

南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2011 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
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.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	45
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	45
7.9 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	47

§9 开放式基金份额变动	47
§10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息	52
§12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)
基金简称	南方中证 500 指数 (LOF); 场内简称: 南方 500
基金主代码	160119
前端交易代码	160119
后端交易代码	160120
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2009 年 9 月 25 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
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	3,631,084,012.69 份
基金合同存续期	不定期

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数量化的风险管理手段, 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		深圳市福田区福华一路六号	北京市东城区建国门内大街

	免税商务大厦塔楼 31、32、33 层 整层	69 号
办公地址	深圳市福田区福华一路六号 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(2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	93,927,212.88
本期利润	-274,488,108.90
加权平均基金份额本期利润	-0.0843
本期加权平均净值利润率	-7.00%
本期基金份额净值增长率	-7.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	521,371,799.70
期末可供分配基金份额利润	0.1436
期末基金资产净值	4,152,455,812.39
期末基金份额净值	1.1436
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	19.52%

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。

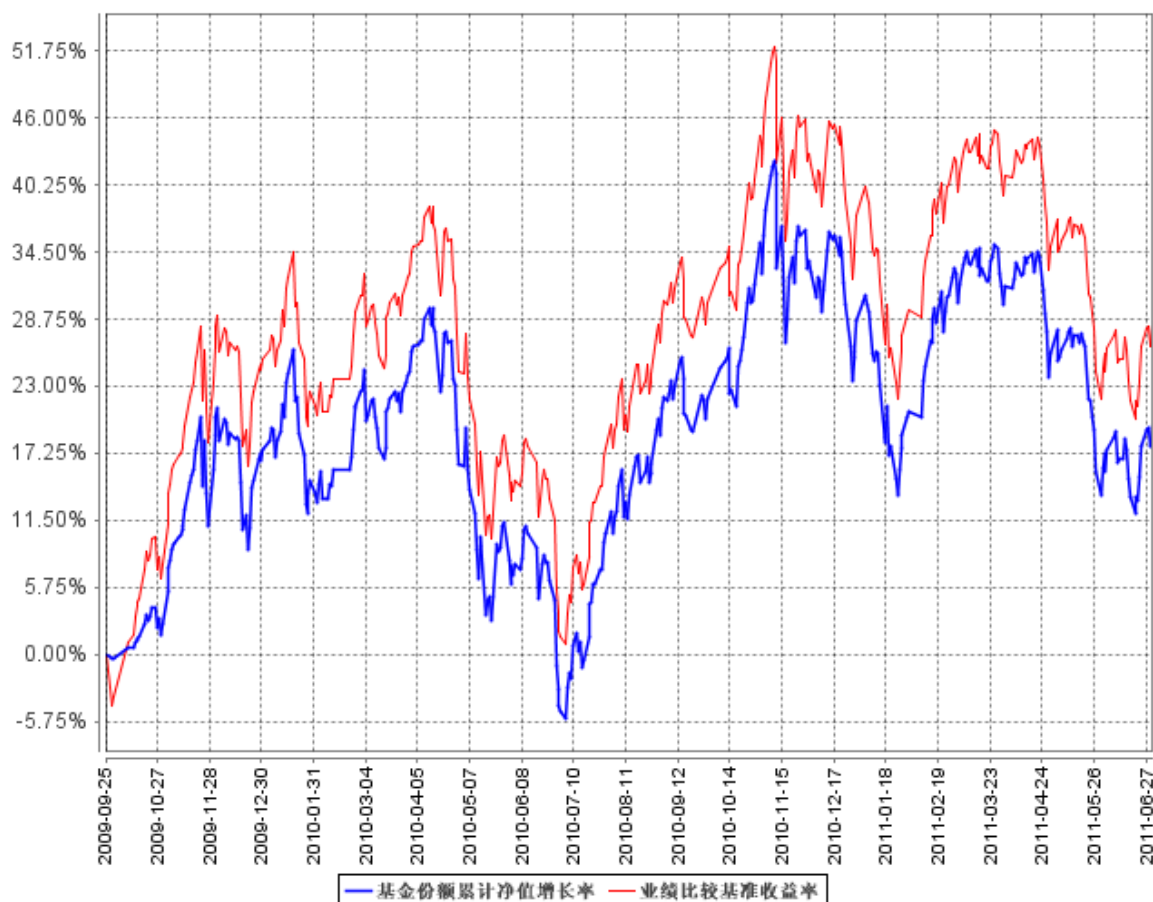
3.2 基金净值表现

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	2.96%	1.37%	2.90%	1.37%	0.06%	0.00%
过去三个月	-8.03%	1.34%	-7.99%	1.34%	-0.04%	0.00%
过去六个月	-7.10%	1.38%	-6.83%	1.38%	-0.27%	0.00%
过去一年	23.10%	1.53%	23.79%	1.53%	-0.69%	0.00%
自基金合同生效起至今	19.52%	1.62%	28.25%	1.66%	-8.73%	-0.04%

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



§ 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,公司管理资产规模近 1,900 亿元,管理 2 只封闭式基金——基金开元、基金天元;27 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)、南方优选成长混合型基金、南方中证 50 债券指数基金和南方保本混合型基金; 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	-	5	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产业主题基金基金经理助理, 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。
潘海宁	本基金的基金经理	2011 年 2 月 17 日	-	10	会计学学士, 具有基金从业资格。曾先后任职于兴业证券股份有限公司、富国基金管理有限公司。2003 年 3 月加入南方基金, 历任行业研究员、基金开元经理助理、投资部总监助理等职务。2009 年 3 月至今, 任南方 300 指数基金经理; 2009 年 12 月至今, 任南方深成 ETF 及联接基金基金经理; 2011 年 2 月至今, 任南方 500 基金经理。
罗文杰	本基金的基金经理助理	2011 年 2 月 28 日	-	7	美国加州大学计算机专业和金融数学专业双硕士。曾任职于美国 Open Link Financial 公司、美国摩根斯坦利公司, 参与利率及衍生品定价模型的相关工作。2008 年加盟南方基金, 现任量化投资部金融工程研究员; 2011 年 2 月至今, 任南方小康及小康 ETF、

					南方 300、南方 500、深成 ETF 及南方深成基金经理助理。
--	--	--	--	--	-----------------------------------

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，“离职日期”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

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》和《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则, 并严格按照《南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的各项规定, 本着诚实守信、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, 为基金持有人谋求与标的指数相近的收益。本报告期内, 基金运作整体合法合规, 无损害基金持有人利益的行为。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

2011 年上半年, 政府为应对通胀压力而持续实施紧缩政策, 市场整体呈现震荡回落格局, 报告期内中证 500 指数涨幅为-7.24%。

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“上海家化”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;

③6月30日前后, 我们根据指数半年度成份股调整进行了基金调仓, 事前我们制定了详细的调仓方案, 在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生, 从实施结果来看, 效果良好, 跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自本基金建仓完成至报告期末年化跟踪误差为 0.376%, 今年初至报告期末年化跟踪误差为 0.249%, 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, 并保持业内同类领先。

截至报告期末, 本基金份额净值为 1.1436 元, 报告期内, 份额净值增长率为-7.10%, 同期业绩基准增长率为-6.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在宏观调控持续的背景下, 今年上半年我国经济呈现增速回落、通胀居高不下的格局, 但从各项经济指标来看, 经济增速回落是宏观政策主动调控的结果, 并不是经济本身出现了问题, 因此经济增长出现“硬着陆”的可能性不大。而当前的通胀应是强弩之末, 流动性的持续收缩和经济的回落将会导致通胀回落, 现阶段正处于从经济回落向通胀回落传导的时滞期内。当前经济回落导致“去库存”压力增加, 但盈利增速回落有限, 去库存的时间和力度决定了盈利预期的变化。从时间上看, 三季度应是去库存的时间, 而力度会低于以往, 这是因为需求下降幅度偏小、库存压力主要体现在地产, 剔除房地产的库存量并不大, 其次流通环节的库存压力较小。

