

# 南方中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金(LOF)2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 03 月 29 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 2018 年 3 月 26 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 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.1.1 目标基金基本情况	
2.2 基金产品说明.....	6
2.2.1 目标基金产品说明	
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.....	7
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	错误！未定义书签。
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	12
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
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.....	14
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.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	错误！未定义书签。
4.10 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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	23

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>53</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	53
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 .....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	68
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 .....	68
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 .....	69
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 .....	69
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 .....	69
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 .....	69
8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	69
8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	69
8.13 投资组合报告附注 .....	70
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>70</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	70
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	71
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	71
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 .....	72
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>72</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>73</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	73
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 .....	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	73
11.4 基金投资策略的改变 .....	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	73
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 .....	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	76
11.8 其他重大事件 .....	73
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>76</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	78
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>78</b>
13.1 备查文件目录 .....	78
13.2 存放地点 .....	79
13.3 查阅方式 .....	79

## § 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	南方基金管理股份有限公司	
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	2,767,041,393.43 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	
下属分级基金的基金简称	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C
下属分级基金的场内简称	南方 500	-
下属分级基金的交易代码	160119	004348
下属分级基金的前端交易代码	160119	-
下属分级基金的后端交易代码	160120	-
报告期末下属分级基金的份额总额	2,697,875,756.00 份	69,165,637.43 份

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	南方基金管理股份有限公司
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 $\times$ 95% + 银行活期存款利率 (税后) $\times$ 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		南方基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	常克川	贺倩
	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	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
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
注册登记机构	南方基金管理股份有限公司	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

### § 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	报告期(2017年01月01日 -2017年12月31日)		报告期(2016年01月01日 -2016年12月31日)		报告期(2015年01月01日 -2015年12月31日)	
	南方中证 500ETF 联接 (LOF)A	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C	南方中证 500ETF 联接 (LOF)A	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C	南方中证 500ETF 联接 (LOF)A	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C
本期已 实现收 益	142,482,136 .41	906,967.45	98,556,570. 65	0.00	1,821,105,3 99.31	0.00
本期利 润	99,576,763. 49	4,985,881.3 0	-857,843,51 8.26	0	1,995,258,2 55.72	0.00
加权平 均基金 份额本 期利润	0.0355	0.1640	-0.2838	0	0.7542	0.0000
本期加 权平均 净值利 润率	2.29%	10.38%	-18.97%	0.00%	43.28%	0.00%
本期基 金份额 净值增 长率	0.64%	-1.90%	-15.19%	0.00%	44.14%	0.00%
3.1.2 期末数 据和指	报告期(2017年12月31日)		报告期(2016年12月31日)		报告期(2015年12月31日)	



标						
期末可供分配利润	1,459,793.26 66.60	37,580,889.10	1,423,389.43 39.67	0.00	2,501,740.80 05.17	0.00
期末可供分配基金份额利润	0.5411	0.5433	0.5313	0	0.7922	0.0000
期末基金资产净值	4,157,669.02 22.60	106,746,526.53	4,102,521.31 14.05	0	5,701,544.85 56.19	0.00
期末基金份额净值	1.5411	1.5433	1.5313	0	1.8055	0.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期(2017年12月31日)		报告期(2016年12月31日)		报告期(2015年12月31日)	
基金份额累计净值增长率	68.15%	-1.90%	67.08%	0.00%	96.99%	0.00%

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、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

南方中证 500ETF 联接 (LOF) A

阶段	净值增长率 ①	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	-5.00%	0.93%	-5.06%	0.93%	0.06%	0.00%
过去六个月	2.03%	0.91%	1.78%	0.91%	0.25%	0.00%
过去一年	0.64%	0.88%	-0.13%	0.88%	0.77%	0.00%
过去三年	23.03%	1.94%	17.42%	1.93%	5.61%	0.01%
过去五年	94.60%	1.71%	86.68%	1.70%	7.92%	0.01%

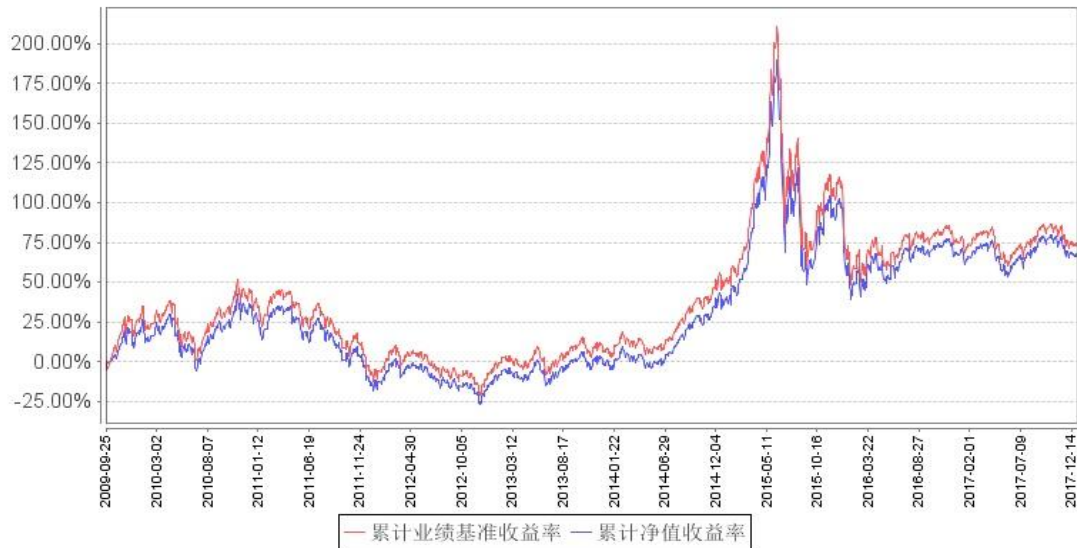
自基金合同 修改起至今	68.15%	1.65%	74.60%	1.65%	-6.45%	0.00%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

南方中证 500ETF 联接 (LOF) C

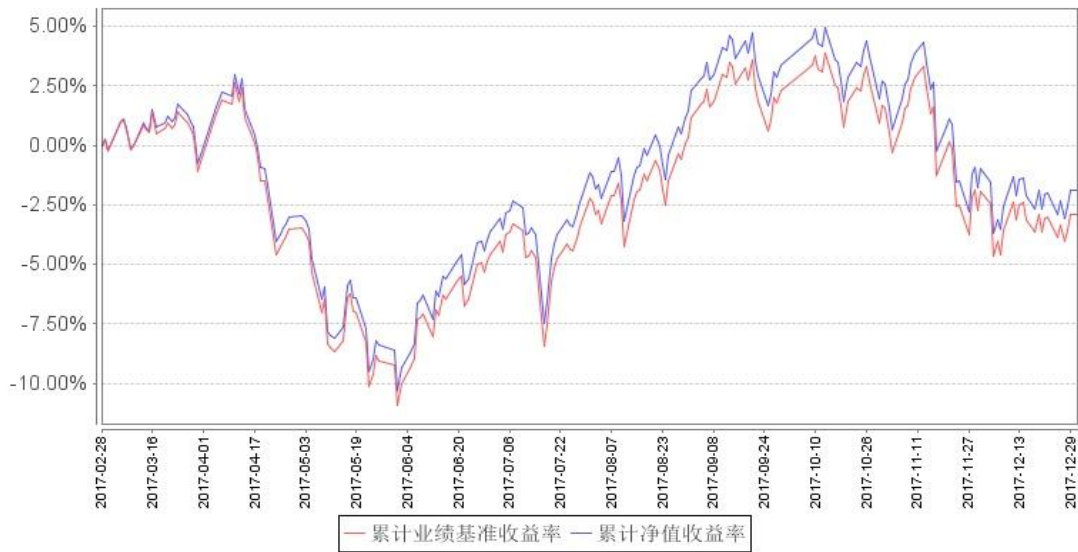
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.10%	0.93%	-5.06%	0.93%	-0.04%	0.00%
过去六个月	1.82%	0.91%	1.78%	0.91%	0.04%	0.00%
自基金合同 修改起至今	-1.90%	0.89%	-2.89%	0.90%	0.99%	-0.01%

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

南方中证500ETF联接(LOF)A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



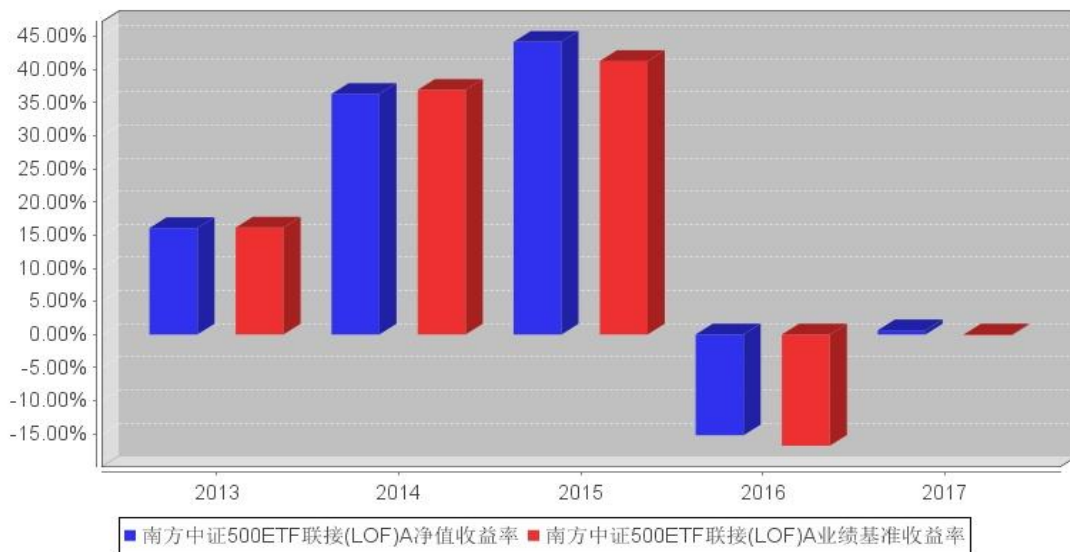
南方中证500ETF联接(LOF)C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



