

# 中证 500 信息技术指数交易型开放式指数 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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

<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、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	23
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>50</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
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.....	60
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.....	60

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.....	60
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.....	60
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
8.12 投资组合报告附注.....	61
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>63</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
9.3 期末上市基金前十名持有人.....	63
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
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.....	64
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>65</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>66</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	66
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.....	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
11.4 基金投资策略的改变.....	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
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.....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
11.8 其他重大事件.....	69
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>70</b>
12.1 备查文件目录.....	70
12.2 存放地点.....	70
12.3 查阅方式.....	70

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中证 500 信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 500 信息技术 ETF
场内简称	500 信息
基金主代码	512330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 29 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	183,188,000.00 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	2015 年 7 月 20 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“500 信息 ETF”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，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。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 信息技术指数。
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	中国农业银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	鲍文革	林葛
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	400-889-8899	95599	
传真	0755-82763889	010-68121816	
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	北京东城区建国门内大街 69 号	
办公地址	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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9	
邮政编码	518048	100031	
法定代表人	张海波	周慕冰	

## 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	<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

## 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 6 月 29 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-3,821,978.60	13,059,988.78
本期利润	-18,889,694.04	14,837,750.30
加权平均基金份额本期利润	-0.2032	0.1545
本期加权平均净值利润率	-23.77%	16.00%
本期基金份额净值增长率	-22.75%	4.75%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-34,953,658.07	1,767,258.86
期末可供分配基金份额利润	-0.1908	0.0475
期末基金资产净值	148,234,341.93	38,955,258.86
期末基金份额净值	0.8092	1.0475
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-19.08%	4.75%

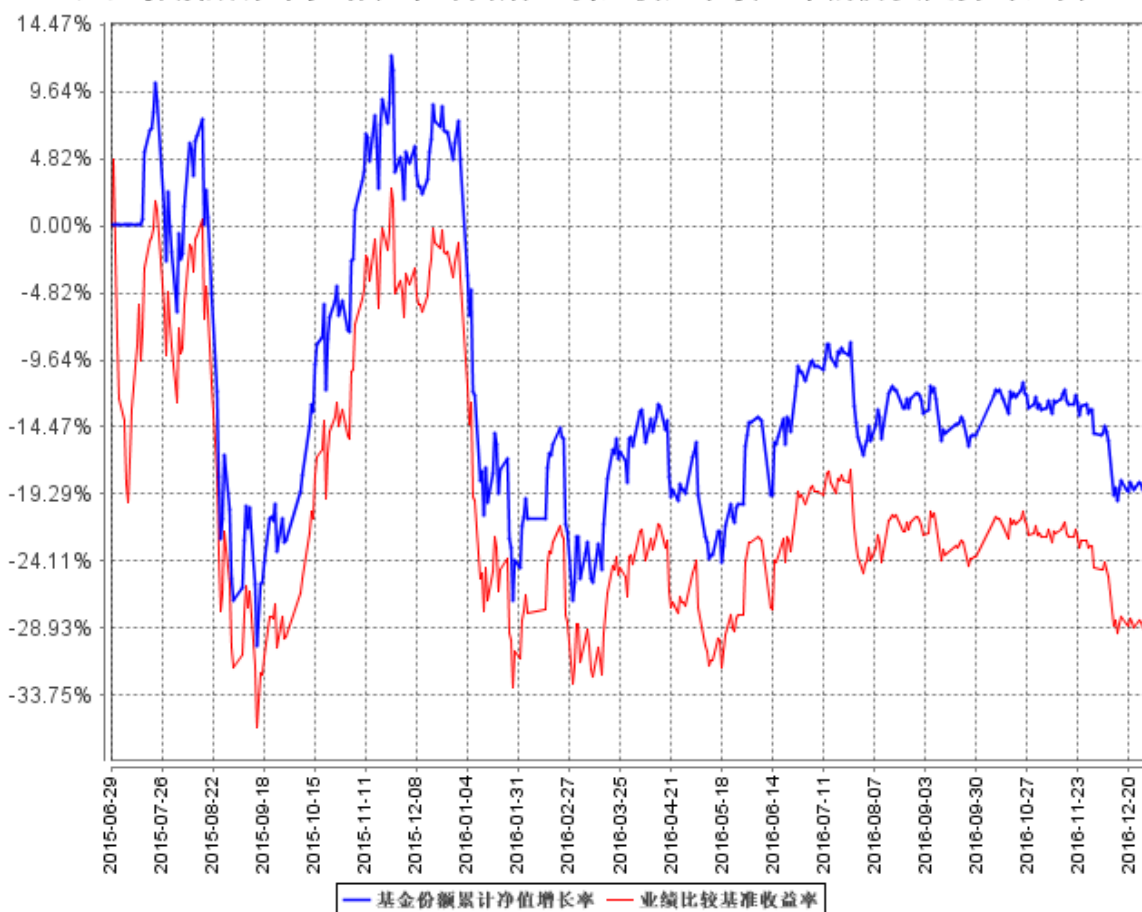
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	-4.76%	1.00%	-6.93%	1.02%	2.17%	-0.02%
过去六个月	-9.63%	1.10%	-12.00%	1.11%	2.37%	-0.01%
过去一年	-22.75%	2.05%	-26.37%	2.06%	3.62%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-19.08%	2.42%	-29.09%	2.56%	10.01%	-0.14%