下半年股市流动性将逐渐趋于好转: 首先是通胀见顶回落, 实体经济对资金的需求将趋弱, 股市流动性压力减轻; 然后是随着通胀回落过程持续一段时间后, 货币政策逐步放松, 流动性进一步从被动性缓解到主动性宽松。一般来说, 市场在见底过程中, 往往是伴随着流动性的放松, 估值先见底回升。在市场见底回升的初期, 盈利预期和经济增长可能还是在继续下降的, 随着流动性放松一段时间后, 经济和盈利预期才会再次回升。市场底往往先于经济底, 经济底往往先于盈利底。因此, 我们认为随着通胀回落, 政策将会逐步松动, 市场有望筑底回升。

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，根据本基金每日持续来自定投的申购量来看，众多投资者已经把“南方 500”基金作为长期的重点定投对象。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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

§ 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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日基金的投资运作, 进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督, 认真履行了托管人的义务, 没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为, 南方基金管理有限公司在南方中证 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 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为, 南方基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定, 基金管理人所编制和披露的南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 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: 南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2011 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.3.1	214,798,003.76	187,051,646.55
结算备付金		2,833,381.20	2,444,946.61
存出保证金		1,357,880.51	717,981.47
交易性金融资产	6.4.3.2	3,944,355,562.55	3,474,189,896.70
其中: 股票投资		3,944,355,562.55	3,474,189,896.70

基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		10,316,426.20	-
应收利息	6.4.3.3	39,785.24	40,735.14
应收股利		317,433.85	-
应收申购款		28,359,870.20	10,686,452.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.4	-	-
资产总计		4,202,378,343.51	3,675,131,659.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		37,774,519.28	8,814,509.31
应付赎回款		5,553,958.19	2,820,991.50
应付管理人报酬		1,959,498.67	1,840,818.45
应付托管费		391,899.74	368,163.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.5	2,910,286.64	1,449,688.64
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	1,332,368.60	902,676.54
负债合计		49,922,531.12	16,196,848.12
所有者权益:			
实收基金	6.4.3.7	3,631,084,012.69	2,972,289,432.83
未分配利润	6.4.3.8	521,371,799.70	686,645,378.09
所有者权益合计		4,152,455,812.39	3,658,934,810.92
负债和所有者权益总计		4,202,378,343.51	3,675,131,659.04

注:报告截止日 2011 年 6 月 30 日, 基金份额净值 1.1436 元, 基金份额总额 3,631,084,012.69 份。

6.2 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: 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		-254,940,859.37	-660,573,117.42
1. 利息收入		743,388.18	857,972.74
其中：存款利息收入	6.4.3.9	743,175.67	857,711.75
债券利息收入		212.51	260.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		111,161,357.25	166,800,179.05
其中：股票投资收益	6.4.3.10	96,554,236.32	154,087,253.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	126,559.19	45,633.81
资产支持证券投资		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.3.12	14,480,561.74	12,667,291.69
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.13	-368,415,321.78	-833,114,928.67
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.14	1,569,716.98	4,883,659.46
减：二、费用		19,547,249.53	21,699,457.65
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	11,621,225.53	11,522,285.53
2. 托管费	6.4.6.2.2	2,324,245.12	2,304,457.11
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.15	4,966,688.11	7,229,235.03
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.16	635,090.77	643,479.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-274,488,108.90	-682,272,575.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-274,488,108.90	-682,272,575.07

6.3 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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,972,289,432.83	686,645,378.09	3,658,934,810.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-274,488,108.90	-274,488,108.90
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)	658,794,579.86	109,214,530.51	768,009,110.37
其中：1. 基金申购款	1,755,098,419.12	362,232,053.53	2,117,330,472.65
2. 基金赎回款	-1,096,303,839.26	-253,017,523.02	-1,349,321,362.28
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)	3,631,084,012.69	521,371,799.70	4,152,455,812.39
	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日		
项目	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)	-	-682,272,575.07	-682,272,575.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,027,588,984.70	68,761,295.11	1,096,350,279.81
其中：1. 基金申购款	4,249,771,705.03	753,397,651.33	5,003,169,356.36
2. 基金赎回款	-3,222,182,720.33	-684,636,356.22	-3,906,819,076.55
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)	3,910,250,852.54	-276,751,638.92	3,633,499,213.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

<u>高良玉</u>	<u>鲍文革</u>	<u>鲍文革</u>
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本报告期无会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
活期存款	214,798,003.76
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	
合计：	214,798,003.76

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,891,175,159.23	3,944,355,562.55	53,180,403.32
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	3,891,175,159.23	3,944,355,562.55	53,180,403.32

6.4.3.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	38,637.74
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,147.50
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	39,785.24

6.4.3.4 其他资产

无余额。

6.4.3.5 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,910,286.64
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,910,286.64

6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	27,821.09
预提费用	804,547.51

合计	1,332,368.60
----	--------------

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	2,972,289,432.83	2,972,289,432.83
本期申购	1,755,098,419.12	1,755,098,419.12
本期赎回(以“-”号填列)	-1,096,303,839.26	-1,096,303,839.26
本期末	3,631,084,012.69	3,631,084,012.69

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.3.8 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	433,775,707.02	252,869,671.07	686,645,378.09
本期利润	93,927,212.88	-368,415,321.78	-274,488,108.90
本期基金份额交易产生的变动数	110,318,279.79	-1,103,749.28	109,214,530.51
其中：基金申购款	290,907,430.61	71,324,622.92	362,232,053.53
基金赎回款	-180,589,150.82	-72,428,372.20	-253,017,523.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	638,021,199.69	-116,649,399.99	521,371,799.70

6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	19,454.03
其他	8,530.99
合计	743,175.67

6.4.3.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,383,429,817.28
减: 卖出股票成本总额	1,286,875,580.96
买卖股票差价收入	96,554,236.32

6.4.3.11 债券投资收益

单位: 人民币元

项目	本期
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
卖出债券 (债转股及债券到期兑付) 成交总额	860,471.70
减: 卖出债券 (债转股及债券到期兑付) 成本总额	733,700.00
减: 应收利息总额	212.51
债券投资收益	126,559.19

6.4.3.12 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	14,480,561.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	14,480,561.74

6.4.3.13 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-368,415,321.78
—— 股票投资	-368,415,321.78
—— 债券投资	-
—— 资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
—— 权证投资	-
3. 其他	-
合计	-368,415,321.78

6.4.3.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,569,716.98
合计	1,569,716.98

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。

6.4.3.15 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	4,966,688.11
银行间市场交易费用	-
合计	4,966,688.11

6.4.3.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
审计费用	54,052.03
信息披露费	148,767.52
上市费	29,752.78
银行汇划费	15,094.25
账户维护费	50.00
指数使用费	387,374.19
合计	635,090.77

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2011 年 7 月 27 日宣告分红，向截至 2011 年 8 月 2 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.20 元。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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无。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金公司”)	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

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
华泰证券	447,082,586.14	12.78%	1,058,033,279.65	21.01%

6.4.6.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券	363,260.67	12.48%	363,260.67	12.48%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券	859,664.50	20.18%	859,664.50	22.87%

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。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,621,225.53	11,522,285.53
其中：支付销售机构的客户维护费	2,792,322.55	2,473,191.10

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.6\% / \text{当年天数}。$$

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,324,245.12	2,304,457.11

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.12\% / \text{当年天数}$$

6.4.6.3 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		上年度可比期间	
	2011年1月1日至2011年6月30日		2010年1月1日至2010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	214,798,003.76	743,175.67	201,642,433.45	814,746.48

