 55%	1, 238, 394	74. 55%	
1 女ய勿	4	1.82		. 56	74. 55%	
申万宏源	2	4, 226, 726, 993	25. 45%	422, 698. 5	25. 45%	_
		. 17		9		
国泰君安	1	_	_	_	_	
银河证券	2	_	_	_	_	_

英大证券	1	_	-	-	
东兴证券	1	_	_	_	
东北证券	2	_	_	_	
华泰证券	2	_	_	_	

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

	债券交	5易	债券回购交易		权证交易	
券商名称	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
东北证券	_	_	_	_	_	_
东兴证券	_	_	_	_	_	_
国泰君安	_	_	_	_	_	_
华泰证券	_	-	_	_	_	_
平安证券	8, 044, 612. 37	29. 80%	42, 000, 000. 00	20. 79%	_	_

申万宏源	18, 949, 691. 92	70. 20%	160, 000, 000. 00	79. 21%	_	_
银河证券	_	_	_	_	_	_
英大证券	_	-	_	_	_	_

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	式指数证券投资基金增加国盛证券	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2018年 02月 07日
	俗黒全招墓说明书(申新)	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2018年 03月 14日
	俗悬全招暴说明书(更新)摘要	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2018年 03月 14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

			报告期内持有	基金份额变化情况		报告期末持有基	金情况
投资者类别	序号	持基份比达或超 20% 时区间	期初份额	申购份额	赎回 份额	持有份额	份额占 比 (%)
-	-	_	_	_	_	_	_
个人	-	-	_	_	_	_	-
机构	1	201801 01- 201806 30	1, 728, 426, 785. 00	_	_	1, 728, 426, 785. 00	39. 65
联接基金	2	201801 01- 201801 24;201 80129-	585, 773, 402. 00	354, 800, 000. 00	13, 600, 000. 00	926, 973, 402. 00	21. 16

	201806					
	30					
N. F. d. L. Compt.						

产品特有风险

本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人,在特定赎回比例及市场条件下,若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产,将会导致流动性风险和基金净值波动风险。

注:申购份额包含红利再投资和份额折算。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立中证500交易型开放式指数证券投资基金的文件。
- 2、中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同。
- 3、中证500交易型开放式指数证券投资基金基金托管协议。
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层。

12.3 查阅方式

网站: http://www.nffund.com