

深证成份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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 2016 年 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.....	7
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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	16
4.10 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.....	26
§8 投资组合报告.....	54
8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	54
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.....	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	76
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	78
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.....	79
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.....	79
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.....	79
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.....	79
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	79
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	79
8.12 投资组合报告附注.....	79
§9 基金份额持有人信息.....	81
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	81
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	81
9.3 期末上市基金前十名持有人.....	81
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	82
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.....	82
§10 开放式基金份额变动.....	83
§11 重大事件揭示.....	84
11.1 基金份额持有人大会决议.....	84
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.....	84

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	84
11.4 基金投资策略的改变.....	84
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	84
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.....	85
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	85
11.8 其他重大事件.....	87
备查文件目录.....	88
11.9 备查文件目录.....	88
11.10 存放地点.....	88
11.11 查阅方式.....	88

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	深成 ETF
场内简称	深成 ETF
基金主代码	159903
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 4 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	457,154,507.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 2 月 2 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“深成 ETF”

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金为完全被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p>
业绩比较基准	<p>本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证成份指数。</p> <p>如果指数编制单位变更或停止深证成份指数的编制及发布、或深证成份指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致深证成份指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资</p>

	的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798
注册地址		深圳市福田区福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 55 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 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		张海波	易会满

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-55,815,139.01	934,216,855.43	-37,319,349.33
本期利润	-114,097,089.64	442,160,825.53	585,708,008.88
加权平均基金份额本期利润	-0.2397	0.5086	0.2872
本期加权平均净值利润率	-21.70%	38.56%	34.75%
本期基金份额净值增长率	-18.70%	15.36%	36.99%
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	-123,490,433.87	-9,640,125.50	-575,968,661.13
期末可供分配基金份额利润	-0.2701	-0.0205	-0.3621
期末基金资产净值	496,075,834.91	626,189,343.36	1,840,641,926.17
期末基金份额净值	1.0851	1.3347	1.1570
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	-19.93%	-1.52%	-14.63%

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

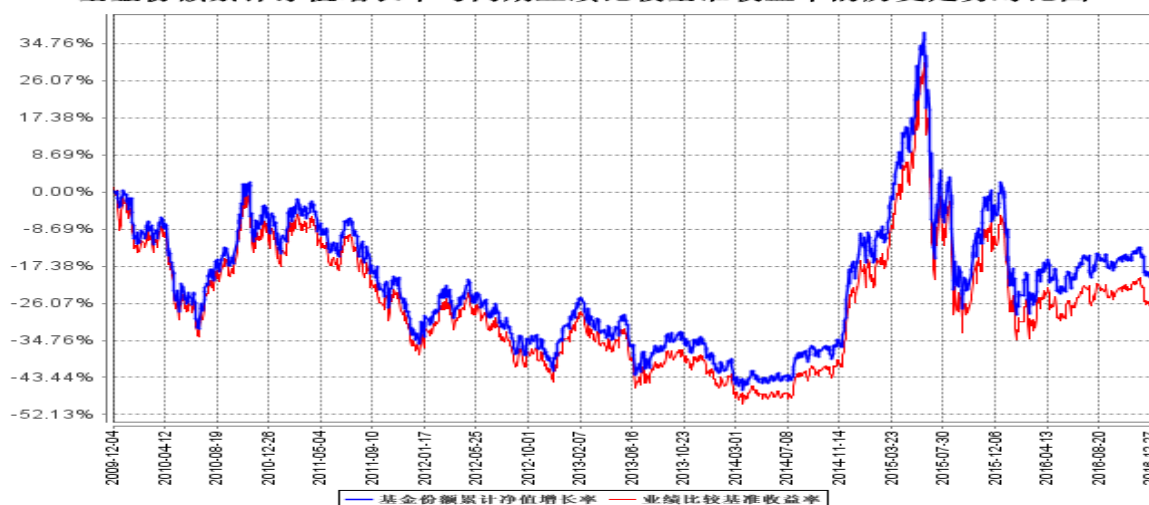
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-3.62%	0.85%	-3.69%	0.85%	0.07%	0.00%
过去六个月	-2.91%	0.93%	-2.98%	0.93%	0.07%	0.00%

