

南方中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 (LOF) 2018 年半年度报告

2018 年 06 月 30 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 08 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 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.....	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	56
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	56

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	56
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	56
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.13 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末上市基金前十名持有人	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	58
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
11.1 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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 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	
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	4,253,238,804.47 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	3,804,706,464.50 份	448,532,339.97 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	2013-02-06
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013-03-15
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	本基金通过投资于目标 ETF, 紧密跟踪业绩比较基准, 追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金, 以中证 500ETF 作为其主要投资标的。为实现投资目标, 本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具, 其目的是为了本基金在应付申购赎回的前提下, 更好地跟踪标的指数。在正常市场情况下, 本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%, 年跟踪误差不得超过 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, 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	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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 01 月 01 日-2018 年 06 月 30 日)	
	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	-6,043,060.86	-1,377,037.72
本期利润	-819,990,553.38	-32,499,528.23
加权平均基金份额本期利润	-0.2409	-0.1146
本期加权平均净值利润率	-16.41%	-7.89%
本期基金份额净值增长率	-15.32%	-15.49%
3.1.2 期末数据	报告期末(2018 年 06 月 30 日)	

和指标		
期末可供分配利润	1,160,389,240.12	136,503,125.45
期末可供分配基金份额利润	0.3050	0.3043
期末基金资产净值	4,965,095,704.62	585,035,465.42
期末基金份额净值	1.3050	1.3043
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2018 年 06 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	42.39%	-17.09%

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-8.52%	1.77%	-8.86%	1.77%	0.34%	0.00%
过去三个月	-13.35%	1.31%	-13.96%	1.31%	0.61%	0.00%
过去六个月	-15.32%	1.37%	-15.71%	1.37%	0.39%	0.00%
过去一年	-13.60%	1.16%	-14.21%	1.16%	0.61%	0.00%
过去三年	-36.53%	1.81%	-39.40%	1.80%	2.87%	0.01%
自基金合同	42.39%	1.64%	47.17%	1.64%	-4.78%	0.00%

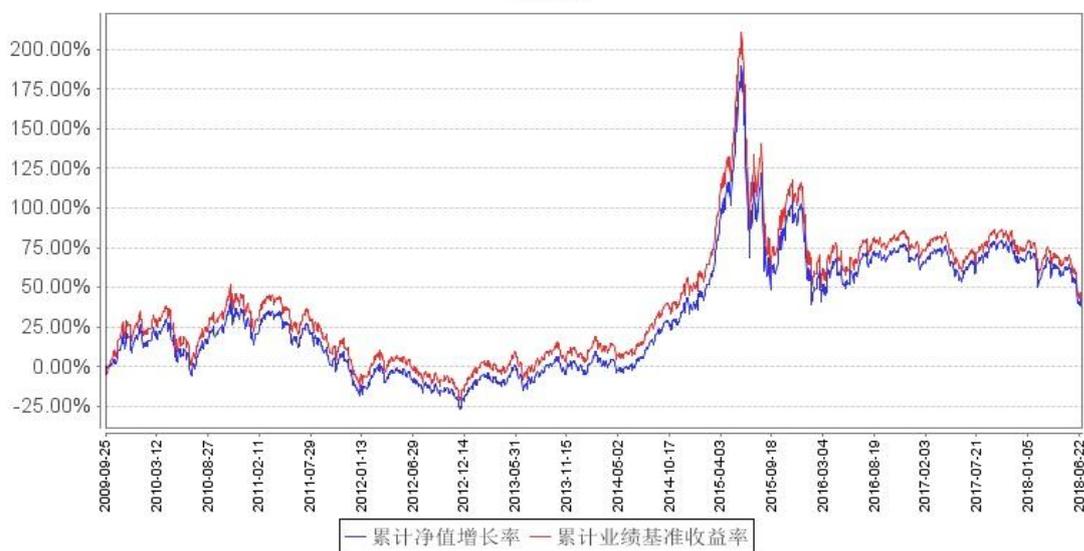
南方中证 500ETF 联接 (LOF) C

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④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	------------	-----	-----

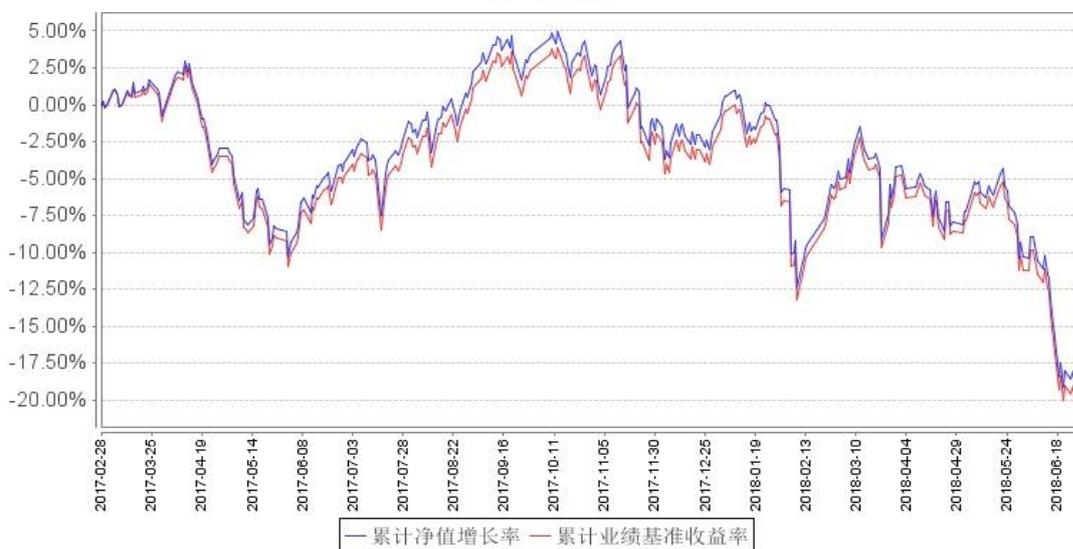
		准差②	率③	率标准差 ④		
过去一个月	-8.55%	1.77%	-8.86%	1.77%	0.31%	0.00%
过去三个月	-13.43%	1.31%	-13.96%	1.31%	0.53%	0.00%
过去六个月	-15.49%	1.37%	-15.71%	1.37%	0.22%	0.00%
过去一年	-13.95%	1.15%	-14.21%	1.16%	0.26%	-0.01%
自基金合同	-17.09%	1.09%	-18.15%	1.09%	1.06%	0.00%

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

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，原收费模式成为 A 类。

§ 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 8,200 亿元, 旗下管理 168 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		
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日		13	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, 具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行, 从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金, 任南方基金量化投资部基金经理助理。2013 年 4 月起担任量化投资部基金经理。现任指数投资部、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、南方 500ETF 基金经理; 2013 年 5 月至今, 任南方 300、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；2018 年 2 月至今，任 H 股 ETF、南方 H 股 ETF 联接基金经理；2018 年 4 月至今，任 MSCI 基金基金经理；2018 年 6 月至今，任 MSCI 联接基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的 5%。

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 16.53%。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）报告期内，我们根据指数每半年度成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金 A 级净值增长率为-15.32%，同期业绩比较基准收益率为-15.71%。本报告期基金 C 级净值增长率为-15.49%，同期业绩比较基准收益率为-15.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年上半年，受到中美贸易战下经济下行的悲观预期和去杠杆持续紧张对企业经营造成的负面冲击等影响，市场出现了震荡探底走势，年初至今经历三波下跌后市场风险得到较为充分的释放。展望下半年市场，权益市场整体无论是指数的估值或是板块的业绩估值性价比均反映出市场内在价值已经到了较优的配置区间，投资价值凸显。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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定, 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, 而 C 类基金份额收取销售服务费, 各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。同一类别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, 本报告期本基金未有分配事项。

4.8 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,南方基金管理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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,南方基金管理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半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 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)

