

# 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 年年度报告

2014 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：2015 年 3 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 2015 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 2014 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</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.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
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.....	11
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.....	12
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.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	15
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.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表.....	16
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
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>41</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	41
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
8.6 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.....	57

8.7 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 .....	57
8.8 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 .....	57
8.9 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 .....	57
8.10 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 .....	57
8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	57
8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
8.13 投资组合报告附注 .....	57
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>59</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	59
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	59
9.4 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 .....	59
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>60</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>60</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	60
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 .....	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
11.4 基金投资策略的改变 .....	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
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 .....	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	61
11.8 其他重大事件 .....	62
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>64</b>
12.1 备查文件目录 .....	64
12.2 存放地点 .....	64
12.3 查阅方式 .....	64

## § 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	3,178,886,245.80 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	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量化的风险管理手段，以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在中证 500 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导

	致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.2.1 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	林葛
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-68121816
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	北京复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层

邮政编码	518048	100031
法定代表人	吴万善	刘士余

## 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(特殊普通合伙)	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	2014 年	2013 年	2012 年
本期已实现收益	529,203,679.72	-352,187,101.50	-539,300,925.90
本期利润	1,429,875,469.90	699,917,156.39	-38,751,033.20
加权平均基金份额本期利润	0.3225	0.1302	-0.0067
本期加权平均净值利润率	31.28%	14.59%	-0.80%
本期基金份额净值增长率	36.29%	16.05%	-0.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配利润	273,188,993.37	-266,015,090.42	-1,163,346,449.63
期末可供分配基金份额利润	0.0859	-0.0571	-0.1875
期末基金资产净值	3,981,924,887.50	4,391,853,798.97	5,042,232,609.53
期末基金份额净值	1.2526	0.9429	0.8125
3.1.3 累计期末指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
基金份额累计净值增长率	36.67%	0.28%	-13.59%

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。

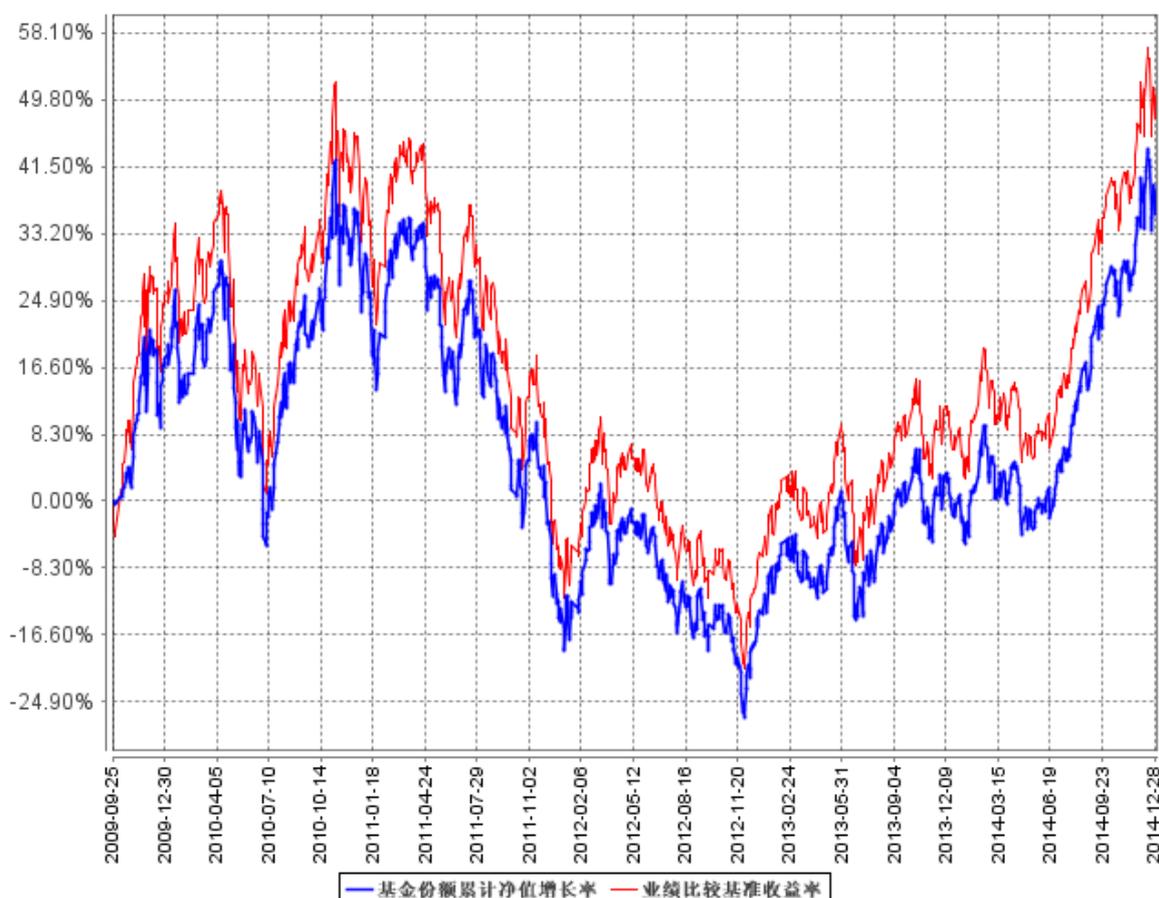
## 3.2 基金净值表现

### 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	7.66%	1.39%	7.88%	1.37%	-0.22%	0.02%
过去六个月	33.64%	1.16%	33.64%	1.16%	0.00%	0.00%
过去一年	36.29%	1.18%	36.88%	1.18%	-0.59%	0.00%
过去三年	57.89%	1.34%	59.65%	1.34%	-1.76%	0.00%
过去五年	16.21%	1.45%	18.57%	1.45%	-2.36%	0.00%
自基金合同生效起至今	36.67%	1.46%	48.69%	1.47%	-12.02%	-0.01%

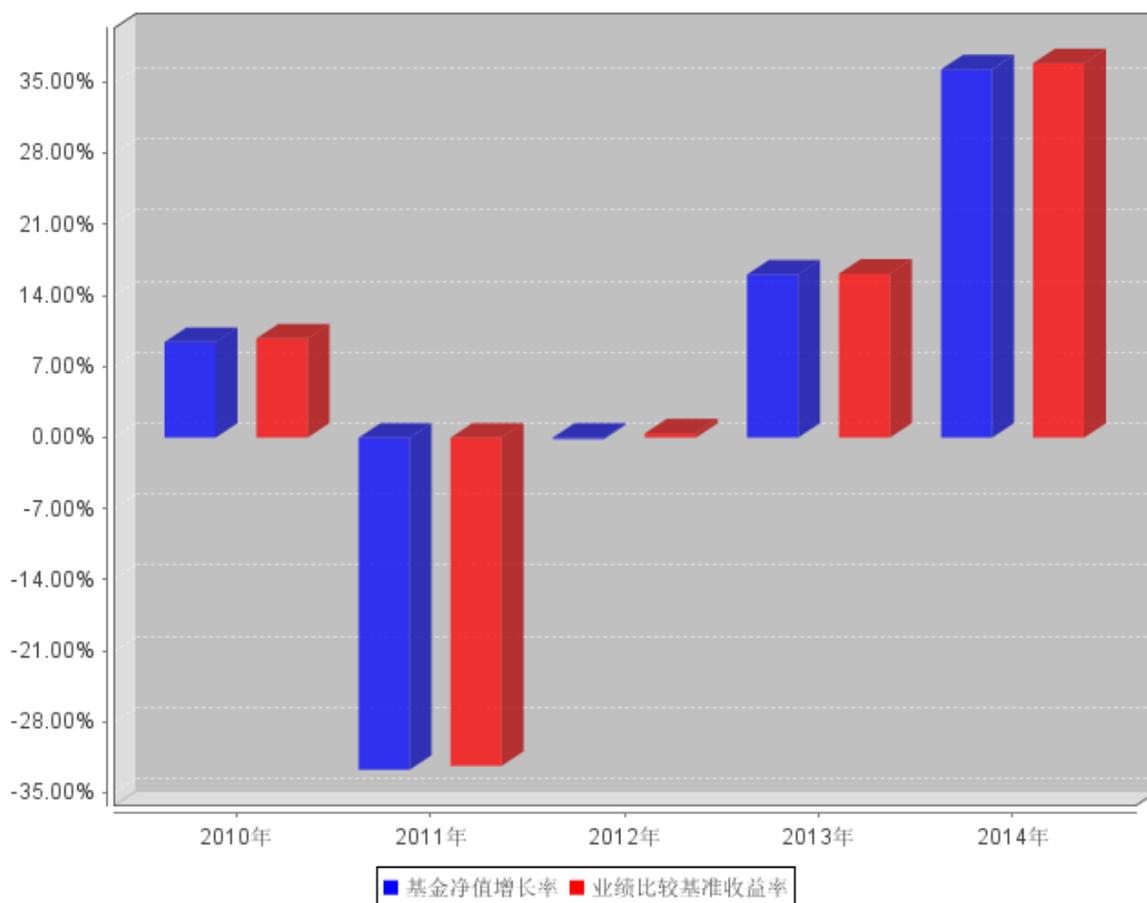
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 过去五年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