### 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

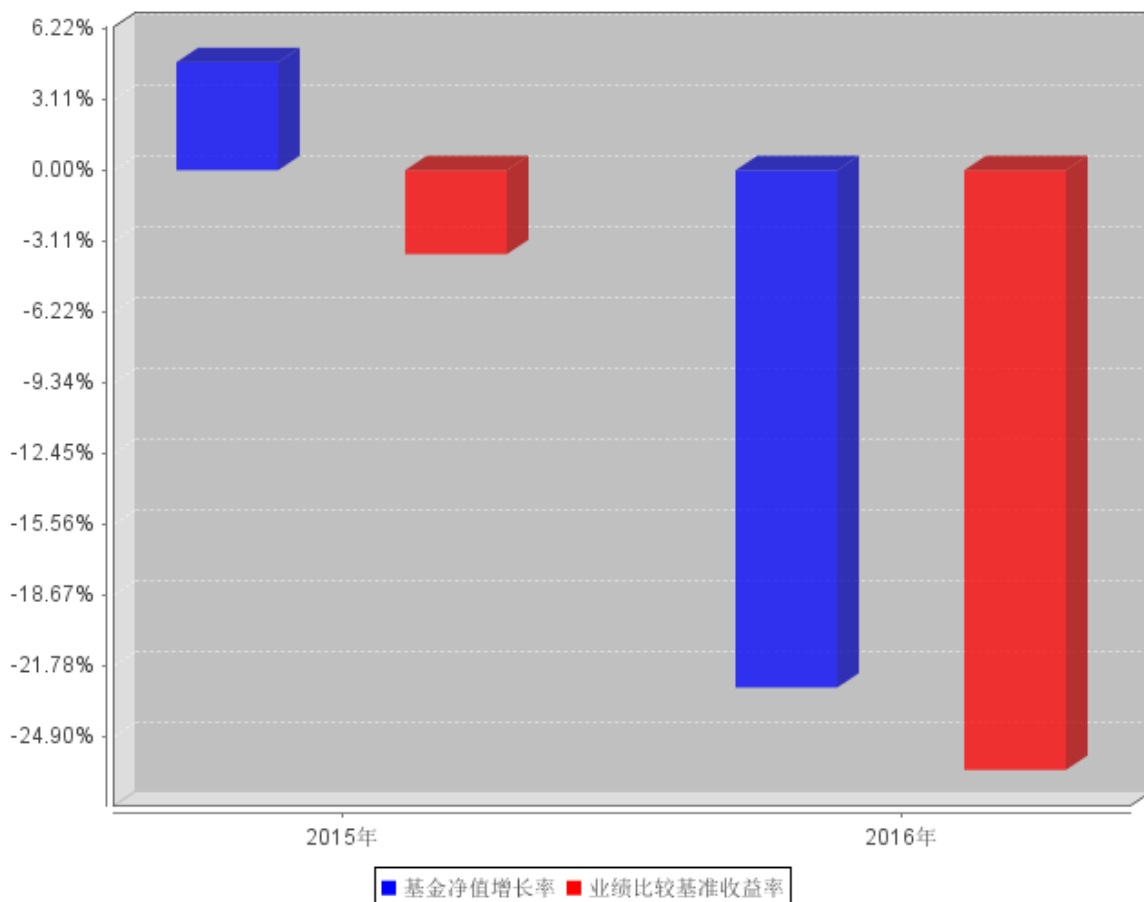
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





### 3.2.3 自基金合同生效以来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

自基金合同生效以来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		
孙伟	本基金基金经理	2015 年 7 月 10 日	-	6 年	管理学学士，具有基金从业资格、金融分析师（CFA）资格、注册会计师（CPA）资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010 年 2 月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员；2014 年 12 月至 2015 年 5 月，担任南方恒生 ETF 的基金经理助理；2015 年 5 月至 2016 年 7 月，任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 7 月至今，任改革基金、高铁基金、500 信息基金经理；2016 年 5 月至今，任南方创业板 ETF、南方创业板 ETF 联接基金经理；2016 年 8 月至今，任 500 信息联接、深成 ETF、南方深成基金经理。
雷本		2015 年	2016 年	8 年	北京大学智能科学系硕士，具有基金从业资格。

俊	基金基金经理	6月29日	7月29日		2008年7月加入南方基金，历任信息技术部投研系统研发员、数量化投资部高级研究员，现任数量化投资部总监助理；2014年12月至2016年4月，任南方恒生ETF基金经理；2015年4月至2016年4月，任南方中证500工业ETF、南方中证500原材料ETF基金经理；2015年4月至今，任大数据100基金经理；2015年6月至今，任改革基金、高铁基金、南方策略优化、大数据300、南方500信息、南方量化成长的基金经理。
---	--------	-------	-------	--	---

