

# 南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券 投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 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 8 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	12
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.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>30</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	43
7.7 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.....	43
7.8 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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	49
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>50</b>
11.1 备查文件目录.....	50
11.2 存放地点.....	50
11.3 查阅方式.....	50

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方开元沪深 300ETF
场内简称	南方 300
基金主代码	159925
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2013 年 2 月 18 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	859,199,451.00 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	2013 年 4 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 300”。

### 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>本基金为被动式指数基金，采用指数复制法，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>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> <p>本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数：沪深 300 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	深圳市福田区中心区福华一路 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	深圳市福田区中心区福华一路 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	易会满

## 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	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
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(2016 年 1 月 1 日 – 2016 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	-30,009,914.35
本期利润	-181,154,816.88
加权平均基金份额本期利润	-0.2131
本期加权平均净值利润率	-17.14%
本期基金份额净值增长率	-14.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2016 年 6 月 30 日 )
期末可供分配利润	105,741,339.25
期末可供分配基金份额利润	0.1231
期末基金资产净值	1,085,750,099.91
期末基金份额净值	1.2637
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2016 年 6 月 30 日 )
基金份额累计净值增长率	20.65%

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. 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）。

## 3.2 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
过去一个月	0.21%	0.97%	-0.49%	0.98%	0.70%	-0.01%
过去三个月	-0.99%	1.01%	-1.99%	1.01%	1.00%	0.00%
过去六个月	-14.67%	1.84%	-15.47%	1.84%	0.80%	0.00%
过去一年	-28.51%	2.30%	-29.49%	2.30%	0.98%	0.00%
过去三年	48.81%	1.84%	43.32%	1.84%	5.49%	0.00%
自基金合同生效起至今	20.65%	1.80%	15.21%	1.81%	5.44%	-0.01%

### 3.2.2 自基金转型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



注：1. 本基金建仓期为三个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

2. 本基金转型日期为 2013 年 2 月 18 日。

3. 合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

## §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——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 5,600 亿元，旗下管理 96 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		
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 5 月 17 日	-	11 年	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，具有中国基金从业资格。曾先后任职于美国 Open Link Financial 公司、摩根斯坦利公司，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理，现任数量化投资部总监助理；2013 年 5 月至 2015 年 6 月，任南方策略基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500 基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方 300 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2014 年 10 月至今，任 500 医药基金经理；2015 年 2 月至今，任南方恒生 ETF 基金经理。
杨德龙	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日	2016 年 3 月 4 日	10 年	北京大学经济学硕士、清华大学工学学士，具有基金从业资格。2006 年加入南方基金，担任研究部高级行业研究员、

	理				首席策略分析师；2010 年 8 月至 2013 年 4 月，任小康 ETF 及南方小康基金经理；2011 年 9 月至 2016 年 3 月，任南方上证 380ETF 及联接基金基金经理；2013 年 3 月至 2016 年 3 月，任南方策略基金经理；2013 年 4 月至 2016 年 3 月，任南方 300 基金经理；2013 年 4 月至 2016 年 3 月，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2014 年 12 月至 2016 年 3 月，任南方恒生 ETF 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，“离任日期”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《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《南方开元沪深 300 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，没有损害基金持有人利益。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。

##### 4.3.2 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超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 1 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。

## 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，沪深 300 指数跌 15.47%。

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”、“ETF 现金流精算系统”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 ETF 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；
- ④6 月中，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

自本基金上市以来至报告期末年化跟踪误差为 0.479%，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 1.2637 元，报告期内，份额净值增长率为-14.67%，同期业绩基准增长率为-15.47%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济结构转型、产业升级的继续推进，潜在增速将放缓，预期利率水平仍持续走低，宽松货币政策逻辑不变，投资方面将导致资产配置荒。

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，组成人员包括副总裁、总裁助理兼权益投资总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等。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。

#### 4.7 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，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。基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；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，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定。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。

#### 4.8 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

本报告期内，本基金托管人在对南方开元沪深300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

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

本报告期内南方开元沪深 300 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南方开元沪深 300 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，南方开元沪深 300 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

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2016 半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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金  
报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.4.1	1,213,325.39	3,161,476.12
结算备付金		38,589.97	4,054,552.78
存出保证金		17,414.97	1,223,149.83
交易性金融资产	6.4.4.2	1,085,235,242.66	1,236,042,763.55
其中：股票投资		1,085,154,574.26	1,236,042,763.55
基金投资		-	-
债券投资		80,668.40	-
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		961,961.56	381.05
应收利息	6.4.4.5	513.72	2,869.22

应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		1,087,467,048.27	1,244,485,192.55
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		440,098.23	527,473.09
应付托管费		88,019.65	105,494.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	47,132.00	29,789.88
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	1,141,698.48	1,029,478.10
负债合计		1,716,948.36	1,692,235.71
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.4.9	980,008,760.66	957,196,624.12
未分配利润	6.4.4.10	105,741,339.25	285,596,332.72
所有者权益合计		1,085,750,099.91	1,242,792,956.84
负债和所有者权益总计		1,087,467,048.27	1,244,485,192.55

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2637 元，基金份额总额 859,199,451.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
<b>一、收入</b>		-177,494,708.71	608,215,680.56
1.利息收入		26,622.50	42,480.25
其中：存款利息收入	6.4.4.11	26,553.70	42,382.31