过去五年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



### 3.3 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
2014	0.3000	69,272,231.01	40,602,277.80	109,874,508.81	
2013	-	-	-	-	
2012	-	-	-	-	
合计	0.3000	69,272,231.01	40,602,277.80	109,874,508.81	

## § 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 3 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 3,000 亿元，旗下管理 57 只开放式基金，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	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日	-	9 年	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；2014 年 10 月至今，任 500 医药基金经理。
--	--	--	--	--	----------------------------------------------------

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》等有关法律法规、中国证监会和《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

本基金管理人根据《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，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，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，两两组合同单日、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，未发现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 7 次，其中 6 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，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。

## 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，央行降息降低经济融资成本，刺激经济回升，降息时间超出市场预期，对股市形成利好，期间中证 500 指数涨 39.01%。

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。
- ④ 6 月中和 12 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 0.389%，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 1.2526 元，报告期内，份额净值增长率为 36.29%，同期业绩基准增长率为 36.88%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着稳增长、“微刺激”政策的持续出台，经济增长质量将得到明显改善，短期经济数据反复并不改变市场反弹走势。随着沪港通的开通，海外资金加大对 A 股的配置力度，加上楼市、金市、实业的资金加速入场，A 股走势更加强劲。融资融券业务推出之后，A 股投资者有了短期加杠杆的工具，目前融资余额已经突破 8000 亿元，对行情起到了推波助澜的作用。展望 2015 年，经济改革预期将深化，各路资金入场节奏不变，预计 A 股仍有较大上涨空间。

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，本基金管理人严格遵守相关法律法规，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。

本报告期内，本基金管理人开展了基金管理公司内控自查、基金从业人员证券投资行为自查等多项内控自查工作，制定或修订了关联交易管理、员工证券投资管理 etc 内部制度，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；针对新出台的法律法规和监管要求，积极组织多项法律法规、职业道德培训以及合规考试，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况；完成各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

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，顺应“放松管制、加强监管”的监管形势，积极健全内部管理制度，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，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 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，组成人员包括副总经理、权益投资总监、数量化投资部总监、风险管理部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。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。

#### 4.8 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。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本基金于 2014 年 10 月 22 日进行了收益分配（每 10 份基金份额合计派 0.30 元）。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

注：无。

## § 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》等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 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 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)年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

# § 6 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(2015)第 20382 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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)
引言段	我们审计了后附的南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)(以下简称“南方中证 500ETF 联接基金”)的财务报表,包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 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	编制和公允列报财务报表是南方中证 500ETF 联接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:

	<p>(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;</p> <p>(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。</p>
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 500ETF 联接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 500ETF 联接基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	汪 棣   陈 熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国·上海市
审计报告日期	2015 年 3 月 24 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产:			

银行存款	7.4.7.1	216,003,083.01	222,842,478.79
结算备付金		-	341,911.29
存出保证金		436,003.20	505,684.42
交易性金融资产	7.4.7.2	3,783,668,765.15	4,157,992,925.20
其中：股票投资		25,800,381.58	595,391.00
基金投资		3,757,868,383.57	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		812,188.32	15,038,010.37
应收利息	7.4.7.5	33,960.90	43,268.91
应收股利		1,691.14	1,691.14
应收申购款		38,468,673.35	2,949,389.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	4,656,593.17	536,766.67
<b>资产总计</b>		<b>4,044,080,958.24</b>	<b>4,400,252,125.95</b>

负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>负债：</b>			
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		11,124,804.26	40,344.60
应付赎回款		49,403,219.59	7,139,490.43
应付管理人报酬		118,664.57	94,868.37
应付托管费		23,732.93	18,973.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	919,878.53	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	7.4.7.8	565,770.86	232,991.81
<b>负债合计</b>		<b>62,156,070.74</b>	<b>8,398,326.98</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	3,178,886,245.80	4,657,868,889.39
未分配利润	7.4.7.10	803,038,641.70	-266,015,090.42
<b>所有者权益合计</b>		<b>3,981,924,887.50</b>	<b>4,391,853,798.97</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>4,044,080,958.24</b>	<b>4,400,252,125.95</b>

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2526 元，基金份额总额 3,178,886,245.80 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>1,437,552,748.30</b>	<b>716,489,215.82</b>
1. 利息收入		1,696,409.10	1,857,071.22
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,696,400.58	1,856,198.15
债券利息收入		8.52	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)		530,741,876.32	-357,552,678.75
其中: 股票投资收益	7.4.7.12	33,760,092.17	-360,789,407.82
基金投资收益	7.4.7.13	496,603,398.16	1,077,432.88
债券投资收益	7.4.7.14	3,357.48	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	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	375,028.51	1,880,240
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	900,671,790.18	1,052,104,257.89
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	4,442,672.70	20,080,565.46
<b>减: 二、费用</b>		<b>7,677,278.40</b>	<b>16,572,059.43</b>
1. 管理人报酬		1,504,552.44	7,702,452.69
2. 托管费		300,910.57	1,540,490.58
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	5,376,959.18	6,323,048.71
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	494,856.21	1,006,067.45
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>1,429,875,469.90</b>	<b>699,917,156.39</b>
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>1,429,875,469.90</b>	<b>699,917,156.39</b>

### 7.3 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 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 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)	4,657,868,889.39	-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)	-	1,429,875,469.90	1,429,875,469.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,478,982,643.59	-250,947,228.97	-1,729,929,872.56
其中: 1. 基金申购款	3,791,220,069.61	45,492,966.62	3,836,713,036.23

2. 基金赎回款	-5, 270, 202, 713. 20	-296, 440, 195. 59	-5, 566, 642, 908. 79
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)	-	-109, 874, 508. 81	-109, 874, 508. 81
五、期末所有者权益(基金净值)	3, 178, 886, 245. 80	803, 038, 641. 70	3, 981, 924, 887. 50
项目	上年度可比期间		
	2013 年 1 月 1 日至 2013 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)	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)	-	699, 917, 156. 39	699, 917, 156. 39
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, 547, 710, 169. 77	197, 414, 202. 82	-1, 350, 295, 966. 95
其中：1. 基金申购款	2, 094, 492, 959. 88	-170, 027, 236. 07	1, 924, 465, 723. 81
2. 基金赎回款	-3, 642, 203, 129. 65	367, 441, 438. 89	-3, 274, 761, 690. 76
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, 657, 868, 889. 39	-266, 015, 090. 42	4, 391, 853, 798. 97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

<u>杨小松</u>	<u>徐超</u>	<u>徐超</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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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《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,将南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)更名为南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF),并对《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)的基金合同》进行了修订,修订后的《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》于 2013 年 2 月 22 日经中国证监会备案后生效。

本基金为中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对中证 500 指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪,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%。

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,于 2013 年 2 月 22 日前,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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定,自 2013 年 2 月 22 日起,本基金的投资范围为目标 ETF、中证 500 指数成份股和备选成份股,本基金可少量投资于新股(一级市场初次发行或增发)、债券、及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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 2015 年 3 月 24 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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 2014 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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 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基金投资、股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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

本基金持有的基金投资、股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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 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。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。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,其处置价格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

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

### 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

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

#### 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[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，应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。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。

#### 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 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
活期存款	216,003,083.01	222,842,478.79
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	216,003,083.01	222,842,478.79

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	25,477,214.95	25,800,381.58	323,166.63
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	2,644,298,286.61	3,757,868,383.57	1,113,570,096.96
其他	-	-	-
<b>合计</b>	<b>2,669,775,501.56</b>	<b>3,783,668,765.15</b>	<b>1,113,893,263.59</b>

项目	上年度末 2013 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	597,081.21	595,391.00	-1,690.21
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	3,944,174,370.58	4,157,397,534.20	213,223,163.62
其他	-	-	-
<b>合计</b>	<b>3,944,771,451.79</b>	<b>4,157,992,925.20</b>	<b>213,221,473.41</b>

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按估值日目标 ETF 的份额净值确定公允价值。本基金可采用股票组合申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 份额的买卖。

