

南方中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 (LOF) 2016 年年度报告

2016 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：2017 年 3 月 30 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 2017 年 3 月 27 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 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	54
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.....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	77
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.....	77
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.....	77

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	77
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	77
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	78
8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	78
8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
8.13 投资组合报告附注	78
§9 基金份额持有人信息	80
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	80
9.2 期末上市基金前十名持有人	80
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	80
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	81
§ 10 开放式基金份额变动	82
§ 11 重大事件揭示	83
11.1 基金份额持有人大会决议	83
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	83
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	83
11.4 基金投资策略的改变	83
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	83
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	83
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	84
11.8 其他重大事件	86
§12 备查文件目录	89
12.1 备查文件目录	89
12.2 存放地点	89
12.3 查阅方式	89

§ 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	2,679,131,874.38 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 年 11 月 11 日

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数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		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		张海波	周慕冰

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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	98,556,570.65	1,821,105,399.31	529,203,679.72
本期利润	-857,843,518.26	1,995,258,255.72	1,429,875,469.90
加权平均基金份额本期利润	-0.2838	0.7542	0.3225
本期加权平均净值利润率	-18.97%	43.28%	31.28%
本期基金份额净值增长率	-15.19%	44.14%	36.29%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	1,423,389,439.67	2,501,740,805.17	273,188,993.37
期末可供分配基金份额利润	0.5313	0.7922	0.0859
期末基金资产净值	4,102,521,314.05	5,701,544,856.19	3,981,924,887.50
期末基金份额净值	1.5313	1.8055	1.2526
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	67.08%	96.99%	36.67%

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

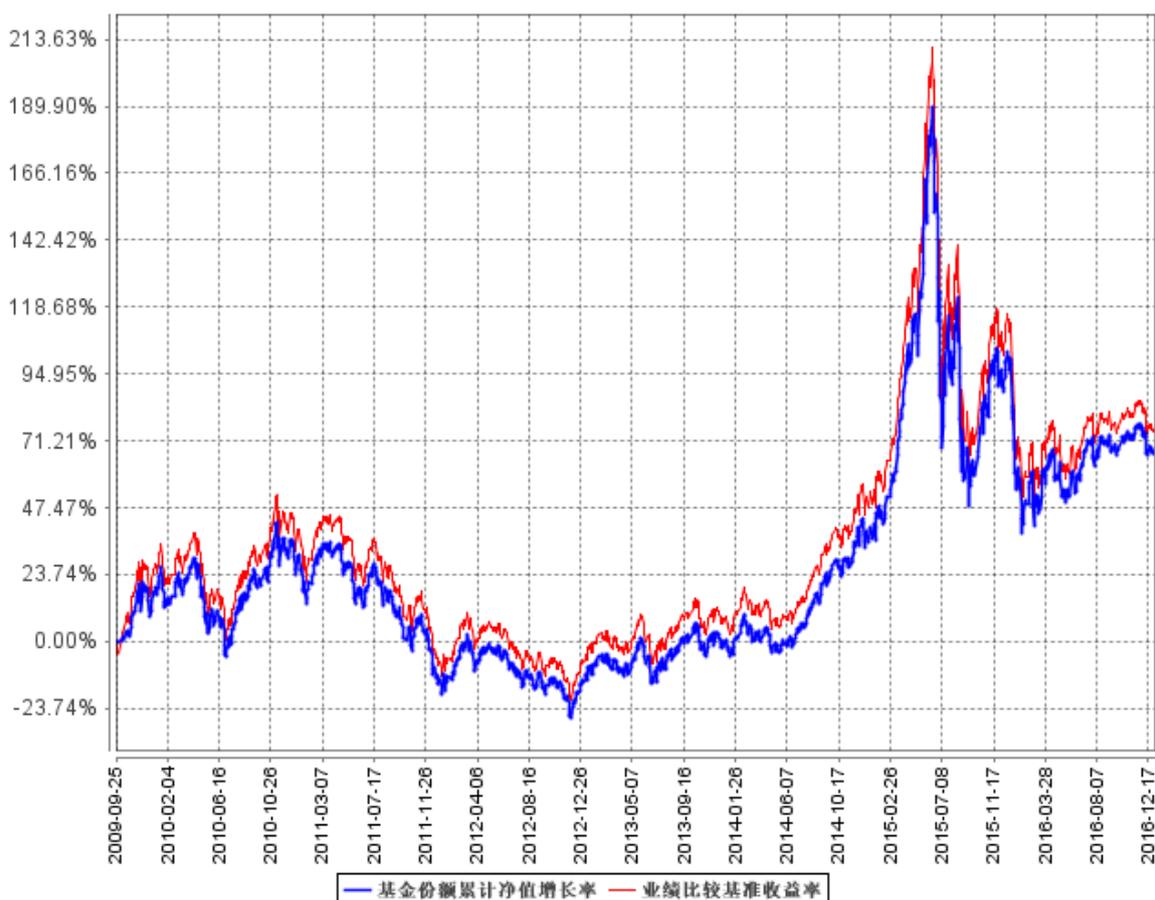
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.94%	0.78%	-0.95%	0.78%	0.01%	0.00%
过去六个月	2.56%	0.87%	2.21%	0.88%	0.35%	-0.01%
过去一年	-15.19%	1.82%	-16.77%	1.81%	1.58%	0.01%
过去三年	66.62%	2.00%	60.94%	1.98%	5.68%	0.02%
过去五年	93.03%	1.79%	87.70%	1.78%	5.33%	0.01%
自基金合同 生效起至今	67.08%	1.73%	74.82%	1.73%	-7.74%	0.00%

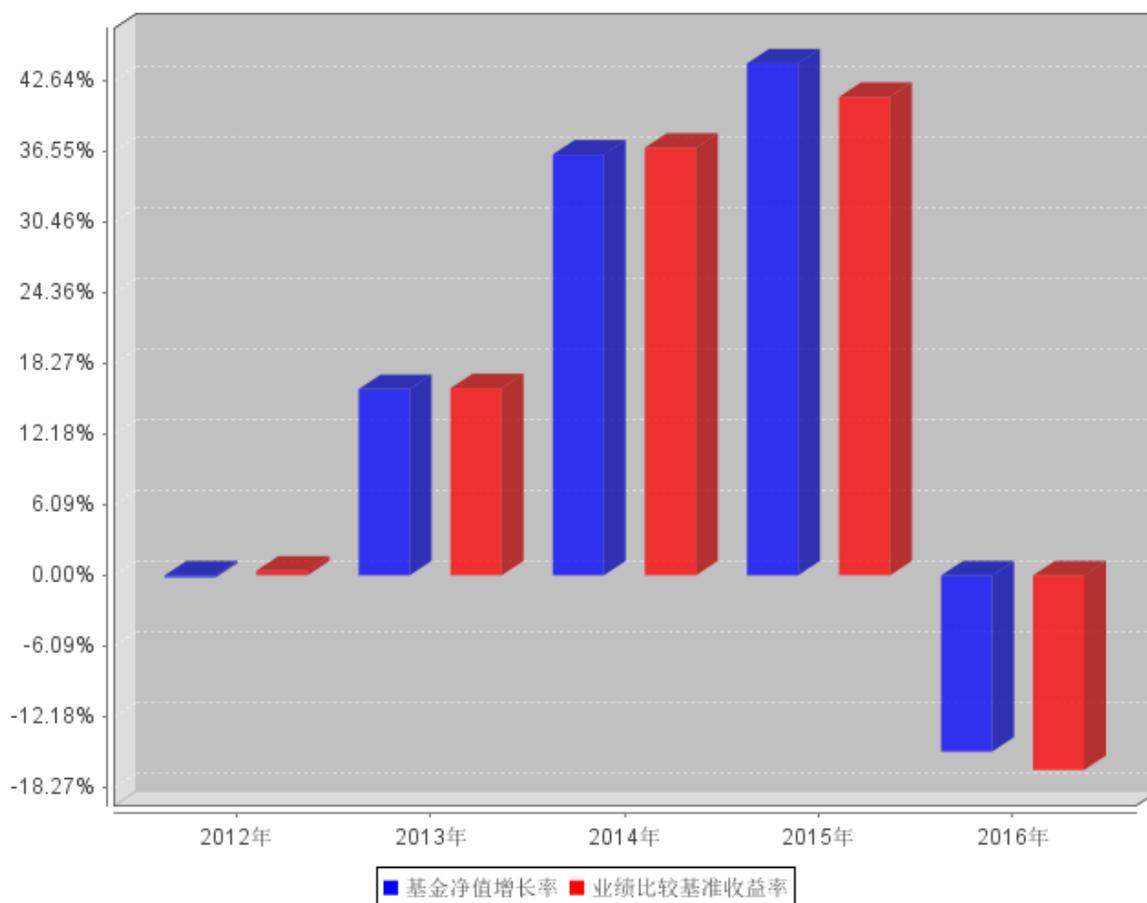
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
2016	-	-	-	-	
2015	-	-	-	-	
2014	0.3000	69,272,231.01	40,602,277.80	109,874,508.81	
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 6,500 亿元，旗下管理 116 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	-	11 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，曾任南方基金量化投资部基金经理助理，现任量化投资部总监助理；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；2016 年 12 月至今，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理。
--	--	--	--	--	---