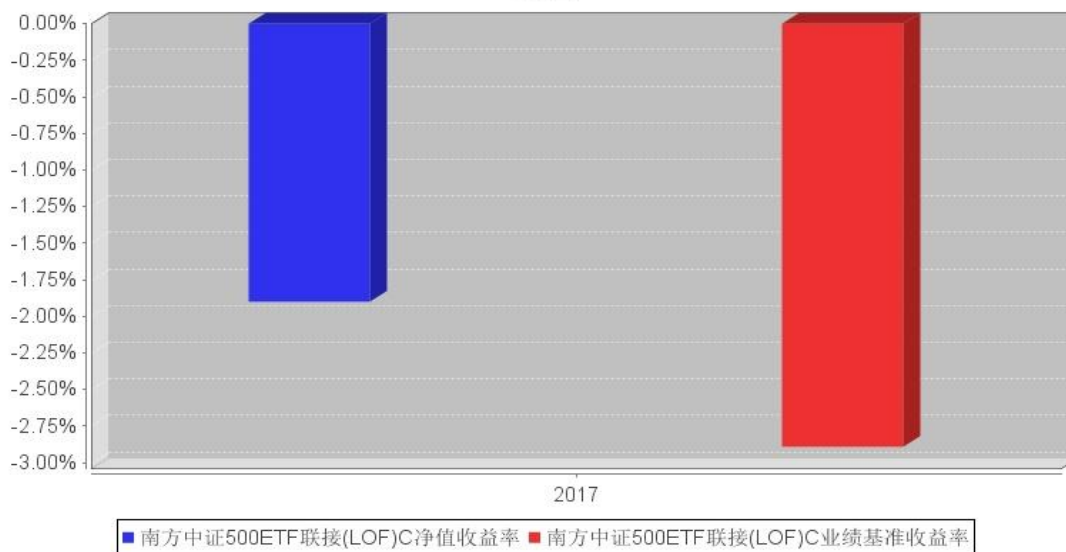
注：本基金 2017 年 2 月 20 日发布公告，增加 C 类收费模式，原有收费模式称为 A 类。

### 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

南方中证500ETF联接(LOF)A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



南方中证500ETF联接(LOF)C基金每年净值增长率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

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。

2018年1月,公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司,注册资本金3亿元人民币。目前股权结构:华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。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,南方基金管理股份有限公司(不含子公司)管理资产规模超7,200亿元,旗下管理153只开放式基金,多个全国社保、基本养老保险、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	本基	2013年	-	12	女,美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学

杰	基金 经理	4 月 22 日			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、摩根士丹利公司，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理，现任指数投资部兼数量化投资部总经理；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；2017 年 7 月至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月至今，任南方房地产联接、南方房地产 ETF 基金经理；2017 年 11 月至今，任南方策略、南方量化混合基金经理。
---	----------	-------------	--	--	--

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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，两两组合间单日、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5次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数型基金成份股调整所致，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0.2%。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) 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（包括调出指数成份股）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) 期间，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

本报告期基金A级净值增长率为0.64%，同期业绩比较基准收益率为-0.13%。本报告期基金C级净值增长率为-1.90%，同期业绩比较基准收益率为-2.89%。

## 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2018年，国内经济阶段企稳、结构转型将带来更高质量的盈利，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、监管要求和业务发展情况，坚持从保护基金持有人利益出发，树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础”的合规理念，继续致力于合规与内控机制的完善，积极推动主动合规风控管理，持续加强业务风险的控制与防范，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实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程，并积极开展形式丰富的合规培训与考试，加强员工行为规范检查、加大合规问责力度，强化全员合规、主动合规理念；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稽核、专项稽核及多项自查，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，排查业务中的风险点并完善内控措施，促进公司业务合规运作、稳健经营；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，持续完善投资合规风控制度流程和系统，加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控，有效确保投研交易业务合规运作；积极参与新产品、新业务合规评估工作，保障新产品、新业务合规开展；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，督促落实投资者适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；继续按照风险为本的原则积极开展各项反洗钱工作，进一步升级反洗钱业务系统，优化其他反洗钱资源配置，重点推进《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》的具体落实工作，加强业务部门反洗钱风险评估频率，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程；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。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险

管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。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：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，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；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；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人、登记机构可在法律法规允许的前提下，按照监管部门要求履行适当程序后，经与基金托管人协商一致酌情调整以上基金收益分配原则，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

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—南方基金管理股份有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 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，南方基金管理股份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，南方基金管理股份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，未发现有关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(2018)第 22854 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：
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了南方中证 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 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 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。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为，后附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，公允反映了南方中证 500ETF 联接基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一

	<p>步阐述了我们在这些准则下的责任。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> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于南方中证 500ETF 联接基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>南方中证 500ETF 联接基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司，以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估南方中证 500ETF 联接基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算南方中证 500ETF 联接基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督南方中证 500ETF 联接基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结</p>

	<p>论。同时，根据获取的审计证据，就可能对南方中证 500ETF 联接基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致南方中证 500ETF 联接基金不能持续经营。</p> <p>(五)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
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）
注册会计师的姓名	薛竞   陈熹
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2018 年 3 月 23 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：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	157,996,155.57	227,730,372.51
结算备付金		201,396.65	67,344.58
存出保证金		155,266.33	390,712.97
交易性金融资产	7.4.7.2	4,118,418,847.97	3,890,046,070.01
其中：股票投资		180,974,094.94	141,785,533.20
基金投资		3,859,192,327.06	3,748,260,536.81
债券投资		78,252,425.97	-
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		3,069.47	-
应收利息	7.4.7.5	1,948,818.65	41,066.53
应收股利		1,691.14	1,691.14
应收申购款		9,607,622.47	4,376,105.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	93,471.20	1,357,532.42
资产总计		4,288,426,339.45	4,124,010,896.03
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年12月31日</b>	<b>上年度末 2016年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		14,048,777.45	13,316,293.47
应付赎回款		9,269,575.99	7,536,613.81
应付管理人报酬		166,641.91	128,959.19
应付托管费		33,328.37	25,791.84
应付销售服务费		34,475.88	-
应付交易费用	7.4.7.7	17,524.16	48,525.43
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	440,466.56	433,398.24
负债合计		24,010,790.32	21,489,581.98
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,767,041,393.43	2,679,131,874.38
未分配利润	7.4.7.10	1,497,374,155.70	1,423,389,439.67
所有者权益合计		4,264,415,549.13	4,102,521,314.05
负债和所有者权益总计		4,288,426,339.45	4,124,010,896.03

注:报告截止日 2017 年 12 月 31 日, 基金份额总额 2,767,041,393.43 份, 其中南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) A 类基金份额总额 2,697,875,756.00 份, 基金份额净值为 1.5411 元; 南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) C 类基金份额 69,165,637.43 份, 基金份额净值为 1.5433 元。

## 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: 2017 年 1 月 1 日至 2017 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
----	-----	----	---------

		2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		108,845,216.81	-852,023,229.58
1. 利息收入		1,874,464.05	1,993,500.96
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,718,356.96	1,937,197.86
债券利息收入		27,029.36	9.13
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		129,077.73	56,293.97
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		143,011,870.26	96,658,060.63
其中：股票投资收益	7.4.7.12	24,359,071.36	-9,435,918.77
基金投资收益	7.4.7.13	117,214,049.74	105,815,502.11
债券投资收益	7.4.7.14	28,714.77	11,335.35
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	1,410,034.39	267,141.94
3. 公允价值变动收益	7.4.7.18	-38,826,459.07	-956,400,088.91
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.19	2,785,341.57	5,725,297.74
减：二、费用		4,282,572.02	5,820,288.68
1. 管理人报酬		1,989,169.30	1,605,369.35
2. 托管费		397,833.80	321,073.85
3. 销售服务费		159,393.80	-
4. 交易费用	7.4.7.20	1,248,118.84	3,404,100.05
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	488,056.28	489,745.43
三、利润总额		104,562,644.79	-857,843,518.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润		104,562,644.79	-857,843,518.26

### 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：2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 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）	2,679,131,874.38	1,423,389,439.67	4,102,521,314.05

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	104,562,644.79	104,562,644.79
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）	87,909,519.05	-30,577,928.76	57,331,590.29
其中：1. 基金申购款	1,967,081,112.30	1,042,607,601.79	3,009,688,714.09
2. 基金赎回款	-1,879,171,593.25	-1,073,185,530.55	-2,952,357,123.80
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）	2,767,041,393.43	1,497,374,155.70	4,264,415,549.13
项目	上年度可比期间 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（本期净利润）	-	-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

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：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) (以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]755 号《关于核准南方中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 募集的批复》核准,由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司,已于 2018 年 1 月 4 日办理完成工商变更登记)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股份有限公司,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[2009]147 号审核同意,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。

根据《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 C 类份额并修改基金合同的公告》以及更新的《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 招募说明书》的有关规定,自 2017 年 2 月 23 日起,本基金根据费率设置的不同,将基金份额分为不

同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额的申购与赎回包括场外和场内两种方式，C 类基金份额在场外申购和赎回。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额之间不能互相转换。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