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”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，“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《中证500信息技术指数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

本年度中证 500 信息指数在 1 月份大跌 27.95% 后，2 至 11 月缓步抬升、振幅收窄，但 12 月再次出现了快速调整，全年累计下跌 26.37%。

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

本基金本年度跟踪误差为 1.32%，并取得了超越标的指数 3.62% 的跟踪正偏离，较为理想地实现了投资目标。积极参与网下新股申购对基金超越业绩基准收益贡献明显。

截至报告期末，本基金份额净值为 0.8092 元，报告期内份额净值增长率为 -22.75%，同期业绩基准增长率为 -26.37%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前我国面临经济发展的“新常态”，信息产业作为引领中国制造 2025 和互联网+的龙头，承担着“培育发展新动力，拓展发展新空间”的重要责任，代表了中国新经济发展的方向。

17 年 1 月，工业和信息化部、国家发展改革委正式印发了《信息产业发展指南》，提出了到 2020 年基本建立具有国际竞争力、安全可控信息产业生态体系的发展目标。中证 500 信息技术指数系由中证 500 指数中的信息技术行业股票所构成，成分股全面涵盖了《信息产业发展指南》提及的集成电路、基础电子、基础软件和工业软件、关键应用软件和行业解决方案、智能硬件和应用电子、计算机与通信设备、大数据、云计算、物联网这 9 个重点发展领域。

中证 500 信息技术指数兼具中证 500 的中盘蓝筹属性和信息技术行业的新兴成长特性，历史表现在同类指数中位居前列。从估值、盈利和跨境比较角度看，权益类资产经历三轮大幅下跌后，投资性价比已经大幅提高。投资者可通过本基金或南方中证 500 信息技术 ETF 联接基金分享指数收益。

#### 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：每一基金份额享有同等分配权；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多 12 次，每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。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

## §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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，南方基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，南方基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §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 21439 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	中证 500 信息技术指数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	我们审计了后附的中证 500 信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“中证 500 信息技术 ETF 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	<p>编制和公允列报财务报表是中证 500 信息技术 ETF 基金的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞</p>



	<p>弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	<p>我们认为，上述中证 500 信息技术 ETF 基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了中证 500 信息技术 ETF 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：中证 500 信息技术指数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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,211,260.44	1,628,321.76
结算备付金		4,825.48	138,552.64
存出保证金		57,876.50	188,792.12
交易性金融资产	7.4.7.2	147,390,171.75	37,137,655.99
其中：股票投资		147,390,171.75	37,137,655.99
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	215.36	559.32
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		148,664,349.53	39,093,881.83
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</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	7.4.7.3	-	-
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		65,022.84	18,190.44
应付托管费		13,004.55	3,638.11
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	8,129.01	5,525.81
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	343,851.20	111,268.61
负债合计		430,007.60	138,622.97
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	183,188,000.00	37,188,000.00
未分配利润	7.4.7.10	-34,953,658.07	1,767,258.86
所有者权益合计		148,234,341.93	38,955,258.86
负债和所有者权益总计		148,664,349.53	39,093,881.83

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8092 元，基金份额总额

183,188,000.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：中证 500 信息技术指数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	上年度可比期间 2015 年 6 月 29 日(基
----	-----	-----------------------	------------------------------

		2016 年 12 月 31 日	金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-17,806,080.83	15,619,987.27
1.利息收入		14,353.02	215,428.00
其中：存款利息收入	7.4.7.11	13,205.80	165,539.88
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,147.22	49,888.12
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,799,995.42	13,983,261.44
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-2,899,505.11	13,973,307.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	99,509.69	9,954.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-15,067,715.44	1,777,761.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	47,277.01	-356,463.69
<b>减：二、费用</b>		1,083,613.21	782,236.97
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	400,682.08	227,367.80
2. 托管费	7.4.10.2.2	80,136.45	45,473.57
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	141,761.28	223,377.81

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	461,033.40	286,017.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-18,889,694.04	14,837,750.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-18,889,694.04	14,837,750.30

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中证 500 信息技术指数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）	37,188,000.00	1,767,258.86	38,955,258.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-18,889,694.04	-18,889,694.04
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）	146,000,000.00	-17,831,222.89	128,168,777.11
其中：1.基金申购款	215,500,000.00	-26,404,406.24	189,095,593.76
2.基金赎回款	-69,500,000.00	8,573,183.35	-60,926,816.65
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）	183,188,000.00	-34,953,658.07	148,234,341.93
项目	上年度可比期间 2015年6月29日(基金合同生效日)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）	272,188,000.00	-	272,188,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,837,750.30	14,837,750.30
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）	-235,000,000.00	-13,070,491.44	-248,070,491.44
其中：1. 基金申购款	60,000,000.00	-1,146,767.97	58,853,232.03
2. 基金赎回款	-295,000,000.00	-11,923,723.47	-306,923,723.47
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）	37,188,000.00	1,767,258.86	38,955,258.86

