

中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年年度报告摘要

2015 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：2016 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示

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 2016 年 3 月 25 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方中证 500ETF
场内简称	500ETF
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	2,607,467,244.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013-03-15

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	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

2.4 信息披露方式

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

§ 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	2015 年	2014 年	2013 年 2 月 6 日 (基金合同生效日)–2013 年 12 月 31 日
本期已实现收益	3,707,520,523.16	1,062,923,895.73	59,380,293.64
本期利润	3,810,362,825.44	1,743,928,258.76	220,928,749.43
加权平均基金份额本期利润	1.6657	0.4024	0.0539
本期基金份额净值增长率	47.56%	39.20%	7.17%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	4.2855	0.3018	0.0141
期末基金资产净值	20,475,912,485.14	4,723,287,249.13	4,469,145,341.32
期末基金份额净值	7.8528	1.4918	1.0717

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

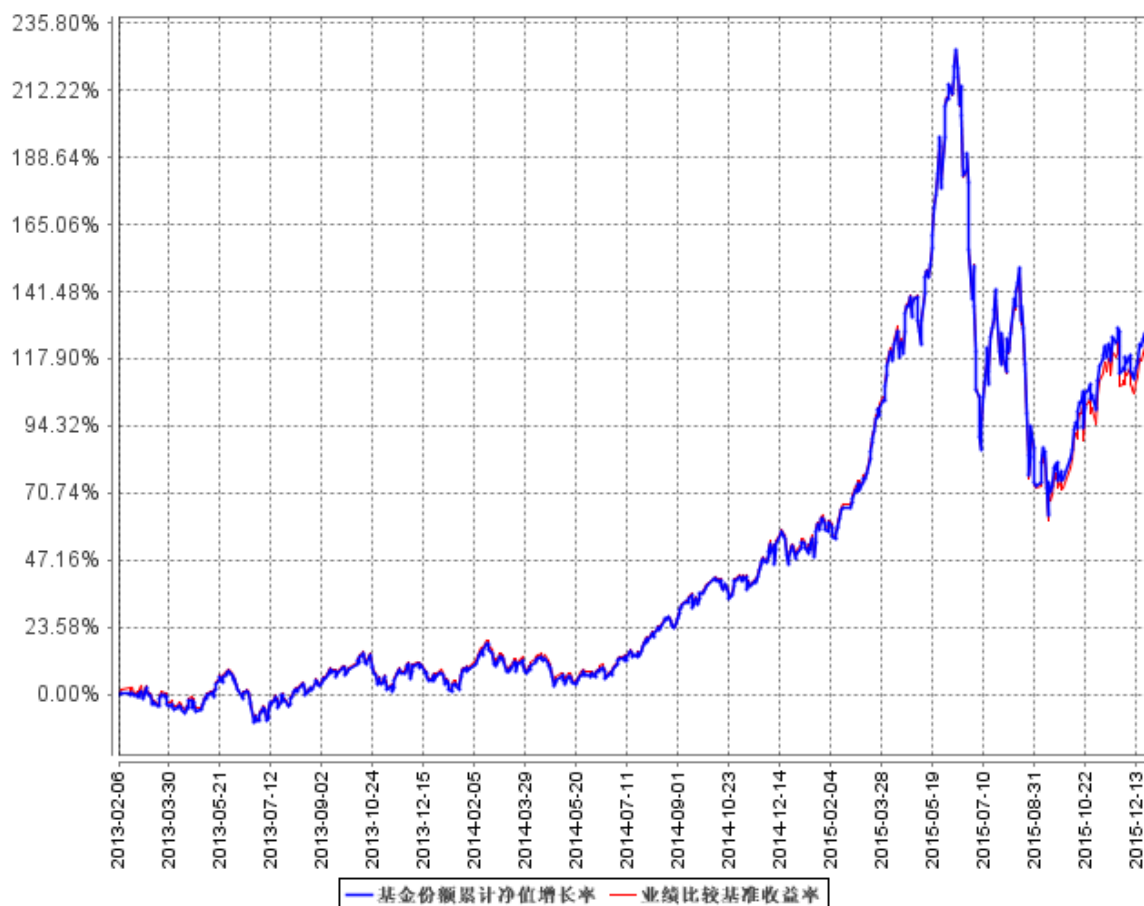
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	25.14%	2.04%	24.40%	2.05%	0.74%	-0.01%
过去六个月	-12.20%	3.25%	-14.47%	3.23%	2.27%	0.02%
过去一年	47.56%	2.83%	43.12%	2.82%	4.44%	0.01%
自基金合同	120.13%	1.97%	114.92%	1.98%	5.21%	-0.01%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