债券利息收入		68.80	97.94
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）		-26,316,774.34	1,063,540,226.78
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-35,595,425.49	1,056,250,542.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	25,057.19	383,852.67
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.4.14	-	-
衍生工具收益	6.4.4.15	-787,380.00	-5,174,280.00
股利收益	6.4.4.16	10,040,973.96	12,080,111.70
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.17	-151,144,902.53	-456,159,283.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	-59,654.34	792,256.82
<b>减：二、费用</b>		3,660,108.17	7,557,235.99
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	2,631,530.15	5,357,457.42
2. 托管费	6.4.7.2.2	526,306.08	1,071,491.47
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.4.19	115,441.87	582,900.48
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.4.20	386,830.07	545,386.62
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-181,154,816.88	600,658,444.57
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-181,154,816.88	600,658,444.57

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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)	957,196,624.12	285,596,332.72	1,242,792,956.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-181,154,816.88	-181,154,816.88
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)	22,812,136.54	1,299,823.41	24,111,959.95
其中: 1. 基金申购款	136,872,819.40	10,915,997.86	147,788,817.26
2. 基金赎回款	-114,060,682.86	-9,616,174.45	-123,676,857.31
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)	980,008,760.66	105,741,339.25	1,085,750,099.91
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	1,935,837,283.04	436,806,471.45	2,372,643,754.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	600,658,444.57	600,658,444.57
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)	-928,453,958.40	-483,717,435.39	-1,412,171,393.79
其中: 1. 基金申购款	714,019,874.53	476,158,693.40	1,190,178,567.93
2. 基金赎回款	-1,642,473,832.93	-959,876,128.79	-2,602,349,961.72
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)	1,007,383,324.64	553,747,480.63	1,561,130,805.27

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.2 重要会计政策和会计估计

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。

##### 6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.2.2 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。

##### 6.4.2.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.3 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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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。

#### 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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	1,213,325.39
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,213,325.39

##### 6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,239,364,493.25	1,085,154,574.26	-154,209,918.99
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	80,668.40	12,668.40
	银行间市场	-	-
	合计	80,668.40	12,668.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,239,432,493.25	1,085,235,242.66	-154,197,250.59

注：股票投资的公允价值和公允价值变动均包含可退替代款的估值增值。

##### 6.4.4.3 衍生金融资产/负债

无。

**6.4.4.4 买入返售金融资产**

无。

**6.4.4.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	443.37
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	15.55
应收债券利息	47.69
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	7.11
合计	513.72

**6.4.4.6 其他资产**

无余额。

**6.4.4.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	47,132.00
银行间市场应付交易费用	-
合计	47,132.00

**6.4.4.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付赎回费	-
预提费用	228,741.24
指数使用费	157,891.83
可退替代款	5,065.41
应退替代款	-

合计	1,141,698.48
----	--------------

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。

#### 6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	839,199,451.00	957,196,624.12
本期申购	120,000,000.00	136,872,819.40
本期赎回(以“-”号填列)	-100,000,000.00	-114,060,682.86
本期末	859,199,451.00	980,008,760.66

#### 6.4.4.10 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	803,831,735.68	-518,235,402.96	285,596,332.72
本期利润	-30,009,914.35	-151,144,902.53	-181,154,816.88
本期基金份额交易产生的变动数	18,704,207.69	-17,404,384.28	1,299,823.41
其中：基金申购款	113,148,278.01	-102,232,280.15	10,915,997.86
基金赎回款	-94,444,070.32	84,827,895.87	-9,616,174.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	792,526,029.02	-686,784,689.77	105,741,339.25

#### 6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
	活期存款利息收入
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	19,684.90
其他	200.80
合计	26,553.70

**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 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-12,573,087.43
股票投资收益——赎回差价收入	-23,022,338.06
合计	-35,595,425.49

**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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	82,216,519.84
减：卖出股票成本总额	94,789,607.27
买卖股票差价收入	-12,573,087.43

**6.4.4.12.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
赎回基金份额对价总额	123,619,985.62
减：现金支付赎回款总额	665,187.31
减：赎回股票成本总额	145,977,136.37
赎回差价收入	-23,022,338.06

**6.4.4.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	346,078.30
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	321,000.00
减：应收利息总额	21.11
买卖债券差价收入	25,057.19

**6.4.4.14 贵金属投资收益**

无。

**6.4.4.15 衍生工具收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016年1月1日至2016年6月30日
权证投资收益	-
股指期货-投资收益	-787,380.00

**6.4.4.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	10,040,973.96
基金投资产生的股利收益	-
合计	10,040,973.96

**6.4.4.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-151,089,642.53
——股票投资	-151,102,310.93
——债券投资	12,668.40
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-55,260.00
——权证投资	-55,260.00
3. 其他	-
合计	-151,144,902.53

**6.4.4.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-59,654.34

合计	-59,654.34
----	------------

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。

#### 6.4.4.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	115,441.87
银行间市场交易费用	-
合计	115,441.87

#### 6.4.4.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,179.94
上市年费	29,835.26
银行汇划费	197.00
指数使用费	157,891.83
合计	386,830.07

### 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

无。

#### 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、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
南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“南方开元沪深 300ETF 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。

#### 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 2016年1月1日至2016年6月 30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	56,277,717.28	32.45%	22,498,545.49	3.71%

##### 6.4.7.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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	5,627.86	32.45%	5,627.86	11.94%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	19,909.07	10.12%	20,960.02	5.09%

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、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。

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。

## 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 2016年1月1日至2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,631,530.15	5,357,457.42
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管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.5\% / \text{当年天数}$ 。

### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	526,306.08	1,071,491.47

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 0.1% 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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}$ 。

