

南方中证 500 指数证券投资基金(LOF) 2010 年年度报告

2010 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2011 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2011 年 3 月 25 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 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
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.....	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	错误！未定义书签。
7.1 资产负债表.....	错误！未定义书签。
7.2 利润表.....	错误！未定义书签。
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告	42
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
8.3 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.....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	58
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	58
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	58

8.9 投资组合报告附注	58
§9 基金份额持有人信息.....	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2 期末上市基金前十名持有人	59
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	59
§10 开放式基金份额变动.....	59
§11 重大事件揭示.....	60
11.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4 基金投资策略的改变	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
11.8 其他重大事件	62
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
§13 备查文件目录.....	66
13.1 备查文件目录	66
13.2 存放地点	66
13.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)
基金简称	南方中证 500 指数 (LOF)
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	2,972,289,432.83 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

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”。

2.2 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量化的风险管理手段，以实现对标的指数的有效跟踪。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	李芳菲
	联系电话	0755-82763888	010-63201510
	电子邮箱	manager@southernfund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-63201816
注册地址		深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		吴万善	项俊波

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 17 号

§ 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	2010 年	2009 年 09 月 25 日 -2009 年 12 月 31 日
本期已实现收益	382,178,312.08	179,466,602.40
本期利润	462,616,870.73	522,613,376.93
加权平均基金份额本期利润	0.1374	0.1740

本期加权平均净值利润率	11.97%	15.81%
本期基金份额净值增长率	9.40%	17.60%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	433,775,707.02	195,517,917.54
期末可供分配基金份额利润	0.1459	0.0678
期末基金资产净值	3,658,934,810.92	3,391,413,066.60
期末基金份额净值	1.2310	1.1760
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	28.66%	17.60%

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。

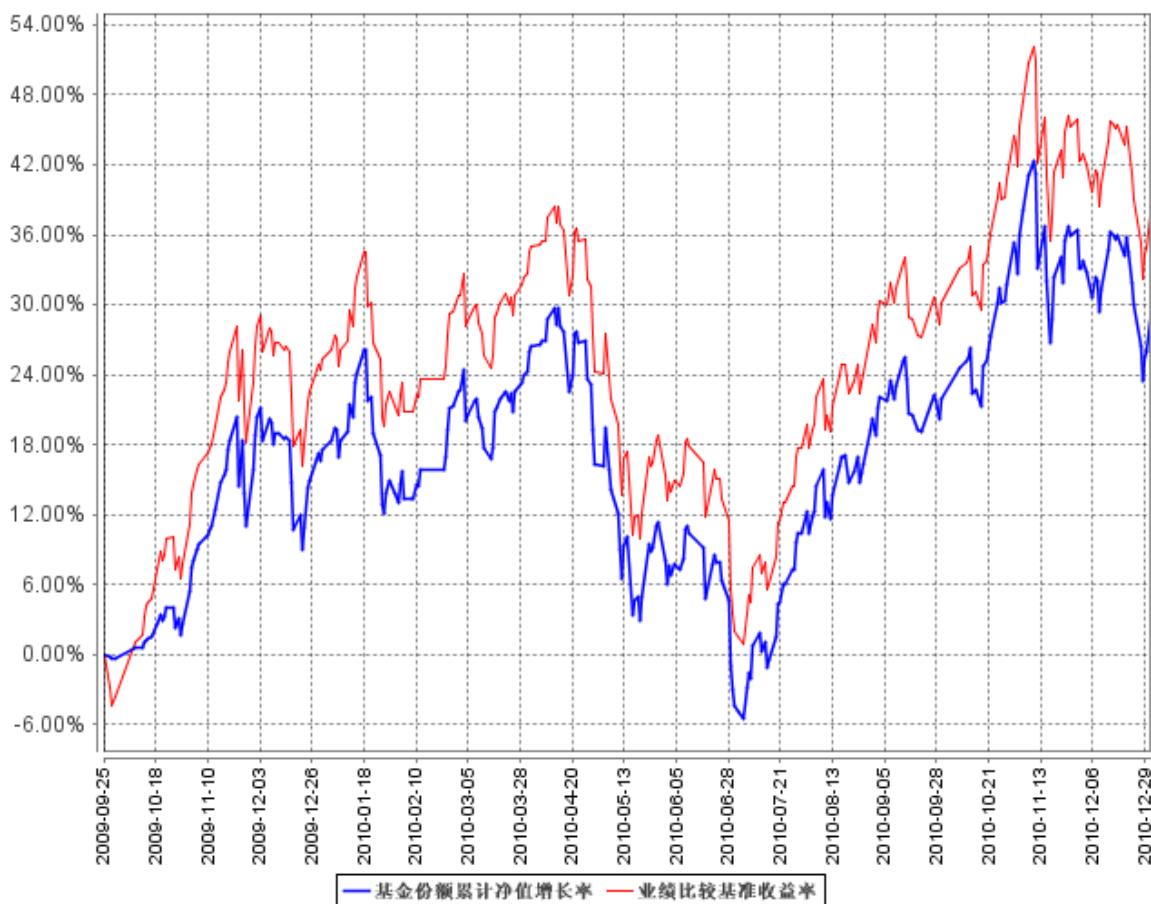
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	5.52%	1.84%	5.68%	1.84%	-0.16%	0.00%
过去六个月	32.51%	1.65%	32.86%	1.65%	-0.35%	0.00%
过去一年	9.40%	1.71%	9.77%	1.72%	-0.37%	-0.01%
自基金合同生效起至今	28.66%	1.70%	37.65%	1.76%	-8.99%	-0.06%

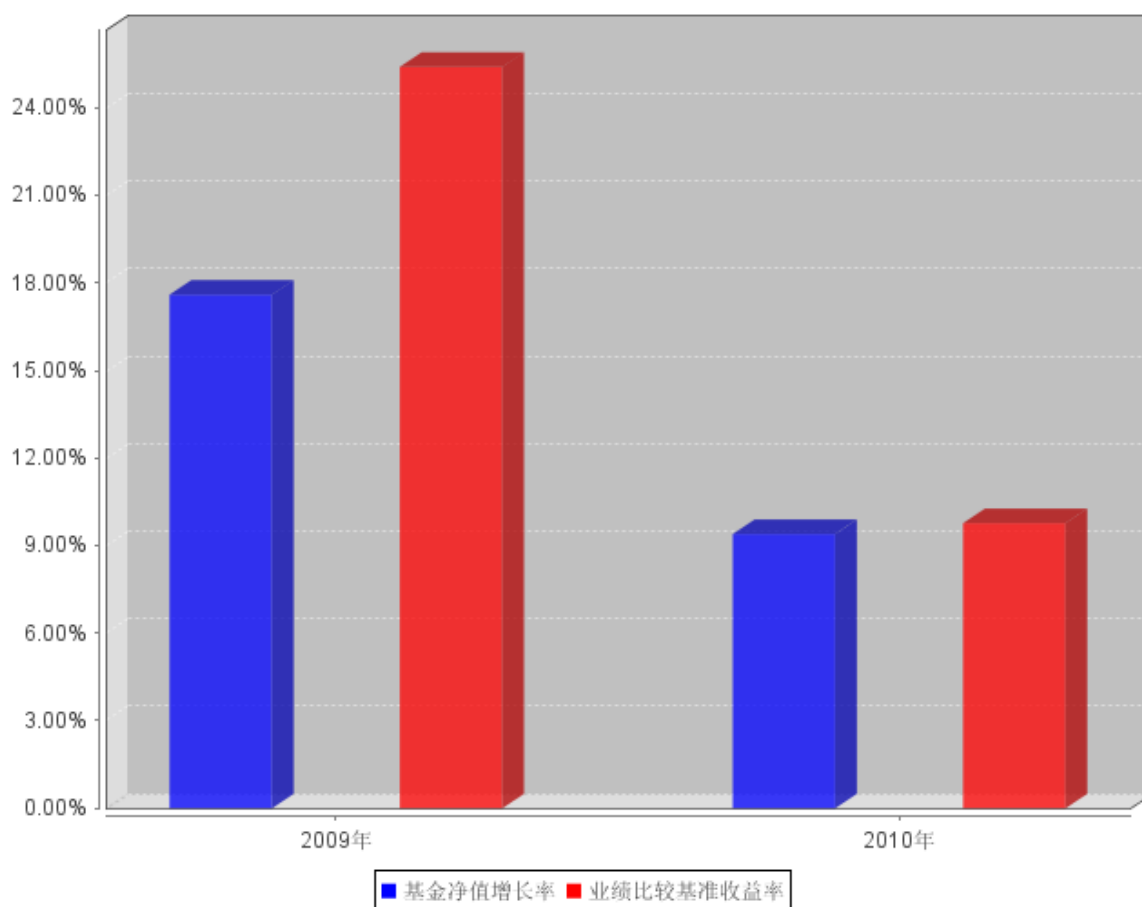
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额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



3.2.3 自基金合同生效以来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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放总 额	再投资形式发放 总额	年度利润分配合 计	备注
2010	0.5000	116,331,049.37	55,660,508.35	171,991,557.72	
2009	-	-	-	-	
合计	0.5000	116,331,049.37	55,660,508.35	171,991,557.72	

§ 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

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[1998]4号文批准,由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000年,经中国证监会证监基金字[2000]78号文批准进行了增资扩股,注册资本达到1亿元人民币。2005年,经中国证监会证监基