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  $\times$  95% + 银行活期存款利率 (税后)  $\times$  5%。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2018 年 3 月 23 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 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变动计入当期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卖出回购金融资产款和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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 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、托管费和销售服务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

本基金同一类别的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和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 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[2017]13号《中国证监会关于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。

(2) 于 2017 年 12 月 25 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 12 月 25 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的

通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **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**

本报告期无会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》,对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,本基金自2017年12月25日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

##### **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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	157,996,155.57	227,730,372.51
定期存款	-	-
其中：存款期限小于 1 个月	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月-1 年	-	-
其他存款	-	-
合计	157,996,155.57	227,730,372.51

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	183,539,635.79	180,974,094.94	-2,565,540.85

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	78,167,006.37	78,252,425.97	85,419.60
	银行间市场	-	-	-
	-	-	-	-
	合计	78,167,006.37	78,252,425.97	85,419.60
资产支持证券	-	-	-	
基金	3,563,892,633.79	3,859,192,327.06	295,299,693.27	
其他	-	-	-	
合计	3,825,599,275.95	4,118,418,847.97	292,819,572.02	
项目	上年度末 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	

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:无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注:无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注:无。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	40,541.29	40,860.43
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	90.60	30.30
应收债券利息	1,908,116.86	-
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	69.90	175.80
合计	1,948,818.65	41,066.53

## 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
应收目标 ETF 可退替代款	93,471.20	1,357,532.42
可收退补款	-	-
合计	93,471.20	1,357,532.42

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	17,524.16	48,525.43
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	17,524.16	48,525.43

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------



应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	34,466.56	27,398.24
预提费用	406,000.00	406,000.00
合计	440,466.56	433,398.24

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 南方中证 500ETF 联接 (LOF) A

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	2,679,131,874.38	2,679,131,874.38
本期申购	1,823,244,983.05	1,823,244,983.05
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,804,501,101.43	-1,804,501,101.43
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	2,697,875,756.00	2,697,875,756.00

##### 南方中证 500ETF 联接 (LOF) C

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	143,836,129.25	143,836,129.25
本期赎回 (以“-”号填列)	-74,670,491.82	-74,670,491.82
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	69,165,637.43	69,165,637.43

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

截至 2017 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 34,583,583.00 份 (2016 年 12 月 31 日：36,647,646.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 2,663,292,173.00 份 (2016 年 12 月 31 日：2,642,484,228.38 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

南方中证 500ETF 联接 (LOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,217,377,614.53	-793,988,174.86	1,423,389,439.67
本期利润	142,482,136.41	-42,905,372.92	99,576,763.49
本期基金份额交易产生的变动数	6,758,645.44	-69,931,582.00	-63,172,936.56
其中：基金申购款	1,550,840,092.85	-587,874,298.95	962,965,793.90
基金赎回款	-1,544,081,447.41	517,942,716.95	-1,026,138,730.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,366,618,396.38	-906,825,129.78	1,459,793,266.60
南方中证 500ETF 联接 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	906,967.45	4,078,913.85	4,985,881.30
本期基金份额交易产生的变动数	59,919,344.55	-27,324,336.75	32,595,007.80
其中：基金申购款	125,210,415.78	-45,568,607.89	79,641,807.89
基金赎回款	-65,291,071.23	18,244,271.14	-47,046,800.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,826,312.00	-23,245,422.90	37,580,889.10

## 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
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,643,058.23	1,814,907.00
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	16,903.40	23,318.26
其他	58,395.33	98,972.60
合计	1,718,356.96	1,937,197.86

#### 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 2017年1月1日至 2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12 月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	26,097,028.70	9,664,241.51
股票投资收益——申购 差价收入	-1,737,957.34	-19,100,160.28
合计	24,359,071.36	-9,435,918.77

##### 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 2017年1月1日至 2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年 12月31日
卖出股票成交总额	866,588,965.77	1,637,620,080.74
减：卖出股票成本总 额	840,491,937.07	1,627,955,839.23
买卖股票差价收入	26,097,028.70	9,664,241.51

##### 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 2017年1月1日至 2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年 12月31日
申购基金份额对价总额	1,122,518,880.00	985,585,000.00
减：现金支付申购款总额	614,523,448.21	546,158,128.59
减：申购股票成本总额	509,733,389.13	458,527,031.69
申购差价收入	-1,737,957.34	-19,100,160.28

**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
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	1,089,661,440.61	1,694,598,412.80
减：卖出/赎回基金成本总额	972,447,390.87	1,588,782,910.69
基金投资收益	117,214,049.74	105,815,502.11

**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
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	142,333.01	98,944.48
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	113,600.00	87,600.00
减：应收利息总额	18.24	9.13
买卖债券差价收入	28,714.77	11,335.35

**7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益**

注：无。

**7.4.7.15 贵金属投资收益**

注：无。

**7.4.7.16 衍生工具收益**

注：无。

**7.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,410,034.39	267,141.94

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,410,034.39	267,141.94

#### 7.4.7.18 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
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-38,826,459.07	-956,400,088.91
股票投资	-574,811.31	-568,205.42
债券投资	85,419.60	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-38,337,067.36	-955,831,883.49
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
其他	-	-
合计	-38,826,459.07	-956,400,088.91

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	2,783,248.98	5,725,297.74
基金转换费收入	2,092.59	-
合计	2,785,341.57	5,725,297.74

注：1 本基金的 A 类基金份额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；C 类基金份额的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入基金资产。

2 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中 A 类基金份额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；C 类基金份额的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入基金资产。

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,197,300.29	3,349,592.61
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	50,818.55	54,507.44
合计	1,248,118.84	3,404,100.05

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	106,000.00	106,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
账户维护费	150.00	200.00
银行费用	21,906.28	23,545.43
上市费	60,000.00	60,000.00
合计	488,056.28	489,745.43

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司（“南方基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（“目标 ETF”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注:1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》，公司名称由“南方基金管理有限公司”变更为“南方基金管理股份有限公司”，公司股权结构等事项未发生变化，并已于 2018 年 1 月 4 日在深圳市市场监督管理局完成相应变更登记手续。

#### 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 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 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	556,808,366.02	31.90	949,374,048.64	31.91

###### 7.4.10.1.2 基金交易

注:无。

###### 7.4.10.1.3 权证交易

注:无。

###### 7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 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	55,686.23	31.90	4,958.77	28.30
关联方名称	上年度可比期间 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
------	-----------	------	-----------	-------

注:: 1. 上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。 2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,989,169.30	1,605,369.35
其中:支付销售机构的客户维护费	5,267,170.87	4,475,515.23

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) X 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 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	397,833.80	321,073.85

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) X 0.1% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费	本期
---------	----



的各关联方名称	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	合计
南方基金	-	158,922.99	158,922.99
华泰证券	-	0.38	0.38
合计	-	158,923.37	158,923.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	合计	
南方基金	-	-	-
华泰证券	-	-	-
合计	-	-	-

注:本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取销售服务费,支付 C 类基金份额销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的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 0.40% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给南方基金,再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为:  
日销售服务费=前一日 C 类基金份额基金资产净值 X 0.40% / 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:无。

#### 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	本期
	2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C
基金合同生效日(2009 年 9 月 25 日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	52,873,972.73	-

期间申购/买入总份额		-
期间因拆分变动份额		-
减: 期间赎回/卖出总份额	13,000,000.00	-
期末持有的基金份额	39,873,972.73	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.48%	-
项目	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年 12月31日
	南方中证 500ETF 联接 (LOF)A	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C
基金合同生效日(2009年9 月25日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	52,873,972.73	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减: 期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	52,873,972.73	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.97%	-

注: 基金管理人南方基金在本年度赎回本基金的交易委托华泰证券办理, 适用费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 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

注: 无。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
中国农业银行股份有限公司	157,996,155.57	1,643,058.23	227,730,372.51	1,814,907.00

注: 本基金由基金托管人中国农业银行保管的银行存款, 按银行约定利率计息。

#### 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: 无。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 585,773,402 份目标 ETF 基金份额(于 2016 年 12 月 31 日：571,773,402 份)，占其份额的比例为 20.84%(于 2016 年 12 月 31 日：22.41%)。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 7.4.12 期末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
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110041	蒙电转债	2017-12-22	2018-01-09	新债未上市	100.00	100.00	400	40,000.00	40,000.00	-
128029	太阳转债	2017-12-22	2018-01-16	新债未上市	100.00	100.00	311	31,100.00	31,100.00	-
123004	铁汉转债	2017-12-18	2018-01-26	新债未上市	100.00	100.00	284	28,400.00	28,400.00	-
128027	崇达转债	2017-12-15	2018-01-22	新债未上市	100.00	100.00	43	4,300.00	4,300.00	-