报告截止日:2018 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.4.1	241,723,950.39	157,996,155.57
结算备付金		863,037.19	201,396.65
存出保证金		497,462.35	155,266.33
交易性金融资产	6.4.4.2	5,432,204,438.61	4,118,418,847.97
其中:股票投资		266,069,075.17	180,974,094.94
基金投资		5,123,660,084.87	3,859,192,327.06
债券投资		42,475,278.57	78,252,425.97
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-

应收证券清算款		4,066,243.99	3,069.47
应收利息	6.4.4.5	866,847.87	1,948,818.65
应收股利		1,691.14	1,691.14
应收申购款		11,264,653.91	9,607,622.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	9,353,849.92	93,471.20
资产总计		5,700,842,175.37	4,288,426,339.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		144,349,692.05	14,048,777.45
应付赎回款		5,619,065.34	9,269,575.99
应付管理人报酬		209,473.94	166,641.91
应付托管费		41,894.79	33,328.37
应付销售服务费		175,926.65	34,475.88
应付交易费用	6.4.4.7	65,360.83	17,524.16
应交税费		3.97	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	249,587.76	440,466.56
负债合计		150,711,005.33	24,010,790.32
所有者权益:			
实收基金	6.4.4.9	4,253,238,804.47	2,767,041,393.43
未分配利润	6.4.4.10	1,296,892,365.57	1,497,374,155.70
所有者权益合计		5,550,131,170.04	4,264,415,549.13
负债和所有者权益总计		5,700,842,175.37	4,288,426,339.45

注: 报告截止日 2018 年 6 月 30 日, 基金 A 份额净值 1.3050 元, 基金份额总额 3,804,706,464.50 份; 基金 C 份额净值 1.3043 元, 基金份额总额 448,532,339.97 份。

6.2 利润表

会计主体: 南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)

本报告期: 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日

一、收入		-849,123,891.13	1,709,346.33
1. 利息收入		1,798,575.46	1,006,801.08
其中：存款利息收入	6.4.4.11	988,535.07	877,721.47
债券利息收入		810,040.39	1.88
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	129,077.73
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-7,504,723.57	89,416,689.43
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-12,583,246.00	10,832,445.97
基金投资收益	6.4.4.13	3,505,933.51	77,487,169.22
债券投资收益	6.4.4.14	161,393.72	1,382.62
资产支持证券投资	6.4.4.14.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.4.15	-	-
衍生工具收益	6.4.4.16	-	-
股利收益	6.4.4.17	1,411,195.20	1,095,691.62
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	-845,069,983.03	-90,273,305.37
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.19	1,652,240.01	1,559,161.19
减：二、费用		3,366,190.48	2,372,980.18
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	1,247,735.72	1,051,831.51
2. 托管费	6.4.7.2.2	249,547.14	210,366.29
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	822,261.48	347.80
4. 交易费用	6.4.4.20	774,656.34	867,104.01
5. 利息支出		28,366.76	-
其中：卖出回购金融资产支出		28,366.76	-
6. 税金及附加		0.43	-
7. 其他费用	6.4.4.21	243,622.61	243,330.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-852,490,081.61	-663,633.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-852,490,081.61	-663,633.85

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,767,041,393.43	1,497,374,155.70	4,264,415,549.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-852,490,081.61	-852,490,081.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,486,197,411.04	652,008,291.48	2,138,205,702.52
其中: 1. 基金申购款	2,209,308,174.45	1,016,325,618.88	3,225,633,793.33
2. 基金赎回款	-723,110,763.41	-364,317,327.40	-1,087,428,090.81
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	4,253,238,804.47	1,296,892,365.57	5,550,131,170.04
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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(本期利润)	-	-663,633.85	-663,633.85
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)	229,186,377.16	61,990,948.26	291,177,325.42
其中: 1. 基金申购款	1,196,051,911.41	606,430,143.85	1,802,482,055.26
2. 基金赎回款	-966,865,534.25	-544,439,195.59	-1,511,304,729.84
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)	2,908,318,251.54	1,484,716,754.08	4,393,035,005.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

杨小松

徐超

徐超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

6.4.2 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。

6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b) 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。

(c) 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。

(d) 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。

(e) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.4 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	241,723,950.39
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月及以上	-
其他存款	-
合计	241,723,950.39

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	282,032,079.84	266,069,075.17	-15,963,004.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	42,597,961.90	42,475,278.57
	银行间市场	-	-
	-	-	-
	合计	42,597,961.90	42,475,278.57
资产支持证券	-	-	-
基金	5,659,824,807.88	5,123,660,084.87	-536,164,723.01

其他	-	-	-
合计	5,984,454,849.62	5,432,204,438.61	-552,250,411.01

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

注:无。

6.4.4.4 买入返售金融资产

注:无。

6.4.4.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	44,200.33
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	349.56
应收债券利息	822,096.47
应收资产支持证券利息	-
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	201.51
合计	866,847.87

6.4.4.6 其他资产

单位:人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	-
应收退补款	3,138,690.69
可收退补款	6,215,159.23
合计	9,353,849.92

6.4.4.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	65,360.83
银行间市场应付交易费用	-
-	-

合计	65,360.83
----	-----------

6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	18,503.25
预提费用	231,084.51
合计	249,587.76

6.4.4.9 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 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,697,875,756.00	2,697,875,756.00
本期申购	1,695,921,052.16	1,695,921,052.16
本期赎回(以“-”号填列)	-589,090,343.66	-589,090,343.66
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	3,804,706,464.50	3,804,706,464.50

南方中证 500ETF 联接 (LOF) C

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	69,165,637.43	69,165,637.43
本期申购	513,387,122.29	513,387,122.29
本期赎回(以“-”号填列)	-134,020,419.75	-134,020,419.75
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	448,532,339.97	448,532,339.97

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额

6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

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	2,366,618,396.38	-906,825,129.78	1,459,793,266.60
本期利润	-6,043,060.86	-813,947,492.52	-819,990,553.38
本期基金份额 交易产生的变 动数	970,835,780.78	-450,249,253.88	520,586,526.90
其中：基金申 购款	1,487,786,951.15	-675,633,427.87	812,153,523.28
基金赎 回款	-516,951,170.37	225,384,173.99	-291,566,996.38
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	3,331,411,116.30	-2,171,021,876.18	1,160,389,240.12
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	60,826,312.00	-23,245,422.90	37,580,889.10
本期利润	-1,377,037.72	-31,122,490.51	-32,499,528.23
本期基金份额 交易产生的变 动数	332,981,486.64	-201,559,722.06	131,421,764.58
其中：基金申 购款	450,663,396.25	-246,491,300.65	204,172,095.60
基金赎 回款	-117,681,909.61	44,931,578.59	-72,750,331.02
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	392,430,760.92	-255,927,635.47	136,503,125.45

6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	902,882.66
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	18,930.33
其他	66,722.08
合计	988,535.07

6.4.4.12 股票投资收益

6.4.4.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,336,603.91
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-16,919,849.91
合计	-12,583,246.00

6.4.4.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
卖出股票成交总额	376,347,257.95
减：卖出股票成本总额	372,010,654.04
买卖股票差价收入	4,336,603.91

6.4.4.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
申购基金份额总额	2,175,923,760.00
减：现金支付申购款总额	1,200,424,601.51
减：申购股票成本总额	992,419,008.40
-	-
申购差价收入	-16,919,849.91

6.4.4.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	87,401,702.96
减：卖出/赎回基金成本总额	83,895,769.45
基金投资收益	3,505,933.51

6.4.4.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	166,100,320.61
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	162,406,938.77
减：应收利息总额	3,531,988.12

买卖债券差价收入	161,393.72
----------	------------

6.4.4.14.1 资产支持证券投资收益

注:无。

6.4.4.15 贵金属投资收益

注:无。

6.4.4.16 衍生工具收益

注:无。

6.4.4.17 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,411,195.20
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,411,195.20

6.4.4.18 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-845,069,983.03
股票投资	-13,397,463.82
债券投资	-208,102.93
资产支持证券投资	-
基金投资	-831,464,416.28
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
-	-
3. 其他	-
减:应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-845,069,983.03