金字[2005]201 号文批准进行增资扩股，注册资本达 1.5 亿元人民币。2010 年，经证监许可[2010]1073 号文核准深圳市机场（集团）有限公司将其持有的 30%股权转让给深圳市投资控股有限公司。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%。

截至报告期末，公司管理资产规模达 1,800 多亿元，管理 2 只封闭式基金——基金开元、基金天元；24 只开放式基金——南方稳健成长基金、南方宝元债券型基金、南方避险增值基金、南方现金增利基金、南方积极配置基金、南方高增长基金、南方多利增强债券型基金、南方稳健成长贰号基金、南方绩优成长基金、南方成份精选基金、南方隆元产业主题基金、南方全球精选配置基金（QDII 基金）、南方盛元红利股票型基金、南方优选价值股票型基金、南方恒元保本混合型基金、南方沪深 300 指数基金、南方中证 500 指数基金、深证成份交易型开放式指数基金、南方深证成份交易型开放式指数基金联接基金、南方策略优化股票型基金、中证南方小康产业交易型开放式指数基金、中证南方小康产业交易型开放式指数基金联接基金、南方广利回报债券型基金和南方金砖四国指数基金（QDII 基金）；以及多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张原	本基金的基金经理	2009 年 9 月 25 日	-	4	美国密歇根大学经济学硕士学位，具有基金从业资格。2006 年 4 月加入南方基金，曾担任南方基金研究部机械及电力设备行业高级研究员，南方高增及南方隆元基金经理助理，2009 年 9 月至今，任南方 500 基金经理；2010 年 2 月至今，任南方绩优基金经理；2011 年 2 月至今，任南方高增基金经理。

注：1、任职日期指基金合同生效日；

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；

3、本基金管理人于 2011 年 2 月 17 日发布公告，增聘潘海宁先生为本基金基金经理。

4、2011 年 2 月 28 日，基金管理人聘任罗文杰为小康 ETF 及南方小康、南方 300、南方 500、深成 ETF 及南方深成的基金经理助理。

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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》和其他有关法律法规的规定，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。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人没有管理与本基金投资风格相似的其他投资组合。

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。

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

2010 年资本市场先抑后扬，市场结构性分化显著。上半年随着投资者对经济刺激政策退出以及经济过热的担忧，市场进入调整阶段；下半年，在明确了积极的货币和财政政策仍将继续稳定推动国内经济重回高速增长的轨迹，特别是“转变经济发展方式”这一大趋势被市场普遍接受后，在新兴产业的引领下，A 股市场重拾升势，本基金跟踪的中证 500 指数甚至创下年内新高，报告期内指数涨幅为+10.07%。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

- ①接受申购赎回所带来的股票仓位偏离，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- ②报告期内，“安信信托”等长期停牌证券，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏

离；

③根据中证 500 指数半年度及年度成份股调整所进行调仓时带来的偏离。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自本基金建仓完成至报告期末年化跟踪误差为 0.425%，较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过 4%的投资目标。

截至报告期末，本基金份额净值为 1.2310 元，报告期内，份额净值增长率为 9.40%，同期业绩基准增长率为 9.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011 年，随着经济先行指标的逐渐筑底和经济内生复苏动力恢复，中央逆周期的调控机制将降低未来经济过热引发的风险，对市场未必产生明显的负面拖累，中国经济在转型深化的背景下，将呈现增长、通胀可控的格局。

政策和经济的博弈仍将主导明年的市场走势路径，而政策选择上也会依赖经济和通胀的变化进行相机抉择。考虑到流动性充裕的局面已经形成，加之国内经济逐步见底回升，且市场整体估值偏低，股市震荡上行概率较大。在此前提下，指数基金将继续体现出其高仓位的优势。

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。

对于没有太多精力专注于股市的投资者，我们认为通过本基金进行定期定投，不失为一种较为省心省力且长期效果不俗的投资方式。而对于那些股市经验丰富的投资者，我们建议在主动配置个股的同时，可根据自己对大盘的判断，用部分仓位通过指数基金进行快速加减仓的波段操作，这也是目前较多专业机构投资者的惯用方法。本基金管理组预祝大家 2011 年能够取得自己满意的投资回报！

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 进一步完善公司各项内部管理制度

本年度监察稽核部加强公司各项内部管理制度的制订、修订工作，对公司各业务部门的内部控制制度提出修改意见和建议，并关注制度的健全性和有效性，进一步完善了公司内控制度，达到更好地防范风险的目的。

(2) 内部审计和开展 SAS70 国际专项认证工作

按照证监会的要求对公司投资、研究、交易、信息技术、基金会计、注册登记、人力资源、基金销售等主要业务进行定期稽核工作。同时，对投资研究、信息技术、基金直销、后台运营等相关业务开展了专项稽核工作，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性等。本年度，本公司聘请普华永道会计师事务所，对公司的内控建设进行 SAS70 国际专项认证工作。

(3) 采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强了对日常投资运作的管理和监控，保证投资遵循既定的投资决策程序与业务流程，基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

(4) 继续做好反商业贿赂工作，从源头上控制销售风险

本年度，我公司积极开展反商业贿赂工作，对公司旗下基金的代销、直销业务进行自查，此项工作有利于更好地控制销售风险。

(5) 对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训

本年度，我公司采取外聘专家和内部专业人士相结合的方式，对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训，进一步提高了我司从业人员的合规素质和职业道德修养。

(6) 全面参与新产品设计、新业务拓展工作，负责日常合同审查，监督客户投诉处理。积极参与证监会新规定出台前的讨论并提出修改建议。

(7) 信息披露和投资者关系管理工作

完成各基金及公司的各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；重视媒体监督和投资者关系管理工作。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生禁止性关联交易、内幕交易，也不存在本基金管理人管理的各基金之间的违规交叉交易，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、数量化投资部总监、监察稽核总监及基金会计负责人等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制订的相关制度，负责估值工作决策和执行的机构成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：每一基金份额享有同等分配权；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多 6 次，每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述收益分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金于 2010 年 5 月 7 日进行了收益分配，每 10 份派 0.50 元。

§ 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

在托管南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）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》等相关法律法规的规定以及《南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）托管协议》的约定，对南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）管理人—南方基金管理有限公司 2010 年 1 月 1 日至 2010 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，南方基金管理有限公司在南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）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南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2011)第 20321 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人:
引言段	我们审计了后附的南方中证 500 指数证券投资基金(LOF) (以下简称“南方中证 500 指数基金”)的财务报表,包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	一、管理层对财务报表的责任 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报

	<p>表是南方中证 500 指数基金的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：（1）设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；（2）选择和运用恰当的会计政策；（3）作出合理的会计估计。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>普华永道中天审字(2011)第 20321 号</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了南方中证 500 指数基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	薛 竞 陈 熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	中国 · 上海市
审计报告日期	2011 年 3 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	187,051,646.55	225,010,537.53
结算备付金		2,444,946.61	10,766,444.15
存出保证金		717,981.47	547,758.94
交易性金融资产	7.4.7.2	3,474,189,896.70	3,217,014,167.22
其中：股票投资		3,474,189,896.70	3,217,014,167.22
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
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		-	206,973,549.89
应收利息	7.4.7.5	40,735.14	41,872.87
应收股利		-	-
应收申购款		10,686,452.57	12,977,699.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,675,131,659.04	3,673,332,030.30

负债和所有者权益	附注号	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 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		8,814,509.31	-
应付赎回款		2,820,991.50	273,135,222.57
应付管理人报酬		1,840,818.45	1,770,678.72
应付托管费		368,163.68	354,135.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,449,688.64	4,881,672.31
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	902,676.54	1,777,254.38
负债合计		16,196,848.12	281,918,963.70
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,972,289,432.83	2,882,661,867.84
未分配利润	7.4.7.10	686,645,378.09	508,751,198.76
所有者权益合计		3,658,934,810.92	3,391,413,066.60
负债和所有者权益总计		3,675,131,659.04	3,673,332,030.30

注:

1. 报告截止日 2010 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.2310 元, 基金份额总额 2,972,289,432.83 份。

2. 比较财务报表的实际编制期间为 2009 年 9 月 25 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 9 月 25 日 (基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
一、收入		503,902,598.98	536,848,260.70
1. 利息收入		1,726,169.83	2,258,393.84
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,725,795.58	2,119,624.76
债券利息收入		374.25	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	138,769.08
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		412,433,038.82	188,071,860.92
其中：股票投资收益	7.4.7.12	395,460,548.10	187,930,975.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	148,280.55	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	16,824,210.17	140,885.11
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	80,438,558.65	343,146,774.53
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	9,304,831.68	3,371,231.41
减：二、费用		41,285,728.25	14,234,883.77
1. 管理人报酬		23,255,071.82	5,243,871.97
2. 托管费		4,651,014.34	1,048,774.38
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	12,096,286.15	7,590,973.18
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	1,283,355.94	351,264.24
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		462,616,870.73	522,613,376.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		462,616,870.73	522,613,376.93

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)