## 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

无。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	33,764.70	42,887.51
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	-	153.90
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	196.20	227.50
<b>合计</b>	<b>33,960.90</b>	<b>43,268.91</b>

## 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应收目标 ETF 可退替代款	1,101,041.41	527,476.00
应收目标 ETF 应退替代款	3,555,551.76	9,290.67
<b>合计</b>	<b>4,656,593.17</b>	<b>536,766.67</b>

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	919,878.53	871,658.10
银行间市场应付交易费用	-	-
<b>合计</b>	<b>919,878.53</b>	<b>871,658.10</b>

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
预提费用	407,000.00	192,000.00
应付赎回费	158,770.86	40,991.81
<b>合计</b>	<b>565,770.86</b>	<b>232,991.81</b>

## 7.4.7.9 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12月31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	3,791,220,069.61	3,791,220,069.61
本期赎回(以“-”号填列)	-5,270,202,713.20	-5,270,202,713.20
本期末	3,178,886,245.80	3,178,886,245.80

注：截至 2014 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 50,190,298.00 份(2013 年 12 月 31 日：107,828,011.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 3,128,695,947.80 份(2013 年 12 月 31 日：4,550,040,878.39 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	-77,380,302.41	-188,634,788.01	-266,015,090.42
本期利润	529,203,679.72	900,671,790.18	1,429,875,469.90
本期基金份额交易产生的变动数	-68,759,875.13	-182,187,353.84	-250,947,228.97
其中：基金申购款	7,807,254.87	37,685,711.75	45,492,966.62
基金赎回款	-76,567,130.00	-219,873,065.59	-296,440,195.59
本期已分配利润	-109,874,508.81	-	-109,874,508.81
本期末	273,188,993.37	529,849,648.33	803,038,641.70

## 7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
	活期存款利息收入	1,637,834.17
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	31,440.29	39,636.90
其他	27,126.12	19,776.59
合计	1,696,400.58	1,856,198.15

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
股票投资收益—买卖股票差价收入	26,443,888.02	-346,467,108.33
股票投资收益—申购差价收入	7,316,204.15	-14,322,299.49
合计	33,760,092.17	-360,789,407.82

## 7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
卖出股票成交总额	1,930,349,714.10	6,261,590,811.06
减：卖出股票成本总额	1,903,905,826.08	6,608,057,919.39
买卖股票差价收入	26,443,888.02	-346,467,108.33

## 7.4.7.12.3 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12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
申购基金份额总额	1,062,290,000.00	210,317,400.00
减：现金支付申购款总额	523,285,551.93	111,423,120.14
减：申购股票成本总额	531,688,243.92	113,216,579.35
申购差价收入	7,316,204.15	-14,322,299.49

## 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	3,399,682,009.24	678,434,627.74
减：卖出/赎回基金成本总额	2,903,078,611.08	677,357,194.86
基金投资收益	496,603,398.16	1,077,432.88

## 7.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
卖出债券成交金额	21,366.00	1,524,906.60
减：卖出债券成本总额	18,000.00	1,244,800.00
减：应收利息总额	8.52	1,050.41
买卖债券差价收入	3,357.48	279,056.19

## 7.4.7.15 衍生工具收益

无。

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
股票投资产生的股利收益	375,028.51	1,880,240.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	375,028.51	1,880,240.00

## 7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
1. 交易性金融资产	900,671,790.18	1,052,104,257.89
——股票投资	324,856.84	838,881,094.27
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	900,346,933.34	213,223,163.62
——贵金属投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	900,671,790.18	1,052,104,257.89

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
基金赎回费收入	4,442,672.70	2,912,514.65
替代损益	-	16,897,129.17
其他	-	270,921.64
<b>合计</b>	<b>4,442,672.70</b>	<b>20,080,565.46</b>

注：

1. 替代损益收入是指本基金采用可以现金替代方式申购目标 ETF 份额时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

2. 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，不低于赎回费总额的 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 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
交易所市场交易费用	5,376,959.18	6,323,048.71
银行间市场交易费用	-	-
<b>合计</b>	<b>5,376,959.18</b>	<b>6,323,048.71</b>

## 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
信息披露费	300,000.00	300,000.00
审计费用	107,000.00	92,000.00
上市费	60,000.00	60,000.00
银行汇划费	27,656.21	24,294.95
账户维护费	200.00	50.00
指数使用费	-	423,542.91
其他	-	106,179.59
<b>合计</b>	<b>494,856.21</b>	<b>1,006,067.45</b>

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

无。

#### 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、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
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
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司
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。

#### 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 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	275,333,057.41	8.52%	1,853,047,564.73	26.40%

###### 7.4.10.1.2 基金交易

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 2014年1月1日至2014年12月31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	243,643.39	8.35%	219,166.13	23.83%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	156,578.31	5.01%	-	-

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。
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 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,504,552.44	7,702,452.69
其中：支付销售机构的客户维护费	5,723,981.32	6,239,968.70

注：

1. 自 2013 年 2 月 22 日起，本基金基金财产中投资于目标 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。

2. 2013 年 2 月 22 日前，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 X 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	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	300,910.57	1,540,490.58

注：

1. 自 2013 年 2 月 22 日起，本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，支付基金托管人中国农业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：

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

2. 2013 年 2 月 22 日前，支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.12% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

## 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

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		上年度可比期间	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 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	216,003,083.01	1,637,834.17	222,842,478.79	1,796,784.66

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

无。

## 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有 2,519,016,211 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 79.56%(于 2013 年 12 月 31 日，本基金持有 3,879,254,954.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 93.03%)。

## 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		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	本期利润分配 合计	备 注
		场内	场外					
1	2014/10/22	2014/10/23	2014/10/22	0.3000	69,272,231.01	40,602,277.80	109,874,508.81	-

## 7.4.12 期末(2014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

无。

## 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
601519	大智慧	2014/07/21	重大资产重组	5.98	2015/01/23	6.58	267,330	1,598,546.89	1,598,633.40	
600240	华业地产	2014/10/16	重大资产重组	9.99	2015/01/22	7.91	121,779	1,025,397.55	1,216,572.21	
600584	长电科技	2014/11/03	重大资产重组	11.13	2015/01/14	12.24	92,900	1,033,469.05	1,033,977.00	
600704	物产中大	2014/10/13	重大资产重组	10.38	2015/02/13	11.42	85,576	883,526.07	888,278.88	
600580	卧龙电气	2014/12/08	重大事项	10.48	2015/01/14	11.12	61,200	631,343.00	641,376.00	
600458	时代新材	2014/10/27	重大事项	12.18	2015/01/05	13.40	51,060	619,709.94	621,910.80	
600575	皖江物流	2014/09/09	重大资产重组	4.11	未知	未知	132,100	541,862.54	542,931.00	
600754	锦江股份	2014/11/10	重大资产重组	25.11	2015/01/19	27.00	20,400	500,731.53	512,244.00	
000977	浪潮信息	2014/12/22	重大事项	41.18	2015/01/19	45.30	12,400	478,602.12	510,632.00	
000897	津滨发展	2014/12/26	重大事项	7.55	2015/01/21	7.50	66,434	530,011.54	501,576.70	
600487	亨通光电	2014/10/30	重大事项	18.95	2015/01/19	20.60	20,400	383,661.76	386,580.00	
300144	宋城演艺	2014/12/18	重大资产重组	30.12	2015/03/18	33.13	12,000	347,590.00	361,440.00	
000612	焦作万方	2014/12/29	重大事项	10.10	2015/01/16	10.20	31,100	291,192.00	314,110.00	
600759	洲际油气	2014/12/24	重大资产重组	9.90	未知	未知	30,300	314,043.93	299,970.00	
600490	鹏欣资源	2014/12/24	重大事项	10.79	2015/01/12	11.87	23,584	306,087.22	254,471.36	
000501	鄂武商 A	2014/12/24	重大事项	15.82	2015/01/16	17.20	13,002	199,304.13	205,691.64	
002123	荣信股份	2014/12/22	重大资产重组	9.22	未知	未知	20,800	189,843.06	191,776.00	
002308	威创股份	2014/12/29	重大事项	8.25	2015/02/04	9.08	21,400	182,147.65	176,550.00	
600761	安徽合力	2014/12/26	重大事项	15.65	2015/01/06	16.60	11,200	153,220.72	175,280.00	
000982	中银绒业	2014/08/25	重大事项	4.64	未知	未知	34,738	150,317.69	161,184.32	
600844	丹化科技	2014/12/15	重大事项	7.60	2015/01/07	8.25	21,100	157,487.17	160,360.00	
002018	华信国际	2014/11/19	重大资产重组	13.99	2015/03/06	15.39	10,200	117,885.00	142,698.00	
000616	亿城投资	2014/12/01	重大事项	4.77	未知	未知	28,958	118,756.51	138,129.66	
000719	大地传媒	2014/12/26	重大事项	16.55	未知	未知	8,110	135,940.61	134,220.50	
600428	中远航运	2014/12/22	重大事项	8.00	2015/01/08	8.30	16,600	98,927.57	132,800.00	
002437	誉衡药业	2014/11/21	重大事项	23.75	2015/01/26	26.13	5,145	129,983.46	122,193.75	
002168	深圳惠程	2014/11/28	重大资产重组	10.13	2015/01/28	9.51	10,200	94,988.00	103,326.00	