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。

6.4.6.4 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金的基金管理人于资产负债表日后，报告批准报出日前宣告的利润分配情况，请参见附注 6.4.4.2 资产负债表日后事项。

6.4.8 期末（2011 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.1 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	2010 年 12 月 3 日	重大事项 停牌	36.88	-	-	423,524	12,259,996.69	15,619,565.12	-
000759	中百集团	2011 年 4 月 13 日	重大事项 停牌	12.32	-	-	1,245,997	14,308,844.59	15,350,683.04	-
000917	电广传媒	2010 年 12 月 24 日	重大事项 停牌	24.40	2011 年 7 月 6 日	26.84	563,200	9,715,279.31	13,742,080.00	-
600021	上海电力	2011 年 5 月 30 日	重大事项 停牌	5.76	2011 年 7 月 28 日	6.34	1,265,280	5,291,004.42	7,288,012.80	-
000767	漳泽电力	2011 年 6 月 3 日	重大事项 停牌	5.56	-	-	1,063,940	4,457,494.97	5,915,506.40	-
000005	世纪星源	2011 年 4 月 29 日	重大事项 停牌	3.86	-	-	1,350,681	6,277,734.31	5,213,628.66	-
600328	兰太实业	2011 年 6 月 21 日	重大事项 停牌	11.30	2011 年 7 月 6 日	12.43	445,807	4,858,324.89	5,037,619.10	-
000563	陕国投 A	2011 年 6 月 27 日	重大事项 停牌	11.10	2011 年 7 月 12 日	12.21	441,091	5,035,927.31	4,896,110.10	-
002276	万马电缆	2011 年 6 月 8 日	重大事项 停牌	13.53	2011 年 7 月 1 日	13.08	322,386	4,648,128.23	4,361,882.58	-
000975	科学城	2011 年 3 月 18 日	重大事项 停牌	9.17	2011 年 7 月 21 日	10.00	804,916	5,569,171.42	7,381,079.72	-
000950	建峰化工	2011 年 2 月 18 日	重大事项 停牌	7.78	-	-	425,284	4,135,369.19	3,308,709.52	-

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 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，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.9.2 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 2011 年 06 月 30 日, 本基金未持有信用类债券。

6.4.9.3 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 6.4.8 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约约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 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及结算备付金等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	214,798,003.76	-	-	-	214,798,003.76
结算备付金	2,833,381.20	-	-	-	2,833,381.20
存出保证金	-	-	-	1,357,880.51	1,357,880.51
交易性金融资产	-	-	-	3,944,355,562.55	3,944,355,562.55
应收证券清算款	-	-	-	10,316,426.20	10,316,426.20
应收利息	-	-	-	39,785.24	39,785.24
应收股利	-	-	-	317,433.85	317,433.85
应收申购款	-	-	-	28,359,870.20	28,359,870.20
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	217,631,384.96	-	-	3,984,746,958.55	4,202,378,343.51
负债					
应付证券清算款	-	-	-	37,774,519.28	37,774,519.28
应付赎回款	-	-	-	5,553,958.19	5,553,958.19
应付管理人报酬	-	-	-	1,959,498.67	1,959,498.67
应付托管费	-	-	-	391,899.74	391,899.74
应付交易费用	-	-	-	2,910,286.64	2,910,286.64
其他负债	-	-	-	1,332,368.60	1,332,368.60
负债总计	-	-	-	49,922,531.12	49,922,531.12
利率敏感度缺口	217,631,384.96	-	-	3,934,824,427.43	4,152,455,812.39
上年度末 2010年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	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

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。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.9.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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。

6.4.9.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日		上年度末 2010 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	3,944,355,562.55	94.99	3,474,189,896.70	94.95
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,944,355,562.55	94.99	3,474,189,896.70	94.95

6.4.9.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

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: 人民币元)	
		本期末 (2011 年 6 月 30 日)	上年度末 (2010 年 12 月 31 日)
	中证 500 指数上升 5%	20,762	18,115
中证 500 指数下降 5%	20,762	18,115	

6.4.10 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

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	3,944,355,562.55	93.86
	其中：股票	3,944,355,562.55	93.86
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	217,631,384.96	5.18
6	其他各项资产	40,391,396.00	0.96
7	合计	4,202,378,343.51	100.00

7.2 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	57,882,196.63	1.39
B	采掘业	92,942,953.11	2.24
C	制造业	2,328,793,586.24	56.08
C0	食品、饮料	170,267,664.62	4.10
C1	纺织、服装、皮毛	91,208,845.56	2.20
C2	木材、家具	25,241,682.69	0.61
C3	造纸、印刷	84,262,844.43	2.03
C4	石油、化学、塑胶、塑料	480,951,622.29	11.58
C5	电子	269,242,500.71	6.48
C6	金属、非金属	335,424,793.30	8.08
C7	机械、设备、仪表	606,951,817.45	14.62
C8	医药、生物制品	247,341,711.07	5.96
C99	其他制造业	17,900,104.12	0.43
D	电力、煤气及水的生产和供应业	140,854,895.84	3.39
E	建筑业	92,843,720.64	2.24
F	交通运输、仓储业	143,635,765.48	3.46
G	信息技术业	227,927,725.68	5.49
H	批发和零售贸易	302,870,045.67	7.29
I	金融、保险业	34,654,889.10	0.83
J	房地产业	279,687,420.19	6.74
K	社会服务业	128,519,315.06	3.10
L	传播与文化产业	55,436,574.57	1.34
M	综合类	58,306,474.34	1.40
	合计	3,944,355,562.55	94.99

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

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	000581	威孚高科	726,434	28,004,030.70	0.67
2	600160	巨化股份	796,599	25,857,603.54	0.62
3	002008	大族激光	1,671,727	20,863,152.96	0.50
4	000400	许继电气	605,448	18,653,852.88	0.45
5	002123	荣信股份	806,750	18,377,765.00	0.44
6	000540	中天城投	1,096,634	18,269,922.44	0.44
7	600259	广晟有色	249,500	18,193,540.00	0.44
8	600311	荣华实业	1,331,729	17,965,024.21	0.43
9	600079	人福医药	789,820	17,423,429.20	0.42
10	002038	双鹭药业	456,997	17,251,636.75	0.42
11	600643	爱建股份	1,641,518	17,235,939.00	0.42
12	600805	悦达投资	1,134,960	17,024,400.00	0.41
13	000939	凯迪电力	1,321,234	16,964,644.56	0.41
14	000970	中科三环	812,468	16,809,962.92	0.40
15	600770	综艺股份	884,074	16,726,680.08	0.40
16	000877	天山股份	466,897	16,593,519.38	0.40
17	600601	方正科技	4,391,600	15,721,928.00	0.38
18	600315	上海家化	423,524	15,619,565.12	0.38
19	600499	科达机电	971,764	15,557,941.64	0.37
20	000759	中百集团	1,245,997	15,350,683.04	0.37
21	600072	中船股份	574,334	14,932,684.00	0.36
22	600570	恒生电子	998,389	14,816,092.76	0.36
23	600110	中科英华	2,301,627	14,776,445.34	0.36
24	000762	西藏矿业	444,405	14,745,357.90	0.36
25	600325	华发股份	1,307,800	14,673,516.00	0.35
26	000541	佛山照明	1,055,140	14,307,698.40	0.34
27	600584	长电科技	1,706,987	14,099,712.62	0.34
28	600586	金晶科技	1,707,950	14,073,508.00	0.34
29	000636	风华高科	1,342,511	14,042,665.06	0.34
30	600060	海信电器	1,040,422	13,962,463.24	0.34
31	600458	时代新材	724,627	13,941,823.48	0.34
32	600720	祁连山	760,173	13,865,555.52	0.33
33	600210	紫江企业	2,299,700	13,798,200.00	0.33
34	600747	大连控股	1,703,647	13,782,504.23	0.33