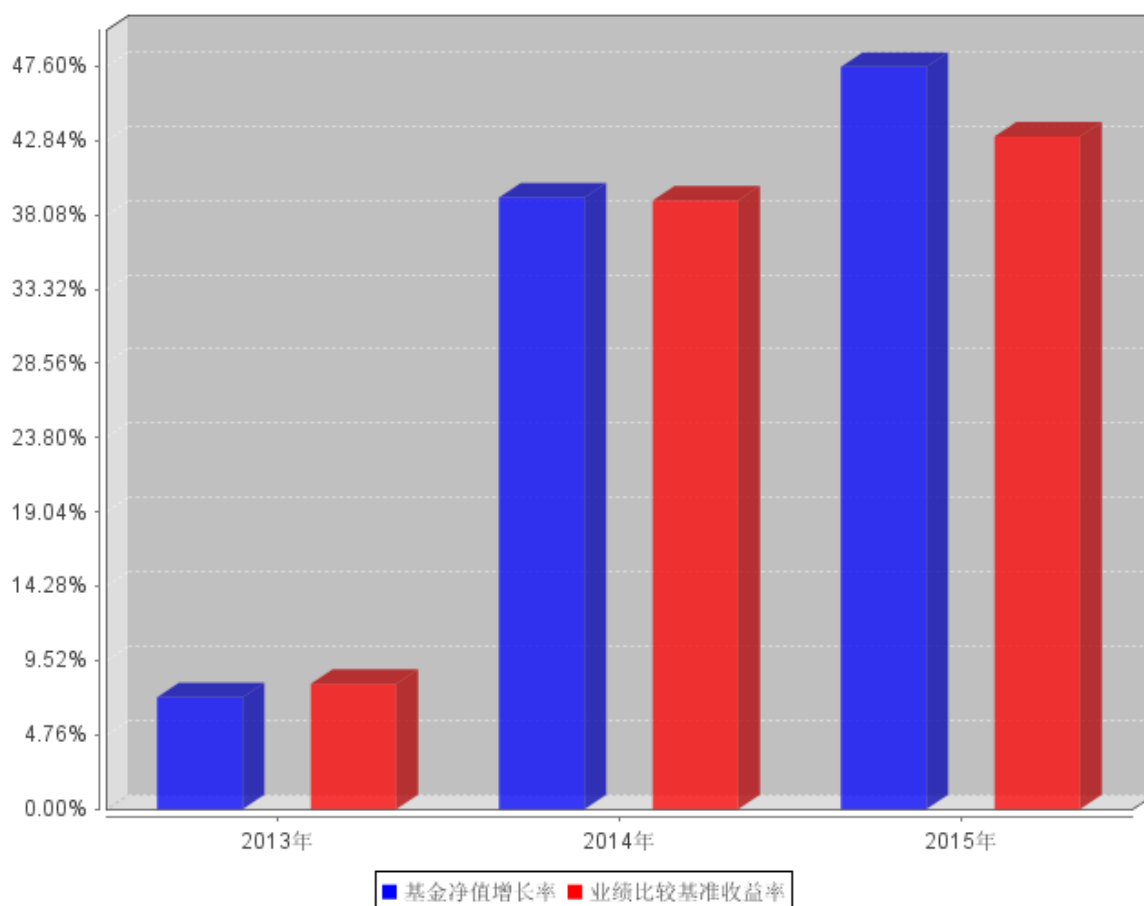
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金成立于 2013 年 2 月 6 日，基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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）管理资产规模超过 5,000 亿元，旗下管理 85 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	-	10 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 5 月至 2015 年 6 月，任南方策略基金经理；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；2014 年 10 月至今，任 500 医药基金经理；2015 年 2 月至今，任南方恒生 ETF 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《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有发生损害基金持有人利益的情形。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 9 次，其中 5 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，2 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，2 次是由于投资组合的投资策略需要，相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

