

深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 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 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
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.....	11
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	41
8.1 期末基金资产组合情况.....	41
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
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.....	58

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	58
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	58
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
8.12	投资组合报告附注	58
§9	基金份额持有人信息	59
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
9.2	期末上市基金前十名持有人	60
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
§10	开放式基金份额变动	60
§11	重大事件揭示	61
11.1	基金份额持有人大会决议	61
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	61
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
11.4	基金投资策略的改变	61
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
11.8	其他重大事件	62
§12	备查文件目录	64
12.1	备查文件目录	64
12.2	存放地点	64
12.3	查阅方式	64

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方深证成份 ETF
场内简称	深成 ETF
基金主代码	159903
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 4 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	469, 154, 507. 00 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	2010-02-02

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“深成 ETF”

2.2 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	<p>本基金为完全被动式指数基金，原则上采用完全复制法，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。</p> <p>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，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证成份指数。如果指数编制单位变更或停止深证成份指数的编制及发布、或深证成份指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致深证成份指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。
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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	洪渊
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798
注册地址		深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		吴万善	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	934,216,855.43	-37,319,349.33	-318,519,726.27
本期利润	442,160,825.53	585,708,008.88	-235,586,555.48

加权平均基金份额本期利润	0.5086	0.2872	-0.0806
本期加权平均净值利润率	38.56%	34.75%	-8.99%
本期基金份额净值增长率	15.36%	36.99%	-9.32%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	-9,640,125.50	-575,968,661.13	-1,209,870,507.33
期末可供分配基金份额利润	-0.0205	-0.3621	-0.5107
期末基金资产净值	626,189,343.36	1,840,641,926.17	2,000,830,119.32
期末基金份额净值	1.3347	1.1570	0.8446
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	-1.52%	-14.63%	-37.68%

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。

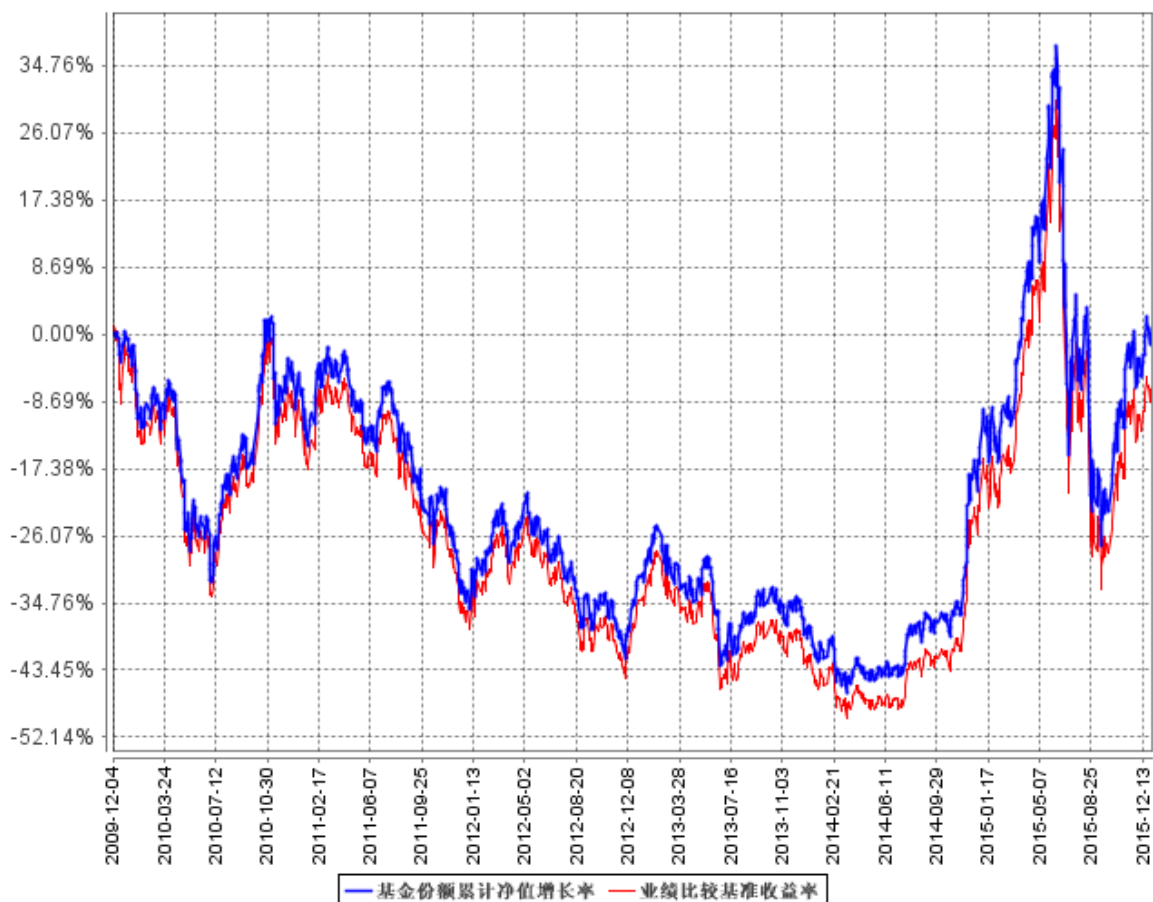
3.2 基金净值表现

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	27.10%	2.05%	26.80%	2.03%	0.30%	0.02%
过去六个月	-9.66%	2.89%	-11.67%	2.96%	2.01%	-0.07%
过去一年	15.36%	2.60%	14.98%	2.66%	0.38%	-0.06%
过去三年	43.30%	1.86%	38.92%	1.90%	4.38%	-0.04%
过去五年	5.64%	1.69%	1.66%	1.72%	3.98%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-1.52%	1.69%	-8.79%	1.72%	7.27%	-0.03%

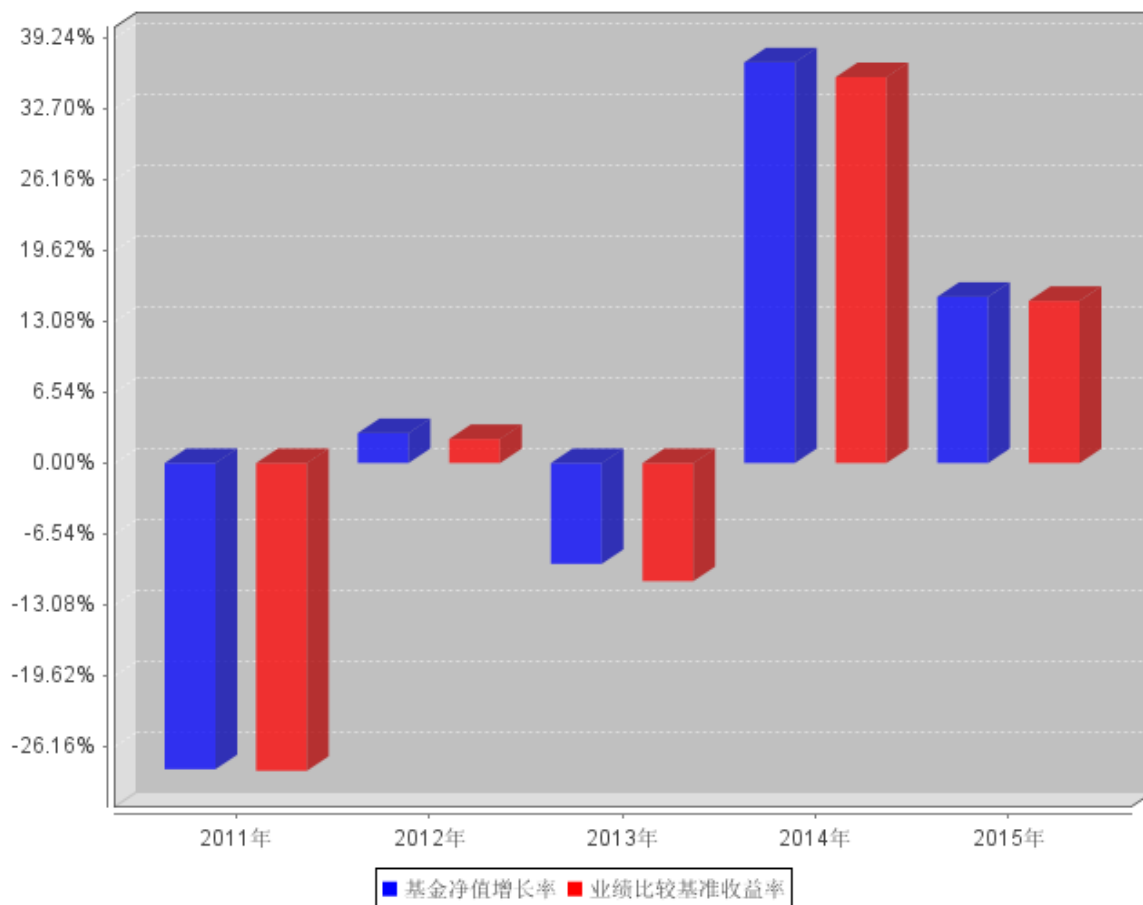
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：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。