本报告期: 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 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)	2,882,661,867.84	508,751,198.76	3,391,413,066.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	462,616,870.73	462,616,870.73
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)	89,627,564.99	-112,731,133.68	-23,103,568.69
其中: 1.基金申购款	6,367,804,733.77	1,147,089,613.98	7,514,894,347.75
2.基金赎回款	-6,278,177,168.78	-1,259,820,747.66	-7,537,997,916.44
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)	-	-171,991,557.72	-171,991,557.72
五、期末所有者权益(基金净值)	2,972,289,432.83	686,645,378.09	3,658,934,810.92
项目	上年度可比期间 2009 年 9 月 25 日(基金合同生效日)至 2009 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)	3,223,217,818.45	-	3,223,217,818.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	522,613,376.93	522,613,376.93
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)	-340,555,950.61	-13,862,178.17	-354,418,128.78
其中: 1. 基金申购款	2,012,364,576.27	330,174,418.75	2,342,538,995.02
2. 基金赎回款	-2,352,920,526.88	-344,036,596.92	-2,696,957,123.80
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)	2,882,661,867.84	508,751,198.76	3,391,413,066.60

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:

基金管理人: 高良玉 主管会计工作负责人: 鲍文革 会计机构负责人: 鲍文革

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]755 号《关于核准南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,222,521,419.53 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 187 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2009 年 9 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,223,217,818.45 份基金份额,其中认购资金利息折合 696,398.92 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2009]第 147 号文审核同意,本基金 581,411,748.00 份基金份额于 2009 年 11 月 11 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证 500 指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中,中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,权证及其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金力争净值增长率与业绩比较基准间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%,年跟踪误差不得超过 4%。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 X 95% + 银行活期存款利率(税后) X 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 2011 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2010 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2009 年 9 月 25 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：**(1)** 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；**(2)** 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；**(3)** 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金采用的行业指数为中证协

(SAC)基金行业股票估值指数。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 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。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
活期存款	187,051,646.55	225,010,537.53
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	187,051,646.55	225,010,537.53

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,050,604,563.52	3,474,189,896.70	423,585,333.18
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	3,050,604,563.52	3,474,189,896.70	423,585,333.18
项目	上年度末 2009 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,873,867,392.69	3,217,014,167.22	343,146,774.53
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,873,867,392.69	3,217,014,167.22	343,146,774.53

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	39,879.44	38,104.57
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	855.70	3,768.30
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	40,735.14	41,872.87

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日

交易所市场应付交易费用	1,449,688.64	4,881,672.31
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,449,688.64	4,881,672.31

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2010 年 12 月 31 日	2009 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	16,075.55	1,049,458.62
预提费用	386,600.99	227,795.76
合计	902,676.54	1,777,254.38

7.4.7.9. 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,882,661,867.84	2,882,661,867.84
本期申购	6,367,804,733.77	6,367,804,733.77
本期赎回(以“-”号填列)	-6,278,177,168.78	-6,278,177,168.78
本期末	2,972,289,432.83	2,972,289,432.83

注：1. 申购含红利再投份额。

2. 截至 2010 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 156,118,599.00 份(2009 年 12 月 31 日：376,641,154.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 2,816,170,833.83 份(2009 年 12 月 31 日：2,506,020,713.84 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 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	195,517,917.54	313,233,281.22	508,751,198.76
本期利润	382,178,312.08	80,438,558.65	462,616,870.73
本期基金份额交易产生的变动数	28,071,035.12	-140,802,168.80	-112,731,133.68
其中：基金申购款	631,707,686.60	515,381,927.38	1,147,089,613.98
基金赎回款	-603,636,651.48	-656,184,096.18	-1,259,820,747.66
本期已分配利润	-171,991,557.72	-	-171,991,557.72
本期末	433,775,707.02	252,869,671.07	686,645,378.09

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 9 月 25 日 (基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,658,079.47	2,067,273.74
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	44,749.68	46,407.16
其他	22,966.43	5,943.86
合计	1,725,795.58	2,119,624.76

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 9 月 25 日 (基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	3,816,267,375.89	1,579,528,842.41
减：卖出股票成本总额	3,420,806,827.79	1,391,597,866.60
买卖股票差价收入	395,460,548.10	187,930,975.81

7.4.7.13 债券投资收益

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 9 月 25 日 (基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
卖出债券成交金额	1,062,454.80	-
减：卖出成本总额	913,800.00	-
减：应收利息总额	374.25	-
债券投资收益	148,280.55	-

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 9 月 25 日 (基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	16,824,210.17	140,885.11

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	16,824,210.17	140,885.11

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 9 月 25 日 (基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	80,438,558.65	343,146,774.53
——股票投资	80,438,558.65	343,146,774.53
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	80,438,558.65	343,146,774.53

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 9 月 25 日 (基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	9,304,831.68	3,371,231.41
合计	9,304,831.68	3,371,231.41

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

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 9 月 25 日 (基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	12,096,286.15	7,590,973.18
银行间市场交易费用	-	-
合计	12,096,286.15	7,590,973.18

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 9 月 25 日 (基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
审计费用	102,000.00	53,000.00
信息披露费	300,000.00	75,000.00
指数使用费	783,990.16	174,795.76
上市年费	60,000.00	40,000.00
银行划款手续费	37,265.78	7,568.48
账户维护费	100.00	-
开户费	-	900.00
合计	1,283,355.94	351,264.24

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 0.02% 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(自然季度)人民币 50,000.00 元。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金公司”)	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、基金代销机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
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(i)	基金管理人的股东(2010 年 9 月 10 日起)
深圳市机场(集团)有限公司(i)	基金管理人的原股东(2010 年 9 月 10 日前)
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司、基金代销机构

注：

(i) 根据基金管理人南方基金公司 2009 年第一次临时股东会会议决议以及中国证监会证监许可[2010]1073 号《关于核准南方基金管理有限公司变更股权的批复》核准，深圳市投资控股有限公司受让深圳市机场(集团)有限公司持有的南方基金公司 30% 的

股权，南方基金公司于 2010 年 9 月 10 日完成了工商登记变更手续。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2009 年 9 月 25 日 (基金合同生效日)至 2009 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	1,703,148,092.	21.67%	1,816,132,905.	31.07%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 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	1,383,827.33	21.12%	442,471.35	30.52%
关联方名称	上年度可比期间 2009 年 9 月 25 日(基金合同生效日)至 2009 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	1,475,633.74	30.23%	1,475,633.74	30.23%

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。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年9月25日 (基金合同生效日)至 2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	23,255,071.82	5,243,871.97
其中：支付销售机构的客户维护费	5,011,291.82	810,786.89

注：支付基金管理人南方基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.6%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 0.6% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年9月25日 (基金合同生效日)至 2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,651,014.34	1,048,774.38

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 0.12%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 0.12% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年9月25日 (基金合同生效日)至 2009年12月31日
基金合同生效日(2009年9月25日)持有的基金份额	-	49,996,750.00
期初持有的基金份额	49,996,750.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间卖出总份额	49,996,750.00	-
期末持有的基金份额	-	49,996,750.00
期末持有的基金份额	-	1.73%

占基金总份额比例		
----------	--	--

注：基金管理人南方基金公司在本年度卖出本基金的交易委托华泰联合证券办理，适用手续费为 181,053.25 元。

7.4.10.4.2 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
无。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2009 年 9 月 25 日 (基金合同生效日)至 2009 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	187,051,646.55	1,658,079.47	225,010,537.53	2,067,273.74

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明
无。

7.4.11 利润分配情况

序号	权益 登记日	除息日 (场内)	除息日 (场外)	每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	10/05/07	10/05/10	10/05/07	0.500	116,331,049.37	55,660,508.35	171,991,557.72	
合计				0.500	116,331,049.37	55,660,508.35	171,991,557.72	

7.4.12 期末(2010 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600315	上海家化	10/12/07	公告重大事项	37.13	未知	未知	423,524	12,259,996.69	15,725,446.12	
000917	电广传媒	10/12/27	公告重大事项	24.40	未知	未知	563,200	9,715,279.31	13,742,080.00	
600637	广电信息	10/09/02	公告重大事项	8.38	11/01/11	9.22	977,800	6,422,453.91	8,193,964.00	
000903	云内动力	10/12/08	公告重大事项	17.60	11/01/07	16.00	442,866	5,412,244.88	7,794,441.60	
600991	广汽长丰	10/10/28	公告重大事项	14.07	未知	未知	361,133	3,436,424.36	5,081,141.31	
600829	三精制药	10/12/29	公告重大事项	21.18	11/02/16	23.30	203,044	4,166,016.92	4,300,471.92	
600894	广钢股份	10/11/09	公告重大事项	7.78	11/01/10	8.56	492,740	3,536,523.27	3,833,517.20	
合计								44,948,939.34	58,671,062.15	

注：本基金截至 2010 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
无。**7.4.13 金融工具风险及管理****7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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。本基金投资的金融工具主要为股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现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目标。

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

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，将风险控制可在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2009 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能

力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金等,其余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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2010年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	187,051,646.55	-	-	-	187,051,646.55
结算备付金	2,444,946.61	-	-	-	2,444,946.61
存出保证金	-	-	-	717,981.47	717,981.47
交易性金融资产	-	-	-	3,474,189,896.70	3,474,189,896.70
应收利息	-	-	-	40,735.14	40,735.14
应收申购款	-	-	-	10,686,452.57	10,686,452.57
资产总计	189,496,593.16	-	-	3,485,635,065.88	3,675,131,659.04
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,814,509.31	8,814,509.31
应付赎回款	-	-	-	2,820,991.50	2,820,991.50
应付管理人报酬	-	-	-	1,840,818.45	1,840,818.45
应付托管费	-	-	-	368,163.68	368,163.68
应付交易费用	-	-	-	1,449,688.64	1,449,688.64
其他负债	-	-	-	902,676.54	902,676.54
负债总计	-	-	-	16,196,848.12	16,196,848.12
利率敏感度缺口	189,496,593.16	-	-	3,469,438,217.76	3,658,934,810.92
上年度末					
2009年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	225,010,537.53	-	-	-	225,010,537.53