000426	兴业矿业	2014/12/11	重大资产重组	11.95	未知	未知	7,900	90,864.18	94,405.00	
002050	三花股份	2014/10/27	重大事项	13.57	2015/01/27	14.93	6,850	94,026.29	92,954.50	
002396	星网锐捷	2014/10/30	重大事项	27.31	2015/02/09	30.04	2,800	80,865.81	76,468.00	
300168	万达信息	2014/12/10	重大事项	46.20	2015/01/08	44.50	1,600	66,868.45	73,920.00	
002663	普邦园林	2014/12/08	重大事项	14.40	2015/03/17	15.84	5,100	69,357.00	73,440.00	
000506	中润资源	2014/11/04	重大资产重组	6.97	2015/02/16	6.27	10,200	66,654.00	71,094.00	
002482	广田股份	2014/12/10	重大事项	15.13	2015/01/06	16.64	1,260	19,394.87	19,063.80	
002152	广电运通	2014/12/17	重要事项未公告	22.15	2014/03/11	24.37	41	762.82	908.15	

注：本基金截至 2014 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

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

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为被动式指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和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，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资的金融工具主要包括基金投资和股票投资。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“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”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，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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。

##### 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。本基金的活期银行存款

存放在本基金的托管行中国农业银行，因而与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 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2013 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。本基金所持目标 ETF 份额能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出，所持股票均在证券交易所上市，因此除附注 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，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理价格适时变现。

于 2014 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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。

本基金持有及承担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、结算备付金及存出保证金等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	216,003,083.01	-	-	-	216,003,083.01
存出保证金	436,003.20	-	-	-	436,003.20
交易性金融资产	-	-	-	3,783,668,765.15	3,783,668,765.15
应收证券清算款	-	-	-	812,188.32	812,188.32
应收利息	-	-	-	33,960.90	33,960.90
应收股利	-	-	-	1,691.14	1,691.14
应收申购款	35,340,520.12	-	-	3,128,153.23	38,468,673.35
其他资产	-	-	-	4,656,593.17	4,656,593.17
<b>资产总计</b>	<b>251,779,606.33</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>3,792,301,351.91</b>	<b>4,044,080,958.24</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	11,124,804.26	11,124,804.26
应付赎回款	-	-	-	49,403,219.59	49,403,219.59
应付管理人报酬	-	-	-	118,664.57	118,664.57
应付托管费	-	-	-	23,732.93	23,732.93
应付交易费用	-	-	-	919,878.53	919,878.53
其他负债	-	-	-	565,770.86	565,770.86
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>62,156,070.74</b>	<b>62,156,070.74</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>251,779,606.33</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>3,730,145,281.17</b>	<b>3,981,924,887.50</b>

上年度末 2013 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
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	148,247.97	-	-	2,801,141.19	2,949,389.16
其他资产	-	-	-	536,766.67	536,766.67
<b>资产总计</b>	<b>223,838,322.47</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>4,176,413,803.48</b>	<b>4,400,252,125.95</b>

<b>负债</b>					
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
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>8,398,326.98</b>	<b>8,398,326.98</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>223,838,322.47</b>	-	-	<b>4,168,015,476.50</b>	<b>4,391,853,798.97</b>

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 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2013 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（2013 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。本基金主要投资于能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出的目标 ETF 份额以及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。

#### 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 2014 年 12 月 31 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	25,800,381.58	0.65	595,391.00	0.01
交易性金融资产—基金投资	3,757,868,383.57	94.37	4,157,397,534.20	94.66
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

合计	3,783,668,765.15	95.02	4,157,992,925.20	94.67
----	------------------	-------	------------------	-------

注：交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标 ETF 份额。

#### 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 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
	1. 中证 500 指数上升 5%	增加约 18,965	增加约 21,853
2. 中证 500 指数下降 5%	减少约 18,965	减少约 21,853	

#### 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2014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次的余额为3,771,637,598.48元，属于第二层次的余额为12,031,166.67元，无属于第三层次的余额(2013年12月31日：第一层次4,157,397,534.20元，第二层次595,391.00元，无第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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次；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次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日：同)。

##### (d) 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。

(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	25,800,381.58	0.64
	其中：股票	25,800,381.58	0.64
2	基金投资	3,757,868,383.57	92.92
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	216,003,083.01	5.34
8	其他各项资产	44,409,110.08	1.10
9	合计	4,044,080,958.24	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	238,622.70	0.01
B	采矿业	571,421.88	0.01
C	制造业	13,421,676.92	0.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	409,032.16	0.01
E	建筑业	464,256.65	0.01
F	批发和零售业	2,190,203.91	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	1,167,587.18	0.03
H	住宿和餐饮业	512,244.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,305,455.27	0.06

J	金融业	348,937.54	0.01
K	房地产业	3,055,011.61	0.08
L	租赁和商务服务业	203,650.90	0.01
M	科学研究和技术服务业	52,663.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	95,348.00	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	624,457.16	0.02
S	综合	139,812.70	0.00
	合计	25,800,381.58	0.65

### 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	601519	大智慧	267,330	1,598,633.40	0.04
2	600240	华业地产	121,779	1,216,572.21	0.03
3	600584	长电科技	92,900	1,033,977.00	0.03
4	600704	物产中大	85,576	888,278.88	0.02
5	300412	迦南科技	36,150	707,817.00	0.02
6	600580	卧龙电气	61,200	641,376.00	0.02
7	600458	时代新材	51,060	621,910.80	0.02
8	600575	皖江物流	132,100	542,931.00	0.01
9	600754	锦江股份	20,400	512,244.00	0.01
10	000977	浪潮信息	12,400	510,632.00	0.01
11	000897	津滨发展	66,434	501,576.70	0.01
12	600487	亨通光电	20,400	386,580.00	0.01
13	300144	宋城演艺	12,000	361,440.00	0.01
14	000612	焦作万方	31,100	314,110.00	0.01
15	600759	洲际油气	30,300	299,970.00	0.01
16	600490	鹏欣资源	23,584	254,471.36	0.01
17	000501	鄂武商A	13,002	205,691.64	0.01
18	002123	荣信股份	20,800	191,776.00	0.00
19	002308	威创股份	21,400	176,550.00	0.00
20	600761	安徽合力	11,200	175,280.00	0.00

21	601099	太平洋	11,800	167,796.00	0.00
22	600158	中体产业	9,200	162,932.00	0.00
23	000982	中银绒业	34,738	161,184.32	0.00
24	600844	丹化科技	21,100	160,360.00	0.00
25	002018	华星化工	10,200	142,698.00	0.00
26	000616	亿城投资	28,958	138,129.66	0.00
27	000719	大地传媒	8,110	134,220.50	0.00
28	600428	中远航运	16,600	132,800.00	0.00
29	002437	誉衡药业	5,145	122,193.75	0.00
30	600376	首开股份	11,400	114,912.00	0.00
31	300059	东方财富	4,100	114,636.00	0.00
32	002030	达安基因	5,300	106,371.00	0.00
33	002168	深圳惠程	10,200	103,326.00	0.00
34	000680	山推股份	13,600	102,680.00	0.00
35	002155	辰州矿业	9,500	96,805.00	0.00
36	000426	兴业矿业	7,900	94,405.00	0.00
37	002050	三花股份	6,850	92,954.50	0.00
38	601012	隆基股份	4,435	92,425.40	0.00
39	600422	昆明制药	3,701	91,858.82	0.00
40	600835	上海机电	4,373	82,037.48	0.00
41	002396	星网锐捷	2,800	76,468.00	0.00
42	000488	晨鸣纸业	12,200	75,274.00	0.00
43	300168	万达信息	1,600	73,920.00	0.00
44	002663	普邦园林	5,100	73,440.00	0.00
45	000506	中润资源	10,200	71,094.00	0.00
46	600266	北京城建	3,000	70,980.00	0.00
47	600169	太原重工	8,100	70,632.00	0.00
48	600694	大商股份	1,424	68,252.32	0.00
49	600881	亚泰集团	9,020	67,379.40	0.00
50	002595	豪迈科技	2,700	66,960.00	0.00
51	000998	隆平高科	3,300	64,977.00	0.00
52	600416	湘电股份	5,310	63,932.40	0.00
53	600755	厦门国贸	5,600	63,280.00	0.00
54	600410	华胜天成	3,103	63,208.11	0.00
55	600879	航天电子	4,000	62,400.00	0.00
56	000748	长城信息	1,600	62,240.00	0.00
57	600820	隧道股份	7,500	61,950.00	0.00
58	600811	东方集团	6,400	60,800.00	0.00
59	600320	振华重工	7,903	57,928.99	0.00