过去一年	-18.70%	1.76%	-19.64%	1.80%	0.94%	-0.04%
过去三年	28.48%	1.95%	25.31%	1.99%	3.17%	-0.04%
过去五年	19.73%	1.76%	14.11%	1.79%	5.62%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	-19.93%	1.70%	-26.70%	1.73%	6.77%	-0.03%

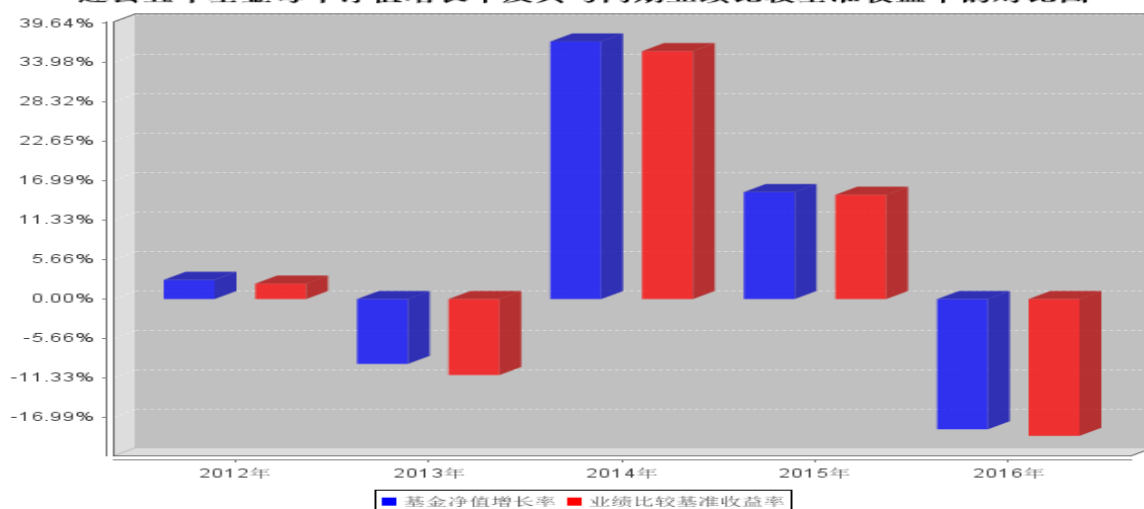
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

南方基金总部设在深圳，注册资本3亿元人民币。股东结构为：华泰证券股份有限公司（45%）；深圳市投资控股有限公司（30%）；厦门国际信托有限公司（15%）；兴业证券股份有限公司（10%）。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——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4月 22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。
孙伟	本基金基金经理	2016年8月	-	6年	管理学学士，具有基金从业资格、金融分

	金经理	19 日			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。
--	-----	------	--	--	--

注: 1. 对基金的首任基金经理, 其“任职日期”为基金合同生效日, “离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期, 对此后的非首任基金经理, “任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金持有人谋求最大利益。本报告期内, 基金运作整体合法合规, 没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定, 针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动, 以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节, 建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则, 投资管理制度和细则, 集中交易管理办法, 公平交易操作指引, 异常交易管理

制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

公司每季度对旗下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

本年度深证成指在1月份大跌25.64%，2月份见全年低点后开始缓步抬升、振幅收窄，并于12月再次出现了快速调整，最终全年收跌19.64%。

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和正偏离分别为 0.69%和 0.94%，理想地完成了投资目标。

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0851 元，报告期内，份额净值增长率为-18.70%，同期业绩基准增长率为-19.64%。

本基金为指数化产品，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，全球流动性拐点出现的趋势越来越明显，各国都面临无风险利率上升的压力，此外，发达国家民粹主义和保守主义普遍抬头。特朗普美国新政府的经济复兴计划有利于我国出口，但贸易保护措施和制造业回流政策又不利于我国长期发展格局，且美国利率的持续回升将给国内利率带来较大压力。另一方面，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，但后市行情能否走好较为依赖投资者风险偏好的提升。

