基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2012年3月26日

南方中证500指数证券投资基金(LOF)

2011年度报告摘要

2011年12月31日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年3月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2011年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证500指数证券投资基金(LOF)
基金简称	南方中证500指数(LOF)
场内简称	南方500
基金主代码	160119
前端交易代码	160119
后端交易代码	160120
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2009年9月25日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,956,039,677.38份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2009年11月11日

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下,可简称为"南方500"。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金,原则上采用指数复制法,按照成份股在中证500指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,并辅之以金融衍生产品投资管理等,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%,年跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数,以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	李芳菲
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-63201816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2011年	2010年	2009年9月25日-2009年12月31日
本期已实现收益	11,100,370.73	382,178,312.08	179,466,602.40
本期利润	-1,751,917,639.63	462,616,870.73	522,613,376.93
加权平均基金份额本期利润	-0.4512	0.1374	0.1740
本期基金份额净值增长率	-32.72%	9.40%	17.60%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1861	0.1459	0.0678
期末基金资产净值	4,033,578,172.24	3,658,934,810.92	3,391,413,066.60
期末基金份额净值	0.8139	1.2310	1.1760

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

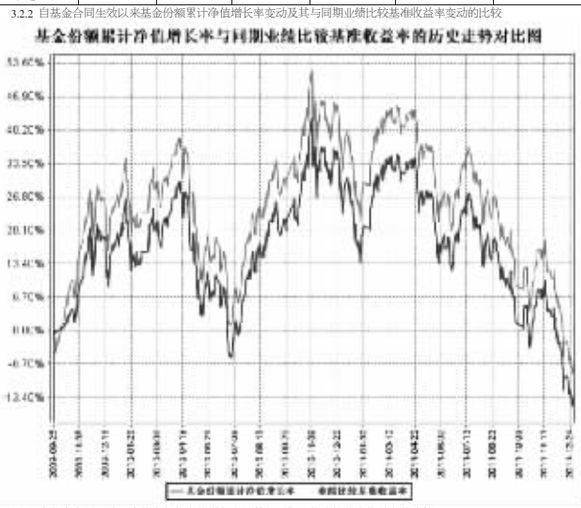
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

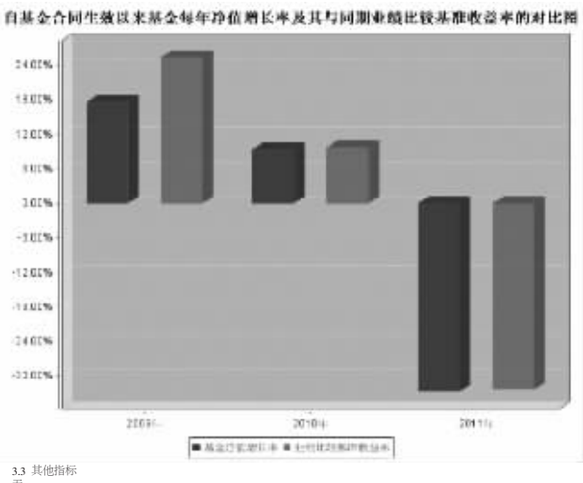
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-14.69%	1.62%	-14.55%	1.62%	-0.14%	0.00%
过去六个月	-27.58%	1.52%	-27.38%	1.52%	-0.20%	0.00%
过去一年	-32.72%	1.45%	-32.34%	1.45%	-0.38%	0.00%
自基金合同生效起至今	-13.44%	1.60%	-6.86%	1.63%	-6.58%	-0.03%

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



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



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011	0.2000	47,591,055.34	32,229,449.82	79,820,505.16	
2010	0.5000	116,331,049.37	55,660,508.35	171,991,557.72	
2009	-	-	-	-	
合计	0.7000	163,922,104.71	87,889,958.17	251,812,062.88	

§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

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[1998]4号文批准,由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000年,经中国证监会证监基金字[2000]78号文批准进行了增资扩股,注册资本达到1亿元人民币。2005年,经中国证监会证监基金字[2005]201号文批准进行增资扩股,注册资本达1.5亿元人民币。2010年,经证监许可[2010]1073号文核准深圳市机场(集团)有限公司将其持有的30%股权转让给深圳市投资控股有限公司。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%。

