

南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2012 年年度报告

2012 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
送出日期：2013 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 3 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	4
1.1 重要提示	4
1.2 目录	5
§2 基金简介	7
2.1 基金基本情况	7
2.2 基金产品说明	7
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	20
§8 投资组合报告	37
8.1 期末基金资产组合情况	37
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	38
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	53
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	53
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	53
8.9 投资组合报告附注	53
§9 基金份额持有人信息	54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
9.2 期末上市基金前十名持有人	54
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	55
§10 开放式基金份额变动	55
§11 重大事件揭示	55

11.1 基金份额持有人大会决议.....	55
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
11.4 基金投资策略的改变.....	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
11.8 其他重大事件.....	57
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§13 备查文件目录.....	60
13.1 备查文件目录.....	60
13.2 存放地点.....	60
13.3 查阅方式.....	60

§ 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	6, 205, 579, 059. 16 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
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.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、	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

	32、33 层整层	
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012 年	2011 年	2010 年
本期已实现收益	-539,300,925.90	11,100,370.73	382,178,312.08
本期利润	-38,751,033.20	-1,751,917,639.63	462,616,870.73
加权平均基金份额本期利润	-0.0067	-0.4512	0.1374
本期加权平均净值利润率	-0.80%	-41.31%	11.97%
本期基金份额净值增长率	-0.17%	-32.72%	9.40%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配利润	-1,163,346,449.63	-922,461,505.14	433,775,707.02
期末可供分配基金份额利润	-0.1875	-0.1861	0.1459
期末基金资产净值	5,042,232,609.53	4,033,578,172.24	3,658,934,810.92
期末基金份额净值	0.8125	0.8139	1.2310
3.1.3 累计期末指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
基金份额累计净值增长率	-13.59%	-13.44%	28.66%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

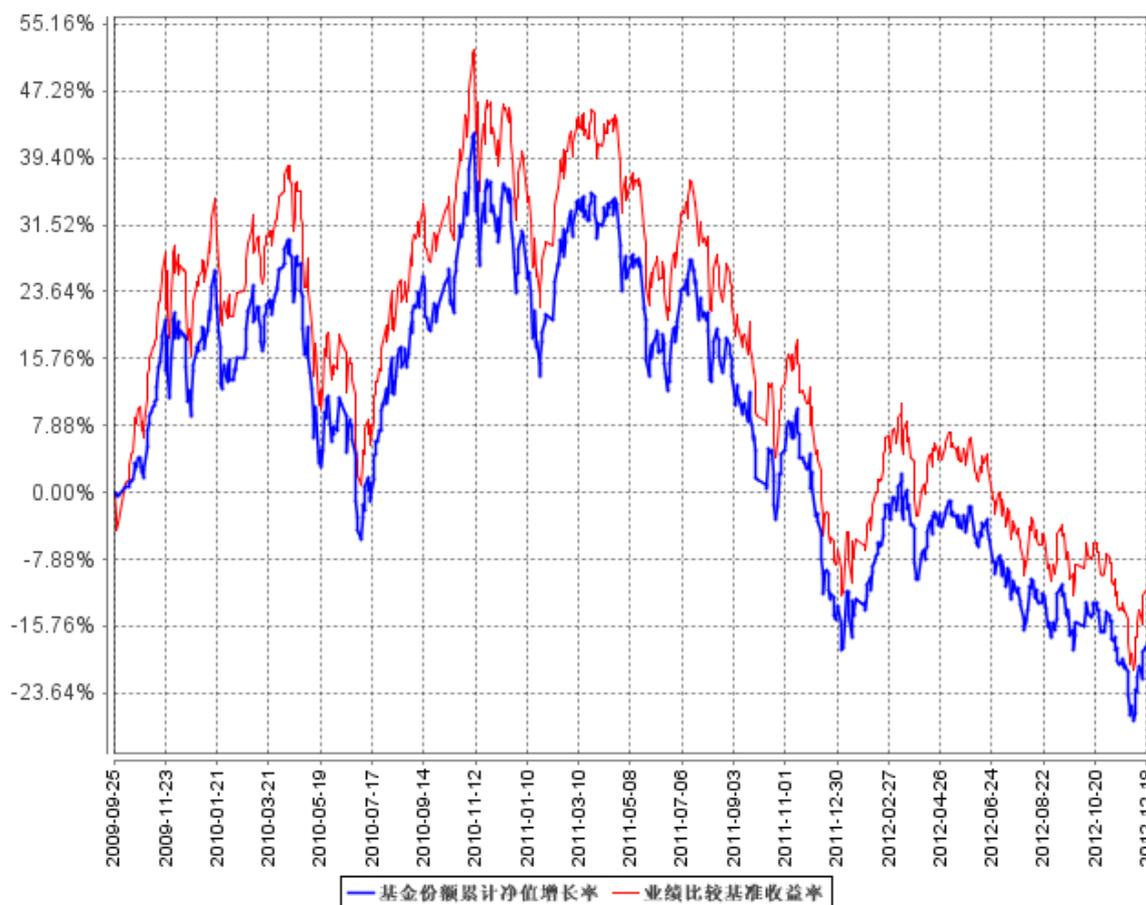
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.05%	1.37%	2.29%	1.37%	-0.24%	0.00%
过去六个月	-5.51%	1.39%	-5.28%	1.39%	-0.23%	0.00%
过去一年	-0.17%	1.46%	0.42%	1.46%	-0.59%	0.00%
过去三年	-26.52%	1.55%	-25.42%	1.55%	-1.10%	0.00%
自基金合同生效起至今	-13.59%	1.56%	-6.47%	1.58%	-7.12%	-0.02%

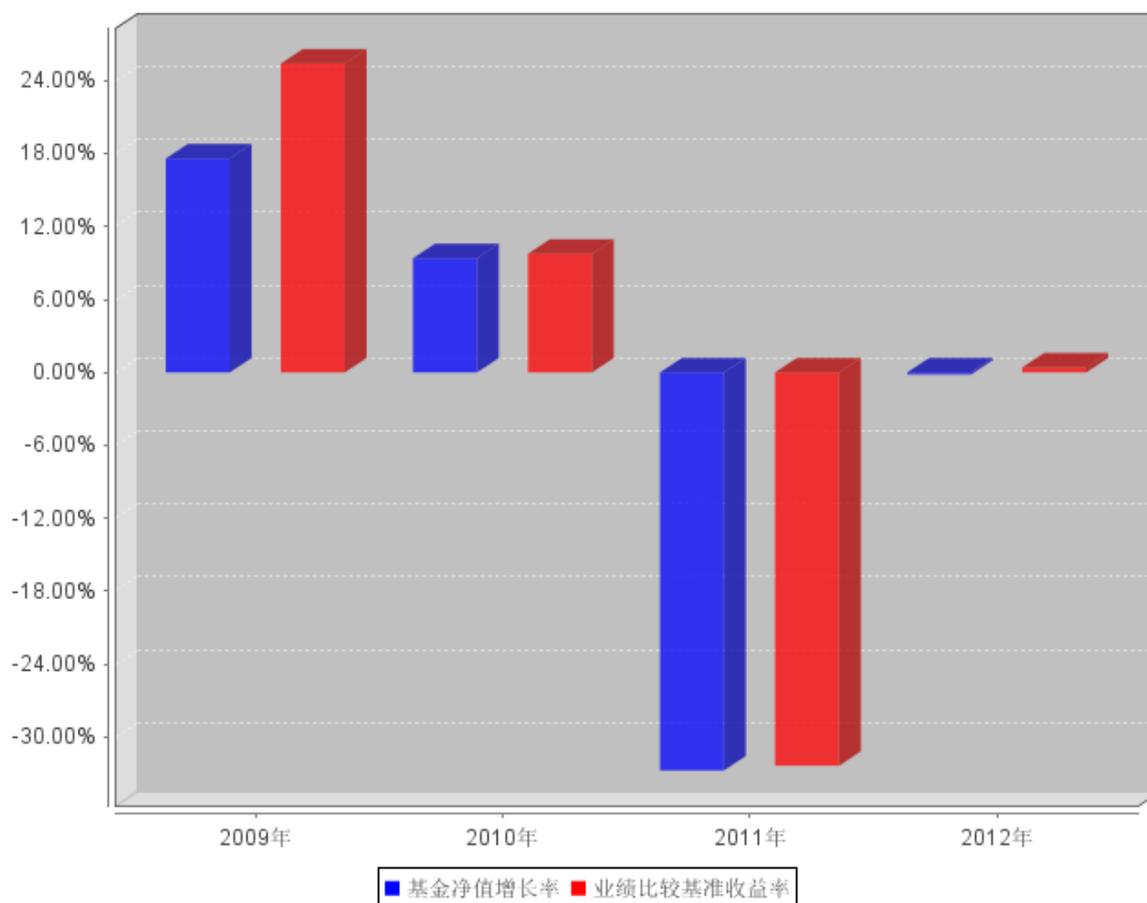
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012	-	-	-	-	
2011	0.2000	47,591,055.34	32,229,449.82	79,820,505.16	
2010	0.5000	116,331,049.37	55,660,508.35	171,991,557.72	
合计	0.7000	163,922,104.71	87,889,958.17	251,812,062.88	