深证成指选取深圳证券市场中市值规模与流动性综合排名前 500 的 A 股组成样本股，随着经济转型不断深化，深证成指中新兴产业的权重在持续提高，凸显了深圳市场以科技、新兴为核心的行业结构特点。投资者可通过本基金或南方深成 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、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。基金管理人根据基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益分配每年最多 12 次，每次基金收益分配比例不低于基金收益分配基准日可供分配利润的 5%。基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；本基金收益分配采取现金分红方式；《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 21503 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	深证成份交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的深证成份交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“深证成份 ETF 基金”)的财务报表，包括 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深证成份 ETF 基金 的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞</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，上述深证成份 ETF 基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了深证成份 ETF 基金 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>
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 03 月 24 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：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	2,147,311.06	11,558,730.82
结算备付金		27,406.12	65,058.20
存出保证金		2,033.39	89,389.80
交易性金融资产	7.4.7.2	494,995,095.82	624,978,907.28
其中：股票投资		494,995,095.82	624,978,907.28
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	352.85	2,399.97
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		497,172,199.24	636,694,486.07
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		320,757.72	9,927,903.35
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		213,273.78	272,948.92
应付托管费		42,654.75	54,589.77
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	35,005.30	9,051.96
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	484,672.78	240,648.71
负债合计		1,096,364.33	10,505,142.71
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	619,566,268.78	635,829,468.86
未分配利润	7.4.7.10	-123,490,433.87	-9,640,125.50
所有者权益合计		496,075,834.91	626,189,343.36
负债和所有者权益总计		497,172,199.24	636,694,486.07

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0851 元，基金份额总额 457,154,507.00 份。

7.2 利润表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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 1 月 1 日至
----	-----	-----------------------	----------------------------

		2016年12月31日	2015年12月31日
一、收入		-110,125,376.67	451,801,123.34
1.利息收入		28,733.44	122,845.89
其中：存款利息收入	7.4.7.11	28,436.02	122,845.89
债券利息收入		72.42	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		225.00	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-51,781,686.02	941,524,073.40
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-57,375,722.54	932,945,506.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	25,566.59	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
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	5,568,469.93	8,578,566.44
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-58,281,950.63	-492,056,029.90
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	-90,473.46	2,210,233.95
减：二、费用		3,971,712.97	9,640,297.81
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,629,978.52	5,774,059.84
2. 托管费	7.4.10.2.2	525,995.64	1,154,812.01
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	175,746.65	1,913,386.39
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	639,992.16	798,039.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-114,097,089.64	442,160,825.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-114,097,089.64	442,160,825.53

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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）	635,829,468.86	-9,640,125.50	626,189,343.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-114,097,089.64	-114,097,089.64
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）	-16,263,200.08	246,781.27	-16,016,418.81
其中：1.基金申购款	130,105,600.85	-27,179,038.26	102,926,562.59
2.基金赎回款	-146,368,800.93	27,425,819.53	-118,942,981.40
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)	619,566,268.78	-123,490,433.87	496,075,834.91
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)	2,156,032,099.57	-315,390,173.40	1,840,641,926.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	442,160,825.53	442,160,825.53
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,520,202,630.71	-136,410,777.63	-1,656,613,408.34
其中：1. 基金申购款	3,033,899,980.41	160,441,746.43	3,194,341,726.84
2. 基金赎回款	-4,554,102,611.12	-296,852,524.06	-4,850,955,135.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	635,829,468.86	-9,640,125.50	626,189,343.36

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.3 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

深证成份交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]1066号《关于核准深证成份交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币4,127,252,482.00元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第263号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2009年12月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,127,538,537.00份基金份额,其中通过代销机构网上现金及直销机构网下现金认购部分的认购资金利息折合286,055.00元份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 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》、《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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、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；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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证

具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

(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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	2,147,311.06	11,558,730.82

定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	2,147,311.06	11,558,730.82

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	591,848,106.79	494,995,095.82	-96,853,010.97
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	591,848,106.79	494,995,095.82	-96,853,010.97
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	663,549,967.62	624,978,907.28	-38,571,060.34
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	663,549,967.62	624,978,907.28	-38,571,060.34

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 2,140.00 元(2015 年 12 月 31 日：无)。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

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	333.54	2,320.66
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	18.41	39.11
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	0.90	40.20
合计	352.85	2,399.97