60	000712	锦龙股份	2,100	57,120.00	0.00
61	601872	招商轮船	9,000	56,610.00	0.00
62	000012	南玻 A	6,300	56,007.00	0.00
63	600635	大众公用	6,300	53,739.00	0.00
64	600187	国中水务	7,000	53,690.00	0.00
65	600528	中铁二局	3,500	52,675.00	0.00
66	600645	中源协和	1,300	52,663.00	0.00
67	600418	江淮汽车	4,300	51,944.00	0.00
68	600643	爱建股份	3,700	50,764.00	0.00
69	600499	科达洁能	2,700	49,842.00	0.00
70	600219	南山铝业	5,600	49,672.00	0.00
71	600895	张江高科	3,700	49,284.00	0.00
72	600601	方正科技	10,500	49,140.00	0.00
73	600312	平高电气	3,277	48,630.68	0.00
74	000528	柳工	3,800	47,804.00	0.00
75	300253	卫宁软件	683	47,789.51	0.00
76	000997	新大陆	1,695	47,697.30	0.00
77	600433	冠豪高新	4,000	47,200.00	0.00
78	600525	长园集团	4,099	47,097.51	0.00
79	600967	北方创业	3,188	47,054.88	0.00
80	601718	际华集团	7,400	46,990.00	0.00
81	600201	金宇集团	1,335	46,831.80	0.00
82	600468	百利电气	3,500	46,480.00	0.00
83	000511	烯碳新材	5,500	45,155.00	0.00
84	002405	四维图新	2,300	44,919.00	0.00
84	600037	歌华有线	3,100	44,919.00	0.00
85	600522	中天科技	2,900	44,631.00	0.00
86	601002	晋亿实业	2,298	44,604.18	0.00
87	600435	北方导航	1,810	44,290.70	0.00
88	600317	营口港	9,300	44,175.00	0.00
89	600816	安信信托	1,500	44,070.00	0.00
90	600737	中粮屯河	4,900	43,610.00	0.00
91	000661	长春高新	500	43,350.00	0.00
92	600587	新华医疗	1,377	43,141.41	0.00
93	600675	中华企业	6,280	43,080.80	0.00
94	002266	浙富控股	5,050	42,672.50	0.00
95	600787	中储股份	4,400	42,416.00	0.00
96	600765	中航重机	2,200	41,910.00	0.00
97	600511	国药股份	1,350	41,836.50	0.00

98	002183	怡亚通	2,800	41,608.00	0.00
99	600611	大众交通	3,468	41,511.96	0.00
100	000758	中色股份	2,800	41,132.00	0.00
101	002022	科华生物	1,915	40,598.00	0.00
102	000939	凯迪电力	3,600	40,500.00	0.00
103	000656	金科股份	2,600	40,300.00	0.00
104	600138	中青旅	2,445	40,244.70	0.00
105	002250	联化科技	2,700	39,960.00	0.00
106	600872	中炬高新	3,830	39,755.40	0.00
107	600536	中国软件	1,200	39,480.00	0.00
108	600125	铁龙物流	4,400	38,984.00	0.00
109	002293	罗莱家纺	1,500	38,640.00	0.00
110	000540	中天城投	3,280	38,638.40	0.00
111	300273	和佳股份	1,668	38,614.20	0.00
112	002358	森源电气	1,100	38,500.00	0.00
113	600517	置信电气	3,600	38,304.00	0.00
114	600325	华发股份	3,100	38,254.00	0.00
115	600685	广船国际	1,070	38,113.40	0.00
116	600654	飞乐股份	3,600	37,548.00	0.00
117	600557	康缘药业	1,624	37,481.92	0.00
118	000777	中核科技	1,320	37,408.80	0.00
119	600805	悦达投资	3,299	37,278.70	0.00
120	002005	德豪润达	4,700	37,271.00	0.00
121	000887	中鼎股份	2,700	37,260.00	0.00
122	002063	远光软件	1,851	37,112.55	0.00
123	002424	贵州百灵	901	36,986.05	0.00
124	002701	奥瑞金	1,800	36,846.00	0.00
125	000088	盐田港	3,725	36,803.00	0.00
126	000690	宝新能源	5,800	36,656.00	0.00
127	002092	中泰化学	4,700	36,425.00	0.00
128	000031	中粮地产	4,300	36,378.00	0.00
129	600175	美都能源	7,034	36,225.10	0.00
130	002573	国电清新	1,300	35,984.00	0.00
131	600200	江苏吴中	3,000	35,970.00	0.00
132	601000	唐山港	3,900	35,919.00	0.00
133	000652	泰达股份	4,912	35,857.60	0.00
134	000988	华工科技	3,000	35,820.00	0.00
135	600478	科力远	1,851	35,742.81	0.00
136	600426	华鲁恒升	3,200	35,008.00	0.00

137	002340	格林美	2,700	34,884.00	0.00
138	600110	中科英华	5,510	34,768.10	0.00
139	601001	大同煤业	4,000	34,680.00	0.00
140	000671	阳光城	2,500	34,675.00	0.00
141	600017	日照港	7,400	34,410.00	0.00
142	600978	宜华木业	5,700	34,314.00	0.00
143	000415	渤海租赁	2,500	34,175.00	0.00
144	600098	广州发展	3,900	34,164.00	0.00
145	300202	聚龙股份	1,100	33,979.00	0.00
146	002073	软控股份	2,800	33,908.00	0.00
147	600151	航天机电	3,600	33,804.00	0.00
148	601666	平煤股份	5,600	33,768.00	0.00
149	002271	东方雨虹	1,010	33,673.40	0.00
150	600216	浙江医药	3,100	33,666.00	0.00
151	000786	北新建材	1,325	33,496.00	0.00
152	600259	广晟有色	600	33,348.00	0.00
153	000685	中山公用	1,500	33,345.00	0.00
154	300134	大富科技	900	33,327.00	0.00
155	000933	神火股份	5,500	32,945.00	0.00
156	600720	祁连山	3,000	32,910.00	0.00
157	600183	生益科技	4,100	32,718.00	0.00
158	600521	华海药业	2,246	32,656.84	0.00
159	002223	鱼跃医疗	1,307	32,622.72	0.00
160	600432	吉恩镍业	2,284	32,501.32	0.00
161	600062	华润双鹤	1,600	32,416.00	0.00
162	600067	冠城大通	4,000	32,400.00	0.00
163	600747	大连控股	4,900	32,291.00	0.00
164	000422	湖北宜化	4,300	32,207.00	0.00
165	000975	银泰资源	2,100	32,109.00	0.00
166	000543	皖能电力	2,500	32,100.00	0.00
167	600770	综艺股份	3,700	32,042.00	0.00
168	002440	闰土股份	1,788	32,040.96	0.00
169	000735	罗牛山	4,200	32,004.00	0.00
170	002428	云南锗业	2,200	31,922.00	0.00
171	600056	中国医药	1,938	31,802.58	0.00
172	000006	深振业 A	4,500	31,725.00	0.00
173	000050	深天马 A	1,650	31,614.00	0.00
174	000959	首钢股份	7,600	31,540.00	0.00
175	600284	浦东建设	2,700	31,374.00	0.00