35	000917	电广传媒	563,200	13,742,080.00	0.33
36	000926	福星股份	1,140,287	13,649,235.39	0.33
37	000816	江淮动力	1,742,779	13,628,531.78	0.33
38	000503	海虹控股	1,438,754	13,178,986.64	0.32
39	002022	科华生物	985,005	13,041,466.20	0.31
40	600199	金种子酒	778,400	13,030,416.00	0.31
41	000973	佛塑科技	980,510	13,021,172.80	0.31
42	600176	中国玻纤	427,593	12,921,860.46	0.31
43	002236	大华股份	279,200	12,644,968.00	0.30
44	002065	东华软件	530,976	12,584,131.20	0.30
45	000735	罗牛山	1,760,957	12,573,232.98	0.30
46	600816	安信信托	636,000	12,522,840.00	0.30
47	000682	东方电子	1,957,127	12,506,041.53	0.30
48	000488	晨鸣纸业	1,781,985	12,491,714.85	0.30
49	600797	浙大网新	1,684,702	12,399,406.72	0.30
50	000826	桑德环境	496,285	12,372,385.05	0.30
51	600409	三友化工	1,060,048	12,296,556.80	0.30
52	600880	博瑞传播	875,625	12,293,775.00	0.30
53	600844	丹化科技	702,137	12,259,312.02	0.30
54	600651	飞乐音响	1,232,256	12,187,011.84	0.29
55	600439	瑞贝卡	1,100,970	12,176,728.20	0.29
56	000751	锌业股份	1,554,867	12,143,511.27	0.29
57	600522	中天科技	513,498	12,139,092.72	0.29
58	600251	冠农股份	362,223	12,011,314.68	0.29
59	000930	中粮生化	1,543,680	11,994,393.60	0.29
60	600425	青松建化	574,682	11,964,879.24	0.29
61	002353	杰瑞股份	183,778	11,927,192.20	0.29
62	600653	中华控股	3,494,251	11,915,395.91	0.29
63	600022	济南钢铁	2,497,400	11,912,598.00	0.29
64	002233	塔牌集团	895,038	11,841,352.74	0.29
65	600330	天通股份	942,461	11,809,036.33	0.28
66	000897	津滨发展	2,588,760	11,804,745.60	0.28
67	000594	国恒铁路	2,988,776	11,775,777.44	0.28
68	600851	海欣股份	1,181,658	11,710,230.78	0.28
69	002056	横店东磁	426,044	11,694,907.80	0.28
70	601588	北辰实业	3,193,300	11,687,478.00	0.28
71	600765	中航重机	778,374	11,675,610.00	0.28
72	002129	中环股份	579,663	11,645,429.67	0.28
73	002097	山河智能	841,237	11,600,658.23	0.28

74	600963	岳阳林纸	1,349,591	11,552,498.96	0.28
75	600755	厦门国贸	1,433,847	11,542,468.35	0.28
76	000998	隆平高科	443,716	11,536,616.00	0.28
77	600815	厦工股份	780,050	11,497,937.00	0.28
78	600596	新安股份	1,087,200	11,437,344.00	0.28
79	000655	金岭矿业	595,610	11,382,107.10	0.27
80	000417	合肥百货	624,142	11,359,384.40	0.27
81	600783	鲁信创投	446,826	11,331,507.36	0.27
82	600366	宁波韵升	720,641	11,285,238.06	0.27
83	600581	八一钢铁	769,307	11,270,347.55	0.27
84	000659	珠海中富	1,059,281	11,186,007.36	0.27
85	600069	银鸽投资	1,155,977	11,120,498.74	0.27
86	600112	长征电气	509,444	11,075,312.56	0.27
87	600326	西藏天路	766,363	11,066,281.72	0.27
88	000683	远兴能源	1,229,058	11,000,069.10	0.26
89	000571	新大洲 A	1,477,572	10,993,135.68	0.26
90	600138	中青旅	831,027	10,969,556.40	0.26
91	600820	隧道股份	1,027,348	10,961,803.16	0.26
92	600017	日照港	2,631,700	10,947,872.00	0.26
93	601002	晋亿实业	591,069	10,928,865.81	0.26
94	600773	西藏城投	460,800	10,874,880.00	0.26
95	600704	物产中大	615,070	10,874,437.60	0.26
96	000510	金路集团	1,218,833	10,847,613.70	0.26
97	000650	仁和药业	756,525	10,765,350.75	0.26
98	600426	华鲁恒升	636,028	10,748,873.20	0.26
99	000667	名流置业	3,584,900	10,718,851.00	0.26
100	600872	中炬高新	1,593,903	10,711,028.16	0.26
101	600141	兴发集团	511,841	10,677,003.26	0.26
102	000962	东方钨业	427,856	10,675,007.20	0.26
103	600673	东阳光铝	662,226	10,602,238.26	0.26
104	600637	广电信息	850,982	10,594,725.90	0.26
105	600410	华胜天成	707,132	10,578,694.72	0.25
106	000963	华东医药	434,243	10,539,077.61	0.25
107	600787	中储股份	1,008,574	10,529,512.56	0.25
108	000616	亿城股份	2,384,741	10,516,707.81	0.25
109	600884	杉杉股份	575,486	10,514,129.22	0.25
110	000501	鄂武商 A	608,995	10,401,634.60	0.25
111	600594	益佰制药	564,610	10,383,177.90	0.25
112	600416	湘电股份	852,208	10,320,238.88	0.25

113	600408	安泰集团	1,410,088	10,293,642.40	0.25
114	000830	鲁西化工	1,465,487	10,258,409.00	0.25
115	600888	新疆众和	422,657	10,249,432.25	0.25
116	600496	精工钢构	813,055	10,236,362.45	0.25
117	600654	飞乐股份	1,510,724	10,227,601.48	0.25
118	002230	科大讯飞	252,193	10,213,816.50	0.25
119	600298	安琪酵母	306,214	10,166,304.80	0.24
120	600685	广船国际	337,447	10,136,907.88	0.24
121	002250	联化科技	317,700	10,118,745.00	0.24
122	600236	桂冠电力	1,825,108	10,092,847.24	0.24
123	600064	南京高科	723,023	10,013,868.55	0.24
124	000078	海王生物	1,044,467	9,985,104.52	0.24
125	002161	远望谷	444,089	9,960,916.27	0.24
126	000988	华工科技	534,870	9,959,279.40	0.24
127	600545	新疆城建	1,081,747	9,930,437.46	0.24
128	600087	长航油运	3,395,600	9,881,196.00	0.24
129	600339	天利高新	809,776	9,846,876.16	0.24
130	600351	亚宝药业	1,266,403	9,839,951.31	0.24
131	600482	风帆股份	645,720	9,827,858.40	0.24
132	600801	华新水泥	383,558	9,819,084.80	0.24
133	002140	东华科技	356,890	9,796,630.50	0.24
134	002344	海宁皮城	448,192	9,792,995.20	0.24
135	002254	烟台氨纶	548,422	9,783,848.48	0.24
136	600702	沱牌曲酒	472,410	9,759,990.60	0.24
137	000726	鲁泰 A	883,855	9,678,212.25	0.23
138	002051	中工国际	352,742	9,665,130.80	0.23
139	600240	华业地产	903,351	9,620,688.15	0.23
140	600227	赤天化	1,521,255	9,614,331.60	0.23
141	600067	冠城大通	1,030,089	9,579,827.70	0.23
142	000522	白云山 A	659,079	9,556,645.50	0.23
143	000627	天茂集团	2,166,653	9,554,939.73	0.23
144	600835	上海机电	806,870	9,545,272.10	0.23
145	600449	赛马实业	273,265	9,539,681.15	0.23
146	600295	鄂尔多斯	489,780	9,447,856.20	0.23
147	000066	长城电脑	1,324,173	9,401,628.30	0.23
148	600322	天房发展	1,769,851	9,397,908.81	0.23
149	600388	龙净环保	342,258	9,353,911.14	0.23
150	000159	国际实业	673,856	9,332,905.60	0.22
151	600478	科力远	440,957	9,268,916.14	0.22