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遵规守信情况的说明

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)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。

公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占优比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。”

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 1 次，是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致，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 指数跌 17.78%。

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；
- ④6 月和 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 0.66%，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 1.5313 元，报告期内，份额净值增长率为-15.19%，同期业绩基准增长率为-16.77%。

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 2017 年，国内经济阶段企稳、通胀压力有所回升，货币政策将更加中性，综合看，权益市场预期将有一个较好的表现。

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，本基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展情况，围绕重合规守底线、抓规范促发展，坚持从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，积极推动主动合规风控管理，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，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展情况，不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，并开展了互联网金融相关业务风险自查、信息技术专项自查等多项内控自查工作，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营及人员管理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，推动公司合规、内控体系的健全完善；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，持续完善投资合规风控制度流程和系统，积极配合各类新产品、新业务，重点加强内幕交易防控以及对高风险品种和业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，有效确保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，督促落实销售适当性管理制度；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；深入贯彻风险为本的反洗钱工作原则，优化反洗钱资源配置，加大反洗钱投入力度，购置外部专业机构制裁名单数据库，积极推进符合基金业务特征的可疑交易监控模型和方法，健全创新业务洗钱风险评估机制，各项反洗钱工作进一步完善；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：每一基金份额享有同等分配权；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多 6 次，每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期末有收益分配事项。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 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

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(2017)第 21443 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)全体基金份额持有人:
引言段	我们审计了后附的南方中证 500 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 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 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: (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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映; (2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	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。 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

	<p>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	<p>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、中国基金业协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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>	
注册会计师的姓名	薛竞	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	2017 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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	227,730,372.51	312,791,396.95
结算备付金		67,344.58	5,734,853.96
存出保证金		390,712.97	2,001,495.02
交易性金融资产	7.4.7.2	3,890,046,070.01	5,408,919,840.57
其中：股票投资		141,785,533.20	104,562,309.34
基金投资		3,748,260,536.81	5,304,357,531.23
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		-	534,124.80
应收利息	7.4.7.5	41,066.53	60,591.71
应收股利		1,691.14	1,691.14
应收申购款		4,376,105.87	20,143,076.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	1,357,532.42	9,310,637.34
资产总计		4,124,010,896.03	5,759,497,708.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日

负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		13,316,293.47	30,657,468.08
应付赎回款		7,536,613.81	24,812,569.23
应付管理人报酬		128,959.19	184,258.05
应付托管费		25,791.84	36,851.62
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	48,525.43	2,067,139.53
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	433,398.24	194,565.54
负债合计		21,489,581.98	57,952,852.05
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,679,131,874.38	3,157,946,424.77
未分配利润	7.4.7.10	1,423,389,439.67	2,543,598,431.42
所有者权益合计		4,102,521,314.05	5,701,544,856.19
负债和所有者权益总计		4,124,010,896.03	5,759,497,708.24

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5313 元，基金份额总额 2,679,131,874.38 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-852,023,229.58	2,005,591,047.27
1.利息收入		1,993,500.96	1,878,583.25
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,937,197.86	1,878,583.25
债券利息收入		9.13	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		56,293.97	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		96,658,060.63	1,820,732,725.54
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-9,435,918.77	66,919,799.94
基金投资收益	7.4.7.13	105,815,502. 11	1,753,211,857. 30
债券投资收益	7.4.7.14	11,335.35	-
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	267,141.94	601,068.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-956,400,088.91	174,152,856.41
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	5,725,297.74	8,826,882.07
减：二、费用		5,820,288.68	10,332,791.55
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,605,369.35	1,672,376.11
2. 托管费	7.4.10.2.2	321,073.85	334,475.27
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	3,404,100.05	7,826,603.71
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	489,745.43	499,336.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-857,843,518.26	1,995,258,255.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-857,843,518.26	1,995,258,255.72

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	3,157,946,424.77	2,543,598,431.42	5,701,544,856.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-857,843,518.26	-857,843,518.26
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）	-478,814,550.39	-262,365,473.49	-741,180,023.88
其中：1.基金申购款	2,766,051,667.81	1,304,293,694.49	4,070,345,362.30
2.基金赎回款	-3,244,866,218.20	-1,566,659,167.98	-4,811,525,386.18
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)	2,679,131,874.38	1,423,389,439.67	4,102,521,314.05
项目	上年度可比期间		
	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)	3,178,886,245.80	803,038,641.70	3,981,924,887.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,995,258,255.72	1,995,258,255.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-20,939,821.03	-254,698,466.00	-275,638,287.03
其中：1.基金申购款	5,075,913,707.99	4,034,714,944.25	9,110,628,652.24
2.基金赎回款	-5,096,853,529.02	-4,289,413,410.25	-9,386,266,939.27
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)	3,157,946,424.77	2,543,598,431.42	5,701,544,856.19

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

基金管理人负责人

徐超

主管会计工作负责人

徐超

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 2017 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(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》、《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、中国基金业协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 2016 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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、股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的基金投资、股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最

近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股票的股息、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 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	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
活期存款	227,730,372.51	312,791,396.95
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	227,730,372.51	312,791,396.95

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	143,776,262.74	141,785,533.20	-1,990,729.54
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	3,414,623,776.18	3,748,260,536.81	333,636,760.63
其他	-	-	-
合计	3,558,400,038.92	3,890,046,070.01	331,646,031.09

项目	上年度末		
	2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	105,984,833.46	104,562,309.34	-1,422,524.12
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	4,014,888,887.11	5,304,357,531.23	1,289,468,644.12
其他	-	-	-
合计	4,120,873,720.57	5,408,919,840.57	1,288,046,120.00

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

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	40,860.43	57,110.41
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	30.30	2,580.70
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	175.80	900.60
合计	41,066.53	60,591.71

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
应收目标ETF可退替代款	1,357,532.42	6,023,432.82
应收目标ETF应退替代款	-	3,287,204.52
合计	1,357,532.42	9,310,637.34

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	48,525.43	2,067,139.53
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	48,525.43	2,067,139.53

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	27,398.24	91,565.54

预提费用	406,000.00	103,000.00
合计	433,398.24	194,565.54

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,157,946,424.77	3,157,946,424.77
本期申购	2,766,051,667.81	2,766,051,667.81
本期赎回(以“-”号填列)	-3,244,866,218.20	-3,244,866,218.20
本期末	2,679,131,874.38	2,679,131,874.38

注：截至 2016 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 36,647,646.00 份（2015 年 12 月 31 日：32,689,049.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 2,642,484,228.38 份（2015 年 12 月 31 日：3,125,257,375.77 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	2,501,740,805.17	41,857,626.25	2,543,598,431.42
本期利润	98,556,570.65	-956,400,088.91	-857,843,518.26
本期基金份额交易产生的变动数	-382,919,761.29	120,554,287.80	-262,365,473.49
其中：基金申购款	2,202,798,476.18	-898,504,781.69	1,304,293,694.49
基金赎回款	-2,585,718,237.47	1,019,059,069.49	-1,566,659,167.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,217,377,614.53	-793,988,174.86	1,423,389,439.67

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	1,814,907.00	1,750,364.61
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	23,318.26	51,909.75
其他	98,972.60	76,308.89
合计	1,937,197.86	1,878,583.25

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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	9,664,241.51	59,581,953.23
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-19,100,160.28	7,337,846.71
合计	-9,435,918.77	66,919,799.94

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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	1,637,620,080.74	2,856,553,181.65

减：卖出股票成本总额	1,627,955,839.23	2,796,971,228.42
买卖股票差价收入	9,664,241.51	59,581,953.23

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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年 12月31日	2015年1月1日至2015年12 月31日
申购基金份额总额	985,585,000.00	3,706,324,200.00
减：现金支付申购款总额	546,158,128.59	2,075,863,401.72
减：申购股票成本总额	458,527,031.69	1,623,122,951.57
申购差价收入	-19,100,160.28	7,337,846.71

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12 月31日	2015年1月1日至2015年12 月31日
卖出/赎回基金成交总额	1,694,598,412.80	4,222,760,380.04
减：卖出/赎回基金成本总额	1,588,782,910.69	2,469,548,522.74
基金投资收益	105,815,502.11	1,753,211,857.30

7.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年 12月31日	2015年1月1日至2015年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	98,944.48	-
减：卖出债券（、债转股及	87,600.00	-

债券到期兑付) 成本总额		
减: 应收利息总额	9.13	-
买卖债券差价收入	11,335.35	-

7.4.7.15 衍生工具收益

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	267,141.94	601,068.30
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	267,141.94	601,068.30