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

中证 500 信息技术指数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[2014]408 号《关于核准中证 500 信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》和证券基金机构监管部部函[2015]1170 号《关于中证 500 信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金延期募集备案的回函》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《中证 500 信息技术指数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,首次设立募集共募集人民币 272,188,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 768 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中证 500 信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 272,188,000.00 份。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2015]298 号审核同意,本基金 272,188,000.00 份基金份额于 2015 年 7 月 20 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中证 500 信息技术指数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中证 500 信息技术指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化;主要投资范围为标的指数成份股、备选成份股;此外,本基金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)、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。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%,且不低于非现金基金资产的 80%。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%。本基金的业绩比较基准为中证 500 信息技术指数。

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》、《中证 500 信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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。比较财务报表的实际编制期间为 2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

#### 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、买入返售金融资产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。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。

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。

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票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，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)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，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	1,211,260.44	1,628,321.76
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	1,211,260.44	1,628,321.76

### 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	160,680,125.67	147,390,171.75	-13,289,953.92

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		160,680,125.67	147,390,171.75	-13,289,953.92
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		35,359,894.47	37,137,655.99	1,777,761.52
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		35,359,894.47	37,137,655.99	1,777,761.52

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零(2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 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	187.16	412.02
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	2.20	62.40
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	26.00	84.90
合计	215.36	559.32

**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	8,129.01	5,525.81
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	8,129.01	5,525.81

**7.4.7.8 其他负债**

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
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	267,653.80	65,000.00
可退替代款	8,620.00	38,802.20
应退替代款	67,577.40	7,466.41
合计	343,851.20	111,268.61

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	37,188,000.00	37,188,000.00
本期申购	215,500,000.00	215,500,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-69,500,000.00	-69,500,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	183,188,000.00	183,188,000.00

注：1. 本基金自 2015 年 6 月 10 日至 2015 年 6 月 19 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 272,188,000.00 元。

2. 根据《中证 500 信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于 2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 7 月 19 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务和赎回业务自 2015 年 7 月 20 日起开始办理。

**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	3,716,073.55	-1,948,814.69	1,767,258.86
本期利润	-3,821,978.60	-15,067,715.44	-18,889,694.04
本期基金份额交易产生的变动数	1,888,874.54	-19,720,097.43	-17,831,222.89
其中：基金申购款	3,880,306.50	-30,284,712.74	-26,404,406.24
基金赎回款	-1,991,431.96	10,564,615.31	8,573,183.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,782,969.49	-36,736,627.56	-34,953,658.07

**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6月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	9,975.78	158,969.40
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	3,230.02	6,570.48
其他	-	-
合计	13,205.80	165,539.88

**7.4.7.12 股票投资收益****7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------



	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 6 月 29 日(基金合同 生效日)至 2015 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价 收入	-2,322,457.80	9,130,222.89
股票投资收益——赎回差价收入	-577,047.31	4,843,084.25
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-2,899,505.11	13,973,307.14

#### 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 6 月 29 日(基金合 同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	90,415,914.37	144,191,354.73
减：卖出股票成本总额	92,738,372.17	135,061,131.84
买卖股票差价收入	-2,322,457.80	9,130,222.89

#### 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 29 日(基金合 同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	60,926,816.65	306,923,723.47
减：现金支付赎回款总额	41,531,987.65	214,158,024.47
减：赎回股票成本总额	19,971,876.31	87,922,614.75
赎回差价收入	-577,047.31	4,843,084.25

**7.4.7.13 债券投资收益**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

**7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益**

注：无。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

注：无。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

**7.4.7.16 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 6 月 29 日(基金合同生 效日)至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	99,509.69	9,954.30
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	99,509.69	9,954.30

**7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 29 日(基金合 同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-15,067,715.44	1,777,761.52
——股票投资	-15,067,715.44	1,777,761.52
——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	-15,067,715.44	1,777,761.52

注：本基金本年度及上年度可比期间公允价值变动损益—股票投资中包括的可退替代款产生的公允价值变动收益均为零。

#### 7.4.7.18 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6月29日(基金合同 生效日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	47,277.01	-429,905.85
其他	-	73,442.16
合计	47,277.01	-356,463.69

注：1. 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。

2. 其他为本基金网下现金认购款项在基金募集期间产生的利息收入。

#### 7.4.7.19 交易费用

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6月29日(基金合同生 效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	141,761.28	223,377.81
银行间市场交易费用	-	-
合计	141,761.28	223,377.81

**7.4.7.20 其他费用**

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 6 月 29 日(基金合同 生效日)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	150,000.00
上市费	60,000.00	55,000.00
银行汇划费	3,229.60	5,367.79
账户维护费	150.00	150.00
指数使用费	42,653.80	20,000.00
其他	-	500.00
合计	461,033.40	286,017.79

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 10,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

