

上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告

2016 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 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 2016 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	18
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息.....	19

6.2 审计报告的基本内容.....	19
§7 年度财务报表.....	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告.....	53
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	53
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.....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	72
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.....	72
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.....	72
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.....	72
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.....	72
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	73
8.12 投资组合报告附注.....	73
§9 基金份额持有人信息.....	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	75
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	75
9.3 期末上市基金前十名持有人.....	75
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	76
9.5 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.....	76
§10 开放式基金份额变动.....	77
§11 重大事件揭示.....	78
11.1 基金份额持有人大会决议.....	78
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.....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	78

11.4 基金投资策略的改变	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	78
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	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	79
11.8 其他重大事件	81
§12 备查文件目录.....	84
12.1 备查文件目录.....	84
12.2 存放地点.....	84
12.3 查阅方式.....	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方上证 380ETF
场内简称	380ETF
基金主代码	510290
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 16 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	168,448,915.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 11 月 8 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“380ETF”。

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，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</p>

	<p>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。</p>
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为上证 380 指数，简称 380 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	田青
	联系电话	0755-82763888	010-67595096
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-8899	010-67595096
传真		0755-82763889	010-66275853
注册地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区福田街道福华	北京市西城区闹市口大街一号

	一路六号免税商务大厦 31-33 层	院一号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	张海波	王洪章

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	北京市西城区太平桥大街 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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-9,864,698.88	-5,583,915.32	46,182,485.86
本期利润	-48,964,055.37	8,241,848.33	70,845,392.68
加权平均基金份额本期利润	-0.2746	0.0416	0.3831
本期加权平均净值利润率	-18.38%	2.33%	37.33%
本期基金份额净值增长率	-16.41%	38.26%	44.86%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	64,818,058.16	72,806,790.12	25,335,545.00
期末可供分配基金份额利润	0.3848	0.4374	0.1149
期末基金资产净值	259,253,426.09	306,487,944.53	293,582,872.70
期末基金份额净值	1.5391	1.8413	1.3318
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	53.91%	84.13%	33.18%

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	1.18%	0.84%	0.66%	0.84%	0.52%	0.00%
过去六个月	4.86%	0.91%	4.36%	0.92%	0.50%	-0.01%

过去一年	-16.41%	1.85%	-17.43%	1.86%	1.02%	-0.01%
过去三年	67.40%	2.21%	65.32%	2.16%	2.08%	0.05%
过去五年	89.40%	1.92%	86.06%	1.89%	3.34%	0.03%
自基金合同生效起至今	53.91%	1.89%	48.95%	1.88%	4.96%	0.01%

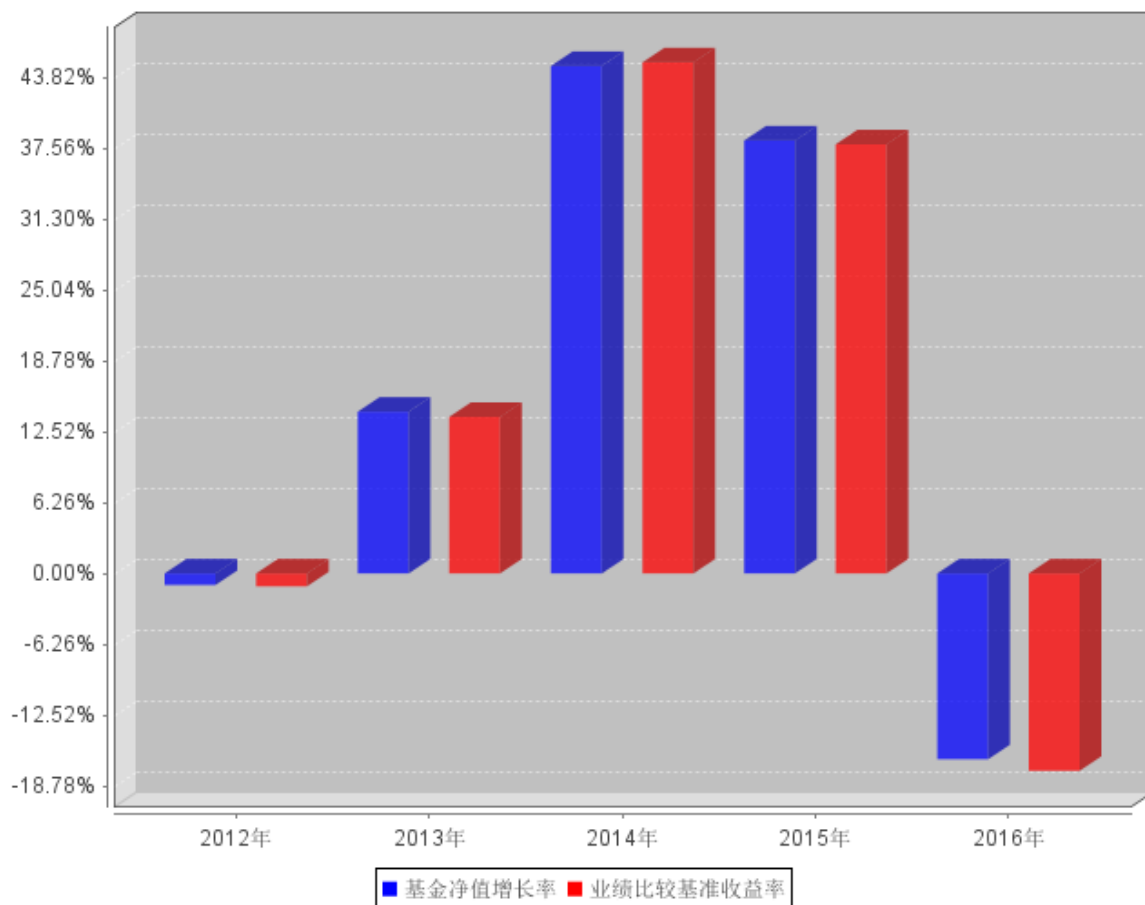
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



注：基金合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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——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）管理资产规模近 6,500 亿元，旗下管理 116 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 5 月 17 日	2016 年 11 月 25 日	19 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，现任资产配置部副总监、FOF 投资决策委员会委员兼秘书；2010 年 8 月至 2016 年 11 月，任小康 ETF 及南方小康基金经理；2013 年 4 月至 2016 年 11 月，任南方深成及南方深成 ETF 的基金经理；2013 年 5 月至 2016 年 11 月，任南方上证 380ETF 及联接基金的基金经理；2015 年 7 月至 2016 年 11 月，任南方互联基金的基金经理。
周豪	本基金基金经理	2016 年 8 月 19 日	-	8 年	北京大学软件工程专业硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金信息技术部，长

					期负责指数基金及 ETF 基金的投研及系统支持工作；2015 年 6 月，任量化投资部高级研究员；2016 年 4 月至今，任 500 工业 ETF、500 原材料 ETF 基金经理；2016 年 8 月至今，任 380ETF、南方 380、小康 ETF、南方小康、互联基金基金经理；2016 年 9 月至今，任 1000ETF 基金经理。
杨德龙	本基金基金经理	2011 年 9 月 16 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、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，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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《上证 380 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。