### 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

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自有资金投资本基金的情况

无。

#### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015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
中国工商银行—南方 开元沪深 300 交易型 开放式指数证券投资 基金联接基金	628,944,419.00	73.2000%	598,944,419.00	71.3700%

注：南方开元沪深 300ETF 联接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。

#### 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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 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
中国工商银行	1,213,325.39	6,668.00	16,751,725.34	18,482.61

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。

#### 6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.8 利润分配情况

##### 6.4.8.1 利润分配情况——非货币市场基金

本期无利润分配。

#### 6.4.9 期末（2016 年 6 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
601966	玲珑轮胎	2016 年 6 月 24 日	2016 年 7 月 6 日	新股流通 受限	12.98	12.98	8,985	116,625.30	116,625.30	
603016	新宏泰	2016 年 6 月 23 日	2016 年 7 月 1 日	新股流通 受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	
300520	科大国创	2016 年	2016 年	新股流通	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	

		6月30日	7月8日	受限						
002805	丰元股份	2016年 6月29日	2016年 7月7日	新股流通 受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

#### 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
000002	万科 A	2015年 12月 21日	重大事 项	24.43	2016年 7月4日	21.99	968,913	13,843,592.51	23,670,544.59	-
000651	格力 电器	2016年 2月22日	重大事 项	19.22	-	-	613,464	12,371,732.86	11,790,778.08	-
600019	宝钢 股份	2016年 6月27日	重大事 项	4.90	-	-	628,268	3,848,787.37	3,078,513.20	-
600649	城投 控股	2016年 6月20日	重大事 项	14.36	-	-	189,596	2,131,236.52	2,722,598.56	-
000728	国元 证券	2016年 6月8日	重大事 项	16.72	2016年 7月8日	17.37	152,466	3,382,866.44	2,549,231.52	-
002065	东华 软件	2015年 12月 22日	重大事 项	25.10	2016年 7月4日	22.59	96,327	2,395,636.35	2,417,807.70	-
002465	海格 通信	2016年 6月13日	重大事 项	12.44	-	-	190,224	2,817,388.34	2,366,386.56	-
000415	渤海 金控	2016年 2月1日	重大事 项	6.82	2016年 8月11日	7.50	230,400	1,938,686.04	1,571,328.00	-
600005	武钢 股份	2016年 6月27日	重大事 项	2.76	-	-	511,400	2,833,065.75	1,411,464.00	-
002129	中环 股份	2016年 4月25日	重大事 项	8.29	-	-	168,818	2,368,628.77	1,399,501.22	-
000629	*ST 钒钛	2016年 5月26日	重大事 项	2.39	-	-	555,047	2,041,687.05	1,326,562.33	-
601611	中国 核建	2016年 6月30日	股价异 常波动	20.92	2016年 7月1日	23.01	26,723	92,728.81	559,045.16	-
600166	福田 汽车	2016年 6月30日	重大事 项	5.52	2016年 7月1日	5.62	16	109.84	88.32	-

注：本基金截至 2016 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

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

本基金为交易型开放式指数基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现。本基金投资的金融工具主要为股票投资等。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工商银行，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制

以控制相应的信用风险。

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

#### **6.4.10.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.9 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，其余金融资产均能以合理价格适时变现。

#### **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、存出保证金等。

##### **6.4.10.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末 2016 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	1,213,325.39	-	-	-	1,213,325.39
结算备付金	38,589.97	-	-	-	38,589.97
存出保证金	17,414.97	-	-	-	17,414.97
交易性金融资产	80,668.40	-	-	-1,085,154,574.26	1,085,235,242.66
应收证券清算款	-	-	-	961,961.56	961,961.56
应收利息	-	-	-	513.72	513.72
资产总计	1,349,998.73	-	-	-1,086,117,049.54	1,087,467,048.27
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	440,098.23	440,098.23
应付托管费	-	-	-	88,019.65	88,019.65
应付交易费用	-	-	-	47,132.00	47,132.00
其他负债	-	-	-	1,141,698.48	1,141,698.48
负债总计	-	-	-	1,716,948.36	1,716,948.36
利率敏感度缺口	1,349,998.73	-	-	-1,084,400,101.18	1,085,750,099.91
上年度末 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	3,161,476.12	-	-	-	3,161,476.12
结算备付金	4,054,552.78	-	-	-	4,054,552.78
存出保证金	1,223,149.83	-	-	-	1,223,149.83
交易性金融资产	-	-	-	-1,236,042,763.55	1,236,042,763.55
应收证券清算款	-	-	-	381.05	381.05
应收利息	-	-	-	2,869.22	2,869.22
资产总计	8,439,178.73	-	-	-1,236,046,013.82	1,244,485,192.55
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	527,473.09	527,473.09
应付托管费	-	-	-	105,494.64	105,494.64
应付交易费用	-	-	-	29,789.88	29,789.88
其他负债	-	-	-	1,029,478.10	1,029,478.10
负债总计	-	-	-	1,692,235.71	1,692,235.71
利率敏感度缺口	8,439,178.73	-	-	-1,234,353,778.11	1,242,792,956.84

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。

#### 6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 06 月 30 日，本基金持有可转债公允价值 80,668.40 元，占基金净资产比例为 0.0074%（2015 年 12 月 31 日：未持有交易型债券投资），因此市场利率的变动对于本基金资产

净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：未持有交易型债券投资)。

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，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。

本基金采用完全复制法，跟踪沪深 300 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，沪深 300 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%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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。