152	600435	中兵光电	744,951	9,267,190.44	0.22
153	000997	新大陆	612,614	9,201,462.28	0.22
154	002277	友阿股份	419,195	9,188,754.40	0.22
155	000786	北新建材	575,415	9,154,852.65	0.22
156	600750	江中药业	373,539	9,144,234.72	0.22
157	600117	西宁特钢	889,835	9,138,605.45	0.22
158	000900	现代投资	559,100	9,113,330.00	0.22
159	600308	华泰股份	908,462	9,111,873.86	0.22
160	600867	通化东宝	1,087,135	9,110,191.30	0.22
161	002083	孚日股份	1,126,702	9,092,485.14	0.22
162	600866	星湖科技	881,019	9,092,116.08	0.22
163	000860	顺鑫农业	526,493	9,076,739.32	0.22
164	600284	浦东建设	553,795	9,065,624.15	0.22
165	600978	宜华木业	1,614,389	9,056,722.29	0.22
166	600467	好当家	760,604	9,051,187.60	0.22
167	600038	哈飞股份	337,513	9,035,223.01	0.22
168	000823	超声电子	616,854	8,969,057.16	0.22
169	000717	韶钢松山	2,338,345	8,955,861.35	0.22
170	600877	中国嘉陵	1,100,102	8,932,828.24	0.22
171	002408	齐翔腾达	280,393	8,924,909.19	0.21
172	000850	华茂股份	1,132,890	8,915,844.30	0.21
173	600961	株冶集团	527,691	8,896,870.26	0.21
174	600033	福建高速	2,745,600	8,895,744.00	0.21
175	600761	安徽合力	599,959	8,885,392.79	0.21
176	600195	中牧股份	390,165	8,876,253.75	0.21
177	000601	韶能股份	1,851,895	8,852,058.10	0.21
178	001696	宗申动力	1,225,780	8,813,358.20	0.21
179	600436	片仔癀	140,049	8,809,082.10	0.21
180	600531	豫光金铅	354,431	8,786,344.49	0.21
181	000554	泰山石油	769,585	8,750,181.45	0.21
182	000698	沈阳化工	925,717	8,748,025.65	0.21
183	600198	大唐电信	614,793	8,736,208.53	0.21
184	600511	国药股份	574,786	8,725,251.48	0.21
185	600127	金健米业	1,089,329	8,649,272.26	0.21
186	600107	美尔雅	576,236	8,597,441.12	0.21
187	600611	大众交通	1,251,200	8,583,232.00	0.21
188	002078	太阳纸业	804,190	8,532,455.90	0.21
189	600122	宏图高科	1,359,910	8,526,635.70	0.21
190	600158	中体产业	1,350,548	8,508,452.40	0.20

191	002064	华峰氨纶	886,412	8,474,098.72	0.20
192	600509	天富热电	787,195	8,462,346.25	0.20
193	600662	强生控股	1,264,546	8,447,167.28	0.20
194	600628	新世界	851,217	8,435,560.47	0.20
195	600831	广电网络	789,124	8,427,844.32	0.20
196	000598	兴蓉投资	461,600	8,354,960.00	0.20
197	000596	古井贡酒	105,030	8,347,784.40	0.20
198	600086	东方金钰	422,953	8,340,633.16	0.20
199	600557	康缘药业	592,840	8,305,688.40	0.20
200	002011	盾安环境	596,034	8,278,912.26	0.20
201	600468	百利电气	304,239	8,278,343.19	0.20
202	600858	银座股份	404,665	8,271,352.60	0.20
203	600723	西单商场	658,713	8,266,848.15	0.20
204	600289	亿阳信通	924,494	8,264,976.36	0.20
205	600995	文山电力	765,994	8,219,115.62	0.20
206	600387	海越股份	618,011	8,194,825.86	0.20
207	002048	宁波华翔	680,839	8,149,642.83	0.20
208	000006	深振业 A	1,385,200	8,048,012.00	0.19
209	600139	西部资源	332,156	8,011,602.72	0.19
210	600078	澄星股份	783,029	8,010,386.67	0.19
211	600736	苏州高新	1,270,033	8,001,207.90	0.19
212	600059	古越龙山	762,112	7,986,933.76	0.19
213	600790	轻纺城	990,420	7,953,072.60	0.19
214	600589	广东榕泰	842,729	7,930,079.89	0.19
215	600580	卧龙电气	963,263	7,918,021.86	0.19
216	000887	中鼎股份	596,024	7,730,431.28	0.19
217	000426	富龙热电	457,045	7,724,060.50	0.19
218	600171	上海贝岭	1,078,524	7,711,446.60	0.19
219	600575	芜湖港	837,800	7,691,004.00	0.19
220	000088	盐田港	1,195,741	7,676,657.22	0.18
221	600521	华海药业	538,790	7,640,042.20	0.18
222	000886	海南高速	1,582,814	7,613,335.34	0.18
223	600290	华仪电气	527,078	7,600,464.76	0.18
224	600993	马应龙	398,048	7,570,872.96	0.18
225	000987	广州友谊	360,329	7,563,305.71	0.18
226	000089	深圳机场	1,352,794	7,480,950.82	0.18
227	000837	秦川发展	558,206	7,463,214.22	0.18
228	600332	广州药业	473,029	7,440,746.17	0.18
229	600491	龙元建设	1,137,614	7,439,995.56	0.18

230	000090	深天健	639,518	7,386,432.90	0.18
231	000975	科学城	804,916	7,381,079.72	0.18
232	600641	万业企业	806,545	7,339,559.50	0.18
233	600707	彩虹股份	589,690	7,335,743.60	0.18
234	600231	凌钢股份	804,331	7,335,498.72	0.18
235	000936	华西村	900,996	7,298,067.60	0.18
236	600021	上海电力	1,265,280	7,288,012.80	0.18
237	600810	神马股份	442,465	7,274,124.60	0.18
238	600337	美克股份	632,910	7,272,135.90	0.18
239	000755	山西三维	657,221	7,262,292.05	0.17
240	002179	中航光电	321,412	7,231,770.00	0.17
241	000028	一致药业	280,073	7,231,484.86	0.17
242	600618	氯碱化工	450,114	7,215,327.42	0.17
243	600525	长园集团	863,842	7,195,803.86	0.17
244	000410	沈阳机床	654,793	7,176,531.28	0.17
245	600569	安阳钢铁	1,915,729	7,088,197.30	0.17
246	600103	青山纸业	1,699,630	7,087,457.10	0.17
247	000407	胜利股份	1,298,995	7,053,542.85	0.17
248	600261	阳光照明	374,854	7,021,015.42	0.17
249	600361	华联综超	799,317	7,018,003.26	0.17
250	000931	中关村	945,205	7,013,421.10	0.17
251	600006	东风汽车	1,600,700	7,011,066.00	0.17
252	000861	海印股份	393,887	7,003,310.86	0.17
253	601678	滨化股份	396,208	6,993,071.20	0.17
254	000848	承德露露	438,100	6,992,076.00	0.17
255	600363	联创光电	595,536	6,967,771.20	0.17
256	000301	东方市场	1,706,246	6,961,483.68	0.17
257	600602	广电电子	1,055,892	6,958,328.28	0.17
258	600710	常林股份	640,505	6,930,264.10	0.17
259	000996	中国中期	368,106	6,920,392.80	0.17
260	000708	大冶特钢	449,637	6,883,942.47	0.17
261	600838	上海九百	802,094	6,865,924.64	0.17
262	600622	嘉宝集团	823,254	6,841,240.74	0.16
263	600616	金枫酒业	614,376	6,831,861.12	0.16
264	002168	深圳惠程	378,725	6,813,262.75	0.16
265	002091	江苏国泰	360,108	6,791,636.88	0.16
266	000799	酒鬼酒	363,791	6,766,512.60	0.16
267	600529	山东药玻	514,951	6,720,110.55	0.16
268	600291	西水股份	537,867	6,701,822.82	0.16