公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占优比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

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 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，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

2016 年度，随着市场在 1 月份的大幅调整，上证 380 指数 1 月份大跌 28.23%，其后逐步企稳，震荡回升，全年上证 380 指数下跌 17.43%。

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（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离。

(3) 根据指数半年度成份股调整进行的基金调仓，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，将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

截至报告期末，本基金份额净值为 1.5391 元，报告期内，份额净值增长率为-16.41%，同期业绩基准增长率为-17.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观上看，随着供给侧改革不断深化，经济转型、消费升级、基础建设助力，2017 年国内经济有望平稳运行，在全球无风险利率上升的影响下，资产配置需求强劲，这些都有利于证券市场向好。另一方面，发达国家民粹主义和保守主义普遍抬头，外部不确定因素增加，还将有更多“黑天鹅”事件，阶段冲击明显，考虑到市场已有充分预期，预计影响偏短期。整体来看，2017 年市场大概率维持震荡格局，可积极参与局部行情。

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，本基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展情况，围绕重合规守底线、抓规范促发展，坚持从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，积极推动主动合规风控管理，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，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展情况，不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，并开展了互联网金融相关业务风险自查、信息技术专项自查等多项内控自查工作，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营及人员管理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，推动公司合规、内控体系的健全完善；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，持续完善投资合规风控制度流程和系统，积极配合各类新产品、新业务，重点加强内幕交易防控以及对高风险品种和业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，有效确保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，督促落实销售适当性管理制度；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；深入贯彻风险为本的反洗钱工作原则，优化反洗钱资源

配置，加大反洗钱投入力度，购置外部专业机构制裁名单数据库，积极推进符合基金业务特征的可疑交易监控模型和方法，健全创新业务洗钱风险评估机制，各项反洗钱工作进一步完善；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、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。在收益评价日，基金管理人计算基金份额净值增长率和标的指数同期增长率。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，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；本基金每年收益分配次数最多为 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；若《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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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(2017)第 21489 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	上证 380 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	我们审计了后附的上证 380 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“上证 380ETF 基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 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	编制和公允列报财务报表是 上证 380ETF 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: (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”)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; (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。
注册会计师的责任段	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。 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

	<p>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	<p>我们认为，上述上证 380ETF 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，公允反映了上证 380ETF 基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
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	2017 年 3 月 24 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：上证 380 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,118,075.39	4,881,156.41
结算备付金		-	94,431.25
存出保证金		1,515.33	68,397.54
交易性金融资产	7.4.7.2	258,604,736.46	301,942,431.60
其中：股票投资		258,604,736.46	301,942,431.60
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		15,940.01	58,245.22
应收利息	7.4.7.5	246.34	1,156.36
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		259,740,513.53	307,045,818.38
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 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		-	123,843.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		111,569.45	133,831.12
应付托管费		22,313.88	26,766.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	63,248.25	11,727.77
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	289,955.86	261,705.71
负债合计		487,087.44	557,873.85
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	168,448,915.00	166,448,915.00
未分配利润	7.4.7.10	90,804,511.09	140,039,029.53
所有者权益合计		259,253,426.09	306,487,944.53
负债和所有者权益总计		259,740,513.53	307,045,818.38

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5391 元，基金份额总额 168,448,915.00 份。

7.2 利润表

会计主体：上证 380 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
一、收入		-46,524,445.19	11,320,028.12
1.利息收入		28,988.19	85,372.15
其中：存款利息收入	7.4.7.11	28,880.00	85,272.31
债券利息收入		108.19	99.84
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）		-7,391,606.63	-7,842,938.58
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-9,656,216.70	-10,615,137.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	66,057.71	240,190.03
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	7.4.7.15	2,198,552.36	2,532,008.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-39,099,356.49	13,825,763.65
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	-62,470.26	5,251,830.90
减：二、费用		2,439,610.18	3,078,179.79
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,331,975.38	1,762,134.99
2. 托管费	7.4.10.2.2	266,395.10	352,427.04
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	7.4.7.18	159,654.08	331,038.10
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	681,585.62	632,579.66
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-48,964,055.37	8,241,848.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-48,964,055.37	8,241,848.33

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：上证 380 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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)	166,448,915.00	140,039,029.53	306,487,944.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-48,964,055.37	-48,964,055.37
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)	2,000,000.00	-270,463.07	1,729,536.93
其中：1.基金申购款	68,000,000.00	30,424,524.20	98,424,524.20
2.基金赎回款	-66,000,000.00	-30,694,987.27	-96,694,987.27
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)	168,448,915.00	90,804,511.09	259,253,426.09

项目	上年度可比期间		
	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）	220,448,915.00	73,133,957.70	293,582,872.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,241,848.33	8,241,848.33
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）	-54,000,000.00	58,663,223.50	4,663,223.50
其中：1. 基金申购款	6,950,000,000.00	7,341,878,231.74	14,291,878,231.74
2. 基金赎回款	-7,004,000,000.00	-7,283,215,008.24	-14,287,215,008.24
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）	166,448,915.00	140,039,029.53	306,487,944.53

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

基金管理人负责人

徐超

主管会计工作负责人

徐超

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

上证 380 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[2011]1096 号《关于核准上证 380 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《上证 380 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 330,429,892.00 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(2011)第 381 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 330,448,915.00 份基金份额,其中通过直销机构网下现金认购部分的认购资金利息折合 19,023.00 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 380 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上证 380 指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化;在正常市场情况下,力争控制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%。本基金主要投资于标的指数的成份股和备选成份股;本基金也可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、新股、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产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。本基金的业绩比较基准为上证 380 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 2011 年 9 月 20 日募集成立了上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“上证 380ETF 联接基金”)。上证 380ETF 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 2017 年 3 月 24 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》、《上证 380 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相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 2016 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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，基金管理人可进行收益分配。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	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
活期存款	1,118,075.39	4,881,156.41
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	1,118,075.39	4,881,156.41

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	259,204,086.87	258,604,736.46	-599,350.41
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	259,204,086.87	258,604,736.46	-599,350.41
项目	上年度末		
	2015 年 12 月 31 日		

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		263,442,425.52	301,942,431.60	38,500,006.08
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		263,442,425.52	301,942,431.60	38,500,006.08

注：于 2016 年 12 月 31 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为 968.00 元(2015 年 12 月 31 日：无)。

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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	245.57	1,075.73
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	-	46.75
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	0.77	33.88
合计	246.34	1,156.36

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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	63,248.25	11,727.77
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	63,248.25	11,727.77

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
预提费用	255,000.00	155,000.00
指数使用费	20,213.86	105,728.11
应退替代款	-	-
可退替代款	14,742.00	977.60
合计	289,955.86	261,705.71

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	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	166,448,915.00	166,448,915.00
本期申购	68,000,000.00	68,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-66,000,000.00	-66,000,000.00
本期末	168,448,915.00	168,448,915.00