##### 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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	1,085,154,574.26	99.95	1,236,042,763.55	99.46
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	1,085,154,574.26	99.95	1,236,042,763.55	99.46

##### 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：人民币万元）

		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	增加约 5,429	增加约 6,203
	业绩比较基准下降 5%	减少约 5,429	减少约 6,203

## §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	1,085,154,574.26	99.79
	其中：股票	1,085,154,574.26	99.79
2	固定收益投资	80,668.40	0.01
	其中：债券	80,668.40	0.01
	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	1,251,915.36	0.12
7	其他各项资产	979,890.25	0.09
8	合计	1,087,467,048.27	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	851,228.43	0.08
B	采矿业	39,033,562.53	3.60
C	制造业	342,979,576.99	31.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,764,341.83	3.94
E	建筑业	35,242,217.61	3.25
F	批发和零售业	22,805,772.92	2.10
G	交通运输、仓储和邮政业	32,889,227.58	3.03
H	住宿和餐饮业	0.00	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	68,757,639.88	6.33
J	金融业	389,894,594.56	35.91
K	房地产业	60,131,393.40	5.54
L	租赁和商务服务业	13,039,222.43	1.20
M	科学研究和技术服务业	0.00	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,574,942.66	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	-
P	教育	0.00	-
Q	卫生和社会工作	1,831,541.14	0.17
R	文化、体育和娱乐业	20,331,190.92	1.87
S	综合	5,377,557.53	0.50
	合计	1,083,504,010.41	99.79

## 7.2.2 期末积极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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,000,900.19	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	559,045.16	0.05
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,492.40	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	1,650,563.85	0.15
--	----	--------------	------

### 7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

## 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

### 7.3.1 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	601318	中国平安	1,376,914	44,116,324.56	4.06
2	600016	民生银行	3,006,420	26,847,330.60	2.47
3	601166	兴业银行	1,695,985	25,846,811.40	2.38
4	000002	万科 A	968,913	23,670,544.59	2.18
5	600036	招商银行	1,311,642	22,953,735.00	2.11
6	601328	交通银行	3,494,034	19,671,411.42	1.81
7	600519	贵州茅台	63,905	18,655,147.60	1.72
8	600000	浦发银行	1,099,707	17,122,437.99	1.58
9	600030	中信证券	999,292	16,218,509.16	1.49
10	600837	海通证券	1,029,046	15,867,889.32	1.46
11	601288	农业银行	4,853,174	15,530,156.80	1.43
12	601398	工商银行	3,080,600	13,677,864.00	1.26
13	601169	北京银行	1,287,084	13,347,061.08	1.23
14	600887	伊利股份	769,998	12,835,866.66	1.18
15	000651	格力电器	613,464	11,790,778.08	1.09
16	601601	中国太保	399,064	10,790,690.56	0.99
17	601766	中国中车	1,163,868	10,672,669.56	0.98
18	600900	长江电力	837,903	10,465,408.47	0.96
19	601668	中国建筑	1,904,430	10,131,567.60	0.93
20	000333	美的集团	406,372	9,639,143.84	0.89
21	601988	中国银行	2,675,855	8,589,494.55	0.79
22	600104	上汽集团	419,941	8,520,602.89	0.78
23	601688	华泰证券	414,700	7,846,124.00	0.72
24	000858	五粮液	240,970	7,838,754.10	0.72
25	600048	保利地产	904,209	7,803,323.67	0.72
26	601818	光大银行	2,021,685	7,601,535.60	0.70
27	000001	平安银行	872,011	7,586,495.70	0.70

28	601989	中国重工	1,166,935	7,386,698.55	0.68
29	600276	恒瑞医药	178,884	7,175,037.24	0.66
30	000725	京东方 A	3,017,282	6,969,921.42	0.64
31	600015	华夏银行	678,236	6,707,754.04	0.62
32	600028	中国石化	1,334,557	6,299,109.04	0.58
33	000776	广发证券	375,769	6,297,888.44	0.58
34	300104	乐视网	117,800	6,232,798.00	0.57
35	600999	招商证券	368,695	6,083,467.50	0.56
36	300059	东方财富	271,020	6,016,644.00	0.55
37	600518	康美药业	377,313	5,731,384.47	0.53
38	600958	东方证券	335,200	5,634,712.00	0.52
39	002450	康得新	326,896	5,589,921.60	0.51
40	002304	洋河股份	76,573	5,507,130.16	0.51
41	002736	国信证券	312,400	5,388,900.00	0.50
42	002024	苏宁云商	472,836	5,134,998.96	0.47
43	002415	海康威视	232,533	4,990,158.18	0.46
44	601390	中国中铁	709,792	4,947,250.24	0.46
45	000783	长江证券	421,442	4,888,727.20	0.45
46	601006	大秦铁路	754,906	4,861,594.64	0.45
47	002594	比亚迪	79,317	4,839,130.17	0.45
48	002739	万达院线	59,700	4,770,030.00	0.44
49	000166	申万宏源	565,830	4,758,630.30	0.44
50	601939	XD 建设银	974,324	4,628,039.00	0.43
51	002673	西部证券	177,258	4,583,891.88	0.42
52	601857	中国石油	616,743	4,459,051.89	0.41
53	601628	中国人寿	211,453	4,402,451.46	0.41
54	601377	兴业证券	594,317	4,392,002.63	0.40
55	600795	国电电力	1,496,830	4,385,711.90	0.40
56	601186	中国铁建	437,503	4,357,529.88	0.40
57	601009	南京银行	460,858	4,327,456.62	0.40
58	000063	中兴通讯	299,475	4,294,471.50	0.40
59	001979	招商蛇口	300,684	4,284,747.00	0.39
60	601336	新华保险	105,935	4,279,774.00	0.39
61	000538	云南白药	66,117	4,251,323.10	0.39
62	600570	恒生电子	62,827	4,194,958.79	0.39
63	600050	XD 中国联	1,074,889	4,095,327.09	0.38
64	601899	紫金矿业	1,203,787	4,056,762.19	0.37
65	601985	中国核电	592,800	4,048,824.00	0.37
66	300017	网宿科技	60,231	4,047,523.20	0.37