南方基金总部设在深圳，注册资本3亿元人民币。股东结构为：华泰证券股份有限公司（45%）；深圳市投资控股有限公司（30%）；厦门国际信托有限公司（15%）；兴业证券股份有限公司（10%）。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司一

一南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 5,000 亿元，旗下管理 85 只开放式基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柯晓	本基金 基金经 理	2013 年 4 月 22 日	-	18 年	美国纽约大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾先后担任美国美林证券公司助理副总裁、招商证券首席产品策略师。2006 年加入南方基金，任首席产品设计师；2010 年 8 月至今，任小康 ETF 及南方小康基金经理；2013 年 4 月至今，任南方深成及南方深成 ETF 的基金经理；2013 年 5 月至今，任南方上证 380ETF 及联接基金的基金经理；2015 年 7 月至今，任南方互联基金的基金经理。

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，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《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

公司每季度对旗下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9次，其中5次是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致，2次是由于指数型基金接受投资者申购后被动增减仓位所致，2次是由于投资组合的投资策略需要，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

我们认为，指数化投资不同于主动式投资，后者强调通过各自不同的投资理念去寻找超越市场的投资机会，而前者的宗旨是尽量拟合标的指数的走势，为投资者提供一个跟踪指数的投资工具。同时，ETF基金又不同于普通指数基金，由于ETF的可上市交易属性，全市场的投资者都将根据基金管理人每日公告的申购赎回清单进行申购及跨市场操作，这就使得ETF基金管理人必须

更加注重风险控制，一丝疏漏都可能导致严重的后果。也正因为深知此理，我们专门针对 ETF 的投资管理制定了科学、严谨的操作流程，使得流程中的每位人员，都清楚的知道自己在什么时点需要完成什么工作。ETF 管理团队除基金经理之外，还由数量投资分析师、交易管理人员、IT 人员等组成，为 ETF 基金的投资管理提供研究、交易、系统及其相关工作的快速支持响应。

对于本基金而言，本报告期跟踪误差的主要来源包括：①大额申购赎回（如联接基金的大比例换购）所带来的成份股权重偏离，对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行应对；②指数成份股调整所带来的跟踪误差是不容忽视的，是本基金跟踪误差的另一主要来源。为此，本基金管理组提前进行了全面模拟测算，并制定了周密的调仓方案，从实施结果来看，本基金成份股调仓较为成功。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金自上市日至本报告期末的指数跟踪期间，相对于标的指数的年化跟踪误差为 0.860%，较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过 2% 的投资目标。

截至报告期末，本基金份额净值为 1.3347 元，报告期内，份额净值增长率为 15.36%，同期业绩基准增长率为 14.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年，中央经济工作重点将在适度扩大总需求的同时，着力加强供给侧结构性改革，着力提高供给体系质量和效率，增强经济持续增长动力，推动我国社会生产力水平实现整体跃升。展望 2016 年全年，A 股市场将逐步实现震荡牛市，震荡来源于估值提升后市场波动加大。蓝筹股和小盘股均有机会，但驱动因素不同。近期险资频频举牌地产、金融、消费等领域优质蓝筹股，根本原因是在低利率背景下，蓝筹股的分红收益率很有吸引力，预计在 2015 年底上演的上市公司控股权之争可能在 2016 年更常见，这也表明产业资本对于蓝筹股长期投资价值的认可。

本基金为指数化产品，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，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人开展了基金管理公司合规风险全面自查、分级基金折算自查等多项内控自查工作，制定或修订了合规手册、公平交易操作指引、股票池管理制度等内部制度，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；针对新出台的法律法规和监管要求，积极组织了多项法律法规、职业道德培训以及合规考试，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况；完成各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总经理、研究部总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。基金管理人根据基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益分配每年最多 12 次，每次基金收益分配比例不低于基金收益分配基准日可

供分配利润的 5%。基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；本基金收益分配采取现金分红方式；《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；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。

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

本报告期内，本基金托管人在对深证成份交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，深证成份交易型开放式指数证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在深证成份交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，深证成份交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2015 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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(2016)第 21223 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	深证成份交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人；
引言段	我们审计了后附的深证成份交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“深证成份 ETF 基金”）的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是深证成份 ETF 基金的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述深证成份 ETF 基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了深证成份 ETF 基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛竞 陈熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

会计师事务所的地址	中国 · 上海市
审计报告日期	2016 年 3 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	11,558,730.82	10,732,025.09
结算备付金		65,058.20	875,697.20
存出保证金		89,389.80	7,518.85
交易性金融资产	7.4.7.2	624,978,907.28	1,825,758,805.13
其中：股票投资		624,978,907.28	1,825,758,805.13
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	5,245,047.77
应收利息	7.4.7.5	2,399.97	7,226.13
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		636,694,486.07	1,842,626,320.17
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		9,927,903.35	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		272,948.92	881,428.96

应付托管费		54,589.77	176,285.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	9,051.96	71,206.09
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	240,648.71	855,473.19
负债合计		10,505,142.71	1,984,394.00
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	635,829,468.86	2,156,032,099.57
未分配利润	7.4.7.10	-9,640,125.50	-315,390,173.40
所有者权益合计		626,189,343.36	1,840,641,926.17
负债和所有者权益总计		636,694,486.07	1,842,626,320.17

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3347 元，基金份额总额

469,154,507.00 份。

7.2 利润表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		451,801,123.34	597,790,808.11
1.利息收入		122,845.89	154,268.90
其中：存款利息收入	7.4.7.11	122,845.89	143,080.29
债券利息收入		-	11,188.61
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		941,524,073.40	-26,347,658.83
其中：股票投资收益	7.4.7.12	932,945,506.96	-61,455,696.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	172,315.99
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	8,578,566.44	34,935,721.45
3.公允价值变动收益（损失以	7.4.7.16	-492,056,029.90	623,027,358.21

“-”号填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.17	2,210,233.95	956,839.83
减: 二、费用		9,640,297.81	12,082,799.23
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,774,059.84	8,432,479.82
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,154,812.01	1,686,495.93
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,913,386.39	1,006,190.69
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	798,039.57	957,632.79
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		442,160,825.53	585,708,008.88
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		442,160,825.53	585,708,008.88

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	2,156,032,099.57	-315,390,173.40	1,840,641,926.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	442,160,825.53	442,160,825.53
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)	-1,520,202,630.71	-136,410,777.63	-1,656,613,408.34
其中: 1. 基金申购款	3,033,899,980.41	160,441,746.43	3,194,341,726.84
2. 基金赎回款	-4,554,102,611.12	-296,852,524.06	-4,850,955,135.18
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)	635,829,468.86	-9,640,125.50	626,189,343.36
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	3,210,700,626.65	-1,209,870,507.33	2,000,830,119.32
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	585,708,008.88	585,708,008.88
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)	-1,054,668,527.08	308,772,325.05	-745,896,202.03
其中：1.基金申购款	4,761,864,993.74	-1,840,635,408.87	2,921,229,584.87
2.基金赎回款	-5,816,533,520.82	2,149,407,733.92	-3,667,125,786.90
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)	2,156,032,099.57	-315,390,173.40	1,840,641,926.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

杨小松

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

深证成份交易型开放式指数证券投资基金(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]1066号《关于核准深证成份交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币4,127,252,482.00元(含募集股票市值),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263号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《深证成份交易型开放式指数

证券投资基金基金合同》于 2009 年 12 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,127,538,537.00 份基金份额，其中通过代销机构网上现金及直销机构网下现金认购部分的认购资金利息折合 286,055.00 元份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人南方基金管理有限公司确定 2010 年 1 月 13 日为本基金的基金份额折算日。当日深证成份指数收盘值为 13,016.557 点，本基金的基金资产净值为 3,964,290,323.04 元，折算前基金份额总额为 4,127,538,537.00 份，折算前基金份额净值为 0.960 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.73786718，折算后基金份额总额为 3,045,554,507.00 份，折算后基金份额净值为 1.302 元。本基金的基金管理人南方基金管理有限公司已根据上述折算比例，对所有基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2010 年 1 月 15 日完成了变更登记。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2010]第 38 号文审核同意，本基金于 2010 年 2 月 2 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数深证成份指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；主要投资范围为标的指数的成份股和备选成份股，该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%；本基金可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为深证成份指数。

本基金的基金管理人南方基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2009 年 12 月 9 日募集成立了南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“南方深证成份 ETF 联接基金”)。南方深证成份 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 2016 年 3 月 25 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》、《深证成份交易型开放

式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 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股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基