6.4.4.19 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
----	----------------------------

基金赎回费收入	1,651,439.29
补差费归资产	800.72
合计	1,652,240.01

注:本基金场内部分的赎回费率为 0.50%, 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。

6.4.4.20 交易费用

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	718,931.35
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	55,724.99
其中: 申购费	-
赎回费	-
其他	55,724.99
-	-
合计	774,656.34

6.4.4.21 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	52,564.21
信息披露费	148,767.52
银行费用	12,538.10
上市费	29,752.78
合计	243,622.61

6.4.4.22 分部报告

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日, 本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
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
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。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华泰证券	462,758,063.27	25.74	443,607,740.85	34.17

6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	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 成交总额的比例 (%)
华泰证券	174,516,636.39	60.75	0.00	0.00

6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
华泰证券	105,361,000.00	38.43	0.00	0.00

6.4.7.1.4 基金交易

注:无。

6.4.7.1.5 权证交易

注:无。

6.4.7.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总额的 比例 (%)
华泰证券	46,280.12	25.74	23,173.26	35.45
关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总额的 比例 (%)
华泰证券	44,365.41	34.17	11,170.20	13.07

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。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,247,735.72	1,051,831.51
其中：支付销售机构的客户维护费	2,395,722.54	1,242,108.66

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。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	249,547.14	210,366.29

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。

6.4.7.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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	-	812,679.03	812,679.03
华泰证券	-	68.59	68.59
合计	-	812,747.62	812,747.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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	-	346.86	346.86
华泰证券	-	-	-
合计	-	346.86	346.86

注:支付销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值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。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30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	39,873,972.73	-
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	50,195.00	-
期末持有的基金份额	39,823,777.73	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.9363%	-
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	1.8200%	-

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	241,723,950.39	902,882.66	240,144,230.23	818,740.80

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。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

6.4.7.7.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 926,973,402.00 份目标 ETF 基金份额(于 2017 年 12 月 31 日：585,773,402 份)，占其份额的比例为 21.16%(于 2017 年 12 月 31 日：20.84%)。

6.4.7.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期交易基金产生的申购费(元)	-	-
当期交易基金产生的赎回费(元)	-	-
当期持有基金产生的应支付销售服	-	-

务费 (元)		
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	12,163,985.29	9,772,436.67
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	2,432,797.06	1,954,487.33
当期交易基金产生的其他费用 (元)	55,724.99	39,155.70

注: 申购费、赎回费是实际产生的费用, 销售服务费、管理费和托管费等其他费用为估算费用。

6.4.8 利润分配情况

注: 无。

6.4.9 期末 (2018 年 06 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位: 人民币元

6.4.12.1.1 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
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新股认购	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股认购	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位: 人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000426	兴业矿业	2018-06-18	重大事项	7.21	-	-	46,300	404,265.15	333,823.00	-
000566	海南海药	2017-11-22	重大资产重组	12.89	2018-07-09	11.43	24,290	316,470.04	313,098.10	-
000587	金洲慈航	2018-06-15	重大事项	4.96	2018-07-02	4.46	42,800	310,990.33	212,288.00	-
000669	金鸿控股	2018-05-18	重大资产重组	7.25	2018-08-06	6.53	18,054	164,938.22	130,891.50	-
000693	*ST 华泽	2018-04-30	未及时披露定	3.31	-	-	16,900	250,450.70	55,939.00	-

			期报 告								
000825	太钢 不锈	2018-04-16	重大 资产 重组	6.00	-	-	160,200	898,164.67	961,200.00	-	
000939	*ST 凯迪	2017-11-16	实行 退市 风险 警示 公告	4.99	2018-07-02	4.74	47,600	271,806.05	237,524.00	-	
002005	德豪 润达	2018-01-01	重大 资产 重组	4.36	2018-07-02	3.92	44,340	233,226.97	193,322.40	-	
002011	盾安 环境	2018-04-30	重大 资产 重组	6.40	-	-	38,600	294,311.24	247,040.00	-	
002051	中工 国际	2018-04-05	重大 资产 重组	15.27	-	-	39,022	683,078.14	595,865.94	-	
002147	新光 圆成	2018-01-18	重大 资产 重组	14.76	-	-	18,030	225,840.88	266,122.80	-	
002359	北讯 集团	2018-05-21	拟披 露重 大事 项	19.58	2018-08-21	17.62	20,640	517,214.31	404,131.20	-	
002408	齐翔 腾达	2018-06-18	重大 资产 重组	12.28	-	-	54,920	712,649.16	674,417.60	-	
002426	胜利 精密	2018-06-18	拟披 露重 大事 项	3.60	2018-07-03	3.26	127,800	510,092.00	460,080.00	-	
002431	棕榈 股份	2018-05-30	重大 事项	6.71	-	-	39,550	323,464.45	265,380.50	-	
002437	誉衡 药业	2018-06-11	重大 资产 重组	6.20	2018-08-13	5.57	53,200	371,574.46	329,840.00	-	
002477	雏鹰 农牧	2018-06-14	重大 事项	3.31	-	-	109,500	431,385.08	362,445.00	-	
002512	达华 智能	2018-06-18	拟披 露重 大事 项	9.70	-	-	40,700	504,455.79	394,790.00	-	

002573	清新环境	2018-06-18	拟披露重大事 项	11.55	-	-	39,908	617,322.30	460,937.40	-
002665	首航节能	2018-05-29	重大资产 重组	5.80	-	-	48,300	323,566.39	280,140.00	-
002699	美盛文化	2018-02-05	重大资产 重组	18.76	2018-07-02	16.88	15,280	269,076.21	286,652.80	-
300146	汤臣倍健	2018-01-31	重大资产 重组	16.60	2018-07-31	16.50	38,400	556,154.73	637,440.00	-
300197	铁汉生态	2018-05-28	重大资产 重组	5.37	-	-	52,050	377,925.57	279,508.50	-
300266	兴源环境	2018-02-05	重大资产 重组	19.99	2018-07-02	11.96	35,028	896,179.27	700,209.72	-
300324	旋极信息	2018-05-30	重大资产 重组	9.49	-	-	33,568	381,835.88	318,560.32	-
600022	山东钢铁	2018-03-27	重大资产 重组	2.02	2018-08-16	1.83	371,560	781,024.87	750,551.20	-
600086	东方金钰	2018-01-19	重大资产 重组	10.04	-	-	4,000	40,160.00	40,160.00	-
600158	中体产业	2018-03-27	拟筹划重 大资产重 组	11.64	2018-07-16	11.59	38,700	443,604.65	450,468.00	-
600750	江中药业	2018-04-30	重大资产 重组	17.75	2018-08-01	16.12	17,135	297,345.58	304,146.25	-
600751	天海投资	2018-01-12	拟筹划重 大资产重 组	6.49	-	-	8,000	51,920.00	51,920.00	-
600759	洲际油气	2018-03-27	重大资产 重组	3.94	-	-	64,200	238,878.36	252,948.00	-

注:本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注:无。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

6.4.10.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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 2018 年 6 月 30 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 0.77%。

6.4.10.3 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 6.4.12 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 2018 年 6 月 30 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。

6.4.10.3.1 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上市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,部分基金资产流通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。

6.4.10.4 市场风险

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

6.4.10.4.1 利率风险

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

本基金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。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	241,723,950.39	-	-	-	241,723,950.39
结算备付金	863,037.19	-	-	-	863,037.19
存出保证金	497,462.35	-	-	-	497,462.35
交易性金融资产	42,475,278.57	-	-	5,389,729,160.04	5,432,204,438.61
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	866,847.87	866,847.87
应收股利	-	-	-	1,691.14	1,691.14
应收申购款	1,925,103.84	-	-	9,339,550.07	11,264,653.91
应收证券清算款	-	-	-	4,066,243.99	4,066,243.99
其他资产	-	-	-	9,353,849.92	9,353,849.92
资产总计	287,484,832.34	-	-	5,413,357,343.03	5,700,842,175.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,619,065.34	5,619,065.34
应付管理人报酬	-	-	-	209,473.94	209,473.94
应付托管费	-	-	-	41,894.79	41,894.79