**7.4.7.21 分部报告**

注：无。

**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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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（“兴业证券”）	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
南方中证 500 信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“南方中证 500 信息技术 ETF 发起式联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 6 月 29 日 (基金合同生效日) 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	234,415,835.53	86.16%	316,675,932.02	82.72%

**7.4.10.1.2 债券交易**

注：无。

**7.4.10.1.3 债券回购交易**

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6月29日(基金合同生效日)至 2015年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
华泰证券	-	-	310,000,000.00	74.70%

**7.4.10.1.4 权证交易**

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

**7.4.10.1.5 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	23,443.13	86.16%	7,322.58	90.08%
关联方名称	上年度可比期间 2015年6月29日(基金合同生效日)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	31,670.70	82.72%	2,981.55	53.96%
------	-----------	--------	----------	--------

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 6 月 29 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	400,682.08	227,367.80
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	80,136.45	45,473.57

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

**7.4.10.2.3 销售服务费**

注：无。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

注：本基金的基金管理人于本基金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。

**7.4.10.4.2 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 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
南方中证 500 信息技术 ETF 发起式联接基金	156,810,000.00	85.6000%	-	-

**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 2016年1月1日至2016年12月 31日		上年度可比期间 2015年6月29日(基金合同生效日)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
中国农业银行	1,211,260.44	9,975.78	1,628,321.76	158,969.40

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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：本基金本报告期内未进行利润分配。

**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	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	20,267	81,068.00	81,068.00	-
300583	赛托生物	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股流通受限	21.30	21.30	2,067	44,027.10	44,027.10	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	10.44	10.44	1,489	15,545.16	15,545.16	-
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-

002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流 通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
300586	美联新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 4 日	新股流 通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流 通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流 通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

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
300088	长信科技	2016 年 9 月 12 日	重大 事项	15.80	-	-	253,300	3,731,726.14	4,002,140.00	-
000748	长城信息	2016 年 11 月 1 日	重大 事项	20.31	-	-	189,600	4,024,808.90	3,850,776.00	-
000050	深天马 A	2016 年 9 月 12 日	重大 事项	18.82	2017 年 3 月 23 日	20.70	175,900	3,387,829.83	3,310,438.00	-

000727	华东科技	2016 年 11 月 17 日	重大事项	3.37	2017 年 2 月 15 日	3.47	781,900	2,686,385.58	2,635,003.00	-
600151	航天机电	2016 年 11 月 11 日	重大事项	10.97	-	-	230,310	2,640,743.97	2,526,500.70	-
600171	上海贝岭	2016 年 12 月 14 日	重大事项	14.05	2017 年 2 月 16 日	14.90	150,042	2,513,465.72	2,108,090.10	-
002635	安洁科技	2016 年 11 月 8 日	重大事项	36.40	2017 年 2 月 8 日	33.50	45,400	1,575,600.78	1,652,560.00	-
002745	木林森	2016 年 7 月 18 日	重大事项	36.49	-	-	2,900	93,376.95	105,821.00	-

注：1. 根据长城信息产业股份有限公司(以下简称“长城信息”)于 2016 年 10 月 25 日公布的《关于中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并公司事宜的提示性公告》和中国长城计算机深圳股份有限公司(以下简称“长城电脑”)于 2017 年 1 月 20 日公布的《中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并长城信息产业股份有限公司及重大资产置换和发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易报告书(修订稿)》，长城电脑将向长城信息全体股东发行 A 股股票，以换股比例 1: 0.5424 取得长城信息股东持有的长城信息全部股票，吸收合并长城信息；长城信息自 2016 年 11 月 1 日起连续停牌。换股合并后新增的长城电脑股票于 2017 年 1 月 18 日上市流通，当日开盘单价为 10.63 元。长城信息人民币普通股股票自 2017 年 1 月 18 日起终止上市并摘牌。

2. 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，紧密跟踪中证 500 信息技术指数，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，跟踪中证 500 信息技术指数，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农业银行，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。

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。本基金交易所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12.2 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计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

## 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	1,211,260.44	-	-	-	1,211,260.44
结算备付金	4,825.48	-	-	-	4,825.48
存出保证金	57,876.50	-	-	-	57,876.50
交易性金融资产	-	-	-	147,390,171.75	147,390,171.75
应收利息	-	-	-	215.36	215.36
资产总计	1,273,962.42	-	-	147,390,387.11	148,664,349.53
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	65,022.84	65,022.84
应付托管费	-	-	-	13,004.55	13,004.55
应付交易费用	-	-	-	8,129.01	8,129.01
其他负债	-	-	-	343,851.20	343,851.20
负债总计	-	-	-	430,007.60	430,007.60
利率敏感度缺口	1,273,962.42	-	-	146,960,379.51	148,234,341.93
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	1,628,321.76	-	-	-	1,628,321.76
结算备付金	138,552.64	-	-	-	138,552.64
存出保证金	188,792.12	-	-	-	188,792.12
交易性金融资产	-	-	-	37,137,655.99	37,137,655.99
应收利息	-	-	-	559.32	559.32
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,955,666.52	-	-	37,138,215.31	39,093,881.83
负债					