金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

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

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	11,558,730.82	10,732,025.09
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	11,558,730.82	10,732,025.09

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	663,549,967.62	624,978,907.28	-38,571,060.34
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	-	-	-
其他	-	-	-
合计	663,549,967.62	624,978,907.28	-38,571,060.34
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,372,273,835.57	1,825,758,805.13	453,484,969.56

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	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,372,273,835.57	1,825,758,805.13	453,484,969.56

注：于 2015 年 12 月 31 日，股票投资的公允价值和公允价值变动中包含的可退替代款估值增值为零(2014 年 12 月 31 日：63,210.00 元)。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,320.66	2,170.78
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	39.11	5,051.95
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	40.20	3.40
合计	2,399.97	7,226.13

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

交易所市场应付交易费用	9,051.96	71,206.09
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	9,051.96	71,206.09

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
预提费用	191,000.00	291,000.00
指数使用费	48,700.71	505,948.79
应退替代款	-	18,003.20
可退替代款	948.00	40,521.20
合计	240,648.71	855,473.19

注：1. 应退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

2. 可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,590,854,507.00	2,156,032,099.57
本期申购	2,238,600,000.00	3,033,899,980.41
本期赎回(以“-”号填列)	-3,360,300,000.00	-4,554,102,611.12
- 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	469,154,507.00	635,829,468.86

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-575,968,661.13	260,578,487.73	-315,390,173.40
本期利润	934,216,855.43	-492,056,029.90	442,160,825.53
本期基金份额交易	-140,969,947.42	4,559,169.79	-136,410,777.63

产生的变动数			
其中：基金申购款	346,135,458.33	-185,693,711.90	160,441,746.43
基金赎回款	-487,105,405.75	190,252,881.69	-296,852,524.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	217,278,246.88	-226,918,372.38	-9,640,125.50

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
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
活期存款利息收入	98,950.55	121,928.96
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	22,685.04	20,948.76
其他	1,210.30	202.57
合计	122,845.89	143,080.29

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	309,836,092.11	-41,245,397.48
股票投资收益——赎回差价收入	623,109,414.85	-20,210,298.79
合计	932,945,506.96	-61,455,696.27

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	1,249,156,851.14	328,956,141.53
减：卖出股票成本总额	939,320,759.03	370,201,539.01
买卖股票差价收入	309,836,092.11	-41,245,397.48

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31日
赎回基金份额对价总额	4,850,955,135.18	3,667,125,786.90
减：现金支付赎回款总额	291,950,734.18	63,739,669.90
减：赎回股票成本总额	3,935,894,986.15	3,623,596,415.79
赎回差价收入	623,109,414.85	-20,210,298.79

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	5,890,044.44
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	5,702,200.00
减：应收利息总额	-	15,528.45
买卖债券差价收入	-	172,315.99

7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
股票投资产生的股利收益	8,578,566.44	34,935,721.45
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	8,578,566.44	34,935,721.45

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
1. 交易性金融资产	-492,056,029.90	623,027,358.21
——股票投资	-492,056,029.90	622,785,675.49
——债券投资	-	241,682.72
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-492,056,029.90	623,027,358.21

注：本基金本年度公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益为-63,210.00元(2014年度：63,210.00元)。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
其他	1,206.00	106.60
替代损益收入	2,209,027.95	956,733.23
合计	2,210,233.95	956,839.83

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
交易所市场交易费用	1,913,386.39	1,006,190.69
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,913,386.39	1,006,190.69

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
审计费用	91,000.00	91,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
银行费用	596.00	684.00
指数使用费	346,443.57	505,948.79
-	-	-
合计	798,039.57	957,632.79

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的0.03%的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为年化人民币300,000元。

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

截至财务报表报出日，本基金并无须做披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司（“南方基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
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
南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“南方深证成份ETF联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	2,374,986.00	0.09%	2,430,752.83	0.36%

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券	2,101.62	0.55%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	2,151.00	0.36%	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年	2014年1月1日至2014年12月

	12月31日	31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,774,059.84	8,432,479.82
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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 0.50% 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 × 0.50% ÷ 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,154,812.01	1,686,495.93

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% ÷ 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本报告期内及上年度可比期末未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
南方深证成份ETF联接基金	276,321,432.00	58.9000%	951,837,173.00	59.8300%

注：南方深证成份ETF联接基金投资本基金相关的费用按基金合同和更新的招募说明书的有关规定以及与券商约定的席位佣金费率支付。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
	中国工商银行	11,558,730.82	98,950.55	10,732,025.09

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未进行利润分配。

7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券流通受限证券。

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
000002	万科A	2015年12月 19日	重大资产 重组	24.43	未知	未知	884,858	12,233,872.71	21,617,080.94	-
300104	乐视网	2015年12月5日	重大资产 重组	58.8	未知	未知	99,262	5,027,058.83	5,836,605.60	-
002465	海格通信	2015年12月 30日	重大事项	16.69	2016年2月4日	15.02	152,900	2,610,349.29	2,551,901.00	-
002065	东华软件	2015年12月 22日	重大事项	25.1	未知	未知	83,000	2,558,890.85	2,083,300.00	-
002340	格林美	2015年12月 29日	重大事项	15.2	2016年1月6日	14.35	108,850	1,590,040.68	1,654,520.00	-
002018	华信国际	2015年6月13日	重大资产 重组	44.08	未知	未知	35,400	1,306,654.62	1,560,432.00	-
000748	长城信息	2015年6月18日	重大资产 重组	34.88	2016年3月10日	31.39	44,400	1,535,157.74	1,548,672.00	-
000712	锦龙股份	2015年12月 25日	重大事项	29.12	2016年1月4日	28.00	52,500	1,869,952.92	1,528,800.00	-

002049	同方国 芯	2015年12月 11日	重大资产 重组	60.15	2016年3月11日	54.14	24,313	1,137,053.79	1,462,426.95	-
000876	新希望	2015年8月15日	重大事项	18.99	2016年3月2日	17.09	69,126	1,506,943.06	1,312,702.74	-
300088	长信科 技	2015年12月 12日	重大资产 重组	14.03	2016年2月29日	12.63	86,302	1,104,310.62	1,210,817.06	-
300010	立思辰	2015年12月 30日	重大事项	31.9	2016年1月8日	28.71	37,500	1,047,924.32	1,196,250.00	-
300324	旋极信 息	2015年12月1日	重大资产 重组	49.25	2016年3月10日	44.33	22,800	661,844.00	1,122,900.00	-
000973	佛塑科 技	2015年12月 18日	重大事项	13	2016年2月22日	11.70	81,000	809,930.73	1,053,000.00	-
300238	冠昊生 物	2015年11月 12日	重大资产 重组	56.67	未知	未知	18,100	789,840.93	1,025,727.00	-
000066	长城电 脑	2015年6月18日	重大资产 重组	21.54	2016年3月10日	19.39	46,000	933,856.70	990,840.00	-
002219	恒康医 疗	2015年7月8日	重大资产 重组	14.9	未知	未知	63,500	1,030,299.06	946,150.00	-
000901	航天科 技	2015年8月19日	重大资产 重组	52.88	2016年2月18日	47.59	17,500	1,087,517.81	925,400.00	-
002011	盾安环 境	2015年12月 26日	重大事项	16.72	2016年2月22日	15.05	54,400	862,772.58	909,568.00	-
300028	金亚科 技	2015年6月10日	重大事项	34.51	未知	未知	24,760	1,049,244.54	854,467.60	-
300043	互动娱 乐	2015年12月 17日	重大事项	15.8	未知	未知	53,900	844,474.47	851,620.00	-
300336	新文化	2015年12月 24日	重大事项	42	未知	未知	18,580	604,377.71	780,360.00	-
000829	天音控 股	2015年11月7日	重大资产 重组	12.22	未知	未知	60,900	1,014,977.09	744,198.00	-
002174	游族网 络	2015年7月23日	重大资产 重组	89.53	2016年2月15日	80.58	8,295	917,178.09	742,651.35	-
000028	国药一 致	2015年10月 21日	重大资产 重组	66.15	2016年3月25日	63.05	11,100	810,171.67	734,265.00	-
300011	鼎汉技 术	2015年12月 31日	重大事项	29.8	2016年1月22日	26.82	23,000	768,918.63	685,400.00	-
002048	宁波华 翔	2015年11月 19日	重大资产 重组	17.4	未知	未知	38,600	825,569.79	671,640.00	-
300054	鼎龙股 份	2015年11月 21日	重大资产 重组	24.66	2016年3月14日	22.19	26,900	634,624.29	663,354.00	-
002242	九阳股 份	2015年12月 24日	重大事项	22.68	2016年1月11日	20.41	29,100	592,951.05	659,988.00	-
002698	博实股 份	2015年12月 26日	重大事项	29.33	2016年1月5日	26.4	20,740	644,992.93	608,304.20	-

