

# 上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告摘要

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	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	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-8899	010-67595096
传真		0755-82763889	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	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

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。

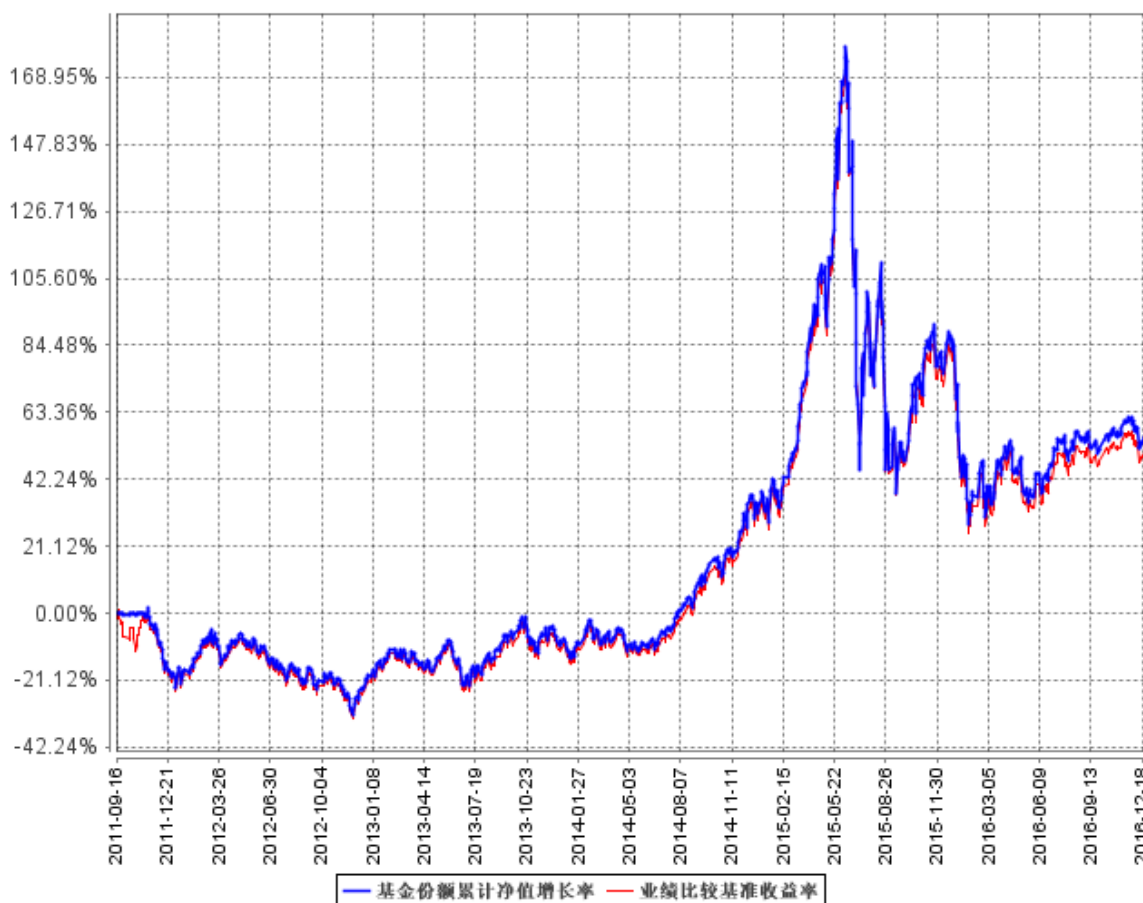
## 3.2 基金净值表现

### 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%

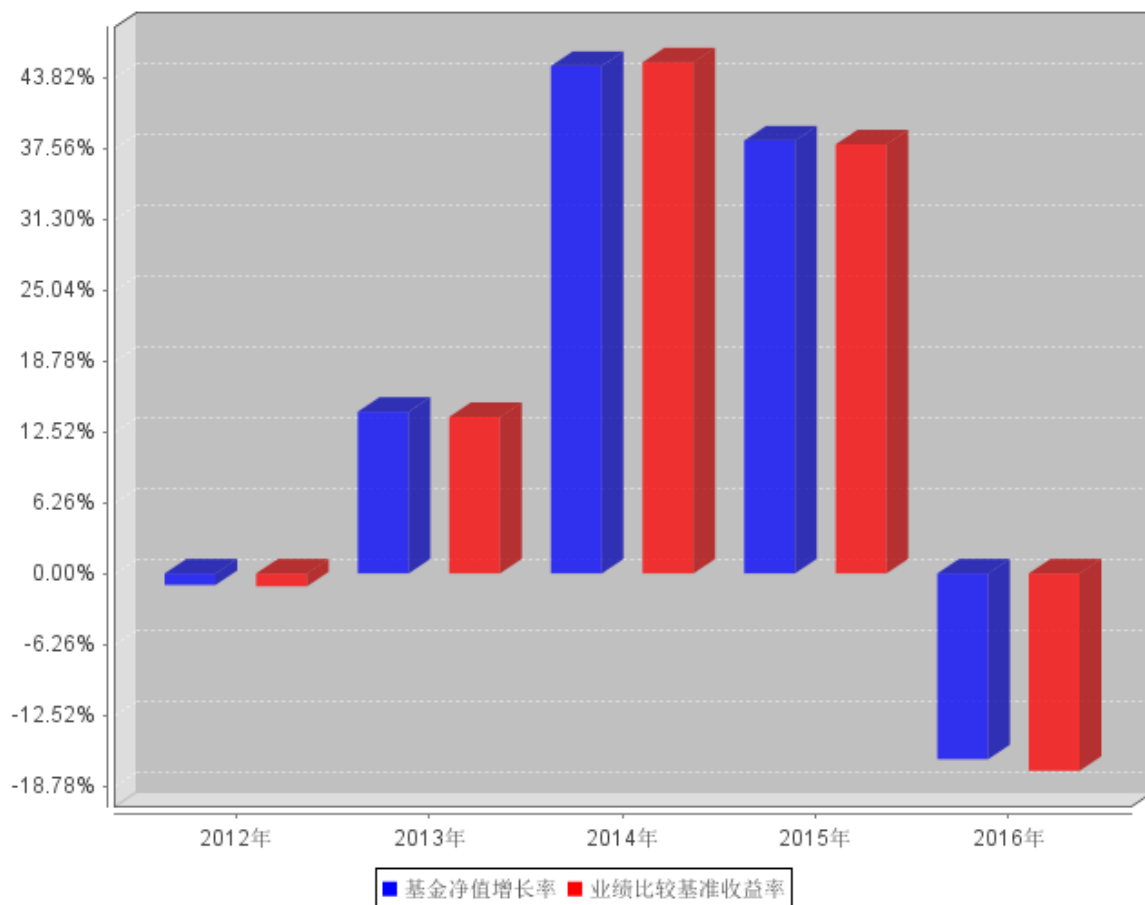
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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，两两组合同单日、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**

本基金 2016 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2017)第 21489 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §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	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	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	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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	15,940.01	58,245.22
应收利息	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	-	-
资产总计	259,740,513.53	307,045,818.38
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 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	-	-
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	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	289,955.86	261,705.71
负债合计	487,087.44	557,873.85
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	168,448,915.00	166,448,915.00
未分配利润	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	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年	2015 年 1 月 1 日至 2015 年

	12月31日	12月31日
<b>一、收入</b>	-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	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	-9,656,216.70	-10,615,137.02
基金投资收益	-	-
债券投资收益	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	2,198,552.36	2,532,008.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-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）	-62,470.26	5,251,830.90
<b>减：二、费用</b>	2,439,610.18	3,078,179.79
1. 管理人报酬	1,331,975.38	1,762,134.99
2. 托管费	266,395.10	352,427.04
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	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	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



### 7.4.1.3 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。

### 7.4.2 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。

### 7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“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

#### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	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%

##### 7.4.4.1.2 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。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	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。

##### 7.4.4.2.2 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。

#### 7.4.4.3 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。

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

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

