

南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2012 年半年度报告

2012 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：2012 年 8 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 2012 年 8 月 21 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 2012 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.....	12
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	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	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	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	29
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.....	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
7.7 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.....	44
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.....	44
7.9 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	45
§9 开放式基金份额变动	46

§10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	47
§11 备查文件目录	49
11.1 备查文件目录.....	49
11.2 存放地点.....	50
11.3 查阅方式.....	50

§ 2

§ 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	5,680,461,201.40 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	2009-11-11

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，以实现对标的有效跟踪。
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	010-66060069
	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	蒋超良

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(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-345,818,033.70
本期利润	234,809,326.56
加权平均基金份额本期利润	0.0425
本期加权平均净值利润率	4.78%
本期基金份额净值增长率	5.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-795,891,565.75
期末可供分配基金份额利润	-0.1401
期末基金资产净值	4,884,569,635.65
期末基金份额净值	0.8599
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-8.55%

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。

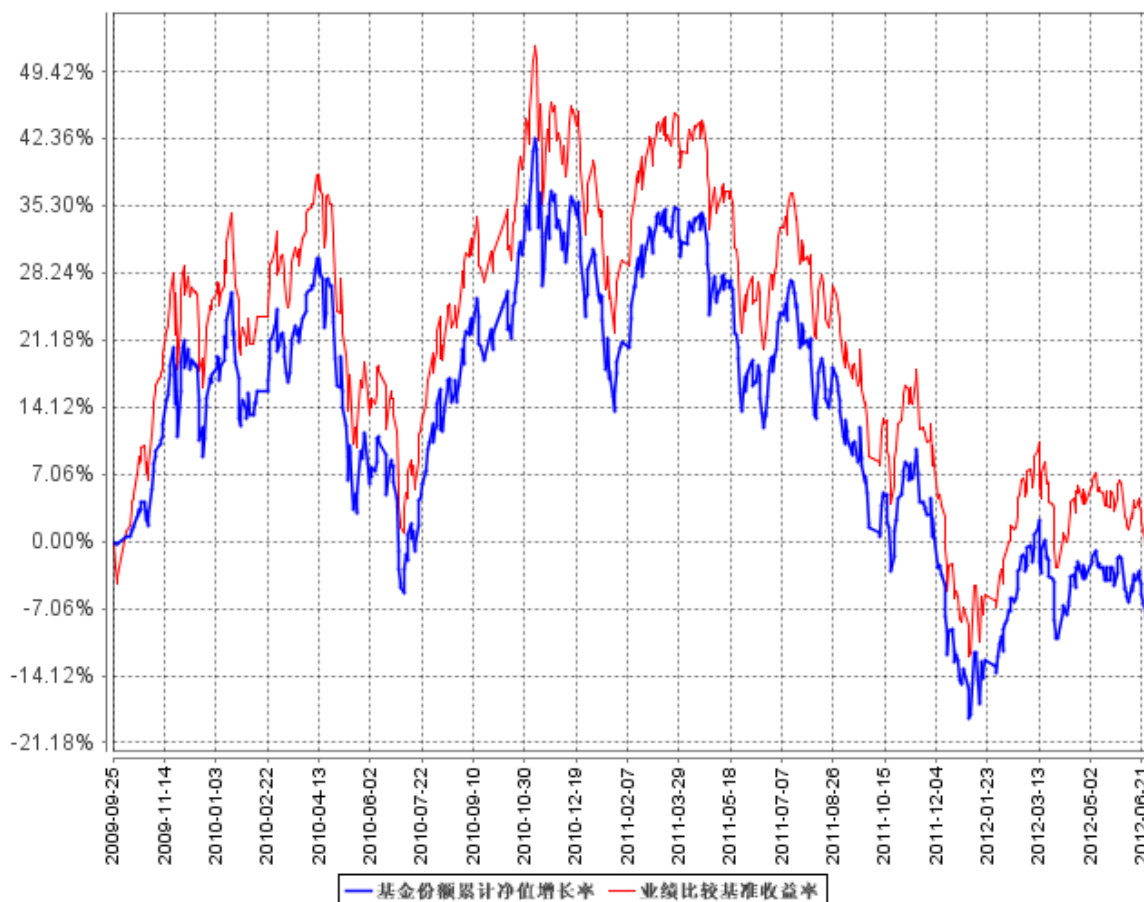
3.2 基金净值表现

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	-7.07%	1.18%	-7.16%	1.18%	0.09%	0.00%
过去三个月	1.74%	1.16%	1.53%	1.16%	0.21%	0.00%
过去六个月	5.65%	1.53%	6.02%	1.53%	-0.37%	0.00%
过去一年	-23.49%	1.53%	-23.01%	1.53%	-0.48%	0.00%
自基金合同生效起至今	-8.55%	1.59%	-1.26%	1.61%	-7.29%	-0.02%

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%。公司在北京、上海、合肥等地设有分公司, 在香港设有子公司—南方东英资产管理有限公司。

截至报告期末, 公司管理资产规模近 2,000 亿元, 旗下管理 32 只开放式基金, 2 只封闭式

基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
张原	本基金的 基金经理	2009 年 9 月 25 日	-	6	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。
潘海宁	本基金的 基金经理	2011 年 2 月 17 日	-	11	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、基金开元基金经理助理、投资部总监助理、数量化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	美国南加州大学金融数学专业硕士、美国加州大学计算机专业硕士，双硕士学历。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，现任数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；2011 年 10 月至今，任南方上证 380ETF 及其联接基金的基金经理助理。

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合规守信情况的说明

报告期内, 本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 14 次, 其中 12 次是由于报告期初指数基金成份股调整, 1 次是由于接受大额申购使得基金规模增大, 配置债券所需, 1 次是由于社保 201 组合调整, 选择期限与收益匹配较好的债券进行投资的需要。

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

2012 年以来, 中央针对经济增速下滑推出了稳健偏松的货币政策和相对积极的财政政策, 使得上半年中证 500 指数相对去年末的低点有所回升, 涨幅为+6.25%。

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接受大额申购、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个别长期停牌证券, 引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离;

③部分成份股分红引起的基金净值相对于业绩基准的正向偏离;

④ 6 月底前后, 我们根据指数每半年度的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 0.357%, 今年初至报告期末年化跟踪误差为 0.476%, 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 0.8599 元, 报告期内, 份额净值增长率为 5.65%, 同期业绩基准增长率为 6.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在全球经济增速低迷的背景下, 中国也面临着经济放缓的局面。但和欧美发达国家相比, 中国仍可依靠降息、下调存款准备金率、财政刺激计划等传统的政策工具。如果下半年经济增速没有企稳回升, 央行可以再次降息和下调存款准备金率, 促使银行加大贷款力度; 也可以在不威胁到政府偿付能力的前提下, 增加基础设施开支和对消费者的补贴。面对经济困境, 中国显然有更多灵活的办法来应对。

另一方面, 我们看到中国是在全球经济衰退中为数不多的几个依然保持经济增长的国家之一, 但国内 A 股的走势与深受金融危机和主权债务危机的美欧及部分东南亚国家的股指相比, 似乎并未同步反应中国经济的相对强势。相信每位投资者都可以对这样的现象分析出自己的观点, 但我们始终认为长期而言股市仍应与国民经济的发展保持一致。下半年随着更多的政策利好信号和流动性进一步改善, A 股市场中长期的投资价值正逐渐显现。