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，中证 500 指数大涨 43.12%。

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”、“ETF 现金流精算系统”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 ETF 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大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- ②报告期内指数成份股（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；
- ③股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；
- ④报告期内，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 0.574%，较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过 2%的投资目标。

截至报告期末，本基金份额净值为 7.8528 元，报告期内，份额净值增长率为 47.56%，同期业绩基准增长率为 43.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年，国内经济结构转型、产业升级加速推进，预期利率水平仍下行，宽松货币政策逻辑不变，投资方面将导致资产配置荒。

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合规风险全面自查、分级基金折算自查等多项内控自查工作，制定或修订了合规手册、公平交易操作指引、股票池管理制度等内部制度，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，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、研究部总监、量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等等。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：当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配采取现金分红方式；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

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

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

在托管本基金的过程中，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基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 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本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本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本基金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

本基金 2015 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2016)第 22235 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	32,810,834.58	77,911,991.82
结算备付金	472,886,806.89	2,570,191.63
存出保证金	56,424,595.26	454,997.74
交易性金融资产	20,044,833,519.70	4,723,354,580.49
其中：股票投资	20,044,833,519.70	4,723,354,580.49
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	226,131.04	8,041,085.07
应收利息	185,277.10	7,606.55
应收股利	9,601.50	9,601.50
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	20,607,376,766.07	4,812,350,054.80
负债和所有者权益	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 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	93,860,509.94	62,218,635.31
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	8,829,132.59	2,118,338.23
应付托管费	1,765,826.52	423,667.61
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,460,781.09	3,626,092.78
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	25,548,030.79	20,676,071.74
负债合计	131,464,280.93	89,062,805.67
所有者权益：		
实收基金	9,301,620,223.72	3,166,093,841.00

未分配利润	11,174,292,261.42	1,557,193,408.13
所有者权益合计	20,475,912,485.14	4,723,287,249.13
负债和所有者权益总计	20,607,376,766.07	4,812,350,054.80

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 7.8528 元，基金份额总额 2,607,467,244.00 份。

7.2 利润表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	3,920,695,794.45	1,789,303,850.10
1.利息收入	16,988,491.97	250,905.18
其中：存款利息收入	16,988,491.97	193,650.06
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	57,255.12
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	3,813,116,507.52	1,090,921,080.95
其中：股票投资收益	3,990,221,708.10	1,043,762,768.54
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-225,594,600.00	-
股利收益	48,489,399.42	47,158,312.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	102,842,302.28	681,004,363.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-12,251,507.32	17,127,500.94
减：二、费用	110,332,969.01	45,375,591.34
1.管理人报酬	62,270,991.47	25,960,915.43
2.托管费	12,454,198.30	5,192,182.98
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	31,293,615.80	12,176,226.48
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	4,314,163.44	2,046,266.45
三、利润总额（亏损总额以“-”	3,810,362,825.44	1,743,928,258.76

号填列)		
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	3,810,362,825.44	1,743,928,258.76

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	3,166,093,841.00	1,557,193,408.13	4,723,287,249.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,810,362,825.44	3,810,362,825.44
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）	6,135,526,382.72	5,806,736,027.85	11,942,262,410.57
其中：1.基金申购款	17,193,484,879.30	20,110,746,234.95	37,304,231,114.25
2.基金赎回款	-11,057,958,496.58	-14,304,010,207.10	-25,361,968,703.68
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）	9,301,620,223.72	11,174,292,261.42	20,475,912,485.14
项目	上年度可比期间 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）	4,170,093,841.00	299,051,500.32	4,469,145,341.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,743,928,258.76	1,743,928,258.76
三、本期基金份额交易	-1,004,000,000.00	-485,786,350.95	-1,489,786,350.95