67	600637	东方明珠	166,489	4,040,688.03	0.37
68	600011	华能国际	533,282	4,010,280.64	0.37
69	601901	方正证券	521,841	3,997,302.06	0.37
70	000625	长安汽车	286,450	3,915,771.50	0.36
71	002230	科大讯飞	114,805	3,771,344.25	0.35
72	600585	海螺水泥	253,553	3,686,660.62	0.34
73	600111	北方稀土	276,794	3,684,128.14	0.34
74	000503	海虹控股	91,300	3,671,173.00	0.34
75	002142	宁波银行	247,592	3,659,409.76	0.34
76	601555	东吴证券	266,193	3,566,986.20	0.33
77	600010	包钢股份	1,240,190	3,546,943.40	0.33
78	601099	太平洋	576,960	3,536,764.80	0.33
79	601088	中国神华	251,230	3,534,806.10	0.33
80	300024	机器人	138,540	3,517,530.60	0.32
81	600547	山东黄金	90,288	3,513,106.08	0.32
82	000423	东阿阿胶	66,301	3,502,681.83	0.32
83	601211	国泰君安	193,600	3,444,144.00	0.32
84	600690	青岛海尔	387,006	3,436,613.28	0.32
85	600893	中航动力	98,841	3,424,840.65	0.32
86	600100	同方股份	225,792	3,377,848.32	0.31
87	600705	中航资本	569,860	3,350,776.80	0.31
88	600271	航天信息	140,776	3,350,468.80	0.31
89	300027	华谊兄弟	247,096	3,345,679.84	0.31
90	600066	宇通客车	168,351	3,333,349.80	0.31
91	002241	歌尔声学	116,132	3,330,665.76	0.31
92	600703	三安光电	161,558	3,226,313.26	0.30
93	600009	上海机场	122,340	3,186,957.00	0.29
94	600029	南方航空	445,800	3,147,348.00	0.29
95	601198	东兴证券	127,200	3,108,768.00	0.29
96	600109	国金证券	230,390	3,105,657.20	0.29
97	600019	宝钢股份	628,268	3,078,513.20	0.28
98	000100	TCL 集团	930,299	3,060,683.71	0.28
99	002202	金风科技	198,388	3,001,610.44	0.28
100	601669	中国电建	523,142	2,987,140.82	0.28
101	000839	中信国安	139,100	2,964,221.00	0.27
102	600383	金地集团	285,653	2,959,365.08	0.27
103	600535	天士力	82,298	2,942,976.48	0.27
104	300070	碧水源	196,997	2,931,315.36	0.27
105	600115	东方航空	430,114	2,843,053.54	0.26

106	600886	国投电力	430,239	2,839,577.40	0.26
107	601727	上海电气	374,700	2,832,732.00	0.26
108	600089	特变电工	329,104	2,803,966.08	0.26
109	000768	中航飞机	140,689	2,770,166.41	0.26
110	000009	中国宝安	202,172	2,769,756.40	0.26
111	600196	复星医药	145,580	2,768,931.60	0.26
112	600340	华夏幸福	112,330	2,738,605.40	0.25
113	600649	城投控股	189,596	2,722,598.56	0.25
114	601888	中国国旅	61,878	2,721,394.44	0.25
115	002456	欧菲光	91,380	2,695,710.00	0.25
116	600177	雅戈尔	194,613	2,683,713.27	0.25
117	000069	华侨城 A	416,143	2,663,315.20	0.25
118	600485	信威集团	148,229	2,644,405.36	0.24
119	000568	泸州老窖	88,934	2,641,339.80	0.24
120	601607	上海医药	146,189	2,638,711.45	0.24
121	002252	上海莱士	69,900	2,633,832.00	0.24
122	600023	浙能电力	517,300	2,633,057.00	0.24
123	000895	双汇发展	125,595	2,622,423.60	0.24
124	601600	中国铝业	694,798	2,619,388.46	0.24
125	600804	鹏博士	143,481	2,615,658.63	0.24
126	600369	西南证券	358,416	2,602,100.16	0.24
127	600153	建发股份	215,945	2,591,340.00	0.24
128	300315	掌趣科技	246,200	2,582,638.00	0.24
129	000793	华闻传媒	260,370	2,572,455.60	0.24
130	000728	国元证券	152,466	2,549,231.52	0.23
131	600118	中国卫星	74,985	2,519,496.00	0.23
132	601788	光大证券	148,600	2,517,284.00	0.23
133	600061	国投安信	140,600	2,505,492.00	0.23
134	600867	通化东宝	120,918	2,501,793.42	0.23
135	600352	浙江龙盛	289,096	2,492,007.52	0.23
136	600660	福耀玻璃	177,769	2,488,766.00	0.23
137	600406	国电南瑞	185,057	2,474,212.09	0.23
138	002008	大族激光	108,239	2,472,178.76	0.23
139	601919	中国远洋	484,100	2,459,228.00	0.23
140	600489	中金黄金	218,745	2,458,693.80	0.23
141	600031	三一重工	482,831	2,423,811.62	0.22
142	002065	东华软件	96,327	2,417,807.70	0.22
143	600739	辽宁成大	155,061	2,414,299.77	0.22
144	601018	宁波港	487,569	2,413,466.55	0.22