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

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, 可根据自己对市场走势的判断, 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，本报告期本基金不符合基金合同约定的收益分配条件，未有收益分配事项。

§ 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 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合规守信、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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为, 南方基金管理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, 未发现有关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: 2012 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.3.1	270,001,273.21	220,681,198.52
结算备付金		1,272,561.99	4,084,350.08
存出保证金		1,586,663.24	1,072,000.86
交易性金融资产	6.4.3.2	4,634,505,450.58	3,804,627,867.53
其中: 股票投资		4,634,505,450.58	3,804,627,867.53
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		11,673,275.05	-
应收利息	6.4.3.3	45,658.33	45,626.84
应收股利		464,418.77	-
应收申购款		6,823,352.96	25,432,664.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.4	-	-
资产总计		4,926,372,654.13	4,055,943,708.11
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011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		30,393,262.48	-
应付赎回款		5,043,201.84	17,121,087.36
应付管理人报酬		2,453,949.74	2,208,748.16
应付托管费		490,789.92	441,749.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.5	1,471,391.36	909,767.02
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	1,950,423.14	1,684,183.68
负债合计		41,803,018.48	22,365,535.87
所有者权益:			
实收基金	6.4.3.7	5,680,461,201.40	4,956,039,677.38
未分配利润	6.4.3.8	-795,891,565.75	-922,461,505.14
所有者权益合计		4,884,569,635.65	4,033,578,172.24
负债和所有者权益总计		4,926,372,654.13	4,055,943,708.11

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8599 元，基金份额总额 5,680,461,201.40 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012年1月1日至 2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年6月30日
一、收入		259,493,547.83	-254,940,859.37

1.利息收入		986,140.61	743,388.18
其中：存款利息收入	6.4.3.9	986,140.61	743,175.67
债券利息收入		-	212.51
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）		-323,681,582.48	111,161,357.25
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-348,838,376.25	96,554,236.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	126,559.19
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.3.11	25,156,793.77	14,480,561.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.12	580,627,360.26	-368,415,321.78
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.13	1,561,629.44	1,569,716.98
减：二、费用		24,684,221.27	19,547,249.53
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	14,557,322.96	11,621,225.53
2. 托管费	6.4.6.2.2	2,911,464.55	2,324,245.12
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.14	6,490,011.30	4,966,688.11
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.15	725,422.46	635,090.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		234,809,326.56	-274,488,108.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		234,809,326.56	-274,488,108.90

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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	4,956,039,677.38	-922,461,505.14	4,033,578,172.24

二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	234,809,326.56	234,809,326.56
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)	724,421,524.02	-108,239,387.17	616,182,136.85
其中: 1.基金申购款	2,159,183,968.35	-232,892,676.76	1,926,291,291.59
2.基金赎回款	-1,434,762,444.33	124,653,289.59	-1,310,109,154.74
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)	5,680,461,201.40	-795,891,565.75	4,884,569,635.65
项目	上年度可比期间 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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

高良玉
基金管理公司负责人

鲍文革
主管会计工作负责人

鲍文革
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 2012年6月30日
活期存款	270,001,273.21
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	270,001,273.21

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,393,310,767.50	4,634,505,450.58	-758,805,316.92
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	5,393,310,767.50	4,634,505,450.58	-758,805,316.92

6.4.3.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	45,142.90
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	515.43
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	45,658.33

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 2012 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,471,391.36
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,471,391.36

6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付赎回费	27,697.78
预提费用	1,172,725.36
合计	1,950,423.14

6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	4,956,039,677.38	4,956,039,677.38
本期申购	2,159,183,968.35	2,159,183,968.35
本期赎回(以“-”号填列)	-1,434,762,444.33	-1,434,762,444.33
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	5,680,461,201.40	5,680,461,201.40

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	688,251,568.79	-1,610,713,073.93	-922,461,505.14
本期利润	-345,818,033.70	580,627,360.26	234,809,326.56
本期基金份额交易产生的变动数	79,108,508.92	-187,347,896.09	-108,239,387.17
其中：基金申购款	219,264,053.51	-452,156,730.27	-232,892,676.76
基金赎回款	-140,155,544.59	264,808,834.18	124,653,289.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	421,542,044.01	-1,217,433,609.76	-795,891,565.75

6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	955,542.32
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	30,598.29	
其他	-	
合计	986,140.61	

6.4.3.10 股票投资收益

6.4.3.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,937,520,512.62
减: 卖出股票成本总额	2,286,358,888.87
买卖股票差价收入	-348,838,376.25

6.4.3.11 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	25,156,793.77
基金投资产生的股利收益	-
合计	25,156,793.77

6.4.3.12 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	580,627,360.26
——股票投资	580,627,360.26
——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	580,627,360.26

6.4.3.13 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,561,629.44
合计	1,561,629.44

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。

6.4.3.14 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期
----	----

	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	6,490,011.30
银行间市场交易费用	-
合计	6,490,011.30

6.4.3.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
银行汇划费	10,391.57
信息披露费	149,179.94
审计费	50,721.58
账户维护费	50.00
指数使用费	485,244.11
上市费	29,835.26
合计	725,422.46

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

无。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	688,353,043.38	15.59%	447,082,586.14	12.78%

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 2012年1月1日至2012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	559,293.23	15.07%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%

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 2012年1月1日至2012年6月 30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	14,557,322.96
其中：支付销售机构的客户维护费	3,366,840.48	2,792,322.55

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。

6.4.6.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,911,464.55	2,324,245.12

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 × 0.12% / 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	
	2012年1月1日至2012年6月30日		2011年1月1日至2011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	270,001,273.21	955,542.32	214,798,003.76	743,175.67

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 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.7.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.7.2 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
600499	科达机电	2012年6月20日	重大事项停牌	10.28	2012年7月2日	10.11	1,482,164	21,644,421.66	15,236,645.92	-
600780	通宝能源	2012年1月18日	重大事项停牌	6.70	-	-	1,247,145	8,272,487.54	8,355,871.50	-
000767	*ST漳电	2012年6月1日	重大事项停牌	3.72	2012年7月27日	3.90	1,954,352	8,270,696.69	7,270,189.44	-

注：本基金截至 2012 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌

的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.8 金融工具风险及管理

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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 2012 年 06 月 30 日,本基金未持有信用类债券。

6.4.8.3 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 6.4.7 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。

6.4.8.4 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。

6.4.8.4.1 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、结算备付金及债券投资等。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。