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	72,806,790.12	67,232,239.41	140,039,029.53
本期利润	-9,864,698.88	-39,099,356.49	-48,964,055.37
本期基金份额交易产生的变动数	1,875,966.92	-2,146,429.99	-270,463.07
其中：基金申购款	28,292,635.40	2,131,888.80	30,424,524.20
基金赎回款	-26,416,668.48	-4,278,318.79	-30,694,987.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	64,818,058.16	25,986,452.93	90,804,511.09

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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	27,669.55	59,874.46
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	1,210.45	24,650.92
其他	-	746.93
合计	28,880.00	85,272.31

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 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,434,709.74	6,887,978.96
股票投资收益——赎回差价收入	-6,221,506.96	-17,503,115.98
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-9,656,216.70	-10,615,137.02

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 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
卖出股票成交总额	74,393,860.19	174,216,120.76
减：卖出股票成本总额	77,828,569.93	167,328,141.80
买卖股票差价收入	-3,434,709.74	6,887,978.96

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	96,694,987.27	14,287,215,008.24
减：现金支付赎回款总额	-321,497.73	1,378,356,658.24
减：赎回股票成本总额	103,237,991.96	12,926,361,465.98
赎回差价收入	-6,221,506.96	-17,503,115.98

7.4.7.13 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 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	518,165.90	938,296.50
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	452,000.00	698,000.00
减：应收利息总额	108.19	106.47
买卖债券差价收入	66,057.71	240,190.03

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,198,552.36	2,532,008.41
基金投资产生的股利收益	-	-

合计	2,198,552.36	2,532,008.41
----	--------------	--------------

7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
1. 交易性金融资产	-39,099,356.49	13,825,763.65
——股票投资	-39,099,356.49	13,825,763.65
——债券投资	-	-
——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	-39,099,356.49	13,825,763.65

注：本基金本年度公允价值变动收益-股票投资中包含的可退替代款产生的公允价值变动收益为968.00元(2015年度：无)。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
替代损益	-62,470.26	5,251,830.90
合计	-62,470.26	5,251,830.90

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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	159,654.08	331,038.10
银行间市场交易费用	-	-
合计	159,654.08	331,038.10

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	55,000.00	55,000.00
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	1,739.87	6,477.10
帐户维护费	360.00	-
指数使用费	264,485.75	211,102.56
其他	-	-
合计	681,585.62	632,579.66

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每季度（自然季度）人民币 50,000 元（基金设立首季不受收取下限的限制）。

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

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号), 要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人, 自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号), 2017 年 7 月 1 日(含)以后, 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人, 按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法, 由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

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
中国建设银行股份有限公司 (“中国建设银行”)	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
南方上证 380 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金(“上证 380ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015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	67,335,886.43	43.41%	22,520,125.99	4.12%

7.4.10.1.2 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	62,707.13	87.72%	62,707.13	99.14%
关联方名称	上年度可比期间			
	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	20,503.00	20.21%	-	-

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
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日

	月 31 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	1,331,975.38	1,762,134.99
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 0.5% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.5% / 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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	266,395.10	352,427.04

注：支付基金托管人中国建设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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 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：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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固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间未运用固有资金投资本基金。

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	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	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
上证 380ETF 联接基金	138,399,941.00	82.16%	128,399,941.00	77.14%

注：上证 380ETF 联接基金和华泰证券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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 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
中国建设银行	1,118,075.39	27,669.55	4,881,156.41	59,874.46

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

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：本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2016 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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

601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	-	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	-	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
603689	皖天然气	2016 年 12 月 30 日	-	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603228	景旺电子	2016 年 12 月 28 日	-	新股流通受限	23.16	23.16	1,050	24,318.00	24,318.00	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	-	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016 年 12 月 30 日	-	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
603186	华正新材	2016 年 12 月 26 日	-	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016 年 12 月 27 日	-	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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
601168	西部矿业	2016 年 12 月 19 日	重大资产重组	7.83			197,674	1,358,791.12	1,547,787.42	-

600673	东阳光科	2016年11月15日	重大资产重组	7.29				183,092	1,332,523.40	1,334,740.68	-
600655	豫园商城	2016年12月20日	重大事项未公告	11.42				103,000	1,154,875.90	1,176,260.00	-
600161	天坛生物	2016年12月6日	重大资产重组	39.40	2017-3-24	43.34		27,200	775,437.80	1,071,680.00	-
600687	刚泰控股	2016年7月25日	重大资产重组	16.42	2017-1-18	16.38		60,240	937,737.28	989,140.80	-
600711	盛屯矿业	2016年12月19日	重大事项未公告	7.02	2017-1-11	7.38		123,300	884,684.38	865,566.00	-
600171	上海贝岭	2016年12月14日	重大事项未公告	14.05	2017-2-16	14.9		55,420	809,322.01	778,651.00	-
600626	申达股份	2016年12月15日	重大资产重组	13.69	2017-1-12	13.7		51,200	646,204.49	700,928.00	-
603111	康尼机电	2016年12月26日	重大事项未公告	14.70				45,300	647,370.56	665,910.00	-
600763	通策医疗	2016年12月19日	重大事项未公告	33.54	2017-1-3	34.8		19,800	580,766.24	664,092.00	-
600537	亿晶光电	2016年12月27日	重大事项未公告	7.43	2017-1-13	8.17		85,802	523,560.32	637,508.86	-
600859	王府井	2016年9月27日	重大资产重组	16.28				37,048	621,246.02	603,141.44	-
600400	红豆股份	2016年12月29日	重大事项未公告	8.56				68,600	712,237.65	587,216.00	-
600577	精达股份	2016年5月3日	重大资产重组	4.18	2017-3-2	4.6		124,900	589,597.72	522,082.00	-

600173	卧龙地产	2016年12月22日	重大事项未公告	11.48			45,300	285,936.62	520,044.00	-
600552	凯盛科技	2016年9月8日	重大资产重组	18.43	2017-2-13	17.51	27,750	455,005.42	511,432.50	-
601700	风范股份	2016年11月25日	重大资产重组	8.47			60,150	451,431.17	509,470.50	-
600239	云南城投	2016年12月30日	重大事项未公告	5.66	2017-1-3	5.7	78,080	464,184.34	441,932.80	-
600480	凌云股份	2016年7月22日	重大资产重组	15.01	2017-1-13	16.51	28,900	411,956.94	433,789.00	-
600551	时代出版	2016年11月28日	重大资产重组	20.32			21,300	376,190.38	432,816.00	-
603169	兰石重装	2016年11月24日	重大资产重组	13.36	2017-3-21	14.32	32,100	465,190.36	428,856.00	-
603308	应流股份	2016年11月24日	重大资产重组	21.92	2017-2-14	21.92	18,400	393,836.04	403,328.00	-
600636	三爱富	2016年5月9日	重大资产重组	13.86			28,530	379,379.70	395,425.80	-
600973	宝胜股份	2016年11月28日	重大资产重组	8.05	2017-2-22	8.86	48,400	344,061.85	389,620.00	-
600814	杭州解百	2016年12月26日	重大事项未公告	11.37	2017-1-9	10.7	29,200	275,853.89	332,004.00	-
603555	贵人鸟	2016年12月12日	重大资产重组	30.76			2,600	68,692.96	79,976.00	-