产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	3,378,000,000.00	684,489,202.12	4,062,489,202.12
2.基金赎回款	-4,382,000,000.00	-1,170,275,553.07	-5,552,275,553.07
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	3,166,093,841.00	1,557,193,408.13	4,723,287,249.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____ 杨小松	_____ 徐超	_____ 徐超
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

中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(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[2012]1727 号《关于核准中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》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《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,147,543,632.00 元(含募集股票市值),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(2013)第 075 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 2 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,147,553,216.00 份,其中通过基金管理人进行网下现金认购部分的认购资金利息折合 9,584.00 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。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2013]第 83 号文审核同意,本基金 4,616,093,841.00 份基金份额于 2013 年 3 月 15 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证 500 指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化;主要投资范围为标的指数的成份股和备选成份股;此外,本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、

衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。

本基金的基金管理人南方基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，根据《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的约定，于 2013 年 2 月 22 日将管理的南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)变更为南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF) (以下简称“南方中证 500ETF 联接基金”)。南方中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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 2016 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相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 2015 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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》、财税[2015]101 号《关于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,于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额,自 2015 年 9 月 8 日起,暂免征收个人所得税。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 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
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
南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)(“南方中证 500ETF 联接基金”)	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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	26,118,575,469.12	61.31%	5,308,368,922.61	67.35%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	5,626,663.52	60.16%	446,583.32	30.57%
关联方名称	上年度可比期间 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	4,697,418.12	66.92%	2,170,798.95	59.87%

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	62,270,991.47	25,960,915.43
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.5\% / \text{当年天数}。$$

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	12,454,198.30	5,192,182.98

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
南方中证 500ETF 联接基金	675,473,402.00	25.91%	2,519,016,211.00	79.56%
华泰证券	2,415,700.00	0.09%	1,216,901.00	0.04%

注：南方中证 500ETF 联接基金和华泰证券投资本基金相关的费用按基金合同和更新的招募说明书的有关规定以及与券商约定的席位佣金费率支付。

7.4.8.5 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	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		2014 年 1 月 1 日至 2014 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	32,810,834.58	2,134,751.56	77,911,991.82	141,762.30

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 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
600654	中安消	2015 年 12 月 14 日	重要事项未公告	28.84	-	-	3,202,975	110,431,800.42	92,373,799.00	-
600584	长电科技	2015 年 11 月 30 日	重大资产重组	22.02	-	-	3,885,653	68,963,052.74	85,562,079.06	-
600122	宏图高科	2015 年 12 月 25 日	重要事项未公告	19.42	-	-	4,292,044	61,531,505.00	83,351,494.48	-
600645	中源协和	2015 年 12 月 30 日	重要事项未公告	65.01	2016 年 1 月 4 日	63.90	1,274,633	66,319,836.84	82,863,891.33	-
600200	江苏吴中	2015 年 11 月 26 日	重大资产重组	27.89	2016 年 3 月 16 日	25.10	2,669,499	61,517,209.53	74,452,327.11	-
002049	同方国芯	2015 年 12 月 11 日	重大资产重组	60.15	2016 年 3 月 11 日	54.14	1,226,018	48,402,739.65	73,744,982.70	-
002340	格林美	2015 年 12 月 29 日	重大事项	15.20	2016 年 1 月 6 日	14.35	4,574,499	64,014,056.83	69,532,384.80	-
600219	南山铝业	2015 年 9 月 29 日	重要事项未公告	6.58	2016 年 1 月 25 日	7.00	9,541,111	78,045,588.75	62,780,510.38	-
002568	百润股份	2015 年 12 月 21 日	重大事项	42.69	2016 年 1 月 18 日	38.42	1,286,733	55,309,295.56	54,930,631.77	-
600851	海欣	2015 年 12 月	重大资产	14.70	2016 年 1 月	13.23	3,467,333	36,655,925.32	50,969,795.10	-