## 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
002168	深圳惠程	2017-12-19	拟披露重大事项	13.76	-	-	84,400	1,330,387.22	1,161,344.00	
600525	长园集团	2017-12-25	重大事项未公告	15.79	2018-1-10	17.3	56,816	1,041,679.33	897,124.64	
300156	神雾环保	2017-07-17	重大资产重组	24.16	2018-1-17	21.74	33,100	954,642.21	799,696.00	
002366	台海核电	2017-12-06	重大资产重组	26.45	-	-	20,100	516,655.96	531,645.00	
600614	鹏起科技	2017-12-26	重大事项未公告	10.16	-	-	45,695	542,719.46	464,261.20	
002745	木林森	2017-12-28	重大事项	45.50	2018-1-5	46.5	9,100	424,337.00	414,050.00	
002004	华邦健康	2017-12-14	重大事项	6.73	2018-3-14	7.30	61,500	488,671.36	413,895.00	
000806	银河生物	2017-07-18	重大资产重组	10.76	2018-1-18	10.01	36,600	474,402.94	393,816.00	
000930	中粮生化	2017-10-24	重大资产重组	13.34	-	-	29,200	365,949.84	389,528.00	
600664	哈药股份	2017-09-28	重大资产重组	5.81	2018-2-27	6.00	66,301	385,753.87	385,208.81	
002512	达华智能	2017-12-06	拟披露重大事项	18.07	2018-3-6	16.26	21,100	346,450.94	381,277.00	
600645	中源协和	2017-10-09	重大资产重组	28.40	2018-1-19	25.56	13,400	348,407.66	380,560.00	
000006	深振业A	2017-09-11	重大资产重组	9.85	2018-3-8	8.87	36,300	310,810.71	357,555.00	
000926	福星股份	2017-12-26	重大事项	10.89	2018-1-10	11.98	32,800	399,582.36	357,192.00	
000979	中弘股份	2017-09-07	重大资产重组	1.94	2018-2-14	1.75	182,248	342,875.91	353,561.12	
300383	光环新网	2017-11-07	拟披露重大事项	13.19	2018-3-19	14.51	26,400	330,372.31	348,216.00	
600187	国中水务	2017-11-09	重大资产重组	4.68	2018-3-20	4.21	72,500	338,704.16	339,300.00	
000031	中粮地产	2017-07-24	重大资产重组	8.00	-	-	41,500	349,469.10	332,000.00	

000592	平潭发展	2017-08-09	重大资产重组	5.75	2018-1-29	5.7	57,400	340,918.62	330,050.00
300116	坚瑞沃能	2017-12-18	重大资产重组	7.62	-	-	42,000	378,904.20	320,040.00
000566	海南海药	2017-11-22	重大资产重组	12.89	-	-	24,290	316,470.04	313,098.10
000547	航天发展	2017-10-30	重大事项	10.26	-	-	30,361	436,664.79	311,503.86
000401	冀东水泥	2017-11-21	重大资产重组	13.79	2018-1-15	15.17	20,460	320,698.89	282,143.40
000156	华数传媒	2017-12-26	重大事项	11.40	-	-	24,700	320,443.00	281,580.00
300134	大富科技	2017-12-18	拟披露重大事项	16.45	2018-3-19	14.81	16,600	357,162.08	273,070.00
002122	天马股份	2017-12-19	重大事项	8.49	-	-	30,800	325,515.55	261,492.00
000939	凯迪生态	2017-11-16	重大资产重组	4.99	-	-	47,600	271,806.05	237,524.00
300159	新研股份	2017-11-23	重大资产重组	10.40	2018-3-22	9.36	22,600	323,107.33	235,040.00
002358	森源电气	2017-12-07	重大资产重组	14.86	2018-3-7	15.05	14,358	257,667.88	213,359.88
000693	*ST 华泽	2016-03-01	重大事项	12.50	2018-3-21	11.88	16,900	250,450.70	211,250.00
002345	潮宏基	2017-12-20	重大事项	10.75	-	-	18,840	204,643.03	202,530.00
000766	通化金马	2017/11/24	重大资产重组	13.60	-	-	13,100	219,515.20	178,160.00
300032	金龙机电	2017-11-27	拟披露重大事项	13.89	-	-	11,000	161,269.54	152,790.00
300010	立思辰	2017-11-17	拟披露重大事项	11.17	2018-2-22	10.05	13,265	204,070.52	148,170.05
002344	海宁皮城	2017-11-01	拟披露重大事项	7.93	2018-1-31	7.44	15,600	156,720.75	123,708.00
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项	41.55	2018-1-2	45.71	821	6,863.56	34,112.55
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项	35.26	2018-1-2	38.79	821	10,311.76	28,948.46

注:本基金截至 2017 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

注:无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金, 风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为被动式指数型基金, 紧密跟踪标的指数, 具有和标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征, 属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资的金融工具主要包括基金投资和股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内, 使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“紧密跟踪业绩比较基准, 追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设, 建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会, 负责制定风险管理的宏观政策, 审议通过风险控制的总体措施等; 在管理层层面设立风险控制委员会, 讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施; 在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责, 协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估, 督察长负责组织指导监察稽核工作。

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

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任, 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, 因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算, 违约风险

可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.0042% (2016 年 12 月 31 日：无)。

#### 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。

于 2017 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。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流动暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

#### **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、存出保证金及债券投资等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	157,996,155.57	-	-	-	157,996,155.57
结算备付金	201,396.65	-	-	-	201,396.65
存出保证金	155,266.33	-	-	-	155,266.33
交易性金融资产	78,072,162.54	49,150.60	131,112.83	4,040,166,422.00	4,118,418,847.97
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,948,818.65	1,948,818.65
应收股利	-	-	-	1,691.14	1,691.14
应收申购款	1,000,882.86	-	-	8,606,739.61	9,607,622.47
应收证券清算款	-	-	-	3,069.47	3,069.47
其他资产	-	-	-	93,471.20	93,471.20
<b>资产总计</b>	<b>237,425,863.95</b>	<b>49,150.60</b>	<b>131,112.83</b>	<b>4,050,820,212.07</b>	<b>4,288,426,339.45</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	9,269,575.99	9,269,575.99
应付管理人报酬	-	-	-	166,641.91	166,641.91
应付托管费	-	-	-	33,328.37	33,328.37
应付证券清算款	-	-	-	14,048,777.45	14,048,777.45
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	34,475.88	34,475.88
应付交易费用	-	-	-	17,524.16	17,524.16
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	440,466.56	440,466.56
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>24,010,790.32</b>	<b>24,010,790.32</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>237,425,863.95</b>	<b>49,150.60</b>	<b>131,112.83</b>	<b>4,026,809,421.75</b>	<b>4,264,415,549.13</b>
<b>上年度末</b>					
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

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 2017 年 12 月 31 日本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.84%(2016 年 12 月 31 日:无),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2016 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 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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	180,974,094.94	4.24	141,785,533.20	3.46
交易性金融资产—基金投资	3,859,192,327.06	90.50	3,748,260,536.81	91.36
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	4,040,166,422.00	94.74	3,890,046,070.01	94.82

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		
	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：人民币元)	
		本期末(2017 年 12 月 31 日)	上年度末(2016 年 12 月 31 日)
分析	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	215,378,454.23	202,747,333.59
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-215,378,454.23	-202,747,333.59

#### 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 2017 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 4,027,350,961.37 元，属于第二层次的余额为 91,067,886.60 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 3,882,674,106.74 元，第二层次 7,371,963.27 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 2017 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(2016 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增

值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，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	180,974,094.94	4.22
	其中：股票	180,974,094.94	4.22
2	基金投资	3,859,192,327.06	89.99
3	固定收益投资	78,252,425.97	1.82
	其中：债券	78,252,425.97	1.82
	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	158,197,552.22	3.69
8	其他各项资产	11,809,939.26	0.28
9	合计	4,288,426,339.45	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末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	2,973,068.00	0.07
B	采矿业	6,330,903.16	0.15
C	制造业	108,205,139.83	2.54
D	电力、热力、燃气及水生产和	5,664,400.69	0.13

	供应业		
E	建筑业	4,125,510.58	0.10
F	批发和零售业	9,595,614.82	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	5,934,283.98	0.14
H	住宿和餐饮业	216,343.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,733,861.84	0.35
J	金融业	3,376,301.52	0.08
K	房地产业	10,576,853.58	0.25
L	租赁和商务服务业	3,026,905.36	0.07
M	科学研究和技术服务业	380,560.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	2,005,463.49	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	215,892.00	0.01
Q	卫生和社会工作	334,860.74	0.01
R	文化、体育和娱乐业	2,351,791.35	0.06
S	综合	926,341.00	0.02
	合计	180,974,094.94	4.22

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600516	方大炭素	46,300	1,337,144.00	0.03
2	600201	生物股份	38,810	1,231,829.40	0.03
3	600176	中国巨石	75,591	1,231,377.39	0.03
4	002405	四维图新	44,296	1,168,971.44	0.03
5	002168	深圳惠程	84,400	1,161,344.00	0.03
6	000661	长春高新	5,880	1,076,040.00	0.03
7	002422	科伦药业	37,263	927,848.70	0.02
8	002271	东方雨虹	22,812	911,567.52	0.02
9	600525	长园集团	56,816	897,124.64	0.02
10	002001	新和成	23,500	894,410.00	0.02
11	600584	长电科技	41,025	875,063.25	0.02
12	000786	北新建材	38,550	867,375.00	0.02
13	000998	隆平高科	32,500	835,900.00	0.02
14	002340	格林美	115,194	828,244.86	0.02
15	600315	上海家化	22,400	826,336.00	0.02