§ 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2,300亿元，旗下管理37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	-	12	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、数量化投资部副总监等职务。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；2013年2月至今，任南方500ETF基金经理；2013年2月至今，任南方开元沪深300ETF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，除首任基金经理外，“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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 17 次。其中，14 次是由于指数型基金根据标的指数成份股调整而被动调仓所致；2 次是由于基金接受投资者大额申赎后，被动增减仓位或组合配置所致；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，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，主要股指在创出数年新低之后于年底展开升势，全年中证 500 指数涨幅为+0.28%。

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年内我们根据指数每半年一次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 0.332%，今年初至报告期末年化跟踪误差为 0.352%，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 0.8125 元，报告期内，份额净值增长率为-0.17%，同期业绩基准增长率为 0.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过 3 年的调整，中国经济增速已经从之前的百分之十几回调至 7.5%附近，事物必有循环规律，增速不可能持续下跌；而日本、韩国等发达国家处在和我国现在同样发展阶段时，经济增长速度也能够保持在 8%左右。因此中国经济未来几年保持 8%左右的增速是可行的，中国经济企稳回升将是大概率事件。

国际方面，美国经济已经处于复苏初期，失业率已经下降到警戒线以下，房价也在恢复性上升，苹果手机和页岩气开发等为美国经济的持续复苏注入了强劲动力，美联储已经表示未来将收紧印钞机器；欧债危机已告一段落，国外投资者已经开始买入希腊、西班牙等危机国家的国债，表明已经不担心这些国家的崩溃，欧洲央行也没有继续加印钞票的理由。因此，国际大宗商品价格未来将保持较低水平，而我国也将因此受益，物价水平也会继续保持低位，货币政策将保持适度宽松格局。伴随经济企稳回升、通胀水平较低、货币政策宽松，企业经营环境将大为好转，盈利能力的恢复有助于提升上市公司的分红收益率和成长性，股票资产的吸引力将逐步提升。

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。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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（1）进一步完善公司各项内部管理制度

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

（2）定期监察稽核工作与专项稽核工作相结合

按照证监会的要求对公司投资、研究、交易、信息技术、基金会计、注册登记、人力资源、基金销售等主要业务进行定期稽核工作。同时，对投资研究、信息技术、基金直销、后台运营等相关业务开展了专项稽核工作，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性等。

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

（4）继续做好反商业贿赂工作，从源头上控制销售风险

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

（5）对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训

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

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

（7）信息披露和投资者关系管理工作

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

(8) 积极配合人民银行开展反洗钱工作，按要求进行可疑交易的报送。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

根据上述分配原则，本报告期内未有收益分配事项。

§ 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 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，南方基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2013)第 20091 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人:
引言段	我们审计了后附的 南方中证 500 指数证券投资基金(LOF) (以下简称南方中证 500 指数基金”)的财务报表,包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年度 的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	一、管理层对财务报表的责任 编制和公允列报财务报表是 南方中证 500 指数基金 的基金管理人 南方基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;

	(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述 南方中证 500 指数基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了 南方中证 500 指数基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度 的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛竞 金毅
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	中国 · 上海市
审计报告日期	2013 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日： 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	306,626,406.73	220,681,198.52
结算备付金		760,713.71	4,084,350.08
存出保证金		818,622.50	1,072,000.86
交易性金融资产	7.4.7.2	4,810,124,476.46	3,804,627,867.53
其中：股票投资		4,808,879,676.46	3,804,627,867.53
基金投资		-	-
债券投资		1,244,800.00	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		43,804,552.52	-
应收利息	7.4.7.5	49,298.73	45,626.84
应收股利		-	-
应收申购款		4,488,528.20	25,432,664.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		5,166,672,598.85	4,055,943,708.11
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		81,151,367.23	-
应付赎回款		37,251,312.39	17,121,087.36
应付管理人报酬		2,337,388.62	2,208,748.16
应付托管费		467,477.74	441,749.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,449,110.52	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	7.4.7.8	1,783,332.82	1,684,183.68
负债合计		124,439,989.32	22,365,535.87
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	6,205,579,059.16	4,956,039,677.38
未分配利润	7.4.7.10	-1,163,346,449.63	-922,461,505.14
所有者权益合计		5,042,232,609.53	4,033,578,172.24
负债和所有者权益总计		5,166,672,598.85	4,055,943,708.11

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8125 元，基金份额总额 6,205,579,059.16 份。

7.2 利润表

会计主体：南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
一、收入		7,334,935.70	-1,712,056,557.10
1. 利息收入		1,910,106.32	1,658,175.11
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,908,751.21	1,657,346.64
债券利息收入		177.34	828.47
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,177.77	-

其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-497,388,962.67	46,421,133.47
其中: 股票投资收益	7.4.7.12	-535,156,866.61	25,633,631.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	177,298.19
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	37,767,903.94	20,610,204.08
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	500,549,892.70	-1,763,018,010.36
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	2,263,899.35	2,882,144.68
减: 二、费用		46,085,968.90	39,861,082.53
1. 管理人报酬		28,875,821.62	25,353,558.63
2. 托管费		5,775,164.26	5,070,711.78
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	9,982,557.95	8,098,225.10
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	1,452,425.07	1,338,587.02
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-38,751,033.20	-1,751,917,639.63
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-38,751,033.20	-1,751,917,639.63

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)

本报告期: 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	-38,751,033.20	-38,751,033.20
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)	1,249,539,381.78	-202,133,911.29	1,047,405,470.49

其中：1. 基金申购款	3,604,889,954.50	-523,216,072.86	3,081,673,881.64
2. 基金赎回款	-2,355,350,572.72	321,082,161.57	-2,034,268,411.15
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)	6,205,579,059.16	-1,163,346,449.63	5,042,232,609.53
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,972,289,432.83	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)	-	-1,751,917,639.63	-1,751,917,639.63
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)	1,983,750,244.55	222,631,261.56	2,206,381,506.11
其中：1. 基金申购款	4,172,769,994.16	476,116,732.96	4,648,886,727.12
2. 基金赎回款	-2,189,019,749.61	-253,485,471.40	-2,442,505,221.01
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)	-	-79,820,505.16	-79,820,505.16
五、期末所有者权益(基金净值)	4,956,039,677.38	-922,461,505.14	4,033,578,172.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>吴万善</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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 2013 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申

购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税。
- (4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
活期存款	306,626,406.73	220,681,198.52
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	306,626,406.73	220,681,198.52

7.4.7.2.1 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		5,647,762,460.94	4,808,879,676.46	-838,882,784.48
债券	交易所市场	1,244,800.00	1,244,800.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,244,800.00	1,244,800.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		5,649,007,260.94	4,810,124,476.46	-838,882,784.48
项目		上年度末 2011年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		5,144,060,544.71	3,804,627,867.53	-1,339,432,677.18
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		5,144,060,544.71	3,804,627,867.53	-1,339,432,677.18

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应收活期存款利息	48,779.09	43,788.84
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	342.30	1,838.00
应收债券利息	177.34	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	49,298.73	45,626.84

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2012年12月31日	2011年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,449,110.52	909,767.02
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,449,110.52	909,767.02

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2012年12月31日	2011年12月31日
应付券商交易单元保证金	750,000.00	750,000.00
应付赎回费	146,049.63	74,439.21
预提费用	887,283.19	859,744.47
合计	1,783,332.82	1,684,183.68

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年度	
	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	3,604,889,954.50	3,604,889,954.50
本期赎回(以“-”号填列)	-2,355,350,572.72	-2,355,350,572.72
本期末	6,205,579,059.16	6,205,579,059.16

注：截至2012年12月31日止，本基金于深交所上市的基金份额为145,716,266.00份(2011年12月31日：151,394,437.00份)，托管在场外未上市交易的基金份额为6,059,862,793.16份(2011年12月31日：4,804,645,240.38份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	688,251,568.79	-1,610,713,073.93	-922,461,505.14
本期利润	-539,300,925.90	500,549,892.70	-38,751,033.20
本期基金份额交易产生的变动数	113,926,744.49	-316,060,655.78	-202,133,911.29
其中：基金申购款	312,227,722.81	-835,443,795.67	-523,216,072.86
基金赎回款	-198,300,978.32	519,383,139.89	321,082,161.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	262,877,387.38	-1,426,223,837.01	-1,163,346,449.63