7.4.7.6 其他资产

注：无。

7.4.7.7 应付交易费用

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
交易所市场应付交易费用	35,005.30	9,051.96
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	35,005.30	9,051.96

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	405,000.00	239,700.71
可退替代款	78,798.06	948.00
应退替代款	874.72	-
合计	484,672.78	240,648.71

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	469,154,507.00	635,829,468.86

本期申购	96,000,000.00	130,105,600.85
本期赎回(以“-”号填列)	-108,000,000.00	-146,368,800.93
本期末	457,154,507.00	619,566,268.78

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	217,278,246.88	-226,918,372.38	-9,640,125.50
本期利润	-55,815,139.01	-58,281,950.63	-114,097,089.64
本期基金份额交易产生的变动数	-3,318,992.07	3,565,773.34	246,781.27
其中：基金申购款	41,359,652.53	-68,538,690.79	-27,179,038.26
基金赎回款	-44,678,644.60	72,104,464.13	27,425,819.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	158,144,115.80	-281,634,549.67	-123,490,433.87

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	26,147.46	98,950.55
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	2,106.36	22,685.04
其他	182.20	1,210.30
合计	28,436.02	122,845.89

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	-28,480,625.14	309,836,092.11
股票投资收益——赎回差价收入	-28,895,097.40	623,109,414.85
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-57,375,722.54	932,945,506.96

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	126,750,220.04	1,339,455,716.30
减：卖出股票成本总额	155,230,845.18	1,029,619,624.19
买卖股票差价收入	-28,480,625.14	309,836,092.11

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1月1日至 2015年12月31日
赎回基金份额对价总额	118,942,981.40	4,850,955,135.18
减：现金支付赎回款总额	2,249,748.40	291,950,734.18

减：赎回股票成本总额	145,588,330.40	3,935,894,986.15
赎回差价收入	-28,895,097.40	623,109,414.85

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	147,839.01	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	122,200.00	-
减：应收利息总额	72.42	-
买卖债券差价收入	25,566.59	-

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 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。

7.4.7.16 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1月1日至2015年 12月31日
股票投资产生的股利收益	5,568,469.93	8,578,566.44

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,568,469.93	8,578,566.44

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1月1日至2015年 12月31日
1. 交易性金融资产	-58,281,950.63	-492,056,029.90
——股票投资	-58,281,950.63	-492,056,029.90
——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	-58,281,950.63	-492,056,029.90

注：本基金本年度公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益为2,140.00元(2015年12月31日：-63,210.00元)。

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1月1日至2015年 12月31日
替代损益收入	-90,473.46	2,209,027.95
其他	-	1,206.00
合计	-90,473.46	2,210,233.95

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。

7.4.7.19 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1月1日至2015年 12月31日
交易所市场交易费用	175,746.65	1,913,386.39
银行间市场交易费用	-	-
合计	175,746.65	1,913,386.39

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1月1日至2015年 12月31日
审计费用	55,000.00	91,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
银行费用	402.00	596.00
指数使用费	224,590.16	346,443.57
合计	639,992.16	798,039.57

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。于2016年3月31日前，标的指数许可使用费的收取下限为年化人民币300,000元；自2016年4月1日起，标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币50,000元。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“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
南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“南方深证成份 ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

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	87,707,375.71	33.79%	2,374,986.00	0.09%

7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	8,769.47	33.79%	8,769.47	25.05%
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	2,101.62	0.55%	-	-

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
当期发生的基金应支付的管理费	2,629,978.52	5,774,059.84
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 X 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	525,995.64	1,154,812.01

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 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基金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
南方深证成份 ETF 联接基金	273,321,432.00	59.7900%	276,321,432.00	58.9000%

注：南方深证成份 ETF 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
中国工商银行	2,147,311.06	26,147.46	11,558,730.82	98,950.55