16	300274	阳光电源	43,760	821,375.20	0.02
17	600521	华海药业	26,988	812,878.56	0.02
18	600438	通威股份	67,000	811,370.00	0.02
19	300156	神雾环保	33,100	799,696.00	0.02
20	603019	中科曙光	19,400	780,656.00	0.02
21	600426	华鲁恒升	48,970	779,602.40	0.02
22	002049	紫光国芯	15,700	753,443.00	0.02
23	000039	中集集团	32,700	747,195.00	0.02
24	002092	中泰化学	55,600	740,036.00	0.02
25	600079	人福医药	40,912	729,870.08	0.02
26	300266	兴源环境	27,028	729,756.00	0.02
27	000050	深天马 A	36,265	714,783.15	0.02
28	000830	鲁西化工	44,210	703,823.20	0.02
29	600298	安琪酵母	21,357	698,801.04	0.02
30	002583	海能达	37,700	697,827.00	0.02
31	600642	申能股份	117,800	690,308.00	0.02
32	600256	广汇能源	135,200	684,112.00	0.02
33	601168	西部矿业	82,200	674,040.00	0.02
34	002179	中航光电	17,047	671,310.86	0.02
35	002050	三花智控	36,600	671,244.00	0.02
36	000009	中国宝安	92,700	670,221.00	0.02
37	600291	西水股份	28,300	665,616.00	0.02
38	000977	浪潮信息	33,400	663,992.00	0.02
39	600392	盛和资源	34,900	663,100.00	0.02
40	002410	广联达	33,800	662,480.00	0.02
41	002384	东山精密	23,100	657,426.00	0.02
42	600004	白云机场	44,600	655,620.00	0.02
43	000418	小天鹅 A	9,528	646,474.80	0.02
44	600879	航天电子	82,100	643,664.00	0.02
45	000488	晨鸣纸业	38,446	640,894.82	0.02
46	600388	龙净环保	36,915	638,629.50	0.01
47	002311	海大集团	27,160	635,544.00	0.01
48	002573	清新环境	27,808	632,075.84	0.01
49	601233	桐昆股份	28,100	631,969.00	0.01
50	300055	万邦达	29,900	628,797.00	0.01
51	000513	丽珠集团	9,422	626,091.90	0.01
52	002078	太阳纸业	67,100	622,688.00	0.01
53	300088	长信科技	79,300	620,919.00	0.01
54	600022	山东钢铁	283,360	606,390.40	0.01
55	600499	科达洁能	54,400	603,296.00	0.01
56	000690	宝新能源	75,100	600,800.00	0.01
57	600872	中炬高新	24,040	595,230.40	0.01

58	603589	口子窖	12,900	594,045.00	0.01
59	600600	青岛啤酒	15,062	592,388.46	0.01
60	600811	东方集团	128,216	587,229.28	0.01
61	601699	潞安环能	51,600	587,208.00	0.01
62	000887	中鼎股份	32,000	581,440.00	0.01
63	600875	东方电气	51,700	580,591.00	0.01
64	002019	亿帆医药	26,000	578,500.00	0.01
65	600056	中国医药	23,073	574,286.97	0.01
66	002176	江特电机	50,700	573,924.00	0.01
67	600885	宏发股份	13,800	570,906.00	0.01
68	000656	金科股份	115,200	570,240.00	0.01
69	002407	多氟多	27,850	568,697.00	0.01
70	600166	福田汽车	201,400	565,934.00	0.01
71	000066	长城电脑	76,232	555,731.28	0.01
72	600839	四川长虹	159,300	554,364.00	0.01
73	002517	恺英网络	24,800	550,808.00	0.01
74	600718	东软集团	37,500	549,750.00	0.01
75	600643	爱建集团	49,594	549,501.52	0.01
76	002038	双鹭药业	17,700	548,169.00	0.01
77	000997	新大陆	30,540	547,582.20	0.01
78	600755	厦门国贸	53,700	542,370.00	0.01
79	600183	生益科技	31,400	541,964.00	0.01
80	600418	江淮汽车	57,200	541,112.00	0.01
81	002439	启明星辰	23,168	540,972.80	0.01
82	002273	水晶光电	22,900	540,211.00	0.01
83	600325	华发股份	73,068	537,780.48	0.01
84	600266	北京城建	40,600	533,484.00	0.01
85	002244	滨江集团	67,100	533,445.00	0.01
86	600260	凯乐科技	18,300	532,713.00	0.01
87	002366	台海核电	20,100	531,645.00	0.01
88	600808	马钢股份	128,701	531,535.13	0.01
89	002359	齐星铁塔	23,500	529,925.00	0.01
90	000970	中科三环	36,800	529,184.00	0.01
91	600787	中储股份	47,500	522,500.00	0.01
92	600138	中青旅	24,957	520,852.59	0.01
93	000581	威孚高科	21,700	520,800.00	0.01
94	000878	云南铜业	36,700	520,773.00	0.01
95	600060	海信电器	33,900	509,178.00	0.01
96	002223	鱼跃医疗	25,916	507,953.60	0.01
97	600673	东阳光科	74,600	503,550.00	0.01
98	002670	国盛金控	25,820	502,199.00	0.01
99	600460	士兰微	32,300	498,389.00	0.01



100	002195	二三四五	85,200	497,568.00	0.01
101	002285	世联行	44,100	491,715.00	0.01
102	000825	太钢不锈	98,300	487,568.00	0.01
103	002408	齐翔腾达	38,320	485,897.60	0.01
104	600160	巨化股份	45,600	484,728.00	0.01
105	600094	大名城	68,800	480,912.00	0.01
106	300197	铁汉生态	39,300	477,495.00	0.01
107	300146	汤臣倍健	31,700	476,134.00	0.01
108	600435	北方导航	38,600	475,938.00	0.01
109	000960	锡业股份	36,000	475,200.00	0.01
110	002640	跨境通	24,800	474,672.00	0.01
111	300182	捷成股份	55,100	474,411.00	0.01
112	300115	长盈精密	23,390	469,437.30	0.01
113	600884	杉杉股份	24,200	468,996.00	0.01
114	600978	宜华生活	51,200	467,968.00	0.01
115	600655	豫园股份	43,400	466,116.00	0.01
116	600614	鹏起科技	45,695	464,261.20	0.01
117	600062	华润双鹤	18,750	464,062.50	0.01
118	601000	唐山港	98,342	463,190.82	0.01
119	600143	金发科技	70,300	461,871.00	0.01
120	000807	云铝股份	45,000	460,350.00	0.01
121	600282	南钢股份	95,100	460,284.00	0.01
122	000981	银亿股份	52,100	460,043.00	0.01
123	000999	华润三九	16,900	459,680.00	0.01
124	000703	恒逸石化	21,300	459,441.00	0.01
125	600346	恒力股份	37,000	456,210.00	0.01
126	600161	天坛生物	15,833	455,832.07	0.01
127	600179	安通控股	18,300	452,925.00	0.01
128	600503	华丽家族	69,100	452,605.00	0.01
129	002183	怡亚通	64,000	451,200.00	0.01
130	000778	新兴铸管	86,100	449,442.00	0.01
131	600970	中材国际	45,400	449,006.00	0.01
132	002013	中航机电	41,522	448,022.38	0.01
133	601231	环旭电子	28,200	444,714.00	0.01
134	002051	中工国际	23,968	441,730.24	0.01
135	002589	瑞康医药	32,480	436,856.00	0.01
136	000988	华工科技	26,300	436,054.00	0.01
137	002048	宁波华翔	18,300	435,540.00	0.01
138	002221	东华能源	35,600	434,676.00	0.01
139	000732	泰禾集团	21,500	430,430.00	0.01
140	002127	南极电商	35,300	430,307.00	0.01
141	600409	三友化工	44,500	426,755.00	0.01

142	600125	铁龙物流	39,400	426,308.00	0.01
143	600240	华业资本	49,161	421,801.38	0.01
144	000598	兴蓉环境	77,300	419,739.00	0.01
145	002373	千方科技	28,600	418,990.00	0.01
146	002268	卫士通	18,054	415,603.08	0.01
147	002745	木林森	9,100	414,050.00	0.01
148	002004	华邦健康	61,500	413,895.00	0.01
149	002491	通鼎互联	32,700	412,020.00	0.01
150	000729	燕京啤酒	60,800	409,792.00	0.01
151	002030	达安基因	21,924	407,347.92	0.01
152	000078	海王生物	68,507	404,191.30	0.01
153	002400	省广股份	75,220	400,922.60	0.01
154	600566	济川药业	10,500	400,575.00	0.01
155	600410	华胜天成	38,060	400,391.20	0.01
156	600597	光明乳业	26,421	400,278.15	0.01
157	002281	光迅科技	13,600	399,840.00	0.01
158	600635	大众公用	83,500	399,130.00	0.01
159	002354	天神娱乐	23,060	394,326.00	0.01
160	000806	银河生物	36,600	393,816.00	0.01
161	000685	中山公用	38,160	391,140.00	0.01
162	002440	闰土股份	19,850	390,846.50	0.01
163	000028	国药一致	6,475	390,118.75	0.01
164	002152	广电运通	52,400	389,856.00	0.01
165	600037	歌华有线	30,000	389,700.00	0.01
166	000930	中粮生化	29,200	389,528.00	0.01
167	600307	酒钢宏兴	135,100	386,386.00	0.01
168	600122	宏图高科	39,872	386,359.68	0.01
169	600664	哈药股份	66,301	385,208.81	0.01
170	000012	南玻 A	45,565	385,024.25	0.01
171	000089	深圳机场	44,200	384,540.00	0.01
172	600572	康恩贝	54,200	383,194.00	0.01
173	600348	阳泉煤业	51,900	383,022.00	0.01
174	002512	达华智能	21,100	381,277.00	0.01
175	600645	中源协和	13,400	380,560.00	0.01
176	600500	中化国际	44,919	380,014.74	0.01
177	002056	横店东磁	35,500	379,850.00	0.01
178	600380	健康元	33,900	379,341.00	0.01
179	600171	上海贝岭	23,300	379,091.00	0.01
180	601200	上海环境	15,200	379,088.00	0.01
181	600717	天津港	36,100	378,689.00	0.01
182	600267	海正药业	25,000	378,500.00	0.01
183	002131	利欧股份	145,277	377,720.20	0.01