6.4.8.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期末 2012 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	270,001,273.21	-	-	-	270,001,273.21
结算备付金	1,272,561.99	-	-	-	1,272,561.99
存出保证金	-	-	-	1,586,663.24	1,586,663.24
交易性金融资产	-	-	-	4,634,505,450.58	4,634,505,450.58
应收证券清算款	-	-	-	11,673,275.05	11,673,275.05
应收利息	-	-	-	45,658.33	45,658.33
应收股利	-	-	-	464,418.77	464,418.77
应收申购款	255,027.11	-	-	6,568,325.85	6,823,352.96
资产总计	271,528,862.31	-	-	4,654,843,791.82	4,926,372,654.13
负债					
应付证券清算款	-	-	-	30,393,262.48	30,393,262.48
应付赎回款	-	-	-	5,043,201.84	5,043,201.84
应付管理人报酬	-	-	-	2,453,949.74	2,453,949.74
应付托管费	-	-	-	490,789.92	490,789.92
应付交易费用	-	-	-	1,471,391.36	1,471,391.36
其他负债	-	-	-	1,950,423.14	1,950,423.14
负债总计	-	-	-	41,803,018.48	41,803,018.48
利率敏感度缺口	271,528,862.31	-	-	4,613,040,773.34	4,884,569,635.65
上年度末 2011 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	220,681,198.52	-	-	-	220,681,198.52
结算备付金	4,084,350.08	-	-	-	4,084,350.08
存出保证金	-	-	-	1,072,000.86	1,072,000.86
交易性金融资产	-	-	-	3,804,627,867.53	3,804,627,867.53
应收利息	-	-	-	45,626.84	45,626.84
应收申购款	23,311,191.36	-	-	2,121,472.92	25,432,664.28
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	248,076,739.96	-	-	3,807,866,968.15	4,055,943,708.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	17,121,087.36	17,121,087.36
应付管理人报酬	-	-	-	2,208,748.16	2,208,748.16
应付托管费	-	-	-	441,749.65	441,749.65

应付交易费用	-	-	-	909,767.02	909,767.02
其他负债	-	-	-	1,684,183.68	1,684,183.68
负债总计	-	-	-	22,365,535.87	22,365,535.87
利率敏感度缺口	248,076,739.96	-	-	-3,785,501,432.28	4,033,578,172.24

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。

6.4.8.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 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	4,634,505,450.58	94.88	3,804,627,867.53	94.32
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	4,634,505,450.58	94.88	3,804,627,867.53	94.32

6.4.8.4.2.2 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 (2012 年 6 月 30 日)	上年度末 (2011 年 12 月 31 日)
	中证 500 指数上升 5%	增加约 24,423 万	增加约 20,168 万
	中证 500 指数下降 5%	减少约 24,423 万	减少约 20,168 万

6.4.9 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	4,634,505,450.58	94.08
	其中: 股票	4,634,505,450.58	94.08
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	271,273,835.20	5.51
6	其他各项资产	20,593,368.35	0.42
7	合计	4,926,372,654.13	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	79,303,619.80	1.62
B	采掘业	104,575,828.43	2.14
C	制造业	2,629,891,117.83	53.84
C0	食品、饮料	280,805,285.82	5.75
C1	纺织、服装、皮毛	137,324,577.58	2.81
C2	木材、家具	17,141,083.04	0.35
C3	造纸、印刷	83,355,202.50	1.71
C4	石油、化学、塑胶、塑料	485,084,935.92	9.93
C5	电子	235,349,329.69	4.82
C6	金属、非金属	302,662,310.47	6.20
C7	机械、设备、仪表	719,016,427.42	14.72
C8	医药、生物制品	344,468,592.94	7.05
C99	其他制造业	24,683,372.45	0.51
D	电力、煤气及水的生产和供应业	194,560,434.15	3.98
E	建筑业	113,150,926.86	2.32
F	交通运输、仓储业	169,595,242.80	3.47
G	信息技术业	236,472,943.53	4.84
H	批发和零售贸易	337,541,086.55	6.91
I	金融、保险业	62,896,060.24	1.29
J	房地产业	447,540,786.62	9.16
K	社会服务业	150,420,496.78	3.08
L	传播与文化产业	101,122,528.15	2.07
M	综合类	7,434,378.84	0.15
	合计	4,634,505,450.58	94.88

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	000799	酒鬼酒	570,391	29,888,488.40	0.61
2	600199	金种子酒	1,138,149	28,430,962.02	0.58
3	600079	人福医药	1,154,870	26,781,435.30	0.55
4	600702	沱牌舍得	690,740	25,039,325.00	0.51
5	000917	电广传媒	973,150	24,065,999.50	0.49
6	600300	维维股份	2,445,753	23,185,738.44	0.47

7	600366	宁波韵升	1,053,641	21,873,587.16	0.45
8	600138	中青旅	1,215,069	21,846,940.62	0.45
9	600637	百视通	1,629,045	21,340,489.50	0.44
10	002029	七匹狼	735,124	20,436,447.20	0.42
11	600478	科力远	736,797	20,387,172.99	0.42
12	600570	恒生电子	1,459,673	20,026,713.56	0.41
13	000826	桑德环境	874,362	20,022,889.80	0.41
14	000522	白云山 A	960,579	19,538,176.86	0.40
15	000750	国海证券	1,572,692	19,469,926.96	0.40
16	000963	华东医药	634,893	19,173,768.60	0.39
17	000939	凯迪电力	2,258,846	19,155,014.08	0.39
18	600157	永泰能源	2,068,355	18,780,663.40	0.38
19	600643	爱建股份	2,263,928	18,677,406.00	0.38
20	600340	华夏幸福	1,031,832	18,665,840.88	0.38
21	600436	片仔癀	209,518	18,414,537.02	0.38
22	002250	联化科技	1,056,775	18,229,368.75	0.37
23	002152	广电运通	1,092,847	18,031,975.50	0.37
24	600635	大众公用	3,849,705	17,939,625.30	0.37
25	002051	中工国际	670,445	17,807,019.20	0.36
26	600141	兴发集团	855,403	17,698,288.07	0.36
27	000877	天山股份	1,802,287	17,572,298.25	0.36
28	002230	科大讯飞	884,877	17,432,076.90	0.36
29	000998	隆平高科	973,105	17,350,462.15	0.36
30	002065	东华软件	776,305	17,233,971.00	0.35
31	000793	华闻传媒	2,785,326	17,213,314.68	0.35
32	600200	江苏吴中	1,824,491	16,712,337.56	0.34
33	000540	中天城投	2,244,708	16,565,945.04	0.34
34	000539	粤电力 A	2,495,054	16,467,356.40	0.34
35	600325	华发股份	1,912,251	16,292,378.52	0.33
36	600601	方正科技	6,421,148	16,117,081.48	0.33
37	600059	古越龙山	1,114,344	15,901,688.88	0.33
38	000690	宝新能源	3,617,770	15,882,010.30	0.33
39	600332	广州药业	691,629	15,852,136.68	0.32
40	600008	首创股份	3,218,190	15,736,949.10	0.32
41	600311	荣华实业	1,947,237	15,577,896.00	0.32
42	000926	福星股份	1,667,162	15,571,293.08	0.32
43	600805	悦达投资	1,659,562	15,483,713.46	0.32
44	600717	天津港	2,449,821	15,482,868.72	0.32
45	600816	安信信托	929,950	15,455,769.00	0.32

