

# 南方中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金(LOF)2013 年半年度报告

2013 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：2013 年 8 月 27 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 2013 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。

2013 年 2 月 6 日，本公司管理的中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金合同生效。根据《南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关约定，基金管理人经与基金托管人协商一致，将本基金变更为中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，本基金的名称相应变更为“南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）”。上述修改事项已报中国证监会备案，自 2013 年 2 月 22 日起生效。

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 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
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.....	36
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.....	36
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.....	36
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	36
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	36
7.11 投资组合报告附注.....	37
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>38</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	38
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>39</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>39</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
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.....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
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.....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8 其他重大事件.....	42
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>43</b>
11.1 备查文件目录.....	43
11.2 存放地点.....	43
11.3 查阅方式.....	43

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)
基金简称	南方中证 500ETF 联接(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	5,121,339,717.26 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”。

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510500
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 日
基金管理人名称	南方基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

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

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90%的资产投资于目标 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、非成份股、新股、权证、债券资产、资产支持证券、固定收益类资产、现金资产、货币市场工具、衍生工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。 在正常市场情况下，本基金力争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。

### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 指数。
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。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理有限公司	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、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	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
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(2013 年 1 月 1 日 - 2013 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-339,048,979.16
本期利润	57,003,850.72
加权平均基金份额本期利润	0.0098
本期加权平均净值利润率	1.13%
本期基金份额净值增长率	-0.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-992,803,909.35
期末可供分配基金份额利润	-0.1939
期末基金资产净值	4,128,535,807.91
期末基金份额净值	0.8061
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-14.27%

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

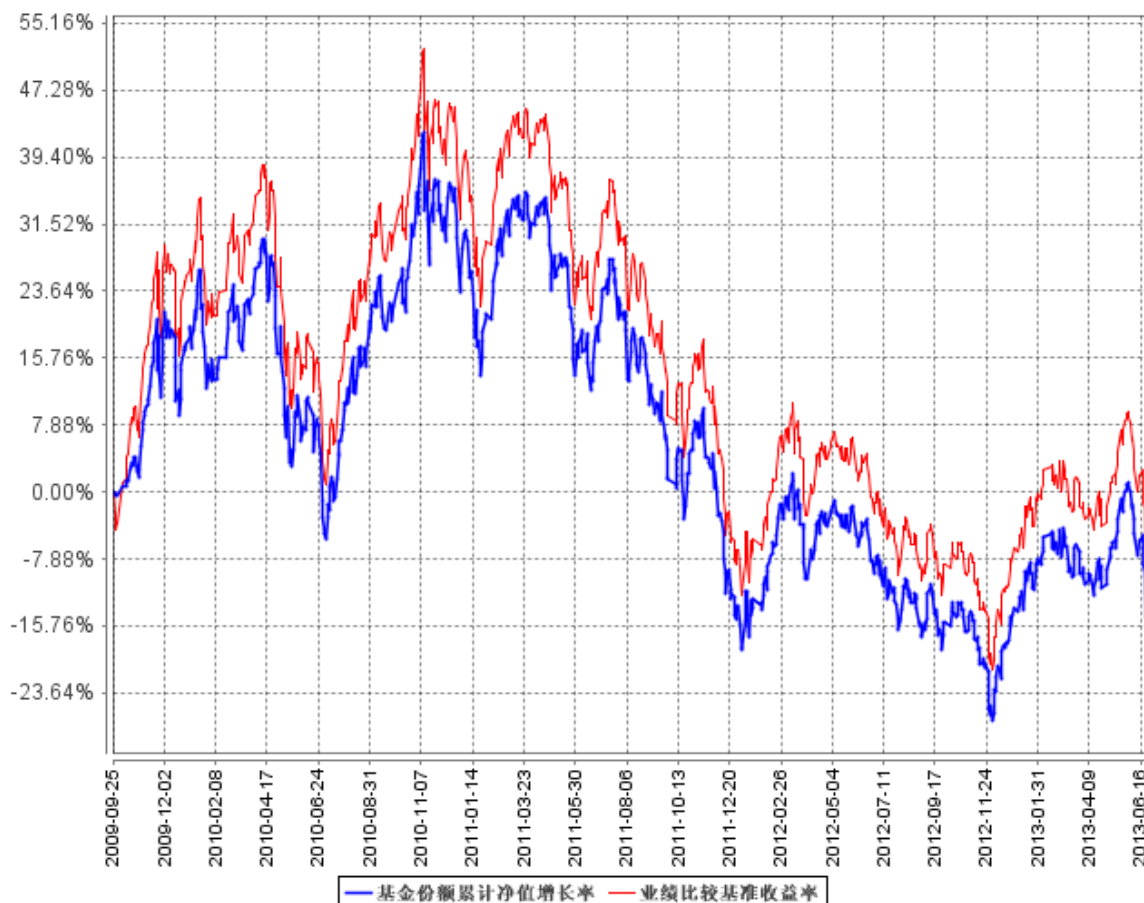
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-14.80%	1.85%	-15.01%	1.86%	0.21%	-0.01%
过去三个月	-5.28%	1.45%	-5.80%	1.46%	0.52%	-0.01%
过去六个月	-0.79%	1.42%	-1.09%	1.42%	0.30%	0.00%
过去一年	-6.26%	1.40%	-6.31%	1.40%	0.05%	0.00%