176	002240	威华股份	1,400	31,346.00	0.00
177	600064	南京高科	1,736	31,230.64	0.00
178	600122	宏图高科	4,341	31,124.97	0.00
179	000848	承德露露	1,415	31,115.85	0.00
180	600161	天坛生物	1,200	30,972.00	0.00
181	600639	浦东金桥	1,300	30,927.00	0.00
182	601717	郑煤机	4,000	30,520.00	0.00
183	002106	莱宝高科	2,400	30,432.00	0.00
184	002191	劲嘉股份	2,200	30,162.00	0.00
185	600572	康恩贝	1,982	29,908.38	0.00
186	002505	大康牧业	4,100	29,848.00	0.00
187	000877	天山股份	2,900	29,725.00	0.00
188	000930	中粮生化	3,730	29,616.20	0.00
189	600545	新疆城建	2,600	29,614.00	0.00
190	000550	江铃汽车	969	29,360.70	0.00
191	000669	金鸿能源	996	29,232.60	0.00
192	000563	陕国投 A	2,322	29,187.54	0.00
193	000926	福星股份	2,700	29,052.00	0.00
194	000566	海南海药	1,900	28,918.00	0.00
195	600651	飞乐音响	3,529	28,867.22	0.00
196	002048	宁波华翔	1,994	28,653.78	0.00
197	002219	恒康医疗	1,500	28,575.00	0.00
198	600797	浙大网新	3,917	28,515.76	0.00
199	300147	香雪制药	1,700	28,356.00	0.00
200	600198	大唐电信	1,720	28,156.40	0.00
201	600120	浙江东方	1,500	28,080.00	0.00
202	600582	天地科技	2,300	28,037.00	0.00
203	600160	巨化股份	4,300	28,036.00	0.00
204	002299	圣农发展	2,200	27,830.00	0.00
205	002004	华邦颖泰	1,600	27,808.00	0.00
206	600270	外运发展	1,700	27,795.00	0.00
207	600171	上海贝岭	2,614	27,629.98	0.00
208	600970	中材国际	2,060	27,624.60	0.00
209	000099	中信海直	2,000	27,500.00	0.00
210	601608	中信重工	3,900	27,417.00	0.00
211	000078	海王生物	2,800	27,356.00	0.00
212	600026	中海发展	3,000	27,300.00	0.00
213	000667	美好集团	8,600	27,262.00	0.00
214	600409	三友化工	4,400	27,148.00	0.00

215	600366	宁波韵升	1,675	27,051.25	0.00
216	600596	新安股份	2,603	27,019.14	0.00
217	601369	陕鼓动力	3,100	26,970.00	0.00
218	002368	太极股份	611	26,822.90	0.00
219	002285	世联行	1,780	26,771.20	0.00
220	600825	新华传媒	2,500	26,750.00	0.00
221	600673	东阳光科	1,800	26,712.00	0.00
222	600748	上实发展	2,100	26,691.00	0.00
223	600546	山煤国际	4,700	26,649.00	0.00
224	002013	中航机电	1,071	26,560.80	0.00
225	000513	丽珠集团	537	26,549.28	0.00
226	600220	江苏阳光	6,800	26,520.00	0.00
227	600176	中国玻纤	1,712	26,484.64	0.00
228	002179	中航光电	1,127	26,461.96	0.00
229	000830	鲁西化工	4,900	26,460.00	0.00
230	000726	鲁泰 A	2,200	26,378.00	0.00
231	002309	中利科技	1,400	26,362.00	0.00
232	001696	宗申动力	3,300	26,301.00	0.00
233	000718	苏宁环球	3,900	26,247.00	0.00
234	000090	天健集团	1,900	26,220.00	0.00
235	601311	骆驼股份	2,000	26,160.00	0.00
236	000028	国药一致	546	26,060.58	0.00
237	002122	天马股份	3,400	25,942.00	0.00
238	000829	天音控股	3,200	25,696.00	0.00
239	600509	天富能源	2,600	25,662.00	0.00
240	002273	水晶光电	1,500	25,650.00	0.00
241	600086	东方金钰	1,000	25,590.00	0.00
242	000541	佛山照明	2,500	25,525.00	0.00
243	603766	隆鑫通用	1,883	25,307.52	0.00
244	000979	中弘股份	5,500	25,025.00	0.00
245	600823	世茂股份	1,700	25,007.00	0.00
246	600392	盛和资源	900	24,975.00	0.00
247	000572	海马汽车	4,700	24,769.00	0.00
248	000732	泰禾集团	1,500	24,675.00	0.00
249	000816	江淮动力	4,100	24,641.00	0.00
250	600757	长江传媒	2,891	24,602.41	0.00
251	002311	海大集团	2,000	24,560.00	0.00
252	600859	王府井	1,100	24,398.00	0.00
253	600851	海欣股份	2,800	24,332.00	0.00

254	000636	风华高科	2,736	24,240.96	0.00
255	600702	沱牌舍得	1,300	24,219.00	0.00
256	600021	上海电力	3,100	24,211.00	0.00
257	000762	西藏矿业	1,801	24,115.39	0.00
258	002508	老板电器	738	24,058.80	0.00
259	600004	白云机场	2,200	24,046.00	0.00
260	600812	华北制药	3,881	24,023.39	0.00
261	002277	友阿股份	1,900	23,997.00	0.00
262	002431	棕榈园林	1,129	23,833.19	0.00
263	000788	北大医药	1,700	23,766.00	0.00
264	600864	哈投股份	1,600	23,760.00	0.00
265	600261	阳光照明	2,799	23,735.52	0.00
266	600657	信达地产	2,900	23,664.00	0.00
267	000900	现代投资	3,361	23,594.22	0.00
268	002665	首航节能	600	23,478.00	0.00
268	600039	四川路桥	4,300	23,478.00	0.00
269	000961	中南建设	1,700	23,290.00	0.00
270	600884	杉杉股份	1,400	23,226.00	0.00
271	300088	长信科技	1,500	23,205.00	0.00
271	600874	创业环保	2,100	23,205.00	0.00
272	002317	众生药业	1,205	23,136.00	0.00
273	600699	均胜电子	1,185	23,119.35	0.00
274	000697	炼石有色	1,300	22,919.00	0.00
275	000973	佛塑科技	3,700	22,866.00	0.00
276	600141	兴发集团	1,500	22,860.00	0.00
277	601678	滨化股份	2,200	22,858.00	0.00
278	300039	上海凯宝	1,800	22,824.00	0.00
279	000969	安泰科技	2,500	22,800.00	0.00
280	600351	亚宝药业	2,600	22,698.00	0.00
281	002161	远望谷	2,800	22,680.00	0.00
282	600006	东风汽车	3,800	22,610.00	0.00
283	002221	东华能源	1,366	22,525.34	0.00
284	002204	大连重工	1,878	22,517.22	0.00
285	002028	思源电气	1,808	22,509.60	0.00
286	002041	登海种业	702	22,499.10	0.00
287	002332	仙琚制药	2,050	22,345.00	0.00
288	002414	高德红外	1,100	22,330.00	0.00
289	600993	马应龙	1,100	22,308.00	0.00
290	002588	史丹利	570	22,201.50	0.00

291	600199	金种子酒	1,900	22,173.00	0.00
292	000596	古井贡酒	600	22,170.00	0.00
293	600790	轻纺城	2,700	22,167.00	0.00
294	601880	大连港	4,800	22,128.00	0.00
295	000860	顺鑫农业	1,181	22,061.08	0.00
296	002371	七星电子	844	22,028.40	0.00
297	002056	横店东磁	1,000	21,950.00	0.00
298	600289	亿阳信通	2,200	21,780.00	0.00
299	300115	长盈精密	1,200	21,756.00	0.00
300	600894	广日股份	1,693	21,755.05	0.00
301	000931	中关村	2,602	21,674.66	0.00
302	000650	仁和药业	2,800	21,616.00	0.00
303	600380	健康元	3,000	21,570.00	0.00
303	600997	开滦股份	3,000	21,570.00	0.00
304	000417	合肥百货	2,600	21,554.00	0.00
305	002181	粤传媒	1,400	21,504.00	0.00
306	002064	华峰氨纶	2,000	21,400.00	0.00
307	002690	美亚光电	600	21,360.00	0.00
308	600112	天成控股	1,900	21,318.00	0.00
309	002444	巨星科技	1,900	21,280.00	0.00
310	600059	古越龙山	2,370	21,187.80	0.00
311	002237	恒邦股份	1,300	21,073.00	0.00
312	600612	老凤祥	649	20,982.17	0.00
313	000681	视觉中国	1,000	20,980.00	0.00
314	000587	金叶珠宝	1,900	20,976.00	0.00
315	600971	恒源煤电	2,400	20,952.00	0.00
316	600628	新世界	2,000	20,920.00	0.00
317	002244	滨江集团	2,600	20,904.00	0.00
318	002672	东江环保	600	20,844.00	0.00
319	002052	同洲电子	2,284	20,830.08	0.00
320	000850	华茂股份	2,693	20,655.31	0.00
321	600073	上海梅林	2,200	20,636.00	0.00
322	002325	洪涛股份	1,900	20,615.00	0.00
323	600300	维维股份	4,000	20,400.00	0.00
324	600460	士兰微	3,545	20,241.95	0.00
325	002390	信邦制药	1,000	20,220.00	0.00
326	600729	重庆百货	809	20,216.91	0.00
327	000021	长城开发	2,800	20,104.00	0.00
328	600251	冠农股份	1,100	20,086.00	0.00