应付证券清算款	-	-	-	144,349,692.05	144,349,692.05
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	175,926.65	175,926.65
应付交易费用	-	-	-	65,360.83	65,360.83
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3.97	3.97
其他负债	-	-	-	249,587.76	249,587.76
负债总计	-	-	-	150,711,005.33	150,711,005.33
利率敏感度缺口	287,484,832.34	-	-	-5,262,646,337.70	5,550,131,170.04
上年度末 2017 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	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
资产总计	237,425,863.95	49,150.60	131,112.83	4,050,820,212.07	4,288,426,339.45
负债					
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
负债总计	-	-	-	24,010,790.32	24,010,790.32
利率敏感度缺口	237,425,863.95	49,150.60	131,112.83	4,026,809,421.75	4,264,415,549.13

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

6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2018 年 6 月 30 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 0.77% (2017 年 12 月 31 日：1.84%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2017 年 12 月 31 日：同)。

6.4.10.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.10.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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。

6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	266,069,075.17	4.79	180,974,094.94	4.24
交易性金融资产—基金投资	5,123,660,084.87	92.32	3,859,192,327.06	90.50

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	5,389,729,160.04	97.11	4,040,166,422.00	94.74

6.4.10.4.3.2 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(2018年6月30日)	上年度末(2017年12月31日)
分析	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	267,360,392.11	215,378,454.23
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-267,360,392.11	-215,378,454.23

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	266,069,075.17	4.67
	其中:股票	266,069,075.17	4.67
2	基金投资	5,123,660,084.87	89.88
3	固定收益投资	42,475,278.57	0.75
	其中:债券	42,475,278.57	0.75
	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	242,586,987.58	4.26

8	其他各项资产	26,050,749.18	0.46
9	合计	5,700,842,175.37	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,892,042.30	0.05
B	采矿业	8,402,323.27	0.15
C	制造业	159,377,307.63	2.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,063,518.50	0.15
E	建筑业	3,890,482.45	0.07
F	批发和零售业	12,559,224.80	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	7,764,938.34	0.14
H	住宿和餐饮业	1,385,235.72	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,793,043.43	0.46
J	金融业	6,877,075.01	0.12
K	房地产业	13,711,745.95	0.25
L	租赁和商务服务业	5,375,386.31	0.10
M	科学研究和技术服务业	214,402.50	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	2,043,026.92	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	197,778.00	0.00
Q	卫生和社会工作	457,703.77	0.01
R	文化、体育和娱乐业	5,037,312.17	0.09
S	综合	2,026,528.10	0.04
	合计	266,069,075.17	4.79

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	000661	长春高新	12,180	2,773,386.00	0.05
2	002049	紫光国微	37,700	1,663,324.00	0.03
3	603444	吉比特	12,669	1,618,971.51	0.03
4	000977	浪潮信息	66,900	1,595,565.00	0.03

5	002410	广联达	56,800	1,575,064.00	0.03
6	000830	鲁西化工	86,310	1,474,174.80	0.03
7	603019	中科曙光	31,900	1,463,253.00	0.03
8	000703	恒逸石化	97,937	1,457,302.56	0.03
9	600201	生物股份	85,212	1,456,273.08	0.03
10	600426	华鲁恒升	82,123	1,444,543.57	0.03
11	600521	华海药业	53,126	1,417,932.94	0.03
12	002038	双鹭药业	36,850	1,399,931.50	0.03
13	002340	格林美	229,994	1,391,463.70	0.03
14	300383	光环新网	99,240	1,330,808.40	0.02
15	603589	口子窖	21,237	1,305,013.65	0.02
16	002078	太阳纸业	134,300	1,301,367.00	0.02
17	600298	安琪酵母	36,057	1,286,513.76	0.02
18	002589	瑞康医药	91,780	1,251,879.20	0.02
19	002179	中航光电	32,089	1,251,471.00	0.02
20	002129	中环股份	156,400	1,224,612.00	0.02
21	000860	顺鑫农业	32,284	1,210,650.00	0.02
22	000418	小天鹅 A	17,433	1,208,978.55	0.02
23	600256	广汇能源	292,491	1,196,288.19	0.02
24	600872	中炬高新	41,782	1,169,896.00	0.02
25	600584	长电科技	68,443	1,159,424.42	0.02
26	000581	威孚高科	51,500	1,138,665.00	0.02
27	600600	青岛啤酒	25,662	1,124,765.46	0.02
28	002268	卫士通	51,494	1,124,114.02	0.02
29	601233	桐昆股份	64,680	1,113,789.60	0.02
30	600673	东阳光科	107,691	1,112,448.03	0.02
31	600879	航天电子	158,100	1,111,443.00	0.02
32	002465	海格通信	138,000	1,108,140.00	0.02
33	000656	金科股份	229,900	1,103,520.00	0.02
34	000066	中国长城	151,132	1,074,548.52	0.02
35	002092	中泰化学	110,100	1,061,364.00	0.02
36	600760	中航黑豹	29,000	1,045,160.00	0.02
37	000690	宝新能源	149,600	1,041,216.00	0.02
38	002223	鱼跃医疗	52,416	1,021,587.84	0.02
39	000488	晨鸣纸业	77,946	1,007,062.32	0.02
40	002127	南极电商	106,350	998,626.50	0.02
41	600642	申能股份	197,300	990,446.00	0.02
42	300315	掌趣科技	235,300	983,554.00	0.02
43	000039	中集集团	73,800	980,064.00	0.02
44	002195	二三四五	228,960	979,948.80	0.02
45	600315	上海家化	24,553	973,035.39	0.02
46	000596	古井贡酒	10,900	967,702.00	0.02

47	002176	江特电机	99,305	965,244.60	0.02
48	600258	首旅酒店	35,460	963,448.20	0.02
49	000825	太钢不锈	160,200	961,200.00	0.02
50	300418	昆仑万维	50,900	960,992.00	0.02
51	300253	卫宁健康	76,972	953,683.08	0.02
52	600392	盛和资源	58,700	952,701.00	0.02
53	300166	东方国信	64,499	950,070.27	0.02
54	002439	启明星辰	44,668	947,854.96	0.02
55	000636	风华高科	59,500	944,860.00	0.02
56	600885	宏发股份	31,503	942,569.76	0.02
57	000887	中鼎股份	64,900	935,209.00	0.02
58	002013	中航机电	123,533	935,144.81	0.02
59	600325	华发股份	120,868	934,309.64	0.02
60	600884	杉杉股份	42,200	932,620.00	0.02
61	000997	新大陆	59,040	929,880.00	0.02
62	002019	亿帆医药	52,600	928,390.00	0.02
63	002110	三钢闽光	57,700	924,931.00	0.02
64	002384	东山精密	38,400	921,600.00	0.02
65	000513	丽珠集团	20,909	918,950.55	0.02
66	300088	长信科技	155,700	903,060.00	0.02
67	600079	人福医药	68,167	901,167.74	0.02
68	000750	国海证券	251,100	896,427.00	0.02
69	000009	中国宝安	182,441	893,960.90	0.02
70	000999	华润三九	31,800	884,994.00	0.02
71	000778	新兴铸管	205,200	878,256.00	0.02
72	601168	西部矿业	137,200	861,616.00	0.02
73	000975	银泰资源	84,160	853,382.40	0.02
74	000930	中粮生化	82,500	849,750.00	0.02
75	000960	锡业股份	70,700	849,107.00	0.02
76	000681	视觉中国	29,300	840,910.00	0.02
77	002373	千方科技	64,400	840,420.00	0.02
78	600718	东软集团	64,187	838,282.22	0.02
79	002183	怡亚通	126,000	837,900.00	0.02
80	603369	今世缘	36,619	836,011.77	0.02
81	300182	捷成股份	110,100	834,558.00	0.02
82	002221	东华能源	84,100	821,657.00	0.01
83	000732	泰禾集团	42,200	820,790.00	0.01
84	002506	协鑫集成	174,800	818,064.00	0.01
85	600528	中铁工业	80,000	817,600.00	0.01
86	000729	燕京啤酒	121,400	817,022.00	0.01
87	600138	中青旅	40,557	808,301.01	0.01
88	002640	跨境通	53,500	803,570.00	0.01