过去三年	-11.71%	1.49%	-10.71%	1.49%	-1.00%	0.00%
自基金合同生效起至今	-14.27%	1.54%	-7.49%	1.56%	-6.78%	-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



注：1、2013年2月6日，根据《南方中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关约定，基金管理人经与基金托管人协商一致，将本基金变更为中证500交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，本基金名称相应变更为“南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）”，上述修改事项已报中国证监会备案，自2013年2月22日起生效，生效日至报告期末不满一年。

2、本基金建仓期为基金备案生效之日起3个月，建仓期末本基金各项资产配置比例达到基金合同的约定。



## § 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，公司管理资产规模超过 2,000 亿元，旗下管理 42 只开放式基金，1 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	2013 年 4 月 19 日	7	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 2013 年 4 月，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	2013 年 4 月 21 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 2013 年 4 月，任南方 300 指数基金经理；2009 年 12 月至 2013 年 4 月，任南方深成 ETF 及联接基金基金经理；2011 年 2 月至 2013 年 4 月，任南方 500 基金经理；2013 年 2 月至 2013 年 4 月，任南方

					500ETF 基金经理；2013 年 2 月至 2013 年 4 月，任南方开元沪深 300ETF 基金经理。
罗文杰	本基金的基金经理	2013 年 4 月 22 日	-	8	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有中国基金从业资格。曾先后任职于美国 Open Link Financial 公司、摩根斯坦利公司，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，任南方基金数量化投资部基金经理助理；2013 年 4 月至今，任南方 500 基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方 300 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方策略基金经理。
罗文杰	本基金的基金经理助理	2011 年 2 月 28 日	2013 年 4 月 19 日	8	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有中国基金从业资格。曾先后任职于美国 Open Link Financial 公司、摩根斯坦利公司，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，任南方基金数量化投资部基金经理助理；2013 年 4 月至今，任南方 500 基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方 300 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方策略基金经理。

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 指数基金(LOF)基金合同》、《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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。

2013 年 6 月 28 日，由于证券市场波动、基金规模发生变化被动调整仓位，导致本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券被动低于基金净值的 5%，基金管理人已于 2013 年 7 月 1 日调整完毕。

### 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 1 次，是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，我国经济增长力度仍然偏弱，但预计在较宽松的资金面支撑下，经济大幅衰退的可能性不高。同期中证 500 指数下跌 1.22%。

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

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

- ①接受申购赎回所带来的股票仓位偏离，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- ②本基金大额换购目标 ETF 所带来的成份股权重偏离，对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行应对；

