

南方中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金(LOF)2014 年半年度报告

2014 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：2014 年 8 月 26 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 2014 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
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.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	32
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.....	32
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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	48
7.10 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.....	48
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.13 投资组合报告附注.....	49

§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	50
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
§11 备查文件目录	54
11.1 备查文件目录.....	54
11.2 存放地点.....	54
11.3 查阅方式.....	54

§ 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	4,650,667,836.59 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
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	<p>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。</p> <p>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%。</p>

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	李芳菲
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-63201816
注册地址		深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		吴万善	蒋超良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	132,379,663.29
本期利润	165,256,343.30
加权平均基金份额本期利润	0.0327
本期加权平均净值利润率	3.43%
本期基金份额净值增长率	1.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-178,657,225.52
期末可供分配基金份额利润	-0.0384
期末基金资产净值	4,472,010,611.07
期末基金份额净值	0.9616
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	2.26%

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

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

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

3.2 基金净值表现

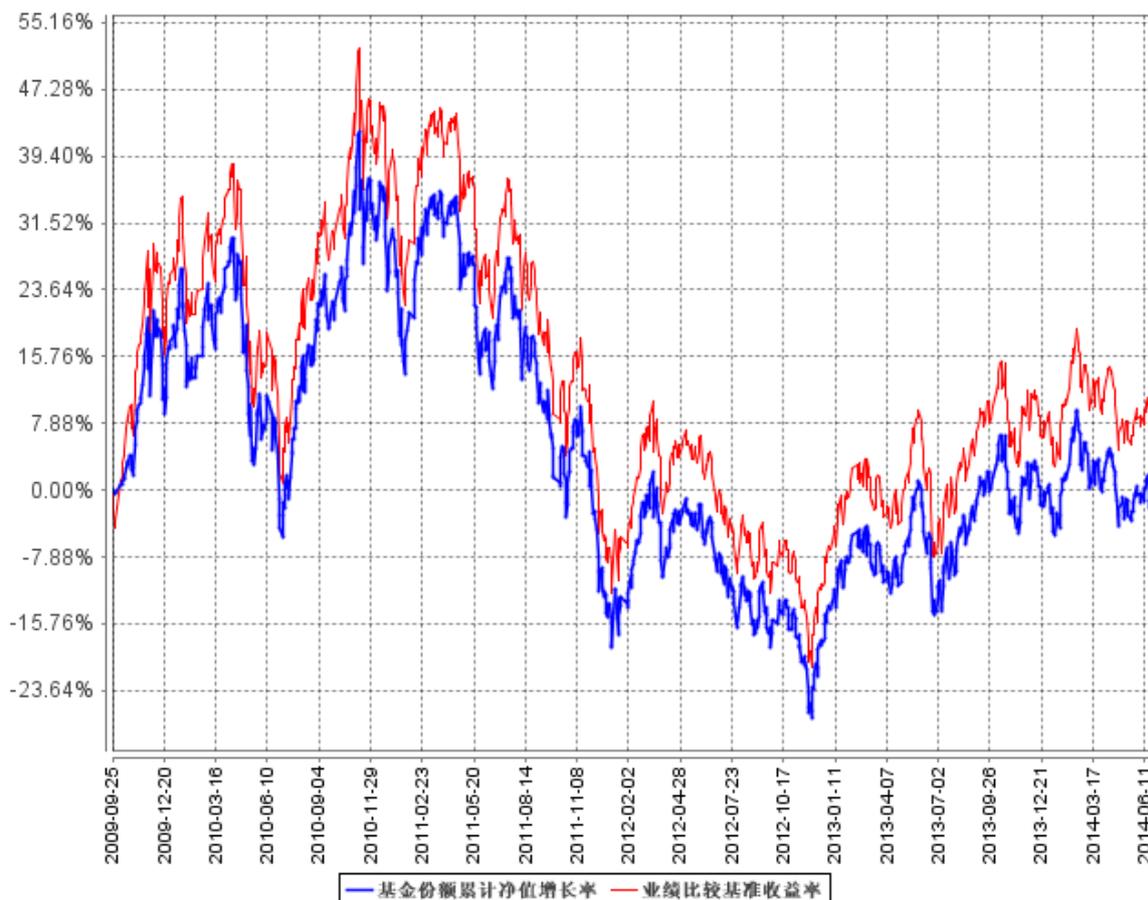
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.68%	0.93%	2.38%	0.93%	0.30%	0.00%
过去三个月	2.53%	1.01%	2.11%	1.01%	0.42%	0.00%
过去六个月	1.98%	1.20%	2.43%	1.19%	-0.45%	0.01%
过去一年	19.29%	1.26%	20.27%	1.26%	-0.98%	0.00%

过去三年	-14.44%	1.40%	-13.25%	1.40%	-1.19%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.26%	1.48%	11.26%	1.50%	-9.00%	-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：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

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

南方基金总部设在深圳，注册资本 1.5 亿元人民币。股东结构为：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%); 兴业证券股份有限公司 (10%)。目前, 公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司, 在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中, 南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末, 南方基金管理有限公司(不含子公司)管理资产规模近 2,800 亿元, 旗下管理 51 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		
罗文杰	本基金的基金经理	2013年4月22日	-	9	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遵规守信情况的说明

报告期内, 本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则, 并严格按照《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的各项规定, 本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金持有人谋求与标的指数相近的收益。本报告期内, 基金运作整体合法合规, 无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 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 4 次，其中 1 次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致，3 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，我国经济增长力度有所放缓，但整体保持在平稳状态。同期中证 500 指数上涨 2.50%。

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；
- ③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；
- ④6 月中，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 0.398%，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 0.9616 元，报告期内，份额净值增长率为 1.98%，同期业绩基准增长率为 2.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前，中国经济进入增长第二季，主要特征为重工业化时代渐行渐远，经济增速下降，经济增长方式亟待转变，改革转型为政策主旋律。海外方面，基本面较为平稳，美国当前经济活动日渐回升，对美国经济复苏的趋势不必过分怀疑。

我国经济已经连续出现企稳信号，大盘短期内迎来阶段性反弹机会，因此在注意控制风险的同时，可以看好一些中长期前景良好的板块。

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，组成人员包括副总裁、总裁助理兼权益投资总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等。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。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。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，本报告期末未有收益分配事项。

§ 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 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：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.4.1	230,896,589.88	222,842,478.79
结算备付金		6,740.28	341,911.29
存出保证金		922,964.11	505,684.42
交易性金融资产	6.4.4.2	4,241,538,218.17	4,157,992,925.20
其中：股票投资		15,651,117.30	595,391.00
基金投资		4,225,887,100.87	4,157,397,534.20
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		15,092,457.10	15,038,010.37
应收利息	6.4.4.5	39,228.87	43,268.91
应收股利		1,691.14	1,691.14
应收申购款		1,165,501.14	2,949,389.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	5,367,66.67
资产总计		4,489,663,390.69	4,400,252,125.95
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	40,344.6
应付赎回款		17,081,109.58	7,139,490.43
应付管理人报酬		106,569.48	94,868.37
应付托管费		21,313.93	18,973.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	174,341.20	871,658.10