	股份	月 21 日	重组		月 19 日					
002219	恒康医疗	2015 年 7 月 8 日	重大资产重组	14.90	-	-	3,390,360	50,272,844.13	50,516,364.00	-
300088	长信科技	2015 年 12 月 14 日	重大资产重组	14.03	2016 年 2 月 29 日	12.63	3,514,402	41,961,101.12	49,307,060.06	-
000973	佛塑科技	2015 年 12 月 18 日	重大事项	13.00	2016 年 2 月 22 日	11.70	3,742,339	32,645,004.22	48,650,407.00	-
002143	印纪传媒	2015 年 12 月 9 日	重大事项	40.55	2016 年 1 月 5 日	36.50	1,131,700	33,809,446.63	45,890,435.00	-
300043	互动娱乐	2015 年 12 月 17 日	重大事项	15.80	-	-	2,740,803	40,113,340.57	43,304,687.40	-
600759	洲际油气	2015 年 9 月 21 日	重大资产重组	7.85	-	-	5,377,216	51,748,505.60	42,211,145.60	-
600572	康恩贝	2015 年 12 月 28 日	重要事项未公告	13.36	2016 年 1 月 4 日	13.18	3,148,014	43,785,226.43	42,057,467.04	-
000028	国药一致	2015 年 10 月 21 日	重大资产重组	66.15	-	-	624,202	39,344,679.10	41,290,962.30	-
002011	盾安环境	2015 年 12 月 28 日	重大事项	16.72	2016 年 2 月 22 日	15.05	2,387,682	32,712,171.61	39,922,043.04	-
000829	天音控股	2015 年 11 月 9 日	重大资产重组	12.22	-	-	3,246,635	36,868,163.32	39,673,879.70	-
601000	唐山港	2015 年 10 月 29 日	重大资产重组	8.25	2016 年 2 月 17 日	7.98	4,339,456	40,603,476.33	35,800,512.00	-
600859	王府井	2015 年 12 月 21 日	重要事项未公告	27.22	2016 年 1 月 4 日	27.22	1,304,390	32,308,800.28	35,505,495.80	-
002048	宁波华翔	2015 年 11 月 19 日	重大资产重组	17.40	-	-	2,023,875	35,465,714.38	35,215,425.00	-
601717	郑煤机	2015 年 12 月 18 日	重大资产重组	7.52	-	-	4,524,979	35,268,122.24	34,027,842.08	-
002242	九阳股份	2015 年 12 月 24 日	重大事项	22.68	2016 年 1 月 11 日	20.41	1,450,819	28,108,327.45	32,904,574.92	-
600699	均胜电子	2015 年 11 月 4 日	重大资产重组	31.25	2016 年 3 月 10 日	29.00	972,593	31,187,038.54	30,393,531.25	-
600282	南钢股份	2015 年 12 月 30 日	重要事项未公告	3.17	2016 年 1 月 12 日	3.24	9,351,000	29,671,955.13	29,642,670.00	-
600729	重庆百货	2015 年 7 月 24 日	重要事项未公告	32.39	2016 年 1 月 4 日	29.90	909,027	25,696,416.78	29,443,384.53	-
000748	长城信息	2015 年 6 月 18 日	重大资产重组	34.88	2016 年 3 月 10 日	31.39	832,364	22,864,849.76	29,032,856.32	-
002698	博实股份	2015 年 12 月 28 日	重大事项	29.33	2016 年 1 月 5 日	26.40	972,846	24,442,033.33	28,533,573.18	-
002018	华信国际	2015 年 6 月 15 日	重大资产重组	44.08	-	-	640,907	14,881,159.05	28,251,180.56	-