结算备付金	10,766,444.15	-	-	-	10,766,444.15
存出保证金	-	-	-	547,758.94	547,758.94
交易性金融资产	-	-	-	3,217,014,167.22	3,217,014,167.22
应收证券清算款	-	-	-	206,973,549.89	206,973,549.89
应收利息	-	-	-	41,872.87	41,872.87
应收申购款	-	-	-	12,977,699.70	12,977,699.70
资产总计	235,776,981.68	-	-	3,437,555,048.62	3,673,332,030.30
负债					
应付赎回款	-	-	-	273,135,222.57	273,135,222.57
应付管理人报酬	-	-	-	1,770,678.72	1,770,678.72
应付托管费	-	-	-	354,135.72	354,135.72
应付交易费用	-	-	-	4,881,672.31	4,881,672.31
其他负债	-	-	-	1,777,254.38	1,777,254.38
负债总计	-	-	-	281,918,963.70	281,918,963.70
利率敏感度缺口	235,776,981.68	-	-	3,155,636,084.92	3,391,413,066.60

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2009 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。本基金通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 500 指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中，中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%。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，包括 VaR(Value at Risk)指标等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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		上年度末 2009 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净 值比例(%)	公允价值	占基金资产净 值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	3,474,189,896.7 0	94.95	3,217,014,167.22	94.86
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,474,189,896.7 0	94.95	3,217,014,167.22	94.86

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位: 人民币万元)	
		本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
	1.中证 500 指数上升 5%	增加约 18,115	成立尚未满一年
	2.中证 500 指数下降 5%	减少约 18,115	成立尚未满一年

注: 于 2009 年 12 月 31 日, 本基金成立尚未满一年, 无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**(1) 公允价值****(a) 不以公允价值计量的金融工具**

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值, 公允价值层级可分为:

第一层级: 相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级: 直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级: 以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于2010年12月31日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为3,415,518,834.55元, 属于第二层级的余额为58,671,062.15元, 无属于第三层级的余额(2009年12月31日: 第一层级3,169,483,149.46元, 第二层级47,531,017.76元, 无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票, 本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级, 并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009会计期间: 同)。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	3,474,189,896.70	94.53
	其中：股票	3,474,189,896.70	94.53
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	189,496,593.16	5.16
6	其他各项资产	11,445,169.18	0.31
7	合计	3,675,131,659.04	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	85,074,007.55	2.33
B	采掘业	42,524,955.66	1.16
C	制造业	2,060,926,725.47	56.33
C0	食品、饮料	123,638,729.58	3.38
C1	纺织、服装、皮毛	105,210,961.85	2.88
C2	木材、家具	18,510,773.91	0.51
C3	造纸、印刷	68,712,130.25	1.88
C4	石油、化学、塑胶、塑料	379,846,392.47	10.38
C5	电子	298,624,390.68	8.16
C6	金属、非金属	208,018,625.65	5.69
C7	机械、设备、仪表	566,466,343.29	15.48
C8	医药、生物制品	248,083,342.81	6.78
C99	其他制造业	43,815,034.98	1.20
D	电力、煤气及水的生产和供应业	139,665,398.43	3.82
E	建筑业	53,536,148.77	1.46
F	交通运输、仓储业	142,898,511.86	3.91
G	信息技术业	227,656,368.46	6.22

H	批发和零售贸易	264,074,809.61	7.22
I	金融、保险业	3,782,790.00	0.10
J	房地产业	141,960,883.02	3.88
K	社会服务业	91,036,859.82	2.49
L	传播与文化产业	57,041,259.28	1.56
M	综合类	164,011,178.77	4.48
	合计	3,474,189,896.70	94.95

8.3 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

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	占基金资产净值比例（%）
1	002073	软控股份	1,319,047	35,205,364.43	0.96
2	600252	中恒集团	775,956	27,507,640.20	0.75
3	002106	莱宝高科	381,047	25,244,363.75	0.69
4	000581	威孚高科	643,030	23,888,564.50	0.65
5	002008	大族激光	989,689	22,169,033.60	0.61
6	600499	科达机电	850,554	20,277,207.36	0.55
7	002123	荣信股份	358,164	17,012,790.00	0.46
8	600584	长电科技	1,515,841	16,795,518.28	0.46
9	600267	海正药业	429,775	16,537,742.00	0.45
10	002152	广电运通	303,974	16,530,106.12	0.45
11	600971	恒源煤电	311,599	16,190,684.04	0.44
12	600458	时代新材	250,674	15,998,014.68	0.44
13	002038	双鹭药业	269,732	15,914,188.00	0.43
14	002022	科华生物	874,704	15,727,177.92	0.43
15	600315	上海家化	423,524	15,725,446.12	0.43
16	600570	恒生电子	775,800	15,709,950.00	0.43
17	000400	许继电气	470,495	15,658,073.60	0.43
18	000541	佛山照明	936,950	15,544,000.50	0.42
19	600770	综艺股份	710,690	15,421,973.00	0.42
20	000759	武汉中百	1,210,028	15,149,550.56	0.41
21	000970	中科三环	541,193	15,142,580.14	0.41
22	000559	万向钱潮	1,086,389	15,046,487.65	0.41
23	600880	博瑞传播	765,927	14,996,850.66	0.41
24	600079	人福医药	586,585	14,946,185.80	0.41
25	600963	岳阳纸业	1,476,147	14,894,323.23	0.41
26	002092	中泰化学	1,025,558	14,798,801.94	0.40

27	000826	桑德环境	440,714	14,706,626.18	0.40
28	000762	西藏矿业	391,932	14,658,256.80	0.40
29	600330	天通股份	836,992	14,471,591.68	0.40
30	002056	横店东磁	365,019	14,330,645.94	0.39
31	000917	电广传媒	563,200	13,742,080.00	0.38
32	000926	福星股份	1,012,576	13,649,524.48	0.37
33	002230	科大讯飞	171,362	13,537,598.00	0.37
34	000540	中天城投	971,571	13,339,669.83	0.36
35	000503	海虹控股	1,064,736	13,245,315.84	0.36
36	000973	佛塑股份	870,684	13,243,103.64	0.36
37	600110	中科英华	1,635,128	13,179,131.68	0.36
38	600866	星湖科技	925,870	13,091,801.80	0.36
39	600765	中航重机	691,190	13,091,138.60	0.36
40	000877	天山股份	414,658	13,090,753.06	0.36
41	600651	飞乐音响	1,094,365	13,033,887.15	0.36
42	600498	烽火通信	314,032	12,988,363.52	0.35
43	600366	宁波韵升	492,228	12,802,850.28	0.35
44	600439	瑞贝卡	977,708	12,798,197.72	0.35
45	600884	杉杉股份	510,976	12,759,070.72	0.35
46	000963	华东医药	385,636	12,675,855.32	0.35
47	600511	国药股份	510,460	12,659,408.00	0.35
48	000735	罗牛山	1,563,838	12,635,811.04	0.35
49	002097	山河智能	747,055	12,513,171.25	0.34
50	600160	巨化股份	544,162	12,341,594.16	0.34
51	600522	中天科技	399,000	12,309,150.00	0.34
52	600298	安琪酵母	271,935	12,041,281.80	0.33
53	000636	风华高科	953,758	11,874,287.10	0.32
54	000829	天音控股	1,009,456	11,871,202.56	0.32
55	002065	东华软件	378,460	11,645,214.20	0.32
56	600720	祁连山	675,046	11,577,038.90	0.32
57	000939	凯迪电力	733,293	11,468,702.52	0.31
58	600750	江中药业	315,462	11,366,095.86	0.31
59	000066	长城电脑	1,175,936	11,347,782.40	0.31
60	600805	悦达投资	775,380	11,343,809.40	0.31
61	000930	丰原生化	1,370,885	11,323,510.10	0.31
62	600416	湘电股份	378,373	11,252,813.02	0.31
63	000998	隆平高科	344,732	11,227,921.24	0.31
64	600351	亚宝药业	1,124,680	11,134,332.00	0.30
65	002254	烟台氨纶	324,646	11,067,182.14	0.30