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	269,445.43	232,991.81
负债合计		17,652,779.62	8,357,982.38
所有者权益：			
实收基金	6.4.4.9	4,650,667,836.59	4,657,868,889.39
未分配利润	6.4.4.10	-178,657,225.52	-266,015,090.42
所有者权益合计		4,472,010,611.07	4,391,853,798.97
负债和所有者权益总计		4,489,663,390.69	4,400,252,125.95

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9616 元，基金份额总额 4,650,667,836.59 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		170,081,819.13	70,595,813.67
1.利息收入		963,962.56	979,736.05
其中：存款利息收入	6.4.4.11	963,962.56	978,862.98
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）		133,480,153.77	-328,253,605.39
其中：股票投资收益	6.4.4.12	19,517,323.18	-325,869,813.21
基金投资收益	6.4.4.13	113,670,980.30	-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		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.4.15	291,850.29	1,825,393.31
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.16	32,876,680.01	396,052,829.88
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	2,761,022.79	1,816,853.13
减：二、费用		4,825,475.83	13,591,962.95

1. 管理人报酬		859,631.45	7,042,576.82
2. 托管费		171,926.39	1,408,515.40
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.4.18	3,555,172.44	4,362,771.59
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	238,745.55	778,099.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		165,256,343.30	57,003,850.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		165,256,343.30	57,003,850.72

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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	4,657,868,889.39	-266,015,090.42	4,391,853,798.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	165,256,343.30	165,256,343.30
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）	-7,201,052.80	-77,898,478.40	-85,099,531.20
其中：1. 基金申购款	2,672,138,605.81	-132,832,707.43	2,539,305,898.38
2. 基金赎回款	-2,679,339,658.61	54,934,229.03	-2,624,405,429.58
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）	4,650,667,836.59	-178,657,225.52	4,472,010,611.07
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		

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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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 2014 年 6 月 30 日
活期存款	230,896,589.88
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	230,896,589.88

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	15,412,862.57	15,651,117.30	238,254.73
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	3,980,027,202.18	4,225,887,100.87	245,859,898.69
其他	-	-	-
合计	3,995,440,064.75	4,241,538,218.17	246,098,153.42

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 2014年6月30日
应收活期存款利息	38,852.31
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	2.79
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	373.77
合计	39,228.87

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 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	174,341.20
银行间市场应付交易费用	-
合计	174,341.20

6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	39,352.80
预提费用	230,092.63
合计	269,445.43

6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	4,657,868,889.39	4,657,868,889.39
本期申购	2,672,138,605.81	2,672,138,605.81
本期赎回(以“-”号填列)	-2,679,339,658.61	-2,679,339,658.61
- 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	4,650,667,836.59	4,650,667,836.59

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	-77,380,302.41	-188,634,788.01	-266,015,090.42
本期利润	132,379,663.29	32,876,680.01	165,256,343.30
本期基金份额交易产生的变动数	-24,462,769.47	-53,435,708.93	-77,898,478.40

其中：基金申购款	-37,058,518.13	-95,774,189.30	-132,832,707.43
基金赎回款	12,595,748.66	42,338,480.37	54,934,229.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,536,591.41	-209,193,816.93	-178,657,225.52

6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	922,137.38
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	24,357.30
其他	17,467.88
合计	963,962.56

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 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,196,164.18
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	7,321,159.00
合计	19,517,323.18

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 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	1,206,644,276.37
减：卖出股票成本总额	1,194,448,112.19
买卖股票差价收入	12,196,164.18

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

	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	1,668,377,713.29
减：现金支付赎回款总额	1,668,377,713.29
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

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	983,968,600.00
减：现金支付申购款总额	486,044,563.62
减：申购股票成本总额	490,602,877.38
申购差价收入	7,321,159.00

6.4.4.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	1,587,884,539.33
减：卖出/赎回基金成本总额	1,474,213,559.03
基金投资收益	113,670,980.30

6.4.4.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	291,850.29
基金投资产生的股利收益	-
合计	291,850.29

6.4.4.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	32,876,680.01
——股票投资	239,944.94
——债券投资	-
——基金投资	32,636,735.07

——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	32,876,680.01

6.4.4.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	2,761,022.79
合计	2,761,022.79

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。

6.4.4.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	3,555,172.44
银行间市场交易费用	-
合计	3,555,172.44

6.4.4.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	51,572.33
信息披露费	148,767.52
上市费	29,752.78
银行汇划费	8,552.92
账户维护费	100.00
合计	238,745.55

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	27,660,953.55	1.25%	170,173,386.97	4.12%

6.4.7.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014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	24,477.26	1.22%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%	-	-

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
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	859,631.45	7,042,576.82
其中：支付销售机构的客户维护费	2,847,264.29	3,141,453.50

注：本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) × 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
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	171,926.39	1,408,515.40

注：本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:

$$\text{日托管费} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产}) \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

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	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		2013 年 1 月 1 日至 2013 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	230,896,589.88	922,137.38	195,904,489.47	949,383.31

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 3,835,787,511 份目标 ETF 基金份额, 占其总份额的比例为 94.50%。

6.4.8 利润分配情况

无

6.4.9 期末(2014 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	2014年6月13日	临时停牌	63.30	-	-	4,600	294,217.60	291,180.00	-
601012	隆基股份	2014年6月19日	临时停牌	15.50	2014年7月1日	15.60	10,200	139,172.00	158,100.00	-
600490	鹏欣资源	2014年4月1日	临时停牌	6.11	2014年7月15日	6.11	25,170	155,896.32	153,788.70	-
600755	厦门国贸	2014年6月27日	临时停牌	4.85	2014年7月7日	4.74	30,200	156,322.20	146,470.00	-
002340	格林美	2014年6月26日	临时停牌	11.19	2014年7月24日	11.77	12,700	138,923.04	142,113.00	-
600685	广船国际	2014年4月7日	临时停牌	17.13	-	-	7,470	124,212.20	127,961.10	-
600582	天地科技	2014年6月26日	临时停牌	7.97	-	-	15,300	140,202.00	121,941.00	-
600757	长江传媒	2014年6月17日	临时停牌	8.85	-	-	11,600	100,255.64	102,660.00	-
600418	江淮汽车	2014年4月14日	临时停牌	10.20	2014年7月11日	11.22	9,300	95,127.43	94,860.00	-
000762	西藏矿业	2014年4月29日	临时停牌	10.54	2014年7月28日	11.59	8,200	92,935.20	86,428.00	-
000612	焦作万方	2014年4月3日	临时停牌	6.08	-	-	12,900	81,657.00	78,432.00	-
600260	凯乐科技	2014年6月9日	临时停牌	6.59	-	-	11,500	78,752.19	75,785.00	-
600864	哈投股份	2014年4月11日	临时停牌	8.68	2014年7月15日	8.30	8,300	70,101.35	72,044.00	-
000852	江钻股份	2014年5月28日	临时停牌	15.80	-	-	4,400	71,015.29	69,520.00	-