184	002431	棕榈股份	44,900	377,160.00	0.01
185	601880	大连港	133,460	372,353.40	0.01
186	600863	内蒙华电	125,300	372,141.00	0.01
187	002506	协鑫集成	87,100	371,917.00	0.01
188	300324	旋极信息	25,300	370,139.00	0.01
189	600881	亚泰集团	70,100	370,128.00	0.01
190	300058	蓝色光标	66,800	368,736.00	0.01
191	600511	国药股份	13,243	368,155.40	0.01
192	000636	风华高科	30,900	367,092.00	0.01
193	002665	首航节能	54,800	364,968.00	0.01
194	002701	奥瑞金	58,200	363,750.00	0.01
195	002028	思源电气	22,918	363,250.30	0.01
196	300002	神州泰岳	59,200	362,304.00	0.01
197	600026	中远海能	59,000	361,080.00	0.01
198	002477	雏鹰农牧	81,200	360,528.00	0.01
199	002280	联络互动	47,000	360,020.00	0.01
200	002191	劲嘉股份	38,700	357,975.00	0.01
201	000006	深振业 A	36,300	357,555.00	0.01
202	002390	信邦制药	42,300	357,435.00	0.01
203	600416	湘电股份	28,600	357,214.00	0.01
204	000926	福星股份	32,800	357,192.00	0.01
205	600120	浙江东方	14,500	356,845.00	0.01
206	002249	大洋电机	51,100	356,167.00	0.01
207	000979	中弘股份	182,248	353,561.12	0.01
208	600737	中粮糖业	44,300	352,185.00	0.01
209	600967	内蒙一机	29,200	351,860.00	0.01
210	300383	光环新网	26,400	348,216.00	0.01
211	600936	广西广电	50,500	346,430.00	0.01
212	000400	许继电气	26,100	344,259.00	0.01
213	600466	蓝光发展	36,800	344,080.00	0.01
214	600633	浙数文化	22,500	342,000.00	0.01
215	600835	上海机电	13,900	340,550.00	0.01
216	600575	皖江物流	83,800	339,390.00	0.01
217	600187	国中水务	72,500	339,300.00	0.01
218	600751	天海投资	55,500	339,105.00	0.01
219	000612	焦作万方	36,000	338,400.00	0.01
220	002635	安洁科技	12,950	337,865.50	0.01
221	600216	浙江医药	25,000	336,000.00	0.01
222	002505	大康农业	118,300	335,972.00	0.01
223	603369	今世缘	21,652	335,822.52	0.01
224	002709	天赐材料	7,300	335,727.00	0.01
225	000667	美好置业	110,400	335,616.00	0.01

226	300244	迪安诊断	14,177	334,860.74	0.01
227	000975	银泰资源	25,000	334,000.00	0.01
228	000031	中粮地产	41,500	332,000.00	0.01
229	300026	红日药业	77,900	331,854.00	0.01
230	600598	北大荒	30,700	330,946.00	0.01
231	600064	南京高科	23,300	330,627.00	0.01
232	300133	华策影视	30,500	330,620.00	0.01
233	000860	顺鑫农业	17,184	330,104.64	0.01
234	000592	平潭发展	57,400	330,050.00	0.01
235	300199	翰宇药业	20,200	328,856.00	0.01
236	600151	航天机电	43,300	328,647.00	0.01
237	000596	古井贡酒	5,000	328,350.00	0.01
238	000758	中色股份	51,000	327,930.00	0.01
239	000712	锦龙股份	19,300	327,714.00	0.01
240	600478	科力远	44,400	327,672.00	0.01
241	300113	顺网科技	17,900	327,391.00	0.01
242	002371	七星电子	7,900	327,376.00	0.01
243	300166	东方国信	25,999	326,287.45	0.01
244	002353	杰瑞股份	24,800	325,376.00	0.01
245	300253	卫宁健康	48,272	323,905.12	0.01
246	002672	东江环保	19,800	321,750.00	0.01
247	300287	飞利信	43,382	321,460.62	0.01
248	002444	巨星科技	23,218	321,104.94	0.01
249	300116	坚瑞消防	42,000	320,040.00	0.01
250	603766	隆鑫通用	45,575	319,936.50	0.01
251	600823	世茂股份	64,700	319,618.00	0.01
252	601678	滨化股份	39,100	317,492.00	0.01
253	600039	四川路桥	77,840	316,808.80	0.01
254	002603	以岭药业	20,300	315,868.00	0.01
255	002807	江阴银行	38,100	315,468.00	0.01
256	600908	无锡银行	39,900	314,013.00	0.01
257	000566	海南海药	24,290	313,098.10	0.01
258	600582	天地科技	67,300	312,945.00	0.01
259	603444	吉比特	1,700	312,681.00	0.01
260	002128	露天煤业	28,200	312,456.00	0.01
261	000547	航天发展	30,361	311,503.86	0.01
262	000027	深圳能源	51,300	310,878.00	0.01
263	600086	东方金钰	29,100	309,915.00	0.01
264	000021	深科技	31,700	308,441.00	0.01
265	002299	圣农发展	21,400	308,160.00	0.01
266	002147	新光圆成	23,630	305,772.20	0.01
267	002002	鸿达兴业	44,600	305,064.00	0.01

268	603077	和邦生物	152,420	304,840.00	0.01
269	300376	易事特	40,200	304,314.00	0.01
270	002155	湖南黄金	31,100	301,670.00	0.01
271	600017	日照港	77,700	301,476.00	0.01
272	600158	中体产业	29,100	299,148.00	0.01
273	600648	外高桥	16,165	299,052.50	0.01
274	600801	华新水泥	21,000	296,730.00	0.01
275	002266	浙富控股	68,300	295,739.00	0.01
276	600563	法拉电子	5,800	294,698.00	0.01
277	000681	视觉中国	15,100	294,450.00	0.01
278	300001	特锐德	21,488	294,170.72	0.01
279	600312	平高电气	29,300	292,707.00	0.01
280	600848	上海临港	13,100	292,130.00	0.01
281	600687	刚泰控股	24,400	288,164.00	0.01
282	002308	威创股份	23,600	287,920.00	0.01
283	600366	宁波韵升	16,400	287,328.00	0.01
284	002032	苏泊尔	7,100	286,698.00	0.01
285	600317	营口港	83,800	284,082.00	0.01
286	000718	苏宁环球	65,500	283,615.00	0.01
287	000563	陕国投 A	66,700	283,475.00	0.01
288	000762	西藏矿业	18,000	282,600.00	0.01
289	002489	浙江永强	46,950	282,169.50	0.01
290	000401	冀东水泥	20,460	282,143.40	0.01
291	000528	柳工	33,055	281,959.15	0.01
292	000156	华数传媒	24,700	281,580.00	0.01
293	000061	农产品	36,600	280,356.00	0.01
294	600594	益佰制药	27,334	279,353.48	0.01
295	000727	华东科技	117,300	279,174.00	0.01
296	002018	华信国际	39,300	277,851.00	0.01
297	600393	粤泰股份	43,800	277,692.00	0.01
298	000877	天山股份	26,600	276,640.00	0.01
299	600108	亚盛集团	67,200	276,192.00	0.01
300	600651	飞乐音响	29,900	273,585.00	0.01
301	300134	大富科技	16,600	273,070.00	0.01
302	002368	太极股份	10,762	273,031.94	0.01
303	002428	云南锗业	22,543	272,094.01	0.01
304	002463	沪电股份	50,600	269,698.00	0.01
305	600270	外运发展	15,600	269,568.00	0.01
306	600611	大众交通	54,000	268,920.00	0.01
307	002251	步步高	14,859	268,204.95	0.01
308	600169	太原重工	77,400	267,804.00	0.01
309	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.01

310	600993	马应龙	13,055	267,366.40	0.01
311	601928	凤凰传媒	32,900	266,819.00	0.01
312	000937	冀中能源	45,700	265,974.00	0.01
313	000501	鄂武商 A	16,630	265,414.80	0.01
314	600859	王府井	13,000	265,200.00	0.01
315	600316	洪都航空	18,585	263,163.60	0.01
316	600729	重庆百货	10,500	263,130.00	0.01
317	002122	天马股份	30,800	261,492.00	0.01
318	600545	卓郎智能	23,800	261,324.00	0.01
319	002375	亚厦股份	34,700	260,944.00	0.01
320	000090	天健集团	25,860	259,634.40	0.01
321	603000	人民网	23,900	258,837.00	0.01
322	002663	普邦股份	46,500	258,075.00	0.01
323	000587	金洲慈航	36,700	256,900.00	0.01
324	600694	大商股份	7,600	256,348.00	0.01
325	002317	众生药业	20,200	256,136.00	0.01
326	600770	综艺股份	33,700	256,120.00	0.01
327	603883	老百姓	4,063	255,928.37	0.01
328	601717	郑煤机	38,600	253,988.00	0.01
329	002277	友阿股份	42,800	251,236.00	0.01
330	600557	康缘药业	18,580	250,458.40	0.01
331	600141	兴发集团	14,800	250,120.00	0.01
332	600098	广州发展	35,300	249,571.00	0.01
333	600259	广晟有色	6,300	247,527.00	0.01
334	603188	亚邦股份	14,875	246,776.25	0.01
335	002250	联化科技	23,227	246,670.74	0.01
336	002233	塔牌集团	20,600	245,346.00	0.01
337	002434	万里扬	23,300	244,650.00	0.01
338	600874	创业环保	18,769	244,184.69	0.01
339	600565	迪马股份	60,900	243,600.00	0.01
340	601311	骆驼股份	18,300	242,475.00	0.01
341	300297	蓝盾股份	25,400	242,316.00	0.01
342	002106	莱宝高科	23,720	241,232.40	0.01
343	002064	华峰氨纶	49,200	241,080.00	0.01
344	000426	兴业矿业	24,200	237,886.00	0.01
345	000939	凯迪生态	47,600	237,524.00	0.01
346	000969	安泰科技	26,600	236,474.00	0.01
347	600765	中航重机	19,619	235,820.38	0.01
348	000099	中信海直	26,100	235,422.00	0.01
349	600587	新华医疗	14,000	235,060.00	0.01
350	300159	新研股份	22,600	235,040.00	0.01
351	002022	科华生物	17,200	234,092.00	0.01