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年度	上年度可比期间 2011 年度
活期存款利息收入	1,804,257.74	1,576,763.80
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	49,345.84	50,454.11
其他	55,147.63	30,128.73
合计	1,908,751.21	1,657,346.64

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年度	上年度可比期间 2011 年度
卖出股票成交总额	2,935,589,717.51	1,956,130,350.88
减：卖出股票成本总额	3,470,746,584.12	1,930,496,719.68
买卖股票差价收入	-535,156,866.61	25,633,631.20

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年度	上年度可比期间 2011 年度
卖出债券成交金额	-	2,584,626.66
减：卖出成本总额	-	2,406,500.00
减：应收利息总额	-	828.47
债券投资收益	-	177,298.19

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年度	上年度可比期间 2011 年度
股票投资产生的股利收益	37,767,903.94	20,610,204.08
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	37,767,903.94	20,610,204.08

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012 年度	上年度可比期间 2011 年度
1. 交易性金融资产	500,549,892.70	-1,763,018,010.36
——股票投资	500,549,892.70	-1,763,018,010.36
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	500,549,892.70	-1,763,018,010.36

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年度	上年度可比期间 2011 年度
基金赎回费收入	2,263,899.35	2,882,144.68
合计	2,263,899.35	2,882,144.68

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

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年度	上年度可比期间 2011 年度
交易所市场交易费用	9,982,557.95	8,098,225.10
银行间市场交易费用	-	-
合计	9,982,557.95	8,098,225.10

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年度	上年度可比期间 2011 年度
审计费用	110,000.00	102,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
上市费	60,000.00	60,000.00
银行汇划费	19,847.77	31,268.36
账户维护费	50.00	200.00
指数使用费	962,527.30	845,118.66
合计	1,452,425.07	1,338,587.02

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提，逐日累计，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币50,000.00元。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局、中国证监会于2012年11月16日联合发布财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（以下简称“通知”），要求个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得，按照本通知的规定计征个人所得税。通知自2013年1月1日起施行。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司（“南方基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012 年度		上年度可比期间 2011 年度	
	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

关联方名称	本期 2012 年度		上年度可比期间 2011 年度	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券	1,135,890,496.18	16.59%	853,280,794.60	14.28%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年度			
	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	953,332.08	16.21%	214,893.50	14.83%
关联方名称	上年度可比期间 2011年度			
	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	693,302.28	13.94%	58,900.95	6.47%

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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的净额列示。权证交易不计佣金。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012 年度	上年度可比期间 2011 年度
当期发生的基金应支付的管理费	28,875,821.62	25,353,558.63
其中：支付销售机构的客户维护费	6,230,033.76	5,983,230.72

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012 年度	上年度可比期间 2011 年度
当期发生的基金应支付的托管费	5,775,164.26	5,070,711.78

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.12%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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
无。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
无。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2012 年度		上年度可比期间 2011 年度	
	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	306,626,406.73	1,804,257.74	220,681,198.52	1,576,763.80

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2012 年度					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位：张)	总金额
兴业证券	600815	厦工股份	配售	255,516	1,640,412.72
上年度可比期间 2011 年度					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位：股)	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注	
000826	桑德环境	2012-12-31	2012-1-9	配股	12.71	22.99	286,738	3,644,439.98	6,592,106.62		

600815	厦工股份	2012-12-21	2013-1-8	增发流 通受限	6.42	6.99	255,516	1,640,412.72	1,786,056.84	
--------	------	------------	----------	------------	------	------	---------	--------------	--------------	--

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功 认购日	可流 通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估值 单价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
125099	海直转债	2012-12-19	2013-1-7	配债	100.00	100.00	12,448	1,244,800.00	1,244,800.00	

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000793	华闻传媒	2012-11-23	重大资产重组	6.63	2013-02-28	7.29	2,990,023	17,404,966.17	19,823,852.49	
600110	中科英华	2012-11-19	重大资产重组	3.61	2013-03-11	3.97	3,604,144	20,641,457.53	13,010,959.84	
600236	桂冠电力	2012-12-21	重大资产重组	3.98	2013-02-05	4.36	2,917,160	12,853,453.88	11,610,296.80	
000973	佛塑科技	2012-12-28	公告重大事项	4.15	2013-01-18	4.57	2,371,649	15,972,939.97	9,842,343.35	
600780	通宝能源	2012-01-18	重要事项未公告	6.70	2013-03-15	6.70	1,247,145	8,272,487.54	8,355,871.50	
002506	超日太阳	2012-12-20	公告重大事项	5.11	2013-02-01	4.85	1,615,983	13,837,980.41	8,257,673.13	
600127	金健米业	2012-12-21	公告重大事项	4.69	2013-02-08	5.16	1,741,180	11,361,499.51	8,166,134.20	
000712	锦龙股份	2012-12-10	重大资产重组	11.10	未知	未知	699,016	10,324,279.88	7,759,077.60	
000903	云内动力	2012-12-31	公告重大事项	4.65	2013-01-04	4.72	1,521,353	8,854,396.80	7,074,291.45	
600580	卧龙电气	2012-11-20	重大资产重组	3.94	2013-01-09	4.33	1,725,528	12,908,030.54	6,798,580.32	
000698	沈阳化工	2012-12-24	公告重大事项	4.22	2013-01-31	4.64	1,479,461	10,680,235.07	6,243,325.42	
000042	深长城	2012-12-18	公告重大事项	20.10	2013-02-05	22.11	305,745	5,524,129.84	6,145,474.50	
000428	华天酒店	2012-12-31	公告重大事项	4.20	2013-01-08	4.38	1,377,164	7,785,008.94	5,784,088.80	
002190	成飞集成	2012-10-16	公告重大事项	11.45	2013-01-14	12.60	319,577	4,698,933.81	3,659,156.65	

注：本基金截至 2012 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现。本基金投资的金融工具主要为股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制限定在限定的范围之内，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之内。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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12月31日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.02% (2011年12月31日：无)

7.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所上市,除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余金融资产均能以合理价格适时变现。

于 2012 年 12 月 31 日,本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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、结算备付金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	306,626,406.73	-	-	-	306,626,406.73
结算备付金	760,713.71	-	-	-	760,713.71
存出保证金	-	-	-	818,622.50	818,622.50
交易性金融资产	-	-	1,244,800.00	4,808,879,676.46	4,810,124,476.46
应收证券清算款	-	-	-	43,804,552.52	43,804,552.52
应收利息	-	-	-	49,298.73	49,298.73
应收申购款	291,076.31	-	-	4,197,451.89	4,488,528.20
资产总计	307,678,196.75	-	1,244,800.00	4,857,749,602.10	5,166,672,598.85
负债					
应付证券清算款	-	-	-	81,151,367.23	81,151,367.23
应付赎回款	-	-	-	37,251,312.39	37,251,312.39
应付管理人报酬	-	-	-	2,337,388.62	2,337,388.62
应付托管费	-	-	-	467,477.74	467,477.74
应付交易费用	-	-	-	1,449,110.52	1,449,110.52
其他负债	-	-	-	1,783,332.82	1,783,332.82
负债总计	-	-	-	124,439,989.32	124,439,989.32
利率敏感度缺口	307,678,196.75	-	1,244,800.00	4,733,309,612.78	5,042,232,609.53

上年度末 2011年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	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
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账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2012年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.02%（2011年12月31日：无），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2011年12月31日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金为完全被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在中证 500 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 500 指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中，中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 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	4,808,879,676.46	95.37	3,804,627,867.53	94.32
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,808,879,676.46	95.37	3,804,627,867.53	94.32

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币万元)	
		本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	1. 中证 500 指数上升 5%	增加约 25,211	增加约 20,168
2. 中证 500 指数下降 5%	减少约 25,211	减少约 20,168	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