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-956,400,088.91	174,152,856.41
——股票投资	-568,205.42	-1,745,690.75
——债券投资	-	-
——基金投资	-955,831,883.49	175,898,547.16
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-

3. 其他	-	-
合计	-956,400,088.91	174,152,856.41

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年 12月31日	2015年1月1日至2015年12 月31日
基金赎回费收入	5,725,297.74	8,826,882.07
合计	5,725,297.74	8,826,882.07

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

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12 月31日	2015年1月1日至2015年12月 31日
交易所市场交易费用	3,404,100.05	7,826,603.71
银行间市场交易费用	-	-
合计	3,404,100.05	7,826,603.71

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年 12月31日	2015年1月1日至2015年12 月31日
审计费用	106,000.00	103,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00

上市年费	60,000.00	60,000.00
银行汇划费	23,545.43	36,136.46
账户维护费	200.00	200.00
合计	489,745.43	499,336.46

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

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(“兴业证券”)	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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 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	949,374,048.64	31.91%	1,389,150,677.14	24.87%

7.4.10.1.2 权证交易

注：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。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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	94,947.24	6.56%	20,414.27	42.07%
关联方名称	上年度可比期间			
	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	457,238.73	10.57%	38,801.01	1.88%
------	------------	--------	-----------	-------

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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,605,369.35	1,672,376.11
其中：支付销售机构的客户维护费	4,475,515.23	5,051,560.26

注：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) × 0.5% / 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
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	321,073.85	334,475.27

注：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：

日托管费 = (前一日基金资产净值 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 0.1% / 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

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
基金合同生效日（2009年9月25日）持有的基金份额	0.00	0.00
期初持有的基金份额	52,873,972.73	38,304,604.31
期间申购/买入总份额	-	14,869,173.42
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	299,805.00
期末持有的基金份额	52,873,972.73	52,873,972.73
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.9700%	1.6700%

注：1. 基金管理人南方基金在上年度可比期间申购本基金的交易委托华泰证券办理，适用费率为每笔人民币 1,000.00 元。

2. 基金管理人南方基金在上年度可比期间非交易过户本基金的交易委托杭州数米网络科技有限公司办理，未产生手续费。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015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
华泰证券	-	-	179,549.11	0.0100%

注：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。

7.4.10.5 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	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015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	227,730,372.51	1,814,907.00	312,791,396.95	1,750,364.61

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

注：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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有 571,773,402 份目标 ETF 基金份额，占其份额的比例为 22.41%(于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有 675,473,402 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 25.91%)。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量（单 位：股）	期末成本总 额	期末估值总 额	备注
601375	中原	2016年12	2017年1	新股申	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-

	证券	月 20 日	月 3 日	购						
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股申购	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股申购	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股申购	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股申购	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
300591	万里马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股申购	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600687	刚泰控股	2016 年 7 月 25 日	重大资产重组	16.42	2017 年 1 月 18 日	16.38	68,000	1,116,560.00	1,116,560.00	-
600859	王府井	2016 年 9 月 27 日	重大资产重组	16.28	-	-	32,080	523,933.68	522,262.40	-
601168	西部矿业	2016 年 12 月 19 日	重大资产重组	7.83	-	-	48,100	371,637.93	376,623.00	-
002602	世纪华通	2016 年 12 月 15 日	重大事项	46.89	2017 年 1 月 9 日	50.00	7,800	304,933.03	365,742.00	-
600655	豫园商城	2016 年 12 月 20 日	重大事项未公告	11.42	-	-	29,300	326,534.97	334,606.00	-
002491	通鼎互联	2016 年 12 月 22 日	重大事项	15.54	2017 年 1 月 3 日	15.89	20,800	334,822.00	323,232.00	-

601005	重庆钢铁	2016年6月2日	重大资产重组	2.52	-	-	127,731	323,028.92	321,882.12	-
000887	中鼎股份	2016年11月18日	重大资产重组	25.94	2017年2月15日	23.99	10,900	260,690.24	282,746.00	-
600673	东阳光科	2016年11月15日	重大资产重组	7.29	-	-	31,000	201,395.57	225,990.00	-
000829	天音控股	2016年9月29日	重大事项	11.28	-	-	19,300	230,277.53	217,704.00	-
000748	长城信息	2016年11月1日	重大资产重组	20.31	-	-	10,432	214,353.40	211,873.92	-
000693	ST华泽	2016年3月1日	重大事项	12.50	-	-	16,900	250,450.70	211,250.00	-
600537	亿晶光电	2016年12月27日	重大事项未公告	7.43	2017年1月13日	8.17	27,200	201,536.88	202,096.00	-
600171	上海贝岭	2016年12月14日	重大事项未公告	14.05	2017年2月16日	14.90	13,600	201,740.85	191,080.00	-
000697	炼石有色	2016年11月17日	重大资产重组	23.51	-	-	8,000	185,837.25	188,080.00	-
002727	一心堂	2016年12月28日	重大事项	21.20	2017年1月5日	21.66	8,600	183,403.08	182,320.00	-
300088	长信科技	2016年9月12日	重大资产重组	15.80	-	-	11,100	162,532.25	175,380.00	-
000563	陕国投A	2016年10月14日	重大资产重组	7.48	2017年1月18日	6.73	23,300	140,920.13	174,284.00	-
000727	华东科技	2016年11月17日	重大资产重组	3.37	2017年2月15日	3.47	48,800	160,967.00	164,456.00	-

600151	航天 机电	2016 年 11 月 11 日	重大资 产重组	10.04	-	-	15,500	170,605.26	155,620.00	-
000050	深天 马 A	2016 年 9 月 12 日	重大资 产重组	18.82	2017 年 3 月 23 日	20.70	7,765	148,251.36	146,137.30	-
600645	中源 协和	2016 年 12 月 13 日	重大资 产重组	26.80	-	-	5,365	168,123.96	143,782.00	-
600161	天坛 生物	2016 年 12 月 6 日	重大资 产重组	39.40	2017 年 3 月 24 日	43.34	3,420	139,588.77	134,748.00	-
002400	省广 股份	2016 年 11 月 28 日	重大事 项	13.79	-	-	9,400	130,126.04	129,626.00	-
002681	奋达 科技	2016 年 12 月 19 日	重大资 产重组	12.93	-	-	9,400	126,669.76	121,542.00	-
002635	安洁 科技	2016 年 11 月 8 日	重大资 产重组	36.40	2017 年 2 月 8 日	33.50	2,800	93,476.66	101,920.00	-
002440	闰土 股份	2016 年 10 月 21 日	重大资 产重组	16.34	2017 年 1 月 12 日	15.22	6,000	93,630.00	98,040.00	-
002025	航天 电器	2016 年 9 月 12 日	重大资 产重组	25.20	-	-	3,500	83,850.27	88,200.00	-
002396	星网 锐捷	2016 年 9 月 12 日	重大事 项未公 告	19.70	2017 年 2 月 21 日	18.35	4,450	84,870.38	87,665.00	-
603555	贵人 鸟	2016 年 12 月 12 日	重大资 产重组	30.76	-	-	2,100	59,749.19	64,596.00	-
600551	时代 出版	2016 年 11 月 28 日	重大资 产重组	20.32	-	-	2,100	42,253.11	42,672.00	-
603169	兰石 重装	2016 年 11 月 24 日	重大资 产重组	13.36	2017 年 3 月 21 日	14.32	3,062	39,993.09	40,908.32	-

注：1. 根据长城信息产业股份有限公司(以下简称“长城信息”)于 2016 年 10 月 25 日公布的《关于中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并公司事宜的提示性公告》和中国长城计算机深圳股份有限公司(以下简称“长城电脑”)于 2017 年 1 月 20 日公布的《中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并长城信息产业股份有限公司及重大资产置换和发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易报告书(修订稿)》，长城电脑将向长城信息全体股东发行 A 股股票，以换股比例 1:0.5424 取得长城信息股东持有的长城信息全部股票，吸收合并长城信息；长城信息自 2016 年 11 月 1 日起连续停牌。换股合并后新增的长城电脑股票于 2017 年 1 月 18 日上市流通，当日开盘单价为 10.63 元。长城信息人民币普通股股票自 2017 年 1 月 18 日起终止上市并摘牌。

2. 本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末及上年度末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末及上年度末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2015 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，以合理的价格适时变现。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有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 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	227,730,372.51	-	-	-	227,730,372.51