269	600360	华微电子	1,085,367	6,696,714.39	0.16
270	600487	亨通光电	248,569	6,674,077.65	0.16
271	600789	鲁抗医药	814,541	6,671,090.79	0.16
272	600597	光明乳业	839,700	6,658,821.00	0.16
273	000903	云内动力	953,515	6,645,999.55	0.16
274	600121	郑州煤电	629,442	6,628,024.26	0.16
275	600644	乐山电力	457,303	6,612,601.38	0.16
276	600590	泰豪科技	637,691	6,606,478.76	0.16
277	000777	中核科技	255,726	6,600,288.06	0.16
278	000099	中信海直	616,628	6,597,919.60	0.16
279	600223	鲁商置业	801,100	6,569,020.00	0.16
280	600991	广汽长丰	416,848	6,544,513.60	0.16
281	600106	重庆路桥	726,540	6,538,860.00	0.16
282	600268	国电南自	508,412	6,507,673.60	0.16
283	600533	栖霞建设	1,260,550	6,441,410.50	0.16
284	600056	中国医药	248,874	6,410,994.24	0.15
285	600317	营口港	1,098,011	6,368,463.80	0.15
286	000537	广宇发展	820,652	6,360,053.00	0.15
287	600293	三峡新材	482,499	6,325,561.89	0.15
288	600507	方大特钢	1,040,909	6,307,908.54	0.15
289	600748	上实发展	867,100	6,277,804.00	0.15
290	600683	京投银泰	741,094	6,269,655.24	0.15
291	000511	银基发展	1,848,486	6,266,367.54	0.15
292	000525	红太阳	448,572	6,262,065.12	0.15
293	600780	通宝能源	917,545	6,239,306.00	0.15
294	600754	锦江股份	357,895	6,230,951.95	0.15
295	000050	深天马 A	574,500	6,227,580.00	0.15
296	600510	黑牡丹	636,666	6,226,593.48	0.15
297	600292	九龙电力	401,560	6,224,180.00	0.15
298	600824	益民集团	1,025,144	6,222,624.08	0.15
299	600282	南钢股份	1,550,911	6,219,153.11	0.15
300	002237	恒邦股份	153,370	6,200,749.10	0.15
301	600075	新疆天业	526,534	6,197,305.18	0.15
302	600288	大恒科技	611,739	6,196,916.07	0.15
303	000911	南宁糖业	344,072	6,193,296.00	0.15
304	600830	香溢融通	636,309	6,184,923.48	0.15
305	600864	哈投股份	655,885	6,165,319.00	0.15
306	002121	科陆电子	396,830	6,123,086.90	0.15
307	601777	力帆股份	571,100	6,122,192.00	0.15

308	000533	万家乐	829,330	6,120,455.40	0.15
309	002506	超日太阳	316,500	6,108,450.00	0.15
310	600246	万通地产	1,217,275	6,086,375.00	0.15
311	600846	同济科技	1,000,019	6,080,115.52	0.15
312	000513	丽珠集团	221,317	6,079,577.99	0.15
313	002431	棕榈园林	230,532	6,076,823.52	0.15
314	000875	吉电股份	1,343,128	6,057,507.28	0.15
315	600323	南海发展	433,861	6,021,990.68	0.15
316	002223	鱼跃医疗	245,430	6,020,397.90	0.14
317	600270	外运发展	724,670	6,007,514.30	0.14
318	002309	中利科技	240,424	5,998,578.80	0.14
319	000949	新乡化纤	765,738	5,972,756.40	0.14
320	600827	友谊股份	350,992	5,942,294.56	0.14
321	600693	东百集团	686,767	5,933,666.88	0.14
322	600480	凌云股份	434,279	5,927,908.35	0.14
323	000767	漳泽电力	1,063,940	5,915,506.40	0.14
324	002465	海格通信	199,613	5,914,533.19	0.14
325	600460	士兰微	347,448	5,903,141.52	0.14
326	000972	新中基	675,179	5,874,057.30	0.14
327	600782	新钢股份	836,382	5,863,037.82	0.14
328	600327	大东方	626,363	5,862,757.68	0.14
329	000712	锦龙股份	426,673	5,849,686.83	0.14
330	600475	华光股份	307,366	5,836,880.34	0.14
331	600657	信达地产	914,900	5,827,913.00	0.14
332	002041	登海种业	281,762	5,824,020.54	0.14
333	600555	九龙山	1,168,654	5,819,896.92	0.14
334	002342	巨力索具	288,100	5,802,334.00	0.14
335	002482	广田股份	192,100	5,799,499.00	0.14
336	600082	海泰发展	1,034,230	5,750,318.80	0.14
337	600825	新华传媒	836,307	5,745,429.09	0.14
338	002242	九阳股份	456,800	5,710,000.00	0.14
339	600725	云维股份	616,540	5,684,498.80	0.14
340	002308	威创股份	513,340	5,651,873.40	0.14
341	600676	交运股份	878,042	5,645,810.06	0.14
342	002475	立讯精密	156,520	5,644,111.20	0.14
343	002410	广联达	162,065	5,626,896.80	0.14
344	002311	海大集团	349,632	5,611,593.60	0.14
345	000016	深康佳 A	1,277,769	5,609,405.91	0.14
346	600398	凯诺科技	1,034,997	5,578,633.83	0.13

347	600197	伊力特	441,182	5,558,893.20	0.13
348	600667	太极实业	656,576	5,554,632.96	0.13
349	600523	贵航股份	288,964	5,504,764.20	0.13
350	600063	皖维高新	468,266	5,502,125.50	0.13
351	000158	常山股份	862,996	5,497,284.52	0.13
352	600776	东方通信	765,155	5,493,812.90	0.13
353	000713	丰乐种业	358,761	5,485,455.69	0.13
354	002249	大洋电机	257,189	5,465,266.25	0.13
355	600429	三元股份	708,329	5,439,966.72	0.13
356	600061	中纺投资	515,089	5,439,339.84	0.13
357	000738	中航动控	377,300	5,436,893.00	0.13
358	600543	莫高股份	513,966	5,422,341.30	0.13
359	600806	昆明机床	468,470	5,415,513.20	0.13
360	600469	风神股份	450,101	5,414,715.03	0.13
361	600896	中海海盛	930,450	5,396,610.00	0.13
362	002430	杭氧股份	240,692	5,389,093.88	0.13
363	002332	仙琚制药	409,867	5,377,455.04	0.13
364	600438	通威股份	687,854	5,351,504.12	0.13
365	600226	升华拜克	568,018	5,322,328.66	0.13
366	600686	金龙汽车	619,888	5,318,639.04	0.13
367	601801	皖新传媒	364,200	5,306,394.00	0.13
368	000520	长航凤凰	1,080,001	5,292,004.90	0.13
369	600966	博汇纸业	706,671	5,285,899.08	0.13
370	002181	粤传媒	490,455	5,282,200.35	0.13
371	600874	创业环保	870,189	5,273,345.34	0.13
372	600102	莱钢股份	553,600	5,248,128.00	0.13
373	600488	天药股份	651,737	5,226,930.74	0.13
374	600120	浙江东方	606,828	5,224,789.08	0.13
375	002052	同洲电子	479,880	5,221,094.40	0.13
376	600329	中新药业	431,627	5,218,370.43	0.13
377	000005	世纪星源	1,350,681	5,213,628.66	0.13
378	600479	千金药业	426,950	5,208,790.00	0.13
379	600894	广钢股份	610,198	5,198,886.96	0.13
380	002281	光迅科技	160,029	5,168,936.70	0.12
381	600277	亿利能源	360,945	5,168,732.40	0.12
382	600983	合肥三洋	426,420	5,087,190.60	0.12
383	000543	皖能电力	618,658	5,072,995.60	0.12
384	600836	界龙实业	501,904	5,064,211.36	0.12
385	600639	浦东金桥	525,499	5,060,555.37	0.12