002638	勤上光电	2014年 6月10 日	临时 停牌	14.15	2014年 7月15 日	14.75	4,800	57,782.76	67,920.00	-
601777	力帆股份	2014年 6月24 日	临时 停牌	6.39	2014年 7月8 日	6.70	10,200	69,226.73	65,178.00	-
600850	华东电脑	2014年 4月4 日	临时 停牌	19.56	2014年 7月11 日	21.52	3,000	58,795.50	58,680.00	-
600059	古越龙山	2014年 6月30 日	临时 停牌	7.97	2014年 7月1 日	7.83	5,700	45,167.94	45,429.00	-
002635	安洁科技	2014年 6月30 日	临时 停牌	31.99	2014年 8月5 日	35.19	1,100	36,502.76	35,189.00	-
600507	方大特钢	2014年 6月30 日	临时 停牌	3.16	2014年 7月2 日	3.03	8,300	27,544.16	26,228.00	-

注：本基金截至 2014 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

本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现。本基金投资的金融工具主要为股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体

系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司总经理负责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.10.2 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 2014 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 2014年6月30日	1年以内	1-5 年	5年 以上	不计息	合计
资产					
银行存款	230,896,589.88	-	-	-	230,896,589.88
结算备付金	6,740.28	-	-	-	6,740.28
存出保证金	922,964.11	-	-	-	922,964.11
交易性金融资产	-	-	-	4,241,538,218.17	4,241,538,218.17
应收证券清算款	-	-	-	15,092,457.10	15,092,457.10
应收利息	-	-	-	39,228.87	39,228.87
应收股利	-	-	-	1,691.14	1,691.14
应收申购款	51,938.99	-	-	1,113,562.15	1,165,501.14
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	231,878,233.26	-	-	-4,257,785,157.43	4,489,663,390.69
负债					
应付赎回款				17,081,109.58	17,081,109.58
应付管理人报酬				106,569.48	106,569.48
应付托管费				21,313.93	21,313.93
应付交易费用				174,341.20	174,341.20
其他负债				269,445.43	269,445.43
负债总计				17,652,779.62	17,652,779.62
利率敏感度缺口	231,878,233.26	-	-	-4,240,132,377.81	4,472,010,611.07
上年度末 2013 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	222,842,478.79	-	-	-	222,842,478.79
结算备付金	341,911.29	-	-	-	341,911.29
存出保证金	505,684.42	-	-	-	505,684.42
交易性金融资产				-4,157,992,925.20	4,157,992,925.20
应收证券清算款				15,038,010.37	15,038,010.37
应收利息				43,268.91	43,268.91
应收股利				1,691.14	1,691.14
应收申购款	61,955.66	-	-	2,887,433.50	2,949,389.16
其他资产				536,766.67	536,766.67
资产总计	223,752,030.16	-	-	4176500095.79	4400252125.95
负债					
应付证券清算款				40,344.60	40,344.60
应付赎回款				7,139,490.43	7,139,490.43
应付管理人报酬				94,868.37	94,868.37
应付托管费				18,973.67	18,973.67
应付交易费用				871,658.10	871,658.10
其他负债				232,991.81	232,991.81
负债总计				8,398,326.98	8,398,326.98
利率敏感度缺口	223,752,030.16	-	-	-4,168,101,768.81	4,391,853,798.97

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 2014 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.10.4.2 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。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 500 指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中，中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 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	15,651,117.30	0.35	595,391.00	0.01
交易性金融资产-基金投资	4,225,887,100.87	94.50	4,157,397,534.20	94.66
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,241,538,218.17	94.85	4,157,992,925.20	94.68

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（2014年6月30日）	上年度末（2013年12月31日）
	中证 500 指数上升 5%	增加约 21,327	增加约 21,853
	中证 500 指数下降 5%	减少约 21,327	减少约 21,853

§ 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	15,651,117.30	0.35
	其中：股票	15,651,117.30	0.35
2	基金投资	4,225,887,100.87	94.13
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	230,903,330.16	5.14
8	其他各项资产	17,221,842.36	0.38
9	合计	4,489,663,390.69	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	267,862.02	0.01
B	采矿业	488,452.86	0.01
C	制造业	9,823,524.66	0.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	384,178.40	0.01

E	建筑业	385,246.00	0.01
F	批发和零售业	1,115,502.71	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	397,946.70	0.01
H	住宿和餐饮业	21,333.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	766,398.10	0.02
J	金融业	227,164.00	0.01
K	房地产业	974,370.85	0.02
L	租赁和商务服务业	218,557.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	58,275.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	131,482.00	0.00
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	220,256.00	0.00
S	综合	170,568.00	0.00
	合计	15,651,117.30	0.35

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	002252	上海莱士	4,600	291,180.00	0.01
2	601012	隆基股份	10,200	158,100.00	0.00
3	600490	鹏欣资源	25,170	153,788.70	0.00
4	600755	厦门国贸	30,200	146,470.00	0.00
5	002340	格林美	12,700	142,113.00	0.00
6	600685	广船国际	7,470	127,961.10	0.00
7	600582	天地科技	15,300	121,941.00	0.00
8	600570	恒生电子	3,600	105,840.00	0.00
9	600757	长江传媒	11,600	102,660.00	0.00
10	600418	江淮汽车	9,300	94,860.00	0.00
11	000762	西藏矿业	8,200	86,428.00	0.00
12	002250	联化科技	5,800	82,360.00	0.00
13	000612	焦作万方	12,900	78,432.00	0.00
14	600587	新华医疗	1,033	77,010.15	0.00

15	600557	康缘药业	2,673	76,715.10	0.00
16	600260	凯乐科技	11,500	75,785.00	0.00
17	600879	航天电子	6,200	73,036.00	0.00
18	000559	万向钱潮	7,100	72,988.00	0.00
19	600864	哈投股份	8,300	72,044.00	0.00
20	000998	隆平高科	2,600	71,448.00	0.00
21	600312	平高电气	5,100	71,094.00	0.00
22	002190	成飞集成	1,200	70,800.00	0.00
23	000852	江钻股份	4,400	69,520.00	0.00
24	002022	科华生物	3,000	69,150.00	0.00
25	002638	勤上光电	4,800	67,920.00	0.00
26	601099	太平洋	10,500	66,885.00	0.00
27	600201	金宇集团	2,100	65,352.00	0.00
28	601777	力帆股份	10,200	65,178.00	0.00
29	600872	中炬高新	5,900	62,953.00	0.00
30	600059	古越龙山	7,770	61,926.90	0.00
31	600398	海澜之家	6,700	61,640.00	0.00
32	600967	北方创业	4,900	61,495.00	0.00
33	002005	德豪润达	7,300	61,101.00	0.00
34	002405	四维图新	3,600	59,832.00	0.00
35	000977	浪潮信息	1,700	59,806.00	0.00
36	600850	华东电脑	3,000	58,680.00	0.00
37	600645	中源协和	2,100	58,275.00	0.00
38	000511	烯碳新材	8,600	57,964.00	0.00
39	600525	长园集团	5,200	57,408.00	0.00
40	002063	远光软件	2,800	57,260.00	0.00
41	002152	广电运通	3,340	56,913.60	0.00
42	600584	长电科技	6,400	56,512.00	0.00
43	600759	正和股份	5,500	56,210.00	0.00
44	600694	大商股份	2,200	56,166.00	0.00
45	600517	置信电气	5,500	55,880.00	0.00
46	600522	中天科技	4,200	54,978.00	0.00
47	600138	中青旅	2,500	54,450.00	0.00
48	600770	综艺股份	5,800	53,708.00	0.00
49	600643	爱建股份	5,800	53,302.00	0.00
50	600601	方正科技	16,400	52,316.00	0.00
51	600811	东方集团	10,000	51,900.00	0.00
52	600881	亚泰集团	14,100	51,888.00	0.00
53	002440	闰土股份	2,800	51,800.00	0.00