66	001696	宗申动力	1,088,530	11,048,579.50	0.30
67	002310	东方园林	80,056	11,046,927.44	0.30
68	600326	西藏天路	680,636	11,019,496.84	0.30
69	002241	歌尔声学	200,300	10,950,401.00	0.30
70	600198	大唐电信	546,035	10,718,667.05	0.29
71	000860	顺鑫农业	467,515	10,635,966.25	0.29
72	600531	豫光金铅	314,754	10,600,914.72	0.29
73	600138	中青旅	738,020	10,583,206.80	0.29
74	600653	申华控股	3,103,020	10,550,268.00	0.29
75	600872	中炬高新	1,415,460	10,446,094.80	0.29
76	600867	通化东宝	715,159	10,398,411.86	0.28
77	002069	獐子岛	241,200	10,335,420.00	0.28
78	600425	青松建化	510,356	10,334,709.00	0.28
79	600797	浙大网新	1,444,636	10,271,361.96	0.28
80	000550	江铃汽车	368,980	10,161,709.20	0.28
81	600289	亿阳信通	800,548	10,078,899.32	0.28
82	600707	彩虹股份	523,589	10,011,021.68	0.27
83	000522	白云山 A	583,439	9,988,475.68	0.27
84	600586	金晶科技	733,959	9,981,842.40	0.27
85	000501	鄂武商 A	540,762	9,944,613.18	0.27
86	000683	远兴能源	1,091,392	9,942,581.12	0.27
87	000417	合肥百货	511,386	9,920,888.40	0.27
88	600755	厦门国贸	1,273,248	9,918,601.92	0.27
89	600815	厦工股份	692,700	9,787,851.00	0.27
90	600467	好当家	675,477	9,760,642.65	0.27
91	600284	浦东建设	491,860	9,738,828.00	0.27
92	600468	百利电气	270,235	9,717,650.60	0.27
93	000962	东方钽业	379,981	9,689,515.50	0.26
94	000078	海王生物	811,534	9,681,600.62	0.26
95	600557	康缘药业	516,939	9,656,420.52	0.26
96	002129	中环股份	343,175	9,584,877.75	0.26
97	002161	远望谷	273,774	9,557,450.34	0.26
98	600064	南京高科	642,078	9,400,021.92	0.26
99	600261	浙江阳光	221,855	9,386,685.05	0.26
100	000816	江淮动力	1,202,540	9,343,735.80	0.26
101	000682	东方电子	1,738,000	9,263,540.00	0.25
102	600059	古越龙山	676,835	9,238,797.75	0.25
103	000887	中鼎股份	378,039	9,224,151.60	0.25
104	000510	金路集团	1,082,458	9,211,717.58	0.25

105	600141	兴发集团	454,579	9,118,854.74	0.25
106	600858	银座股份	359,365	9,088,340.85	0.25
107	000159	国际实业	598,400	9,059,776.00	0.25
108	000616	亿城股份	1,764,766	9,035,601.92	0.25
109	600888	新疆众和	375,350	9,027,167.50	0.25
110	600628	新世界	755,969	9,011,150.48	0.25
111	600580	卧龙电气	533,557	8,958,422.03	0.24
112	000997	新大陆	453,280	8,938,681.60	0.24
113	000823	超声电子	547,796	8,923,596.84	0.24
114	600702	沱牌曲酒	419,571	8,920,079.46	0.24
115	600060	海信电器	769,950	8,892,922.50	0.24
116	600978	宜华木业	1,433,664	8,888,716.80	0.24
117	600482	风帆股份	573,355	8,869,801.85	0.24
118	000886	海南高速	1,405,596	8,827,142.88	0.24
119	002064	华峰氨纶	787,182	8,824,310.22	0.24
120	600704	中大股份	546,262	8,811,206.06	0.24
121	600790	轻纺城	879,619	8,778,597.62	0.24
122	000972	新中基	599,550	8,753,430.00	0.24
123	600525	长园集团	383,530	8,748,319.30	0.24
124	600449	赛马实业	242,743	8,729,038.28	0.24
125	600594	益佰制药	438,755	8,647,861.05	0.24
126	600332	广州药业	417,540	8,638,902.60	0.24
127	000513	丽珠集团	195,893	8,584,031.26	0.23
128	000996	中国中期	326,913	8,558,582.34	0.23
129	000601	韶能股份	1,644,596	8,551,899.20	0.23
130	600038	哈飞股份	299,677	8,534,800.96	0.23
131	600158	中体产业	1,142,210	8,532,308.70	0.23
132	600295	鄂尔多斯	434,925	8,454,942.00	0.23
133	000627	天茂集团	1,683,578	8,434,725.78	0.23
134	600122	宏图高科	603,813	8,405,076.96	0.23
135	600961	株冶集团	468,604	8,397,383.68	0.23
136	600487	亨通光电	206,604	8,388,122.40	0.23
137	000987	广州友谊	318,877	8,364,143.71	0.23
138	000988	华工科技	434,574	8,361,203.76	0.23
139	000571	新大洲A	1,307,900	8,292,086.00	0.23
140	600877	中国嘉陵	854,808	8,265,993.36	0.23
141	600195	中牧股份	346,531	8,264,764.35	0.23
142	002041	登海种业	125,062	8,242,836.42	0.23
143	002048	宁波华翔	604,667	8,217,424.53	0.22

144	000028	一致药业	248,685	8,206,605.00	0.22
145	600637	广电信息	977,800	8,193,964.00	0.22
146	600171	上海贝岭	957,752	8,102,581.92	0.22
147	600673	东阳光铝	441,080	8,084,996.40	0.22
148	600993	马应龙	176,791	8,066,973.33	0.22
149	002078	太阳纸业	714,190	7,998,928.00	0.22
150	600410	华胜天成	448,481	7,996,416.23	0.22
151	600067	冠城大通	914,790	7,958,673.00	0.22
152	600761	安徽合力	444,020	7,943,517.80	0.22
153	600227	赤天化	1,350,976	7,876,190.08	0.22
154	600654	飞乐股份	1,341,611	7,794,759.91	0.21
155	000903	云内动力	442,866	7,794,441.60	0.21
156	600072	中船股份	425,040	7,765,480.80	0.21
157	600529	山东药玻	457,289	7,760,194.33	0.21
158	000301	东方市场	1,515,200	7,727,520.00	0.21
159	600581	八一钢铁	680,880	7,721,179.20	0.21
160	600308	华泰股份	806,800	7,704,940.00	0.21
161	600360	华微电子	741,468	7,703,852.52	0.21
162	600509	天富热电	699,061	7,682,680.39	0.21
163	000050	深天马 A	510,174	7,632,203.04	0.21
164	000786	北新建材	510,989	7,572,856.98	0.21
165	600139	西部资源	210,643	7,572,615.85	0.21
166	600747	大连控股	1,323,800	7,558,898.00	0.21
167	000006	深振业 A	1,081,455	7,537,741.35	0.21
168	000533	万家乐	736,439	7,526,406.58	0.21
169	000755	山西三维	583,640	7,505,610.40	0.21
170	600388	龙净环保	221,679	7,499,400.57	0.20
171	600622	嘉宝集团	731,063	7,449,531.97	0.20
172	000659	珠海中富	940,700	7,431,530.00	0.20
173	002237	恒邦股份	136,135	7,403,021.30	0.20
174	600086	东方金钰	312,262	7,397,486.78	0.20
175	600754	锦江股份	317,868	7,384,073.64	0.20
176	600255	鑫科材料	638,928	7,341,282.72	0.20
177	000726	鲁泰 A	784,900	7,323,117.00	0.20
178	000911	南宁糖业	305,620	7,289,037.00	0.20
179	600662	强生控股	1,011,910	7,285,752.00	0.20
180	600521	华海药业	478,522	7,254,393.52	0.20
181	002091	江苏国泰	266,553	7,250,241.60	0.20
182	600602	广电电子	937,686	7,220,182.20	0.20

183	600831	广电网络	700,790	7,218,137.00	0.20
184	601002	晋亿实业	524,852	7,216,715.00	0.20
185	000407	胜利股份	887,402	7,196,830.22	0.20
186	002121	科陆电子	234,994	7,155,567.30	0.20
187	600322	天房发展	1,571,682	7,119,719.46	0.19
188	600616	金枫酒业	545,618	7,093,034.00	0.19
189	600460	士兰微	308,562	7,062,984.18	0.19
190	002051	中工国际	180,685	7,057,556.10	0.19
191	000799	酒鬼酒	323,098	7,043,536.40	0.19
192	000410	沈阳机床	581,512	7,036,295.20	0.19
193	000426	富龙热电	405,797	7,020,288.10	0.19
194	002249	大洋电机	228,408	6,973,296.24	0.19
195	000698	沈阳化工	822,080	6,971,238.40	0.19
196	600479	千金药业	379,159	6,965,150.83	0.19
197	600117	西宁特钢	790,180	6,961,485.80	0.19
198	000936	华西村	797,450	6,953,764.00	0.19
199	600995	文山电力	595,172	6,939,705.52	0.19
200	600121	郑州煤电	558,968	6,931,203.20	0.19
201	600409	三友化工	834,320	6,891,483.20	0.19
202	600545	新疆城建	720,500	6,887,980.00	0.19
203	600288	大恒科技	543,281	6,850,773.41	0.19
204	000830	鲁西化工	1,115,405	6,848,586.70	0.19
205	600292	九龙电力	356,660	6,830,039.00	0.19
206	600851	海欣股份	1,049,340	6,810,216.60	0.19
207	000837	秦川发展	495,712	6,766,468.80	0.18
208	600496	精工钢构	412,556	6,765,918.40	0.18
209	000090	深天健	567,978	6,741,898.86	0.18
210	600590	泰豪科技	566,342	6,728,142.96	0.18
211	600327	大厦股份	556,205	6,668,897.95	0.18
212	000777	中核科技	189,218	6,649,120.52	0.18
213	000712	锦龙股份	378,882	6,611,490.90	0.18
214	600475	华光股份	272,927	6,520,226.03	0.18
215	002083	孚日股份	667,049	6,497,057.26	0.18
216	600723	西单商场	508,403	6,431,297.95	0.18
217	600480	凌云股份	385,597	6,420,190.05	0.18
218	600323	南海发展	385,304	6,349,809.92	0.17
219	600636	三爱富	431,913	6,336,163.71	0.17
220	600361	华联综超	603,024	6,325,721.76	0.17
221	000713	丰乐种业	318,609	6,298,899.93	0.17