145	002236	大华股份	184,163	2,412,535.30	0.22
146	000338	潍柴动力	307,030	2,397,904.30	0.22
147	600309	万华化学	137,922	2,386,050.60	0.22
148	000917	电广传媒	144,104	2,382,039.12	0.22
149	002500	山西证券	143,543	2,377,072.08	0.22
150	600221	海南航空	748,796	2,373,683.32	0.22
151	300168	万达信息	91,100	2,367,689.00	0.22
152	002465	海格通信	190,224	2,366,386.56	0.22
153	300124	汇川技术	121,176	2,350,814.40	0.22
154	002475	立讯精密	119,588	2,349,904.20	0.22
155	600718	东软集团	126,260	2,313,083.20	0.21
156	600674	川投能源	279,632	2,309,760.32	0.21
157	000157	中联重科	556,943	2,300,174.59	0.21
158	000686	东北证券	178,033	2,298,406.03	0.21
159	600446	金证股份	63,600	2,286,420.00	0.21
160	002183	怡亚通	159,600	2,285,472.00	0.21
161	000623	吉林敖东	91,373	2,279,756.35	0.21
162	601618	中国中冶	617,667	2,279,191.23	0.21
163	000559	万向钱潮	145,430	2,268,708.00	0.21
164	600741	华域汽车	159,804	2,238,854.04	0.21
165	000540	中天城投	356,600	2,221,618.00	0.20
166	000876	新希望	266,198	2,214,767.36	0.20
167	601998	中信银行	389,032	2,205,811.44	0.20
168	601111	XD 中国国	324,031	2,190,449.56	0.20
169	000630	铜陵有色	848,365	2,154,847.10	0.20
170	600415	小商品城	347,390	2,146,870.20	0.20
171	601933	永辉超市	515,696	2,129,824.48	0.20
172	600663	陆家嘴	93,077	2,117,501.75	0.20
173	600018	上港集团	411,882	2,100,598.20	0.19
174	002385	大北农	259,708	2,093,246.48	0.19
175	000963	华东医药	30,787	2,075,043.80	0.19
176	600085	同仁堂	69,588	2,073,026.52	0.19
177	600839	四川长虹	468,164	2,069,284.88	0.19
178	000060	中金岭南	196,629	2,050,840.47	0.19
179	603993	洛阳钼业	492,530	2,043,999.50	0.19
180	600068	XD 葛洲坝	350,765	2,041,452.30	0.19
181	601800	XD 中国交	193,587	2,038,471.11	0.19
182	002081	金螳螂	201,361	2,017,637.22	0.19
183	300003	乐普医疗	110,616	2,017,635.84	0.19

184	000046	泛海控股	199,100	2,012,901.00	0.19
185	000792	盐湖股份	94,264	1,988,970.40	0.18
186	000750	国海证券	268,930	1,987,392.70	0.18
187	002292	奥飞娱乐	66,309	1,985,954.55	0.18
188	000826	启迪桑德	64,822	1,980,312.10	0.18
189	000413	东旭光电	228,789	1,965,297.51	0.18
190	600150	中国船舶	87,344	1,944,277.44	0.18
191	600398	海澜之家	171,087	1,933,283.10	0.18
192	600583	海油工程	279,729	1,932,927.39	0.18
193	600816	安信信托	112,300	1,894,501.00	0.17
194	600157	永泰能源	473,270	1,864,683.80	0.17
195	000402	金融街	191,154	1,858,016.88	0.17
196	002007	华兰生物	59,127	1,856,587.80	0.17
197	600208	新湖中宝	437,164	1,849,203.72	0.17
198	300144	宋城演艺	73,900	1,840,849.00	0.17
199	300015	爱尔眼科	50,138	1,831,541.14	0.17
200	600588	用友网络	92,815	1,817,317.70	0.17
201	000977	浪潮信息	76,100	1,784,545.00	0.16
202	600895	张江高科	98,300	1,777,264.00	0.16
203	600060	海信电器	99,658	1,761,953.44	0.16
204	600074	保千里	116,900	1,744,148.00	0.16
205	601106	中国一重	332,000	1,729,720.00	0.16
206	300058	蓝色光标	177,641	1,724,894.11	0.16
207	600688	上海石化	278,221	1,697,148.10	0.16
208	002152	广电运通	102,500	1,685,100.00	0.16
209	601333	广深铁路	430,619	1,683,720.29	0.16
210	002422	科伦药业	109,216	1,683,018.56	0.16
211	600332	白云山	67,979	1,675,002.56	0.15
212	600820	隧道股份	199,600	1,674,644.00	0.15
213	000425	徐工机械	542,585	1,660,310.10	0.15
214	600642	申能股份	288,907	1,658,326.18	0.15
215	601098	中南传媒	91,226	1,652,102.86	0.15
216	600256	广汇能源	397,745	1,630,754.50	0.15
217	300002	神州泰岳	150,900	1,605,576.00	0.15
218	002470	金正大	199,284	1,604,236.20	0.15
219	601866	中海集运	402,863	1,595,337.48	0.15
220	601258	庞大集团	575,954	1,583,873.50	0.15
221	600376	首开股份	142,200	1,581,264.00	0.15
222	000415	渤海金控	230,400	1,571,328.00	0.14