89	600260	凯乐科技	29,600	794,464.00	0.01
90	600967	内蒙一机	61,800	787,332.00	0.01
91	000686	东北证券	121,100	776,251.00	0.01
92	002407	多氟多	55,250	774,605.00	0.01
93	002174	游族网络	38,900	774,110.00	0.01
94	600643	爱建集团	82,185	772,539.00	0.01
95	300274	阳光电源	85,760	769,267.20	0.01
96	600839	四川长虹	266,700	762,762.00	0.01
97	000988	华工科技	52,500	758,625.00	0.01
98	600060	海信电器	56,210	752,651.90	0.01
99	600022	山东钢铁	371,560	750,551.20	0.01
100	002371	北方华创	15,100	750,017.00	0.01
101	600808	马钢股份	208,801	749,595.59	0.01
102	600062	华润双鹤	30,430	747,056.50	0.01
103	002273	水晶光电	57,960	745,945.20	0.01
104	002028	思源电气	44,318	744,099.22	0.01
105	002603	以岭药业	52,500	733,950.00	0.01
106	002670	国盛金控	68,063	733,038.51	0.01
107	002491	通鼎互联	65,806	728,472.42	0.01
108	000528	柳工	67,755	725,656.05	0.01
109	600056	中国医药	39,668	724,734.36	0.01
110	000401	冀东水泥	81,160	719,889.20	0.01
111	300010	立思辰	58,465	715,611.60	0.01
112	600160	巨化股份	97,606	714,475.92	0.01
113	600143	金发科技	136,800	714,096.00	0.01
114	002358	森源电气	47,058	708,222.90	0.01
115	002030	达安基因	45,916	708,024.72	0.01
116	300287	飞利信	97,682	702,333.58	0.01
117	300266	兴源环境	35,028	700,209.72	0.01
118	600282	南钢股份	158,400	700,128.00	0.01
119	002244	滨江集团	134,300	698,360.00	0.01
120	000807	云铝股份	134,800	698,264.00	0.01
121	600572	康恩贝	97,297	697,619.49	0.01
122	600655	豫园股份	73,446	694,064.70	0.01
123	600410	华胜天成	79,133	692,413.75	0.01
124	600460	士兰微	56,500	689,300.00	0.01
125	600183	生益科技	75,165	688,511.40	0.01
126	600166	福田汽车	337,500	685,125.00	0.01
127	000878	云南铜业	71,600	683,064.00	0.01
128	002399	海普瑞	30,800	681,912.00	0.01
129	600388	龙净环保	52,910	676,189.80	0.01
130	002440	闰土股份	57,825	675,974.25	0.01

131	601098	中南传媒	53,400	674,976.00	0.01
132	002408	齐翔腾达	54,920	674,417.60	0.01
133	002281	光迅科技	31,700	672,040.00	0.01
134	000970	中科三环	71,800	671,330.00	0.01
135	002368	太极股份	23,062	670,412.34	0.01
136	002517	恺英网络	93,200	670,108.00	0.01
137	600380	健康元	56,500	670,090.00	0.01
138	600755	厦门国贸	91,500	667,035.00	0.01
139	000547	航天发展	84,761	661,983.41	0.01
140	603077	和邦生物	382,620	661,932.60	0.01
141	600094	大名城	114,860	661,593.60	0.01
142	000089	深圳机场	86,300	660,195.00	0.01
143	002583	海能达	79,000	659,650.00	0.01
144	000078	海王生物	136,307	655,636.67	0.01
145	002353	杰瑞股份	40,300	654,875.00	0.01
146	600409	三友化工	75,931	653,765.91	0.01
147	002299	圣农发展	42,070	651,664.30	0.01
148	002745	木林森	36,500	649,335.00	0.01
149	000028	国药一致	13,011	649,248.90	0.01
150	300113	顺网科技	37,200	647,652.00	0.01
151	002563	森马服饰	44,700	639,210.00	0.01
152	603816	顾家家居	8,688	638,654.88	0.01
153	300146	汤臣倍健	38,400	637,440.00	0.01
154	002280	联络互动	111,300	636,636.00	0.01
155	600895	张江高科	55,300	635,950.00	0.01
156	300058	蓝色光标	111,500	635,550.00	0.01
157	600291	西水股份	47,560	635,401.60	0.01
158	600266	北京城建	67,369	633,268.60	0.01
159	600348	阳泉煤业	88,400	632,060.00	0.01
160	002672	东江环保	48,050	628,974.50	0.01
161	600418	江淮汽车	96,568	628,657.68	0.01
162	300133	华策影视	59,000	628,350.00	0.01
163	000553	沙隆达 A	39,600	626,076.00	0.01
164	002004	华邦健康	122,400	621,792.00	0.01
165	002366	台海核电	43,600	621,736.00	0.01
166	002152	广电运通	105,600	620,928.00	0.01
167	000598	兴蓉环境	152,700	619,962.00	0.01
168	603885	吉祥航空	40,100	617,941.00	0.01
169	600787	中储股份	78,989	611,374.86	0.01
170	600240	华业资本	82,661	605,905.13	0.01
171	300055	万邦达	52,700	605,523.00	0.01
172	002131	利欧股份	287,377	603,491.70	0.01

173	603899	晨光文具	18,977	601,381.13	0.01
174	600875	东方电气	80,700	597,987.00	0.01
175	002051	中工国际	39,022	595,865.94	0.01
176	600978	宜华生活	86,945	593,834.35	0.01
177	002600	领益智造	114,400	593,736.00	0.01
178	600827	百联股份	58,000	591,600.00	0.01
179	600267	海正药业	40,605	590,396.70	0.01
180	600511	国药股份	21,871	589,423.45	0.01
181	300115	长盈精密	45,190	586,114.30	0.01
182	002191	劲嘉股份	78,300	584,901.00	0.01
183	300308	中际旭创	9,700	582,388.00	0.01
184	000979	中弘股份	575,148	580,899.48	0.01
185	600161	天坛生物	29,971	579,938.85	0.01
186	002690	美亚光电	24,300	579,312.00	0.01
187	300199	翰宇药业	40,300	575,484.00	0.01
188	002916	深南电路	9,000	571,590.00	0.01
189	000685	中山公用	71,540	570,173.80	0.01
190	600737	中粮糖业	75,300	567,762.00	0.01
191	600270	外运发展	27,001	565,940.96	0.01
192	600525	长园集团	53,286	563,233.02	0.01
193	002831	裕同科技	11,219	560,950.00	0.01
194	300026	红日药业	153,600	560,640.00	0.01
195	600649	城投控股	90,900	556,308.00	0.01
196	601872	招商轮船	153,700	554,857.00	0.01
197	300159	新研股份	78,200	553,656.00	0.01
198	002709	天赐材料	14,300	551,122.00	0.01
199	000848	承德露露	51,560	546,020.40	0.01
200	601966	玲珑轮胎	34,576	545,263.52	0.01
201	600125	铁龙物流	65,000	544,050.00	0.01
202	600466	蓝光发展	87,640	543,368.00	0.01
203	000031	中粮地产	94,000	543,320.00	0.01
204	002701	奥瑞金	99,500	543,270.00	0.01
205	002285	世联行	86,100	539,847.00	0.01
206	000758	中色股份	119,500	537,750.00	0.01
207	002317	众生药业	50,500	533,785.00	0.01
208	000738	航发控制	39,800	530,534.00	0.01
209	600729	重庆百货	16,096	530,363.20	0.01
210	600037	歌华有线	51,300	529,416.00	0.01
211	600801	华新水泥	35,200	529,056.00	0.01
212	600500	中化国际	76,819	523,905.58	0.01
213	600575	皖江物流	140,700	521,997.00	0.01
214	600635	大众公用	139,900	520,428.00	0.01