002544	杰赛科技	2015年8月29日	重大资产重组	29.65	未知	未知	20,500	651,852.77	607,825.00	-
000767	漳泽电力	2015年12月30日	重大事项	5.77	2016年1月4日	6.1	103,600	792,133.01	597,772.00	-
300197	铁汉生态	2015年12月30日	重大事项	17.11	2016年1月7日	16.59	32,260	673,667.98	551,968.60	-
300355	蒙草抗旱	2015年12月12日	重大事项	17.84	2016年2月16日	16.06	22,500	406,148.14	401,400.00	-
002240	威华股份	2015年12月26日	重大事项	13.68	2016年1月22日	12.31	26,600	434,980.83	363,888.00	-
000426	兴业矿业	2015年10月28日	重大资产重组	7.06	2016年3月21日	7.77	46,600	323,863.33	328,996.00	-
002638	勤上光电	2015年8月29日	重大资产重组	15.32	2016年1月19日	16.85	20,500	419,185.84	314,060.00	-
002235	安妮股份	2015年7月2日	重大资产重组	29.1	2016年1月12日	32	10,200	337,023.71	296,820.00	-
002313	日海通讯	2015年8月8日	重大事项	14.8	2016年1月22日	13.9	19,600	432,858.04	290,080.00	-
000553	沙隆达A	2015年8月5日	重大资产重组	10.7	未知	未知	19,700	297,824.83	210,790.00	-

注：本基金截至 2015 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

本基金本报告期末及上年度可比期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪深证成份指数，具有和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。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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工商银行，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。

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 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资 (2014 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

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。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

于 2015 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。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

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、存出保证金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,558,730.82	-	-	-	11,558,730.82
结算备付金	65,058.20	-	-	-	65,058.20
存出保证金	89,389.80	-	-	-	89,389.80
交易性金融资 产	-	-	-	624,978,907.28	624,978,907.28
应收利息	-	-	-	2,399.97	2,399.97
资产总计	11,713,178.82	-	-	624,981,307.25	636,694,486.07
负债					
应付证券清算	-	-	-	9,927,903.35	9,927,903.35

款					
应付管理人报酬	-	-	-	272,948.92	272,948.92
应付托管费	-	-	-	54,589.77	54,589.77
应付交易费用	-	-	-	9,051.96	9,051.96
其他负债	-	-	-	240,648.71	240,648.71
负债总计	-	-	-	10,505,142.71	10,505,142.71
利率敏感度缺口	11,713,178.82	-	-	614,476,164.54	626,189,343.36
上年度末 2014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	10,732,025.09	-	-	-	10,732,025.09
结算备付金	875,697.20	-	-	-	875,697.20
存出保证金	7,518.85	-	-	-	7,518.85
交易性金融资产	-	-	-	1,825,758,805.13	1,825,758,805.13
应收证券清算款	-	-	-	5,245,047.77	5,245,047.77
应收利息	-	-	-	7,226.13	7,226.13
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,615,241.14	-	-	1,831,011,079.03	1,842,626,320.17
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	881,428.96	881,428.96
应付托管费	-	-	-	176,285.76	176,285.76
应付交易费用	-	-	-	71,206.09	71,206.09
其他负债	-	-	-	855,473.19	855,473.19
负债总计	-	-	-	1,984,394.00	1,984,394.00
利率敏感度缺口	11,615,241.14	-	-	1,829,026,685.03	1,840,641,926.17

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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2015年12月31日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2014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。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票和债券，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。

本基金采用完全复制法跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，深证成份指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%，新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例不高于基金资产净值的 5%。此外，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 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 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	624,978,907.28	99.81	1,825,758,805.13	99.19
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	624,978,907.28	99.81	1,825,758,805.13	99.19

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2015年 12月31日)	上年度末(2014年 12月31日)
	1. 业绩比较基准(附注		30,420,000.00

	7.4.1) 上升 5		
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1) 下降 5	-30,420,000.00	-90,630,000.00

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2015 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 3,194,341,726.84 元(2014 年度：2,921,229,584.87 元)，其中包括以股票支付的申购款 2,915,271,001.47 元和以现金支付的申购款 279,070,725.37 元(2014 年度：其中包括以股票支付的申购款 2,856,169,081.71 元和以现金支付的申购款 65,060,503.16 元)。

(2) 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 2015 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 562,481,966.24 元，属于第二层次的余额为 62,496,941.04 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 1,740,255,593.13 元，第二层次 85,503,212.00 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 2015 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 (2014 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。

(3) 除基金申购款和公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	624,978,907.28	98.16
	其中：股票	624,978,907.28	98.16
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	11,623,789.02	1.83
7	其他各项资产	91,789.77	0.01
8	合计	636,694,486.07	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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	7,736,903.50	1.24
B	采矿业	9,686,495.73	1.55
C	制造业	354,275,630.52	56.58

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,151,957.90	1.94
E	建筑业	10,615,786.72	1.70
F	批发和零售业	17,807,408.69	2.84
G	交通运输、仓储和邮政业	3,122,549.00	0.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	75,655,533.13	12.08
J	金融业	40,711,737.74	6.50
K	房地产业	46,809,044.53	7.48
L	租赁和商务服务业	14,167,178.62	2.26
M	科学研究和技术服务业	1,281,217.00	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	10,074,742.82	1.61
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,979,142.28	0.48
R	文化、体育和娱乐业	14,848,468.76	2.37
S	综合	3,055,110.34	0.49
	合计	624,978,907.28	99.81

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资。

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

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万科 A	884,858	21,617,080.94	3.45
2	000651	格力电器	470,340	10,512,099.00	1.68
3	000001	平安银行	645,310	7,737,266.90	1.24
4	000725	京东方 A	2,409,542	7,156,339.74	1.14
5	000333	美的集团	208,338	6,837,653.16	1.09
6	300059	东方财富	114,440	5,954,313.20	0.95
7	300104	乐视网	99,262	5,836,605.60	0.93

8	000776	广发证券	297,359	5,783,632.55	0.92
9	002024	苏宁云商	415,351	5,586,470.95	0.89
10	000858	五粮液	179,841	4,906,062.48	0.78
11	002450	康得新	128,295	4,888,039.50	0.78
12	002415	海康威视	134,114	4,612,180.46	0.74
13	000783	长江证券	355,519	4,415,545.98	0.71
14	000063	中兴通讯	226,233	4,214,720.79	0.67
15	001979	招商蛇口	190,127	3,966,049.22	0.63
16	000166	申万宏源	352,740	3,777,845.40	0.60
17	000100	TCL 集团	867,771	3,696,704.46	0.59
18	002202	金风科技	161,736	3,685,963.44	0.59
19	000625	长安汽车	210,798	3,577,242.06	0.57
20	300027	华谊兄弟	85,470	3,545,295.60	0.57
21	002594	比亚迪	54,236	3,492,798.40	0.56
22	300024	机器人	49,750	3,407,875.00	0.54
23	002673	西部证券	100,040	3,292,316.40	0.53
24	002230	科大讯飞	85,180	3,155,919.00	0.50
25	002183	怡亚通	67,870	3,126,092.20	0.50
26	000917	电广传媒	115,200	3,059,712.00	0.49
27	000538	云南白药	40,886	2,969,141.32	0.47
28	000069	华侨城 A	337,249	2,967,791.20	0.47
29	300070	碧水源	56,464	2,923,141.28	0.47
30	000768	中航飞机	116,290	2,880,503.30	0.46
31	300017	网宿科技	46,942	2,816,050.58	0.45
32	000423	东阿阿胶	53,571	2,801,763.30	0.45
33	002142	宁波银行	180,625	2,801,493.75	0.45
34	002304	洋河股份	40,861	2,800,612.94	0.45
35	002241	歌尔声学	80,605	2,788,933.00	0.45
36	000559	万向钱潮	119,400	2,702,022.00	0.43
37	000402	金融街	228,363	2,633,025.39	0.42
38	002736	国信证券	130,400	2,575,400.00	0.41
39	002465	海格通信	152,900	2,551,901.00	0.41
40	000728	国元证券	106,964	2,416,316.76	0.39
41	000157	中联重科	445,427	2,383,034.45	0.38
42	000009	中国宝安	130,829	2,349,688.84	0.38
43	000503	海虹控股	69,650	2,332,578.50	0.37
44	000623	吉林敖东	72,829	2,254,057.55	0.36
45	000061	农产品	124,100	2,195,329.00	0.35
46	000338	潍柴动力	225,704	2,180,300.64	0.35