注：本基金截至 2016 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，紧密跟踪上证 380 指数，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，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，跟踪上证 380 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建设银行，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 2016 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2015 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 2016 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付息，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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金等，其余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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	1,118,075.39	-	-	-	1,118,075.39
存出保证金	1,515.33	-	-	-	1,515.33
交易性金融资产	-	-	-	-258,604,736.46	258,604,736.46
应收利息	-	-	-	246.34	246.34
应收证券清算款	-	-	-	15,940.01	15,940.01
资产总计	1,119,590.72	-	-	-258,620,922.81	259,740,513.53
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	111,569.45	111,569.45
应付托管费	-	-	-	22,313.88	22,313.88
应付交易费用	-	-	-	63,248.25	63,248.25
其他负债	-	-	-	289,955.86	289,955.86
负债总计	-	-	-	487,087.44	487,087.44
利率敏感度缺口	1,119,590.72	-	-	-258,133,835.37	259,253,426.09
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	4,881,156.41	-	-	-	4,881,156.41
结算备付金	94,431.25	-	-	-	94,431.25
存出保证金	68,397.54	-	-	-	68,397.54
交易性金融资产	-	-	-	-301,942,431.60	301,942,431.60
应收证券清算款	-	-	-	58,245.22	58,245.22
应收利息	-	-	-	1,156.36	1,156.36
资产总计	5,043,985.20	-	-	-302,001,833.18	307,045,818.38
负债					

应付证券清算款	-	-	-	123,843.00	123,843.00
应付管理人报酬	-	-	-	133,831.12	133,831.12
应付托管费	-	-	-	26,766.25	26,766.25
应付交易费用	-	-	-	11,727.77	11,727.77
其他负债	-	-	-	261,705.71	261,705.71
负债总计	-	-	-	557,873.85	557,873.85
利率敏感度缺口	5,043,985.20	-	-	-301,443,959.33	306,487,944.53

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 年 12 月 31 日：同），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：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，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，跟踪上证 380 指数指数，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，上证 380 指数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。

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 2016 年 12 月 31 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	258,604,736.46	99.75	301,942,431.60	98.52
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	258,604,736.46	99.75	301,942,431.60	98.52

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(2016年12月 31日)	上年度末(2015年12月 31日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	12,750,000.00	15,780,000.00
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-12,750,000.00	-15,780,000.00

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

于本年度，本基金申购基金份额的对价总额为 98,424,524.20 元(2015 年度：14,291,878,231.74 元)，其中包括以股票支付的申购款 94,741,564.00 元和以现金支付的申购款 3,682,960.20 元(2015 年度：其中包括以股票支付的申购款 12,720,461,721.90 元和以现金支付的申购款 1,571,416,509.84 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 2016 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 241,278,034.84 元，属于第二层次的余额为 17,326,701.62 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 277,507,466.33 元，第二层次 24,434,965.27 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 2016 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(2015 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	258,604,736.46	99.56
	其中：股票	258,604,736.46	99.56
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	1,118,075.39	0.43
7	其他各项资产	17,701.68	0.01
8	合计	259,740,513.53	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	1,114,633.40	0.43
B	采矿业	14,008,091.44	5.40
C	制造业	150,751,192.32	58.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,555,592.88	6.00
E	建筑业	7,942,925.42	3.06

F	批发和零售业	19,470,985.92	7.51
G	交通运输、仓储和邮政业	16,941,247.30	6.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,305,366.45	3.20
J	金融业	0.00	-
K	房地产业	6,982,508.17	2.69
L	租赁和商务服务业	5,211,659.61	2.01
M	科学研究和技术服务业	657,952.00	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	1,904,510.90	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	383,776.57	0.15
Q	卫生和社会工作	664,092.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	5,499,930.50	2.12
S	综合	2,174,902.60	0.84
	合计	257,569,367.48	99.35

8.2.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	650,145.77	0.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.01
E	建筑业	15,592.23	0.01
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	214,506.64	0.08
J	金融业	106,780.00	0.04
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	-	-
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	1,034,400.98	0.40

8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

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	600660	福耀玻璃	147,000	2,738,610.00	1.06
2	600309	万华化学	112,100	2,413,513.00	0.93
3	600867	通化东宝	102,800	2,254,404.00	0.87
4	601888	中国国旅	50,600	2,196,040.00	0.85
5	600718	东软集团	103,100	2,026,946.00	0.78

6	600398	海澜之家	186,342	2,010,630.18	0.78
7	600201	生物股份	63,562	2,007,923.58	0.77
8	600525	长园集团	138,105	1,926,564.75	0.74
9	600682	南京新百	51,476	1,918,510.52	0.74
10	600584	长电科技	107,384	1,895,327.60	0.73
11	600170	上海建工	369,800	1,749,154.00	0.67
12	600487	亨通光电	90,137	1,681,956.42	0.65
13	600583	海油工程	226,200	1,669,356.00	0.64
14	600642	申能股份	283,244	1,662,642.28	0.64
15	601012	隆基股份	123,455	1,653,062.45	0.64
16	600027	华电国际	330,900	1,637,955.00	0.63
17	601168	西部矿业	197,674	1,547,787.42	0.60
18	600256	广汇能源	324,900	1,517,283.00	0.59
19	600166	福田汽车	484,200	1,496,178.00	0.58
20	600436	片仔癀	31,395	1,437,577.05	0.55
21	600521	华海药业	65,088	1,433,888.64	0.55
22	600498	烽火通信	54,300	1,368,903.00	0.53
23	600664	哈药股份	158,269	1,357,948.02	0.52
24	600879	航天电子	89,000	1,356,360.00	0.52
25	600673	东阳光科	183,092	1,334,740.68	0.51
26	600143	金发科技	170,917	1,329,734.26	0.51
27	600666	奥瑞德	47,700	1,285,515.00	0.50
28	600614	鼎立股份	109,700	1,283,490.00	0.50
29	600500	中化国际	108,000	1,259,280.00	0.49
30	600138	中青旅	60,013	1,258,472.61	0.49
31	600497	驰宏锌锗	178,800	1,256,964.00	0.48
32	601098	中南传媒	74,500	1,241,170.00	0.48
33	600635	大众公用	201,112	1,208,683.12	0.47