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自本基金建仓完毕至报告期末年化跟踪误差为 0.353%，较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过 4% 的投资目标。

截至报告期末，本基金份额净值为 0.8061 元，报告期内，份额净值增长率为-0.79%，同期业绩基准增长率为-1.09%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内方面，经济有继续下滑风险。7 月汇丰中国制造业 PMI 预览值降至 47.7，创 11 个月以来新低，比 6 月的 48.2 又降低了 0.5。下半年经济仍将保持低迷状态，而政策方面却没有任何松动。在经济增长压力增大的同时，政府高层连续表态，大规模刺激政策不会出台。财政部部长楼继伟表示，中国政府不会再次推出大规模经济刺激政策。新华社表示，中国经济增速低于 7%是不允许的，鉴于上半年增速 7.6%，下半年增速不会低于 7%，全年完成 7%压力不大，因此，政府对经济下滑的容忍度是变高了。不过，在投资方面仍有一些稳经济的措施出台。

总体而言，当前看不到政策出现大规模放松，经济可能将继续下行。本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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》相关法律法规的规定以及《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》、《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)托管协议》的约定，对南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)管理人—南方基金管理有限公司 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，南方基金管理有限公司在南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.4.1	195,904,489.47	306,626,406.73
结算备付金		2,196,740.95	760,713.71
存出保证金		645,116.91	818,622.50
交易性金融资产	6.4.4.2	3,908,438,408.82	4,810,124,476.46
其中：股票投资		17,649,016.58	4,808,879,676.46
基金投资		3,890,789,392.24	-
债券投资		-	1,244,800.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		23,716,586.85	43,804,552.52
应收利息	6.4.4.5	37,656.87	49,298.73
应收股利		20,089.44	-
应收申购款		4,938,409.55	4,488,528.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		4,135,897,498.86	5,166,672,598.85
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2012 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
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		186,196.36	81,151,367.23
应付赎回款		5,208,068.72	37,251,312.39
应付管理人报酬		115,160.87	2,337,388.62
应付托管费		23,032.20	467,477.74
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	912,285.48	1,449,110.52
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	916,947.32	1,783,332.82
负债合计		7,361,690.95	124,439,989.32
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.4.9	5,121,339,717.26	6,205,579,059.16
未分配利润	6.4.4.10	-992,803,909.35	-1,163,346,449.63
所有者权益合计		4,128,535,807.91	5,042,232,609.53
负债和所有者权益总计		4,135,897,498.86	5,166,672,598.85

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8061 元，基金份额总额 5,121,339,717.26 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		70,595,813.67	259,493,547.83
1.利息收入		979,736.05	986,140.61
其中：存款利息收入	6.4.4.11	978,862.98	986,140.61
债券利息收入		873.07	-
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）		-328,253,605.39	-323,681,582.48
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-325,869,813.21	-348,838,376.25
基金投资收益	6.4.4.13	-4,488,241.68	-
债券投资收益	6.4.4.14	279,056.19	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.4.15	1,825,393.31	25,156,793.77
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.16	396,052,829.88	580,627,360.26
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.17	1,816,853.13	1,561,629.44
<b>减：二、费用</b>		13,591,962.95	24,684,221.27
1. 管理人报酬		7,042,576.82	14,557,322.96
2. 托管费		1,408,515.40	2,911,464.55
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.4.18	4,362,771.59	6,490,011.30

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.4.19	778,099.14	725,422.46
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		57,003,850.72	234,809,326.56
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		57,003,850.72	234,809,326.56

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	6,205,579,059.16	-1,163,346,449.63	5,042,232,609.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	57,003,850.72	57,003,850.72
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）	-1,084,239,341.90	113,538,689.56	-970,700,652.34
其中：1. 基金申购款	877,214,493.69	-121,787,072.43	755,427,421.26
2. 基金赎回款	-1,961,453,835.59	235,325,761.99	-1,726,128,073.60
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）	5,121,339,717.26	-992,803,909.35	4,128,535,807.91
项目	上年度可比期间 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