600120	浙江东方	2015 年 10 月 12 日	重大资产重组	19.86	-	-	1,394,203	34,670,408.79	27,688,871.58	-
600880	博瑞传播	2015 年 9 月 16 日	重大资产重组	7.50	2016 年 1 月 18 日	8.25	3,687,817	44,994,562.91	27,658,627.50	-
601678	滨化股份	2015 年 12 月 31 日	重大事项	8.02	2016 年 1 月 5 日	7.22	3,412,241	26,702,426.64	27,366,172.82	-
002174	游族网络	2015 年 7 月 23 日	重大资产重组	89.53	2016 年 2 月 15 日	80.58	230,717	18,035,310.70	20,656,093.01	-
000426	兴业矿业	2015 年 10 月 28 日	重大资产重组	7.06	2016 年 3 月 21 日	7.77	2,780,492	16,722,954.24	19,630,273.52	-
000066	长城电脑	2015 年 6 月 18 日	重大资产重组	21.54	2016 年 3 月 10 日	19.39	882,352	12,336,663.87	19,005,862.08	-
002678	珠江钢琴	2015 年 12 月 21 日	非公开发行	17.21	2016 年 1 月 19 日	15.49	967,530	15,332,096.79	16,651,191.30	-
600864	哈投股份	2015 年 10 月 9 日	重大资产重组	10.88	2016 年 1 月 14 日	11.97	1,522,204	20,074,374.95	16,561,579.52	-
002371	七星电子	2015 年 10 月 8 日	重大事项	19.28	2016 年 1 月 11 日	21.21	838,766	23,811,591.93	16,171,408.48	-
600429	三元股份	2015 年 9 月 21 日	重大资产重组	7.29	2016 年 1 月 27 日	7.49	2,099,096	19,560,543.47	15,302,409.84	-
000982	中银绒业	2014 年 8 月 25 日	重大事项	4.64	2016 年 2 月 25 日	5.10	2,103,424	9,707,097.96	9,759,887.36	-
600978	宜华木业	2015 年 6 月 18 日	重大资产重组	22.33	2016 年 1 月 21 日	20.10	255,766	4,916,073.14	5,711,254.78	-
601388	怡球资源	2015 年 7 月 27 日	重大资产重组	23.33	2016 年 2 月 15 日	21.00	25,568	430,460.17	596,501.44	-
002320	海峡股份	2015 年 6 月 25 日	重大资产重组	27.43	2016 年 1 月 7 日	24.69	16,700	281,130.70	458,081.00	-

注：本基金截至 2015 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末及上年度可比期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2015 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 37,304,231,114.25 元(2014 年度：4,062,489,202.12 元)，其中包括以股票支付的申购款 14,933,584,726.16 元和以现金支付的申购款 22,370,646,388.09 元(2014 年度：以股票支付的申购款 2,061,692,001.37 元和以现金支付的申购款 2,000,797,200.75 元)。

(2) 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 2015 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 18,299,477,912.96 元，属于第二层次的余额为 1,745,355,606.74 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 4,341,781,466.83 元，第二层次 381,573,113.66 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 2015 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(2014 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。

(3) 除基金申购款和公允价值外，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	20,044,833,519.70	97.27
	其中：股票	20,044,833,519.70	97.27
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	505,697,641.47	2.45
7	其他各项资产	56,845,604.90	0.28
8	合计	20,607,376,766.07	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	365,472,873.54	1.78
B	采矿业	638,200,526.72	3.12
C	制造业	11,851,308,106.04	57.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	614,971,539.84	3.00
E	建筑业	529,621,345.51	2.59
F	批发和零售业	1,245,335,785.97	6.08
G	交通运输、仓储和邮政业	589,920,521.52	2.88
H	住宿和餐饮业	47,190,895.44	0.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,280,932,496.47	6.26
J	金融业	217,255,561.77	1.06
K	房地产业	1,390,312,339.43	6.79

L	租赁和商务服务业	395,296,802.33	1.93
M	科学研究和技术服务业	111,191,303.54	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	148,874,772.83	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	52,982,039.22	0.26
R	文化、体育和娱乐业	278,277,718.63	1.36
S	综合	287,691,864.90	1.41
	合计	20,044,836,493.70	97.89