34	600426	华鲁恒升	90,448	1,198,436.00	0.46
35	600038	中直股份	24,533	1,187,887.86	0.46
36	600655	豫园商城	103,000	1,176,260.00	0.45
37	600122	宏图高科	95,400	1,165,788.00	0.45
38	601992	金隅股份	259,400	1,156,924.00	0.45
39	600373	中文传媒	57,100	1,153,420.00	0.44
40	600856	中天能源	82,300	1,135,740.00	0.44
41	600418	江淮汽车	98,100	1,134,036.00	0.44
42	600312	平高电气	70,296	1,098,023.52	0.42
43	600388	龙净环保	88,707	1,097,305.59	0.42
44	600594	益佰制药	65,626	1,092,672.90	0.42
45	600161	天坛生物	27,200	1,071,680.00	0.41
46	600811	东方集团	148,050	1,058,557.50	0.41
47	600056	中国医药	55,360	1,053,500.80	0.41
48	600787	中储股份	114,000	1,033,980.00	0.40
49	600881	亚泰集团	188,624	1,031,773.28	0.40
50	600172	黄河旋风	57,540	1,028,815.20	0.40
51	600008	首创股份	249,800	1,026,678.00	0.40
52	600685	中船防务	34,100	1,012,770.00	0.39
53	603000	人民网	57,300	1,011,918.00	0.39
54	600200	江苏吴中	52,400	1,011,844.00	0.39
55	600410	华胜天成	91,544	995,083.28	0.38
56	600176	中国巨石	100,848	992,344.32	0.38
57	600755	厦门国贸	120,688	989,641.60	0.38
58	600687	刚泰控股	60,240	989,140.80	0.38
59	601058	赛轮金宇	237,740	967,601.80	0.37
60	601000	唐山港	238,925	958,089.25	0.37
61	600098	广州发展	85,174	955,652.28	0.37

62	600633	浙报传媒	54,000	953,640.00	0.37
63	600572	康恩贝	130,072	950,826.32	0.37
64	600226	升华拜克	90,730	948,128.50	0.37
65	600026	中远海能	137,900	939,099.00	0.36
66	600502	安徽水利	93,790	936,024.20	0.36
67	600863	内蒙华电	302,578	931,940.24	0.36
68	603019	中科曙光	33,300	926,406.00	0.36
69	600967	北方创业	68,192	925,365.44	0.36
70	600568	中珠医疗	36,900	922,500.00	0.36
71	601021	春秋航空	25,000	918,500.00	0.35
72	603766	隆鑫通用	43,977	913,842.06	0.35
73	600409	三友化工	96,361	904,829.79	0.35
74	601880	大连港	320,575	897,610.00	0.35
75	600039	四川路桥	188,786	894,845.64	0.35
76	600511	国药股份	29,725	894,722.50	0.35
77	600885	宏发股份	27,700	885,015.00	0.34
78	600499	科达洁能	117,000	884,520.00	0.34
79	600717	天津港	87,300	879,984.00	0.34
80	600416	湘电股份	59,100	869,361.00	0.34
81	600711	盛屯矿业	123,300	865,566.00	0.33
82	600567	山鹰纸业	237,147	858,472.14	0.33
83	600582	天地科技	172,460	857,126.20	0.33
84	600611	大众交通	130,326	856,241.82	0.33
85	600600	青岛啤酒	28,957	852,494.08	0.33
86	600587	新华医疗	33,706	846,357.66	0.33
87	600348	阳泉煤业	125,300	843,269.00	0.33
88	600391	成发科技	23,900	842,475.00	0.33
89	600062	华润双鹤	37,766	839,538.18	0.32

90	600343	航天动力	39,900	838,698.00	0.32
91	600597	光明乳业	64,100	837,146.00	0.32
92	600884	杉杉股份	58,500	823,680.00	0.32
93	600183	生益科技	74,860	823,460.00	0.32
94	601877	正泰电器	41,169	823,380.00	0.32
95	603288	海天味业	28,000	821,240.00	0.32
96	600872	中炬高新	58,105	818,118.40	0.32
97	600380	健康元	82,195	816,196.35	0.31
98	601238	广汽集团	35,160	814,657.20	0.31
99	600300	维维股份	121,400	810,952.00	0.31
100	600366	宁波韵升	40,600	799,414.00	0.31
101	600267	海正药业	60,360	793,734.00	0.31
102	600566	济川药业	25,300	790,878.00	0.31
103	601808	中海油服	61,400	787,762.00	0.30
104	600073	上海梅林	68,440	783,638.00	0.30
105	600017	日照港	192,300	778,815.00	0.30
106	600171	上海贝岭	55,420	778,651.00	0.30
107	600970	中材国际	109,680	777,631.20	0.30
108	600422	昆药集团	57,552	777,527.52	0.30
109	601958	金钼股份	100,900	771,885.00	0.30
110	600648	外高桥	39,000	769,860.00	0.30
111	600125	铁龙物流	95,248	769,603.84	0.30
112	600086	东方金钰	70,300	764,864.00	0.30
113	600284	浦东建设	57,772	762,012.68	0.29
114	600651	飞乐音响	72,286	761,171.58	0.29
115	600557	康缘药业	44,927	760,614.11	0.29
116	600298	安琪酵母	42,673	760,432.86	0.29
117	600216	浙江医药	59,935	759,975.80	0.29

118	600491	龙元建设	65,800	759,332.00	0.29
119	600562	国睿科技	24,785	753,959.70	0.29
120	600260	凯乐科技	48,600	752,328.00	0.29
121	600634	中技控股	42,000	745,080.00	0.29
122	600536	中国软件	30,894	743,309.64	0.29
123	600175	美都能源	148,216	733,669.20	0.28
124	600694	大商股份	18,373	733,633.89	0.28
125	600486	扬农化工	19,367	733,428.29	0.28
126	600662	强生控股	65,900	730,831.00	0.28
127	601231	环旭电子	68,026	728,558.46	0.28
128	601801	皖新传媒	41,200	723,884.00	0.28
129	601311	骆驼股份	44,200	721,786.00	0.28
130	600990	四创电子	9,876	717,985.20	0.28
131	600169	太原重工	176,800	712,504.00	0.27
132	601010	文峰股份	134,788	708,984.88	0.27
133	600626	申达股份	51,200	700,928.00	0.27
134	600255	鑫科材料	144,100	697,444.00	0.27
135	600765	中航重机	48,600	696,438.00	0.27
136	600988	赤峰黄金	44,600	687,732.00	0.27
137	600323	瀚蓝环境	47,877	687,513.72	0.27
138	600517	置信电气	70,656	687,482.88	0.27
139	600116	三峡水利	72,450	684,652.50	0.26
140	600210	紫江企业	126,400	683,824.00	0.26
141	600667	太极实业	88,095	679,212.45	0.26
142	600004	白云机场	47,921	675,206.89	0.26
143	600736	苏州高新	74,627	673,881.81	0.26
144	600809	山西汾酒	26,900	673,038.00	0.26
145	603111	康尼机电	45,300	665,910.00	0.26