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：

<u>杨小松</u>	<u>邓见梁</u>	<u>邓见梁</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 重要会计政策和会计估计

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 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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、红利时代扣代缴个人所得税，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。

(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。

#### 6.4.4 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
活期存款	195,904,489.47
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	195,904,489.47

##### 6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	18,450,308.51	17,649,016.58	-801,291.93
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	4,332,818,054.91	3,890,789,392.24	-442,028,662.67
其他	-	-	-
合计	4,351,268,363.42	3,908,438,408.82	-442,829,954.60

**6.4.4.3 衍生金融资产/负债**

无

**6.4.4.4 买入返售金融资产****6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无

**6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无

**6.4.4.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应收活期存款利息	36,505.86
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	889.74
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	261.27
合计	37,656.87

**6.4.4.6 其他资产**

无

**6.4.4.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
交易所市场应付交易费用	912,285.48
银行间市场应付交易费用	-
合计	912,285.48

**6.4.4.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	22,486.47
预提费用	394,460.85
合计	916,947.32

**6.4.4.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	6,205,579,059.16	6,205,579,059.16
本期申购	877,214,493.69	877,214,493.69
本期赎回(以“-”号填列)	-1,961,453,835.59	-1,961,453,835.59
- 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	5,121,339,717.26	5,121,339,717.26

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**6.4.4.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	262,877,387.38	-1,426,223,837.01	-1,163,346,449.63
本期利润	-339,048,979.16	396,052,829.88	57,003,850.72
本期基金份额交易产生的变动数	2,899,274.54	110,639,415.02	113,538,689.56
其中：基金申购款	15,335,200.76	-137,122,273.19	-121,787,072.43
基金赎回款	-12,435,926.22	247,761,688.21	235,325,761.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-73,272,317.24	-919,531,592.11	-992,803,909.35

**6.4.4.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	949,383.78
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	26,180.09
其他	3,299.11
合计	978,862.98

#### 6.4.4.12 股票投资收益

##### 6.4.4.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-325,869,813.21
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-325,869,813.21

##### 6.4.4.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,560,288,270.84
减：卖出股票成本总额	5,886,158,084.05
买卖股票差价收入	-325,869,813.21

##### 6.4.4.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	15,029,965.52
减：现金支付赎回款总额	15,029,965.52
减：赎回股票成本总额	-
赎回差价收入	-

##### 6.4.4.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无

**6.4.4.13 基金投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	35,599,698.96
减：卖出/赎回基金成本总额	40,087,940.64
基金投资收益	-4,488,241.68

**6.4.4.14 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,524,906.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,244,800.00
减：应收利息总额	1,050.41
债券投资收益	279,056.19

**6.4.4.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,825,393.31
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,825,393.31

**6.4.4.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	396,052,829.88
——股票投资	838,081,492.55
——债券投资	-
——基金投资	-442,028,662.67
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-

合计	396,052,829.88
----	----------------

#### 6.4.4.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,555,972.59
替代损益	260,880.54
合计	1,816,853.13

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。

#### 6.4.4.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	4,362,771.59
银行间市场交易费用	-
合计	4,362,771.59

#### 6.4.4.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
审计费用	54,547.97
信息披露费	148,767.52
其他	106,179.59
上市费	29,752.78
银行汇划费	15,258.37
账户维护费	50.00
指数使用费	423,542.91
合计	778,099.14

### 6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.5.1 或有事项

无。

### 6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

### 6.4.6 关联方关系

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

本报告期本基金关联方新增了目标 ETF：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金。

#### 6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司（“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
南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（“目标 ETF”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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。

### 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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	170,173,386.97	4.12%	688,353,043.38	15.59%

##### 6.4.7.1.2 权证交易

无

##### 6.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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	150,587.74	3.87%	-	-



关联方名称	上年度可比期间 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%	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.7.2 关联方报酬

##### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,042,576.82	14,557,322.96
其中：支付销售机构的客户维护费	3,141,453.50	3,366,840.48

注：1、南方中证 500 指数证券投资基金支付基金管理人南方基金管理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。

2、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付基金管理人南方基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数，则取零)的 0.5% 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 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) X 0.5% / 当年天数。

##### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,408,515.40	2,911,464.55

注：1、南方中证 500 指数证券投资基金支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.12% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.12% / 当年天数。

2、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.1% 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 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) X 0.1% / 当年天数。

#### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 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

注：本基金本报告期内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		2012 年 1 月 1 日至 2012 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	195,904,489.47	949,383.31	270,001,273.21	955,542.32

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 4,277,943,257.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 95.57%。

### 6.4.8 利润分配情况

无

### 6.4.9 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2013年3月26日	临时停牌	21.00	2013年7月2日	22.80	107,936	1,515,605.78	2,266,656.00	-
000683	远兴能源	2013年4月4日	临时停牌	4.80	2013年7月18日	5.09	436,932	3,194,559.59	2,097,273.60	-
600654	飞乐股份	2013年4月4日	临时停牌	4.63	2013年7月16日	5.09	441,370	2,417,952.96	2,043,543.10	-
600983	合肥三洋	2013年5月14日	临时停牌	9.96	2013年8月13日	9.91	75,066	762,261.57	747,657.36	-
000997	新大陆	2013年5月31日	临时停牌	15.11	-	-	47,009	594,290.18	710,305.99	-
600328	兰太实业	2013年5月8日	临时停牌	7.30	2013年7月31日	6.57	88,457	846,936.78	645,736.10	-
600088	中视传媒	2013年5月30日	临时停牌	14.29	-	-	27,681	369,557.45	395,561.49	-
600292	九龙电力	2013年6月5日	临时停牌	19.37	2013年7月1日	17.50	15,522	226,573.23	300,661.14	-
000719	大地传媒	2013年5月17日	临时停牌	9.61	2013年8月12日	10.57	23,525	221,058.53	226,075.25	-
601886	江河创建	2013年6月20日	临时停牌	13.22	2013年7月16日	13.78	5,600	74,032.00	74,032.00	-

600284	浦东建设	2013年6月24日	临时停牌	9.50	-	-	7,000	66,500.00	66,500.00	-
600725	云维股份	2013年6月24日	临时停牌	3.77	2013年7月1日	3.42	5,600	21,112.00	21,112.00	-
000998	隆平高科	2013年5月3日	临时停牌	20.73	2013年7月8日	20.50	149,036	2,658,099.23	3,089,516.28	-

注：本基金截至 2013 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无

### 6.4.10 金融工具风险及管理

#### 6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金为交易型开放式指数证券投资基金联接基金，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。

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

其特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.10.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；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 2013 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

#### 6.4.10.3 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 6.4.9 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。

#### 6.4.10.4 市场风险

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

##### 6.4.10.4.1 利率风险

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

本基金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。

##### 6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	195,904,489.47	-	-	-	195,904,489.47
结算备付金	2,196,740.95	-	-	-	2,196,740.95
存出保证金	645,116.91	-	-	-	645,116.91
交易性金融资产	-	-	-	3,908,438,408.82	3,908,438,408.82
应收证券清算款	-	-	-	23,716,586.85	23,716,586.85
应收利息	-	-	-	37,656.87	37,656.87
应收股利	-	-	-	20,089.44	20,089.44
应收申购款	377,478.17	-	-	4,560,931.38	4,938,409.55
其他资产	-	-	-	-186,196.36	-186,196.36
<b>资产总计</b>	<b>199,123,825.50</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>3,936,587,477.00</b>	<b>4,135,711,302.50</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	186,196.36	186,196.36
应付赎回款	-	-	-	5,208,068.72	5,208,068.72
应付管理人报酬	-	-	-	115,160.87	115,160.87
应付托管费	-	-	-	23,032.20	23,032.20
应付交易费用	-	-	-	912,285.48	912,285.48
其他负债	-	-	-	730,750.96	730,750.96
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>7,175,494.59</b>	<b>7,175,494.59</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>199,123,825.50</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>3,929,411,982.41</b>	<b>4,128,535,807.91</b>
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2012 年 12 月 31 日			上		
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	176,977.37	-	-	4,311,550.83	4,488,528.20
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	308,808,897.81	-	-	4,857,863,701.04	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	308,808,897.81	-	-	4,733,423,711.72	5,042,232,609.53