54	002153	石基信息	1,000	51,300.00	0.00
55	600654	飞乐股份	5,600	50,680.00	0.00
56	002219	恒康医疗	2,300	50,554.00	0.00
57	600175	美都控股	8,655	49,766.25	0.00
58	600037	歌华有线	4,700	49,444.00	0.00
59	000712	锦龙股份	3,300	49,269.00	0.00
60	600820	隧道股份	10,100	48,985.00	0.00
61	600200	江苏吴中	4,700	48,833.00	0.00
62	000897	津滨发展	9,600	48,096.00	0.00
63	600675	中华企业	9,780	47,433.00	0.00
64	600747	大连控股	7,600	47,196.00	0.00
65	600635	大众公用	9,800	46,942.00	0.00
66	600158	中体产业	5,000	46,900.00	0.00
67	600511	国药股份	2,050	46,535.00	0.00
68	002004	华邦颖泰	2,500	46,500.00	0.00
69	002701	奥瑞金	2,300	46,391.00	0.00
70	002048	宁波华翔	3,086	45,981.40	0.00
71	600805	悦达投资	5,000	45,950.00	0.00
72	600787	中储股份	3,500	45,745.00	0.00
73	000550	江铃汽车	1,569	45,469.62	0.00
74	002266	浙富控股	6,400	45,376.00	0.00
75	000848	承德露露	2,275	45,204.25	0.00
76	600410	华胜天成	3,800	45,182.00	0.00
77	600110	中科英华	8,600	45,150.00	0.00
78	000997	新大陆	2,600	45,136.00	0.00
79	002092	中泰化学	7,200	44,496.00	0.00
80	000988	华工科技	4,700	44,133.00	0.00
81	002191	劲嘉股份	3,300	43,890.00	0.00
82	600261	阳光照明	4,400	43,472.00	0.00
83	600432	吉恩镍业	3,000	43,320.00	0.00
84	600478	科力远	1,900	43,054.00	0.00
85	600978	宜华木业	8,800	42,944.00	0.00
86	600151	航天机电	5,600	42,784.00	0.00
87	002049	同方国芯	1,800	42,750.00	0.00
88	600797	浙大网新	6,200	42,470.00	0.00
89	002271	东方雨虹	1,700	42,245.00	0.00
90	002073	软控股份	4,400	42,108.00	0.00
91	600422	昆明制药	2,002	42,062.02	0.00
92	600765	中航重机	3,500	42,000.00	0.00

93	600572	康恩贝	3,000	41,610.00	0.00
94	000939	凯迪电力	5,600	41,440.00	0.00
95	600139	西部资源	3,000	41,400.00	0.00
96	002437	誉衡药业	800	41,200.00	0.00
97	600651	飞乐音响	5,500	40,700.00	0.00
98	600500	中化国际	6,300	40,572.00	0.00
99	600198	大唐电信	2,700	40,230.00	0.00
100	000049	德赛电池	1,000	40,170.00	0.00
101	600366	宁波韵升	2,700	40,068.00	0.00
102	000028	国药一致	1,000	39,950.00	0.00
103	000735	罗牛山	6,500	39,780.00	0.00
104	600284	浦东建设	4,200	39,522.00	0.00
105	000788	北大医药	2,600	39,468.00	0.00
106	600183	生益科技	6,400	39,424.00	0.00
107	600320	振华重工	12,303	39,246.57	0.00
108	000541	佛山照明	3,900	38,844.00	0.00
109	002223	鱼跃医疗	1,599	38,775.75	0.00
110	600521	华海药业	3,500	38,675.00	0.00
111	000887	中鼎股份	4,000	38,640.00	0.00
112	600112	天成控股	3,000	38,460.00	0.00
113	002309	中利科技	2,200	38,258.00	0.00
114	002155	辰州矿业	5,100	38,148.00	0.00
115	000513	丽珠集团	800	37,784.00	0.00
116	002595	豪迈科技	800	37,720.00	0.00
116	600351	亚宝药业	4,100	37,720.00	0.00
117	600835	上海机电	2,400	37,392.00	0.00
118	600776	东方通信	2,800	37,380.00	0.00
119	600699	均胜电子	1,485	37,318.05	0.00
120	000690	宝新能源	9,000	36,720.00	0.00
121	002690	美亚光电	1,040	36,680.80	0.00
122	600596	新安股份	4,000	36,600.00	0.00
123	002396	星网锐捷	1,300	36,387.00	0.00
124	600038	哈飞股份	1,300	36,179.00	0.00
125	600884	杉杉股份	2,100	36,099.00	0.00
126	600169	太原重工	12,700	36,068.00	0.00
127	600426	华鲁恒升	5,000	36,000.00	0.00
128	000829	天音控股	4,200	35,532.00	0.00
129	600611	大众交通	5,400	35,478.00	0.00
130	002635	安洁科技	1,100	35,189.00	0.00