结算备付金	67,344.58	-	-	-	67,344.58
存出保证金	390,712.97	-	-	-	390,712.97
交易性金融资产	-	-	-	3,890,046,070.01	3,890,046,070.01
应收利息	-	-	-	41,066.53	41,066.53
应收股利	-	-	-	1,691.14	1,691.14
应收申购款	860,312.87	-	-	3,515,793.00	4,376,105.87
其他资产	-	-	-	1,357,532.42	1,357,532.42
资产总计	229,048,742.93	-	-	3,894,962,153.10	4,124,010,896.03
负债					
应付证券清算款	-	-	-	13,316,293.47	13,316,293.47
应付赎回款	-	-	-	7,536,613.81	7,536,613.81
应付管理人报酬	-	-	-	128,959.19	128,959.19
应付托管费	-	-	-	25,791.84	25,791.84
应付交易费用	-	-	-	48,525.43	48,525.43
其他负债	-	-	-	433,398.24	433,398.24
负债总计	-	-	-	21,489,581.98	21,489,581.98
利率敏感度缺口	229,048,742.93	-	-	3,873,472,571.12	4,102,521,314.05
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	312,791,396.95	-	-	-	312,791,396.95
结算备付金	5,734,853.96	-	-	-	5,734,853.96
存出保证金	2,001,495.02	-	-	-	2,001,495.02
交易性金融资产	-	-	-	5,408,919,840.57	5,408,919,840.57
应收证券清算款	-	-	-	534,124.80	534,124.80
应收利息	-	-	-	60,591.71	60,591.71
应收股利	-	-	-	1,691.14	1,691.14
应收申购款	18,663,416.49	-	-	1,479,660.26	20,143,076.75
其他资产	-	-	-	9,310,637.34	9,310,637.34

资产总计	339,191,162.42	-	-	-5,420,306,545.82	5,759,497,708.24
负债					
应付证券清算款	-	-	-	30,657,468.08	30,657,468.08
应付赎回款	-	-	-	24,812,569.23	24,812,569.23
应付管理人报酬	-	-	-	184,258.05	184,258.05
应付托管费	-	-	-	36,851.62	36,851.62
应付交易费用	-	-	-	2,067,139.53	2,067,139.53
其他负债	-	-	-	194,565.54	194,565.54
负债总计	-	-	-	57,952,852.05	57,952,852.05
利率敏感度缺口	339,191,162.42	-	-	-5,362,353,693.77	5,701,544,856.19

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 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（2015 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 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 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	141,785,533.20	3.46	104,562,309.34	1.83
交易性金融资产-基金投资	3,748,260,536.81	91.36	5,304,357,531.23	93.03
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,890,046,070.01	94.82	5,408,919,840.57	94.86

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	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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(2016年12月31日)	上年度末(2015年12月31日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 20,275.00	增加约 27,203.00
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 20,275.00	减少约 27,203.00	

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 2016 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 3,882,674,106.74 元，属于第二层次的余额为 7,371,963.27 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 5,395,924,178.14 元，第二层次 12,995,662.43 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，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 2016 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(2015 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	141,785,533.20	3.44
	其中：股票	141,785,533.20	3.44
2	基金投资	3,748,260,536.81	90.89
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	227,797,717.09	5.52
8	其他各项资产	6,167,108.93	0.15
9	合计	4,124,010,896.03	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	1,886,904.24	0.05
B	采矿业	5,339,312.22	0.13
C	制造业	87,582,389.26	2.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,497,506.37	0.11
E	建筑业	4,148,442.85	0.10

F	批发和零售业	8,697,456.99	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	4,197,042.80	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,727,946.32	0.21
J	金融业	1,164,553.00	0.03
K	房地产业	9,165,580.42	0.22
L	租赁和商务服务业	1,733,162.09	0.04
M	科学研究和技术服务业	256,936.37	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	687,336.76	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	68,629.00	0.00
Q	卫生和社会工作	402,464.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,942,660.53	0.05
S	综合	1,287,209.98	0.03
	合计	141,785,533.20	3.46

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	600687	刚泰控股	68,000	1,116,560.00	0.03
2	000656	金科股份	141,900	743,556.00	0.02
3	600201	生物股份	23,250	734,467.50	0.02
4	600522	中天科技	69,300	729,729.00	0.02
5	300136	信维通信	25,500	726,750.00	0.02
6	600682	南京新百	18,800	700,676.00	0.02
7	600525	长园集团	49,933	696,565.35	0.02
8	600584	长电科技	39,300	693,645.00	0.02

9	600079	人福医药	34,112	680,534.40	0.02
10	600643	爱建集团	54,500	676,345.00	0.02
11	600219	南山铝业	210,450	650,290.50	0.02
12	002405	四维图新	32,300	625,005.00	0.02
13	600487	亨通光电	32,900	613,914.00	0.01
14	601012	隆基股份	45,100	603,889.00	0.01
15	600158	中体产业	25,600	603,392.00	0.01
16	002092	中泰化学	48,800	590,480.00	0.01
17	000661	长春高新	5,200	581,620.00	0.01
18	300156	神雾环保	23,000	575,230.00	0.01
19	002572	索菲亚	10,500	568,680.00	0.01
20	600315	上海家化	20,400	553,044.00	0.01
21	600166	福田汽车	177,000	546,930.00	0.01
22	300266	兴源环境	9,690	531,787.20	0.01
23	300115	长盈精密	20,390	531,363.40	0.01
24	002366	台海核电	9,900	530,838.00	0.01
25	002460	赣锋锂业	20,000	530,200.00	0.01
26	002422	科伦药业	32,800	528,736.00	0.01
27	600521	华海药业	23,758	523,388.74	0.01
28	600859	王府井	32,080	522,262.40	0.01
29	600436	片仔癀	11,400	522,006.00	0.01
30	002407	多氟多	19,050	519,874.50	0.01
31	600699	均胜电子	15,700	519,513.00	0.01
32	300296	利亚德	15,400	519,288.00	0.01
33	000998	隆平高科	23,800	510,034.00	0.01
34	002508	老板电器	13,850	509,680.00	0.01
35	002340	格林美	77,234	505,882.70	0.01
36	600503	华丽家族	60,700	503,203.00	0.01

37	000581	威孚高科	22,200	498,168.00	0.01
38	002168	深圳惠程	31,300	496,418.00	0.01
39	600664	哈药股份	57,821	496,104.18	0.01
40	300026	红日药业	91,300	495,759.00	0.01
41	600879	航天电子	32,400	493,776.00	0.01
42	000930	中粮生化	36,600	491,904.00	0.01
43	002004	华邦健康	54,000	489,780.00	0.01
44	000997	新大陆	24,940	484,584.20	0.01
45	002439	启明星辰	23,068	479,583.72	0.01
46	600978	宜华生活	45,000	479,250.00	0.01
47	600266	北京城建	35,600	474,548.00	0.01
48	600614	鼎立股份	40,100	469,170.00	0.01
49	002176	江特电机	39,000	465,270.00	0.01
50	002701	奥瑞金	53,600	463,104.00	0.01
51	600500	中化国际	39,519	460,791.54	0.01
52	600143	金发科技	59,200	460,576.00	0.01
53	600138	中青旅	21,957	460,438.29	0.01
54	600497	驰宏锌锗	65,394	459,719.82	0.01
55	000690	宝新能源	49,500	458,865.00	0.01
56	002030	达安基因	19,224	445,996.80	0.01
57	002013	中航机电	24,315	444,721.35	0.01
58	600635	大众公用	73,500	441,735.00	0.01
59	000961	中南建设	42,200	438,880.00	0.01
60	002311	海大集团	29,160	438,858.00	0.01
61	600426	华鲁恒升	33,100	438,575.00	0.01
62	002271	东方雨虹	20,112	436,229.28	0.01
63	000970	中科三环	32,300	431,205.00	0.01
64	600122	宏图高科	34,900	426,478.00	0.01

65	002573	清新环境	24,208	422,913.76	0.01
66	300253	卫宁健康	21,580	422,752.20	0.01
67	300324	旋极信息	21,800	421,394.00	0.01
68	600759	洲际油气	42,900	421,278.00	0.01
69	300113	顺网科技	15,500	416,795.00	0.01
70	002038	双鹭药业	15,600	416,676.00	0.01
71	000400	许继电气	22,900	415,635.00	0.01
72	002179	中航光电	11,444	415,302.76	0.01
73	600418	江淮汽车	35,900	415,004.00	0.01
74	600565	迪马股份	55,000	408,100.00	0.01
75	600751	天海投资	48,800	407,968.00	0.01
76	600240	华业资本	37,772	405,671.28	0.01
77	002001	新和成	20,600	403,760.00	0.01
78	300244	迪安诊断	12,577	402,464.00	0.01
79	600312	平高电气	25,700	401,434.00	0.01
80	600388	龙净环保	32,400	400,788.00	0.01
81	002273	水晶光电	20,100	399,990.00	0.01
82	600594	益佰制药	24,000	399,600.00	0.01
83	000959	首钢股份	60,200	398,524.00	0.01
84	000806	银河生物	25,000	396,000.00	0.01
85	000012	南玻 A	34,800	394,632.00	0.01
86	002665	首航节能	44,800	392,448.00	0.01
87	002223	鱼跃医疗	12,644	392,216.88	0.01
88	000598	兴蓉环境	67,900	391,104.00	0.01
89	600811	东方集团	54,212	387,615.80	0.01
90	002217	合力泰	21,600	386,640.00	0.01
91	000566	海南海药	30,400	386,384.00	0.01
92	600056	中国医药	20,273	385,795.19	0.01