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2013 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2012 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.10.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.10.4.3 其他价格风险

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

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投

资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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	17,649,016.58	0.43	4,808,879,676.46	95.37
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	1,244,800.00	0.02
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	17,649,016.58	0.43	4,810,124,476.46	95.40

#### 6.4.10.4.3.2 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：人民币万元）	
		本期末（2013 年 6 月 30 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	中证 500 指数上升 5%	增加约 19,817	增加约 25,211
中证 500 指数下降 5%	减少约 19,817	减少约 25,211	

## § 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	17,649,016.58	0.43
	其中：股票	17,649,016.58	0.43



2	基金投资	3,890,789,392.24	94.07
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	198,101,230.42	4.79
7	其他各项资产	29,357,859.62	0.71
8	合计	4,135,897,498.86	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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,089,516.28	0.07
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,708,813.39	0.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	300,661.14	0.01
E	建筑业	140,532.00	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	77,551.04	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	710,305.99	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	621,636.74	0.02
S	综合	-	-
	合计	17,649,016.58	0.43

## 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	600198	大唐电信	294,371	3,815,048.16	0.09
2	000998	隆平高科	149,036	3,089,516.28	0.07
3	002252	上海莱士	107,936	2,266,656.00	0.05
4	000683	远兴能源	436,932	2,097,273.60	0.05
5	600654	飞乐股份	441,370	2,043,543.10	0.05
6	600983	合肥三洋	75,066	747,657.36	0.02
7	600685	广船国际	75,245	740,410.80	0.02
8	000997	新大陆	47,009	710,305.99	0.02
9	600328	兰太实业	88,457	645,736.10	0.02
10	600088	中视传媒	27,681	395,561.49	0.01
11	600292	九龙电力	15,522	300,661.14	0.01
12	000719	大地传媒	23,525	226,075.25	0.01
13	600200	江苏吴中	11,200	175,168.00	0.00
14	600458	时代新材	14,303	130,014.27	0.00
15	000099	中信海直	12,448	77,551.04	0.00
16	601886	江河创建	5,600	74,032.00	0.00
17	600284	浦东建设	7,000	66,500.00	0.00
18	600725	云维股份	5,600	21,112.00	0.00
19	600072	中船股份	1,400	14,056.00	0.00
20	601388	怡球资源	1,400	12,138.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000598	兴蓉投资	4,374,828.55	0.09
2	600815	厦工股份	4,291,378.47	0.09
3	002190	成飞集成	4,129,907.35	0.08
4	002004	华邦颖泰	2,779,165.20	0.06
5	600517	置信电气	2,481,048.00	0.05
6	002230	科大讯飞	1,798,390.85	0.04

7	000503	海虹控股	1,588,577.60	0.03
8	600141	兴发集团	1,471,733.58	0.03
9	000400	许继电气	1,459,875.51	0.03
10	600079	人福医药	1,406,056.34	0.03
11	000826	桑德环境	1,398,086.74	0.03
12	000661	长春高新	1,225,538.25	0.02
13	002450	康得新	1,210,996.01	0.02
14	002250	联化科技	1,180,138.93	0.02
15	600436	片仔癀	1,141,712.68	0.02
16	600805	悦达投资	1,119,724.35	0.02
17	002008	大族激光	1,114,926.29	0.02
18	600199	金种子酒	1,072,148.00	0.02
19	000917	电广传媒	1,070,075.94	0.02
20	600557	康缘药业	1,037,777.64	0.02