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002466	天齐锂业	738,600	103,957,950.00	0.51
2	002405	四维图新	2,669,001	103,557,238.80	0.51
3	600160	巨化股份	4,233,768	99,366,534.96	0.49
4	600201	生物股份	2,687,474	99,355,913.78	0.49
5	600816	安信信托	4,154,826	94,605,388.02	0.46
6	600079	人福医药	4,208,575	93,682,879.50	0.46
7	600654	中安消	3,202,975	92,373,799.00	0.45
8	600635	大众公用	9,255,016	91,254,457.76	0.45
9	002030	达安基因	2,168,864	89,313,819.52	0.44
10	002439	启明星辰	2,726,590	87,250,880.00	0.43

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 <http://www.nffund.com> 的年度报告正文。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资。

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	300033	同花顺	170,882,345.31	3.62
2	002183	怡亚通	162,630,618.09	3.44
3	000540	中天城投	162,614,576.25	3.44
4	000661	长春高新	157,367,156.50	3.33
5	000997	新大陆	154,455,895.76	3.27
6	000592	平潭发展	152,090,226.10	3.22
7	000012	南玻 A	151,722,206.69	3.21
8	000998	隆平高科	150,705,641.71	3.19
9	002405	四维图新	150,528,786.38	3.19
10	300253	卫宁软件	147,577,738.07	3.12
11	300144	宋城演艺	146,015,016.84	3.09
12	002030	达安基因	141,997,279.22	3.01
13	002004	华邦健康	140,717,683.47	2.98
14	300291	华录百纳	136,735,501.17	2.89
15	000547	航天发展	133,757,576.88	2.83
16	002276	万马股份	130,389,135.72	2.76
17	002400	省广股份	128,314,033.47	2.72
18	300072	三聚环保	125,821,008.93	2.66
19	000031	中粮地产	125,461,548.36	2.66
20	600654	中安消	122,697,941.82	2.60
21	000930	中粮生化	122,424,061.36	2.59
22	002022	科华生物	121,741,147.67	2.58
23	002340	格林美	120,183,679.74	2.54
24	002701	奥瑞金	117,387,893.20	2.49
25	002573	清新环境	116,479,540.28	2.47
26	002266	浙富控股	115,461,728.08	2.44
27	002063	远光软件	114,522,090.33	2.42
28	300059	东方财富	114,471,134.54	2.42
29	002073	软控股份	114,248,262.72	2.42
30	300244	迪安诊断	113,983,880.16	2.41
31	000616	海航投资	112,594,276.05	2.38

32	000656	金科股份	111,949,577.95	2.37
33	600446	金证股份	111,710,538.62	2.37
34	300267	尔康制药	111,221,669.27	2.35
35	000690	宝新能源	111,085,508.71	2.35
36	300199	翰宇药业	110,617,443.92	2.34
37	002223	鱼跃医疗	110,187,075.48	2.33
38	000718	苏宁环球	108,769,223.84	2.30
39	002595	豪迈科技	108,645,624.84	2.30
40	000415	渤海租赁	108,584,840.28	2.30
41	002250	联化科技	107,563,432.43	2.28
42	000887	中鼎股份	107,367,749.55	2.27
43	300273	和佳股份	106,961,184.18	2.26
44	300274	阳光电源	105,443,206.70	2.23
45	000566	海南海药	104,829,715.74	2.22
46	002013	中航机电	103,025,008.56	2.18
47	300147	香雪制药	102,745,477.45	2.18
48	000006	深振业 A	101,648,049.52	2.15
49	002315	焦点科技	101,485,369.96	2.15
50	002285	世联行	101,472,740.91	2.15
51	002424	贵州百灵	98,887,395.04	2.09
52	002271	东方雨虹	98,616,135.67	2.09
53	000988	华工科技	97,316,027.88	2.06
54	300202	聚龙股份	97,068,778.40	2.06
55	603766	隆鑫通用	95,152,683.23	2.01
56	002508	老板电器	95,024,637.70	2.01
57	002665	首航节能	94,829,475.53	2.01

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	300059	东方财富	283,660,151.70	6.01
2	000540	中天城投	208,685,004.66	4.42
3	002183	怡亚通	182,850,610.70	3.87