应付管理人报酬	-	-	-	18,190.44	18,190.44
应付托管费	-	-	-	3,638.11	3,638.11
应付交易费用	-	-	-	5,525.81	5,525.81
其他负债	-	-	-	111,268.61	111,268.61
负债总计	-	-	-	138,622.97	138,622.97
利率敏感度缺口	1,955,666.52	-	-	36,999,592.34	38,955,258.86

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 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，跟踪中证 500 信息技术指数，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，中证 500 信息技术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%。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	147,390,171.75	99.43	37,137,655.99	95.33
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	147,390,171.75	99.43	37,137,655.99	95.33

#### 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%	7,290,000.00	1,390,000.00
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-7,290,000.00	-1,390,000.00

#### 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 2016 年度, 本基金申购基金份额的对价总额为 189,095,593.76 元(2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日: 58,853,232.03 元), 其中包括以股票支付的申购款 54,430,360.00 元和以现金支付的申购款 134,665,233.76 元(2015 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日: 其中包括以股票支付的申购款 19,719,975.00 元和以现金支付的申购款 39,133,257.03 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 126,948,644.74 元，属于第二层次的余额为 20,441,527.01 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 31,681,050.95 元，第二层次 5,456,605.04 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，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	147,390,171.75	99.14
	其中：股票	147,390,171.75	99.14
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	1,216,085.92	0.82
7	其他各项资产	58,091.86	0.04
8	合计	148,664,349.53	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	87,947,528.63	59.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

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	58,405,809.30	39.40
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	-	-
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	146,353,337.93	98.73

### 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	801,826.39	0.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	138,347.20	0.09
J	金融业	81,068.00	0.05
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	1,036,833.82	0.70

### 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投资股票。

### 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	600584	长电科技	291,675	5,148,063.75	3.47
2	002405	四维图新	242,030	4,683,280.50	3.16
3	300088	长信科技	253,300	4,002,140.00	2.70
4	300115	长盈精密	151,680	3,952,780.80	2.67
5	000748	长城信息	189,600	3,850,776.00	2.60
6	300296	利亚德	111,100	3,746,292.00	2.53
7	000997	新大陆	184,080	3,576,674.40	2.41
8	002439	启明星辰	171,600	3,567,564.00	2.41
9	000050	深天马 A	175,900	3,310,438.00	2.23

10	000970	中科三环	239,100	3,191,985.00	2.15
11	300113	顺网科技	114,500	3,078,905.00	2.08
12	002179	中航光电	84,700	3,073,763.00	2.07
13	300324	旋极信息	156,900	3,032,877.00	2.05
14	002273	水晶光电	147,550	2,936,245.00	1.98
15	002217	合力泰	159,800	2,860,420.00	1.93
16	600601	方正科技	615,500	2,831,300.00	1.91
17	002410	广联达	188,300	2,749,180.00	1.85
18	000988	华工科技	174,450	2,730,142.50	1.84
19	600410	华胜天成	248,540	2,701,629.80	1.82
20	000727	华东科技	781,900	2,635,003.00	1.78
21	600151	航天机电	230,310	2,526,500.70	1.70
22	603019	中科曙光	89,700	2,495,454.00	1.68
23	300287	飞利信	201,969	2,403,431.10	1.62
24	002657	中科金财	55,400	2,391,064.00	1.61
25	002544	杰赛科技	84,400	2,375,016.00	1.60
26	000066	长城电脑	185,500	2,307,620.00	1.56
27	002268	卫士通	72,700	2,284,234.00	1.54
28	002261	拓维信息	186,800	2,226,656.00	1.50
29	600183	生益科技	201,700	2,218,700.00	1.50
30	002308	威创股份	145,600	2,146,144.00	1.45
31	600171	上海贝岭	150,042	2,108,090.10	1.42
32	002373	千方科技	152,400	2,103,120.00	1.42
33	300010	立思辰	122,200	2,030,964.00	1.37
34	600260	凯乐科技	130,000	2,012,400.00	1.36
35	600651	飞乐音响	189,400	1,994,382.00	1.35
36	600536	中国软件	82,600	1,987,356.00	1.34
37	000021	深科技	204,500	1,928,435.00	1.30