46	600750	江中药业	546,123	15,242,292.93	0.31
47	600499	科达机电	1,482,164	15,236,645.92	0.31
48	600158	中体产业	1,974,698	15,145,933.66	0.31
49	600879	航天电子	1,898,130	14,957,264.40	0.31
50	600072	中船股份	839,817	14,915,149.92	0.31
51	600675	中华企业	3,186,227	14,911,542.36	0.31
52	002477	雏鹰农牧	781,099	14,723,716.15	0.30
53	600594	益佰制药	738,855	14,629,329.00	0.30
54	600747	大连控股	3,113,666	14,540,820.22	0.30
55	600426	华鲁恒升	1,952,737	14,430,726.43	0.30
56	002450	康得新	906,307	14,419,344.37	0.30
57	600239	云南城投	1,686,268	14,316,415.32	0.29
58	000650	仁和药业	1,659,414	14,237,772.12	0.29
59	600522	中天科技	1,648,844	14,064,639.32	0.29
60	000762	西藏矿业	974,756	13,958,505.92	0.29
61	000400	许继电气	885,302	13,872,682.34	0.28
62	600210	紫江企业	3,362,572	13,853,796.64	0.28
63	600636	三爱富	711,055	13,758,914.25	0.28
64	000816	江淮动力	2,548,207	13,632,907.45	0.28
65	600755	厦门国贸	2,725,398	13,626,990.00	0.28
66	000830	鲁西化工	2,999,668	13,618,492.72	0.28
67	002129	中环股份	1,059,242	13,611,259.70	0.28
68	000518	四环生物	3,012,014	13,433,582.44	0.28
69	002008	大族激光	2,138,819	13,431,783.32	0.27
70	600312	平高电气	1,916,718	13,417,026.00	0.27
71	600820	隧道股份	1,502,128	13,368,939.20	0.27
72	000541	佛山照明	1,542,757	13,313,992.91	0.27
73	601588	北辰实业	4,669,115	13,306,977.75	0.27
74	600458	时代新材	1,059,417	13,295,683.35	0.27
75	002005	德豪润达	1,706,203	13,274,259.34	0.27
76	002063	远光软件	904,863	13,129,562.13	0.27
77	600572	康恩贝	1,234,990	13,127,943.70	0.27
78	600787	中储股份	1,474,681	13,095,167.28	0.27
79	600110	中科英华	3,365,234	13,057,107.92	0.27
80	000683	远兴能源	2,298,324	12,985,530.60	0.27
81	000550	江铃汽车	607,630	12,972,900.50	0.27
82	600586	金晶科技	2,913,445	12,964,830.25	0.27
83	600844	丹化科技	1,026,537	12,841,977.87	0.26
84	600880	博瑞传播	1,286,059	12,822,008.23	0.26

85	600616	金枫酒业	898,365	12,801,701.25	0.26
86	600269	赣粤高速	3,416,100	12,776,214.00	0.26
87	000616	亿城股份	3,486,821	12,761,764.86	0.26
88	600978	宜华木业	2,697,728	12,760,253.44	0.26
89	600651	飞乐音响	1,801,756	12,720,397.36	0.26
90	600220	江苏阳光	4,173,796	12,646,601.88	0.26
91	000823	超声电子	901,955	12,582,272.25	0.26
92	600557	康缘药业	851,145	12,579,923.10	0.26
93	600858	银座股份	1,064,987	12,545,546.86	0.26
94	002022	科华生物	1,152,113	12,500,426.05	0.26
95	600517	置信电气	1,086,052	12,457,016.44	0.26
96	000735	罗牛山	2,574,857	12,436,559.31	0.25
97	600653	申华控股	5,109,071	12,415,042.53	0.25
98	600867	通化东宝	1,589,535	12,382,477.65	0.25
99	600388	龙净环保	500,356	12,378,807.44	0.25
100	000860	顺鑫农业	769,813	12,332,404.26	0.25
101	000503	海虹控股	2,103,654	12,222,229.74	0.25
102	000028	国药一致	409,420	12,192,527.60	0.25
103	600112	长征电气	1,042,813	12,169,627.71	0.25
104	600064	南京高科	1,057,163	12,157,374.50	0.25
105	600351	亚宝药业	1,851,744	12,054,853.44	0.25
106	000031	中粮地产	2,653,030	12,044,756.20	0.25
107	600122	宏图高科	2,651,180	12,036,357.20	0.25
108	600704	物产中大	1,349,060	12,020,124.60	0.25
109	600584	长电科技	2,495,887	11,980,257.60	0.25
110	600872	中炬高新	2,330,603	11,932,687.36	0.24
111	600425	青松建化	1,008,402	11,929,395.66	0.24
112	600521	华海药业	787,850	11,904,413.50	0.24
113	002311	海大集团	664,576	11,869,327.36	0.24
114	600298	安琪酵母	482,166	11,866,105.26	0.24
115	000759	中百集团	1,593,842	11,858,184.48	0.24
116	002154	报喜鸟	868,642	11,839,590.46	0.24
117	000652	泰达股份	3,021,751	11,815,046.41	0.24
118	600511	国药股份	840,413	11,765,782.00	0.24
119	002123	荣信股份	1,032,091	11,734,874.67	0.24
120	000900	现代投资	817,406	11,639,861.44	0.24
121	600720	祁连山	1,111,474	11,637,132.78	0.24
122	000636	风华高科	1,570,371	11,620,745.40	0.24
123	000006	深振业 A	2,025,346	11,564,725.66	0.24

124	601002	晋亿实业	1,080,189	11,558,022.30	0.24
125	600067	冠城大通	2,065,663	11,505,742.91	0.24
126	000417	合肥百货	912,661	11,453,895.55	0.23
127	600597	光明乳业	1,227,800	11,443,096.00	0.23
128	000612	焦作万方	983,291	11,416,008.51	0.23
129	000488	晨鸣纸业	2,605,540	11,386,209.80	0.23
130	000415	渤海租赁	1,485,356	11,348,119.84	0.23
131	000667	名流置业	5,241,700	11,322,072.00	0.23
132	000850	华茂股份	1,656,390	11,263,452.00	0.23
133	000848	承德露露	640,653	11,243,460.15	0.23
134	600326	西藏天路	1,120,563	11,183,218.74	0.23
135	002506	超日太阳	925,327	11,122,430.54	0.23
136	000501	鄂武商 A	741,969	11,040,498.72	0.23
137	600575	芜湖港	1,424,942	11,029,051.08	0.23
138	000598	兴蓉投资	1,349,939	11,002,002.85	0.23
139	000930	中粮生化	2,257,126	10,969,632.36	0.22
140	600410	华胜天成	1,334,715	10,944,663.00	0.22
141	000786	北新建材	841,264	10,885,956.16	0.22
142	000829	天音控股	1,662,113	10,836,976.76	0.22
143	000897	津滨发展	3,785,060	10,825,271.60	0.22
144	600815	厦工股份	1,168,699	10,810,465.75	0.22
145	000988	华工科技	782,126	10,769,875.02	0.22
146	600161	天坛生物	753,915	10,758,367.05	0.22
147	000571	新大洲 A	2,153,372	10,702,258.84	0.22
148	600525	长园集团	1,515,680	10,700,700.80	0.22
149	002408	齐翔腾达	656,122	10,668,543.72	0.22
150	000997	新大陆	1,044,908	10,605,816.20	0.22
151	000975	科学城	1,275,616	10,587,612.80	0.22
152	000601	韶能股份	2,770,450	10,583,119.00	0.22
153	600236	桂冠电力	2,668,607	10,567,683.72	0.22
154	600765	中航重机	1,365,500	10,528,005.00	0.22
155	600736	苏州高新	1,856,946	10,510,314.36	0.22
156	000078	海王生物	1,527,147	10,491,499.89	0.21
157	600439	瑞贝卡	1,931,798	10,470,345.16	0.21
158	002482	广田股份	598,989	10,452,358.05	0.21
159	002097	山河智能	1,203,700	10,448,116.00	0.21
160	002011	盾安环境	980,523	10,442,569.95	0.21
161	002237	恒邦股份	266,343	10,382,050.14	0.21
162	000962	东方钽业	773,830	10,338,368.80	0.21