352	600639	浦东金桥	13,800	233,910.00	0.01
353	000541	佛山照明	25,400	233,680.00	0.01
354	002437	誉衡药业	33,900	233,571.00	0.01
355	600338	西藏珠峰	5,600	233,240.00	0.01
356	002657	中科金财	10,200	232,764.00	0.01
357	601689	拓普集团	9,400	232,556.00	0.01
358	000543	皖能电力	46,320	232,526.40	0.01
359	000848	承德露露	24,560	232,337.60	0.01
360	000600	建投能源	30,000	231,300.00	0.01
361	000519	江南红箭	23,400	230,490.00	0.01
362	600155	宝硕股份	22,500	230,175.00	0.01
363	600073	上海梅林	28,300	229,796.00	0.01
364	601016	节能风电	69,600	228,984.00	0.01
365	000829	天音控股	24,100	228,950.00	0.01
366	600277	亿利洁能	35,500	228,620.00	0.01
367	000158	常山股份	28,560	226,766.40	0.01
368	002332	仙琚制药	27,650	225,900.50	0.01
369	002690	美亚光电	11,700	225,459.00	0.01
370	600058	五矿发展	18,500	223,480.00	0.01
371	002276	万马股份	25,900	223,258.00	0.01
372	002261	拓维信息	28,800	222,912.00	0.01
373	000572	海马汽车	48,091	220,256.78	0.01
374	600869	智慧能源	38,300	219,842.00	0.01
375	002073	软控股份	27,463	219,704.00	0.01
376	600971	恒源煤电	21,012	219,155.16	0.01
377	603816	顾家家居	3,700	218,189.00	0.01
378	002242	九阳股份	12,800	217,216.00	0.01
379	002503	搜于特	39,200	217,168.00	0.01
380	600754	锦江股份	6,700	216,343.00	0.01
381	603377	东方时尚	5,400	215,892.00	0.01
382	002063	远光软件	20,263	215,395.69	0.01
383	600578	京能电力	58,200	215,340.00	0.01
384	000669	金鸿能源	14,696	215,296.40	0.01
385	002642	荣之联	16,400	215,004.00	0.01
386	600284	浦东建设	23,073	214,578.90	0.01
387	002681	奋达科技	19,200	214,272.00	0.01
388	603515	欧普照明	5,000	214,200.00	0.01
389	002254	泰和新材	18,400	214,176.00	0.01
390	600773	西藏城投	18,300	213,744.00	0.01
391	601002	晋亿实业	19,900	213,527.00	0.01
392	002358	森源电气	14,358	213,359.88	0.01
393	600300	维维股份	48,800	213,256.00	0.01

394	300202	聚龙股份	11,868	213,030.60	-
395	601001	大同煤业	35,100	212,355.00	-
396	600536	中国软件	12,800	211,840.00	-
397	000062	深圳华强	9,000	211,410.00	-
398	000693	ST 华泽	16,900	211,250.00	-
399	600422	昆药集团	23,041	210,825.15	-
400	300273	和佳股份	23,192	210,119.52	-
401	000049	德赛电池	5,307	210,104.13	-
402	000680	山推股份	41,100	209,199.00	-
403	600759	洲际油气	48,800	207,888.00	-
404	600623	华谊集团	24,300	207,279.00	-
405	002482	广田集团	25,827	207,132.54	-
406	600289	亿阳信通	20,800	206,752.00	-
407	002699	美盛文化	11,380	206,091.80	-
408	300039	上海凯宝	32,330	205,618.80	-
409	002544	杰赛科技	13,000	204,490.00	-
410	601777	力帆股份	28,162	204,456.12	-
411	600458	时代新材	20,266	204,078.62	-
412	002345	潮宏基	18,840	202,530.00	-
413	600428	中远海特	35,700	200,277.00	-
414	600335	国机汽车	17,813	200,218.12	-
415	300257	开山股份	14,300	200,200.00	-
416	000552	靖远煤电	56,200	197,824.00	-
417	600006	东风汽车	33,700	197,145.00	-
418	002041	登海种业	15,200	195,320.00	-
419	600280	中央商场	24,800	195,176.00	-
420	002123	梦网荣信	18,800	194,580.00	-
421	002005	德豪润达	44,340	193,322.40	-
422	002479	富春环保	19,900	193,229.00	-
423	300291	华录百纳	17,000	192,950.00	-
424	600750	江中药业	7,544	192,221.12	-
425	603658	安图生物	3,600	191,592.00	-
426	002707	众信旅游	17,549	191,108.61	-
427	600580	卧龙电气	23,800	190,638.00	-
428	600059	古越龙山	20,200	189,678.00	-
429	000777	中核科技	12,700	189,230.00	-
430	600395	盘江股份	27,500	188,925.00	-
431	000652	泰达股份	42,810	188,792.10	-
432	000897	津滨发展	55,800	188,604.00	-
433	000990	诚志股份	10,800	186,408.00	-
434	603328	依顿电子	12,900	185,115.00	-
435	002011	盾安环境	23,000	184,920.00	-



436	600517	置信电气	28,300	183,101.00	-
437	600329	中新药业	12,225	181,785.75	-
438	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	-
439	000766	通化金马	13,100	178,160.00	-
440	600757	长江传媒	25,589	177,843.55	-
441	603198	迎驾贡酒	10,100	177,659.00	-
442	600657	信达地产	31,800	177,444.00	-
443	600195	中牧股份	9,000	177,390.00	-
444	002269	美邦服饰	52,750	173,547.50	-
445	001696	宗申动力	27,300	172,536.00	-
446	603355	莱克电气	3,500	172,480.00	-
447	300147	香雪制药	19,110	171,416.70	-
448	603556	海兴电力	4,700	171,080.00	-
449	002325	洪涛股份	35,710	170,336.70	-
450	600628	新世界	16,715	169,991.55	-
451	600862	中航高科	17,400	168,432.00	-
452	600880	博瑞传播	31,900	168,113.00	-
453	002342	巨力索具	28,000	167,720.00	-
454	600894	广日股份	17,900	167,365.00	-
455	002118	紫鑫药业	21,406	160,973.12	-
456	002588	史丹利	23,854	159,583.26	-
457	002093	国脉科技	16,800	159,432.00	-
458	603868	飞科电器	2,100	159,075.00	-
459	300043	星辉娱乐	25,950	158,814.00	-
460	601127	小康股份	7,800	156,858.00	-
461	000662	天夏智慧	10,500	156,135.00	-
462	002190	成飞集成	7,200	155,808.00	-
463	002392	北京利尔	30,800	155,232.00	-
464	600184	光电股份	8,460	154,987.20	-
465	300032	金龙机电	11,000	152,790.00	-
466	603888	新华网	6,450	152,542.50	-
467	000816	智慧农业	46,600	149,586.00	-
468	300010	立思辰	13,265	148,170.05	-
469	600748	上实发展	23,100	148,071.00	-
470	600776	东方通信	20,371	147,282.33	-
471	600292	远达环保	16,387	146,663.65	-
472	600640	号百控股	9,938	145,293.56	-
473	600743	华远地产	39,290	143,801.40	-
474	601020	华钰矿业	6,800	139,536.00	-
475	600481	双良节能	33,412	133,982.12	-
476	002414	高德红外	7,700	129,437.00	-
477	600996	贵广网络	13,000	128,700.00	-

478	002551	尚荣医疗	13,981	128,065.96	-
479	600053	九鼎投资	5,300	126,617.00	-
480	002344	海宁皮城	15,600	123,708.00	-
481	000761	本钢板材	23,600	122,720.00	-
482	002416	爱施德	12,858	121,765.26	-
483	603225	新凤鸣	3,400	121,720.00	-
484	603806	福斯特	3,500	119,350.00	-
485	603568	伟明环保	5,600	117,880.00	-
486	600826	兰生股份	8,705	114,644.85	-
487	000536	华映科技	23,100	114,114.00	-
488	000987	越秀金控	11,500	113,275.00	-
489	600126	杭钢股份	15,900	109,233.00	-
490	603228	景旺电子	2,000	107,540.00	-
491	603169	兰石重装	12,700	106,553.00	-
492	600618	氯碱化工	9,300	100,719.00	-
493	603001	奥康国际	6,735	97,455.45	-
494	603528	多伦科技	10,700	94,481.00	-
495	601811	新华文轩	6,800	91,324.00	-
496	000025	特力 A	2,201	84,760.51	-
497	601969	海南矿业	9,300	82,305.00	-
498	600917	重庆燃气	6,900	76,866.00	-
499	601128	常熟银行	10,500	74,865.00	-
500	002815	崇达技术	2,200	69,432.00	-
501	600939	重庆建工	8,600	63,812.00	-
502	603569	长久物流	2,600	62,894.00	-
503	603877	太平鸟	2,300	62,353.00	-
504	603025	大豪科技	1,900	55,898.00	-
505	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	-
506	002818	富森美	1,700	51,527.00	-
507	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	-
508	300730	科创信息	821	34,112.55	-
509	002919	名臣健康	821	28,948.46	-
510	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	-
511	603161	科华控股	1,239	20,753.25	-
512	603329	上海雅仕	1,182	17,942.76	-
513	002923	润都股份	954	16,227.54	-
514	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	-
515	300684	中石科技	827	11,528.38	-
516	603655	朗博科技	880	8,184.00	-