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

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

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

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

(ii) 各层级金融工具公允价值

于2012年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为4,687,593,350.41元,属于第二层级的余额为122,531,126.05元,无属于第三层级的余额(2011年12月31日:第一层级3,704,681,292.07元,第二层级99,946,575.46元,无属于第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,808,879,676.46	93.07
	其中:股票	4,808,879,676.46	93.07
2	固定收益投资	1,244,800.00	0.02
	其中:债券	1,244,800.00	0.02
	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	307,387,120.44	5.95
6	其他各项资产	49,161,001.95	0.95
7	合计	5,166,672,598.85	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	79,965,350.71	1.59
B	采掘业	116,694,937.74	2.31
C	制造业	2,717,357,589.02	53.89
C0	食品、饮料	243,205,893.61	4.82
C1	纺织、服装、皮毛	108,305,428.02	2.15
C2	木材、家具	18,515,134.83	0.37
C3	造纸、印刷	83,839,896.45	1.66
C4	石油、化学、塑胶、塑料	495,467,614.01	9.83
C5	电子	270,087,678.55	5.36
C6	金属、非金属	316,573,715.50	6.28
C7	机械、设备、仪表	727,656,309.44	14.43
C8	医药、生物制品	421,203,856.17	8.35
C99	其他制造业	32,502,062.44	0.64
D	电力、煤气及水的生产和供应业	199,431,701.51	3.96
E	建筑业	130,442,033.90	2.59
F	交通运输、仓储业	141,672,971.56	2.81
G	信息技术业	264,476,565.48	5.25
H	批发和零售贸易	303,621,543.35	6.02
I	金融、保险业	42,340,885.69	0.84
J	房地产业	494,689,864.34	9.81
K	社会服务业	166,564,189.27	3.30
L	传播与文化产业	130,191,202.99	2.58
M	综合类	21,430,840.90	0.43
	合计	4,808,879,676.46	95.37

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	000826	桑德环境	1,377,733	31,674,081.67	0.63
2	600079	人福医药	1,253,257	29,313,681.23	0.58
3	002230	科大讯飞	960,281	29,096,514.30	0.58
4	600436	片仔癀	222,192	24,201,152.64	0.48
5	002450	康得新	983,526	23,899,681.80	0.47

6	600199	金种子酒	1,235,094	23,726,155.74	0.47
7	000400	许继电气	960,708	23,681,452.20	0.47
8	000917	电广传媒	2,257,701	22,509,278.97	0.45
9	002250	联化科技	1,146,874	22,364,043.00	0.44
10	000503	海虹控股	2,282,754	21,640,507.92	0.43
11	000998	隆平高科	1,056,007	21,627,023.36	0.43
12	600702	沱牌舍得	749,590	21,595,687.90	0.43
13	600805	悦达投资	1,800,911	21,430,840.90	0.43
14	600138	中青旅	1,318,658	20,993,035.36	0.42
15	000661	长春高新	333,393	20,370,312.30	0.40
16	000793	华闻传媒	2,990,023	19,823,852.49	0.39
17	600418	江淮汽车	2,863,925	19,560,607.75	0.39
18	600643	爱建股份	2,456,715	19,481,749.95	0.39
19	600557	康缘药业	923,713	19,213,230.40	0.38
20	002008	大族激光	2,320,939	18,985,281.02	0.38
21	000522	白云山A	1,042,329	18,761,922.00	0.37
22	002065	东华软件	1,314,234	18,478,130.04	0.37
23	000877	天山股份	1,955,838	18,423,993.96	0.37
24	600675	中华企业	3,457,585	18,290,624.65	0.36
25	600300	维维股份	2,654,103	18,286,769.67	0.36
26	600366	宁波韵升	1,143,392	18,145,631.04	0.36
27	600478	科力远	799,617	17,959,397.82	0.36
28	600570	恒生电子	1,578,296	17,692,698.16	0.35
29	600325	华发股份	2,075,102	17,638,367.00	0.35
30	600311	荣华实业	2,113,117	17,327,559.40	0.34
31	600635	大众公用	4,177,561	17,295,102.54	0.34
32	000690	宝新能源	3,837,045	17,189,961.60	0.34
33	000926	福星股份	1,809,265	17,097,554.25	0.34
34	000540	中天城投	2,435,948	16,905,479.12	0.34
35	002152	广电运通	1,186,163	16,831,652.97	0.33
36	600141	兴发集团	928,264	16,745,882.56	0.33
37	002237	恒邦股份	722,418	16,738,425.06	0.33
38	600601	方正科技	6,968,133	16,514,475.21	0.33
39	002063	远光软件	1,125,516	16,500,064.56	0.33
40	600426	华鲁恒升	2,119,204	16,423,831.00	0.33
41	600867	通化东宝	1,724,990	16,387,405.00	0.33
42	000735	罗牛山	2,794,157	16,289,935.31	0.32
43	600517	置信电气	1,178,514	16,263,493.20	0.32
44	000598	兴蓉投资	2,197,243	16,237,625.77	0.32
45	600720	祁连山	1,516,653	16,076,521.80	0.32

46	600717	天津港	2,658,413	16,056,814.52	0.32
47	600594	益佰制药	801,576	16,039,535.76	0.32
48	000939	凯迪电力	2,395,811	16,004,017.48	0.32
49	000786	北新建材	912,931	15,967,163.19	0.32
50	002294	信立泰	415,124	15,899,249.20	0.32
51	002477	雏鹰农牧	847,688	15,851,765.60	0.31
52	600239	云南城投	1,829,905	15,828,678.25	0.31
53	000028	国药一致	444,281	15,683,119.30	0.31
54	000616	亿城股份	3,783,777	15,513,485.70	0.31
55	600747	大连控股	3,378,967	15,509,458.53	0.31
56	002004	华邦制药	956,968	15,368,906.08	0.30
57	600008	首创股份	3,492,176	15,260,809.12	0.30
58	600312	平高电气	2,080,013	15,121,694.51	0.30
59	002029	七匹狼	799,666	15,097,694.08	0.30
60	000816	江淮动力	2,765,330	15,043,395.20	0.30
61	600820	隧道股份	1,649,187	15,007,601.70	0.30
62	600458	时代新材	1,149,652	15,002,958.60	0.30
63	000762	西藏矿业	1,208,737	14,952,076.69	0.30
64	600645	中源协和	825,393	14,807,550.42	0.29
65	600067	冠城大通	2,241,652	14,705,237.12	0.29
66	600086	东方金钰	671,060	14,669,371.60	0.29
67	600978	宜华木业	2,927,450	14,403,054.00	0.29
68	600844	丹化科技	1,299,597	14,386,538.79	0.29
69	600200	江苏吴中	1,980,091	14,256,655.20	0.28
70	002129	中环股份	1,116,048	14,229,612.00	0.28
71	000006	深振业A	2,857,206	14,143,169.70	0.28
72	600522	中天科技	1,789,319	14,117,726.91	0.28
73	600017	日照港	4,882,061	14,109,156.29	0.28
74	000680	山推股份	2,892,134	14,084,692.58	0.28
75	002244	滨江集团	1,287,572	13,970,156.20	0.28
76	600064	南京高科	1,147,213	13,961,582.21	0.28
77	000975	科学城	1,384,366	13,954,409.28	0.28
78	600059	古越龙山	1,209,266	13,809,817.72	0.27
79	600422	昆明制药	698,192	13,593,798.24	0.27
80	600880	博瑞传播	1,395,559	13,453,188.76	0.27
81	600879	航天电子	2,059,830	13,430,091.60	0.27
82	002482	广田股份	650,152	13,425,638.80	0.27
83	600816	安信信托	1,009,146	13,310,635.74	0.26
84	600511	国药股份	912,068	13,288,830.76	0.26
85	600500	中化国际	2,281,919	13,189,491.82	0.26

86	002005	德豪润达	1,851,503	13,145,671.30	0.26
87	002022	科华生物	1,250,222	13,127,331.00	0.26
88	600755	厦门国贸	2,957,488	13,101,671.84	0.26
89	000830	鲁西化工	3,255,391	13,021,564.00	0.26
90	600110	中科英华	3,604,144	13,010,959.84	0.26
91	600240	华业地产	2,702,932	13,001,102.92	0.26
92	600596	新安股份	1,724,998	12,937,485.00	0.26
93	000667	名流置业	5,733,300	12,899,925.00	0.26
94	600704	物产中大	1,756,806	12,824,683.80	0.25
95	600210	紫江企业	3,648,951	12,807,818.01	0.25
96	002456	欧菲光	304,763	12,790,903.11	0.25
97	600220	江苏阳光	4,529,247	12,727,184.07	0.25
98	600499	科达机电	1,448,209	12,686,310.84	0.25
99	600269	赣粤高速	3,707,087	12,678,237.54	0.25
100	600072	中船股份	911,277	12,666,750.30	0.25
101	000518	四环生物	3,268,490	12,649,056.30	0.25
102	000031	中粮地产	2,879,030	12,552,570.80	0.25
103	600572	康恩贝	1,285,110	12,529,822.50	0.25
104	000566	海南海药	1,257,597	12,525,666.12	0.25
105	002140	东华科技	566,424	12,449,999.52	0.25
106	600787	中储股份	1,600,250	12,369,932.50	0.25
107	600158	中体产业	2,142,898	12,364,521.46	0.25
108	600260	凯乐科技	1,339,990	12,341,307.90	0.24
109	000513	丽珠集团	349,960	12,178,608.00	0.24
110	600470	六国化工	1,324,601	12,159,837.18	0.24
111	002428	云南锗业	518,285	12,158,966.10	0.24
112	600729	重庆百货	473,634	12,120,294.06	0.24
113	000417	合肥百货	1,732,993	12,113,621.07	0.24
114	601002	晋亿实业	1,172,250	12,062,452.50	0.24
115	600112	长征电气	1,131,573	12,039,936.72	0.24
116	002408	齐翔腾达	711,935	11,932,030.60	0.24
117	600388	龙净环保	543,006	11,891,831.40	0.24
118	600521	华海药业	1,042,787	11,887,771.80	0.24
119	000550	江铃汽车	659,349	11,855,095.02	0.24
120	000897	津滨发展	4,107,510	11,829,628.80	0.23
121	000488	晨鸣纸业	2,827,457	11,790,495.69	0.23
122	000683	远兴能源	2,437,574	11,773,482.42	0.23
123	600748	上实发展	1,375,799	11,763,081.45	0.23
124	000930	中粮生化	2,449,348	11,732,376.92	0.23
125	000655	金岭矿业	944,977	11,717,714.80	0.23