222	600824	益民集团	910,370	6,290,656.70	0.17
223	600478	科力远	391,575	6,284,778.75	0.17
224	600363	联创光电	527,119	6,262,173.72	0.17
225	002266	浙富股份	132,928	6,247,616.00	0.17
226	600231	凌钢股份	714,331	6,221,823.01	0.17
227	600830	香溢融通	565,044	6,215,484.00	0.17
228	000525	红太阳	398,399	6,195,104.45	0.17
229	000099	中信海直	547,529	6,165,176.54	0.17
230	600523	贵航股份	256,576	6,137,297.92	0.17
231	000708	大冶特钢	399,289	6,133,079.04	0.17
232	600838	上海九百	712,294	6,125,728.40	0.17
233	600268	国电南自	225,725	6,112,633.00	0.17
234	600408	安泰集团	1,073,330	6,096,514.40	0.17
235	600339	天利高新	653,678	6,092,278.96	0.17
236	600197	伊力特	391,800	6,088,572.00	0.17
237	600710	常林股份	604,717	6,065,311.51	0.17
238	600061	中纺投资	457,452	6,061,239.00	0.17
239	000537	广宇发展	728,786	6,019,772.36	0.16
240	600553	太行水泥	472,660	6,002,782.00	0.16
241	000850	华茂股份	670,708	5,996,129.52	0.16
242	600507	方大特钢	924,344	5,971,262.24	0.16
243	002232	启明信息	259,301	5,961,329.99	0.16
244	600652	爱使股份	989,720	5,908,628.40	0.16
245	600787	中储股份	746,392	5,896,496.80	0.16
246	600106	重庆路桥	645,120	5,896,396.80	0.16
247	600127	金健米业	773,940	5,881,944.00	0.16
248	600420	现代制药	306,721	5,879,841.57	0.16
249	000554	泰山石油	683,458	5,877,738.80	0.16
250	600293	三峡新材	428,444	5,835,407.28	0.16
251	000861	海印股份	349,787	5,806,464.20	0.16
252	600069	银鸽投资	1,026,550	5,789,742.00	0.16
253	600202	哈空调	476,783	5,788,145.62	0.16
254	600075	新疆天业	467,580	5,774,613.00	0.16
255	600827	友谊股份	311,740	5,742,250.80	0.16
256	000608	阳光股份	799,520	5,732,558.40	0.16
257	600693	东百集团	487,920	5,728,180.80	0.16
258	600270	外运发展	643,600	5,702,296.00	0.16
259	002181	粤传媒	435,500	5,652,790.00	0.15
260	600644	乐山电力	406,105	5,628,615.30	0.15

261	600317	营口港	975,111	5,626,390.47	0.15
262	600533	栖霞建设	1,119,361	5,607,998.61	0.15
263	600438	通威股份	610,791	5,607,061.38	0.15
264	600855	航天长峰	415,928	5,590,072.32	0.15
265	600107	美尔雅	511,710	5,587,873.20	0.15
266	000931	中关村	839,377	5,581,857.05	0.15
267	600329	中新药业	383,320	5,577,306.00	0.15
268	600387	海越股份	548,853	5,576,346.48	0.15
269	600589	广东榕泰	641,456	5,555,008.96	0.15
270	000428	华天酒店	589,595	5,548,088.95	0.15
271	600563	法拉电子	199,941	5,498,377.50	0.15
272	600676	交运股份	779,742	5,497,181.10	0.15
273	600543	莫高股份	456,454	5,468,318.92	0.15
274	600896	中海海盛	826,322	5,461,988.42	0.15
275	002344	海宁皮城	99,486	5,459,791.68	0.15
276	002293	罗莱家纺	74,782	5,450,112.16	0.15
277	600078	澄星股份	694,561	5,445,358.24	0.15
278	600226	升华拜克	503,300	5,440,673.00	0.15
279	000416	民生投资	756,054	5,436,028.26	0.15
280	600103	青山纸业	1,509,400	5,433,840.00	0.15
281	000088	盐田港	884,900	5,424,437.00	0.15
282	600621	上海金陵	744,940	5,423,163.20	0.15
283	000016	深康佳 A	1,134,780	5,401,552.80	0.15
284	600020	中原高速	1,521,200	5,385,048.00	0.15
285	000511	银基发展	1,641,537	5,367,825.99	0.15
286	600281	太化股份	457,013	5,342,481.97	0.15
287	600291	西水股份	477,564	5,329,614.24	0.15
288	600260	凯乐科技	750,000	5,317,500.00	0.15
289	600398	凯诺科技	919,173	5,312,819.94	0.15
290	600874	创业环保	772,700	5,308,449.00	0.15
291	000875	吉电股份	1,192,800	5,296,032.00	0.14
292	600789	鲁抗医药	620,025	5,276,412.75	0.14
293	002179	中航光电	285,492	5,270,182.32	0.14
294	600641	万业企业	716,170	5,220,879.30	0.14
295	600780	通宝能源	930,680	5,211,808.00	0.14
296	600333	长春燃气	410,022	5,203,179.18	0.14
297	000572	海马股份	876,627	5,189,631.84	0.14
298	600725	云维股份	547,432	5,173,232.40	0.14
299	600777	新潮实业	889,048	5,156,478.40	0.14

300	600112	长征电气	451,382	5,150,268.62	0.14
301	600801	华新水泥	170,339	5,127,203.90	0.14
302	600240	华业地产	687,605	5,122,657.25	0.14
303	600488	天药股份	578,772	5,116,344.48	0.14
304	000584	友利控股	581,177	5,091,110.52	0.14
305	600328	兰太实业	382,900	5,084,912.00	0.14
306	600991	广汽长丰	361,133	5,081,141.31	0.14
307	000952	广济药业	447,240	5,080,646.40	0.14
308	600501	航天晨光	345,811	5,052,298.71	0.14
309	002252	上海莱士	144,944	5,020,860.16	0.14
310	002251	步步高	192,157	5,005,689.85	0.14
311	600686	金龙汽车	550,480	5,003,863.20	0.14
312	600864	哈投股份	582,520	5,003,846.80	0.14
313	000733	振华科技	445,431	4,997,735.82	0.14
314	000617	石油济柴	255,470	4,991,883.80	0.14
315	600836	界龙实业	445,708	4,933,987.56	0.13
316	600966	博汇纸业	627,558	4,932,605.88	0.13
317	002011	盾安环境	198,514	4,929,102.62	0.13
318	600249	两面针	639,700	4,925,690.00	0.13
319	600736	苏州高新	939,888	4,925,013.12	0.13
320	600555	九龙山	1,037,854	4,909,049.42	0.13
321	600826	兰生股份	249,107	4,889,970.41	0.13
322	000828	东莞控股	738,790	4,883,401.90	0.13
323	600082	海泰发展	918,440	4,876,916.40	0.13
324	000707	双环科技	659,750	4,875,552.50	0.13
325	000975	科学城	774,777	4,865,599.56	0.13
326	600423	柳化股份	496,742	4,858,136.76	0.13
327	000910	大亚科技	562,388	4,842,160.68	0.13
328	002315	焦点科技	62,673	4,822,687.35	0.13
329	000520	长航凤凰	959,095	4,814,656.90	0.13
330	600667	太极实业	583,120	4,810,740.00	0.13
331	600846	同济科技	777,052	4,802,181.36	0.13
332	600178	东安动力	410,490	4,794,523.20	0.13
333	000677	山东海龙	918,948	4,787,719.08	0.13
334	600337	美克股份	449,661	4,779,896.43	0.13
335	002292	奥飞动漫	136,415	4,771,796.70	0.13
336	000005	世纪星源	1,299,700	4,769,899.00	0.13
337	002311	海大集团	155,200	4,767,744.00	0.13
338	600844	丹化科技	311,736	4,729,035.12	0.13

339	600429	三元股份	629,000	4,723,790.00	0.13
340	000989	九芝堂	317,292	4,708,613.28	0.13
341	600683	京投银泰	658,108	4,698,891.12	0.13
342	600088	中视传媒	294,448	4,693,501.12	0.13
343	600983	合肥三洋	378,638	4,668,606.54	0.13
344	000731	四川美丰	710,468	4,660,670.08	0.13
345	002233	塔牌集团	284,299	4,619,858.75	0.13
346	002019	鑫富药业	274,186	4,603,582.94	0.13
347	600359	新农开发	285,212	4,554,835.64	0.12
348	600726	华电能源	1,363,410	4,553,789.40	0.12
349	600459	贵研铂业	119,156	4,551,759.20	0.12
350	002025	航天电器	351,860	4,542,512.60	0.12
351	000607	华智控股	693,315	4,541,213.25	0.12
352	000859	国风塑业	522,964	4,539,327.52	0.12
353	002308	威创股份	227,946	4,533,845.94	0.12
354	000532	力合股份	490,000	4,498,200.00	0.12
355	600640	中卫国脉	427,946	4,459,197.32	0.12
356	600129	太极集团	455,113	4,446,454.01	0.12
357	600565	迪马股份	895,530	4,441,828.80	0.12
358	000548	湖南投资	620,931	4,439,656.65	0.12
359	000990	诚志股份	316,620	4,432,680.00	0.12
360	002277	友阿股份	186,105	4,429,299.00	0.12
361	600190	锦州港	951,612	4,377,415.20	0.12
362	600630	龙头股份	528,416	4,370,000.32	0.12
363	600290	华仪电气	292,100	4,369,816.00	0.12
364	600163	福建南纸	897,300	4,360,878.00	0.12
365	000573	粤宏远 A	1,106,496	4,359,594.24	0.12
366	600063	皖维高新	457,804	4,335,403.88	0.12
367	002062	宏润建设	319,835	4,301,780.75	0.12
368	600829	三精制药	203,044	4,300,471.92	0.12
369	000748	长城信息	533,856	4,292,202.24	0.12
370	600624	复旦复华	490,660	4,283,461.80	0.12
371	600469	风神股份	399,719	4,280,990.49	0.12
372	002320	海峡股份	109,104	4,276,876.80	0.12
373	000514	渝开发	495,600	4,267,116.00	0.12
374	000158	常山股份	638,607	4,259,508.69	0.12
375	600639	浦东金桥	466,712	4,256,413.44	0.12
376	600744	华银电力	885,089	4,195,321.86	0.11
377	600682	南京新百	382,022	4,194,601.56	0.11