93	000975	银泰资源	24,600	384,744.00	0.01
94	600094	大名城	43,200	384,480.00	0.01
95	300159	新研股份	28,300	384,314.00	0.01
96	000939	凯迪生态	29,800	383,526.00	0.01
97	600601	方正科技	83,200	382,720.00	0.01
98	600528	中铁二局	27,700	381,152.00	0.01
99	002221	东华能源	30,700	380,373.00	0.01
100	000878	云南铜业	32,200	380,282.00	0.01
101	000078	海王生物	60,207	379,304.10	0.01
102	600787	中储股份	41,700	378,219.00	0.01
103	600881	亚泰集团	69,000	377,430.00	0.01
104	300055	万邦达	23,000	376,740.00	0.01
105	601168	西部矿业	48,100	376,623.00	0.01
106	002410	广联达	25,500	372,300.00	0.01
107	600198	大唐电信	23,400	371,358.00	0.01
108	000988	华工科技	23,700	370,905.00	0.01
109	600200	江苏吴中	19,200	370,752.00	0.01
110	002408	齐翔腾达	33,620	369,820.00	0.01
111	002353	杰瑞股份	18,200	369,460.00	0.01
112	600478	科力远	36,900	369,000.00	0.01
113	000031	中粮地产	41,300	368,396.00	0.01
114	600435	北方导航	28,200	367,728.00	0.01
115	300134	大富科技	14,500	367,720.00	0.01
116	603589	口子窖	11,400	366,282.00	0.01
117	000960	锡业股份	27,900	366,048.00	0.01
118	000999	华润三九	14,800	366,004.00	0.01
119	002602	世纪华通	7,800	365,742.00	0.01
120	601699	潞安环能	45,400	365,470.00	0.01

121	000612	焦作万方	31,600	364,980.00	0.01
122	600410	华胜天成	33,480	363,927.60	0.01
123	600176	中国巨石	36,926	363,351.84	0.01
124	002191	劲嘉股份	34,900	363,309.00	0.01
125	600755	厦门国贸	44,200	362,440.00	0.01
126	600516	方大炭素	39,100	362,066.00	0.01
127	600851	海欣股份	28,000	362,040.00	0.01
128	600549	厦门钨业	16,400	361,128.00	0.01
129	000979	中弘股份	136,320	359,884.80	0.01
130	002250	联化科技	22,127	358,014.86	0.01
131	000758	中色股份	44,800	357,952.00	0.01
132	000667	美好置业	97,000	357,930.00	0.01
133	300273	和佳股份	20,900	356,554.00	0.01
134	002048	宁波华翔	16,100	356,454.00	0.01
135	600026	中远海能	51,900	353,439.00	0.01
136	002018	华信国际	34,500	350,865.00	0.01
137	000488	晨鸣纸业	33,730	349,442.80	0.01
138	000786	北新建材	33,950	349,345.50	0.01
139	600572	康恩贝	47,600	347,956.00	0.01
140	600633	浙报传媒	19,700	347,902.00	0.01
141	600098	广州发展	31,000	347,820.00	0.01
142	601000	唐山港	86,380	346,383.80	0.01
143	601929	吉视传媒	82,600	346,094.00	0.01
144	600064	南京高科	20,500	343,375.00	0.01
145	600575	皖江物流	59,300	340,975.00	0.01
146	000825	太钢不锈	86,400	340,416.00	0.01
147	600325	华发股份	26,571	340,108.80	0.01
148	603019	中科曙光	12,200	339,404.00	0.01

149	600967	北方创业	25,000	339,250.00	0.01
150	600863	内蒙华电	110,100	339,108.00	0.01
151	600160	巨化股份	32,000	338,560.00	0.01
152	000006	深振业A	35,800	338,310.00	0.01
153	600108	亚盛集团	59,100	338,052.00	0.01
154	600655	豫园商城	29,300	334,606.00	0.01
155	000860	顺鑫农业	15,184	334,048.00	0.01
156	603766	隆鑫通用	16,050	333,519.00	0.01
157	600120	浙江东方	11,500	332,580.00	0.01
158	002657	中科金财	7,700	332,332.00	0.01
159	600409	三友化工	35,100	329,589.00	0.01
160	600511	国药股份	10,942	329,354.20	0.01
161	002544	杰赛科技	11,700	329,238.00	0.01
162	601880	大连港	117,360	328,608.00	0.01
163	600039	四川路桥	68,740	325,827.60	0.01
164	600307	酒钢宏兴	118,700	324,051.00	0.01
165	300287	飞利信	27,200	323,680.00	0.01
166	600499	科达洁能	42,800	323,568.00	0.01
167	002491	通鼎互联	20,800	323,232.00	0.01
168	002375	亚厦股份	30,500	322,690.00	0.01
169	601005	重庆钢铁	127,731	321,882.12	0.01
170	002051	中工国际	14,040	321,796.80	0.01
171	002276	万马股份	21,400	321,642.00	0.01
172	002078	太阳纸业	48,100	321,308.00	0.01
173	600316	洪都航空	16,300	320,458.00	0.01
174	002672	东江环保	18,200	320,320.00	0.01
175	600808	马钢股份	113,101	320,075.83	0.01
176	002595	豪迈科技	15,200	319,960.00	0.01

177	002019	亿帆医药	20,900	319,561.00	0.01
178	600717	天津港	31,700	319,536.00	0.01
179	002390	信邦制药	32,300	319,447.00	0.01
180	600022	山东钢铁	127,700	319,250.00	0.01
181	002444	巨星科技	20,400	318,240.00	0.01
182	000513	丽珠集团	5,340	317,730.00	0.01
183	600416	湘电股份	21,500	316,265.00	0.01
184	002384	东山精密	16,100	315,721.00	0.01
185	002281	光迅科技	4,000	314,000.00	0.01
186	600466	蓝光发展	32,400	313,308.00	0.01
187	300199	翰宇药业	17,400	312,852.00	0.01
188	000028	国药一致	4,675	312,757.50	0.01
189	002155	湖南黄金	27,300	312,585.00	0.01
190	002489	浙江永强	41,250	312,262.50	0.01
191	000066	长城电脑	25,100	312,244.00	0.01
192	600600	青岛啤酒	10,600	312,064.00	0.01
193	600611	大众交通	47,400	311,418.00	0.01
194	000089	深圳机场	38,900	311,200.00	0.01
195	000685	中山公用	27,960	311,194.80	0.01
196	002022	科华生物	15,500	310,000.00	0.01
197	000543	皖能电力	40,720	309,879.20	0.01
198	600587	新华医疗	12,300	308,853.00	0.01
199	002268	卫士通	9,800	307,916.00	0.01
200	600348	阳泉煤业	45,600	306,888.00	0.01
201	600770	综艺股份	29,600	306,360.00	0.01
202	600062	华润双鹤	13,722	305,040.06	0.01
203	600597	光明乳业	23,321	304,572.26	0.01
204	000401	冀东水泥	25,560	304,164.00	0.01

205	002266	浙富控股	52,500	302,400.00	0.01
206	002261	拓维信息	25,300	301,576.00	0.01
207	002050	三花智控	27,300	301,392.00	0.01
208	600183	生益科技	27,300	300,300.00	0.01
209	600884	杉杉股份	21,300	299,904.00	0.01
210	300122	智飞生物	18,200	299,754.00	0.01
211	600380	健康元	30,100	298,893.00	0.01
212	002640	跨境通	16,300	298,290.00	0.01
213	002477	雏鹰农牧	59,400	298,188.00	0.01
214	600187	国中水务	55,200	297,528.00	0.01
215	600872	中炬高新	21,100	297,088.00	0.01
216	000592	平潭发展	43,900	296,764.00	0.01
217	600300	维维股份	44,400	296,592.00	0.01
218	002603	以岭药业	17,100	294,804.00	0.01
219	000519	江南红箭	19,600	292,040.00	0.01
220	600366	宁波韵升	14,800	291,412.00	0.01
221	600267	海正药业	22,000	289,300.00	0.01
222	002373	千方科技	20,900	288,420.00	0.01
223	002431	棕榈股份	31,300	286,708.00	0.01
224	002122	天马股份	22,500	285,525.00	0.01
225	600392	盛和资源	21,400	285,262.00	0.01
226	600073	上海梅林	24,900	285,105.00	0.01
227	002308	威创股份	19,300	284,482.00	0.01
228	600067	冠城大通	39,600	283,536.00	0.01
229	600017	日照港	70,000	283,500.00	0.01
230	600970	中材国际	39,900	282,891.00	0.01
231	000887	中鼎股份	10,900	282,746.00	0.01
232	002073	软控股份	24,863	282,195.05	0.01