截至报告期末,公司管理资产规模达1,700多亿元,管理2只封闭式基金——基金开元、基金天元;30只开放式基金——南方稳健成长基金、南方宝元债券型基金、南方避险增值基金、南方现金增利基金、南方积极配置基金、南方高增长基金、南方多利增强债券型基金、南方稳健成长贰号基金、南方绩优成长基金、南方成份精选基金、南方隆元产业主题基金、南方全球精选配置基金(QDII基金)、南方盛元红利股票型基金、南方恒元保本混合型基金、南方沪深300指数基金、南方中证500指数基金、深证成份交易型开放式指数基金、南方深证成份交易型开放式指数基金联接基金、南方策略优化股票型基金、中证南方小康产业交易型开放式指数基金、中证南方小康产业交易型开放式指数基金联接基金、南方广利回报债券型基金、南方金砖四国指数基金(QDII基金)、南方优选成长混合型基金、南方中证50债券指数基金、南方保本混合型基金、上证380交易型开放式指数基金、南方上证380交易型开放式指数基金联接基金和南方中国中小盘基金(QDII基金);以及多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张原	本基金的基金经理	2009年9月25日	-	5	美国密歇根大学经济学硕士学位,具有基金从业资格。2006年4月加入南方基金,曾担任南方基金研究部机械及电力设备行业高级研究员,南方高增及南方隆元基金经理助理,2009年9月至今,任南方500基金经理;2010年2月至今,任南方绩优基金经理;2011年2月至今,任南方高增基金经理。
潘海宁	本基金的基金经理	2011年2月17日	-	10	会计学学士,具有基金从业资格。曾先后任职于兴业证券股份有限公司、富国基金管理有限公司。2003年3月加入南方基金,历任行业研究员、基金开元基金经理助理、投资部总监助理、数量化投资部总监助理等职务。2009年3月至今,任南方300指数基金经理;2009年12月至今,任南方深成ETF及联接基金基金经理;2011年2月至今,任南方500基金经理。
罗文杰	本基金的基金经理助理	2011年2月28日	-	6	美国加州大学计算机专业和金融数学专业双硕士。曾任职于美国Open Link Financial公司、美国摩根斯坦利公司,参与利率及衍生品定价模型的相关工作。2008年加盟南方基金,现任数量化投资部金融工程研究员;2011年2月至今,任南方小康及小康ETF、南方300、南方500、深成ETF及南方深成基金经理助理。

注:1.对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离职日期"为根据公司决定确定的解聘日期,除首任基金经理外,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《南方中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金持有人利益。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7.1至7.4财务报表由下列负责人签署

高良玉 鲍文革 鲍文革

基金管理公司负责人: 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本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.2.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.2.3 差错更正的说明

无。

7.4.3关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(简称"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(简称"中国农业银行")	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司(简称"华泰证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
兴业证券股份有限公司(简称"兴业证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
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(简称"投资控股")	基金管理人的股东(2010年9月10日起)
深圳市机场(集团)有限公司(简称"机场集团")	基金管理人的原股东(2010年9月10日前)

注:

(1)根据基金管理人南方基金2009年第一次临时股东会会议决议以及中国证监会证监许可[2010]1073号《关于核准南方基金管理有限公司变更股权的批复》核准,深圳市投资控股有限公司受让深圳市机场(集团)有限公司持有的南方基金30%的股权,南方基金于2010年9月10日完成了工商登记变更手续。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	853,280,794.60	14.28%	1,703,148,092.83	21.67%

7.4.4.1.2权证交易

无。

7.4.4.1.3应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011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	693,302.28	13.94%	58,900.95	6.47%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	1,383,827.33	21.12%	442,471.35	30.52%

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。

7.4.4.2关联方报酬

7.4.4.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	25,353,558.63	23,255,071.82
其中:支付销售机构的客户维护费	5,983,230.72	5,011,291.82

注:支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.6%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值X0.6%/当年天数。

7.4.4.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,070,711.78	4,651,014.34

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

日托管费=前一日基金资产净值X0.12%/当年天数。

7.4.4.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.4.4各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
期初持有的基金份额	-	49,996,750.00
期间申购总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回总份额	-	49,996,750.00
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

7.4.4.4.2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

无。

7.4.4.5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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	220,681,198.52	1,576,763.80	187,051,646.55	1,658,079.47