223	600027	华电国际	310,342	1,536,192.90	0.14
224	000738	中航动控	58,000	1,531,200.00	0.14
225	600252	中恒集团	351,537	1,525,670.58	0.14
226	600737	中粮屯河	130,300	1,504,965.00	0.14
227	601718	际华集团	195,100	1,490,564.00	0.14
228	000709	河钢股份	537,083	1,487,719.91	0.14
229	600875	东方电气	151,461	1,487,347.02	0.14
230	601991	大唐发电	379,100	1,474,699.00	0.14
231	600873	梅花生物	235,820	1,464,442.20	0.13
232	601021	春秋航空	30,300	1,452,582.00	0.13
233	600373	中文传媒	69,700	1,446,275.00	0.13
234	600362	江西铜业	104,995	1,415,332.60	0.13
235	600005	武钢股份	511,400	1,411,464.00	0.13
236	002129	中环股份	168,818	1,399,501.22	0.13
237	600170	上海建工	362,199	1,387,222.17	0.13
238	601117	中国化学	249,568	1,380,111.04	0.13
239	300133	华策影视	88,333	1,375,344.81	0.13
240	600704	物产中大	145,830	1,364,968.80	0.13
241	000729	燕京啤酒	178,233	1,352,788.47	0.12
242	600037	歌华有线	87,900	1,336,959.00	0.12
243	601225	陕西煤业	257,610	1,331,843.70	0.12
244	000629	*ST 钒钛	555,047	1,326,562.33	0.12
245	000039	中集集团	93,490	1,324,753.30	0.12
246	601179	中国西电	259,200	1,314,144.00	0.12
247	000061	农产品	107,573	1,308,087.68	0.12
248	600372	中航电子	66,745	1,299,525.15	0.12
249	601633	长城汽车	152,393	1,286,196.92	0.12
250	300251	光线传媒	111,240	1,285,934.40	0.12
251	000778	新兴铸管	276,432	1,282,644.48	0.12
252	002027	分众传媒	77,600	1,281,176.00	0.12
253	601872	招商轮船	268,000	1,254,240.00	0.12
254	300146	汤臣倍健	92,060	1,246,492.40	0.11
255	600038	中直股份	29,900	1,240,252.00	0.11
256	601992	金隅股份	158,088	1,225,182.00	0.11
257	000999	华润三九	50,400	1,220,688.00	0.11
258	601216	君正集团	163,248	1,219,462.56	0.11
259	601898	中煤能源	236,049	1,218,012.84	0.11
260	000712	锦龙股份	57,800	1,199,928.00	0.11
261	002195	二三四五	96,600	1,187,214.00	0.11

262	600008	首创股份	304,860	1,185,905.40	0.11
263	600827	百联股份	97,548	1,178,379.84	0.11
264	000883	湖北能源	251,598	1,164,898.74	0.11
265	603000	人民网	69,940	1,161,703.40	0.11
266	000800	一汽轿车	104,692	1,139,048.96	0.10
267	600863	内蒙华电	374,144	1,129,914.88	0.10
268	002146	荣盛发展	168,034	1,129,188.48	0.10
269	600021	上海电力	108,200	1,111,214.00	0.10
270	002294	信立泰	40,400	1,098,880.00	0.10
271	600959	江苏有线	77,200	1,077,712.00	0.10
272	002153	石基信息	40,386	1,065,382.68	0.10
273	601928	凤凰传媒	98,269	1,035,755.26	0.10
274	300085	银之杰	34,500	1,031,550.00	0.10
275	600600	青岛啤酒	35,131	1,021,258.17	0.09
276	601958	金钼股份	124,727	1,016,525.05	0.09
277	600666	奥瑞德	29,100	1,011,516.00	0.09
278	000156	华数传媒	54,273	1,006,764.15	0.09
279	000027	深圳能源	153,300	978,054.00	0.09
280	600648	外高桥	48,166	949,351.86	0.09
281	600582	天地科技	209,000	940,500.00	0.09
282	601808	中海油服	76,464	929,037.60	0.09
283	000825	太钢不锈	293,500	927,460.00	0.09
284	002424	贵州百灵	53,500	920,200.00	0.08
285	000898	鞍钢股份	237,900	911,157.00	0.08
286	601608	中信重工	167,700	900,549.00	0.08
287	600871	石化油服	228,200	876,288.00	0.08
288	601118	海南橡胶	152,277	851,228.43	0.08
289	600317	营口港	250,400	841,344.00	0.08
290	600783	鲁信创投	38,433	830,537.13	0.08
291	002399	海普瑞	47,414	827,848.44	0.08
292	600098	广州发展	103,300	807,806.00	0.07
293	600685	中船防务	31,100	788,696.00	0.07
294	600578	京能电力	178,400	763,552.00	0.07
295	600998	九州通	42,546	744,980.46	0.07
296	600188	XD 兖州煤	49,488	541,398.72	0.05
297	600022	山东钢铁	212,600	503,862.00	0.05
298	600606	绿地控股	46,100	498,802.00	0.05
299	002568	百润股份	22,600	497,200.00	0.05
300	603885	吉祥航空	18,500	485,625.00	0.04