131	002428	云南锆业	2,900	35,177.00	0.00
132	002573	国电清新	2,000	35,160.00	0.00
133	000969	安泰科技	3,800	34,960.00	0.00
134	600161	天坛生物	1,900	34,922.00	0.00
135	601519	大智慧	5,930	34,809.10	0.00
136	002273	水晶光电	1,900	34,770.00	0.00
137	600387	海越股份	2,300	34,684.00	0.00
138	600503	华丽家族	8,500	34,680.00	0.00
139	600816	安信信托	2,400	34,560.00	0.00
140	002424	贵州百灵	1,400	34,524.00	0.00
141	000809	铁岭新城	2,900	34,423.00	0.00
142	000528	柳工	5,900	34,338.00	0.00
143	600435	北方导航	2,800	34,300.00	0.00
143	600673	东阳光科	2,800	34,300.00	0.00
144	000671	阳光城	3,900	34,281.00	0.00
145	600704	物产中大	4,100	33,948.00	0.00
146	002508	老板电器	1,200	33,924.00	0.00
147	600122	宏图高科	6,800	33,864.00	0.00
148	000616	亿城投资	10,600	33,708.00	0.00
149	000422	湖北宜化	6,700	33,567.00	0.00
150	002368	太极股份	1,000	33,490.00	0.00
151	002181	粤传媒	2,100	33,180.00	0.00
152	002477	雏鹰农牧	3,500	32,935.00	0.00
153	600545	新疆城建	4,000	32,800.00	0.00
154	600125	铁龙物流	6,800	32,776.00	0.00
155	600171	上海贝岭	4,014	32,754.24	0.00
156	000566	海南海药	3,000	32,640.00	0.00
157	600270	外运发展	2,700	32,616.00	0.00
158	000006	深振业 A	7,100	32,518.00	0.00
159	600160	巨化股份	6,700	32,428.00	0.00
160	000759	中百集团	4,000	32,400.00	0.00
161	002052	同洲电子	3,600	32,364.00	0.00
162	600790	轻纺城	3,600	32,328.00	0.00
163	600056	中国医药	3,038	32,293.94	0.00
164	600509	天富热电	4,000	32,280.00	0.00
165	600580	卧龙电气	4,200	32,214.00	0.00
166	002317	众生药业	1,600	31,952.00	0.00
167	000078	海王生物	4,300	31,863.00	0.00
168	600220	江苏阳光	10,700	31,779.00	0.00

169	600067	冠城大通	6,300	31,563.00	0.00
170	600761	安徽合力	3,200	31,488.00	0.00
171	600240	华业地产	6,400	31,232.00	0.00
172	002050	三花股份	2,850	30,951.00	0.00
173	002414	高德红外	1,700	30,923.00	0.00
174	002069	獐子岛	2,200	30,756.00	0.00
175	000415	渤海租赁	4,000	30,720.00	0.00
176	002041	登海种业	1,103	30,707.52	0.00
177	002018	华星化工	3,600	30,528.00	0.00
178	600458	时代新材	3,460	30,517.20	0.00
179	600825	新华传媒	3,900	30,459.00	0.00
180	600289	亿阳信通	3,400	30,430.00	0.00
181	002431	棕榈园林	1,700	30,260.00	0.00
182	601717	郑煤机	6,200	30,132.00	0.00
183	600536	中国软件	1,400	30,100.00	0.00
184	600266	北京城建	4,000	29,880.00	0.00
185	600325	华发股份	4,800	29,808.00	0.00
186	000652	泰达股份	7,700	29,799.00	0.00
187	600017	日照港	11,500	29,785.00	0.00
188	600187	国中水务	6,500	29,770.00	0.00
189	600409	三友化工	6,800	29,716.00	0.00
190	600416	湘电股份	3,100	29,667.00	0.00
191	000510	金路集团	4,500	29,565.00	0.00
192	000088	盐田港	5,800	29,464.00	0.00
193	600812	华北制药	6,000	29,460.00	0.00
194	000933	神火股份	8,500	29,410.00	0.00
195	002168	深圳惠程	4,000	29,360.00	0.00
196	600481	双良节能	3,000	29,310.00	0.00
197	002161	远望谷	3,800	29,260.00	0.00
198	002056	横店东磁	1,500	29,190.00	0.00
198	002249	大洋电机	2,100	29,190.00	0.00
199	000823	超声电子	2,400	29,112.00	0.00
200	000540	中天城投	5,700	29,070.00	0.00
201	000697	炼石有色	2,100	29,043.00	0.00
202	000726	鲁泰 A	3,300	29,007.00	0.00
203	600720	祁连山	4,600	28,842.00	0.00
204	000786	北新建材	2,100	28,812.00	0.00
205	000488	晨鸣纸业	6,600	28,776.00	0.00
206	600086	东方金钰	1,600	28,576.00	0.00

207	600292	中电远达	1,500	28,560.00	0.00
208	600851	海欣股份	4,400	28,556.00	0.00
209	002444	巨星科技	3,000	28,500.00	0.00
210	600064	南京高科	2,636	28,337.00	0.00
211	002064	华峰氨纶	3,300	28,248.00	0.00
212	000877	天山股份	4,600	28,106.00	0.00
213	600894	广日股份	2,543	28,049.29	0.00
214	601718	际华集团	11,400	28,044.00	0.00
215	002183	怡亚通	3,600	27,828.00	0.00
216	600460	士兰微	4,700	27,824.00	0.00
217	000816	江淮动力	6,400	27,648.00	0.00
218	600640	号百控股	1,600	27,584.00	0.00
219	601369	陕鼓动力	4,900	27,489.00	0.00
220	002029	七匹狼	3,400	27,472.00	0.00
221	000926	福星股份	4,200	27,384.00	0.00
222	000572	海马汽车	7,400	27,380.00	0.00
223	600563	法拉电子	810	26,932.50	0.00
224	600251	冠农股份	1,800	26,910.00	0.00
225	002118	紫鑫药业	1,900	26,885.00	0.00
226	600859	王府井	1,700	26,860.00	0.00
227	600132	重庆啤酒	1,800	26,856.00	0.00
228	000982	中银绒业	3,699	26,817.75	0.00
229	601311	骆驼股份	2,500	26,800.00	0.00
230	600575	芜湖港	7,200	26,784.00	0.00
231	000830	鲁西化工	7,600	26,752.00	0.00
232	000919	金陵药业	1,900	26,448.00	0.00
233	002714	牧原股份	600	26,430.00	0.00
234	002311	海大集团	2,400	26,424.00	0.00
235	000973	佛塑科技	5,000	26,400.00	0.00
236	600885	宏发股份	1,200	26,364.00	0.00
237	600329	中新药业	1,700	26,333.00	0.00
238	601000	唐山港	6,000	26,280.00	0.00
239	600507	方大特钢	8,300	26,228.00	0.00
240	600073	上海梅林	3,600	26,172.00	0.00
241	002028	思源电气	2,780	26,132.00	0.00
242	600389	江山股份	800	26,088.00	0.00
243	600401	海润光伏	3,264	26,046.72	0.00
244	000667	美好集团	15,200	25,992.00	0.00
245	600120	浙江东方	2,300	25,990.00	0.00