215	600277	亿利洁能	99,270	520,174.80	0.01
216	002390	信邦制药	70,600	516,792.00	0.01
217	600435	北方导航	63,098	514,879.68	0.01
218	600648	外高桥	27,966	511,218.48	0.01
219	002266	浙富控股	136,000	510,000.00	0.01
220	002128	露天煤业	55,700	504,642.00	0.01
221	601179	中国西电	147,300	503,766.00	0.01
222	002505	大康农业	234,400	501,616.00	0.01
223	000027	深圳能源	100,200	494,988.00	0.01
224	002444	巨星科技	44,718	492,345.18	0.01
225	002056	横店东磁	69,900	489,999.00	0.01
226	002250	联化科技	55,327	487,984.14	0.01
227	002155	湖南黄金	71,100	486,324.00	0.01
228	300002	神州泰岳	116,500	485,805.00	0.01
229	600171	上海贝岭	41,900	485,202.00	0.01
230	002400	省广集团	149,720	483,595.60	0.01
231	600598	北大荒	52,700	482,732.00	0.01
232	000926	福星股份	67,100	482,449.00	0.01
233	002332	仙琚制药	54,950	480,812.50	0.01
234	300001	特锐德	42,288	480,391.68	0.01
235	002839	张家港行	78,800	479,892.00	0.01
236	600307	酒钢宏兴	227,800	478,380.00	0.01
237	601678	滨化股份	77,246	477,380.28	0.01
238	000813	德展健康	57,900	477,096.00	0.01
239	600863	内蒙华电	210,000	476,700.00	0.01
240	000006	深振业 A	81,300	476,418.00	0.01
241	002212	南洋股份	39,800	473,222.00	0.01
242	600859	王府井	22,200	472,194.00	0.01
243	002242	九阳股份	26,600	470,554.00	0.01
244	000718	苏宁环球	128,100	470,127.00	0.01
245	600021	上海电力	69,600	469,104.00	0.01
246	000012	南玻 A	94,605	468,294.75	0.01
247	600064	南京高科	63,760	467,998.40	0.01
248	002233	塔牌集团	40,900	467,896.00	0.01
249	000667	美好置业	219,300	467,109.00	0.01
250	002180	纳思达	17,000	466,820.00	0.01
251	002573	清新环境	39,908	460,937.40	0.01
252	600717	天津港	61,155	460,497.15	0.01
253	002426	胜利精密	127,800	460,080.00	0.01
254	600563	法拉电子	9,267	458,623.83	0.01
255	600823	世茂股份	109,500	457,710.00	0.01
256	300244	迪安诊断	24,077	457,703.77	0.01

257	601128	常熟银行	80,000	457,600.00	0.01
258	000519	中兵红箭	58,600	455,322.00	0.01
259	000563	陕国投 A	133,700	454,580.00	0.01
260	600503	华丽家族	115,700	452,387.00	0.01
261	600158	中体产业	38,700	450,468.00	0.01
262	002635	安洁科技	25,850	444,620.00	0.01
263	600582	天地科技	120,634	442,726.78	0.01
264	600835	上海机电	23,400	441,324.00	0.01
265	300257	开山股份	28,800	440,352.00	0.01
266	000021	深科技	64,500	439,890.00	0.01
267	600120	浙江东方	32,391	438,898.05	0.01
268	600881	亚泰集团	117,661	438,875.53	0.01
269	000727	华东科技	232,900	437,852.00	0.01
270	002022	科华生物	36,900	437,265.00	0.01
271	601880	大连港	224,360	435,258.40	0.01
272	002807	江阴银行	77,100	433,302.00	0.01
273	300376	易事特	80,500	432,285.00	0.01
274	002254	泰和新材	37,900	431,302.00	0.01
275	002249	大洋电机	100,000	431,000.00	0.01
276	600039	四川路桥	131,140	430,139.20	0.01
277	000612	焦作万方	81,800	429,450.00	0.01
278	002354	天神娱乐	46,160	427,441.60	0.01
279	002424	贵州百灵	37,600	427,136.00	0.01
280	600754	锦江股份	11,412	421,787.52	0.01
281	300297	蓝盾股份	51,600	418,476.00	0.01
282	603883	老百姓	5,000	415,800.00	0.01
283	002707	众信旅游	42,949	412,310.40	0.01
284	603658	安图生物	5,000	412,300.00	0.01
285	600026	中远海能	97,100	411,704.00	0.01
286	000400	许继电气	52,700	411,587.00	0.01
287	000543	皖能电力	93,120	410,659.20	0.01
288	002064	华峰氨纶	99,300	410,109.00	0.01
289	601200	上海环境	25,859	409,347.97	0.01
290	600594	益佰制药	45,634	408,880.64	0.01
291	600936	广西广电	85,400	406,504.00	0.01
292	002841	视源股份	7,600	405,916.00	0.01
293	002359	北讯集团	20,640	404,131.20	0.01
294	002512	达华智能	40,700	394,790.00	0.01
295	002544	杰赛科技	28,800	394,272.00	0.01
296	002434	万里扬	44,800	393,344.00	0.01
297	600004	白云机场	30,000	392,700.00	0.01
298	000712	锦龙股份	39,100	390,218.00	0.01

299	000090	天健集团	62,712	388,814.40	0.01
300	002277	友阿股份	84,200	388,162.00	0.01
301	600908	无锡银行	65,900	388,151.00	0.01
302	000501	鄂武商 A	31,430	386,274.70	0.01
303	000158	常山北明	56,160	385,819.20	0.01
304	002657	中科金财	24,300	384,912.00	0.01
305	600098	广州发展	59,300	382,485.00	0.01
306	002048	宁波华翔	30,900	380,997.00	0.01
307	000592	平潭发展	133,700	379,708.00	0.01
308	000937	冀中能源	92,200	378,942.00	0.01
309	600329	中新药业	19,846	377,074.00	0.01
310	000980	众泰汽车	53,000	376,830.00	0.01
311	002308	威创股份	45,300	375,990.00	0.01
312	002073	软控股份	65,363	375,837.25	0.01
313	002463	沪电股份	99,200	371,008.00	0.01
314	600557	康缘药业	30,026	370,821.10	0.01
315	002815	崇达技术	23,000	370,300.00	0.01
316	002509	天广中茂	126,800	368,988.00	0.01
317	600597	光明乳业	37,321	368,358.27	0.01
318	601717	郑煤机	63,092	366,564.52	0.01
319	000877	天山股份	54,200	365,850.00	0.01
320	600993	马应龙	21,355	363,248.55	0.01
321	002477	雏鹰农牧	109,500	362,445.00	0.01
322	002503	搜于特	103,200	361,200.00	0.01
323	600580	卧龙电气	46,831	356,852.22	0.01
324	603515	欧普照明	7,551	352,933.74	0.01
325	300156	神雾环保	52,700	351,509.00	0.01
326	600280	中央商场	40,100	349,672.00	0.01
327	603198	迎驾贡酒	19,000	349,030.00	0.01
328	601016	节能风电	121,213	347,881.31	0.01
329	000762	西藏矿业	35,700	343,791.00	0.01
330	002345	潮宏基	39,440	339,184.00	0.01
331	600195	中牧股份	17,400	338,430.00	0.01
332	000062	深圳华强	17,200	337,120.00	0.01
333	002681	奋达科技	38,900	336,874.00	0.01
334	000572	海马汽车	97,891	335,766.13	0.01
335	002002	鸿达兴业	72,700	335,147.00	0.01
336	000426	兴业矿业	46,300	333,823.00	0.01
337	000969	安泰科技	53,300	333,125.00	0.01
338	000600	建投能源	59,600	331,972.00	0.01
339	000541	佛山照明	55,230	330,827.70	0.01
340	601928	凤凰传媒	54,400	330,752.00	0.01