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.4.7其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5期末(2011年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.5.2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
000816	江淮动力	2011/1/07	重大资产重组	7.04	2012/2/27	6.51	2,280,779.00	14,513,454.40	16,056,684.16	
002051	中工国际	2011/12/08	重大资产重组	27.97	2012/3/19	30.00	476,742	11,477,069.78	13,334,473.74	
000655	金岭矿业	2011/12/12	公告重大事项	14.80	2012/2/07	16.28	806,510	17,179,247.77	11,936,348.00	
600820	隧道股份	2011/12/27	重大资产重组	7.87	2012/1/04	8.15	1,384,648	14,610,160.24	10,897,179.76	
000522	白云山A	2011/1/07	重大资产重组	12.16	未知	未知	859,779	11,825,555.01	10,454,912.64	
600963	岳阳林纸	2011/12/27	公告重大事项	4.68	2012/1/04	4.92	1,818,991	15,536,178.76	8,512,877.88	
600991	广汽长丰	2011/12/29	公告重大事项	14.72	2012/1/04	15.11	564,648	7,119,510.30	8,311,618.56	
600332	广州药业	2011/1/07	重大资产重组	13.14	未知	未知	619,029	8,753,046.72	8,134,041.06	
600121	郑州煤电	2011/10/10	重大资产重组	10.43	2012/1/13	11.47	777,542	8,732,570.86	8,109,763.06	
600056	中国医药	2011/1/16	重大资产重组	20.24	未知	未知	339,074	6,771,336.46	6,862,857.76	
000677	ST海龙	2011/08/22	公告重大事项	4.82	未知	未知	1,185,013	7,763,981.55	5,711,762.66	
000005	世纪星源	2011/05/03	公告重大事项	3.86	未知	未知	1,350,681	6,277,734.31	5,213,628.66	
合计								130,559,846.16	113,536,147.94	

注:本基金截至2011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。

7.4.5.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

§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	3,804,627,867.53	93.80
	其中:股票	3,804,627,867.53	93.80
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	224,765,548.60	5.54
6	其他各项资产	26,550,291.98	0.65
7	合计	4,055,943,708.11	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	69,286,721.91	1.72
B	采掘业	104,468,366.93	2.59
C	制造业	2,196,510,337.59	54.46
C0	食品、饮料	186,982,132.98	4.64
C1	纺织、服装、皮毛	89,707,696.93	2.22
C2	木材、家具	15,964,908.62	0.40
C3	造纸、印刷	92,676,330.25	2.30
C4	石油、化学、塑胶、塑料	405,948,968.37	10.06
C5	电子	273,276,843.56	6.78
C6	金属、非金属	282,790,954.59	7.01
C7	机械、设备、仪表	568,554,998.33	14.10
C8	医药、生物制品	268,121,823.69	6.65
C99	其他制造业	12,485,680.27	0.31
D	电力、煤气及水的生产和供应业	113,192,943.27	2.81
E	建筑业	114,512,884.11	2.84
F	交通运输、仓储业	143,195,661.56	3.55
G	信息技术业	230,029,530.99	5.70
H	批发和零售贸易	324,827,140.60	8.05
I	金融、保险业	31,711,288.85	0.79
J	房地产业	282,403,990.31	7.00
K	社会服务业	138,681,795.95	3.44
L	传播与文化产业	45,063,892.46	1.12
M	综合类	10,743,313.00	0.27
	合计	3,804,627,867.53	94.32

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000581	威孚高科	980,134	35,177,009.26	0.87
2	000917	电广传媒	880,500	22,355,895.00	0.55
3	000970	中科三环	1,099,868	21,986,361.32	0.55
4	600079	人福医药	1,069,126	20,602,058.02	0.51
5	002038	双鹭药业	618,697	20,324,196.45	0.50
6	600160	巨化股份	959,399	19,235,949.95	0.48
7	600770	综艺股份	1,196,674	19,063,016.82	0.47
8	002065	东华软件	862,471	19,026,110.26	0.47
9	000939	凯迪电力	1,788,434	18,957,400.40	0.47
10	600805	悦达投资	1,536,360	18,881,864.40	0.47

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

8.4 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	600311	荣华实业	36,670,818.12	1.00
2	600259	广晟有色	25,663,608.41	0.70
3	600643	爱建股份	25,346,030.57	0.69
4	600601	方正科技	23,025,229.63	0.63
5	000751	锌业股份	21,558,109.49	0.59
6	000581	威孚高科	21,444,973.48	0.59
7	000655	金岭矿业	21,034,592.17	0.57
8	600060	海信电器	20,984,207.78	0.57
9	600079	人福医药	20,917,589.66	0.57
10	000897	津滨发展	20,644,351.79	0.56
11	002081	金螳螂	20,621,749.38	0.56
12	000488	晨鸣纸业	20,573,851.00	0.56
13	600325	华发股份	20,572,063.00	0.56
14	600199	金种子酒	20,381,595.92	0.56
15	002353	杰瑞股份	20,348,906.31	0.56
16	600816	安信信托	20,149,774.75	0.55
17	600210	紫江企业	20,119,932.86	0.55
18	002123	荣信股份	19,643,719.41	0.54
19	600176	中国玻纤	19,528,534.76	0.53
20	000970	中科三环	18,992,424.81	0.52