163	600021	上海电力	1,877,938	10,328,659.00	0.21
164	002294	信立泰	382,484	10,327,068.00	0.21
165	600835	上海机电	1,179,760	10,299,304.80	0.21
166	000627	天茂集团	3,167,953	10,295,847.25	0.21
167	002168	深圳惠程	1,107,459	10,277,219.52	0.21
168	001696	宗申动力	1,735,580	10,274,633.60	0.21
169	000511	银基发展	2,702,736	10,270,396.80	0.21
170	000426	兴业矿业	768,735	10,262,612.25	0.21
171	000927	一汽夏利	1,400,056	10,262,410.48	0.21
172	000685	中山公用	700,948	10,226,831.32	0.21
173	000659	珠海中富	3,008,992	10,170,392.96	0.21
174	600240	华业地产	1,132,151	10,166,715.98	0.21
175	600491	龙元建设	1,663,336	10,079,816.16	0.21
176	600428	中远航运	2,472,725	10,063,990.75	0.21
177	002161	远望谷	1,298,540	10,050,699.60	0.21
178	002140	东华科技	521,997	10,048,442.25	0.21
179	600993	马应龙	582,003	10,039,551.75	0.21
180	600176	中国玻纤	1,021,153	10,037,933.99	0.21
181	600884	杉杉股份	841,415	10,004,424.35	0.20
182	000973	佛塑科技	2,150,415	9,999,429.75	0.20
183	600740	山西焦化	1,158,493	9,997,794.59	0.20
184	600069	银鸽投资	1,690,277	9,972,634.30	0.20
185	600654	飞乐股份	2,208,925	9,962,251.75	0.20
186	600017	日照港	3,599,197	9,933,783.72	0.20
187	600251	冠农股份	529,687	9,921,037.51	0.20
188	000959	首钢股份	3,479,957	9,917,877.45	0.20
189	600759	正和股份	1,784,701	9,887,243.54	0.20
190	600724	宁波富达	1,268,415	9,868,268.70	0.20
191	600596	新安股份	1,589,585	9,839,531.15	0.20
192	000655	金岭矿业	870,817	9,779,274.91	0.20
193	600195	中牧股份	570,440	9,731,706.40	0.20
194	600851	海欣股份	1,727,738	9,692,610.18	0.20
195	600330	天通股份	1,378,061	9,687,768.83	0.20
196	002233	塔牌集团	1,046,938	9,673,707.12	0.20
197	600531	豫光金铅	518,285	9,629,735.30	0.20
198	000726	鲁泰 A	1,325,255	9,594,846.20	0.20
199	600611	大众交通	1,829,422	9,586,171.28	0.20
200	002056	横店东磁	601,068	9,569,002.56	0.20
201	002277	友阿股份	612,955	9,568,227.55	0.20

202	600078	澄星股份	1,163,029	9,525,207.51	0.20
203	600033	福建高速	4,014,411	9,474,009.96	0.19
204	000682	东方电子	2,861,656	9,472,081.36	0.19
205	600790	轻纺城	1,448,195	9,471,195.30	0.19
206	002475	立讯精密	320,332	9,465,810.60	0.19
207	600685	广船国际	641,327	9,459,573.25	0.19
208	600409	三友化工	1,443,548	9,426,368.44	0.19
209	000572	海马汽车	2,886,679	9,410,573.54	0.19
210	002429	兆驰股份	829,421	9,372,457.30	0.19
211	600496	精工钢构	1,201,250	9,309,687.50	0.19
212	000563	陕国投 A	676,836	9,292,958.28	0.19
213	600797	浙大网新	1,970,682	9,281,912.22	0.19
214	000088	盐田港	2,272,731	9,272,742.48	0.19
215	600831	广电网络	1,153,824	9,265,206.72	0.19
216	600171	上海贝岭	1,577,025	9,241,366.50	0.19
217	600322	天房发展	2,587,751	9,238,271.07	0.19
218	002223	鱼跃医疗	622,045	9,237,368.25	0.19
219	600503	华丽家族	1,999,412	9,197,295.20	0.19
220	002293	罗莱家纺	123,052	9,179,679.20	0.19
221	600197	伊力特	659,997	9,167,358.33	0.19
222	600004	白云机场	1,345,717	9,164,332.77	0.19
223	000861	海印股份	575,948	9,157,573.20	0.19
224	600509	天富热电	1,150,926	9,115,333.92	0.19
225	600545	新疆城建	1,581,657	9,078,711.18	0.19
226	002048	宁波华翔	1,294,678	9,075,692.78	0.19
227	600761	安徽合力	1,052,628	9,073,653.36	0.19
228	600151	航天机电	1,399,955	9,057,708.85	0.19
229	600198	大唐电信	899,028	9,053,211.96	0.19
230	002254	泰和新材	801,820	9,052,547.80	0.19
231	002340	格林美	678,251	9,027,520.81	0.18
232	000510	金路集团	1,782,124	9,017,547.44	0.18
233	600261	阳光照明	755,220	8,987,118.00	0.18
234	000513	丽珠集团	322,521	8,962,858.59	0.18
235	600139	西部资源	968,206	8,897,813.14	0.18
236	600801	华新水泥	710,638	8,897,187.76	0.18
237	600380	健康元	1,808,955	8,845,789.95	0.18
238	601880	大连港	2,951,870	8,826,091.30	0.18
239	600737	中粮屯河	1,470,953	8,766,879.88	0.18
240	002410	广联达	355,478	8,723,430.12	0.18

241	000932	华菱钢铁	3,528,905	8,610,528.20	0.18
242	002041	登海种业	411,937	8,564,170.23	0.18
243	002028	思源电气	771,742	8,558,618.78	0.18
244	600063	皖维高新	3,067,332	8,557,856.28	0.18
245	600308	华泰股份	2,390,988	8,535,827.16	0.17
246	600435	北方导航	1,089,271	8,528,991.93	0.17
247	600628	新世界	1,244,653	8,525,873.05	0.17
248	600773	西藏城投	673,650	8,514,936.00	0.17
249	002006	精工科技	798,917	8,500,476.88	0.17
250	600284	浦东建设	1,166,093	8,489,157.04	0.17
251	002025	航天电器	579,233	8,427,840.15	0.17
252	000717	韶钢松山	3,418,933	8,376,385.85	0.17
253	600780	通宝能源	1,247,145	8,355,871.50	0.17
254	600227	赤天化	2,224,295	8,341,106.25	0.17
255	002646	青青稞酒	263,333	8,339,756.11	0.17
256	600268	国电南自	929,111	8,296,961.23	0.17
257	600963	岳阳林纸	1,973,316	8,287,927.20	0.17
258	600387	海越股份	903,683	8,277,736.28	0.17
259	600416	湘电股份	1,246,103	8,274,123.92	0.17
260	600289	亿阳信通	1,351,012	8,268,193.44	0.17
261	600038	哈飞股份	493,418	8,235,146.42	0.17
262	000712	锦龙股份	623,833	8,209,642.28	0.17
263	600086	东方金钰	618,353	8,137,525.48	0.17
264	002470	金正大	614,357	8,134,086.68	0.17
265	600723	首商股份	963,071	8,089,796.40	0.17
266	600103	青山纸业	2,485,164	8,076,783.00	0.17
267	600888	新疆众和	781,605	8,073,979.65	0.17
268	600580	卧龙电气	1,609,556	8,063,875.56	0.17
269	600482	风帆股份	944,087	8,053,062.11	0.16
270	600662	强生控股	1,848,933	8,024,369.22	0.16
271	000886	海南高速	2,314,255	8,007,322.30	0.16
272	002428	云南锗业	382,096	7,997,269.28	0.16
273	600056	中国医药	363,874	7,987,034.30	0.16
274	600612	老凤祥	309,189	7,961,616.75	0.16
275	600292	九龙电力	599,030	7,943,137.80	0.16
276	000852	江钻股份	468,501	7,941,091.95	0.16
277	000777	中核科技	373,926	7,848,706.74	0.16
278	600830	香溢融通	930,408	7,834,035.36	0.16
279	600449	宁夏建材	839,548	7,824,587.36	0.16