47	000793	华闻传媒	143,900	2,162,817.00	0.35
48	002252	上海莱士	53,278	2,118,866.06	0.34
49	002008	大族激光	80,800	2,091,912.00	0.33
50	000686	东北证券	119,300	2,087,750.00	0.33
51	002236	大华股份	56,571	2,087,469.90	0.33
52	002065	东华软件	83,000	2,083,300.00	0.33
53	002292	奥飞动漫	40,100	2,073,571.00	0.33
54	002466	天齐锂业	14,600	2,054,950.00	0.33
55	002405	四维图新	52,754	2,046,855.20	0.33
56	000839	中信国安	98,300	2,000,405.00	0.32
57	000826	启迪桑德	50,407	1,997,125.34	0.32
58	002456	欧菲光	63,801	1,979,107.02	0.32
59	300168	万达信息	59,146	1,959,506.98	0.31
60	000895	双汇发展	95,624	1,951,685.84	0.31
61	002681	奋达科技	44,520	1,945,524.00	0.31
62	000060	中金岭南	138,230	1,939,366.90	0.31
63	300058	蓝色光标	130,734	1,925,711.82	0.31
64	000425	徐工机械	450,808	1,915,934.00	0.31
65	002030	达安基因	46,420	1,911,575.60	0.31
66	000977	浪潮信息	59,400	1,883,574.00	0.30
67	000568	泸州老窖	68,892	1,868,351.04	0.30
68	000963	华东医药	22,582	1,850,820.72	0.30
69	000806	银河生物	64,700	1,845,891.00	0.29
70	000039	中集集团	87,000	1,827,000.00	0.29
71	300124	汇川技术	37,750	1,781,800.00	0.28
72	000750	国海证券	138,600	1,781,010.00	0.28
73	300003	乐普医疗	45,400	1,752,440.00	0.28
74	002400	省广股份	69,600	1,750,440.00	0.28
75	300315	掌趣科技	123,700	1,731,800.00	0.28
76	002500	山西证券	112,600	1,716,024.00	0.27
77	000581	威孚高科	69,051	1,709,702.76	0.27
78	000997	新大陆	65,880	1,668,081.60	0.27
79	002439	启明星辰	52,100	1,667,200.00	0.27
80	000415	渤海租赁	183,860	1,658,417.20	0.26
81	002340	格林美	108,850	1,654,520.00	0.26
82	000413	东旭光电	182,100	1,653,468.00	0.26
83	002081	金螳螂	88,384	1,651,013.12	0.26
84	000540	中天城投	180,400	1,645,248.00	0.26
85	002153	石基信息	10,695	1,614,945.00	0.26

86	002004	华邦健康	113,400	1,604,610.00	0.26
87	000792	盐湖股份	62,423	1,603,022.64	0.26
88	000566	海南海药	40,900	1,589,374.00	0.25
89	300113	顺网科技	15,600	1,581,372.00	0.25
90	002276	万马股份	52,400	1,577,240.00	0.25
91	300253	卫宁软件	37,600	1,574,688.00	0.25
92	000998	隆平高科	66,100	1,569,875.00	0.25
93	002701	奥瑞金	55,400	1,565,604.00	0.25
94	002018	华信国际	35,400	1,560,432.00	0.25
95	002407	多氟多	20,400	1,555,704.00	0.25
96	000748	长城信息	44,400	1,548,672.00	0.25
97	000012	南玻 A	115,500	1,541,925.00	0.25
98	000712	锦龙股份	52,500	1,528,800.00	0.24
99	002385	大北农	125,100	1,527,471.00	0.24
100	000709	河北钢铁	456,100	1,518,813.00	0.24
101	000031	中粮地产	106,441	1,495,496.05	0.24
102	000078	海王生物	61,800	1,480,728.00	0.24
103	000938	紫光股份	15,000	1,475,700.00	0.24
104	300079	数码视讯	121,400	1,471,368.00	0.23
105	002152	广电运通	47,200	1,462,728.00	0.23
106	002049	同方国芯	24,313	1,462,426.95	0.23
107	000629	攀钢钒钛	397,959	1,460,509.53	0.23
108	000410	沈阳机床	58,200	1,456,164.00	0.23
109	000046	泛海控股	115,112	1,444,655.60	0.23
110	000887	中鼎股份	60,900	1,437,240.00	0.23
111	002038	双鹭药业	42,700	1,430,450.00	0.23
112	000738	中航动控	45,150	1,427,643.00	0.23
113	002007	华兰生物	32,400	1,425,600.00	0.23
114	002475	立讯精密	44,530	1,422,733.50	0.23
115	002573	清新环境	63,200	1,418,208.00	0.23
116	300251	光线传媒	46,760	1,416,360.40	0.23
117	300144	宋城演艺	49,370	1,397,171.00	0.22
118	000778	新兴铸管	215,032	1,395,557.68	0.22
119	000718	苏宁环球	105,696	1,394,130.24	0.22
120	000988	华工科技	65,500	1,387,290.00	0.22
121	300002	神州泰岳	105,884	1,387,080.40	0.22
122	300033	同花顺	19,400	1,378,370.00	0.22
123	000800	一汽轿车	83,200	1,361,984.00	0.22
124	000831	五矿稀土	65,000	1,345,500.00	0.21

125	002308	威创股份	54,519	1,343,893.35	0.21
126	002268	卫士通	23,900	1,343,419.00	0.21
127	000547	航天发展	70,100	1,335,405.00	0.21
128	000598	兴蓉环境	187,300	1,333,576.00	0.21
129	002085	万丰奥威	40,820	1,313,587.60	0.21
130	000876	新希望	69,126	1,312,702.74	0.21
131	300156	神雾环保	26,173	1,308,388.27	0.21
132	300142	沃森生物	99,200	1,307,456.00	0.21
133	000661	长春高新	10,800	1,300,860.00	0.21
134	300072	三聚环保	38,200	1,297,654.00	0.21
135	000630	铜陵有色	361,600	1,294,528.00	0.21
136	300077	国民技术	28,600	1,292,148.00	0.21
137	000930	中粮生化	87,400	1,291,772.00	0.21
138	000400	许继电气	66,300	1,288,209.00	0.21
139	002104	恒宝股份	53,100	1,273,869.00	0.20
140	002422	科伦药业	68,278	1,269,970.80	0.20
141	002410	广联达	69,619	1,265,673.42	0.20
142	000690	宝新能源	129,300	1,264,554.00	0.20
143	000970	中科三环	90,000	1,262,700.00	0.20
144	300133	华策影视	42,324	1,260,831.96	0.20
145	000541	佛山照明	74,980	1,252,166.00	0.20
146	300267	尔康制药	37,000	1,243,200.00	0.20
147	002657	中科金财	15,500	1,239,845.00	0.20
148	000883	湖北能源	201,000	1,234,140.00	0.20
149	002353	杰瑞股份	48,587	1,233,138.06	0.20
150	000656	金科股份	233,400	1,232,352.00	0.20
151	002161	远望谷	55,252	1,232,119.60	0.20
152	002129	中环股份	100,720	1,230,798.40	0.20
153	002022	科华生物	42,201	1,228,049.10	0.20
154	002176	江特电机	69,500	1,223,200.00	0.20
155	002312	三泰控股	43,775	1,216,945.00	0.19
156	000516	国际医学	55,220	1,214,840.00	0.19
157	300367	东方网力	17,400	1,212,780.00	0.19
158	300088	长信科技	86,302	1,210,817.06	0.19
159	300170	汉得信息	60,850	1,207,872.50	0.19
160	300207	欣旺达	42,900	1,205,490.00	0.19
161	000627	天茂集团	111,900	1,204,044.00	0.19
162	300010	立思辰	37,500	1,196,250.00	0.19
163	000027	深圳能源	119,800	1,175,238.00	0.19

164	002146	荣盛发展	122,900	1,171,237.00	0.19
165	000697	炼石有色	42,100	1,171,222.00	0.19
166	000592	平潭发展	58,500	1,168,830.00	0.19
167	000878	云南铜业	84,296	1,167,499.60	0.19
168	300147	香雪制药	46,340	1,158,963.40	0.19
169	300244	迪安诊断	16,598	1,154,224.92	0.18
170	002739	万达院线	9,600	1,152,000.00	0.18
171	000006	深振业 A	99,200	1,141,792.00	0.18
172	002179	中航光电	29,977	1,137,926.92	0.18
173	300257	开山股份	36,800	1,135,280.00	0.18
174	300287	飞利信	62,300	1,127,630.00	0.18
175	002470	金正大	55,300	1,124,802.00	0.18
176	300324	旋极信息	22,800	1,122,900.00	0.18
177	002266	浙富控股	137,830	1,121,936.20	0.18
178	002273	水晶光电	27,600	1,120,560.00	0.18
179	002467	二六三	53,200	1,116,668.00	0.18
180	300146	汤臣倍健	29,000	1,116,500.00	0.18
181	002563	森马服饰	89,700	1,112,280.00	0.18
182	000999	华润三九	40,600	1,108,380.00	0.18
183	002073	软控股份	65,400	1,105,260.00	0.18
184	000762	西藏矿业	41,800	1,099,340.00	0.18
185	300182	捷成股份	45,750	1,098,000.00	0.18
186	300216	千山药机	24,900	1,097,592.00	0.18
187	000875	吉电股份	119,200	1,095,448.00	0.17
188	002250	联化科技	58,000	1,094,460.00	0.17
189	300055	万邦达	50,400	1,094,184.00	0.17
190	000667	美好集团	218,100	1,081,776.00	0.17
191	000729	燕京啤酒	129,800	1,068,254.00	0.17
192	002508	老板电器	23,700	1,065,315.00	0.17
193	002375	亚厦股份	67,550	1,065,263.50	0.17
194	300203	聚光科技	31,000	1,062,990.00	0.17
195	300166	东方国信	33,178	1,062,691.34	0.17
196	000973	佛塑科技	81,000	1,053,000.00	0.17
197	300274	阳光电源	38,375	1,052,242.50	0.17
198	002223	鱼跃医疗	27,300	1,049,685.00	0.17
199	000939	凯迪生态	72,200	1,039,680.00	0.17
200	002665	首航节能	34,000	1,037,000.00	0.17
201	002294	信立泰	34,400	1,036,128.00	0.17
202	300238	冠昊生物	18,100	1,025,727.00	0.16