146	600337	美克家居	47,020	665,803.20	0.26
147	600763	通策医疗	19,800	664,092.00	0.26
148	600835	上海机电	33,590	655,676.80	0.25
149	600261	阳光照明	90,812	655,662.64	0.25
150	600399	抚顺特钢	94,800	651,276.00	0.25
151	600273	嘉化能源	67,700	650,597.00	0.25
152	603588	高能环境	20,600	644,780.00	0.25
153	603188	亚邦股份	36,000	642,960.00	0.25
154	603077	和邦生物	125,470	642,406.40	0.25
155	600559	老白干酒	27,432	640,537.20	0.25
156	600282	南钢股份	206,400	639,840.00	0.25
157	600495	晋西车轴	88,088	639,518.88	0.25
158	600433	冠豪高新	79,500	637,590.00	0.25
159	600537	亿晶光电	85,802	637,508.86	0.25
160	600481	双良节能	84,446	635,033.92	0.24
161	601678	滨化股份	86,610	631,386.90	0.24
162	600285	羚锐制药	49,377	630,050.52	0.24
163	600993	马应龙	31,408	627,217.76	0.24
164	601777	力帆股份	65,418	625,396.08	0.24
165	600270	外运发展	37,698	623,524.92	0.24
166	603885	吉祥航空	26,600	619,780.00	0.24
167	600277	亿利洁能	86,688	616,351.68	0.24
168	600571	信雅达	31,964	613,069.52	0.24
169	600894	广日股份	44,800	612,416.00	0.24
170	600269	赣粤高速	121,700	612,151.00	0.24
171	600580	卧龙电气	67,182	611,356.20	0.24
172	600363	联创光电	37,000	610,500.00	0.24
173	600206	有研新材	61,200	608,328.00	0.23

174	600105	永鼎股份	58,800	607,404.00	0.23
175	600578	京能电力	144,300	606,060.00	0.23
176	600859	王府井	37,048	603,141.44	0.23
177	600730	中国高科	48,600	602,154.00	0.23
178	600439	瑞贝卡	68,850	601,749.00	0.23
179	600668	尖峰集团	35,880	600,631.20	0.23
180	600012	皖通高速	36,412	600,433.88	0.23
181	601666	平煤股份	123,011	599,063.57	0.23
182	600826	兰生股份	21,903	598,389.96	0.23
183	601689	拓普集团	20,300	597,226.00	0.23
184	600289	亿阳信通	45,975	595,376.25	0.23
185	600420	现代制药	17,950	594,504.00	0.23
186	600729	重庆百货	25,370	594,419.10	0.23
187	600458	时代新材	41,840	592,036.00	0.23
188	600527	江南高纤	83,598	591,873.84	0.23
189	600823	世茂股份	83,800	588,276.00	0.23
190	600400	红豆股份	68,600	587,216.00	0.23
191	601222	林洋能源	72,272	583,235.04	0.23
192	600803	新奥股份	40,900	583,234.00	0.23
193	600112	天成控股	53,096	582,994.08	0.22
194	603118	共进股份	14,800	582,380.00	0.22
195	600596	新安股份	56,649	580,085.76	0.22
196	600750	江中药业	18,707	576,549.74	0.22
197	600123	兰花科创	71,400	574,056.00	0.22
198	600761	安徽合力	44,965	571,954.80	0.22
199	600006	东风汽车	83,000	571,040.00	0.22
200	600318	新力金融	17,700	569,940.00	0.22
201	600742	一汽富维	35,300	569,389.00	0.22

202	600351	亚宝药业	57,433	567,438.04	0.22
203	600824	益民集团	76,879	556,603.96	0.21
204	600063	皖维高新	120,000	555,600.00	0.21
205	600141	兴发集团	36,500	555,165.00	0.21
206	600395	盘江股份	68,700	554,409.00	0.21
207	601233	桐昆股份	38,539	553,420.04	0.21
208	600477	杭萧钢构	54,800	550,740.00	0.21
209	600986	科达股份	36,000	548,640.00	0.21
210	600428	中远海特	89,423	547,268.76	0.21
211	600756	浪潮软件	23,600	544,688.00	0.21
212	600496	精工钢构	125,917	538,924.76	0.21
213	600869	智慧能源	69,374	536,954.76	0.21
214	603198	迎驾贡酒	24,900	536,595.00	0.21
215	601001	大同煤业	87,171	532,614.81	0.21
216	600862	中航高科	43,500	532,440.00	0.21
217	600720	祁连山	64,741	528,933.97	0.20
218	600850	华东电脑	21,830	527,849.40	0.20
219	601890	亚星锚链	60,000	527,400.00	0.20
220	601636	旗滨集团	135,203	524,587.64	0.20
221	603899	晨光文具	28,742	523,104.40	0.20
222	600757	长江传媒	62,900	522,699.00	0.20
223	600577	精达股份	124,900	522,082.00	0.20
224	600173	卧龙地产	45,300	520,044.00	0.20
225	600641	万业企业	42,000	519,120.00	0.20
226	603883	老百姓	11,100	517,815.00	0.20
227	600329	中新药业	29,495	514,392.80	0.20
228	600563	法拉电子	14,027	514,370.09	0.20
229	600280	中央商场	59,556	512,777.16	0.20

230	601886	江河集团	48,114	512,414.10	0.20
231	603369	今世缘	39,050	512,336.00	0.20
232	600552	凯盛科技	27,750	511,432.50	0.20
233	601700	风范股份	60,150	509,470.50	0.20
234	600405	动力源	45,500	508,235.00	0.20
235	601567	三星医疗	44,125	506,555.00	0.20
236	600093	禾嘉股份	34,900	506,050.00	0.20
237	600292	远达环保	40,680	503,211.60	0.19
238	600185	格力地产	85,900	499,079.00	0.19
239	600033	福建高速	143,000	494,780.00	0.19
240	600831	广电网络	37,850	494,321.00	0.19
241	600612	老凤祥	13,233	492,664.59	0.19
242	600586	金晶科技	106,400	492,632.00	0.19
243	601126	四方股份	50,610	492,435.30	0.19
244	600775	南京熊猫	35,000	486,500.00	0.19
245	600657	信达地产	79,300	483,730.00	0.19
246	600460	士兰微	77,545	482,329.90	0.19
247	600676	交运股份	53,618	480,953.46	0.19
248	600846	同济科技	52,124	480,062.04	0.19
249	600501	航天晨光	26,250	478,800.00	0.18
250	603368	柳州医药	5,900	475,599.00	0.18
251	600195	中牧股份	22,316	474,215.00	0.18
252	600531	豫光金铅	55,100	472,758.00	0.18
253	600748	上实发展	57,700	472,563.00	0.18
254	600825	新华传媒	54,350	472,301.50	0.18
255	601002	晋亿实业	49,600	472,192.00	0.18
256	600650	锦江投资	20,300	469,336.00	0.18
257	600236	桂冠电力	75,800	462,380.00	0.18

258	600114	东睦股份	26,481	455,738.01	0.18
259	600350	山东高速	70,150	454,572.00	0.18
260	600387	海越股份	32,200	448,868.00	0.17
261	600686	金龙汽车	31,500	447,615.00	0.17
262	600438	通威股份	70,200	447,174.00	0.17
263	600965	福成股份	34,130	446,420.40	0.17
264	601158	重庆水务	60,000	445,800.00	0.17
265	600640	号百控股	22,300	445,554.00	0.17
266	601069	西部黄金	19,900	444,964.00	0.17
267	601908	京运通	62,400	444,288.00	0.17
268	600119	长江投资	22,300	443,993.00	0.17
269	600239	云南城投	78,080	441,932.80	0.17
270	600377	宁沪高速	51,650	441,607.50	0.17
271	600305	恒顺醋业	37,500	438,000.00	0.17
272	603008	喜临门	23,900	437,370.00	0.17
273	600459	贵研铂业	19,073	436,771.70	0.17
274	600743	华远地产	97,974	435,984.30	0.17
275	600188	兖州煤业	40,054	434,986.44	0.17
276	600480	凌云股份	28,900	433,789.00	0.17
277	600551	时代出版	21,300	432,816.00	0.17
278	600180	瑞茂通	31,800	430,572.00	0.17
279	600113	浙江东日	19,800	429,858.00	0.17
280	600624	复旦复华	49,929	429,389.40	0.17
281	603169	兰石重装	32,100	428,856.00	0.17
282	600054	黄山旅游	26,666	427,989.30	0.17
283	600776	东方通信	49,812	426,390.72	0.16
284	600020	中原高速	93,653	420,501.97	0.16
285	600526	菲达环保	34,200	420,318.00	0.16