246	000021	长城开发	4,400	25,960.00	0.00
247	000587	金叶珠宝	2,500	25,950.00	0.00
248	000669	金鸿能源	1,500	25,770.00	0.00
249	000543	皖能电力	3,900	25,740.00	0.00
250	600482	风帆股份	2,400	25,680.00	0.00
251	000050	深天马 A	2,050	25,625.00	0.00
252	000886	海南高速	5,900	25,547.00	0.00
253	600141	兴发集团	2,600	25,506.00	0.00
254	000975	银泰资源	3,200	25,504.00	0.00
255	600874	创业环保	3,200	25,440.00	0.00
256	002325	洪涛股份	3,100	25,420.00	0.00
257	600566	洪城股份	1,100	25,410.00	0.00
258	002011	盾安环境	3,200	25,376.00	0.00
259	600636	三爱富	2,000	25,260.00	0.00
260	000979	中弘股份	8,500	25,245.00	0.00
261	601002	晋亿实业	3,000	25,200.00	0.00
262	002663	普邦园林	2,100	25,116.00	0.00
263	600300	维维股份	6,200	25,048.00	0.00
264	600551	时代出版	1,500	25,005.00	0.00
265	600528	中铁二局	5,400	25,002.00	0.00
266	002262	恩华药业	1,120	24,875.20	0.00
267	000518	四环生物	7,700	24,717.00	0.00
268	002179	中航光电	1,400	24,570.00	0.00
269	000636	风华高科	3,900	24,336.00	0.00
270	002648	卫星石化	1,700	24,327.00	0.00
271	000900	现代投资	5,270	24,294.70	0.00
272	600311	荣华实业	5,000	24,100.00	0.00
273	600628	新世界	3,100	24,056.00	0.00
274	002013	中航机电	1,620	23,992.20	0.00
275	600004	白云机场	3,400	23,936.00	0.00
276	000860	顺鑫农业	1,700	23,868.00	0.00
277	600748	上实发展	3,200	23,776.00	0.00
278	002277	友阿股份	2,500	23,750.00	0.00
279	600456	宝钛股份	1,600	23,744.00	0.00
280	600438	通威股份	2,500	23,725.00	0.00
281	600826	兰生股份	1,600	23,712.00	0.00
282	002408	齐翔腾达	1,700	23,698.00	0.00
283	600729	重庆百货	1,209	23,623.86	0.00
284	600993	马应龙	1,500	23,565.00	0.00

285	600740	山西焦化	4,500	23,490.00	0.00
286	000685	中山公用	2,300	23,391.00	0.00
287	000921	海信科龙	2,673	23,255.10	0.00
288	002384	东山精密	2,300	23,253.00	0.00
289	600831	广电网络	3,000	23,190.00	0.00
290	600380	健康元	4,600	23,184.00	0.00
291	000563	陕国投 A	3,600	23,148.00	0.00
292	001696	宗申动力	5,100	23,103.00	0.00
293	600823	世茂股份	2,700	23,058.00	0.00
294	002123	荣信股份	3,000	23,010.00	0.00
295	600612	老凤祥	900	22,779.00	0.00
296	002242	九阳股份	2,300	22,724.00	0.00
297	600322	天房发展	6,600	22,572.00	0.00
298	600970	中材国际	3,300	22,506.00	0.00
299	002698	博实股份	900	22,428.00	0.00
300	002358	森源电气	900	22,374.00	0.00
301	000090	天健集团	2,900	22,359.00	0.00
302	002285	世联行	2,780	22,267.80	0.00
303	002345	潮宏基	1,300	22,256.00	0.00
304	000501	鄂武商 A	1,902	22,253.40	0.00
305	000099	中信海直	2,500	22,150.00	0.00
306	002083	孚日股份	5,400	22,086.00	0.00
307	002276	万马股份	3,500	22,085.00	0.00
308	002371	七星电子	1,100	22,066.00	0.00
309	002254	泰和新材	2,600	21,970.00	0.00
310	002025	航天电器	1,400	21,966.00	0.00
311	002140	东华科技	1,300	21,879.00	0.00
312	601886	江河创建	3,500	21,875.00	0.00
313	002672	东江环保	800	21,864.00	0.00
314	000031	中粮地产	6,700	21,842.00	0.00
315	002237	恒邦股份	1,700	21,709.00	0.00
316	000850	华茂股份	4,200	21,672.00	0.00
317	002216	三全食品	1,200	21,660.00	0.00
318	600586	金晶科技	7,400	21,608.00	0.00
319	600487	亨通光电	1,500	21,570.00	0.00
320	600754	锦江股份	1,300	21,333.00	0.00
321	000627	天茂集团	8,100	21,222.00	0.00
322	603766	隆鑫通用	2,400	21,216.00	0.00
323	000417	合肥百货	4,100	21,197.00	0.00

324	002461	珠江啤酒	1,500	21,180.00	0.00
325	000930	中粮生化	5,700	21,147.00	0.00
326	000680	山推股份	7,400	21,090.00	0.00
327	000931	中关村	4,000	21,040.00	0.00
328	000426	兴业矿业	2,200	21,032.00	0.00
329	000525	红太阳	1,500	21,015.00	0.00
330	600021	上海电力	4,800	20,976.00	0.00
331	600702	沱牌舍得	2,000	20,940.00	0.00
332	000650	仁和药业	4,400	20,900.00	0.00
333	600983	合肥三洋	1,600	20,768.00	0.00
334	600844	丹化科技	3,500	20,755.00	0.00
335	002308	威创股份	3,100	20,708.00	0.00
336	002122	天马股份	4,400	20,680.00	0.00
337	000066	长城电脑	4,900	20,678.00	0.00
338	002281	光迅科技	600	20,634.00	0.00
339	002393	力生制药	700	20,433.00	0.00
340	600335	国机汽车	1,300	20,423.00	0.00
341	600298	安琪酵母	1,400	20,412.00	0.00
342	600750	江中药业	1,300	20,371.00	0.00
343	600199	金种子酒	2,900	20,329.00	0.00
344	600176	中国玻纤	2,612	20,269.12	0.00
345	601101	昊华能源	3,600	20,268.00	0.00
346	600496	精工钢构	3,100	20,243.00	0.00
347	002221	东华能源	1,800	20,142.00	0.00
348	002646	青青稞酒	1,300	20,137.00	0.00
349	600997	开滦股份	4,600	20,056.00	0.00
350	600180	瑞茂通	1,900	20,045.00	0.00
351	002091	江苏国泰	1,300	19,903.00	0.00
352	600392	盛和资源	1,100	19,778.00	0.00
353	000777	中核科技	1,720	19,762.80	0.00
354	600971	恒源煤电	3,700	19,758.00	0.00
355	002275	桂林三金	1,300	19,734.00	0.00
356	601880	大连港	7,500	19,725.00	0.00
357	000732	泰禾集团	2,300	19,642.00	0.00
358	002225	濮耐股份	3,700	19,573.00	0.00
359	002128	露天煤业	3,000	19,500.00	0.00
360	002342	巨力索具	3,600	19,368.00	0.00
361	600639	浦东金桥	1,900	19,342.00	0.00
362	600425	青松建化	4,100	19,311.00	0.00