203	300291	华录百纳	28,753	1,023,606.80	0.16
204	000616	海航投资	129,300	1,016,298.00	0.16
205	000960	锡业股份	75,300	1,013,538.00	0.16
206	002005	德豪润达	99,700	1,010,958.00	0.16
207	300015	爱尔眼科	31,992	1,010,307.36	0.16
208	001696	宗申动力	73,000	1,008,860.00	0.16
209	000601	韶能股份	91,300	1,005,213.00	0.16
210	002055	得润电子	25,800	997,428.00	0.16
211	000816	智慧农业	119,300	994,962.00	0.16
212	000066	长城电脑	46,000	990,840.00	0.16
213	002424	贵州百灵	38,600	990,476.00	0.16
214	002123	荣信股份	38,601	990,115.65	0.16
215	000983	西山煤电	162,500	988,000.00	0.16
216	000926	福星股份	58,600	986,824.00	0.16
217	002063	远光软件	46,517	983,369.38	0.16
218	002390	信邦制药	68,050	976,517.50	0.16
219	000758	中色股份	65,530	975,086.40	0.16
220	002690	美亚光电	24,135	973,847.25	0.16
221	002191	劲嘉股份	63,375	973,440.00	0.16
222	002195	二三四五	26,300	973,100.00	0.16
223	000021	深科技	79,900	963,594.00	0.15
224	002630	华西能源	65,200	963,004.00	0.15
225	002185	华天科技	53,700	962,841.00	0.15
226	002311	海大集团	68,840	961,694.80	0.15
227	000666	经纬纺机	32,000	961,600.00	0.15
228	002013	中航机电	42,190	956,025.40	0.15
229	300408	三环集团	25,600	954,368.00	0.15
230	000650	仁和药业	89,739	948,541.23	0.15
231	002299	圣农发展	43,100	947,769.00	0.15
232	002219	恒康医疗	63,500	946,150.00	0.15
233	000825	太钢不锈	230,700	945,870.00	0.15
234	002501	利源精制	75,105	944,820.90	0.15
235	300273	和佳股份	45,030	941,127.00	0.15
236	000543	皖能电力	111,070	940,762.90	0.15
237	000777	中核科技	29,800	935,422.00	0.15
238	002428	云南锗业	46,100	934,908.00	0.15
239	000901	航天科技	17,500	925,400.00	0.15
240	000587	金叶珠宝	43,500	924,375.00	0.15
241	000671	阳光城	102,090	921,872.70	0.15

242	002595	豪迈科技	40,600	921,214.00	0.15
243	002261	拓维信息	23,600	918,040.00	0.15
244	300115	长盈精密	27,200	913,104.00	0.15
245	002011	盾安环境	54,400	909,568.00	0.15
246	300498	温氏股份	19,800	905,652.00	0.14
247	002426	胜利精密	34,800	905,496.00	0.14
248	000511	烯碳新材	77,300	905,183.00	0.14
249	300212	易华录	19,500	900,315.00	0.14
250	002051	中工国际	35,350	895,415.50	0.14
251	300199	翰宇药业	36,272	893,379.36	0.14
252	002050	三花股份	83,700	891,405.00	0.14
253	002131	利欧股份	45,700	891,150.00	0.14
254	002067	景兴纸业	99,730	890,588.90	0.14
255	002474	榕基软件	37,100	888,545.00	0.14
256	002001	新和成	50,930	888,219.20	0.14
257	002444	巨星科技	42,900	888,030.00	0.14
258	002019	亿帆鑫富	22,200	888,000.00	0.14
259	300026	红日药业	42,000	886,200.00	0.14
260	002429	兆驰股份	69,800	885,762.00	0.14
261	002642	荣之联	15,100	874,139.00	0.14
262	002310	东方园林	33,000	873,180.00	0.14
263	002550	千红制药	39,000	861,900.00	0.14
264	000860	顺鑫农业	40,300	858,390.00	0.14
265	002373	千方科技	18,700	855,525.00	0.14
266	300028	金亚科技	24,760	854,467.60	0.14
267	300001	特锐德	29,400	852,600.00	0.14
268	000733	振华科技	34,100	852,500.00	0.14
269	300043	互动娱乐	53,900	851,620.00	0.14
270	300352	北信源	13,600	848,640.00	0.14
271	002130	沃尔核材	37,000	848,040.00	0.14
272	300090	盛运环保	72,408	847,897.68	0.14
273	000732	泰禾集团	34,600	847,700.00	0.14
274	002318	久立特材	55,300	846,090.00	0.14
275	300068	南都电源	42,500	843,200.00	0.13
276	300136	信维通信	28,500	842,175.00	0.13
277	000158	常山股份	41,300	840,455.00	0.13
278	000848	承德露露	50,650	835,725.00	0.13
279	000687	华讯方舟	30,900	834,918.00	0.13
280	002190	成飞集成	19,000	831,440.00	0.13

281	002491	通鼎互联	42,900	831,402.00	0.13
282	002588	史丹利	25,500	829,515.00	0.13
283	000518	四环生物	116,800	829,280.00	0.13
284	000681	视觉中国	21,800	828,618.00	0.13
285	000685	中山公用	58,340	825,511.00	0.13
286	000089	深圳机场	100,100	816,816.00	0.13
287	300347	泰格医药	26,500	814,610.00	0.13
288	002551	尚荣医疗	24,636	812,248.92	0.13
289	000488	晨鸣纸业	91,000	811,720.00	0.13
290	002052	同洲电子	55,334	810,643.10	0.13
291	002399	海普瑞	22,900	809,973.00	0.13
292	000861	海印股份	104,720	809,485.60	0.13
293	002583	海能达	64,720	808,352.80	0.13
294	002570	贝因美	54,100	807,713.00	0.13
295	000670	盈方微	50,600	802,516.00	0.13
296	002489	浙江永强	73,800	799,992.00	0.13
297	000519	江南红箭	47,060	799,078.80	0.13
298	000563	陕国投 A	52,800	798,336.00	0.13
299	002271	东方雨虹	40,600	792,918.00	0.13
300	002396	星网锐捷	32,800	792,120.00	0.13
301	002095	生意宝	10,660	784,469.40	0.13
302	000897	津滨发展	137,500	783,750.00	0.13
303	002138	顺络电子	54,600	783,510.00	0.13
304	000680	山推股份	102,100	781,065.00	0.12
305	300336	新文化	18,580	780,360.00	0.12
306	002376	新北洋	42,200	779,856.00	0.12
307	000652	泰达股份	109,300	779,309.00	0.12
308	002269	美邦服饰	115,500	775,005.00	0.12
309	300202	聚龙股份	24,000	772,560.00	0.12
310	002672	东江环保	38,100	768,477.00	0.12
311	002023	海特高新	41,900	768,446.00	0.12
312	300020	银江股份	31,200	765,024.00	0.12
313	002714	牧原股份	16,100	757,827.00	0.12
314	300171	东富龙	25,266	757,474.68	0.12
315	000801	四川九洲	24,469	756,826.17	0.12
316	000558	莱茵体育	27,300	756,210.00	0.12
317	300085	银之杰	13,500	754,650.00	0.12
318	000572	海马汽车	117,700	753,280.00	0.12
319	000050	深天马 A	35,500	752,955.00	0.12