301	601016	节能风电	26,300	261,159.00	0.02
302	600166	福田汽车	16	88.32	0.00

### 7.3.2 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

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	601611	中国核建	26,723	559,045.16	0.05
2	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.02
3	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.02
4	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
5	601966	玲珑轮胎	8,985	116,625.30	0.01
6	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.01
7	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.01
8	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
9	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
10	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
11	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
12	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
13	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
14	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
15	002805	丰元股份	971	5,631.80	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	002739	万达院线	3,846,859.00	0.31
2	600958	东方证券	3,561,263.13	0.29
3	600900	长江电力	2,708,396.93	0.22
4	601328	交通银行	2,681,876.00	0.22
5	000839	中信国安	2,655,344.90	0.21
6	600061	国投安信	2,431,338.00	0.20
7	002736	国信证券	2,419,769.00	0.19
8	300168	万达信息	2,268,668.00	0.18

9	002183	怡亚通	2,239,488.17	0.18
10	600446	金证股份	2,232,782.00	0.18
11	600816	安信信托	1,872,459.94	0.15
12	600074	保千里	1,808,297.20	0.15
13	000977	浪潮信息	1,806,585.00	0.15
14	002152	广电运通	1,759,003.00	0.14
15	600376	首开股份	1,554,558.00	0.13
16	601198	东兴证券	1,550,959.00	0.12
17	601398	工商银行	1,420,179.00	0.11
18	600737	中粮屯河	1,411,719.00	0.11
19	600704	物产中大	1,406,317.00	0.11
20	600037	歌华有线	1,364,439.72	0.11

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	600016	民生银行	7,751,248.05	0.62
2	600000	浦发银行	6,275,352.00	0.50
3	600315	上海家化	1,935,012.81	0.16
4	600637	东方明珠	1,769,376.44	0.14
5	600549	厦门钨业	1,637,780.16	0.13
6	601238	广汽集团	1,636,730.00	0.13
7	002038	双鹭药业	1,581,812.02	0.13
8	002024	苏宁云商	1,543,314.00	0.12
9	000983	西山煤电	1,520,615.29	0.12
10	601318	中国平安	1,353,690.00	0.11
11	002353	杰瑞股份	1,341,222.88	0.11
12	000831	*ST 五稀	1,275,478.41	0.10
13	000581	威孚高科	1,267,623.90	0.10
14	000598	兴蓉环境	1,241,517.54	0.10
15	600633	浙报传媒	1,207,734.20	0.10
16	000400	许继电气	1,193,466.80	0.10
17	600166	福田汽车	1,191,872.00	0.10
18	002410	广联达	1,154,118.18	0.09

19	603288	海天味业	1,051,900.10	0.08
20	601699	潞安环能	992,172.58	0.08

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	94,550,346.72
卖出股票收入（成交）总额	82,216,519.84

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	80,668.40	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	80,668.40	0.01

### 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	113009	广汽转债	680	80,668.40	0.01

### 7.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.8 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
公允价值变动总额合计（元）					-55,260.00
股指期货投资本期收益（元）					-787,380.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-55,260.00

注:本基金本期末无股指期货持仓。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 7.11 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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	17,414.97
2	应收证券清算款	961,961.56
3	应收股利	-

4	应收利息	513.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	979,890.25

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 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	23,670,544.59	2.18	重大事项

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	601611	中国核建	559,045.16	0.05	股票异常波动停牌

## §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

#### 8.1.1 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
23,161	37,096.82	631,505,847.00	73.50%	227,693,604.00	26.50%

**8.1.2 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－南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	628,944,419.00	73.20%

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－南方开元沪深 300 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。

**8.2 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	杨京京	4,196,454.00	0.49%
2	刘剑	2,500,000.00	0.29%
3	毛燕蓉	1,700,000.00	0.20%
4	黄爱萍	1,673,446.00	0.19%
5	陈淑兰	1,335,254.00	0.16%
6	蔡景玲	1,277,829.00	0.15%
7	徐国忠	1,227,417.00	0.14%
8	王宏图	1,180,000.00	0.14%
9	曹瑞生	943,357.00	0.11%
10	虞朋荣	914,151.00	0.11%
	中国工商银行－南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	628,944,419.00	73.20%

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

本公司的所有从业人员均未持有本基金份额。

**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**

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。

**§9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2013 年 2 月 18 日）基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	839,199,451.00
本报告期基金总申购份额	120,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	100,000,000.00

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	859,199,451.00

## §10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 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，基金管理人没有发生重大人事变动。

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。

### 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、基金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	
申万宏源	2	117,141,663.45	67.55%	11,714.26	67.55%	-
华泰证券	2	56,277,717.28	32.45%	5,627.86	32.45%	-

东海证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

### 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	
	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
申万宏源	346,078.30	100.00%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

渤海证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

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。

## 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	关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年4月12日
2	南方基金管理有限公司电子交易赎回转认/申购业务规则	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年3月28日
3	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）（2016 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年3月25日
4	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2016 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年3月25日
5	关于南方开元沪深 300 交易型开	中国证券报、上海	2016年3月5日

	放式指数证券投资基金变更基金经理的公告	证券报、证券时报	
6	南方基金关于临时暂停电子直销实时赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 15 日
7	南方基金关于电子直销平台通过货币基金定投其他基金费率为 0 的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 15 日
8	南方基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 7 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 7 日
9	关于南方基金管理有限公司旗下部分基金净值揭示异常的提示	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日
10	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日
11	南方基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 4 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日
12	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准基金开元转型为南方 300 的批复。
- 2、《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。
- 3、《南方开元沪深 300 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披露的各项公告。

### 11.2 存放地点

深圳市福田区福华 1 路 6 号免税商务大厦 31 至 33 楼

### 11.3 查阅方式

公司网站：<http://www.nffund.com>