126	600801	华新水泥	771,237	11,699,665.29	0.23
127	600750	江中药业	592,676	11,687,570.72	0.23
128	002028	思源电气	837,554	11,683,878.30	0.23
129	000652	泰达股份	3,279,137	11,673,727.72	0.23
130	002429	兆驰股份	904,138	11,672,421.58	0.23
131	000900	现代投资	1,330,596	11,656,020.96	0.23
132	600872	中炬高新	2,529,052	11,633,639.20	0.23
133	601886	江河幕墙	533,219	11,624,174.20	0.23
134	600236	桂冠电力	2,917,160	11,610,296.80	0.23
135	000612	焦作万方	1,067,061	11,556,270.63	0.23
136	600122	宏图高科	2,877,007	11,508,028.00	0.23
137	600584	长电科技	2,708,443	11,483,798.32	0.23
138	600597	光明乳业	1,166,743	11,469,083.69	0.23
139	600183	生益科技	2,710,575	11,411,520.75	0.23
140	002154	报喜鸟	1,140,595	11,383,138.10	0.23
141	000759	中百集团	1,729,598	11,380,754.84	0.23
142	600765	中航重机	1,481,956	11,277,685.16	0.22
143	600176	中国玻纤	1,108,180	11,248,027.00	0.22
144	600636	三爱富	848,836	11,230,100.28	0.22
145	000860	顺鑫农业	835,364	11,152,109.40	0.22
146	000511	银基发展	2,933,046	11,145,574.80	0.22
147	000510	金路集团	1,934,006	11,139,874.56	0.22
148	000541	佛山照明	1,674,177	11,099,793.51	0.22
149	600284	浦东建设	1,265,379	11,097,373.83	0.22
150	600651	飞乐音响	2,346,348	11,027,835.60	0.22
151	000988	华工科技	1,980,193	10,970,269.22	0.22
152	001696	宗申动力	1,883,420	10,923,836.00	0.22
153	000685	中山公用	988,793	10,886,610.93	0.22
154	600322	天房发展	2,808,189	10,867,691.43	0.22
155	600858	银座股份	1,155,731	10,829,199.47	0.21
156	600586	金晶科技	3,161,687	10,812,969.54	0.21
157	600078	澄星股份	1,262,129	10,690,232.63	0.21
158	600740	山西焦化	1,257,193	10,686,140.50	0.21
159	600545	新疆城建	1,716,381	10,658,726.01	0.21
160	600326	西藏天路	1,216,083	10,616,404.59	0.21
161	600197	伊力特	699,997	10,604,954.55	0.21
162	000415	渤海租赁	1,611,836	10,589,762.52	0.21
163	002041	登海种业	446,968	10,548,444.80	0.21
164	600428	中远航运	2,683,345	10,545,545.85	0.21
165	000636	风华高科	1,704,080	10,531,214.40	0.21

166	000962	东方钨业	839,684	10,529,637.36	0.21
167	000650	仁和药业	1,887,024	10,529,593.92	0.21
168	002168	深圳惠程	1,442,147	10,513,251.63	0.21
169	000601	韶能股份	2,938,351	10,489,913.07	0.21
170	000848	承德露露	764,679	10,483,749.09	0.21
171	600496	精工钢构	1,303,486	10,466,992.58	0.21
172	002223	鱼跃医疗	675,098	10,464,019.00	0.21
173	600410	华胜天成	1,646,317	10,454,112.95	0.21
174	000426	兴业矿业	834,235	10,436,279.85	0.21
175	600525	长园集团	1,644,831	10,395,331.92	0.21
176	000959	首钢股份	3,767,157	10,359,681.75	0.21
177	600004	白云机场	1,460,316	10,353,640.44	0.21
178	600835	上海机电	1,280,189	10,318,323.34	0.20
179	600298	安琪酵母	627,938	10,254,227.54	0.20
180	600491	龙元建设	1,805,036	10,252,604.48	0.20
181	600761	安徽合力	1,142,331	10,212,439.14	0.20
182	601608	中信重工	2,609,465	10,203,008.15	0.20
183	600759	正和股份	1,936,723	10,187,162.98	0.20
184	600161	天坛生物	818,276	10,179,353.44	0.20
185	600851	海欣股份	1,874,824	10,105,301.36	0.20
186	600139	西部资源	1,050,634	10,096,592.74	0.20
187	002161	远望谷	1,643,909	10,093,601.26	0.20
188	600509	天富热电	1,248,952	10,091,532.16	0.20
189	600503	华丽家族	2,169,712	10,089,160.80	0.20
190	600038	哈飞股份	535,468	10,077,507.76	0.20
191	000088	盐田港	2,466,381	9,988,843.05	0.20
192	600654	飞乐股份	2,397,028	9,947,666.20	0.20
193	603000	人民网	263,139	9,922,971.69	0.20
194	000021	长城开发	2,094,064	9,863,041.44	0.20
195	000973	佛塑科技	2,371,649	9,842,343.35	0.20
196	002048	宁波华翔	1,346,177	9,813,630.33	0.19
197	600435	北方导航	1,182,072	9,775,735.44	0.19
198	002011	盾安环境	1,064,123	9,726,084.22	0.19
199	002123	荣信股份	1,120,038	9,699,529.08	0.19
200	002219	独一味	681,994	9,684,314.80	0.19
201	000627	天茂集团	3,437,773	9,660,142.13	0.19
202	002470	金正大	666,658	9,646,541.26	0.19
203	000078	海王生物	1,657,224	9,645,043.68	0.19
204	600531	豫光金铅	562,385	9,633,655.05	0.19
205	002475	立讯精密	347,609	9,621,817.12	0.19

206	002277	友阿股份	1,064,268	9,620,982.72	0.19
207	600888	新疆众和	1,017,660	9,596,533.80	0.19
208	600611	大众交通	1,985,222	9,588,622.26	0.19
209	000931	中关村	1,713,902	9,580,712.18	0.19
210	600069	银鸽投资	1,834,200	9,574,524.00	0.19
211	600198	大唐电信	1,177,338	9,571,757.94	0.19
212	000563	陕国投A	734,500	9,548,500.00	0.19
213	002233	塔牌集团	1,136,143	9,543,601.20	0.19
214	000682	东方电子	3,105,339	9,533,390.73	0.19
215	600736	苏州高新	2,015,046	9,511,017.12	0.19
216	600963	岳阳林纸	2,318,216	9,481,503.44	0.19
217	000726	鲁泰A	1,437,931	9,475,965.29	0.19
218	600021	上海电力	2,037,898	9,455,846.72	0.19
219	600251	冠农股份	574,766	9,403,171.76	0.19
220	600351	亚宝药业	1,757,468	9,384,879.12	0.19
221	002393	力生制药	289,550	9,381,420.00	0.19
222	600884	杉杉股份	913,000	9,376,510.00	0.19
223	600790	轻纺城	1,534,073	9,373,186.03	0.19
224	000823	超声电子	978,745	9,317,652.40	0.18
225	000501	鄂武商A	805,193	9,259,719.50	0.18
226	600578	京能热电	1,236,433	9,248,518.84	0.18
227	000572	海马汽车	3,132,711	9,241,497.45	0.18
228	600797	浙大网新	2,138,462	9,238,155.84	0.18
229	600106	重庆路桥	2,305,426	9,221,704.00	0.18
230	600121	郑州煤电	1,201,371	9,214,515.57	0.18
231	000997	新大陆	1,133,918	9,184,735.80	0.18
232	600439	瑞贝卡	2,096,305	9,181,815.90	0.18
233	600533	栖霞建设	2,000,060	9,160,274.80	0.18
234	002056	横店东磁	652,229	9,157,295.16	0.18
235	000850	华茂股份	1,797,519	9,149,371.71	0.18
236	002465	海格通信	316,700	9,136,795.00	0.18
237	600628	新世界	1,350,653	9,116,907.75	0.18
238	000886	海南高速	2,511,394	9,116,360.22	0.18
239	601880	大连港	3,203,369	9,065,534.27	0.18
240	600622	嘉宝集团	1,306,216	9,065,139.04	0.18
241	000659	珠海中富	3,265,412	9,012,537.12	0.18
242	600308	华泰股份	2,594,695	9,003,591.65	0.18
243	002325	洪涛股份	584,484	8,942,605.20	0.18
244	002097	山河智能	1,306,205	8,934,442.20	0.18
245	600409	三友化工	2,349,822	8,929,323.60	0.18