363	002204	大连重工	1,500	19,140.00	0.00
364	601608	中信重工	6,100	19,093.00	0.00
365	600439	瑞贝卡	4,900	19,012.00	0.00
366	601515	东风股份	1,600	19,008.00	0.00
367	600026	中海发展	4,700	18,988.00	0.00
368	600039	四川路桥	3,400	18,972.00	0.00
369	000693	华泽钴镍	800	18,944.00	0.00
370	600858	银座股份	2,700	18,927.00	0.00
371	600088	中视传媒	1,300	18,876.00	0.00
372	600429	三元股份	2,600	18,798.00	0.00
373	601801	皖新传媒	1,400	18,718.00	0.00
374	002203	海亮股份	1,700	18,717.00	0.00
375	002332	仙琚制药	2,350	18,706.00	0.00
376	601678	滨化股份	2,500	18,700.00	0.00
377	600537	亿晶光电	1,800	18,576.00	0.00
378	601965	中国汽研	1,500	18,555.00	0.00
379	000799	酒鬼酒	1,700	18,547.00	0.00
380	600239	云南城投	4,300	18,533.00	0.00
381	600830	香溢融通	2,400	18,480.00	0.00
382	600428	中远航运	6,300	18,459.00	0.00
383	600479	千金药业	1,600	18,448.00	0.00
384	600736	苏州高新	4,700	18,283.00	0.00
385	000962	东方钨业	1,900	18,126.00	0.00
386	002612	朗姿股份	900	18,072.00	0.00
387	000030	富奥股份	2,800	18,060.00	0.00
388	600467	好当家	3,300	17,985.00	0.00
389	002480	新筑股份	2,500	17,975.00	0.00
390	002482	广田股份	1,500	17,955.00	0.00
391	600616	金枫酒业	2,300	17,940.00	0.00
392	600006	东风汽车	6,000	17,880.00	0.00
393	002574	明牌珠宝	700	17,843.00	0.00
394	002447	壹桥苗业	1,450	17,820.50	0.00
395	002093	国脉科技	2,600	17,186.00	0.00
396	000596	古井贡酒	900	17,163.00	0.00
397	601616	广电电气	4,800	17,136.00	0.00
398	000703	恒逸石化	2,600	17,134.00	0.00
399	002315	焦点科技	400	17,064.00	0.00
400	601126	四方股份	1,200	17,040.00	0.00
401	002244	滨江集团	3,000	17,010.00	0.00

402	600773	西藏城投	1,700	16,813.00	0.00
403	002588	史丹利	820	16,810.00	0.00
404	002479	富春环保	2,182	16,801.40	0.00
405	002251	步步高	1,300	16,744.00	0.00
406	600078	澄星股份	3,000	16,740.00	0.00
407	002601	佰利联	900	16,650.00	0.00
408	600337	美克股份	2,900	16,646.00	0.00
409	002557	洽洽食品	1,000	16,580.00	0.00
410	002194	武汉凡谷	1,300	16,575.00	0.00
411	600508	上海能源	2,103	16,571.64	0.00
412	002392	北京利尔	1,800	16,542.00	0.00
413	002572	索菲亚	1,000	16,440.00	0.00
414	002078	太阳纸业	5,200	16,380.00	0.00
415	600803	威远生化	1,400	16,352.00	0.00
416	002463	沪电股份	5,060	16,343.80	0.00
417	000418	小天鹅 A	1,600	16,336.00	0.00
418	600963	岳阳林纸	5,400	16,254.00	0.00
419	000506	中润资源	4,200	16,212.00	0.00
419	603366	日出东方	1,200	16,212.00	0.00
420	002293	罗莱家纺	800	16,080.00	0.00
421	600614	鼎立股份	1,600	16,064.00	0.00
422	002233	塔牌集团	2,600	15,756.00	0.00
423	600815	厦工股份	4,300	15,695.00	0.00
424	002154	报喜鸟	2,700	15,633.00	0.00
425	002489	浙江永强	1,500	15,630.00	0.00
426	600195	中牧股份	1,200	15,612.00	0.00
427	600488	天药股份	3,600	15,588.00	0.00
428	600449	宁夏建材	2,100	15,372.00	0.00
429	000655	金岭矿业	2,236	15,361.32	0.00
430	600723	首商股份	2,500	15,350.00	0.00
431	600888	新疆众和	2,800	15,288.00	0.00
432	600737	中粮屯河	3,100	14,818.00	0.00
433	600780	通宝能源	3,400	14,654.00	0.00
434	000951	中国重汽	1,236	14,547.72	0.00
435	600197	伊力特	1,600	14,464.00	0.00
436	002490	山东墨龙	1,700	14,450.00	0.00
437	600801	华新水泥	2,160	14,407.20	0.00
438	601011	宝泰隆	1,100	14,311.00	0.00
439	603077	和邦股份	1,100	14,300.00	0.00

440	600657	信达地产	4,500	14,265.00	0.00
441	601908	京运通	2,000	14,260.00	0.00
442	002327	富安娜	1,269	14,123.97	0.00
443	002678	珠江钢琴	1,500	14,025.00	0.00
444	600468	百利电气	1,400	13,944.00	0.00
445	600683	京投银泰	2,800	13,916.00	0.00
446	600491	龙元建设	4,200	13,818.00	0.00
447	000552	靖远煤电	1,700	13,804.00	0.00
448	601339	百隆东方	1,700	13,753.00	0.00
449	601566	九牧王	1,300	13,702.00	0.00
450	002267	陕天然气	1,500	13,650.00	0.00
451	601636	旗滨集团	1,900	13,604.00	0.00
452	002075	沙钢股份	3,500	13,475.00	0.00
453	000620	新华联	2,400	13,464.00	0.00
454	600333	长春燃气	1,900	13,129.00	0.00
455	600162	香江控股	2,800	12,992.00	0.00
456	000688	建新矿业	2,490	12,972.90	0.00
457	601100	恒立油缸	1,400	12,964.00	0.00
458	601388	怡球资源	1,200	12,948.00	0.00
459	002430	杭氧股份	1,900	12,939.00	0.00
460	601233	桐昆股份	2,100	12,873.00	0.00
461	000927	一汽夏利	3,600	12,852.00	0.00
462	000409	山东地矿	1,400	12,740.00	0.00
463	002226	江南化工	1,200	12,732.00	0.00
464	603555	贵人鸟	1,000	12,730.00	0.00
465	601999	出版传媒	1,600	12,688.00	0.00
466	600618	氯碱化工	1,700	12,631.00	0.00
467	600724	宁波富达	3,200	12,608.00	0.00
468	600510	黑牡丹	2,400	12,480.00	0.00
469	002305	南国置业	2,061	12,469.05	0.00
470	000861	海印股份	1,300	12,467.00	0.00
471	600094	大名城	2,000	12,440.00	0.00
472	603001	奥康国际	900	12,375.00	0.00
473	002032	苏泊尔	900	12,321.00	0.00
474	601208	东材科技	1,800	12,150.00	0.00
475	600280	中央商场	1,200	12,108.00	0.00
476	600268	国电南自	2,400	11,904.00	0.00
477	000719	大地传媒	1,000	11,850.00	0.00
478	000987	广州友谊	1,300	11,843.00	0.00