280	600329	中新药业	631,117	7,819,539.63	0.16
281	000099	中信海直	901,574	7,816,646.58	0.16
282	000931	中关村	1,382,005	7,808,328.25	0.16
283	002249	大洋电机	837,948	7,792,916.40	0.16
284	000159	国际实业	985,319	7,784,020.10	0.16
285	000525	红太阳	593,586	7,775,976.60	0.16
286	600106	重庆路桥	2,124,476	7,775,582.16	0.16
287	600995	文山电力	1,119,994	7,750,358.48	0.16
288	600163	福建南纸	1,511,641	7,679,136.28	0.16
289	600707	彩虹股份	1,293,190	7,655,684.80	0.16
290	002181	粤传媒	809,792	7,652,534.40	0.16
291	000066	长城电脑	1,936,119	7,628,308.86	0.16
292	600748	上实发展	1,267,799	7,619,471.99	0.16
293	600961	株冶集团	771,534	7,591,894.56	0.16
294	600467	好当家	1,068,548	7,586,690.80	0.16
295	600533	栖霞建设	1,843,049	7,574,931.39	0.16
296	002479	富春环保	500,895	7,553,496.60	0.15
297	600270	外运发展	1,059,570	7,544,138.40	0.15
298	002292	奥飞动漫	359,444	7,526,757.36	0.15
299	000822	山东海化	1,571,207	7,510,369.46	0.15
300	002332	仙琚制药	599,306	7,491,325.00	0.15
301	600408	安泰集团	2,061,788	7,484,290.44	0.15
302	000506	中润资源	905,907	7,473,732.75	0.15
303	002191	劲嘉股份	751,269	7,452,588.48	0.15
304	000090	深天健	1,028,640	7,437,067.20	0.15
305	000301	东方市场	2,494,758	7,434,378.84	0.15
306	600479	千金药业	624,231	7,428,348.90	0.15
307	601616	广电电气	1,636,924	7,415,265.72	0.15
308	600622	嘉宝集团	1,203,716	7,402,853.40	0.15
309	000887	中鼎股份	871,479	7,398,856.71	0.15
310	002083	孚日股份	1,647,302	7,396,385.98	0.15
311	002308	威创股份	750,576	7,393,173.60	0.15
312	600127	金健米业	1,592,839	7,390,772.96	0.15
313	600581	八一钢铁	1,121,107	7,388,095.13	0.15
314	600578	京能热电	921,173	7,378,595.73	0.15
315	600373	中文传媒	509,377	7,314,653.72	0.15
316	000656	金科股份	677,881	7,287,220.75	0.15
317	000767	*ST 漳电	1,954,352	7,270,189.44	0.15
318	600825	新华传媒	1,222,733	7,263,034.02	0.15

319	600117	西宁特钢	1,301,041	7,259,808.78	0.15
320	600824	益民集团	1,498,946	7,254,898.64	0.15
321	000410	沈阳机床	957,502	7,248,290.14	0.15
322	600121	郑州煤电	920,272	7,214,932.48	0.15
323	600295	鄂尔多斯	716,172	7,061,455.92	0.14
324	600290	华仪电气	1,078,861	7,034,173.72	0.14
325	600589	广东榕泰	1,232,229	7,011,383.01	0.14
326	600487	亨通光电	363,514	6,986,739.08	0.14
327	600874	创业环保	1,272,289	6,946,697.94	0.14
328	000987	广州友谊	525,097	6,941,782.34	0.14
329	000755	山西三维	961,021	6,909,740.99	0.14
330	002424	贵州百灵	412,863	6,898,940.73	0.14
331	002309	中利科技	703,001	6,847,229.74	0.14
332	600866	星湖科技	1,288,119	6,827,030.70	0.14
333	600869	三普药业	289,626	6,791,729.70	0.14
334	600481	双良节能	947,858	6,786,663.28	0.14
335	002078	太阳纸业	1,175,876	6,784,804.52	0.14
336	600569	安阳钢铁	2,801,129	6,778,732.18	0.14
337	000698	沈阳化工	1,353,530	6,754,114.70	0.14
338	000608	阳光股份	1,316,373	6,752,993.49	0.14
339	600510	黑牡丹	930,885	6,748,916.25	0.14
340	600339	天利高新	1,183,977	6,736,829.13	0.14
341	002283	天润曲轴	818,241	6,685,028.97	0.14
342	600468	百利电气	533,880	6,678,838.80	0.14
343	600337	美克股份	1,110,500	6,663,000.00	0.14
344	000912	泸天化	855,703	6,648,812.31	0.14
345	002393	力生制药	213,531	6,634,408.17	0.14
346	600107	美尔雅	842,589	6,631,175.43	0.14
347	002465	海格通信	291,869	6,596,239.40	0.14
348	000979	中弘股份	888,299	6,573,412.60	0.13
349	601000	唐山港	989,947	6,573,248.08	0.13
350	601107	四川成渝	1,898,182	6,567,709.72	0.13
351	002242	九阳股份	890,440	6,553,638.40	0.13
352	600246	万通地产	1,779,875	6,549,940.00	0.13
353	002440	闰土股份	448,790	6,516,430.80	0.13
354	600602	仪电电子	1,543,942	6,515,435.24	0.13
355	600673	东阳光铝	726,279	6,500,197.05	0.13
356	002179	中航光电	469,964	6,447,906.08	0.13
357	000554	泰山石油	1,125,285	6,447,883.05	0.13

358	002601	佰利联	82,519	6,444,733.90	0.13
359	601010	文峰股份	432,471	6,430,843.77	0.13
360	002612	朗姿股份	175,504	6,388,345.60	0.13
361	600551	时代出版	591,841	6,368,209.16	0.13
362	000543	皖能电力	904,558	6,340,951.58	0.13
363	002342	巨力索具	842,500	6,318,750.00	0.13
364	600438	通威股份	1,005,656	6,315,519.68	0.13
365	000713	丰乐种业	611,990	6,309,616.90	0.13
366	601519	大智慧	1,219,873	6,306,743.41	0.13
367	002306	湘鄂情	585,080	6,289,610.00	0.13
368	600360	华微电子	1,586,947	6,252,571.18	0.13
369	600073	上海梅林	875,241	6,222,963.51	0.13
370	000919	金陵药业	737,246	6,207,611.32	0.13
371	601678	滨化股份	579,208	6,174,357.28	0.13
372	002121	科陆电子	696,137	6,167,773.82	0.13
373	002648	卫星石化	351,151	6,148,654.01	0.13
374	600162	香江控股	1,123,156	6,143,663.32	0.13
375	600223	鲁商置业	1,171,300	6,137,612.00	0.13
376	600429	三元股份	1,035,634	6,099,884.26	0.12
377	601100	恒立油缸	552,878	6,081,658.00	0.12
378	600590	泰豪科技	878,192	5,998,051.36	0.12
379	000708	大冶特钢	657,390	5,995,396.80	0.12
380	002183	怡亚通	976,145	5,983,768.85	0.12
381	000951	中国重汽	490,811	5,958,445.54	0.12
382	600864	哈投股份	959,066	5,946,209.20	0.12
383	600657	信达地产	1,337,793	5,926,422.99	0.12
384	600480	凌云股份	740,726	5,925,808.00	0.12
385	000903	云内动力	1,394,074	5,924,814.50	0.12
386	600618	氯碱化工	658,089	5,922,801.00	0.12
387	000936	华西股份	1,313,004	5,921,648.04	0.12
388	600507	方大特钢	1,521,870	5,920,074.30	0.12
389	600829	三精制药	508,934	5,913,813.08	0.12
390	000428	华天酒店	1,261,917	5,905,771.56	0.12
391	601886	江河幕墙	327,766	5,896,510.34	0.12
392	600789	鲁抗医药	1,190,939	5,859,419.88	0.12
393	600501	航天晨光	683,346	5,849,441.76	0.12
394	600226	升华拜克	830,485	5,846,614.40	0.12
395	002064	华峰氨纶	1,080,128	5,821,889.92	0.12
396	600776	东方通信	1,118,755	5,817,526.00	0.12