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(或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	600252	中恒集团	38,156,218.18	1.04
2	002073	软控股份	37,126,150.13	1.01
3	002106	莱宝高科	25,889,102.35	0.71
4	002081	金螳螂	17,536,976.27	0.48
5	600971	恒源煤电	16,975,634.23	0.46
6	002152	广电运通	16,665,962.79	0.46
7	600267	海正药业	16,263,019.59	0.44
8	000559	万向钱潮	15,040,197.02	0.41
9	002092	中泰化学	15,030,298.78	0.41
10	600315	上海家化	14,296,173.83	0.39
11	002241	歌尔声学	13,208,314.87	0.36
12	600498	烽火通信	12,564,940.52	0.34
13	000829	天音控股	11,832,963.04	0.32
14	600060	海信电器	10,879,640.75	0.30
15	002069	獐子岛	10,384,176.89	0.28
16	002310	东方园林	10,044,571.91	0.27
17	000550	江铃汽车	10,018,138.48	0.27
18	000581	威孚高科	9,532,697.61	0.26
19	600963	岳阳林纸	9,389,974.36	0.26
20	000707	双环科技	9,305,669.47	0.25

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(或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(或交)总额	4,031,596,900.93
卖出股票收入(或交)总额	1,961,784,942.86

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3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	1,072,000.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	45,626.84
5	应收申购款	25,432,664.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,550,291.98

8.9.4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。

8.9.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:期末前十名股票中不存在流通受限情况

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
411,583	12,041.41	784,440,498.77	15.83%	4,171,599,178.61	84.17%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	姜山	10,131,043.00	6.69%
2	朝恒房地产(深圳)有限公司	8,000,000.00	5.28%
3	项志英	1,500,000.00	0.99%
4	吴彤	1,107,200.00	0.73%
5	高琪	1,000,000.00	0.66%
6	林家福	963,000.00	0.64%
7	吕大贤	872,556.00	0.58%
8	平安信托有限责任公司-中惠万金	755,393.00	0.50%
9	叶有容	750,000.00	0.50%
10	彭冬梅	700,000.00	0.46%

9.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	2,736,812.41	0.0600%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2009年9月25日)基金份额总额	3,223,217,818.45
本报告期期初基金份额总额	2,972,289,432.83
本报告期基金总申购份额	4,172,769,994.16
减:本报告期基金总赎回份额	2,189,019,749.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,956,039,677.38

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2011年8月16日,基金管理人发布公告,聘任朱运东为公司副总经理。2011年1月21日,中国证监会核准中国农业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格(证监许可[2011]116号),张健任中国农业银行股份有限公司托管业务部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期未变更会计师事务所。本年度支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费用102,000元,该审计机构已提供审计服务的连续年限为3年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
英大证券	2	1,188,420,768.88	19.89%	1,010,168.89	20.31%	-
招商证券	1	875,991,202.63	14.66%	711,753.25	14.31%	-
华泰证券	1	853,280,794.60	14.28%	693,302.28	13.94%	-
江海证券	1	820,682,183.50	13.74%	666,812.11	13.40%	-
国泰君安	1	802,008,147.68	13.43%	681,708.25	13.70%	-
东方证券	1	780,513,268.60	13.07%	663,440.28	13.34%	-
东兴证券	1	360,613,738.41	6.04%	306,523.74	6.16%	-
日信证券	1	188,431,912.31	3.15%	153,103.93	3.08%	-
高华证券	1	103,706,498.88	1.74%	88,150.99	1.77%	-
中天证券	1	-	-	-	-	-

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

A:选择标准

a、公司经营行为规范,财务状况和经营状况良好;

b、公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告;

c、公司内部管理规范,能满足基金操作的保密要求;

d、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

B:选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比,并根据评比的结果选择交易单元:

a、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座;

b、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实,投资建议是否准确;

c、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

11.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
英大证券	690,615.70	26.72%	-	-	-	-
招商证券	169,856.00	6.57%	-	-	-	-
华泰证券	1,724,154.96	66.