4	300144	宋城演艺	182,597,061.62	3.87
5	300033	同花顺	182,553,173.05	3.86
6	300168	万达信息	146,398,415.12	3.10
7	002424	贵州百灵	142,851,712.08	3.02
8	000415	渤海租赁	134,514,811.65	2.85
9	000661	长春高新	125,723,077.13	2.66
10	600895	张江高科	122,974,992.85	2.60
11	000012	南玻 A	121,352,897.99	2.57
12	000997	新大陆	118,709,122.52	2.51
13	600446	金证股份	116,429,486.82	2.47
14	000998	隆平高科	109,886,527.35	2.33
15	601718	际华集团	107,906,520.83	2.28
16	002315	焦点科技	105,378,310.06	2.23
17	002030	达安基因	103,463,335.96	2.19
18	300253	卫宁软件	102,548,162.62	2.17
19	600737	中粮屯河	100,750,639.04	2.13
20	002405	四维图新	98,980,441.52	2.10

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	25,300,186,274.78
卖出股票收入（成交）总额	17,300,646,326.11

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

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

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前十名资产支持证券投资明细

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1601	IC1601	130	192,374,000.00	-619,200.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-619,200.00
股指期货投资本期收益(元)					-225,594,600.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-619,200.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1**

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	56,424,595.26
2	应收证券清算款	226,131.04
3	应收股利	9,601.50
4	应收利息	185,277.10

5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	56,845,604.90

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资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	600654	中安消	92,373,799.00	0.45	重大事项未公告

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资。

§ 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

9.1.1 本基金的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
7,446	350,183.62	2,561,243,182.00	98.23%	46,224,062.00	1.77%

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例
中国农业银行—南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	675,473,402.00	25.91%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国农业银行—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“持有份额”和“占总份额比例”数据。

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	中央汇金投资有限责任公司	1,728,426,785.00	66.29%
2	中国人寿保险股份有限公司	25,363,330.00	0.97%
3	中国平安人寿保险股份有限公司－万能一个险万能	13,611,404.00	0.52%
4	中国人寿再保险有限责任公司	7,687,565.00	0.29%
5	华融国际信托有限责任公司－华融·汇金1号证券投资单一资金信托	5,825,400.00	0.22%
6	新华人寿保险股份有限公司	4,650,828.00	0.18%
7	南京市投资公司	4,485,197.00	0.17%
8	工银瑞信基金－工商银行－特定客户资产管理	4,198,900.00	0.16%
9	中江国际信托股份有限公司－金狮158号资金信托合同	3,870,770.00	0.15%
10	国泰君安－建行－香港上海汇丰银行有限公司	3,564,400.00	0.14%
	中国农业银行－南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	675,473,402.00	25.91%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

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

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 2 月 6 日）基金份额总额	1,147,553,216.00
本报告期期初基金份额总额	3,166,093,841.00
本报告期基金总申购份额	5,677,600,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	4,101,600,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-2,134,626,597.00
本报告期期末基金份额总额	2,607,467,244.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据南方基金管理有限公司第六届董事会第十四次会议审议通过，并向中国基金业协会报备，基金管理人于 2015 年 5 月 29 日发布公告，聘任常克川、李海鹏为公司副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、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

本报告期内本基金未更换会计师事务所，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 156,000 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 3 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

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	
华泰证券	2	226,118,575,469.12	61.31%	5,626,663.52	58.75%	-
申万宏源	2	7,398,008,758.19	17.37%	739,801.34	7.72%	-
银河证券	2	6,467,749,290.42	15.18%	646,830.35	6.75%	-

招商证券	1	1, 565, 042, 572. 56	3. 67%	1, 384, 909. 61	14. 46%	-
瑞银证券	1	663, 275, 039. 84	1. 56%	603, 846. 64	6. 30%	-
东方证券	1	386, 041, 924. 69	0. 91%	351, 454. 98	3. 67%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

注：为节约交易单元资源, 我公司在交易所交易系统升级的基础上, 对同一银行托管基金进行了席位整合。

本基金本报告期租用证券公司交易单元情况如下：专用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专用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。