397	600469	风神股份	658,090	5,817,515.60	0.12
398	002252	上海莱士	429,714	5,805,436.14	0.12
399	601801	皖新传媒	532,490	5,772,191.60	0.12
400	600676	交运股份	1,261,484	5,752,367.04	0.12
401	600288	大恒科技	915,274	5,747,920.72	0.12
402	601777	力帆股份	835,050	5,703,391.50	0.12
403	600644	乐山电力	668,609	5,689,862.59	0.12
404	600710	常林股份	936,560	5,656,822.40	0.12
405	002285	世联地产	381,974	5,653,215.20	0.12
406	600633	浙报传媒	377,036	5,629,147.48	0.12
407	600475	华光股份	449,319	5,616,487.50	0.11
408	000837	秦川发展	816,105	5,614,802.40	0.11
409	600460	士兰微	1,269,904	5,612,975.68	0.11
410	600639	浦东金桥	786,232	5,574,384.88	0.11
411	000738	中航动控	551,658	5,516,580.00	0.11
412	600054	黄山旅游	369,028	5,509,588.04	0.11
413	600088	中视传媒	484,797	5,497,597.98	0.11
414	600641	万业企业	1,179,177	5,494,964.82	0.11
415	000050	深天马 A	839,997	5,485,180.41	0.11
416	000418	小天鹅 A	645,709	5,482,069.41	0.11
417	002091	江苏国泰	526,608	5,471,457.12	0.11
418	600231	凌钢股份	1,176,081	5,468,776.65	0.11
419	600782	新钢股份	1,222,944	5,466,559.68	0.11
420	600075	新疆天业	769,904	5,458,619.36	0.11
421	600810	神马股份	646,939	5,389,001.87	0.11
422	601126	四方股份	365,200	5,342,876.00	0.11
423	002238	天威视讯	374,936	5,335,339.28	0.11
424	600488	天药股份	952,969	5,327,096.71	0.11
425	002267	陕天然气	297,493	5,274,550.89	0.11
426	601011	宝泰隆	452,801	5,252,491.60	0.11
427	000042	深长城	280,228	5,248,670.44	0.11
428	002449	国星光电	628,988	5,226,890.28	0.11
429	600293	三峡新材	705,521	5,192,634.56	0.11
430	600328	兰太实业	630,412	5,131,553.68	0.11
431	002384	东山精密	449,320	5,122,248.00	0.10
432	000533	万家乐	1,212,619	5,080,873.61	0.10
433	600683	京投银泰	1,083,594	5,071,219.92	0.10
434	000620	新华联	934,999	5,058,344.59	0.10
435	002480	新筑股份	491,506	5,047,766.62	0.10

436	600563	法拉电子	329,090	5,021,913.40	0.10
437	600983	合肥三洋	623,441	4,987,528.00	0.10
438	000911	南宁糖业	503,110	4,935,509.10	0.10
439	002276	万马电缆	909,076	4,909,010.40	0.10
440	002345	潮宏基	210,631	4,884,532.89	0.10
441	002109	兴化股份	629,111	4,869,319.14	0.10
442	002437	誉衡药业	245,782	4,866,483.60	0.10
443	002218	拓日新能	573,029	4,824,904.18	0.10
444	601636	旗滨集团	609,703	4,767,877.46	0.10
445	000631	顺发恒业	917,556	4,725,413.40	0.10
446	000158	常山股份	1,261,823	4,719,218.02	0.10
447	600333	长春燃气	675,100	4,685,194.00	0.10
448	600277	亿利能源	897,109	4,593,198.08	0.09
449	002190	成飞集成	302,895	4,588,859.25	0.09
450	000514	渝开发	897,581	4,586,638.91	0.09
451	002585	双星新材	365,088	4,578,203.52	0.09
452	000893	东凌粮油	324,780	4,576,150.20	0.09
453	601311	骆驼股份	491,940	4,570,122.60	0.09
454	601999	出版传媒	644,685	4,564,369.80	0.09
455	002320	海峡股份	373,767	4,552,482.06	0.09
456	002463	沪电股份	1,020,368	4,550,841.28	0.09
457	002461	珠江啤酒	397,986	4,497,241.80	0.09
458	600386	北巴传媒	589,812	4,470,774.96	0.09
459	600725	云维股份	901,382	4,452,827.08	0.09
460	002498	汉缆股份	418,589	4,449,601.07	0.09
461	002232	启明信息	597,593	4,434,140.06	0.09
462	002194	武汉凡谷	650,537	4,417,146.23	0.09
463	600743	华远地产	1,109,711	4,394,455.56	0.09
464	002414	高德红外	263,275	4,380,896.00	0.09
465	002489	浙江永强	422,860	4,380,829.60	0.09
466	600287	江苏舜天	638,929	4,363,885.07	0.09
467	000949	新乡化纤	1,455,540	4,352,064.60	0.09
468	600061	中纺投资	878,789	4,306,066.10	0.09
469	002386	天原集团	561,468	4,267,156.80	0.09
470	002534	杭锅股份	234,302	4,212,749.96	0.09
471	002281	光迅科技	187,229	4,193,929.60	0.09
472	600178	东安动力	675,899	4,163,537.84	0.09
473	000517	荣安地产	620,991	4,110,960.42	0.08
474	000935	四川双马	540,549	4,081,144.95	0.08