320	000830	鲁西化工	108,600	752,598.00	0.12
321	002344	海宁皮城	49,000	751,660.00	0.12
322	000513	丽珠集团	13,060	750,035.80	0.12
323	000829	天音控股	60,900	744,198.00	0.12
324	002174	游族网络	8,295	742,651.35	0.12
325	300271	华宇软件	15,600	740,688.00	0.12
326	000751	锌业股份	115,020	738,428.40	0.12
327	002437	誉衡药业	24,300	735,075.00	0.12
328	000028	国药一致	11,100	734,265.00	0.12
329	002280	联络互动	11,950	733,730.00	0.12
330	000969	安泰科技	56,500	733,370.00	0.12
331	000979	中弘股份	182,540	730,160.00	0.12
332	002366	台海核电	11,030	727,428.50	0.12
333	300039	上海凯宝	52,300	724,878.00	0.12
334	300101	振芯科技	24,500	722,995.00	0.12
335	300053	欧比特	17,600	717,200.00	0.11
336	002108	沧州明珠	40,550	716,518.50	0.11
337	002482	广田股份	24,400	713,700.00	0.11
338	002285	世联行	43,793	710,760.39	0.11
339	002653	海思科	32,409	709,433.01	0.11
340	002106	莱宝高科	53,100	708,354.00	0.11
341	002121	科陆电子	23,900	707,440.00	0.11
342	300012	华测检测	28,700	705,733.00	0.11
343	000931	中关村	55,545	705,421.50	0.11
344	000786	北新建材	59,100	703,290.00	0.11
345	002358	森源电气	38,100	702,945.00	0.11
346	300122	智飞生物	19,300	702,134.00	0.11
347	002603	以岭药业	38,600	699,818.00	0.11
348	000062	深圳华强	19,008	695,692.80	0.11
349	000090	天健集团	40,800	694,416.00	0.11
350	000049	德赛电池	12,200	692,716.00	0.11
351	002477	雏鹰农牧	40,900	691,619.00	0.11
352	000898	鞍钢股份	144,553	689,517.81	0.11
353	000528	柳工	82,900	687,241.00	0.11
354	300011	鼎汉技术	23,000	685,400.00	0.11
355	002249	大洋电机	51,534	683,340.84	0.11
356	300005	探路者	29,800	682,420.00	0.11
357	002089	新海宜	30,300	682,053.00	0.11
358	002048	宁波华翔	38,600	671,640.00	0.11

359	002028	思源电气	41,900	665,791.00	0.11
360	002244	滨江集团	83,600	665,456.00	0.11
361	002168	深圳惠程	56,100	663,663.00	0.11
362	300054	鼎龙股份	26,900	663,354.00	0.11
363	000539	粤电力 A	90,140	662,529.00	0.11
364	002092	中泰化学	75,200	661,760.00	0.11
365	300288	朗玛信息	10,699	660,342.28	0.11
366	002242	九阳股份	29,100	659,988.00	0.11
367	002025	航天电器	25,390	659,886.10	0.11
368	002029	七匹狼	48,200	658,894.00	0.11
369	002155	湖南黄金	72,600	652,674.00	0.10
370	300159	新研股份	39,300	652,380.00	0.10
371	002215	诺普信	33,600	644,448.00	0.10
372	002414	高德红外	21,100	642,917.00	0.10
373	002181	粤传媒	40,400	640,340.00	0.10
374	300134	大富科技	21,269	640,196.90	0.10
375	002177	御银股份	58,800	637,980.00	0.10
376	002342	巨力索具	83,700	636,957.00	0.10
377	000961	中南建设	41,200	636,952.00	0.10
378	000807	云铝股份	88,500	636,315.00	0.10
379	000726	鲁泰 A	47,000	635,440.00	0.10
380	002326	永太科技	30,000	631,200.00	0.10
381	002041	登海种业	37,350	629,347.50	0.10
382	000088	盐田港	72,600	625,812.00	0.10
383	300229	拓尔思	19,900	624,860.00	0.10
384	002074	国轩高科	16,800	623,280.00	0.10
385	002527	新时达	28,250	621,217.50	0.10
386	300032	金龙机电	20,400	620,160.00	0.10
387	300295	三六五网	12,500	620,000.00	0.10
388	002309	中利科技	32,900	617,862.00	0.10
389	000735	罗牛山	81,600	617,712.00	0.10
390	000417	合肥百货	56,514	617,698.02	0.10
391	002221	东华能源	26,400	617,232.00	0.10
392	000401	冀东水泥	56,600	616,940.00	0.10
393	002099	海翔药业	25,800	615,330.00	0.10
394	300183	东软载波	22,800	614,916.00	0.10
395	300178	腾邦国际	21,100	614,010.00	0.10
396	000900	现代投资	72,800	610,792.00	0.10
397	002577	雷柏科技	10,640	608,820.80	0.10

398	002698	博实股份	20,740	608,304.20	0.10
399	002544	杰赛科技	20,500	607,825.00	0.10
400	002093	国脉科技	40,600	604,128.00	0.10
401	300228	富瑞特装	19,300	602,160.00	0.10
402	300157	恒泰艾普	49,100	599,511.00	0.10
403	000767	漳泽电力	103,600	597,772.00	0.10
404	000933	神火股份	120,000	597,600.00	0.10
405	000099	中信海直	40,400	597,112.00	0.10
406	002262	恩华药业	20,400	597,108.00	0.10
407	002151	北斗星通	11,400	594,852.00	0.09
408	300137	先河环保	28,000	586,600.00	0.09
409	000996	中国中期	20,700	586,431.00	0.09
410	002555	顺荣三七	12,000	586,320.00	0.09
411	002056	横店东磁	20,800	584,688.00	0.09
412	002317	众生药业	44,100	583,884.00	0.09
413	002384	东山精密	29,000	580,580.00	0.09
414	002303	美盈森	42,400	578,760.00	0.09
415	000739	普洛药业	70,200	575,640.00	0.09
416	002178	延华智能	43,400	575,484.00	0.09
417	002229	鸿博股份	19,300	574,368.00	0.09
418	002047	宝鹰股份	51,000	573,240.00	0.09
419	002556	辉隆股份	30,900	571,341.00	0.09
420	002064	华峰氨纶	87,900	570,471.00	0.09
421	000555	神州信息	13,500	568,350.00	0.09
422	000620	新华联	56,100	567,171.00	0.09
423	002663	普邦园林	71,100	564,534.00	0.09
424	000550	江铃汽车	18,800	563,624.00	0.09
425	000902	新洋丰	18,501	563,355.45	0.09
426	002498	汉缆股份	75,600	562,464.00	0.09
427	000156	华数传媒	17,000	557,600.00	0.09
428	000915	山大华特	15,800	555,528.00	0.09
429	300197	铁汉生态	32,260	551,968.60	0.09
430	002237	恒邦股份	55,200	550,896.00	0.09
431	002421	达实智能	24,900	545,310.00	0.09
432	000975	银泰资源	43,400	543,368.00	0.09
433	000937	冀中能源	107,800	543,312.00	0.09
434	000731	四川美丰	56,200	541,768.00	0.09
435	002277	友阿股份	38,900	540,321.00	0.09
436	002480	新筑股份	42,202	540,185.60	0.09

437	000506	中润资源	56,360	539,928.80	0.09
438	300226	上海钢联	10,600	537,420.00	0.09
439	002009	天奇股份	25,700	533,275.00	0.09
440	002540	亚太科技	53,200	530,936.00	0.08
441	300075	数字政通	16,800	526,680.00	0.08
442	000869	张裕 A	11,500	526,470.00	0.08
443	002078	太阳纸业	93,400	525,842.00	0.08
444	300185	通裕重工	57,200	525,668.00	0.08
445	002433	太安堂	35,260	523,963.60	0.08
446	002079	苏州固锴	47,500	518,225.00	0.08
447	002154	报喜鸟	67,800	515,958.00	0.08
448	002233	塔牌集团	35,000	512,750.00	0.08
449	002071	长城影视	28,800	511,200.00	0.08
450	000851	高鸿股份	32,700	511,101.00	0.08
451	300074	华平股份	34,560	509,414.40	0.08
452	300316	晶盛机电	34,640	507,476.00	0.08
453	000987	广州友谊	19,300	505,467.00	0.08
454	002431	棕榈园林	18,800	504,592.00	0.08
455	000877	天山股份	62,800	504,284.00	0.08
456	002197	证通电子	18,900	504,252.00	0.08
457	300034	钢研高纳	19,200	503,040.00	0.08
458	002463	沪电股份	77,400	500,004.00	0.08
459	002122	天马股份	59,900	498,967.00	0.08
460	002339	积成电子	20,400	497,760.00	0.08
461	000693	华泽钴镍	26,600	495,558.00	0.08
462	000812	陕西金叶	38,600	494,080.00	0.08
463	000554	泰山石油	39,900	493,563.00	0.08
464	002170	芭田股份	37,500	492,000.00	0.08
465	002432	九安医疗	19,900	491,530.00	0.08
466	000600	建投能源	46,100	491,426.00	0.08
467	002408	齐翔腾达	36,919	491,391.89	0.08
468	300339	润和软件	10,200	489,804.00	0.08
469	002522	浙江众成	26,400	489,192.00	0.08
470	000958	东方能源	18,900	486,108.00	0.08
471	002625	龙生股份	9,900	481,635.00	0.08
472	002217	合力泰	28,200	477,990.00	0.08
473	002649	博彦科技	8,400	472,752.00	0.08
474	300052	中青宝	16,300	472,537.00	0.08
475	000507	珠海港	63,700	472,017.00	0.08