341	002437	誉衡药业	53,200	329,840.00	0.01
342	600770	综艺股份	55,888	329,739.20	0.01
343	601689	拓普集团	16,900	328,536.00	0.01
344	002093	国脉科技	42,600	328,446.00	0.01
345	002489	浙江永强	89,950	327,418.00	0.01
346	600499	科达洁能	47,447	325,486.42	0.01
347	600694	大商股份	9,991	324,807.41	0.01
348	601608	中信重工	124,800	324,480.00	0.01
349	000990	诚志股份	23,100	323,400.00	0.01
350	002428	云南锗业	41,843	323,027.96	0.01
351	600108	亚盛集团	111,500	322,235.00	0.01
352	601801	皖新传媒	42,100	320,381.00	0.01
353	002302	西部建设	29,700	319,869.00	0.01
354	603659	璞泰来	5,000	319,450.00	0.01
355	002818	富森美	12,100	319,198.00	0.01
356	300324	旋极信息	33,568	318,560.32	0.01
357	000552	靖远煤电	97,400	318,498.00	0.01
358	600317	营口港	140,500	317,530.00	0.01
359	600073	上海梅林	47,600	316,064.00	0.01
360	002251	步步高	27,759	315,897.42	0.01
361	000536	华映科技	114,700	315,425.00	0.01
362	002276	万马股份	53,700	313,608.00	0.01
363	600259	广晟有色	10,700	313,296.00	0.01
364	000566	海南海药	24,290	313,098.10	0.01
365	600611	大众交通	78,404	312,047.92	0.01
366	000049	德赛电池	11,007	310,617.54	0.01
367	000829	天音控股	42,300	310,059.00	0.01
368	600565	迪马股份	105,000	309,750.00	0.01
369	002414	高德红外	23,011	309,267.84	0.01
370	000061	农产品	57,200	308,880.00	0.01
371	300273	和佳股份	45,492	308,435.76	0.01
372	002118	紫鑫药业	43,106	308,207.90	0.01
373	300039	上海凯宝	52,930	306,994.00	0.01
374	002920	德赛西威	10,200	304,980.00	0.01
375	002482	广田集团	51,027	304,631.19	0.01
376	300202	聚龙股份	29,168	304,222.24	0.01
377	600750	江中药业	17,135	304,146.25	0.01
378	601001	大同煤业	61,100	303,056.00	0.01
379	600422	昆药集团	39,041	302,567.75	0.01
380	600545	卓郎智能	37,491	297,678.54	0.01
381	002375	亚厦股份	55,700	297,438.00	0.01
382	002642	荣之联	32,200	295,918.00	0.01

383	600395	盘江股份	48,200	292,574.00	0.01
384	600578	京能电力	93,732	292,443.84	0.01
385	603188	亚邦股份	28,475	290,445.00	0.01
386	600169	太原重工	123,600	289,224.00	0.01
387	002699	美盛文化	15,280	286,652.80	0.01
388	001696	宗申动力	57,700	282,730.00	0.01
389	002665	首航节能	48,300	280,140.00	0.01
390	300197	铁汉生态	52,050	279,508.50	0.01
391	601000	唐山港	118,239	277,861.65	0.01
392	002663	普邦股份	93,300	277,101.00	0.00
393	600155	宝硕股份	38,500	276,815.00	0.00
394	600869	智慧能源	58,404	275,666.88	0.00
395	603888	新华网	15,950	268,917.00	0.00
396	002344	海宁皮城	54,900	266,814.00	0.00
397	002147	新光圆成	18,030	266,122.80	0.00
398	600316	洪都航空	28,485	265,480.20	0.00
399	002431	棕榈股份	39,550	265,380.50	0.00
400	600300	维维股份	81,100	264,386.00	0.00
401	600971	恒源煤电	36,412	259,981.68	0.00
402	002261	拓维信息	56,500	259,900.00	0.00
403	600179	安通控股	25,480	258,112.40	0.00
404	300291	华录百纳	36,500	257,325.00	0.00
405	600216	浙江医药	20,000	255,400.00	0.00
406	002190	成飞集成	14,900	254,641.00	0.00
407	002588	史丹利	48,854	253,063.72	0.00
408	600759	洲际油气	64,200	252,948.00	0.00
409	600623	华谊集团	25,300	252,494.00	0.00
410	603556	海兴电力	13,800	250,746.00	0.00
411	601777	力帆股份	47,462	248,226.26	0.00
412	603228	景旺电子	5,000	247,200.00	0.00
413	002011	盾安环境	38,600	247,040.00	0.00
414	600664	哈药股份	62,000	246,140.00	0.00
415	600970	中材国际	36,754	245,516.72	0.00
416	600757	长江传媒	43,089	245,176.41	0.00
417	600017	日照港	75,400	242,034.00	0.00
418	603868	飞科电器	5,000	241,850.00	0.00
419	000939	凯迪生态	47,600	237,524.00	0.00
420	600058	五矿发展	28,400	236,004.00	0.00
421	600006	东风汽车	57,700	235,993.00	0.00
422	000806	银河生物	54,500	235,985.00	0.00
423	600640	号百控股	22,920	233,096.40	0.00
424	000025	特力A	7,201	231,656.17	0.00

425	600657	信达地产	54,200	230,350.00	0.00
426	600880	博瑞传播	53,300	227,058.00	0.00
427	603568	伟明环保	8,950	226,435.00	0.00
428	600428	中远海特	63,160	224,218.00	0.00
429	601127	小康股份	12,900	223,041.00	0.00
430	300032	金龙机电	39,500	221,595.00	0.00
431	600478	科力远	43,200	220,320.00	0.00
432	300116	坚瑞沃能	79,500	219,420.00	0.00
433	603328	依顿电子	20,100	218,085.00	0.00
434	600458	时代新材	29,266	215,397.76	0.00
435	600645	中源协和	11,100	213,786.00	0.00
436	600639	浦东金桥	17,100	213,408.00	0.00
437	600614	鹏起科技	37,300	212,983.00	0.00
438	000587	金洲慈航	42,800	212,288.00	0.00
439	002479	富春环保	37,400	211,310.00	0.00
440	603000	人民网	25,100	208,330.00	0.00
441	300043	星辉娱乐	51,450	205,800.00	0.00
442	002342	巨力索具	54,300	205,797.00	0.00
443	603766	隆鑫通用	37,118	201,550.74	0.00
444	600939	重庆建工	40,600	200,564.00	0.00
445	600748	上实发展	39,300	198,072.00	0.00
446	603377	东方时尚	14,280	197,778.00	0.00
447	600338	西藏珠峰	9,400	194,768.00	0.00
448	002005	德豪润达	44,340	193,322.40	0.00
449	002041	登海种业	28,100	191,642.00	0.00
450	600416	湘电股份	26,591	191,189.29	0.00
451	300134	大富科技	21,300	190,422.00	0.00
452	600350	山东高速	46,800	189,540.00	0.00
453	600366	宁波韵升	30,269	184,640.90	0.00
454	600184	光电股份	14,860	184,115.40	0.00
455	000987	越秀金控	23,100	181,566.00	0.00
456	600312	平高电气	32,000	180,480.00	0.00
457	600141	兴发集团	15,000	174,750.00	0.00
458	600517	置信电气	47,200	174,640.00	0.00
459	600481	双良节能	56,312	172,314.72	0.00
460	601311	骆驼股份	15,000	172,050.00	0.00
461	002416	爱施德	29,270	171,814.90	0.00
462	600167	联美控股	17,000	170,000.00	0.00
463	600126	杭钢股份	28,100	167,757.00	0.00
464	603056	德邦股份	6,100	167,079.00	0.00
465	600777	新潮能源	76,200	166,878.00	0.00
466	603877	太平鸟	5,000	166,650.00	0.00