479	000780	平庄能源	3,000	11,820.00	0.00
480	002498	汉缆股份	1,600	11,488.00	0.00
481	600054	黄山旅游	900	11,475.00	0.00
482	002320	海峡股份	1,300	11,466.00	0.00
483	600869	远东电缆	1,400	11,410.00	0.00
484	002419	天虹商场	1,200	11,400.00	0.00
485	002238	天威视讯	900	11,277.00	0.00
486	601010	文峰股份	1,600	11,168.00	0.00
487	600743	华远地产	4,000	11,120.00	0.00
488	002378	章源钨业	600	10,548.00	0.00
489	002662	京威股份	1,300	10,439.00	0.00
490	000631	顺发恒业	2,300	10,396.00	0.00
491	600397	安源煤业	3,000	10,170.00	0.00
492	000603	盛达矿业	800	9,448.00	0.00
493	002503	搜于特	1,100	9,020.00	0.00
494	002705	新宝股份	600	8,964.00	0.00
495	000935	四川双马	1,710	8,909.10	0.00
496	600184	光电股份	400	8,440.00	0.00
497	002534	杭锅股份	500	6,705.00	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	600499	科达洁能	9,199,670.51	0.21
2	600587	新华医疗	8,873,445.30	0.20
3	600388	龙净环保	8,217,353.50	0.19
4	600594	益佰制药	7,874,534.27	0.18
5	600570	恒生电子	7,768,117.49	0.18
6	600557	康缘药业	7,371,166.76	0.17
7	600872	中炬高新	7,040,651.80	0.16
8	600880	博瑞传播	6,762,612.16	0.15
9	601929	吉视传媒	6,501,408.79	0.15
10	600643	爱建股份	6,423,056.18	0.15
11	600879	航天电子	6,117,719.54	0.14

12	600312	平高电气	6,078,931.96	0.14
13	600138	中青旅	6,068,527.74	0.14
14	600770	综艺股份	6,036,336.99	0.14
15	600881	亚泰集团	5,702,791.15	0.13
16	600517	置信电气	5,672,560.95	0.13
17	600418	江淮汽车	5,474,337.53	0.12
18	600835	上海机电	5,430,762.40	0.12
19	600675	中华企业	5,393,443.50	0.12
20	600805	悦达投资	5,385,397.10	0.12

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600587	新华医疗	11,115,400.22	0.25
2	600499	科达洁能	10,338,068.36	0.24
3	600388	龙净环保	10,224,620.18	0.23
4	601929	吉视传媒	9,845,136.94	0.22
5	600570	恒生电子	9,720,529.16	0.22
6	600594	益佰制药	9,697,035.43	0.22
7	600312	平高电气	8,529,375.80	0.19
8	600880	博瑞传播	8,193,720.64	0.19
9	600418	江淮汽车	7,939,950.37	0.18
10	600770	综艺股份	7,879,754.52	0.18
11	600879	航天电子	7,868,796.85	0.18
12	600557	康缘药业	7,818,122.43	0.18
13	600517	置信电气	7,736,270.30	0.18
14	600872	中炬高新	7,575,172.95	0.17
15	600138	中青旅	7,573,318.96	0.17
16	600643	爱建股份	7,303,460.98	0.17
17	600522	中天科技	7,265,193.50	0.17
18	600717	天津港	7,076,732.12	0.16
19	300371	汇中股份	7,065,102.88	0.16
20	600584	长电科技	7,049,101.15	0.16

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	1,009,110,230.17
卖出股票收入（成交）总额	1,206,644,276.37

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序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期内未投资贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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	4,225,887,100.87	94.50

7.11 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。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

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。

7.13.2

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。

7.13.3 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	922,964.11
2	应收证券清算款	15,092,457.10
3	应收股利	1,691.14
4	应收利息	39,228.87
5	应收申购款	1,165,501.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,221,842.36

7.13.4 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。

7.13.5 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	002252	上海莱士	291,180.00	0.01	临时停牌
2	601012	隆基股份	158,100.00	0.00	临时停牌
3	600490	鹏欣资源	153,788.70	0.00	临时停牌
4	600755	厦门国贸	146,470.00	0.00	临时停牌
5	002340	格林美	142,113.00	0.00	临时停牌
6	600685	广船国际	127,961.10	0.00	临时停牌
7	600582	天地科技	121,941.00	0.00	临时停牌
8	600757	长江传媒	102,660.00	0.00	临时停牌

9	600418	江淮汽车	94,860.00	0.00	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。

§ 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
281,852	16,500.39	561,417,870.54	12.07%	4,089,249,966.05	87.93%

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	朝恒房地产(深圳)有限公司	8,500,000.00	8.71%
2	项志英	1,500,000.00	1.54%
3	陈枫	1,489,210.00	1.53%
4	吴彤	1,107,200.00	1.13%
5	高琪	1,000,000.00	1.02%
6	吕大贤	872,556.00	0.89%
7	姜登斌	800,000.00	0.82%
8	姚红伟	770,000.00	0.79%
9	彭冬梅	700,000.00	0.72%
10	苏岩	664,500.00	0.68%

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	4,485,034.62	0.0962%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	50-100

本基金基金经理持有本开放式基金	0-10
-----------------	------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2009 年 9 月 25 日) 基金份额总额	3, 223, 217, 818. 45
本报告期期初基金份额总额	4, 657, 868, 889. 39
本报告期基金总申购份额	2, 672, 138, 605. 81
减: 本报告期基金总赎回份额	2, 679, 339, 658. 61
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期末基金份额总额	4, 650, 667, 836. 59

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、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

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	1,616,091,583.15	73.09%	1,471,291.65	73.60%	-
招商证券	1	514,695,924.53	23.28%	455,456.19	22.78%	-
英大证券	2	52,632,688.02	2.38%	47,917.36	2.40%	-
华泰证券	1	27,660,953.55	1.25%	24,477.26	1.22%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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	成交金额	占当期权证成交总额	成交金额	占当期基金成交总额

				成交总 额的比例		的比例		的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-	787,706,275.22	100.00%
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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联合基金网为代销机构及开通定投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	2014年6月25日
2	• 南方基金关于开通网上交易机构版业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年5月23日
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) 招募说明书 (更新) (2014 年第 1 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年5月5日
4	• 南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 招募说明书 (更新) 摘要 (2014 年第 1 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年5月5日
5	• 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	2014年4月30日
6	• 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	2014年4月28日
7	• 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	2014年4月1日
8	• 南方基金关于开通京东网上交易平台基金销售业务的通知	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年3月31日
9	• 南方基金管理有限公司关于开通“网银在线”基金直销支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014年3月31日
10	• 南方基金关于旗下部分基金增加好	中国证券报、上海	2014年3月13日

	买基金为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券报、证券时报	
11	• 南方基金关于旗下部分基金增加恒天明泽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	2014 年 2 月 24 日
12	• 南方基金关于电子直销平台相关业务调整费率优惠方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 2 月 24 日
13	• 南方基金关于旗下部分基金增加民族证券为代销机构并开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 1 月 27 日
14	• 南方基金关于旗下部分基金参加同花顺网上交易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	2014 年 1 月 15 日
15	• 南方基金关于旗下部分基金增加同花顺为代销机构及开通定投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	2014 年 1 月 10 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>