286	603528	多伦科技	6,400	418,240.00	0.16
287	601139	深圳燃气	45,800	416,322.00	0.16
288	601515	东风股份	34,760	416,077.20	0.16
289	603128	华贸物流	41,600	416,000.00	0.16
290	600818	中路股份	12,400	413,912.00	0.16
291	603108	润达医疗	13,400	409,504.00	0.16
292	600987	航民股份	33,100	408,454.00	0.16
293	601789	宁波建工	61,000	407,480.00	0.16
294	600684	珠江实业	51,600	405,576.00	0.16
295	603308	应流股份	18,400	403,328.00	0.16
296	600396	金山股份	76,708	399,648.68	0.15
297	600251	冠农股份	49,100	398,201.00	0.15
298	600636	三爱富	28,530	395,425.80	0.15
299	603699	纽威股份	23,463	395,116.92	0.15
300	600310	桂东电力	43,100	392,210.00	0.15
301	600335	国机汽车	32,225	391,533.75	0.15
302	600973	宝胜股份	48,400	389,620.00	0.15
303	601218	吉鑫科技	72,300	388,251.00	0.15
304	603806	福斯特	8,300	384,041.00	0.15
305	600661	新南洋	13,499	383,776.57	0.15
306	603355	莱克电气	8,300	383,211.00	0.15
307	601016	节能风电	43,100	381,435.00	0.15
308	600077	宋都股份	69,500	379,470.00	0.15
309	600864	哈投股份	33,000	376,860.00	0.15
310	600830	香溢融通	33,100	375,685.00	0.14
311	603686	龙马环卫	11,300	374,256.00	0.14
312	600507	方大特钢	55,250	374,042.50	0.14
313	600257	大湖股份	35,100	373,815.00	0.14

314	600397	安源煤业	72,200	372,552.00	0.14
315	600874	创业环保	45,350	368,695.50	0.14
316	600708	光明地产	41,200	367,916.00	0.14
317	600888	新疆众和	46,592	364,815.36	0.14
318	600135	乐凯胶片	26,400	362,208.00	0.14
319	600007	中国国贸	20,873	360,476.71	0.14
320	600299	安迪苏	25,000	359,750.00	0.14
321	600483	福能股份	32,300	357,561.00	0.14
322	603698	航天工程	12,800	353,152.00	0.14
323	601208	东材科技	45,850	352,586.50	0.14
324	600326	西藏天路	41,600	351,936.00	0.14
325	603567	珍宝岛	17,700	349,752.00	0.13
326	603618	杭电股份	28,500	343,995.00	0.13
327	603508	思维列控	5,000	342,600.00	0.13
328	603989	艾华集团	9,300	342,333.00	0.13
329	601107	四川成渝	67,627	342,192.62	0.13
330	603939	益丰药房	11,300	334,932.00	0.13
331	603609	禾丰牧业	25,900	334,887.00	0.13
332	603979	金诚信	18,640	332,351.20	0.13
333	600814	杭州解百	29,200	332,004.00	0.13
334	601968	宝钢包装	34,600	331,122.00	0.13
335	601799	星宇股份	8,600	331,100.00	0.13
336	600197	伊力特	22,850	331,096.50	0.13
337	600327	大东方	35,450	329,685.00	0.13
338	603328	依顿电子	10,300	329,394.00	0.13
339	603737	三棵树	4,500	328,590.00	0.13
340	603568	伟明环保	14,100	328,530.00	0.13
341	603306	华懋科技	8,950	325,690.50	0.13

342	600697	欧亚集团	9,935	318,218.05	0.12
343	600617	国新能源	30,300	318,150.00	0.12
344	603126	中材节能	25,400	304,800.00	0.12
345	603898	好莱客	9,300	301,041.00	0.12
346	601199	江南水务	38,748	299,134.56	0.12
347	600975	新五丰	33,800	294,398.00	0.11
348	600468	百利电气	22,570	293,861.40	0.11
349	600101	明星电力	23,920	288,236.00	0.11
350	603798	康普顿	4,500	287,325.00	0.11
351	603168	莎普爱思	6,802	286,568.26	0.11
352	600897	厦门空港	12,399	280,341.39	0.11
353	600386	北巴传媒	20,989	280,203.15	0.11
354	601015	陕西黑猫	29,350	279,999.00	0.11
355	603116	红蜻蜓	12,690	279,941.40	0.11
356	601368	绿城水务	22,900	276,861.00	0.11
357	600829	人民同泰	18,000	275,040.00	0.11
358	600278	东方创业	16,300	266,016.00	0.10
359	603338	浙江鼎力	5,100	265,761.00	0.10
360	603818	曲美家居	15,100	263,495.00	0.10
361	603997	继峰股份	13,100	256,236.00	0.10
362	600548	深高速	30,100	255,850.00	0.10
363	601313	江南嘉捷	20,694	244,603.08	0.09
364	603669	灵康药业	8,100	243,324.00	0.09
365	600295	鄂尔多斯	25,473	241,738.77	0.09
366	600891	秋林集团	25,600	238,592.00	0.09
367	603339	四方冷链	6,400	238,592.00	0.09
368	600917	重庆燃气	17,800	234,782.00	0.09
369	603600	永艺股份	4,500	234,630.00	0.09

370	603868	飞科电器	5,000	234,300.00	0.09
371	600162	香江控股	58,515	232,304.55	0.09
372	600981	汇鸿集团	25,700	218,193.00	0.08
373	601020	华钰矿业	5,500	215,490.00	0.08
374	600613	神奇制药	15,200	213,256.00	0.08
375	601038	一拖股份	18,600	210,180.00	0.08
376	600845	宝信软件	11,574	204,165.36	0.08
377	603599	广信股份	11,800	200,128.00	0.08
378	603025	大豪科技	5,100	199,053.00	0.08
379	600081	东风科技	13,000	195,650.00	0.08
380	603861	白云电器	5,500	173,690.00	0.07
381	600828	茂业商业	19,830	167,563.50	0.06
382	600623	华谊集团	10,949	147,154.56	0.06
383	603555	贵人鸟	2,600	79,976.00	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

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	600996	贵广网络	11,416	214,506.64	0.08
2	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.05
3	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.04
4	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.03
5	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.03
6	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.03
7	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.03
8	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.02
9	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.02