38	601231	环旭电子	178,000	1,906,380.00	1.29
39	300166	东方国信	90,700	1,885,653.00	1.27
40	300202	聚龙股份	76,200	1,874,520.00	1.26
41	002063	远光软件	135,763	1,783,925.82	1.20
42	002106	莱宝高科	157,300	1,768,052.00	1.19
43	002368	太极股份	57,700	1,766,197.00	1.19
44	002123	梦网荣信	117,500	1,762,500.00	1.19
45	000636	风华高科	175,300	1,710,928.00	1.15
46	002354	天神娱乐	24,600	1,701,336.00	1.15
47	002161	远望谷	144,900	1,670,697.00	1.13
48	002635	安洁科技	45,400	1,652,560.00	1.11
49	002690	美亚光电	76,200	1,612,392.00	1.09
50	600289	亿阳信通	124,300	1,609,685.00	1.09
51	300297	蓝盾股份	128,200	1,594,808.00	1.08
52	002463	沪电股份	325,700	1,556,846.00	1.05
53	300032	金龙机电	90,900	1,462,581.00	0.99
54	002642	荣之联	70,700	1,421,070.00	0.96
55	600850	华东电脑	58,126	1,405,486.68	0.95
56	600563	法拉电子	37,400	1,371,458.00	0.93
57	002371	七星电子	50,900	1,353,940.00	0.91
58	002093	国脉科技	120,200	1,330,614.00	0.90
59	600460	士兰微	202,900	1,262,038.00	0.85
60	002414	高德红外	53,700	1,223,286.00	0.83
61	603528	多伦科技	16,800	1,097,880.00	0.74
62	002315	焦点科技	15,800	952,582.00	0.64
63	603005	晶方科技	30,600	919,224.00	0.62
64	603328	依顿电子	28,511	911,781.78	0.62
65	603025	大豪科技	12,300	480,069.00	0.32

66	002745	木林森	2,900	105,821.00	0.07
----	--------	-----	-------	------------	------

### 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	7,000	131,530.00	0.09
2	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.08
3	603298	杭叉集团	3,552	86,242.56	0.06
4	601375	中原证券	20,267	81,068.00	0.05
5	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.05
6	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.05
7	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.05
8	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.04
9	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.04
10	603877	太平鸟	2,067	44,027.10	0.03
11	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.03
12	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.02
13	002833	弘亚数控	1,910	33,654.20	0.02
14	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.02
15	603886	元祖股份	903	15,983.10	0.01
16	603239	浙江仙通	502	15,787.90	0.01
17	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.01
18	603035	常熟汽饰	1,489	15,545.16	0.01
19	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.01
20	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.01
21	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.01
22	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.01

23	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	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	002405	四维图新	6,671,512.39	17.13
2	300113	顺网科技	5,597,470.68	14.37
3	000748	长城信息	5,207,213.90	13.37
4	002049	紫光国芯	5,195,089.14	13.34
5	002439	启明星辰	4,708,810.53	12.09
6	000997	新大陆	4,539,246.45	11.65
7	000970	中科三环	4,433,308.00	11.38
8	300115	长盈精密	4,313,441.52	11.07
9	000988	华工科技	4,301,657.00	11.04
10	002179	中航光电	4,094,624.86	10.51
11	002273	水晶光电	4,050,198.55	10.40
12	002410	广联达	3,905,346.07	10.03
13	300296	利亚德	3,904,683.00	10.02
14	002354	天神娱乐	3,809,867.06	9.78
15	300088	长信科技	3,804,279.45	9.77
16	002368	太极股份	3,611,720.46	9.27
17	300182	捷成股份	3,367,782.61	8.65
18	000050	深天马 A	3,319,812.99	8.52
19	002268	卫士通	3,305,108.99	8.48
20	000727	华东科技	3,295,342.00	8.46
21	300324	旋极信息	3,215,007.10	8.25



22	002657	中科金财	3,177,707.30	8.16
23	300287	飞利信	3,167,543.91	8.13
24	000066	长城电脑	3,143,422.51	8.07
25	300274	阳光电源	3,137,048.22	8.05
26	002308	威创股份	3,082,907.93	7.91
27	300010	立思辰	3,076,506.27	7.90
28	002261	拓维信息	2,980,199.21	7.65
29	002373	千方科技	2,831,500.15	7.27
30	002512	达华智能	2,806,381.96	7.20
31	600884	杉杉股份	2,768,895.00	7.11
32	002217	合力泰	2,742,065.20	7.04
33	000021	深科技	2,737,500.99	7.03
34	300166	东方国信	2,637,881.33	6.77
35	002544	杰赛科技	2,565,667.96	6.59
36	002161	远望谷	2,486,166.67	6.38
37	002106	莱宝高科	2,349,605.55	6.03
38	300202	聚龙股份	2,329,229.86	5.98
39	002414	高德红外	2,312,400.10	5.94
40	002063	远光软件	2,237,498.57	5.74
41	002371	七星电子	2,164,140.48	5.56
42	600651	飞乐音响	2,141,903.78	5.50
43	002642	荣之联	2,125,905.67	5.46
44	000636	风华高科	2,106,104.61	5.41
45	002624	完美世界	2,071,234.33	5.32
46	002315	焦点科技	2,048,192.75	5.26
47	300032	金龙机电	2,042,307.48	5.24
48	002056	横店东磁	2,021,532.59	5.19
49	002463	沪电股份	1,984,108.00	5.09

50	002123	梦网荣信	1,919,146.00	4.93
51	601231	环旭电子	1,917,406.53	4.92
52	300297	蓝盾股份	1,770,969.52	4.55
53	002635	安洁科技	1,729,455.20	4.44
54	000049	德赛电池	1,712,685.13	4.40
55	002309	中利科技	1,707,297.00	4.38
56	002093	国脉科技	1,616,315.52	4.15
57	002690	美亚光电	1,609,753.22	4.13
58	603528	多伦科技	1,320,968.00	3.39
59	603019	中科曙光	852,813.00	2.19