386	600328	兰太实业	445,807	5,037,619.10	0.12
387	002480	新筑股份	168,100	5,036,276.00	0.12
388	000572	海马汽车	987,153	5,034,480.30	0.12
389	600563	法拉电子	225,115	5,024,566.80	0.12
390	600501	航天晨光	389,445	5,012,157.15	0.12
391	000733	振华科技	501,602	4,995,955.92	0.12
392	002440	闰土股份	230,151	4,968,960.09	0.12
393	600423	柳化股份	559,352	4,967,045.76	0.12
394	600565	迪马股份	1,008,463	4,921,299.44	0.12
395	000608	阳光股份	900,250	4,915,365.00	0.12
396	000428	华天酒店	865,956	4,909,970.52	0.12
397	000563	陕国投 A	441,091	4,896,110.10	0.12
398	600708	海博股份	714,833	4,889,457.72	0.12
399	600163	福建南纸	1,010,408	4,860,062.48	0.12
400	600640	中卫国脉	401,501	4,858,162.10	0.12
401	002025	航天电器	396,160	4,845,036.80	0.12
402	000584	友利控股	572,662	4,844,720.52	0.12
403	600202	哈空调	536,917	4,832,253.00	0.12
404	600263	路桥建设	326,685	4,802,269.50	0.12
405	002326	永太科技	192,341	4,758,516.34	0.11
406	000677	山东海龙	1,037,213	4,740,063.41	0.11
407	002444	巨星科技	304,330	4,720,158.30	0.11
408	002285	世联地产	261,227	4,689,024.65	0.11
409	600420	现代制药	345,457	4,684,396.92	0.11
410	002088	鲁阳股份	327,666	4,679,070.48	0.11
411	000597	东北制药	333,901	4,671,274.99	0.11
412	002292	奥飞动漫	245,840	4,670,960.00	0.11
413	000852	江钻股份	320,501	4,660,084.54	0.11
414	600052	浙江广厦	1,046,593	4,636,406.99	0.11
415	000919	金陵药业	504,246	4,634,020.74	0.11
416	002183	怡亚通	667,545	4,626,086.85	0.11
417	000910	大亚科技	633,278	4,591,265.50	0.11
418	002336	人人乐	240,150	4,562,850.00	0.11
419	002232	启明信息	408,770	4,545,522.40	0.11
420	600178	东安动力	462,299	4,525,907.21	0.11
421	000687	保定天鹅	770,205	4,505,699.25	0.11
422	002191	劲嘉股份	513,770	4,485,212.10	0.11
423	002479	富春环保	256,900	4,446,939.00	0.11
424	601126	四方股份	240,500	4,408,365.00	0.11

425	600333	长春燃气	461,720	4,400,191.60	0.11
426	002393	力生制药	109,480	4,379,200.00	0.11
427	600129	太极集团	512,475	4,376,536.50	0.11
428	002276	万马电缆	322,386	4,361,882.58	0.11
429	600826	兰生股份	420,868	4,360,192.48	0.11
430	000514	渝开发	558,110	4,353,258.00	0.10
431	002428	云南锗业	98,018	4,344,157.76	0.10
432	600359	新农开发	321,107	4,334,944.50	0.10
433	002362	汉王科技	171,400	4,322,708.00	0.10
434	002489	浙江永强	144,100	4,321,559.00	0.10
435	000899	赣能股份	646,931	4,302,091.15	0.10
436	000912	泸天化	587,197	4,298,282.04	0.10
437	600829	三精制药	348,111	4,288,727.52	0.10
438	002218	拓日新能	293,989	4,245,201.16	0.10
439	600054	黄山旅游	252,379	4,194,538.98	0.10
440	000925	众合机电	241,151	4,167,089.28	0.10
441	000619	海螺型材	432,186	4,166,273.04	0.10
442	000617	石油济柴	230,144	4,144,893.44	0.10
443	000631	顺发恒业	627,558	4,110,504.90	0.10
444	002109	兴化股份	430,311	4,105,166.94	0.10
445	000989	九芝堂	357,260	4,101,344.80	0.10
446	002340	格林美	194,212	4,090,104.72	0.10
447	600088	中视传媒	331,609	4,045,629.80	0.10
448	600287	江苏舜天	437,003	4,033,537.69	0.10
449	002062	宏润建设	360,187	3,998,075.70	0.10
450	600650	锦江投资	390,695	3,965,554.25	0.10
451	002437	誉衡药业	168,092	3,933,352.80	0.09
452	002306	湘鄂情	200,090	3,903,755.90	0.09
453	600162	香江控股	768,156	3,894,550.92	0.09
454	600073	上海梅林	356,575	3,890,233.25	0.09
455	600759	正和股份	732,350	3,888,778.50	0.09
456	002384	东山精密	115,215	3,888,506.25	0.09
457	002252	上海莱士	163,279	3,886,040.20	0.09
458	002172	澳洋科技	556,466	3,884,132.68	0.09
459	002328	新朋股份	240,147	3,873,571.11	0.09
460	002386	天原集团	287,940	3,864,154.80	0.09
461	002225	濮耐股份	292,266	3,790,690.02	0.09
462	002345	潮宏基	144,062	3,757,136.96	0.09
463	000905	厦门港务	531,207	3,745,009.35	0.09

464	600834	申通地铁	382,039	3,732,521.03	0.09
465	002414	高德红外	180,075	3,729,353.25	0.09
466	002194	武汉凡谷	333,658	3,703,603.80	0.09
467	600012	皖通高速	699,650	3,694,152.00	0.09
468	600743	华远地产	759,021	3,688,842.06	0.09
469	000990	诚志股份	356,547	3,683,130.51	0.09
470	000517	荣安地产	424,691	3,660,836.42	0.09
471	002267	陕天然气	203,438	3,653,746.48	0.09
472	600168	武汉控股	441,357	3,623,540.97	0.09
473	000893	东凌粮油	177,630	3,598,783.80	0.09
474	600126	杭钢股份	671,414	3,598,779.04	0.09
475	600386	北巴传媒	403,397	3,557,961.54	0.09
476	002463	沪电股份	332,300	3,532,349.00	0.09
477	600035	楚天高速	748,122	3,516,173.40	0.08
478	600897	厦门空港	238,309	3,505,525.39	0.08
479	000042	深长城	191,626	3,489,509.46	0.08
480	002238	天威视讯	192,335	3,444,719.85	0.08
481	002287	奇正藏药	162,441	3,435,627.15	0.08
482	600191	华资实业	485,147	3,420,286.35	0.08
483	002315	焦点科技	70,512	3,417,716.64	0.08
484	002314	雅致股份	232,072	3,413,779.12	0.08
485	002429	兆驰股份	189,081	3,354,296.94	0.08
486	000950	建峰化工	425,284	3,308,709.52	0.08
487	002110	三钢闽光	320,944	3,286,466.56	0.08
488	600258	首旅股份	185,157	3,279,130.47	0.08
489	002449	国星光电	129,093	3,253,143.60	0.08
490	600230	沧州大化	259,391	3,156,788.47	0.08
491	002320	海峡股份	196,625	3,146,000.00	0.08
492	601000	唐山港	400,200	3,077,538.00	0.07
493	000883	湖北能源	383,300	3,066,400.00	0.07
494	000979	中弘地产	405,000	3,005,100.00	0.07
495	601999	出版传媒	330,735	2,893,931.25	0.07
496	000029	深深房A	535,219	2,740,321.28	0.07
497	002383	合众思壮	86,457	2,738,957.76	0.07
498	600278	东方创业	241,182	2,508,292.80	0.06
499	600648	外高桥	151,700	2,076,773.00	0.05
500	600623	双钱股份	124,762	1,893,887.16	0.05
501	002534	杭锅股份	66,000	1,446,720.00	0.03
502	002317	众生药业	36,558	820,727.10	0.02