10	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.01
11	603886	元祖股份	1,500	26,550.00	0.01
12	603239	N 仙通	774	24,342.30	0.01
13	603228	景旺电子	1,050	24,318.00	0.01
14	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.01
15	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.01
16	603929	N 亚翔	2,193	15,592.23	0.01
17	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
18	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
19	603389	亚振家居	96	2,314.56	0.00
20	601882	海天精工	48	1,211.52	0.00

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	600660	福耀玻璃	2,714,276.38	0.89
2	600867	通化东宝	2,331,540.60	0.76
3	601888	中国国旅	2,189,073.00	0.71
4	600718	东软集团	2,058,775.10	0.67
5	600309	万华化学	2,043,703.00	0.67
6	600027	华电国际	1,692,177.13	0.55
7	600583	海油工程	1,668,345.00	0.54
8	600654	中安消	1,667,622.00	0.54
9	600256	广汇能源	1,569,560.00	0.51
10	600170	上海建工	1,559,917.32	0.51
11	600879	航天电子	1,393,552.00	0.45

12	600373	中文传媒	1,358,838.00	0.44
13	600418	江淮汽车	1,317,807.86	0.43
14	601992	金隅股份	1,184,319.00	0.39
15	600699	均胜电子	1,175,055.00	0.38
16	600655	豫园商城	1,169,452.00	0.38
17	600633	浙报传媒	1,087,476.52	0.35
18	600856	中天能源	1,062,804.00	0.35
19	600978	宜华生活	1,053,594.00	0.34
20	600568	中珠医疗	1,022,666.00	0.33

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	600009	上海机场	3,154,717.83	1.03
2	600522	中天科技	2,215,533.84	0.72
3	601888	中国国旅	2,078,055.65	0.68
4	600446	金证股份	1,992,093.74	0.65
5	600079	人福医药	1,803,997.29	0.59
6	600654	中安消	1,693,221.34	0.55
7	600978	宜华生活	1,558,939.86	0.51
8	600482	中国动力	1,408,104.20	0.46
9	600655	豫园商城	1,308,280.38	0.43
10	600549	厦门钨业	1,281,868.34	0.42
11	600699	均胜电子	1,275,455.91	0.42
12	601699	潞安环能	1,179,731.00	0.38
13	600601	方正科技	1,155,054.00	0.38

14	600565	迪马股份	1,130,631.00	0.37
15	600435	北方导航	1,123,900.00	0.37
16	600528	中铁二局	1,116,332.00	0.36
17	600160	巨化股份	1,113,534.24	0.36
18	600026	中远海能	1,018,803.44	0.33
19	600058	五矿发展	1,001,368.40	0.33
20	600704	物产中大	983,330.36	0.32

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	82,004,409.80
卖出股票收入（成交）总额	74,393,860.19

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

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

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	1,515.33
2	应收证券清算款	15,940.01
3	应收股利	-
4	应收利息	246.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,701.68

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**

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 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	601375	中原证券	106,780.00	0.04	新股锁定

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
1,033	163,067.68	148,333,210.00	88.06%	20,115,705.00	11.94%

9.2 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
中国建设银行股份有限公司—南方 上证 380 交易型开放式指数证券基 金联接基金	138,399,941.00	82.16%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国建设银行股份有限公司—南方上证 380 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。

9.3 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	泰康资产强化回报混合型养老金产品—中国 建设银行股份有限公司	1,923,300.00	1.14%
2	中国建设银行股份有限公司企业年金计划— 中国工商银行股份有限公司	1,611,200.00	0.96%
3	中国石油天然气集团公司企业年金计划—中 国工商银行股份有限公司	1,572,800.00	0.93%
4	方正证券股份有限公司	1,430,806.00	0.85%
5	郑州煤炭工业（集团）有限责任公司企业年金 计划—中国建设银行股份有限公司	1,220,400.00	0.72%

6	胡海燕	1,073,900.00	0.64%
7	徐志烨	705,200.00	0.42%
8	北京无限立通通讯技术有限责任公司	609,600.00	0.36%
9	山西焦煤集团有限责任公司企业年金计划一 中国工商银行股份有限公司	576,800.00	0.34%
10	刘晓梅	550,000.00	0.33%
11	中国建设银行股份有限公司—南方上证 380 交易型开放式指数证券	138,399,941.00	82.16%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本公司的所有从业人员均未持有本基金份额。

9.5 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（2011年9月16日）基金份额总额	330,448,915.00
本报告期期初基金份额总额	166,448,915.00
本报告期基金总申购份额	68,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	66,000,000.00
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	168,448,915.00

§ 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七届董事会第一次会议审议通过，并按规定向中国证券监督管理委员会深圳监管局备案，基金管理人于 2016 年 10 月 20 日发布公告，自 2016 年 10 月 18 日起，张海波先生担任本基金管理人董事长，吴万善先生不再担任本基金管理人董事长。

基金管理人于 2016 年 10 月 20 日发布公告，南方基金管理有限公司（以下简称“公司”）第六届董事会任期届满，根据《公司法》、《证券投资基金管理公司管理办法》等法律法规和《公司章程》的规定，公司股东会 2016 年第一次临时会议选举产生了公司第七届董事会。

根据南方基金管理有限公司第六届董事会第二十八次会议审议通过，并按规定向中国证券投资基金业协会报备，基金管理人于 2016 年 10 月 19 日发布公告，自 2016 年 10 月 17 日起，郑文祥先生不再担任本基金管理人副总经理。

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，无涉及基金管理业务、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 55,000 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	187,783,775.14	56.59%	8,778.56	12.28%	-
华泰证券	1	67,335,886.43	43.41%	62,707.13	87.72%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
诚浩证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-

注：1、为节约交易单元资源，我公司在交易所交易系统升级的基础上，对同一银行托管基金进行了席位整合。

2、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专用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

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
银河证券	518,165.90	100.00%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-

湘财证券	-	-	-	-	-	-
诚浩证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-

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	南方基金关于旗下 380ETF 和 500ETF 增加大同证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 12 月 22 日
2	关于上证 380 交易型开放式指数证券投资基金变更基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 11 月 28 日
3	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 10 月 25 日
4	上证 380 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 2 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 10 月 21 日
5	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)(2016 年第 2 号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 10 月 21 日
6	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	2016 年 9 月 26 日
7	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告(正文)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 29 日
8	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告(摘要)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 29 日
9	关于上证 380 交易型开放式指数证券投资基金变更基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 20 日
10	关于南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 20 日

	接基金变更基金经理的公告	报、证券时报	
11	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 7 月 21 日
12	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 21 日
13	上证 380 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 4 月 21 日
14	上证 380 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 4 月 21 日
15	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
16	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 30 日
17	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年度报告 (摘要)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 30 日
18	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
19	关于上证 380 交易型开放式指数证券投资基金变更基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 5 日
20	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
21	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 21 日
22	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
23	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
24	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

25	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
26	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 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立上证 380 交易型开放式指数证券投资基金的文件。
- 2、上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同。
- 3、上证 380 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

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>