246	600408	安泰集团	2,237,370	8,904,732.60	0.18
247	600815	厦工股份	1,268,295	8,865,382.05	0.18
248	600993	马应龙	631,553	8,854,373.06	0.18
249	600380	健康元	1,962,989	8,833,450.50	0.18
250	600063	皖维高新	3,328,632	8,820,874.80	0.17
251	000861	海印股份	625,065	8,813,416.50	0.17
252	600227	赤天化	2,413,726	8,810,099.90	0.17
253	000932	华菱钢铁	3,829,489	8,769,529.81	0.17
254	000887	中鼎股份	945,668	8,747,429.00	0.17
255	600612	老凤祥	402,695	8,678,077.25	0.17
256	600425	青松建化	875,402	8,657,725.78	0.17
257	002340	格林美	736,000	8,648,000.00	0.17
258	600685	广船国际	695,994	8,630,325.60	0.17
259	600616	金枫酒业	974,874	8,627,634.90	0.17
260	002309	中利科技	762,920	8,582,850.00	0.17
261	002050	三花股份	943,993	8,533,696.72	0.17
262	600151	航天机电	1,587,570	8,525,250.90	0.17
263	600289	亿阳信通	1,466,003	8,502,817.40	0.17
264	002006	精工科技	1,011,397	8,495,734.80	0.17
265	600961	株冶集团	837,231	8,489,522.34	0.17
266	600467	好当家	1,159,592	8,488,213.44	0.17
267	000090	深天健	1,116,245	8,472,299.55	0.17
268	600387	海越股份	980,583	8,452,625.46	0.17
269	600773	西藏城投	731,046	8,392,408.08	0.17
270	002083	孚日股份	2,085,492	8,383,677.84	0.17
271	000301	东方市场	2,707,306	8,365,575.54	0.17
272	600737	中粮屯河	1,596,253	8,364,365.72	0.17
273	600780	通宝能源	1,247,145	8,355,871.50	0.17
274	600449	宁夏建材	911,156	8,337,077.40	0.17
275	000608	阳光股份	1,428,423	8,327,706.09	0.17
276	600614	鼎立股份	709,142	8,282,778.56	0.16
277	002506	超日太阳	1,615,983	8,257,673.13	0.16
278	600831	广电网络	1,252,085	8,226,198.45	0.16
279	600292	九龙电力	650,050	8,177,629.00	0.16
280	600127	金健米业	1,741,180	8,166,134.20	0.16
281	600270	外运发展	1,149,890	8,152,720.10	0.16
282	002308	威创股份	814,532	8,137,174.68	0.16
283	600171	上海贝岭	1,711,338	8,128,855.50	0.16
284	600479	千金药业	677,380	8,128,560.00	0.16
285	600757	长江传媒	1,320,258	8,119,586.70	0.16

286	600866	星湖科技	1,747,240	8,107,193.60	0.16
287	600487	亨通光电	394,464	8,106,235.20	0.16
288	600056	中国医药	394,861	7,972,243.59	0.16
289	600662	强生控股	2,006,450	7,945,542.00	0.16
290	600510	黑牡丹	1,010,226	7,920,171.84	0.16
291	002254	泰和新材	870,141	7,918,283.10	0.16
292	600330	天通股份	1,495,504	7,896,261.12	0.16
293	600482	风帆股份	1,024,526	7,847,869.16	0.16
294	600195	中牧股份	619,091	7,812,928.42	0.15
295	603001	奥康国际	381,781	7,795,968.02	0.15
296	600103	青山纸业	2,696,864	7,793,936.96	0.15
297	600723	首商股份	1,045,150	7,786,367.50	0.15
298	000712	锦龙股份	699,016	7,759,077.60	0.15
299	600373	中文传媒	540,204	7,703,309.04	0.15
300	000506	中润资源	983,116	7,697,798.28	0.15
301	002430	杭氧股份	773,323	7,671,364.16	0.15
302	000979	中弘股份	963,899	7,614,802.10	0.15
303	000525	红太阳	644,123	7,568,445.25	0.15
304	000927	一汽夏利	1,519,225	7,565,740.50	0.15
305	002181	粤传媒	878,734	7,548,325.06	0.15
306	000099	中信海直	978,314	7,513,451.52	0.15
307	000543	皖能电力	981,658	7,509,683.70	0.15
308	600639	浦东金桥	833,898	7,505,082.00	0.15
309	600429	三元股份	1,123,893	7,428,932.73	0.15
310	002663	普邦园林	266,032	7,427,613.44	0.15
311	002191	劲嘉股份	815,250	7,418,775.00	0.15
312	000777	中核科技	405,726	7,396,384.98	0.15
313	600589	广东榕泰	1,337,177	7,381,217.04	0.15
314	600246	万通地产	1,931,518	7,378,398.76	0.15
315	002292	奥飞动漫	390,116	7,369,291.24	0.15
316	600438	通威股份	1,091,315	7,300,897.35	0.14
317	600329	中新药业	684,818	7,259,070.80	0.14
318	600824	益民集团	1,626,673	7,238,694.85	0.14
319	600581	八一钢铁	1,216,669	7,214,847.17	0.14
320	000050	深天马A	911,497	7,209,941.27	0.14
321	000631	顺发恒业	995,784	7,209,476.16	0.14
322	600223	鲁商置业	1,271,102	7,207,148.34	0.14
323	002437	誉衡药业	355,532	7,195,967.68	0.14
324	000852	江钻股份	508,455	7,179,384.60	0.14
325	600826	兰生股份	667,551	7,176,173.25	0.14

326	000713	丰乐种业	664,190	7,159,968.20	0.14
327	600481	双良节能	1,028,756	7,139,566.64	0.14
328	002025	航天电器	628,633	7,128,698.22	0.14
329	601311	骆驼股份	811,334	7,099,172.50	0.14
330	600261	阳光照明	819,560	7,097,389.60	0.14
331	000829	天音控股	1,803,668	7,088,415.24	0.14
332	002424	贵州百灵	448,035	7,087,913.70	0.14
333	000903	云内动力	1,521,353	7,074,291.45	0.14
334	000066	长城电脑	2,101,030	7,017,440.20	0.14
335	002653	海思科	253,919	6,982,772.50	0.14
336	601616	广电电气	1,776,407	6,963,515.44	0.14
337	600117	西宁特钢	1,411,885	6,960,593.05	0.14
338	002179	中航光电	510,062	6,936,843.20	0.14
339	600295	鄂尔多斯	777,143	6,908,801.27	0.14
340	600416	湘电股份	1,352,250	6,896,475.00	0.14
341	002479	富春环保	551,162	6,889,525.00	0.14
342	000159	国际实业	1,069,219	6,875,078.17	0.14
343	000822	山东海化	1,704,943	6,870,920.29	0.14
344	002601	佰利联	298,379	6,868,684.58	0.14
345	000951	中国重汽	532,611	6,833,399.13	0.14
346	600337	美克股份	1,205,130	6,821,035.80	0.14
347	600580	卧龙电气	1,725,528	6,798,580.32	0.13
348	002396	星网锐捷	445,740	6,784,162.80	0.13
349	600830	香溢融通	1,009,608	6,764,373.60	0.13
350	600995	文山电力	1,215,394	6,757,590.64	0.13
351	002283	天润曲轴	1,065,476	6,755,117.84	0.13
352	601100	恒立油缸	600,056	6,750,630.00	0.13
353	002242	九阳股份	966,301	6,744,780.98	0.13
354	002573	国电清新	375,808	6,708,172.80	0.13
355	002646	青青稞酒	285,677	6,704,839.19	0.13
356	002480	新筑股份	533,307	6,666,337.50	0.13
357	601010	文峰股份	469,381	6,660,516.39	0.13
358	000987	广州友谊	569,815	6,655,439.20	0.13
359	002078	太阳纸业	1,275,967	6,609,509.06	0.13
360	002410	广联达	385,767	6,608,188.71	0.13
361	600644	乐山电力	725,524	6,602,268.40	0.13
362	000418	小天鹅A	700,701	6,600,603.42	0.13
363	603077	和邦股份	428,436	6,585,061.32	0.13
364	002672	东江环保	109,262	6,525,126.64	0.13
365	000809	铁岭新城	523,564	6,502,664.88	0.13