378	000737	南风化工	682,500	4,163,250.00	0.11
379	600491	龙元建设	336,747	4,162,192.92	0.11
380	000949	新乡化纤	680,011	4,141,266.99	0.11
381	000599	青岛双星	746,001	4,125,385.53	0.11
382	002194	武汉凡谷	296,322	4,118,875.80	0.11
383	002340	格林美	64,651	4,103,398.97	0.11
384	600806	昆明机床	415,931	4,101,079.66	0.11
385	600708	海博股份	544,100	4,080,750.00	0.11
386	000893	东凌粮油	157,800	4,080,708.00	0.11
387	000597	东北制药	237,240	4,066,293.60	0.11
388	002326	永太科技	71,121	4,053,897.00	0.11
389	600626	申达股份	588,968	4,022,651.44	0.11
390	002303	美盈森	95,335	3,996,443.20	0.11
391	000919	金陵药业	358,200	3,986,766.00	0.11
392	600128	弘业股份	350,760	3,981,126.00	0.11
393	600861	北京城乡	394,040	3,948,280.80	0.11
394	600054	黄山旅游	224,114	3,930,959.56	0.11
395	002281	光迅科技	85,310	3,914,875.90	0.11
396	600650	锦江投资	346,995	3,907,163.70	0.11
397	000687	保定天鹅	684,028	3,905,799.88	0.11
398	002191	劲嘉股份	342,236	3,894,645.68	0.11
399	600810	神马股份	392,908	3,893,718.28	0.11
400	600396	金山股份	423,673	3,893,554.87	0.11
401	600263	路桥建设	295,640	3,890,622.40	0.11
402	600120	浙江东方	449,120	3,880,396.80	0.11
403	002109	兴化股份	382,104	3,874,534.56	0.11
404	600074	中达股份	822,461	3,873,791.31	0.11
405	002238	天威视讯	142,372	3,872,518.40	0.11
406	600510	黑牡丹	424,017	3,862,794.87	0.11
407	600606	金丰投资	533,892	3,860,039.16	0.11
408	000594	国恒铁路	1,061,660	3,843,209.20	0.11
409	600530	交大昂立	332,620	3,838,434.80	0.10
410	600894	广钢股份	492,740	3,833,517.20	0.10
411	600287	江苏舜天	388,046	3,795,089.88	0.10
412	000563	陕国投 A	382,100	3,782,790.00	0.10
413	002267	陕天然气	180,721	3,782,490.53	0.10
414	000619	海螺型材	383,804	3,776,631.36	0.10
415	002218	拓日新能	153,500	3,773,030.00	0.10
416	600052	浙江广厦	774,528	3,771,951.36	0.10

417	600802	福建水泥	474,976	3,766,559.68	0.10
418	000938	紫光股份	256,330	3,765,487.70	0.10
419	000912	泸天化	519,696	3,762,599.04	0.10
420	600551	时代出版	224,681	3,752,172.70	0.10
421	000543	皖能电力	549,400	3,746,908.00	0.10
422	000767	漳泽电力	940,800	3,744,384.00	0.10
423	600073	上海梅林	316,648	3,688,949.20	0.10
424	000589	黔轮胎 A	316,336	3,682,151.04	0.10
425	600258	首旅股份	164,440	3,676,878.40	0.10
426	600012	皖通高速	621,321	3,672,007.11	0.10
427	002309	中利科技	128,105	3,670,208.25	0.10
428	600386	北巴传媒	358,222	3,668,193.28	0.10
429	600834	申通地铁	339,280	3,637,081.60	0.10
430	002332	仙琚制药	182,000	3,630,900.00	0.10
431	000925	众合机电	148,727	3,624,476.99	0.10
432	002285	世联地产	115,959	3,615,601.62	0.10
433	600056	中国医药	220,993	3,606,605.76	0.10
434	000679	大连友谊	253,324	3,604,800.52	0.10
435	002287	奇正藏药	144,306	3,588,890.22	0.10
436	600035	楚天高速	662,186	3,569,182.54	0.10
437	600776	东方通信	679,428	3,539,819.88	0.10
438	600973	宝胜股份	166,272	3,528,291.84	0.10
439	002183	怡亚通	296,398	3,515,280.28	0.10
440	600192	长城电工	364,322	3,497,491.20	0.10
441	002052	同洲电子	364,040	3,494,784.00	0.10
442	600168	武汉控股	391,880	3,487,732.00	0.10
443	600798	宁波海运	773,908	3,482,586.00	0.10
444	002088	鲁阳股份	207,828	3,433,318.56	0.09
445	000899	赣能股份	574,516	3,406,879.88	0.09
446	002172	澳洋科技	370,964	3,405,449.52	0.09
447	600759	正和股份	650,414	3,401,665.22	0.09
448	000040	深鸿基	667,550	3,377,803.00	0.09
449	600162	香江控股	682,179	3,376,786.05	0.09
450	600692	亚通股份	437,479	3,355,463.93	0.09
451	600578	京能热电	305,634	3,340,579.62	0.09
452	000609	绵世股份	370,764	3,322,045.44	0.09
453	000916	华北高速	774,700	3,284,728.00	0.09
454	000852	江钻股份	284,556	3,272,394.00	0.09
455	600987	航民股份	376,324	3,262,729.08	0.09

456	002276	万马电缆	213,216	3,249,411.84	0.09
457	600618	氯碱化工	399,716	3,245,693.92	0.09
458	002328	新朋股份	159,921	3,224,007.36	0.09
459	600897	厦门空港	211,644	3,200,057.28	0.09
460	601005	重庆钢铁	849,300	3,193,368.00	0.09
461	600399	抚顺特钢	462,018	3,164,823.30	0.09
462	600592	龙溪股份	266,500	3,155,360.00	0.09
463	600051	宁波联合	322,400	3,130,504.00	0.09
464	600665	天地源	639,759	3,115,626.33	0.09
465	601999	出版传媒	293,699	3,113,209.40	0.09
466	000429	粤高速 A	645,650	3,112,033.00	0.09
467	600230	沧州大化	230,360	3,096,038.40	0.08
468	002110	三钢闽光	284,999	3,083,689.18	0.08
469	002212	南洋股份	135,974	3,073,012.40	0.08
470	002306	湘鄂情	106,628	3,060,223.60	0.08
471	600981	江苏开元	458,555	3,058,561.85	0.08
472	000062	深圳华强	355,472	3,017,957.28	0.08
473	600191	华资实业	430,792	2,972,464.80	0.08
474	600743	华远地产	518,451	2,965,539.72	0.08
475	000042	深 长 城	170,234	2,953,559.90	0.08
476	600126	杭钢股份	596,242	2,897,736.12	0.08
477	002317	众生药业	63,975	2,874,396.75	0.08
478	600391	成发科技	116,689	2,855,379.83	0.08
479	002133	广宇集团	442,958	2,795,064.98	0.08
480	002322	理工监测	35,540	2,763,945.80	0.08
481	000905	厦门港务	377,400	2,713,506.00	0.07
482	000600	建投能源	486,981	2,649,176.64	0.07
483	000965	天保基建	246,078	2,642,877.72	0.07
484	002314	雅致股份	154,546	2,642,736.60	0.07
485	600278	东方创业	227,401	2,637,851.60	0.07
486	002258	利尔化学	143,889	2,604,390.90	0.07
487	000950	建峰化工	319,220	2,531,414.60	0.07
488	600548	深高速	509,300	2,521,035.00	0.07
489	600818	中路股份	153,786	2,449,810.98	0.07
490	000155	川化股份	334,000	2,331,320.00	0.06
491	000029	深深房 A	475,300	2,233,910.00	0.06
492	002345	潮宏基	64,000	2,225,920.00	0.06
493	002274	华昌化工	185,799	2,166,416.34	0.06
494	002225	濮耐股份	199,634	2,090,167.98	0.06

495	000882	华联股份	263,200	1,887,144.00	0.05
496	600623	双钱股份	100,350	1,690,897.50	0.05
497	002107	沃华医药	116,574	1,609,886.94	0.04
498	002342	巨力索具	85,300	1,559,284.00	0.04
499	002305	南国置业	85,300	994,598.00	0.03