## 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	6,689,345.00	0.16
2	601012	隆基股份	6,304,040.54	0.15
3	600487	亨通光电	6,279,119.43	0.15
4	600525	长园集团	6,233,138.44	0.15
5	600219	南山铝业	5,963,980.50	0.15
6	600584	长电科技	5,898,932.05	0.14
7	600079	人福医药	5,694,954.90	0.14
8	600522	中天科技	5,604,151.04	0.14
9	600315	上海家化	5,319,185.57	0.13
10	600166	福田汽车	4,972,741.00	0.12
11	600879	航天电子	4,796,371.75	0.12
12	600682	南京新百	4,629,414.38	0.11
13	600521	华海药业	4,348,005.33	0.11
14	600643	爱建集团	4,296,924.76	0.10
15	600176	中国巨石	4,262,315.20	0.10
16	600056	中国医药	4,187,655.00	0.10
17	600266	北京城建	4,185,843.57	0.10
18	600138	中青旅	4,118,184.84	0.10
19	600699	均胜电子	4,100,992.90	0.10
20	600516	方大炭素	4,041,695.00	0.10

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	601012	隆基股份	8,720,793.70	0.21
2	600487	亨通光电	8,039,740.73	0.20
3	600219	南山铝业	6,793,232.00	0.17
4	600201	生物股份	6,527,887.56	0.16
5	600525	长园集团	6,318,298.40	0.15
6	600584	长电科技	5,792,714.36	0.14
7	600643	爱建集团	5,519,229.33	0.13
8	600079	人福医药	5,360,932.48	0.13
9	600516	方大炭素	5,330,375.20	0.13

10	600522	中天科技	5,154,760.96	0.13
11	600315	上海家化	4,954,163.00	0.12
12	600166	福田汽车	4,633,441.84	0.11
13	600699	均胜电子	4,411,885.03	0.11
14	600682	南京新百	4,402,625.98	0.11
15	600879	航天电子	4,219,964.80	0.10
16	600528	中铁工业	4,197,930.49	0.10
17	300136	信维通信	4,163,069.36	0.10
18	600614	鹏起科技	4,152,118.25	0.10
19	600176	中国巨石	4,079,668.80	0.10
20	600521	华海药业	4,031,791.58	0.10

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	886,315,299.33
卖出股票收入 (成交) 总额	866,588,965.77

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

金额单位: 人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	78,072,162.54	1.83
	其中: 政策性金融债	78,072,162.54	1.83
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债 (可交换债)	180,263.43	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	78,252,425.97	1.84

#### 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

金额单位: 人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	108601	国开 1703	782,443	78,072,162.54	1.83
2	110041	蒙电转债	400	40,000.00	0.00
3	128029	太阳转债	311	31,100.00	0.00
4	110040	生益转债	280	30,318.40	0.00
5	123004	铁汉转债	284	28,400.00	0.00

### 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	南方中证 500ETF	股票型	交易型开放式	南方基金管理股份有限公司	3,859,192,327.06	90.50

### 8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

#### 8.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

## 8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注: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	155,266.33
2	应收证券清算款	3,069.47
3	应收股利	1,691.14
4	应收利息	1,948,818.65
5	应收申购款	9,607,622.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	可收退补款	93,471.20
9	其他	-
10	合计	11,809,939.26

### 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	002168	深圳惠程	1,161,344.00	0.03	拟披露重大事项
2	600525	长园集团	897,124.64	0.02	重要事项未公告

## § 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

份额级别	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 (%)
南方 500 联接 A	390,124	6,915.43	79,207,749.15	2.94	2,618,668,006.85	97.06
南方 500C	211	327,799.23	68,107,468.71	98.47	1,058,168.72	1.53
合计	390,335	7,088.89	147,315,217.86	5.32	2,619,726,175.57	94.68

注: 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中, 对下属分级基金, 比例的分母采用各自级别的份额, 对合计数, 比例的分母采用下属分级基金份额的合计数 (即期末基金份额总额)。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

南方中证 500ETF 联接 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	郑林祥	700,000.00	2.02
2	王少琴	555,053.00	1.60
3	姚红伟	529,900.00	1.53
4	牟小勇	515,900.00	1.49
5	薛宜平	459,570.00	1.33
6	张振华	300,000.00	0.87
7	姚坚	272,200.00	0.79
8	梁仿	269,900.00	0.78
9	翟建忠	268,502.00	0.78
10	李鹏	262,700.00	0.76

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	南方中证 500ETF 联接 (LOF) A	3,068,171.07	0.1137
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	1,214.74	0.0018
	合计	3,069,385.81	0.1109

注: 分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中, 对下属分级基金, 比例的

分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

#### 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

项目	份额级别	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	南方中证 500ETF 联接 (LOF)A	>=100
	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C	0~10
	合计	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	南方中证 500ETF 联接 (LOF)A	10~50
	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C	-
	合计	10~50

注: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

项目	南方中证 500ETF 联接 (LOF)A	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C
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	2, 679, 131, 874. 38	-
本报告期基金总申购份额	1, 823, 244, 983. 05	143, 836, 129. 25
减：本报告期基金总赎回份额	1, 804, 501, 101. 43	74, 670, 491. 82
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, 697, 875, 756. 00	69, 165, 637. 43



## § 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

2017 年 1 月 23 日南方基金管理有限公司第七届董事会第二次会议，审议通过秦长奎因任期届满，工作调整的原因不再担任公司副总经理职务。2017 年 12 月 8 日南方基金管理股份有限公司（筹）第一届董事会第一次会议，审议通过聘任史博担任公司副总经理。

本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期未变更会计师事务所。本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 106,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 9 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、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 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公司旗下证券投资基金缴纳增值税及其附加税费的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 30 日
2	南方基金关于旗下部分基金增加深圳农村商业银行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	2017 年 12 月 28 日
3	南方基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 26 日
4	南方基金关于旗下部分基金增加川财证券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	2017 年 12 月 14 日

	的公告		
5	南方基金关于旗下部分基金增加嘉实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	2017 年 12 月 06 日
6	南方基金关于旗下部分基金增加晋中银行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	2017 年 11 月 24 日
7	南方基金关于旗下部分基金增加中国工商银行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	2017 年 11 月 15 日
8	南方基金关于旗下部分基金增加众禄金融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	2017 年 10 月 30 日
9	南方基金关于旗下部分基金增加华泰证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 10 月 24 日
10	南方基金关于旗下部分基金增加联储证券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	2017 年 10 月 13 日
11	南方基金关于旗下部分基金增加蚂蚁基金、天天基金、同花顺、新兰德、陆金所资管和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	2017 年 08 月 07 日
12	南方基金关于旗下部分基金增加盈米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	2017 年 07 月 31 日
13	南方基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低申购金额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 06 月 12 日
14	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 C 类份额并修改基金合同的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 02 月 20 日
15	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 02 月 20 日
16	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 02 月 20 日
17	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)C 类份额开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 02 月 20 日
18	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	2017 年 12 月 30 日
19	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 29 日

	告		
20	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	2017 年 12 月 29 日
21	南方基金关于旗下部分基金增加挖财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	2017 年 12 月 01 日
22	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	2017 年 11 月 14 日
23	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)招募说明书(更新)(2017 年第 2 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 10 月 31 日
24	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)招募说明书(更新)摘要(2017 年第 2 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 10 月 31 日
25	南方基金管理有限公司关于调整旗下部分深圳证券交易所上市开放式基金场内份额持有期规则的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 10 月 14 日
26	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	2017 年 07 月 31 日
27	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	2017 年 07 月 20 日
28	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 07 月 04 日
29	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	2017 年 07 月 03 日
30	南方基金关于旗下部分基金参加浦发银行基金定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 06 月 30 日
31	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	2017 年 05 月 24 日
32	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)招募说明书(更新)摘要(2017 年第 1 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 04 月 28 日
33	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)招募说明书(更新)(2017 年第 1 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 04 月 28 日
34	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	2017 年 04 月 22 日
35	南方基金关于旗下部分基金增加苏	中国证券报、上海证券	2017 年 04 月 10 日

	宁基金、大泰金石为代销机构及开通相关业务的公告	报、证券时报	
36	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	2017 年 04 月 01 日
37	南方基金关于旗下部分基金增加华夏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	2017 年 03 月 15 日
38	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	2017 年 03 月 01 日
39	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	2017 年 02 月 23 日
40	南方基金关于旗下部分基金增加新浪仓石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	2017 年 01 月 18 日
41	南方基金关于旗下部分基金增加肯特瑞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	2017 年 01 月 11 日

## 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	1,188,873,134.75	68.10%	118,887.83	68.10%	
华泰证券	1	556,808,366.02	31.90%	55,686.23	31.90%	
高华证券	1	-	-	-	-	
江海证券	1	-	-	-	-	
中天证券	1	-	-	-	-	
瑞银证券	1	-	-	-	-	
申万宏源	2	-	-	-	-	
英大证券	1	-	-	-	-	
招商证券	1	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	

东兴证券	1	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-
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。

### 11.8.2 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 (%)
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰	102,761.74	0.13	510,000,000.00	100.00	-	-	-	-

君安									
华泰 证券	78,029,054.84	99.87		-	-	-	-	-	-
江海 证券				-	-	-	-	-	-
日信 证券				-	-	-	-	-	-
瑞银 证券				-	-	-	-	-	-
申万 宏源				-	-	-	-	-	-
英大 证券				-	-	-	-	-	-
招商 证券				-	-	-	-	-	-
中泰 证券				-	-	-	-	-	-
中天 证券				-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注:无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注:无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

### 13.2 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。

### 13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>

南方基金管理股份有限公司

2018 年 03 月 29 日