366	600874	创业环保	1,380,636	6,475,182.84	0.13
367	600825	新华传媒	1,326,932	6,462,158.84	0.13
368	000410	沈阳机床	1,039,041	6,431,663.79	0.13
369	002332	仙琚制药	650,329	6,399,237.36	0.13
370	002252	上海莱士	466,327	6,351,373.74	0.13
371	002648	卫星石化	380,946	6,350,369.82	0.13
372	002249	大洋电机	909,239	6,301,026.27	0.12
373	002306	湘鄂情	634,918	6,298,386.56	0.12
374	002342	巨力索具	914,342	6,290,672.96	0.12
375	601678	滨化股份	628,608	6,267,221.76	0.12
376	600469	风神股份	714,240	6,249,600.00	0.12
377	000698	沈阳化工	1,479,461	6,243,325.42	0.12
378	000603	盛达矿业	320,424	6,177,774.72	0.12
379	600333	长春燃气	732,600	6,161,166.00	0.12
380	000042	深长城	305,745	6,145,474.50	0.12
381	600657	信达地产	1,451,689	6,140,644.47	0.12
382	600468	百利电气	579,262	6,140,177.20	0.12
383	600163	福建南纸	1,603,181	6,108,119.61	0.12
384	600073	上海梅林	949,763	6,097,478.46	0.12
385	600551	时代出版	642,304	6,095,464.96	0.12
386	000697	炼石有色	458,041	6,082,784.48	0.12
387	600231	凌钢股份	1,276,281	6,062,334.75	0.12
388	000828	东莞控股	1,320,054	6,045,847.32	0.12
389	002440	闰土股份	487,028	6,039,147.20	0.12
390	600397	安源煤业	471,321	6,037,622.01	0.12
391	000554	泰山石油	1,221,148	6,020,259.64	0.12
392	600339	天利高新	1,284,785	5,999,945.95	0.12
393	601801	皖新传媒	577,839	5,997,968.82	0.12
394	600683	京投银泰	1,175,893	5,997,054.30	0.12
395	002118	紫鑫药业	814,207	5,976,279.38	0.12
396	600710	常林股份	1,422,882	5,976,104.40	0.12
397	600162	香江控股	1,218,804	5,972,139.60	0.12
398	600743	华远地产	1,505,345	5,961,166.20	0.12
399	600290	华仪电气	1,170,891	5,959,835.19	0.12
400	600673	东阳光铝	788,079	5,957,877.24	0.12
401	600501	航天晨光	741,546	5,947,198.92	0.12
402	600864	哈投股份	1,040,766	5,911,550.88	0.12
403	600268	国电南自	1,008,395	5,899,110.75	0.12
404	002216	三全食品	255,290	5,879,328.70	0.12
405	603366	日出东方	380,906	5,865,952.40	0.12

406	601519	大智慧	1,323,874	5,864,761.82	0.12
407	600618	氯碱化工	714,189	5,813,498.46	0.12
408	002285	世联地产	414,485	5,798,645.15	0.12
409	600094	大名城	833,496	5,792,797.20	0.11
410	601777	力帆股份	906,145	5,790,266.55	0.11
411	000428	华天酒店	1,377,164	5,784,088.80	0.11
412	002293	罗莱家纺	133,667	5,781,097.75	0.11
413	002305	南国置业	914,178	5,777,604.96	0.11
414	000936	华西股份	1,424,804	5,741,960.12	0.11
415	600590	泰豪科技	953,038	5,613,393.82	0.11
416	600075	新疆天业	835,399	5,597,173.30	0.11
417	002064	华峰氨纶	1,172,099	5,544,028.27	0.11
418	600633	浙报传媒	409,236	5,524,686.00	0.11
419	002203	海亮股份	737,044	5,520,459.56	0.11
420	000919	金陵药业	799,987	5,503,910.56	0.11
421	601126	四方股份	387,259	5,495,205.21	0.11
422	600488	天药股份	1,034,079	5,490,959.49	0.11
423	600641	万业企业	1,279,678	5,451,428.28	0.11
424	002121	科陆电子	755,637	5,433,030.03	0.11
425	000755	山西三维	1,042,865	5,412,469.35	0.11
426	600226	升华拜克	901,201	5,407,206.00	0.11
427	000620	新华联	1,020,337	5,377,175.99	0.11
428	601011	宝泰隆	491,412	5,366,219.04	0.11
429	000533	万家乐	1,323,256	5,359,186.80	0.11
430	600563	法拉电子	359,135	5,340,337.45	0.11
431	002267	陕天然气	649,235	5,336,711.70	0.11
432	000708	大冶特钢	717,356	5,301,260.84	0.11
433	600776	东方通信	1,220,826	5,298,384.84	0.11
434	600480	凌云股份	808,308	5,286,334.32	0.10
435	002612	朗姿股份	191,530	5,267,075.00	0.10
436	002204	大连重工	411,102	5,262,105.60	0.10
437	600460	士兰微	1,385,820	5,182,966.80	0.10
438	600983	合肥三洋	680,369	5,177,608.09	0.10
439	601515	东风股份	352,922	5,173,836.52	0.10
440	000738	中航动控	602,008	5,171,248.72	0.10
441	000732	泰禾集团	649,466	5,163,254.70	0.10
442	000517	荣安地产	677,691	5,157,228.51	0.10
443	002225	濮耐股份	695,645	5,085,164.95	0.10
444	600054	黄山旅游	402,747	5,066,557.26	0.10
445	601208	东材科技	781,973	5,020,266.66	0.10

446	600829	三精制药	555,391	5,004,072.91	0.10
447	002386	天原集团	761,465	4,995,210.40	0.10
448	002183	怡亚通	1,065,219	4,985,224.92	0.10
449	600869	三普药业	632,175	4,975,217.25	0.10
450	600088	中视传媒	528,998	4,951,421.28	0.10
451	600537	亿晶光电	620,473	4,945,169.81	0.10
452	600475	华光股份	490,331	4,932,729.86	0.10
453	002281	光迅科技	254,025	4,930,625.25	0.10
454	002463	沪电股份	1,113,474	4,921,555.08	0.10
455	002091	江苏国泰	574,664	4,867,404.08	0.10
456	002662	京威股份	571,307	4,827,544.15	0.10
457	002444	巨星科技	485,570	4,792,575.90	0.10
458	000912	泸天化	933,816	4,734,447.12	0.09
459	002574	明牌珠宝	304,739	4,696,027.99	0.09
460	601388	怡球资源	390,389	4,688,571.89	0.09
461	000918	嘉凯城	1,151,956	4,688,460.92	0.09
462	002414	高德红外	287,332	4,623,171.88	0.09
463	002276	万马电缆	889,717	4,582,042.55	0.09
464	600328	兰太实业	687,925	4,560,942.75	0.09
465	002449	国星光电	686,388	4,530,160.80	0.09
466	601636	旗滨集团	665,303	4,510,754.34	0.09
467	002384	东山精密	490,338	4,501,302.84	0.09
468	000911	南宁糖业	549,104	4,475,197.60	0.09
469	002345	潮宏基	229,824	4,458,585.60	0.09
470	600523	贵航股份	460,994	4,453,202.04	0.09
471	600386	北巴传媒	643,613	4,447,365.83	0.09
472	601999	出版传媒	703,529	4,397,056.25	0.09
473	002238	天威视讯	409,189	4,386,506.08	0.09
474	002194	武汉凡谷	709,913	4,309,171.91	0.09
475	000935	四川双马	589,823	4,276,216.75	0.08
476	000925	众合机电	481,019	4,266,638.53	0.08
477	002498	汉缆股份	456,855	4,129,969.20	0.08
478	600287	江苏舜天	697,229	4,127,595.68	0.08
479	002489	浙江永强	461,513	4,112,080.83	0.08
480	000893	东凌粮油	354,382	4,110,831.20	0.08
481	600725	云维股份	983,635	4,091,921.60	0.08
482	002232	启明信息	652,172	4,082,596.72	0.08
483	601339	百隆东方	476,190	3,957,138.90	0.08
484	002320	海峡股份	407,867	3,915,523.20	0.08
485	600184	光电股份	200,493	3,893,574.06	0.08