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600311	荣华实业	27,834,726.31	0.76
2	002081	金螳螂	20,621,749.38	0.56
3	600259	广晟有色	18,233,184.31	0.50
4	600643	爱建股份	17,643,007.84	0.48
5	000751	锌业股份	16,606,516.09	0.45
6	000655	金岭矿业	15,962,363.04	0.44
7	000897	津滨发展	15,627,544.72	0.43
8	600601	方正科技	15,617,811.75	0.43
9	000488	晨鸣纸业	14,887,148.15	0.41
10	600325	华发股份	14,377,639.72	0.39
11	600060	海信电器	14,029,376.11	0.38
12	600816	安信信托	13,932,690.11	0.38
13	600210	紫江企业	13,755,294.14	0.38
14	002353	杰瑞股份	13,704,667.38	0.37
15	600435	中兵光电	13,190,578.11	0.36
16	600199	金种子酒	13,044,602.88	0.36
17	600176	中国玻纤	12,876,283.76	0.35
18	002375	亚厦股份	12,855,111.50	0.35
19	600820	隧道股份	12,279,533.90	0.34
20	002236	大华股份	12,188,294.47	0.33

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600252	中恒集团	38,156,218.18	1.04
2	002073	软控股份	37,126,150.13	1.01

3	002106	莱宝高科	25,889,102.35	0.71
4	002081	金螳螂	17,536,976.27	0.48
5	600971	恒源煤电	16,975,634.23	0.46
6	002152	广电运通	16,665,962.79	0.46
7	600267	海正药业	16,263,019.59	0.44
8	000559	万向钱潮	15,040,197.02	0.41
9	002092	中泰化学	15,030,298.78	0.41
10	002241	歌尔声学	13,208,314.87	0.36
11	600498	烽火通信	12,564,940.52	0.34
12	000829	天音控股	11,832,963.04	0.32
13	002069	獐子岛	10,384,176.89	0.28
14	002310	东方园林	10,044,571.91	0.27
15	000550	江铃汽车	10,018,138.48	0.27
16	000707	双环科技	9,305,669.47	0.25
17	002375	亚厦股份	8,901,594.99	0.24
18	600060	海信电器	8,872,530.94	0.24
19	601992	金隅股份	8,821,456.45	0.24
20	600724	宁波富达	8,709,845.14	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	2,127,446,176.67
卖出股票收入（成交）总额	1,383,429,817.28

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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。

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 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	1,357,880.51
2	应收证券清算款	10,316,426.20
3	应收股利	317,433.85
4	应收利息	39,785.24
5	应收申购款	28,359,870.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,391,396.00

7.9.4 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。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
343, 178	10, 580. 76	469, 264, 267. 16	12. 92%	3, 161, 819, 745. 53	87. 08%

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	姜山	10, 131, 043. 00	7. 72%
2	朝恒房地产 (深圳) 有限公司	8, 000, 000. 00	6. 10%
3	周茂永	3, 000, 000. 00	2. 29%
4	闫明江	1, 806, 562. 00	1. 38%
5	项志英	1, 500, 000. 00	1. 14%
6	杨平	1, 237, 644. 00	0. 94%
7	壮丽	1, 206, 961. 00	0. 92%
8	吴彤	1, 107, 200. 00	0. 84%
9	林家福	1, 063, 000. 00	0. 81%
10	高琪	1, 000, 000. 00	0. 76%

8.3 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, 250, 613. 28	0. 0620%

§ 9 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, 972, 289, 432. 83
本报告期基金总申购份额	1, 755, 098, 419. 12
减: 本报告期基金总赎回份额	1, 096, 303, 839. 26
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3, 631, 084, 012. 69

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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

2011 年 1 月 21 日, 中国证监会核准中国农业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格 (证监许可【2011】116 号), 张健任中国农业银行股份有限公司托管业务部总经理。2011 年 8 月 16 日, 基金管理人发布公告, 聘任朱运东为公司副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
英大证券	2	717,985,539.66	20.53%	610,297.11	20.97%	-
招商证券	1	701,748,218.94	20.07%	570,178.89	19.59%	-
国泰君安	1	562,314,194.35	16.08%	477,967.45	16.42%	-
东方证券	1	553,441,460.76	15.83%	470,426.10	16.16%	-
江海证券	1	514,648,654.56	14.72%	418,156.42	14.37%	-

华泰证券	1	447,082,586.14	12.78%	363,260.67	12.48%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-

注：1、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 (a)公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；(b)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；(c)公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；(d)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：(a)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；(b)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；(c)资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
英大证券	690,615.70	80.26%	-	-	-	-
招商证券	169,856.00	19.74%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-

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	· 南方基金关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机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	2011年6月30日

2	<ul style="list-style-type: none"> 南方基金关于旗下部分基金参加中信银行个人网银、移动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	2011 年 6 月 30 日
3	<ul style="list-style-type: none"> 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	2011 年 6 月 22 日
4	<ul style="list-style-type: none"> 南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加乌鲁木齐商业银行为代销机构的公告 	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2011 年 6 月 21 日
5	<ul style="list-style-type: none"> 南方基金关于开通网上直销赎回转认/申购业务的公告 	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2011 年 6 月 15 日
6	<ul style="list-style-type: none"> 南方基金关于暂停中国银行广东省分行银行卡网上直销业务的公告 	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2011 年 5 月 26 日
7	<ul style="list-style-type: none"> 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	2011 年 5 月 11 日
8	<ul style="list-style-type: none"> 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	2011 年 4 月 21 日
9	<ul style="list-style-type: none"> 南方基金关于旗下部分基金参加中国农业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	2011 年 4 月 6 日
10	<ul style="list-style-type: none"> 关于旗下部分基金参加华夏银行网上银行基金申购费率优惠活动的补充公告 	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2011 年 4 月 2 日
11	<ul style="list-style-type: none"> 南方基金关于旗下部分基金参加东莞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、	2011 年 4 月 1 日

		证券时报	
12	• 南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2011 年 4 月 1 日
13	• 南方基金关于旗下部分基金参加华夏银行延长基金定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2011 年 4 月 1 日
14	• 南方基金关于旗下部分基金参加“华夏银行盈基金 2011”网上银行基金申购 4 折优惠活动的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2011 年 4 月 1 日
15	• 关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2011 年 3 月 22 日
16	• 南方基金关于旗下部分开放式证券投资基金增加重庆银行为代销机构的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2011 年 3 月 21 日
17	• 南方基金关于旗下基金在天相投顾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	2011 年 3 月 15 日
18	• 南方基金关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2011 年 3 月 11 日
19	• 南方基金关于旗下部分基金参加浦发银行基金定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2011 年 3 月 1 日
20	• 南方基金关于南方中证 500 指数 (LOF) 基金增聘基金经理公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2011 年 2 月 17 日
21	• 南方基金关于南方高增长股票 (LOF) 基金增聘基金	中国证券报、	2011 年 2 月 17 日

	经理公告	上海证券报、 证券时报	
22	• 南方基金管理有限公司关于开通基金电话交易的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2011 年 1 月 28 日
23	• 南方基金关于旗下部分基金在浙商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	2011 年 1 月 14 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路 6 号免税商务大厦 31 至 33 楼

12.3 查阅方式

网站: <http://www.nffund.com>