476	300205	天喻信息	22,800	470,592.00	0.08
477	300111	向日葵	71,100	467,838.00	0.07
478	002440	闰土股份	24,404	464,896.20	0.07
479	002251	步步高	28,170	459,171.00	0.07
480	002505	大康牧业	52,800	448,272.00	0.07
481	002298	鑫龙电器	23,100	443,751.00	0.07
482	002369	卓翼科技	32,700	434,910.00	0.07
483	000596	古井贡酒	11,910	434,715.00	0.07
484	002658	雪迪龙	15,900	432,321.00	0.07
485	300433	蓝思科技	5,100	425,238.00	0.07
486	300152	科融环境	36,600	410,286.00	0.07
487	300369	绿盟科技	8,400	408,576.00	0.07
488	300355	蒙草抗旱	22,500	401,400.00	0.06
489	002307	北新路桥	35,100	395,928.00	0.06
490	002493	荣盛石化	25,500	395,250.00	0.06
491	002240	威华股份	26,600	363,888.00	0.06
492	002203	海亮股份	31,800	349,800.00	0.06
493	000426	兴业矿业	46,600	328,996.00	0.05
494	002638	勤上光电	20,500	314,060.00	0.05
495	000151	中成股份	12,300	300,612.00	0.05
496	002235	安妮股份	10,200	296,820.00	0.05
497	002773	康弘药业	3,600	295,920.00	0.05
498	002313	日海通讯	19,600	290,080.00	0.05
499	002128	露天煤业	34,200	288,990.00	0.05
500	300276	三丰智能	10,800	274,968.00	0.04
501	300413	快乐购	5,400	213,840.00	0.03
502	300148	天舟文化	12,080	212,608.00	0.03
503	000553	沙隆达 A	19,700	210,790.00	0.03
504	000727	华东科技	20,700	205,137.00	0.03

8.3.2 期末积极投资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

注：本基金本报告期末未持有积极投资。

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	300059	东方财富	18,101,874.80	0.98
2	000725	京东方 A	12,455,105.60	0.68
3	002594	比亚迪	12,258,773.11	0.67
4	002450	康得新	9,265,138.04	0.50
5	300024	机器人	8,884,814.00	0.48
6	000503	海虹控股	8,472,572.89	0.46
7	300168	万达信息	8,384,104.35	0.46
8	002183	怡亚通	8,335,624.50	0.45
9	000333	美的集团	7,752,667.39	0.42
10	000917	电广传媒	7,561,639.56	0.41
11	002202	金风科技	7,179,334.74	0.39
12	000728	国元证券	7,115,143.58	0.39
13	000001	平安银行	6,915,218.00	0.38
14	002065	东华软件	6,336,926.99	0.34
15	002400	省广股份	6,178,833.05	0.34
16	002673	西部证券	6,017,626.40	0.33
17	002405	四维图新	5,879,767.81	0.32
18	300104	乐视网	5,869,447.88	0.32
19	002129	中环股份	5,709,316.20	0.31
20	002465	海格通信	5,687,218.89	0.31

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	000651	格力电器	74,362,071.27	4.04
2	000002	万科 A	70,703,628.31	3.84
3	000001	平安银行	57,582,572.55	3.13
4	000625	长安汽车	52,618,795.62	2.86
5	000166	申万宏源	50,391,925.45	2.74
6	000776	广发证券	46,654,813.28	2.53
7	002024	苏宁云商	44,087,505.79	2.40
8	000333	美的集团	43,279,040.66	2.35

9	000783	长江证券	40,511,662.97	2.20
10	000063	中兴通讯	34,333,689.58	1.87
11	300104	乐视网	33,696,308.00	1.83
12	000024	招商地产	30,271,348.51	1.64
13	002594	比亚迪	29,134,473.49	1.58
14	000100	TCL 集团	28,671,083.87	1.56
15	002230	科大讯飞	27,982,599.70	1.52
16	000858	五粮液	25,080,997.41	1.36
17	002415	海康威视	23,915,937.61	1.30
18	000069	华侨城 A	23,839,129.38	1.30
19	000768	中航飞机	23,810,593.50	1.29
20	000725	京东方 A	23,659,013.28	1.29

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,251,220,875.76
卖出股票收入（成交）总额	1,249,156,851.14

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	89,389.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,399.97
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	91,789.77

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资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	000002	万科 A	21,617,080.94	3.45	重大事项停牌
2	300104	乐视网	5,836,605.60	0.93	重大事项停牌

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§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****9.1.1 本基金的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
6,104	76,860.17	299,212,652.00	63.78%	169,941,855.00	36.22%

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
中国工商银行-南方深证成份交易型 开放式指数证券投资基金联接基金	276,321,432.00	58.90%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行—南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

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	国信证券股份有限公司融券专用证 券账户	7,353,900.00	1.57%
2	国信证券股份有限公司	5,338,800.00	1.14%
3	陈维东	5,000,000.00	1.07%
4	中国银河证券股份有限公司	2,472,368.00	0.53%
5	台新国际商业银行股份有限公司— 自有资金	2,362,721.00	0.50%
6	曲怀仁	2,000,000.00	0.43%
7	刘素坚	1,845,018.00	0.39%
8	邬海滨	1,475,867.00	0.31%

9	凌燕	1,475,778.00	0.31%
10	王燕燕	1,439,379.00	0.31%
11	中国工商银行股份有限公司—南方深证成份交易型开放式指数证券投	276,321,432.00	58.90%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额；本只基金的基金经理未持有本基金份额。

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

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

基金合同生效日（2009年12月4日）基金份额总额	4,127,538,537.00
本报告期期初基金份额总额	1,590,854,507.00
本报告期基金总申购份额	2,238,600,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,360,300,000.00
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	469,154,507.00

§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

根据南方基金管理有限公司第六届董事会第十四次会议审议通过，并向中国基金业协会报备，基金管理人于2015年5月29日发布公告，聘任常克川、李海鹏为公司副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，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 91,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 6 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	
银河证券	1	11,683,158,074.43	67.32%	175,819.65	46.10%	-
申万宏源	1	659,197,683.54	26.37%	65,925.91	17.28%	-
东北证券	1	73,368,548.95	2.93%	64,924.14	17.02%	-
国泰君安	1	51,408,062.93	2.06%	45,491.74	11.93%	-
广发证券	1	17,514,703.56	0.70%	15,498.82	4.06%	-
中泰证券	1	10,018,820.17	0.40%	8,865.95	2.32%	-
国信证券	1	3,150,638.40	0.13%	2,788.05	0.73%	-
华泰证券	1	2,374,986.00	0.09%	2,101.62	0.55%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	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

- (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席位:

- (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

注: 无。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于电子直销平台相关业务调整费率优惠方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年12月29日
2	关于京东电子交易平台实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年12月4日
3	关于电子直销业务调整通联支付申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年11月23日
4	南方基金管理有限公司关于公司旗下开放式基金变更代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年9月12日
5	关于修订公司旗下开放式指数基金基金合同有关基金关联交易限制等投资限制条款的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年8月12日
6	关于注意防范冒用南方基金名义进行的非法证券活动的提示	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年8月7日
7	南方基金管理有限公司关于深成ETF申购赎回清单新增申赎数量限制指标的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年7月30日
8	关于京东电子交易平台实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年7月9日
9	南方基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年5月29日
10	关于配合深证成份指数编制方案修订具体安排的第四次提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年5月18日

11	南方基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年5月7日
12	关于配合深证成份指数编制方案修订具体安排的第三次提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年5月4日
13	南方基金管理有限公司深圳分公司负责人等信息变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年4月28日
14	南方基金管理有限公司关于公司高级管理人员在子公司兼职情况变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年4月23日
15	关于配合深证成份指数编制方案修订具体安排的第二次提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年4月20日
16	南方基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼任职务情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年4月18日
17	关于配合深证成份指数编制方案修订具体安排的第一次提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年4月7日
18	关于配合深证成份指数编制方案修订具体安排的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年3月27日
19	关于配合深证成份指数编制方案修订有关事项的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年3月23日
20	南方基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年3月17日
21	南方基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼任职务情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年2月12日

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立深证成份交易型开放式指数证券投资基金的文件。
- 2、深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同。
- 3、深证成份交易型开放式指数证券投资基金托管协议。
- 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

深圳市福田区福华一路 6 号免税商务大厦 31-33 楼

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>