

中证500交易型开放式指数证券投资基金

[2015] 第四季度报告

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
报告送出日期:2016年1月21日§ 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	南方500ETF
场内简称	500ETF
交易代码	510600
基金份额净值	-
报告期末基金份额总额	2,607,467,244.00
报告期末基金资产净值	2,607,467,244.00
报告期末可供分配基金份额益	0.00
报告期末可供分配金额	0.00
报告期末基金资产净值	2,607,467,244.00
报告期末基金份额净值	2,607,467,244.00

注:上表中的股票投资按公可退替代款估值增值,而6.5.2的合计项中不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权证投资	20,044,833,519.70	92.91
2	国债投资	20,044,833,519.70	92.91
3	其中:债券	-	-
4	货币市场基金	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其中:质押及逆回购	-	-
7	应收利息	66,346,064.00	0.28
8	其他资产	-	-
9	合计	20,607,376,769.69	100.00

注:上表中的股票投资按公可退替代款估值增值,而6.5.2的合计项中不含可退替代款估值增值。

5.2.2 报告期按行业分类的股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3 报告期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

5.3.1 报告期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

5.3.2 报告期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

5.3.3 报告期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

5.3.4 报告期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

5.3.5 报告期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

5.3.6 报告期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

5.3.7 报告期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

5.3.8 报告期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

5.3.9 报告期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

5.3.10 报告期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

5.3.11 报告期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

5.3.12 报告期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

5.3.13 报告期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

5.3.14 报告期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

5.3.15 报告期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

5.3.16 报告期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

5.3.17 报告期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

5.3.18 报告期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

5.3.19 报告期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

5.3.20 报告期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

5.3.21 报告期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

5.3.22 报告期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

5.3.23 报告期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

5.3.24 报告期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

5.3.25 报告期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

5.3.26 报告期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

5.3.27 报告期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

5.3.28 报告期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

5.3.29 报告期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

5.3.30 报告期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

5.3.31 报告期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

5.3.32 报告期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

5.3.33 报告期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

5.3.34 报告期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

5.3.35 报告期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

5.3.36 报告期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

5.3.37 报告期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

5.3.38 报告期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

5.3.39 报告期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

5.3.40 报告期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

5.3.41 报告期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

5.3.42 报告期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

5.3.43 报告期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

5.3.44 报告期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

5.3.45 报告期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

5.3.46 报告期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

5.3.47 报告期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

5.3.48 报告期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

5.3.49 报告期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

5.3.50 报告期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

5.3.51 报告期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

5.3.52 报告期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

5.3.53 报告期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

5.3.54 报告期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

5.3.55 报告期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

5.3.56 报告期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

5.3.57 报告期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

5.3.58 报告期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

5.3.59 报告期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

5.3.60 报告期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

5.3.61 报告期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

5.3.62 报告期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

5.3.63 报告期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

5.3.64 报告期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

5.3.65 报告期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

5.3.66 报告期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

5.3.67 报告期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

5.3.68 报告期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

5.3.69 报告期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

5.3.70 报告期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

5.3.71 报告期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

5.3.72 报告期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

5.3.73 报告期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

5.3.74 报告期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

5.3.75 报告期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

5.3.76 报告期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

5.3.77 报告期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

5.3.78 报告期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

5.3.79 报告期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

5.3.80 报告期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

5.3.81 报告期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

5.3.82 报告期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

5.3.83 报告期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

5.3.84 报告期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

5.3.85 报告期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

5.3.86 报告期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

5.3.87 报告期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

5.3.88 报告期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

5.3.89 报告期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

5.3.90 报告期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

5.3.91 报告期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

5.3.92 报告期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

5.3.93 报告期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

5.3.94 报告期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

5.3.95 报告期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

5.3.96 报告期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

5.3.97 报告期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

5.3.98 报告期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

5.3.99 报告期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

5.3.100 报告期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

5.3.101 报告期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

5.3.102 报告期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

5.3.103 报告期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