233	600422	昆药集团	20,884	282,142.84	0.01
234	300274	阳光电源	26,680	281,207.20	0.01
235	600125	铁龙物流	34,600	279,568.00	0.01
236	600086	东方金钰	25,600	278,528.00	0.01
237	600298	安琪酵母	15,600	277,992.00	0.01
238	600216	浙江医药	21,900	277,692.00	0.01
239	600651	飞乐音响	26,300	276,939.00	0.01
240	600284	浦东建设	20,973	276,633.87	0.01
241	000703	恒逸石化	18,400	276,552.00	0.01
242	600557	康缘药业	16,320	276,297.60	0.01
243	000810	创维数字	19,600	275,772.00	0.01
244	002437	誉衡药业	33,300	275,391.00	0.01
245	000926	福星股份	21,600	275,184.00	0.01
246	300010	立思辰	16,500	274,230.00	0.01
247	300291	华录百纳	12,300	274,044.00	0.01
248	600169	太原重工	68,000	274,040.00	0.01
249	600260	凯乐科技	17,700	273,996.00	0.01
250	000816	智慧农业	43,000	273,480.00	0.01
251	600536	中国软件	11,300	271,878.00	0.01
252	002512	达华智能	16,600	271,078.00	0.01
253	000937	冀中能源	40,200	270,948.00	0.01
254	002358	森源电气	14,058	269,632.44	0.01
255	002002	鸿达兴业	36,700	269,378.00	0.01
256	000418	小天鹅A	8,328	269,160.96	0.01
257	000762	西藏矿业	15,800	269,074.00	0.01
258	600175	美都能源	54,200	268,290.00	0.01
259	002479	富春环保	18,100	268,242.00	0.01
260	600694	大商股份	6,700	267,531.00	0.01

261	601801	皖新传媒	15,100	265,307.00	0.01
262	601231	环旭电子	24,700	264,537.00	0.01
263	000021	深科技	27,900	263,097.00	0.01
264	601311	骆驼股份	16,100	262,913.00	0.01
265	002028	思源电气	19,918	262,519.24	0.01
266	300001	特锐德	15,088	261,625.92	0.01
267	000777	中核科技	11,600	259,608.00	0.01
268	002399	海普瑞	14,200	258,724.00	0.01
269	300166	东方国信	12,400	257,796.00	0.01
270	601010	文峰股份	49,000	257,740.00	0.01
271	601717	郑煤机	36,600	257,298.00	0.01
272	002325	洪涛股份	31,910	255,599.10	0.01
273	300202	聚龙股份	10,368	255,052.80	0.01
274	600880	博瑞传播	29,000	254,040.00	0.01
275	600765	中航重机	17,700	253,641.00	0.01
276	002503	搜于特	17,600	253,264.00	0.01
277	002041	登海种业	13,300	251,104.00	0.01
278	600517	置信电气	25,700	250,061.00	0.01
279	600545	新疆城建	20,500	249,280.00	0.01
280	000848	承德露露	22,260	249,089.40	0.01
281	002707	众信旅游	16,000	248,800.00	0.01
282	600058	五矿发展	16,300	248,249.00	0.01
283	002123	梦网荣信	16,300	244,500.00	0.01
284	600673	东阳光科	31,000	225,990.00	0.01
285	000829	天音控股	19,300	217,704.00	0.01
286	600809	山西汾酒	8,600	215,172.00	0.01
287	002244	滨江集团	30,800	214,984.00	0.01
288	600736	苏州高新	23,700	214,011.00	0.01

289	001696	宗申动力	22,700	213,380.00	0.01
290	000620	新华联	25,100	212,848.00	0.01
291	600259	广晟有色	5,000	212,450.00	0.01
292	000748	长城信息	10,432	211,873.92	0.01
293	000693	ST 华泽	16,900	211,250.00	0.01
294	002581	未名医药	8,700	211,149.00	0.01
295	002063	远光软件	16,063	211,067.82	0.01
296	002589	瑞康医药	6,500	210,925.00	0.01
297	000600	建投能源	23,700	210,456.00	0.01
298	002368	太极股份	6,862	210,045.82	0.01
299	000158	常山股份	16,800	210,000.00	0.01
300	002106	莱宝高科	18,620	209,288.80	0.01
301	002269	美邦服饰	41,750	209,167.50	0.01
302	600835	上海机电	10,700	208,864.00	0.01
303	000587	金洲慈航	14,000	208,320.00	0.01
304	600639	浦东金桥	11,200	207,872.00	0.01
305	600291	西水股份	10,800	207,144.00	0.01
306	002285	世联行	27,000	205,200.00	0.01
307	600220	江苏阳光	47,100	204,414.00	0.00
308	603077	和邦生物	39,800	203,776.00	0.00
309	000572	海马汽车	37,991	203,631.76	0.00
310	603188	亚邦股份	11,400	203,604.00	0.00
311	600282	南钢股份	65,400	202,740.00	0.00
312	600433	冠豪高新	25,200	202,104.00	0.00
313	600537	亿晶光电	27,200	202,096.00	0.00
314	000636	风华高科	20,700	202,032.00	0.00
315	000062	深圳华强	7,100	201,711.00	0.00
316	600481	双良节能	26,800	201,536.00	0.00

317	002277	友阿股份	14,000	201,040.00	0.00
318	002354	天神娱乐	2,900	200,564.00	0.00
319	601678	滨化股份	27,500	200,475.00	0.00
320	002317	众生药业	16,200	200,070.00	0.00
321	600993	马应龙	9,995	199,600.15	0.00
322	601777	力帆股份	20,762	198,484.72	0.00
323	600270	外运发展	12,000	198,480.00	0.00
324	600053	九鼎投资	4,300	198,058.00	0.00
325	300147	香雪制药	15,310	197,499.00	0.00
326	000616	海航投资	37,800	197,316.00	0.00
327	002161	远望谷	17,100	197,163.00	0.00
328	002663	普邦股份	32,400	196,668.00	0.00
329	600277	亿利洁能	27,600	196,236.00	0.00
330	600894	广日股份	14,200	194,114.00	0.00
331	300257	开山股份	11,300	193,908.00	0.00
332	600580	卧龙电气	21,300	193,830.00	0.00
333	300297	蓝盾股份	15,500	192,820.00	0.00
334	002505	大康农业	54,400	192,576.00	0.00
335	000669	金鸿能源	11,196	192,011.40	0.00
336	000973	佛塑科技	25,600	192,000.00	0.00
337	002428	云南锗业	15,143	191,861.81	0.00
338	002344	海宁皮城	16,900	191,308.00	0.00
339	000501	鄂武商 A	9,800	191,296.00	0.00
340	600171	上海贝岭	13,600	191,080.00	0.00
341	600805	悦达投资	22,502	191,041.98	0.00
342	000541	佛山照明	19,400	190,896.00	0.00
343	000090	天健集团	19,760	190,881.60	0.00
344	000528	柳工	26,055	190,462.05	0.00

345	002482	广田集团	20,527	189,874.75	0.00
346	600729	重庆百货	8,100	189,783.00	0.00
347	000726	鲁泰 A	14,800	189,588.00	0.00
348	000830	鲁西化工	33,910	189,556.90	0.00
349	002498	汉缆股份	44,000	189,200.00	0.00
350	600289	亿阳信通	14,610	189,199.50	0.00
351	002056	横店东磁	13,600	189,176.00	0.00
352	600826	兰生股份	6,900	188,508.00	0.00
353	002690	美亚光电	8,900	188,324.00	0.00
354	601689	拓普集团	6,400	188,288.00	0.00
355	000652	泰达股份	34,100	188,232.00	0.00
356	000697	炼石有色	8,000	188,080.00	0.00
357	600458	时代新材	13,266	187,713.90	0.00
358	600823	世茂股份	26,550	186,381.00	0.00
359	002005	德豪润达	32,340	185,955.00	0.00
360	002128	露天煤业	21,600	185,760.00	0.00
361	002463	沪电股份	38,700	184,986.00	0.00
362	600112	天成控股	16,800	184,464.00	0.00
363	600596	新安股份	17,900	183,296.00	0.00
364	000897	津滨发展	42,700	182,756.00	0.00
365	002727	一心堂	8,600	182,320.00	0.00
366	002190	成飞集成	5,700	182,286.00	0.00
367	002064	华峰氨纶	33,200	182,268.00	0.00
368	002242	九阳股份	10,100	182,103.00	0.00
369	600750	江中药业	5,900	181,838.00	0.00
370	600006	东风汽车	26,400	181,632.00	0.00
371	000680	山推股份	32,800	181,384.00	0.00
372	600628	新世界	12,813	181,047.69	0.00