467	600151	航天机电	41,000	166,460.00	0.00
468	600292	远达环保	28,087	164,870.69	0.00
469	600743	华远地产	63,890	164,197.30	0.00
470	600393	粤泰股份	45,000	162,900.00	0.00
471	600996	贵广网络	21,300	158,046.00	0.00
472	600536	中国软件	7,016	151,756.08	0.00
473	603355	莱克电气	5,000	150,250.00	0.00
474	000156	华数传媒	15,500	149,420.00	0.00
475	601020	华钰矿业	10,800	148,932.00	0.00
476	000761	本钢板材	35,700	144,228.00	0.00
477	601019	山东出版	17,600	140,976.00	0.00
478	600874	创业环保	15,000	140,100.00	0.00
479	600618	氯碱化工	16,200	137,862.00	0.00
480	600773	西藏城投	19,500	134,940.00	0.00
481	603806	福斯特	6,130	134,921.30	0.00
482	601969	海南矿业	24,400	133,712.00	0.00
483	603169	兰石重装	26,400	132,264.00	0.00
484	000669	金鸿控股	18,054	130,891.50	0.00
485	603225	新凤鸣	6,460	129,006.20	0.00
486	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.00
487	600765	中航重机	15,719	116,949.36	0.00
488	600187	国中水务	40,000	113,600.00	0.00
489	600651	飞乐音响	26,970	105,183.00	0.00
490	000766	通化金马	8,500	100,980.00	0.00
491	601811	新华文轩	10,368	100,776.96	0.00
492	603025	大豪科技	5,000	96,700.00	0.00
493	600862	中航高科	15,000	92,250.00	0.00
494	600917	重庆燃气	13,000	88,530.00	0.00
495	600053	九鼎投资	5,000	85,850.00	0.00
496	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.00
497	603569	长久物流	4,980	71,114.40	0.00
498	002122	*ST 天马	30,800	62,216.00	0.00
499	000693	*ST 华泽	16,900	55,939.00	0.00
500	600751	天海投资	8,000	51,920.00	0.00
501	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
502	600086	东方金钰	4,000	40,160.00	0.00
503	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
504	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00
505	603486	科沃斯	39	2,506.53	0.00
506	603587	地素时尚	42	1,735.02	0.00
507	601066	中信建投	90	968.40	0.00
508	300746	汉嘉设计	18	616.50	0.00

509	300745	欣锐科技	4	328.32	0.00
510	601990	南京证券	30	325.50	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600201	生物股份	16,880,557.72	0.40
2	600516	方大炭素	16,044,693.00	0.38
3	600176	中国巨石	13,799,034.00	0.32
4	600426	华鲁恒升	13,287,174.14	0.31
5	603019	中科曙光	12,954,960.00	0.30
6	600521	华海药业	12,114,632.25	0.28
7	600584	长电科技	11,687,276.29	0.27
8	600525	长园集团	11,336,498.16	0.27
9	601233	桐昆股份	10,571,499.20	0.25
10	600298	安琪酵母	10,432,404.48	0.24
11	603589	口子窖	10,413,525.90	0.24
12	600315	上海家化	10,381,602.02	0.24
13	600872	中炬高新	10,309,362.28	0.24
14	600642	申能股份	10,248,537.82	0.24
15	600004	白云机场	10,147,919.75	0.24
16	600256	广汇能源	9,889,891.61	0.23
17	600079	人福医药	9,702,067.56	0.23
18	600879	航天电子	9,642,931.24	0.23
19	600673	东阳光科	9,421,313.77	0.22
20	601168	西部矿业	9,400,272.34	0.22

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600516	方大炭素	4,581,276.00	0.11
2	600176	中国巨石	3,981,386.19	0.09
3	002422	科伦药业	3,451,456.48	0.08
4	002405	四维图新	3,120,471.50	0.07
5	000786	北新建材	2,624,893.18	0.06
6	603444	吉比特	2,613,882.00	0.06

7	002271	东方雨虹	2,572,485.80	0.06
8	600201	生物股份	2,447,269.63	0.06
9	000661	长春高新	2,437,881.00	0.06
10	002001	新和成	2,335,554.80	0.05
11	600438	通威股份	2,321,079.21	0.05
12	603019	中科曙光	2,124,169.00	0.05
13	600315	上海家化	2,032,622.68	0.05
14	600426	华鲁恒升	2,020,387.00	0.05
15	002050	三花智控	1,999,330.00	0.05
16	600521	华海药业	1,967,882.70	0.05
17	600584	长电科技	1,888,242.00	0.04
18	601699	潞安环能	1,883,642.00	0.04
19	600346	恒力股份	1,878,553.00	0.04
20	002311	海大集团	1,875,119.46	0.04

注:卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	1,423,976,246.49
卖出股票收入(成交)总额	376,347,257.95

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	4,994,000.00	0.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	37,419,550.00	0.67
	其中:政策性金融债	37,419,550.00	0.67
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)	61,728.57	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	42,475,278.57	0.77

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	018002	国开 1302	240,100	24,370,150.00	0.44
2	018005	国开 1701	130,000	13,049,400.00	0.24
3	019592	18 国债 10	50,000	4,994,000.00	0.09
4	128038	利欧转债	570	49,749.60	0.00
5	113018	常熟转债	110	10,505.00	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位:人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	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	5,123,660,084.87	92.32

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	497,462.35
2	应收证券清算款	4,066,243.99
3	应收股利	1,691.14
4	应收利息	866,847.87
5	应收申购款	11,264,653.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	9,353,849.92
9	合计	26,050,749.18

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128020	水晶转债	642.95	0.00
2	123004	铁汉转债	365.16	0.00
3	128029	太阳转债	121.19	0.00
4	128027	崇达转债	344.67	0.00

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	385,333	9,873.81	884,520,785.00	23.25	2,920,185,679.50	76.75
南方中证 500ETF	2,795	160,476.69	438,714,227.74	97.81	9,818,112.23	2.19

联接 (LOF)C						
合计	388,128	10,958.34	1,323,235,012.74	31.11	2,930,003,791.73	68.89

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。

8.2 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	800,000.00	1.87
2	唐镇洲	534,455.00	1.25
3	姚红伟	529,900.00	1.24
4	牟小勇	515,900.00	1.21
5	吴昊	458,900.00	1.08
6	张彩玉	369,335.00	0.87
7	荣华	306,207.00	0.72
8	李鹏	304,700.00	0.71
9	张振华	300,000.00	0.70
10	梁仿	269,900.00	0.63

8.3 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	3,550,844.36	0.0933
	南方中证 500ETF 联接 (LOF) C	12,850.66	0.0029
	合计	3,563,695.02	0.084

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)。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	-
	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	-
	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C	-
	合计	-

§ 9 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	2,697,875,756.00	69,165,637.43
本报告期基金总申购份额	1,695,921,052.16	513,387,122.29
减：本报告期基金总赎回份额	589,090,343.66	134,020,419.75
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	3,804,706,464.50	448,532,339.97

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	1,335,456,163.55	74.27%	133,518.74	74.26%	
华泰证券	1	462,758,063.27	25.73%	46,280.12	25.74%	
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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	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	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	112,625,824.00	39.20%	168,800,000.00	61.57%	-	-	-	-
华泰证券	174,516,636.39	60.75%	105,361,000.00	38.43%	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	143,000.00	0.05%	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	2018年01月06日

2	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	2018 年 01 月 06 日
3	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	2018 年 01 月 06 日
4	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	2018 年 01 月 06 日
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下部分开放式基金赎回费调整的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 03 月 27 日
6	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	2018 年 03 月 30 日
7	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	2018 年 03 月 31 日
8	南方基金管理股份有限公司关于调整电子直销系统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	2018 年 04 月 26 日
9	南方基金关于旗下部分基金增加大连网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	2018 年 04 月 27 日
10	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 (2018 年第 1 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 05 月 03 日
11	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 招募说明书 (更新) (2018 年第 1 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018 年 05 月 03 日
12	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	2018 年 01 月 06 日
13	南方基金关于旗下部分基金增加中民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	2018 年 06 月 25 日
14	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	2018 年 03 月 31 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 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>