##### 7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年12月31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
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。

#### 7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 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	
	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。

**7.4.4.6 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。

**7.4.4.7 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。

**7.4.5 利润分配情况**

注：本基金本报告期内无利润分配。

**7.4.6 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.6.1 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	-	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-

		12月27日		通受限						
--	--	--------	--	-----	--	--	--	--	--	--

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。

#### 7.4.6.2 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	重大事项 未公告	14.05	2017-2-16	14.9	55,420	809,322.01	778,651.00	-



		14 日									
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	重大资产 重组	8.47			60,150	451,431.17	509,470.50	-	

		25 日									
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。

### 7.4.6.3 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。

## §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前 10 名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于

<http://www.nffund.com> 的年度报告正文。

### 8.3.2 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前 10 名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	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
----	--------	------	-------	-----------	------

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。

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于

<http://www.nffund.com> 的年度报告正文。

### 8.3.3 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。

### 8.4 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。

### 8.5 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。

### 8.6 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。

### 8.7 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.8 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。

### 8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.9.1 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。

#### 8.9.2 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。

## 8.10 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。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1

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。

### 8.11.2

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。

### 8.11.3 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

### 8.11.4 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。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.11.5.1 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。



**8.11.5.2 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

**8.11.6 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	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额
---	-------	---------	--------

号			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	徐志焯	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— 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	-	-	-	-	-	-