373	000861	海印股份	37,190	180,371.50	0.00
374	600141	兴发集团	11,800	179,478.00	0.00
375	600351	亚宝药业	18,164	179,460.32	0.00
376	000969	安泰科技	16,900	178,126.00	0.00
377	000681	视觉中国	9,300	177,258.00	0.00
378	600395	盘江股份	21,900	176,733.00	0.00
379	300088	长信科技	11,100	175,380.00	0.00
380	601233	桐昆股份	12,200	175,192.00	0.00
381	000563	陕国投A	23,300	174,284.00	0.00
382	002254	泰和新材	14,100	174,276.00	0.00
383	002588	史丹利	15,354	174,267.90	0.00
384	600790	轻纺城	24,200	174,240.00	0.00
385	600428	中远海特	28,400	173,808.00	0.00
386	300032	金龙机电	10,800	173,772.00	0.00
387	002011	盾安环境	18,200	173,264.00	0.00
388	600773	西藏城投	14,500	172,985.00	0.00
389	000596	古井贡酒	3,800	172,900.00	0.00
390	000049	德赛电池	4,100	172,405.00	0.00
391	000552	靖远煤电	45,300	171,687.00	0.00
392	600496	精工钢构	39,960	171,028.80	0.00
393	600869	智慧能源	22,000	170,280.00	0.00
394	603198	迎驾贡酒	7,900	170,245.00	0.00
395	002699	美盛文化	5,000	169,000.00	0.00
396	600862	中航高科	13,800	168,912.00	0.00
397	002642	荣之联	8,400	168,840.00	0.00
398	601001	大同煤业	27,600	168,636.00	0.00
399	002345	潮宏基	13,940	168,395.20	0.00
400	300039	上海凯宝	16,400	167,772.00	0.00

401	600720	祁连山	20,500	167,485.00	0.00
402	600850	华东电脑	6,910	167,083.80	0.00
403	300043	星辉娱乐	16,400	166,296.00	0.00
404	600757	长江传媒	20,000	166,200.00	0.00
405	600563	法拉电子	4,500	165,015.00	0.00
406	000727	华东科技	48,800	164,456.00	0.00
407	000099	中信海直	14,000	163,940.00	0.00
408	600329	中新药业	9,400	163,936.00	0.00
409	600059	古越龙山	16,000	163,840.00	0.00
410	600280	中央商场	19,000	163,590.00	0.00
411	603883	老百姓	3,500	163,275.00	0.00
412	603369	今世缘	12,400	162,688.00	0.00
413	002371	七星电子	6,100	162,260.00	0.00
414	000869	张裕 A	4,500	162,000.00	0.00
415	601886	江河集团	15,200	161,880.00	0.00
416	600292	远达环保	12,900	159,573.00	0.00
417	002093	国脉科技	14,300	158,301.00	0.00
418	600831	广电网络	12,000	156,720.00	0.00
419	600586	金晶科技	33,700	156,031.00	0.00
420	002332	仙琚制药	12,100	155,727.00	0.00
421	600151	航天机电	15,500	155,620.00	0.00
422	000417	合肥百货	18,000	155,340.00	0.00
423	600657	信达地产	25,200	153,720.00	0.00
424	600460	士兰微	24,700	153,634.00	0.00
425	002342	巨力索具	22,200	153,402.00	0.00
426	002029	七匹狼	15,000	153,150.00	0.00
427	600195	中牧股份	7,100	150,875.00	0.00
428	000931	中关村	17,800	150,766.00	0.00

429	002309	中利科技	10,592	150,512.32	0.00
430	002416	爱施德	10,200	150,246.00	0.00
431	000426	兴业矿业	17,200	149,984.00	0.00
432	600825	新华传媒	17,237	149,789.53	0.00
433	600748	上实发展	18,250	149,467.50	0.00
434	601002	晋亿实业	15,700	149,464.00	0.00
435	002551	尚荣医疗	7,379	146,915.89	0.00
436	000050	深天马 A	7,765	146,137.30	0.00
437	000877	天山股份	20,400	143,820.00	0.00
438	600645	中源协和	5,365	143,782.00	0.00
439	600640	号百控股	7,100	141,858.00	0.00
440	002414	高德红外	6,200	141,236.00	0.00
441	601908	京运通	19,800	140,976.00	0.00
442	002251	步步高	8,559	140,795.55	0.00
443	002698	博实股份	9,010	140,285.70	0.00
444	600743	华远地产	30,990	137,905.50	0.00
445	600180	瑞茂通	10,098	136,726.92	0.00
446	600776	东方通信	15,800	135,248.00	0.00
447	000919	金陵药业	9,963	134,799.39	0.00
448	600161	天坛生物	3,420	134,748.00	0.00
449	603528	多伦科技	2,000	130,700.00	0.00
450	002400	省广股份	9,400	129,626.00	0.00
451	600425	青松建化	27,322	127,047.30	0.00
452	600251	冠农股份	15,600	126,516.00	0.00
453	603806	福斯特	2,700	124,929.00	0.00
454	600801	华新水泥	16,100	124,775.00	0.00
455	600338	西藏珠峰	4,300	124,614.00	0.00
456	600335	国机汽车	10,213	124,087.95	0.00

457	002327	富安娜	14,100	124,080.00	0.00
458	002118	紫鑫药业	16,906	121,723.20	0.00
459	002681	奋达科技	9,400	121,542.00	0.00
460	603001	奥康国际	5,300	121,370.00	0.00
461	601016	节能风电	13,700	121,245.00	0.00
462	603355	莱克电气	2,600	120,042.00	0.00
463	600864	哈投股份	10,400	118,768.00	0.00
464	000631	顺发恒业	24,140	118,286.00	0.00
465	600397	安源煤业	22,900	118,164.00	0.00
466	600874	创业环保	14,369	116,819.97	0.00
467	002315	焦点科技	1,900	114,551.00	0.00
468	002392	北京利尔	19,800	114,048.00	0.00
469	600483	福能股份	10,300	114,021.00	0.00
470	002646	青青稞酒	5,900	113,575.00	0.00
471	603698	航天工程	4,100	113,119.00	0.00
472	603005	晶方科技	3,700	111,148.00	0.00
473	603567	珍宝岛	5,600	110,656.00	0.00
474	000517	荣安地产	21,000	110,460.00	0.00
475	002233	塔牌集团	11,800	110,330.00	0.00
476	600618	氯碱化工	7,400	107,966.00	0.00
477	600184	光电股份	5,000	107,900.00	0.00
478	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.00
479	603328	依顿电子	3,300	105,534.00	0.00
480	603568	伟明环保	4,500	104,850.00	0.00
481	600971	恒源煤电	16,512	103,530.24	0.00
482	000723	美锦能源	6,800	102,816.00	0.00
483	002635	安洁科技	2,800	101,920.00	0.00
484	002249	大洋电机	11,700	100,971.00	0.00

485	000025	特力 A	1,800	99,486.00	0.00
486	002440	闰土股份	6,000	98,040.00	0.00
487	002194	武汉凡谷	7,500	96,450.00	0.00
488	600088	中视传媒	4,400	96,448.00	0.00
489	600468	百利电气	7,100	92,442.00	0.00
490	002238	天威视讯	6,100	89,365.00	0.00
491	002025	航天电器	3,500	88,200.00	0.00
492	002396	星网锐捷	4,450	87,665.00	0.00
493	600917	重庆燃气	5,700	75,183.00	0.00
494	603868	飞科电器	1,600	74,976.00	0.00
495	600981	汇鸿集团	8,100	68,769.00	0.00
496	603377	东方时尚	1,700	68,629.00	0.00
497	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.00
498	603866	桃李面包	1,500	65,850.00	0.00
499	603555	贵人鸟	2,100	64,596.00	0.00
500	603025	大豪科技	1,600	62,448.00	0.00
501	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
502	000761	本钢板材	9,900	53,262.00	0.00
503	600551	时代出版	2,100	42,672.00	0.00
504	603169	兰石重装	3,062	40,908.32	0.00
505	603239	N 仙通	924	29,059.80	0.00
506	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
507	002837	英维克	500	14,255.00	0.00
508	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
509	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
510	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
511	603858	步长制药	70	6,671.00	0.00
512	603559	中通国脉	99	5,335.11	0.00