329	600292	中电远达	900	20,052.00	0.00
330	002269	美邦服饰	1,900	20,045.00	0.00
331	002251	步步高	1,429	20,020.29	0.00
332	600482	风帆股份	1,571	19,967.41	0.00
333	002140	东华科技	1,100	19,789.00	0.00
334	601101	昊华能源	2,300	19,780.00	0.00
335	600826	兰生股份	1,001	19,609.59	0.00
336	002029	七匹狼	2,200	19,602.00	0.00
337	600481	双良节能	1,935	19,524.15	0.00
338	600740	山西焦化	2,900	19,488.00	0.00
339	002254	泰和新材	1,700	19,448.00	0.00
340	600132	重庆啤酒	1,200	19,416.00	0.00
341	600387	海越股份	1,516	19,389.64	0.00
342	002203	海亮股份	2,200	19,382.00	0.00
343	002646	青青稞酒	903	19,369.35	0.00
344	002011	盾安环境	1,974	19,305.72	0.00
345	002477	雏鹰农牧	2,200	19,272.00	0.00
346	600586	金晶科技	4,729	19,247.03	0.00
347	600239	云南城投	2,800	19,180.00	0.00
348	002482	广田股份	1,260	19,063.80	0.00
349	000919	金陵药业	1,400	19,040.00	0.00
350	600496	精工钢构	2,000	18,980.00	0.00
351	002463	沪电股份	3,960	18,968.40	0.00
352	600885	宏发股份	1,010	18,866.80	0.00
353	002276	万马股份	2,277	18,739.71	0.00
354	000886	海南高速	3,800	18,582.00	0.00
355	000809	铁岭新城	1,800	18,468.00	0.00
356	000066	长城电脑	3,200	18,336.00	0.00
357	600750	江中药业	904	18,306.00	0.00
358	601886	江河创建	2,200	18,260.00	0.00
359	600438	通威股份	1,954	18,172.20	0.00
360	002025	航天电器	960	18,144.00	0.00
361	600337	美克家居	1,901	18,135.54	0.00
362	000049	德赛电池	600	18,072.00	0.00
363	002408	齐翔腾达	1,102	18,006.68	0.00
364	600425	青松建化	2,600	17,914.00	0.00
365	600850	华东电脑	500	17,820.00	0.00
366	600636	三爱富	1,300	17,628.00	0.00
367	600563	法拉电子	610	17,580.20	0.00

368	002480	新筑股份	1,551	17,526.30	0.00
369	600831	广电网络	1,900	17,347.00	0.00
370	600736	苏州高新	3,000	17,310.00	0.00
371	002233	塔牌集团	1,700	17,289.00	0.00
372	000951	中国重汽	836	17,288.48	0.00
373	600260	凯乐科技	2,000	17,280.00	0.00
374	600456	宝钛股份	1,000	17,180.00	0.00
375	002342	巨力索具	2,800	17,080.00	0.00
376	600773	西藏城投	1,400	16,954.00	0.00
377	000620	新华联	2,300	16,951.00	0.00
378	002551	尚荣医疗	826	16,866.92	0.00
379	002345	潮宏基	2,000	16,800.00	0.00
380	000852	江钻股份	800	16,672.00	0.00
381	600298	安琪酵母	900	16,614.00	0.00
382	002242	九阳股份	1,500	16,605.00	0.00
383	600488	天药股份	2,800	16,520.00	0.00
384	000823	超声电子	1,511	16,500.12	0.00
385	002727	一心堂	400	16,444.00	0.00
386	002384	东山精密	1,500	16,410.00	0.00
387	600335	国机汽车	909	16,298.37	0.00
388	000510	金路集团	2,900	15,892.00	0.00
389	000525	红太阳	1,000	15,870.00	0.00
390	600537	亿晶光电	1,145	15,697.95	0.00
391	600401	海润光伏	2,264	15,644.24	0.00
392	002069	獐子岛	1,314	15,636.60	0.00
393	002216	三全食品	800	15,528.00	0.00
394	000555	神州信息	400	15,400.00	0.00
395	000703	恒逸石化	1,704	15,387.12	0.00
396	600830	香溢融通	1,500	15,315.00	0.00
397	600551	时代出版	944	15,302.24	0.00
398	600439	瑞贝卡	3,200	15,296.00	0.00
399	600329	中新药业	1,000	15,260.00	0.00
400	000030	富奥股份	1,800	15,210.00	0.00
401	000927	一汽夏利	2,300	15,203.00	0.00
402	000062	深圳华强	1,000	15,170.00	0.00
403	600640	号百控股	980	15,131.20	0.00
404	601801	皖新传媒	900	14,958.00	0.00
405	002128	露天煤业	1,602	14,946.66	0.00
406	002489	浙江永强	1,098	14,921.82	0.00

407	600180	瑞茂通	1,211	14,919.52	0.00
408	002281	光迅科技	400	14,864.00	0.00
409	601233	桐昆股份	1,400	14,840.00	0.00
410	600780	通宝能源	2,200	14,828.00	0.00
411	002083	孚日股份	3,000	14,790.00	0.00
412	002392	北京利尔	1,100	14,784.00	0.00
413	002275	桂林三金	800	14,680.00	0.00
414	600088	中视传媒	829	14,665.01	0.00
415	000519	江南红箭	1,100	14,652.00	0.00
416	600776	东方通信	1,800	14,634.00	0.00
417	600614	鼎立股份	1,100	14,630.00	0.00
418	600429	三元股份	1,655	14,613.65	0.00
419	000962	东方钽业	1,250	14,550.00	0.00
419	603077	和邦股份	1,500	14,550.00	0.00
420	002698	博实股份	593	14,528.50	0.00
421	002648	卫星石化	1,200	14,520.00	0.00
422	002174	游族网络	300	14,493.00	0.00
423	002091	江苏国泰	1,001	14,484.47	0.00
424	002118	紫鑫药业	1,202	14,460.06	0.00
425	000418	小天鹅 A	1,100	14,388.00	0.00
426	000921	海信科龙	1,711	14,286.85	0.00
427	002249	大洋电机	1,228	14,072.88	0.00
428	603369	今世缘	500	13,935.00	0.00
429	601126	四方股份	800	13,840.00	0.00
430	002503	搜于特	700	13,804.00	0.00
431	600616	金枫酒业	1,468	13,769.84	0.00
432	000861	海印股份	1,700	13,651.00	0.00
433	601908	京运通	1,208	13,590.00	0.00
434	600983	惠而浦	1,101	13,542.30	0.00
435	600197	伊力特	1,100	13,508.00	0.00
436	002315	焦点科技	246	13,480.80	0.00
437	002078	太阳纸业	3,300	13,398.00	0.00
438	600467	好当家	2,100	13,356.00	0.00
439	002574	明牌珠宝	1,300	13,312.00	0.00
440	600389	江山股份	500	13,290.00	0.00
441	600507	方大特钢	2,500	13,250.00	0.00
442	002714	牧原股份	300	13,200.00	0.00
443	603366	日出东方	800	12,984.00	0.00
444	600078	澄星股份	1,900	12,977.00	0.00

445	002461	珠江啤酒	1,001	12,822.81	0.00
446	601208	东材科技	1,497	12,799.35	0.00
447	002393	力生制药	399	12,779.97	0.00
448	600195	中牧股份	800	12,680.00	0.00
449	603005	晶方科技	300	12,630.00	0.00
450	002226	江南化工	1,000	12,580.00	0.00
451	002479	富春环保	1,382	12,548.56	0.00
452	601777	力帆股份	1,400	12,404.00	0.00
453	002093	国脉科技	2,040	12,403.20	0.00
454	000693	华泽钴镍	500	12,105.00	0.00
455	600743	华远地产	2,600	12,012.00	0.00
456	601515	东风股份	1,074	12,007.32	0.00
457	600803	威远生化	976	11,897.44	0.00
458	002267	陕天然气	1,100	11,891.00	0.00
459	002678	珠江钢琴	900	11,889.00	0.00
460	002194	武汉凡谷	1,100	11,770.00	0.00
461	000688	建新矿业	1,621	11,719.83	0.00
462	000780	平庄能源	1,900	11,647.00	0.00
463	603328	依顿电子	500	11,645.00	0.00
464	600162	香江控股	1,800	11,628.00	0.00
465	600510	黑牡丹	1,500	11,565.00	0.00
466	601999	出版传媒	1,100	11,539.00	0.00
467	600280	中央商场	800	11,520.00	0.00
468	600184	光电股份	321	11,504.64	0.00
469	002557	洽洽食品	600	11,346.00	0.00
470	601010	文峰股份	1,100	11,055.00	0.00
471	601965	中国汽研	900	11,016.00	0.00
472	603001	奥康国际	600	10,716.00	0.00
473	601566	九牧王	829	10,694.10	0.00
474	600618	氯碱化工	1,062	10,566.90	0.00
475	002225	濮耐股份	1,500	10,365.00	0.00
476	002327	富安娜	769	10,304.60	0.00
477	002430	杭氧股份	1,176	10,301.76	0.00
478	600397	安源煤业	1,900	10,260.00	0.00
479	600801	华新水泥	960	10,166.40	0.00
480	000552	靖远煤电	1,000	10,100.00	0.00
481	002419	天虹商场	741	10,070.19	0.00
482	603555	贵人鸟	600	10,056.00	0.00
483	600333	长春燃气	1,300	9,997.00	0.00