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	000826	桑德环境	40,966,048.45	0.81
2	000503	海虹控股	37,647,052.63	0.75
3	002230	科大讯飞	36,312,510.10	0.72
4	600079	人福医药	34,523,893.76	0.68
5	002450	康得新	32,915,074.98	0.65
6	000661	长春高新	31,831,986.69	0.63
7	002008	大族激光	30,796,336.92	0.61
8	000598	兴蓉投资	30,023,744.33	0.60
9	000400	许继电气	29,748,674.72	0.59
10	002250	联化科技	29,271,746.47	0.58
11	600436	片仔癀	29,029,074.30	0.58
12	600805	悦达投资	28,444,491.95	0.56
13	600557	康缘药业	27,854,886.49	0.55
14	600199	金种子酒	27,184,929.86	0.54
15	000917	电广传媒	26,444,135.88	0.52
16	600008	首创股份	26,332,618.85	0.52

17	000793	华闻传媒	25,812,358.07	0.51
18	002065	东华软件	25,160,935.07	0.50
19	600867	通化东宝	24,987,637.39	0.50
20	600645	中源协和	24,862,129.93	0.49

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	270,317,511.82
卖出股票收入（成交）总额	5,560,288,270.84

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	500ETF	股票型	交易型开放式	南方基金管理有限公司	3,890,789,392.24	94.24

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

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。

### 7.11.2

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。

### 7.11.3 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	645,116.91
2	应收证券清算款	23,716,586.85
3	应收股利	20,089.44
4	应收利息	37,656.87
5	应收申购款	4,938,409.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,357,859.62

### 7.11.4 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。

### 7.11.5 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	000998	隆平高科	3,089,516.28	0.07	临时停牌
2	002252	上海莱士	2,266,656.00	0.05	临时停牌
3	000683	远兴能源	2,097,273.60	0.05	临时停牌
4	600654	飞乐股份	2,043,543.10	0.05	临时停牌
5	600983	合肥三洋	747,657.36	0.02	临时停牌
6	000997	新大陆	710,305.99	0.02	临时停牌
7	600328	兰太实业	645,736.10	0.02	临时停牌
8	600088	中视传媒	395,561.49	0.01	临时停牌

注：本基金本报告期末前十名股票中除上述股票外不存在流通受限情况。

### 7.11.6 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
356,482	14,366.33	223,088,630.70	4.36%	4,898,251,086.56	95.64%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份 额比例
1	姜山	10,131,043.00	8.19%
2	朝恒房地产（深圳）有限公司	8,500,000.00	6.88%
3	项志英	1,500,000.00	1.21%
4	陈枫	1,489,210.00	1.20%
5	幸芸	1,219,223.00	0.99%
6	吴彤	1,107,200.00	0.90%
7	韩镛	1,105,794.00	0.89%
8	高琪	1,000,000.00	0.81%
9	姜登斌	947,200.00	0.77%
10	吕大贤	872,556.00	0.71%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	3,586,247.40	0.0700%

注：本公司基金投资和部门负责人未持有本基金份额，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），本基金基金经理持有本基金份额的数量区间为 0 至 10 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	6, 205, 579, 059. 16
本报告期基金总申购份额	877, 214, 493. 69
减: 本报告期基金总赎回份额	1, 961, 453, 835. 59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	5, 121, 339, 717. 26

## § 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

经中国证监会基金部【2013】13 号文函复，基金管理人于 2013 年 1 月 5 日发布公告，自 2013 年 1 月 1 日起，高良玉不再担任公司总经理职务，由董事长吴万善代为履行公司总经理职务。

经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1087 号文核准，基金管理人于 2013 年 8 月 22 日发布公告，自 2013 年 8 月 22 日起，杨小松转任公司总经理职务，不再担任公司督察长职务；由鲍文革担任公司督察长职务。