486	002585	双星新材	398,388	3,892,250.76	0.08
487	002392	北京利尔	517,200	3,868,656.00	0.08
488	600810	神马股份	706,031	3,854,929.26	0.08
489	002461	珠江啤酒	434,286	3,791,316.78	0.08
490	002638	勤上光电	356,689	3,780,903.40	0.07
491	002190	成飞集成	319,577	3,659,156.65	0.07
492	002218	拓日新能	625,427	3,646,239.41	0.07
493	002326	永太科技	306,847	3,562,493.67	0.07
494	002678	珠江钢琴	303,392	3,516,313.28	0.07
495	002534	杭锅股份	255,718	3,508,450.96	0.07
496	002651	利君股份	254,509	3,502,043.84	0.07
497	600258	首旅股份	295,461	3,353,482.35	0.07
498	002315	焦点科技	112,556	3,346,289.88	0.07
499	601908	京运通	548,990	3,321,389.50	0.07
500	002226	江南化工	251,120	3,056,130.40	0.06
501	601677	明泰铝业	254,497	2,873,271.13	0.06
502	000719	大地传媒	279,057	2,617,554.66	0.05

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600827	友谊股份	32,416,529.18	0.80
2	002029	七匹狼	24,534,137.26	0.61
3	600157	永泰能源	23,600,411.12	0.59
4	600022	山东钢铁	23,586,114.90	0.58
5	600340	华夏幸福	23,030,236.45	0.57
6	000750	国海证券	22,410,478.24	0.56
7	000793	华闻传媒	22,035,444.64	0.55
8	600517	置信电气	21,885,005.98	0.54
9	600635	大众公用	21,767,449.11	0.54
10	600717	天津港	21,636,228.16	0.54
11	002006	精功科技	21,243,407.99	0.53
12	600636	三爱富	21,177,094.52	0.53
13	002152	广电运通	21,074,389.58	0.52
14	000661	长春高新	20,216,215.92	0.50
15	600418	江淮汽车	19,617,691.88	0.49

16	600200	江苏吴中	19,611,757.10	0.49
17	000539	粤电力A	19,599,303.07	0.49
18	000877	天山股份	19,375,814.01	0.48
19	002005	德豪润达	19,153,317.38	0.47
20	600008	首创股份	18,807,289.86	0.47

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000970	中科三环	57,764,968.81	1.43
2	600637	百视通	35,524,511.89	0.88
3	600340	华夏幸福	33,930,142.37	0.84
4	000581	威孚高科	33,271,418.18	0.82
5	600827	友谊股份	31,935,602.86	0.79
6	600060	海信电器	31,850,187.85	0.79
7	000963	华东医药	30,316,809.92	0.75
8	002236	大华股份	30,251,586.65	0.75
9	000799	酒鬼酒	27,930,627.35	0.69
10	600157	永泰能源	26,987,260.21	0.67
11	002051	中工国际	25,358,588.50	0.63
12	000750	国海证券	22,412,499.74	0.56
13	002311	海大集团	21,530,326.66	0.53
14	000539	粤电力A	20,866,653.14	0.52
15	601588	北辰实业	20,286,013.50	0.50
16	002038	双鹭药业	19,862,532.70	0.49
17	600160	巨化股份	19,295,477.22	0.48
18	600653	申华控股	18,903,251.84	0.47
19	600770	综艺股份	18,365,731.46	0.46
20	600022	山东钢铁	18,214,488.09	0.45

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,974,448,500.35
卖出股票收入（成交）总额	2,935,589,717.51

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

相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,244,800.00	0.02
8	其他	-	-
9	合计	1,244,800.00	0.02

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	125099	海直转债	12,448	1,244,800.00	0.02

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1

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

8.9.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	818,622.50
2	应收证券清算款	43,804,552.52
3	应收股利	-

4	应收利息	49,298.73
5	应收申购款	4,488,528.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	49,161,001.95

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000826	桑德环境	6,592,106.62	0.13	网上增发

注：期末前十名股票中除上述股票外不存在流通受限情况

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	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
390,772	15,880.31	1,091,351,752.73	17.59%	5,114,227,306.43	82.41%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	姜山	10,131,043.00	6.95%
2	朝恒房地产(深圳)有限公司	8,000,000.00	5.49%
3	项志英	1,500,000.00	1.03%
4	幸芸	1,219,223.00	0.84%
5	吴彤	1,107,200.00	0.76%
6	高琪	1,000,000.00	0.69%
7	姜登斌	947,200.00	0.65%
8	吕大贤	872,556.00	0.60%
9	韩环	802,401.00	0.55%
10	王晓辉	792,600.00	0.54%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	3,527,655.43	0.0568%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额，数量区间为 50 万份至 100 万份（含）；本基金基金经理持有本基金份额，数量区间为 10 万份至 50 万份（含）。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年9月25日）基金份额总额	3,223,217,818.45
本报告期期初基金份额总额	4,956,039,677.38
本报告期基金总申购份额	3,604,889,954.50
减：本报告期基金总赎回份额	2,355,350,572.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,205,579,059.16

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据公司第五届董事会第二十二次会议审议通过，并经中国证监会证监许可{2012}1550号文批准，聘任杨小松为公司督察长。

根据公司第五届董事会第二十二次会议审议通过，并向中国基金业协会报备，聘任秦长奎为公司副总经理，同时辞去公司督察长职务。

经中国证监会基金部【2013】13号文函复，自2013年1月1日起，高良玉不再担任我公司总经理职务，由董事长吴万善代为履行我公司总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期未变更会计师事务所。本年度支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费用 110,000 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 4 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	1,328,560,866.02	19.41%	1,138,900.37	19.36%	-
华泰证券	1	1,135,890,496.18	16.59%	953,332.08	16.21%	-
国泰君安	1	1,064,970,157.06	15.56%	927,297.39	15.77%	-
东方证券	1	969,611,180.54	14.16%	832,856.55	14.16%	-
齐鲁证券	1	680,049,893.92	9.93%	619,119.65	10.53%	-
江海证券	1	489,070,677.75	7.14%	404,794.24	6.88%	-
高华证券	1	461,573,103.65	6.74%	396,071.57	6.73%	-
日信证券	1	247,256,448.79	3.61%	200,898.45	3.42%	-
东兴证券	1	220,310,469.13	3.22%	187,265.98	3.18%	-
中天证券	1	132,811,699.72	1.94%	120,914.31	2.06%	-
英大证券	2	116,029,134.86	1.69%	100,040.37	1.70%	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择交易单元：

- 服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	15,000,000.00	100.00%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	• 南方基金关于旗下部分基金参与浙商银行网上银行与定期定额申购业务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12月31日
2	• 南方基金关于旗下部分基金参与中信建投证券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12月31日
3	• 南方基金关于旗下部分基金参与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、证券时报	2012年12月31日
4	• 南方基金关于旗下部分基金参加平安银行电子渠道与定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012年12月28日
5	• 南方基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行基金定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012年12月28日
6	• 南方基金管理有限公司关于开通支付宝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12月27日
7	• 南方基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012年12月26日

	者身份证明文件的公告		
8	• 南方基金管理有限公司网上直销关于开通“e 智定投”业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 12 月 26 日
9	• 南方基金关于旗下部分基金增加东莞农村商业银行作为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 12 月 20 日
10	• 南方基金关于旗下部分基金参加中国银行网银和手机银行交易进行基金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 12 月 1 日
11	• 南方基金关于旗下部分基金参加华鑫证券自助式交易系统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 11 月 5 日
12	• 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	2012 年 10 月 11 日
13	• 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 10 月 8 日
14	• 南方基金关于旗下部分基金增加包商银行作为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 9 月 25 日
15	• 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 9 月 20 日
16	• 南方基金关于旗下部分基金增加大通证券为代销机构及开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012 年 8 月 9 日
17	• 南方基金关于旗下部分基金参加银河证券网上交易系统基金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 7 月 23 日
18	• 南方基金关于旗下部分基金增加深圳众禄基金销售有限公司为代销机构及开通转换业务并参与其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 7 月 13 日
19	• 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 7 月 1 日
20	• 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
21	• 南方基金关于旗下部分基金参与	中国证券报、上海证券	2012 年 6 月 29 日

	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	报、证券时报	
22	• 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
23	• 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
24	• 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
25	• 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
26	• 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
27	• 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
28	• 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
29	• 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
30	• 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
31	• 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
32	• 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
33	• 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
34	• 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
35	• 南方基金关于开通电子直销汇款交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012年3月26日

36	• 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
37	• 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
38	• 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
39	• 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
40	• 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
41	• 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
42	• 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
43	• 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
44	• 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

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

深圳市福田区福华一路 6 号免税商务大厦 31-33 楼

13.3 查阅方式

网站: <http://www.nffund.com>