484	601388	怡球资源	1,060	9,858.00	0.00
485	000631	顺发恒业	1,500	9,435.00	0.00
486	002490	山东墨龙	1,030	8,888.90	0.00
487	002320	海峡股份	800	8,664.00	0.00
488	002635	安洁科技	310	8,360.70	0.00
489	002498	汉缆股份	1,000	8,170.00	0.00
490	002662	京威股份	674	8,155.40	0.00
491	600869	智慧能源	900	7,938.00	0.00
492	002238	天威视讯	537	7,528.74	0.00
493	601011	宝泰隆	700	6,944.00	0.00
494	002612	朗姿股份	300	6,900.00	0.00
495	000603	盛达矿业	500	6,130.00	0.00
496	002705	新宝股份	400	5,896.00	0.00
497	002152	广电运通	41	908.15	0.00

## 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	600499	科达洁能	9,713,789.51	0.22
2	600587	新华医疗	9,627,886.45	0.22
3	600570	恒生电子	8,974,872.49	0.20
4	600388	龙净环保	8,217,353.50	0.19
5	600557	康缘药业	8,165,112.76	0.19
6	600594	益佰制药	7,874,534.27	0.18
7	600872	中炬高新	7,721,430.51	0.18
8	600879	航天电子	7,215,755.27	0.16
9	600643	爱建股份	7,109,022.18	0.16
10	600312	平高电气	6,765,878.96	0.15
11	600880	博瑞传播	6,762,612.16	0.15
12	600138	中青旅	6,652,657.64	0.15
13	600770	综艺股份	6,650,000.99	0.15
14	601929	吉视传媒	6,501,408.79	0.15
15	600881	亚泰集团	6,415,031.75	0.15
16	600418	江淮汽车	6,222,146.53	0.14

17	600522	中天科技	5,965,688.75	0.14
18	600675	中华企业	5,952,620.50	0.14
19	600805	悦达投资	5,897,335.10	0.13
20	600835	上海机电	5,889,611.40	0.13

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	600570	恒生电子	18,698,830.97	0.43
2	600587	新华医疗	15,004,683.46	0.34
3	600879	航天电子	13,204,700.53	0.30
4	600312	平高电气	12,792,964.81	0.29
5	600418	江淮汽车	12,556,410.65	0.29
6	600557	康缘药业	11,780,931.35	0.27
7	600643	爱建股份	11,178,905.83	0.25
8	600522	中天科技	11,119,105.65	0.25
9	600872	中炬高新	11,084,692.25	0.25
10	600770	综艺股份	11,058,807.77	0.25
11	600881	亚泰集团	10,979,237.02	0.25
12	600138	中青旅	10,929,715.60	0.25
13	600517	置信电气	10,714,713.06	0.24
14	600499	科达洁能	10,662,510.36	0.24
15	600601	方正科技	10,440,024.69	0.24
16	600388	龙净环保	10,224,620.18	0.23
17	600645	中源协和	10,009,765.58	0.23
18	600200	江苏吴中	9,935,327.59	0.23
19	601929	吉视传媒	9,845,136.94	0.22
20	600805	悦达投资	9,758,267.76	0.22

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	1,309,568,353.98
卖出股票收入（成交）总额	1,930,349,714.10

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.6 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。

### 8.7 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。

### 8.8 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：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 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。

### 8.10 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	ETF	南方基金管理有限公司	3,757,868,383.57	94.37

### 8.11 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。

### 8.12 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。

### 8.13 投资组合报告附注

#### 8.13.1

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。

### 8.13.2

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。

### 8.13.3 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	436,003.20
2	应收证券清算款	5,468,781.49
3	应收股利	1,691.14
4	应收利息	33,960.90
5	应收申购款	38,468,673.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,409,110.08

### 8.13.4 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。

### 8.13.5 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	601519	大智慧	1,598,633.40	0.04	临时停牌
2	600584	长电科技	1,033,977.00	0.03	临时停牌
3	600704	物产中大	888,278.88	0.02	临时停牌
4	600580	卧龙电气	641,376.00	0.02	临时停牌
5	600458	时代新材	621,910.80	0.02	临时停牌
6	600575	皖江物流	542,931.00	0.01	临时停牌
7	600754	锦江股份	512,244.00	0.01	临时停牌
8	000977	浪潮信息	510,632.00	0.01	临时停牌

注：期末前十名股票中除上述股票外不存在流通受限情况

## § 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
229,854	13,830.02	294,089,107.05	9.25%	2,884,797,138.75	90.75%

### 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	项志英	1,500,000.00	2.99%
2	高琪	1,000,000.00	1.99%
3	姚红伟	770,000.00	1.53%
4	姜登斌	700,000.00	1.39%
5	苏岩	664,500.00	1.32%
6	张亦斌	655,014.00	1.30%
7	壮丽	606,961.00	1.21%
8	姚苏玲	604,726.00	1.20%
9	宋毅	440,400.00	0.88%
10	陈若琦	366,400.00	0.73%

### 9.3 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	7,075,647.82	0.2225%

### 9.4 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 究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	<10

## § 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, 657, 868, 889. 39
本报告期基金总申购份额	3, 791, 220, 069. 61
减:本报告期基金总赎回份额	5, 270, 202, 713. 20
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	3, 178, 886, 245. 80

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 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

本报告期内，本基金的基金管理人没有发生重大人事变动。因中国农业银行股份有限公司工作需要，任命余晓晨先生主持中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心工作。余晓晨先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国基金业协会备案。

### 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，无涉及基金管理业务、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(特殊普通合伙)审计费用 107,000 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 6 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	
国泰君安	1	11,777,513,731.17	54.98%	1,618,251.31	55.44%	-
招商证券	1	514,695,924.53	15.92%	455,456.19	15.60%	-
英大证券	2	509,516,545.55	15.76%	463,864.83	15.89%	-
华泰证券	1	275,333,057.41	8.52%	243,643.39	8.35%	-
江海证券	1	155,729,586.72	4.82%	137,805.27	4.72%	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-

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		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	-	-	-	-	-	-	845,229,979.82	48.26%
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	21,366.00	100.00%	-	-	-	-	906,355,154.10	51.74%
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	• 南方基金关于南方 300 与南方 500 基金参加中国光大银行电子渠道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 12 月 31 日
2	• 南方基金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	2014 年 12 月 31 日
3	• 南方基金关于旗下部分基金参加邮储银行个人网上银行和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	2014 年 12 月 31 日
4	南方基金管理有限公司关于公司高级管理人员在子公司兼职情况变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 12 月 25 日
5	• 南方基金关于旗下部分基金增	中国证券报、上海证	2014 年 12 月 10 日

	加长量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	券报、证券时报	
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 12 月 3 日
7	• 南方基金关于旗下部分基金增加宏信证券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	2014 年 11 月 28 日
8	• 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 11 月 27 日
9	南方基金管理有限公司增资公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 11 月 15 日
10	• 南方基金关于旗下部分基金增加太平洋证券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	2014 年 11 月 3 日
11	• 南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF) 分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 10 月 17 日
12	• 南方基金关于旗下部分基金增加数米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 9 月 24 日
13	• 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 9 月 4 日
14	• 关于电子直销业务增加通联支付第三方支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 8 月 28 日
15	• 关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 8 月 1 日
16	• 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
17	• 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
18	• 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
19	• 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
20	• 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
21	• 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
22	• 南方基金关于开通京东网上交	中国证券报、上海证	2014 年 3 月 31 日

	易平台基金销售业务的通知	券报、证券时报	
23	• 南方基金关于旗下部分基金增加好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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 3 月 13 日
24	• 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
25	• 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
26	• 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
27	• 南方基金关于旗下部分基金增加厦门银行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	2014 年 1 月 23 日
28	• 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
29	• 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

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路 6 号免税商务大厦 31-33 楼

### 12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>