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	601607	上海医药	37,199,667.43	1.1
2	002073	软控股份	26,050,067.37	0.77
3	600425	青松建化	23,933,400.13	0.71
4	600252	中恒集团	20,653,479.36	0.61
5	000559	万向钱潮	19,272,433.82	0.57
6	600584	长电科技	19,180,862.22	0.57
7	600570	恒生电子	19,080,414.81	0.56
8	600511	国药股份	17,897,086.68	0.53
9	600499	科达机电	17,875,005.08	0.53
10	002022	科华生物	17,578,238.99	0.52
11	000759	武汉中百	17,575,613.11	0.52
12	002038	双鹭药业	16,718,925.92	0.49
13	002092	中泰化学	16,351,944.67	0.48
14	002152	广电运通	16,036,898.74	0.47
15	600880	博瑞传播	15,809,565.89	0.47
16	000400	许继电气	15,294,236.26	0.45
17	600963	岳阳纸业	15,115,614.31	0.45
18	000917	电广传媒	15,113,999.67	0.45
19	600060	海信电器	15,083,646.20	0.44
20	600406	国电南瑞	14,976,779.82	0.44

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	600755	厦门国贸	48,478,698.90	1.43
2	601607	上海医药	38,700,333.02	1.14
3	600406	国电南瑞	37,073,383.82	1.09
4	002073	软控股份	26,354,260.22	0.78
5	600425	青松建化	22,525,449.71	0.66
6	600703	三安光电	22,083,645.62	0.65
7	600584	长电科技	20,918,189.38	0.62
8	600481	双良节能	20,193,302.40	0.60
9	600499	科达机电	19,028,346.65	0.56
10	600729	重庆百货	18,999,593.99	0.56
11	002022	科华生物	17,979,308.35	0.53
12	002092	中泰化学	16,816,274.64	0.50
13	000829	天音控股	16,667,530.43	0.49
14	600315	上海家化	16,458,080.47	0.49
15	000759	武汉中百	16,360,172.92	0.48
16	000400	许继电气	16,177,430.21	0.48
17	000541	佛山照明	16,142,909.07	0.48
18	600880	博瑞传播	16,129,512.50	0.48
19	600110	中科英华	15,942,416.44	0.47
20	600546	山煤国际	15,644,050.43	0.46

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	3,597,543,998.62
卖出股票收入（成交）总额	3,816,267,375.89

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	717,981.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	40,735.14
5	应收申购款	10,686,452.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,445,169.18

8.9.4 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。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：期末前十名股票中不存在流通受限情况

§ 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

持有人户数	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	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
241,397	12,312.87	311,005,009.40	10.46%	2,661,284,423.43	89.54%

9.2 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	姜山	10,131,043.00	6.49%
2	中意人寿保险有限公司一分红一团体年金债券基金账户	8,500,600.00	5.44%
3	中意人寿保险有限公司	8,494,900.00	5.44%
4	朝恒房地产（深圳）有限公司	8,000,000.00	5.12%
5	周茂永	4,600,000.00	2.95%
6	安信证券股份有限公司	3,939,696.00	2.52%
7	壮丽	1,526,961.00	0.98%
8	黄作森	1,500,000.00	0.96%
9	项志英	1,500,000.00	0.96%
10	闫明江	1,500,000.00	0.96%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	2,214,863.56	0.0745%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

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	2,882,661,867.84
本报告期基金总申购份额	6,367,804,733.77
减：本报告期基金总赎回份额	6,278,177,168.78
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,972,289,432.83

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

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

本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门在本报告期内没有发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

2009 年 6 月 18 日，中国国际经济贸易仲裁委员会向我公司送达通知，南方稳健成长贰号证券投资基金的基金份额持有人袁近秋就该基金 2007 年度的基金分红问题，对我公司提出了仲裁申请，要求本公司赔偿其红利损失及相应利息共计 66586.52 元，退还管理费 2041.49 元，争议标的总额为人民币 68628.01 元。

2010 年 3 月 26 日，中国国际经济贸易仲裁委员会向我公司送达（2010）中国贸仲京裁字第 0152 号《裁决书》，驳回申请人袁近秋的赔偿请求，具体裁决如下：（一）被申请人应向南方稳健成长贰号证券投资基金退还管理费计人民币 702.71 元。（二）本案仲裁费为人民币 5011 元，由申请人承担人民币 1002.20 元，由被申请人承担人民币 4008.80 元。（三）驳回申请人的其他仲裁请求。

2010 年 10 月 28 日，北京市第一中级人民法院向我公司送达通知，袁近秋向该院申请撤销中国国际经济贸易仲裁委员会于 2010 年 3 月 25 日作出的（2010）中国贸仲京裁字第 0152 号仲裁裁决。

2010 年 12 月 7 日，经审理，北京市第一中级人民法院向我公司送达（2010）一中民特字第 16746 号《民事裁定书》，具体裁定如下：

驳回袁近秋提出的撤销中国国际经济贸易仲裁委员会作出的（2010）中国贸仲京裁字第 0152 号仲裁裁决的申请。

案件受理费四百元，由袁近秋负担。

本裁定为终审裁定。

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

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费用 102,000.00 元, 该审计机构已提供审计服务的连续年限为 2 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、基金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	
东方证券	1	2,264,538,835.42	28.82%	1,924,867.82	29.37%	-
华泰证券	1	1,703,148,092.83	21.67%	1,383,827.33	21.12%	-
招商证券	1	1,663,864,878.90	21.17%	1,351,880.40	20.63%	-
国泰君安	1	1,259,753,006.71	16.03%	1,070,791.13	16.34%	-
瑞银证券	1	966,586,845.85	12.30%	821,600.29	12.54%	-

注: 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

- 公司经营行为规范, 财务状况和经营状况良好;
- 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;
- 公司内部管理规范, 能满足基金操作的保密要求;
- 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交易单元:

- 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;
- 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;
- 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

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	396,360.00	37.31%	-	-	-	-
招商证券	666,094.80	62.69%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	• 南方基金关于开展工行卡网上直销费率阶段性优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年12月31日
2	• 南方基金关于旗下部分基金参加邮储银行个人网上基金前端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年12月30日
3	• 南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行基金定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年12月30日
4	• 南方基金关于旗下部分基金在交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年12月30日
5	• 南方基金关于旗下部分基金参加深圳发展银行网上银行与定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年12月30日
6	• 南方基金关于旗下部分基金参加浙商银行网上银行与定投申购	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年12月30日

	费率优惠活动的公告		
7	• 南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加上海农村商业银行作为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 12 月 24 日
8	• 南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加华夏银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 12 月 1 日
9	• 南方基金管理有限公司关于开通汇付天天盈网上直销交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 11 月 30 日
10	• 南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 11 月 3 日
11	• 南方基金管理有限公司关于自有资金投资的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 10 月 19 日
12	• 南方基金关于旗下部分基金参加东莞银行网上交易和基金定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 9 月 20 日
13	• 关于开展工行卡网上直销申购费率阶段性优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 8 月 26 日
14	• 南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加中山证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 8 月 18 日
15	• 南方基金关于旗下部分基金参加邮储银行个人网上申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 7 月 1 日
16	• 南方基金关于旗下部分基金参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 6 月 30 日

17	• 关于旗下部分开放式基金变更基金份额净值计算位数的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 6 月 30 日
18	• 关于开通交通银行卡网上直销交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 6 月 10 日
19	• 关于开通工商银行卡网上直销交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 6 月 10 日
20	• 关于旗下部分基金在信达证券推出基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 6 月 9 日
21	• 关于旗下部分基金在申银万国推出基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 6 月 7 日
22	• 关于旗下部分基金参加中信银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 6 月 1 日
23	• 关于增加江苏张家港农村商业银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 5 月 20 日
24	• 关于公司旗下基金持有停牌股票恢复使用收盘价估值的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 5 月 8 日
25	• 关于公司旗下基金持有停牌股票恢复使用收盘价估值的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 5 月 6 日
26	• 南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加代销机构及开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 5 月 6 日
27	• 南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 5 月 4 日

28	• 南方基金关于旗下基金参与深圳发展银行开展的基金定投及申购费率优惠推广活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 5 月 4 日
29	• 关于调整网上直销交易定投申购金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 4 月 20 日
30	• 关于基金对账单邮寄服务规则调整的说明	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 4 月 14 日
31	• 关于旗下部分开放式证券投资基金增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 4 月 9 日
32	• 关于调整旗下基金在上海浦东发展银行定期定额投资起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 4 月 9 日
33	• 关于旗下基金在中国工商银行开展个人网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 4 月 1 日
34	• 关于旗下部分开放式证券投资基金增加浙商银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 3 月 10 日
35	• 南方基金管理有限公司北京分公司搬迁公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 3 月 9 日
36	• 南方基金关于网上交易开通定期不定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 2 月 9 日
37	• 南方基金关于网上交易开通定期定额转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 2 月 9 日
38	• 南方基金关于网上交易开通兴业银行卡定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 2 月 9 日
39	• 关于旗下部分开放式证券投资基金增加华融证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 2 月 4 日

40	• 关于旗下部分开放式证券投资基金增加广发华福证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 2 月 4 日
41	• 关于旗下部分开放式证券投资基金增加华融证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 1 月 25 日
42	• 关于南方中证 500 指数基金在中国工商银行开通基金定投业务并参加定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 1 月 25 日
43	• 关于旗下部分基金在交通银行网上银行基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 1 月 4 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证 500 指数证券投资基金的文件。
- 2、南方中证 500 指数证券投资基金基金合同。
- 3、南方中证 500 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。

13.2 存放地点

深圳市福田区福华一路 6 号免税商务大厦 31-33 楼

13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>