475	000918	嘉凯城	1,055,556	4,053,335.04	0.08
476	600537	亿晶光电	284,261	4,036,506.20	0.08
477	002204	大连重工	251,082	3,992,203.80	0.08
478	600523	贵航股份	422,394	3,966,279.66	0.08
479	601208	东材科技	540,470	3,945,431.00	0.08
480	601908	京运通	503,090	3,939,194.70	0.08
481	002075	沙钢股份	922,252	3,919,571.00	0.08
482	002444	巨星科技	444,970	3,875,688.70	0.08
483	000925	众合机电	440,719	3,851,884.06	0.08
484	000732	泰禾集团	595,126	3,838,562.70	0.08
485	002326	永太科技	281,171	3,829,549.02	0.08
486	002574	明牌珠宝	210,569	3,699,697.33	0.08
487	002315	焦点科技	103,111	3,572,796.15	0.07
488	002362	汉王科技	313,150	3,472,833.50	0.07
489	000597	东北制药	488,300	3,369,270.00	0.07
490	000617	石油济柴	336,483	3,321,087.21	0.07
491	600258	首旅股份	270,792	3,300,954.48	0.07
492	002225	濮耐股份	427,435	3,231,408.60	0.07
493	600184	光电股份	183,800	3,165,036.00	0.06
494	000029	深深房 A	782,619	2,926,995.06	0.06
495	002383	合众思壮	164,337	2,801,945.85	0.06
496	002110	三钢闽光	469,244	2,787,309.36	0.06
497	002653	海思科	93,937	2,714,779.30	0.06
498	600819	耀皮玻璃	318,104	2,118,572.64	0.04
499	600623	双钱股份	182,476	1,773,666.72	0.04
500	002651	利君股份	96,600	1,518,552.00	0.03

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600827	友谊股份	32,416,529.18	0.80
2	600022	山东钢铁	23,586,114.90	0.58
3	002029	七匹狼	21,058,331.61	0.52
4	600157	永泰能源	19,741,791.24	0.49
5	000793	华闻传媒	19,333,423.00	0.48

6	000750	国海证券	19,031,621.19	0.47
7	600517	置信电气	18,948,353.83	0.47
8	600636	三爱富	18,799,002.73	0.47
9	600340	华夏幸福	18,572,575.56	0.46
10	002006	精功科技	18,534,054.39	0.46
11	600717	天津港	18,528,284.75	0.46
12	600635	大众公用	18,223,159.13	0.45
13	002152	广电运通	17,726,835.90	0.44
14	002005	德豪润达	16,722,324.65	0.41
15	600200	江苏吴中	16,552,972.74	0.41
16	000539	粤电力 A	16,418,623.13	0.41
17	000877	天山股份	16,061,084.30	0.40
18	600269	赣粤高速	15,981,280.09	0.40
19	600008	首创股份	15,811,368.93	0.39
20	000652	泰达股份	15,723,743.45	0.39

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

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	000970	中科三环	57,764,968.81	1.43
2	000581	威孚高科	33,271,418.18	0.82
3	600827	友谊股份	31,935,602.86	0.79
4	600060	海信电器	31,850,187.85	0.79
5	002236	大华股份	30,251,586.65	0.75
6	002038	双鹭药业	19,862,532.70	0.49
7	600160	巨化股份	19,295,477.22	0.48
8	600770	综艺股份	18,365,731.46	0.46
9	600022	山东钢铁	18,214,488.09	0.45
10	002353	杰瑞股份	17,549,438.01	0.44
11	601566	九牧王	16,354,362.17	0.41
12	000407	胜利股份	13,786,598.40	0.34
13	002344	海宁皮城	13,340,733.58	0.33
14	000594	国恒铁路	13,142,245.55	0.33
15	600259	广晟有色	12,696,219.35	0.31

16	000596	古井贡酒	12,540,452.03	0.31
17	002430	杭氧股份	10,817,138.36	0.27
18	600754	锦江股份	10,386,382.70	0.26
19	600087	*ST 长油	10,359,712.28	0.26
20	000537	广宇发展	10,307,092.69	0.26

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	2,534,238,317.86
卖出股票收入（成交）总额	1,937,520,512.62

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。

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	1,586,663.24
2	应收证券清算款	11,673,275.05
3	应收股利	464,418.77
4	应收利息	45,658.33
5	应收申购款	6,823,352.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,593,368.35

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
412,315	13,776.99	885,958,948.87	15.60%	4,794,502,252.53	84.40%

8.2 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	2,458,524.89	0.04%

注：本公司基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理未持有本基金份额，本公司高级管理人员持有本基金份额的数量区间为 50 万份至 100 万份（含）。

§ 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	4, 956, 039, 677. 38
本报告期基金总申购份额	2, 159, 183, 968. 35
减: 本报告期基金总赎回份额	1, 434, 762, 444. 33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	5, 680, 461, 201. 40

§ 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

本报告期内, 本基金管理人未发生重大人事变动。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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内, 无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	861,927,444.69	19.53%	748,351.63	20.16%	-
东方证券	1	825,788,988.65	18.71%	701,921.93	18.91%	-
招商证券	1	783,909,385.67	17.76%	657,619.92	17.72%	-
华泰证券	1	688,353,043.38	15.59%	559,293.23	15.07%	-
高华证券	1	399,791,170.23	9.06%	339,824.95	9.15%	-
江海证券	1	332,078,160.89	7.52%	270,430.17	7.29%	-
日信证券	1	247,256,448.79	5.60%	200,898.45	5.41%	-
东兴证券	1	220,310,469.13	4.99%	187,265.98	5.04%	-
瑞银证券	1	54,537,076.85	1.24%	46,356.55	1.25%	-
中天证券	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。

10.8 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加中信银行网上银行和移动银行优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012年6月29日
2	• 南方基金关于旗下部分基金参与交通银行网上银行	中国证券报、上海	2012年6月29日

	银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	证券报、证券时报	
3	• 关于注意防范冒用南方基金名义进行的非法证券活动的提示	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 6 月 25 日
4	• 南方基金管理有限公司网上直销关于开通电脑 PC 客户端交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 6 月 25 日
5	• 南方基金管理有限公司关于恢复直销电话交易服务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 6 月 5 日
6	• 南方基金关于旗下部分基金参加华融证券网上交易系统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	2012 年 5 月 31 日
7	• 南方基金关于旗下部分基金参加重庆银行网银申购及网银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	2012 年 5 月 22 日
8	• 南方基金管理有限公司关于旗下部分基金在渤海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	2012 年 5 月 21 日
9	• 南方基金关于旗下部分基金参加中国光大银行电子渠道定投申购费率四折优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 5 月 10 日
10	• 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	2012 年 5 月 2 日
11	• 南方基金管理有限公司关于旗下部分基金参加邮储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	2012 年 5 月 2 日
12	• 南方基金关于旗下部分基金参加国泰君安自助式交易系统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	2012 年 4 月 9 日
13	• 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	2012 年 3 月 31 日
14	• 南方基金关于南方价值与南方 500 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	2012 年 3 月 31 日
15	• 南方基金关于旗下部分基金参加江苏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	2012 年 3 月 31 日
16	• 南方基金关于开通电子直销汇款交易的公告	中国证券报、上海	2012 年 3 月 26 日

		证券报、证券时报	
17	• 南方基金关于开通光大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	2012 年 3 月 26 日
18	• 南方基金关于电子直销开通多交易账户的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 3 月 26 日
19	• 南方基金关于暂停直销电话交易系统服务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 3 月 23 日
20	• 南方基金关于暂停网上直销交易系统服务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 3 月 23 日
21	• 南方基金关于开展农行卡网上直销费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 3 月 6 日
22	• 南方基金关于旗下部分基金参加齐鲁证券网上交易系统网上委托申购及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	2012 年 2 月 13 日
23	• 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	2012 年 2 月 6 日
24	• 南方基金关于旗下部分基金增加华西证券为代销机构并开通定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 1 月 9 日
25	• 关于注意防范冒用南方基金名义进行的非法证券活动的提示	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 1 月 9 日

§ 11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 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

11.3 查阅方式

网站: <http://www.nffund.com>