513	300558	贝达药业	72	5,313.60	0.00
514	002818	富森美	82	4,809.30	0.00
515	002819	东方中科	93	4,427.73	0.00
516	603819	神力股份	98	3,900.40	0.00
517	603336	宏辉果蔬	71	3,341.97	0.00
518	300565	科信技术	82	3,253.76	0.00
519	603033	三维股份	60	3,094.20	0.00
520	603585	苏利股份	41	2,858.52	0.00
521	002822	中装建设	97	2,802.33	0.00
522	603633	徕木股份	58	2,378.58	0.00
523	300072	三聚环保	50	2,314.50	0.00
524	002823	凯中精密	47	2,171.40	0.00
525	002826	易明医药	81	2,128.68	0.00
526	600498	烽火通信	80	2,016.80	0.00
527	002049	紫光国芯	60	1,976.40	0.00
528	603928	兴业股份	70	1,949.50	0.00
529	002827	高争民爆	59	1,745.22	0.00
530	603660	苏州科达	53	1,707.66	0.00
531	002828	贝肯能源	42	1,621.20	0.00
532	603727	博迈科	32	1,520.96	0.00
533	603389	亚振家居	63	1,518.93	0.00
534	002831	裕同科技	19	1,314.80	0.00
535	000550	江铃汽车	46	1,242.00	0.00
536	601882	海天精工	48	1,211.52	0.00
537	603319	湘油泵	21	1,186.50	0.00
538	601515	东风股份	94	1,125.18	0.00
539	002678	珠江钢琴	67	996.96	0.00
540	300570	太辰光	10	553.00	0.00

541	603556	海兴电力	8	359.68	0.00
542	603036	如通股份	14	342.86	0.00
543	000671	阳光城	50	278.50	0.00
544	603977	国泰集团	10	274.50	0.00
545	002714	牧原股份	8	186.24	0.00
546	603987	康德莱	3	96.87	0.00
547	002085	万丰奥威	4	79.04	0.00
548	600320	振华重工	14	71.40	0.00
549	600510	黑牡丹	8	69.04	0.00
550	300182	捷成股份	5	51.55	0.00
551	603060	国检集团	1	35.37	0.00
552	002461	珠江啤酒	1	12.05	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	600201	生物股份	8,919,429.78	0.16
2	600079	人福医药	8,782,574.57	0.15
3	600522	中天科技	7,707,982.87	0.14
4	601012	隆基股份	7,290,638.75	0.13
5	600635	大众公用	7,187,406.52	0.13
6	600482	中国动力	6,869,814.23	0.12
7	600498	烽火通信	6,789,923.00	0.12
8	600158	中体产业	6,633,147.10	0.12
9	600503	华丽家族	6,575,558.45	0.12
10	600673	东阳光科	6,541,022.87	0.11
11	600816	安信信托	6,500,195.50	0.11

12	600521	华海药业	6,472,736.33	0.11
13	600160	巨化股份	6,420,537.07	0.11
14	600879	航天电子	6,401,786.67	0.11
15	600643	爱建集团	6,368,469.70	0.11
16	600664	哈药股份	6,349,052.19	0.11
17	600525	长园集团	6,341,331.36	0.11
18	600655	豫园商城	6,330,439.40	0.11
19	600138	中青旅	6,277,594.07	0.11
20	600388	龙净环保	6,016,448.50	0.11

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	600201	生物股份	11,831,519.37	0.21
2	600079	人福医药	11,348,225.36	0.20
3	600522	中天科技	10,839,714.24	0.19
4	600498	烽火通信	10,003,011.73	0.18
5	601012	隆基股份	9,716,126.39	0.17
6	600978	宜华生活	9,667,548.29	0.17
7	600482	中国动力	9,193,394.00	0.16
8	600521	华海药业	9,189,753.21	0.16
9	600635	大众公用	9,136,314.12	0.16
10	600503	华丽家族	8,987,142.13	0.16
11	600673	东阳光科	8,889,702.89	0.16
12	600158	中体产业	8,868,320.61	0.16
13	600879	航天电子	8,726,644.34	0.15
14	600664	哈药股份	8,684,383.75	0.15

15	600525	长园集团	8,576,423.16	0.15
16	600655	豫园商城	8,461,764.74	0.15
17	600219	南山铝业	8,386,874.23	0.15
18	600138	中青旅	8,171,976.58	0.14
19	600487	亨通光电	7,993,685.33	0.14
20	600699	均胜电子	7,875,475.58	0.14

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	1,343,058,147.80
卖出股票收入（成交）总额	1,637,620,080.74

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	3,748,260,536.81	91.36

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	390,712.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,691.14
4	应收利息	41,066.53

5	应收申购款	4,376,105.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	1,357,532.42
9	合计	6,167,108.93

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	600687	刚泰控股	1,116,560.00	0.03	重大资产重组

§ 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
404,194	6,628.33	205,973,875.67	7.69%	2,473,157,998.71	92.31%

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	徐兴耀	551,100.00	0.02%
2	姚红伟	529,900.00	0.02%
3	牟子豪	515,900.00	0.02%
4	王少琴	515,053.00	0.02%
5	张振华	300,000.00	0.01%
6	栾荣华	300,000.00	0.01%
7	翟建忠	268,502.00	0.01%
8	王湘伟	260,000.00	0.01%
9	薛宜平	251,443.00	0.01%
10	毛新程	229,200.00	0.01%

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	3,417,229.76	0.1275%

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	0~10

§ 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	3, 157, 946, 424. 77
本报告期基金总申购份额	2, 766, 051, 667. 81
减:本报告期基金总赎回份额	3, 244, 866, 218. 20
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以 "-" 填列)	-
本报告期期末基金份额总额	2, 679, 131, 874. 38

§ 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

根据南方基金管理有限公司第七届董事会第一次会议审议通过，并按规定向中国证券监督管理委员会深圳监管局备案，基金管理人于 2016 年 10 月 20 日发布公告，自 2016 年 10 月 18 日起，张海波先生担任本基金管理人董事长，吴万善先生不再担任本基金管理人董事长。

基金管理人于 2016 年 10 月 20 日发布公告，南方基金管理有限公司（以下简称“公司”）第六届董事会任期届满，根据《公司法》、《证券投资基金管理公司管理办法》等法律法规和《公司章程》的规定，公司股东会 2016 年第一次临时会议选举产生了公司第七届董事会。

根据南方基金管理有限公司第六届董事会第二十八次会议审议通过，并按规定向中国证券投资基金业协会报备，基金管理人于 2016 年 10 月 19 日发布公告，自 2016 年 10 月 17 日起，郑文祥先生不再担任本基金管理人副总经理。

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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期未变更会计师事务所。本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 106,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 8 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	2,025,735,697.73	68.09%	1,353,095.40	93.44%	-
华泰证券	1	949,374,048.64	31.91%	94,947.24	6.56%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序

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

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、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；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、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：

1、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；

2、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；

3、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	92,452.40	93.44%	220,000,000.00	100.00%	-	-	6,004,568.80	100.00%
华泰证券	6,492.08	6.56%	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

高华证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证 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	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月4日
2	南方基金管理有限公司关于在2016年1月4日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月4日
3	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月5日
4	关于南方基金管理有限公司旗下部分基金净值揭示异常的提示	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月6日
5	南方基金管理有限公司关于在2016年1月7日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月7日
6	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月8日
7	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	2016年1月12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	2016年1月13日
9	南方基金关于电子直销平台通过货币基金定投其他基金费率为0的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月15日
10	南方基金关于旗下部分基金增加中证金牛为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年1月26日
11	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	2016年1月27日
12	南方基金管理有限公司电子交易赎回转认/申购业	中国证券报、上海	2016年1月27

	务规则	证券报、证券时报	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	2016 年 1 月 29 日
14	南方基金关于临时暂停电子直销实时赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 4 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	2016 年 2 月 18 日
16	南方基金关于继续开展直销柜台部分指数型基金赎回费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 30 日
17	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	2016 年 3 月 31 日
18	关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 12 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	2016 年 5 月 14 日
20	南方基金关于旗下部分基金增加厦门鑫鼎盛为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 6 月 6 日
21	南方基金关于旗下部分基金增加积木基金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 6 月 20 日
22	南方基金关于南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 增加微众银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 6 月 28 日
23	南方基金关于南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 增加微众银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 6 月 28 日
24	南方基金关于继续开展直销柜台部分指数型基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 6 月 30 日
25	关于京东电子交易平台实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 6 月 30 日
26	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 6 月 30 日
27	南方基金关于旗下部分基金增加大智慧财富为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 7 月 26 日
28	南方基金关于旗下部分基金增加广源达信为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 7 月 28 日
29	南方基金关于旗下部分基金增加蛋卷基金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 19 日
30	南方基金关于旗下部分基金增加云湾投资为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 29 日
31	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 9 月 20 日
32	南方基金关于旗下部分基金增加钱景财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 9 月 27 日

33	南方基金关于旗下部分基金增加弘业期货为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 11 月 16 日
34	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	2016 年 11 月 29 日
35	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 11 月 29 日
36	南方基金关于继续开展直销柜台部分指数型基金赎回费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 11 月 30 日
37	南方基金关于旗下部分基金增加汇成基金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 12 月 8 日
38	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	2016 年 12 月 13 日
39	南方基金关于旗下部分基金增加基煜基金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 12 月 16 日
40	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 12 月 22 日
41	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	2016 年 12 月 30 日
42	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	2016 年 12 月 30 日
43	南方基金关于旗下部分基金参加中国农业银行开放式公募基金交易优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 12 月 30 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

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>