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。

### 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

2013 年 2 月 6 日，本公司管理的中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金合同生效。根据《南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关约定，基金管理人经与基金托管人协商一致，将本基金变更为中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，本基金的名称相应变更为“南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）”。本基金投资策略修改为：“本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目

标 ETF。为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90%的资产投资于目标 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、非成份股、新股、权证、债券资产、资产支持证券、固定收益类资产、现金资产、货币市场工具、衍生工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。

## 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

因基金管理人管理的南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（“开元 300ETF”）在集中申购期超过沪深 300 指数自然权重大比例接受停牌的永泰能源股票换购，然后在建仓期大比例卖出超过沪深 300 自然权重的部分股票，致使基金资产受到较大损失，2013 年 4 月 19 日中国证监会向公司下发了《关于对南方基金管理有限公司采取责令整改等措施的决定》（【2013】18 号）的行政监管措施决定书，认为基金管理人在开元 300ETF 投资过程中未能履行谨慎勤勉义务，内部控制方面存在内部控制制度建设薄弱，缺乏 ETF 募集期股票换购的相关制度规定；合规及风控管理未能覆盖 ETF 基金投资环节；关于永泰能源的相关决策未能留痕等。鉴于上述情况，按照《证券投资基金管理公司管理办法》第七十五条的规定，中国证监会责令公司进行为期 3 个月的整改，在整改期间暂停受理和审核公司所有新产品和新业务申请。

基金管理人于 2013 年 4 月 24 日发布了《南方开元沪深 300ETF 基金持有人补偿公告》，对开元 300ETF 超比例接受永泰能源股票换购给相关基金份额持有人造成的经济损失进行了补偿，实际补偿金额为 47,996,008.62 元。

同时，基金管理人就公司内部管理、合规及风险控制制度建设、ETF 募集及投资管理程序方面的问题进行了一一整改，并向中国证监会及其深圳监管局提交了整改报告，目前已完成整改工作、经监管部门现场检查并验收合格。

除上述情况外，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	股票交易	应支付该券商的佣金



	交易单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	备注
国泰君安	1	2,917,435,978.34	70.71%	2,823,264.13	72.46%	-
华泰证券	1	170,173,386.97	4.12%	150,587.74	3.87%	-
招商证券	1	895,987,785.62	21.72%	792,870.66	20.35%	-
齐鲁证券	1	58,219,416.46	1.41%	53,003.59	1.36%	-
中天证券	1	44,186,326.52	1.07%	40,227.64	1.03%	-
东方证券	1	39,781,667.23	0.96%	36,217.88	0.93%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元的选择标准和程序 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48 号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。 A：选择标准 (a)公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好； (b)公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告； (c)公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求； (d)建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。 B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位： (a)服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座； (b)研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确； (c)资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-	820,818,249.81	100.00%

华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	1,524,906.60	100.00%	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	• 南方基金关于旗下部分基金增加展恒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	2013年6月21日
2	• 南方基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海证券推出基金定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年6月5日
3	• 关于南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 变更基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年4月22日
4	• 关于南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 变更基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年4月20日
5	• 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	2013年4月1日
6	• 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	2013年4月1日
7	• 南方基金关于旗下部分基金增加天天基金为代销机构及开通定投和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	2013年3月15日
8	• 南方基金关于旗下部分基金增加东兴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	2013年3月1日
9	• 南方基金关于旗下部分基金增加联讯证券为代销机构及开通定	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013年2月28日

	投和转换业务的公告		
10	• 关于南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 修改基金合同、托管协议并变更基金名称的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 2 月 20 日
11	• 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	2013 年 1 月 31 日
12	• 南方基金关于南方 500 基金增加汉口银行行为代销机构及开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 1 月 31 日
13	• 南方基金管理有限公司关于旗下基金投资非控股股东承销证券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013 年 1 月 8 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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金合同。
- 3、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 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

深圳市福田区中心区福华一路 6 号免税商务大厦 31 至 33 楼

### 11.3 查阅方式

网站: <http://www.nffund.com>