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	002049	紫光国芯	5,382,971.14	13.82
2	601012	隆基股份	4,152,345.25	10.66
3	300182	捷成股份	3,663,446.41	9.40
4	300274	阳光电源	3,183,103.36	8.17
5	600478	科力远	2,761,930.89	7.09
6	002512	达华智能	2,558,305.94	6.57
7	600366	宁波韵升	2,373,868.00	6.09
8	600884	杉杉股份	2,338,265.00	6.00
9	002056	横店东磁	2,217,398.56	5.69
10	002354	天神娱乐	2,188,075.04	5.62
11	000049	德赛电池	2,136,895.93	5.49
12	002405	四维图新	1,972,914.00	5.06

13	002624	完美世界	1,959,035.54	5.03
14	603806	福斯特	1,796,436.52	4.61
15	002309	中利科技	1,776,528.16	4.56
16	000988	华工科技	1,688,464.87	4.33
17	002439	启明星辰	1,649,246.00	4.23
18	600537	亿晶光电	1,646,948.15	4.23
19	000997	新大陆	1,564,668.15	4.02
20	002368	太极股份	1,530,130.86	3.93
21	000970	中科三环	1,357,587.27	3.48
22	300113	顺网科技	1,267,788.16	3.25
23	002414	高德红外	1,256,803.40	3.23
24	002315	焦点科技	1,183,875.28	3.04
25	002179	中航光电	1,174,784.56	3.02
26	002308	威创股份	1,158,877.74	2.97
27	000748	长城信息	1,138,089.00	2.92
28	002273	水晶光电	1,121,794.17	2.88
29	300115	长盈精密	1,117,419.14	2.87
30	002410	广联达	1,041,817.00	2.67
31	002174	游族网络	1,033,159.42	2.65
32	002161	远望谷	1,009,408.75	2.59
33	002217	合力泰	931,992.00	2.39
34	002268	卫士通	926,926.00	2.38
35	002106	莱宝高科	899,447.62	2.31
36	002657	中科金财	874,848.00	2.25
37	300253	卫宁健康	867,393.45	2.23
38	000066	长城电脑	859,803.00	2.21
39	002371	七星电子	838,893.70	2.15
40	000636	风华高科	823,085.73	2.11

41	002642	荣之联	801,759.00	2.06
42	000021	深科技	801,202.00	2.06

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	183,600,119.68
卖出股票收入（成交）总额	90,415,914.37

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投资。

#### 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

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	57,876.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	215.36
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	58,091.86

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300088	长信科技	4,002,140.00	2.70	重大事项
2	000748	长城信息	3,850,776.00	2.60	重大事项
3	000050	深天马 A	3,310,438.00	2.23	重大事项

**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	81,068.00	0.05	新股流通受限

## §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

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
583	314, 216. 12	162, 630, 193. 00	88. 78%	20, 557, 807. 00	11. 22%

### 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
中国农业银行股份有限公司—南方中证 500 信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	156, 810, 000. 00	85. 60%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国农业银行股份有限公司—南方中证 500 信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”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	开滦集团财务有限责任公司	5, 000, 000. 00	2. 73%
2	胡孝义	1, 003, 000. 00	0. 55%
3	弓淑华	1, 000, 000. 00	0. 55%
4	方正证券股份有限公司	820, 193. 00	0. 45%
5	刘进华	750, 000. 00	0. 41%
6	王云鹏	700, 000. 00	0. 38%
7	李远兵	517, 100. 00	0. 28%
8	陈燕	337, 400. 00	0. 18%
9	杨俊昇	320, 000. 00	0. 17%

10	樊利谋	300,000.00	0.16%
	中国农业银行股份有限公司—南方中证 500 信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	156,810,000.00	85.60%

#### 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（包含高级管理人员、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。

#### 9.5 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（2015年6月29日）基金份额总额	272,188,000.00
本报告期期初基金份额总额	37,188,000.00
本报告期基金总申购份额	215,500,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	69,500,000.00
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	183,188,000.00

## §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

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。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 55,000.00 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 2 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	
华泰证券	3	234,415,835.53	86.16%	23,443.13	86.16%	-
银河证券	2	26,596,635.07	9.78%	2,659.75	9.77%	-
申万宏源	2	11,071,388.53	4.07%	1,107.13	4.07%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-

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**

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、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；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；

4、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:

1、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;

2、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;

3、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
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	9,000,000.00	100.00%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

## 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	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 12 月 1 日
2	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
3	关于中证 500 信息技术指数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 7 月 30 日
4	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
5	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 4 日
6	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 1 月 27 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	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 5 日
10	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 4 日

11	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 4 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中证 500 信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金的文件。
- 2、中证 500 信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金基金合同。
- 3、中证 500 信息技术指数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>。