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

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
300583	赛托生物	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 6 日	新股未上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股未上市	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	新股未上市	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	新股未上市	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	新股未上市	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	新股未上市	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
000166	申万宏源	2016年 12月 21日	重大事项	6.25	2017年 1月26日	6.29	566,869	5,046,901.87	3,542,931.25	-
300104	乐视网	2016年 12月7日	重大事项	35.80	2017年 1月16日	36.88	94,893	4,858,439.10	3,397,169.40	-
000540	中天城投	2016年 11月 28日	重大事项	6.93	2017年 1月3日	7.00	244,600	2,463,081.02	1,695,078.00	-
000887	中鼎股份	2016年 11月 18日	重大事项	25.94	2017年 2月15日	23.99	54,500	1,517,244.20	1,413,730.00	-
000750	国海证券	2016年 12月 15日	重大事项	6.97	2017年 1月20日	6.27	196,150	1,896,286.46	1,367,165.50	-
300088	长信科技	2016年 9月12日	重大事项	15.80	-	-	85,402	1,117,802.04	1,349,351.60	-
000748	长城信息	2016年 11月1日	重大事项	20.31	-	-	62,400	1,859,618.96	1,267,344.00	注1
002400	省广股份	2016年 11月 28日	重大事项	13.79	-	-	85,720	1,646,083.31	1,182,078.80	-
000516	国际医学	2016年 12月5日	重大事项	7.90	-	-	136,700	1,216,540.71	1,079,930.00	-

002129	中环股 份	2016 年 4 月 25 日	重大事项	8.27	-	-	129,420	2,280,813.30	1,070,303.40	-
002075	沙钢股 份	2016 年 9 月 19 日	重大事项	16.12	-	-	65,800	654,139.91	1,060,696.00	-
000547	航天发 展	2016 年 4 月 19 日	重大事项	15.36	2017 年 1 月 3 日	16.90	64,900	1,378,192.55	996,864.00	-
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	52,900	1,116,591.87	995,578.00	-
000697	炼石有 色	2016 年 11 月 17 日	重大事项	23.51	-	-	38,100	748,388.66	895,731.00	-
002491	通鼎互 联	2016 年 12 月 22 日	重大事项	15.54	2017 年 1 月 3 日	15.89	51,600	942,226.26	801,864.00	-
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	237,400	841,824.39	800,038.00	-
002602	世纪华 通	2016 年 12 月 15 日	重大事项	46.89	2017 年 1 月 9 日	50.00	16,500	318,719.70	773,685.00	-
300271	华宇软 件	2016 年 12 月 19 日	重大事项	17.45	-	-	42,040	964,208.16	733,598.00	-
300367	东方网 力	2016 年 12 月 15 日	重大事项	20.04	-	-	36,600	973,372.64	733,464.00	-
000563	陕国投 A	2016 年 10 月	重大事项	7.48	2017 年 1 月 18 日	6.73	91,000	595,125.70	680,680.00	-

		14日								
002440	闰土股份	2016年 10月 21日	重大事项	16.34	2017年 1月12日	15.22	38,604	761,738.20	630,789.36	-
000829	天音控股	2016年 9月29日	重大事项	11.28	-	-	55,100	875,723.20	621,528.00	-
300212	易华录	2016年 11月 30日	重大事项	34.00	-	-	18,100	1,088,406.17	615,400.00	-
300098	高新兴	2016年 11月 17日	重大事项	15.84	2017年 1月23日	14.26	38,800	618,243.64	614,592.00	-
002025	航天电器	2016年 9月12日	重大事项	25.20	-	-	22,490	568,171.28	566,748.00	-
000558	莱茵体育	2016年 10月 17日	重大事项	14.75	-	-	38,100	962,451.39	561,975.00	-
002396	星网锐捷	2016年 9月12日	重大事项	19.70	2017年 2月21日	18.35	27,000	713,009.71	531,900.00	-
300496	中科创达	2016年 10月 11日	重大事项	52.28	2017年 1月6日	47.49	9,054	614,382.25	473,343.12	-
002151	北斗星通	2016年 11月 16日	重大事项	31.90	2017年 1月12日	31.00	14,600	498,644.84	465,740.00	-
300005	探路者	2016年 11月	重大事项	16.69	2017年 2月6日	15.02	27,000	692,544.06	450,630.00	-

		28 日								
002681	奋达科技	2016 年 12 月 19 日	重大事项	12.93	-	-	28,940	457,033.17	374,194.20	-
002071	长城影视	2016 年 6 月 15 日	重大事项	13.64	2017 年 1 月 3 日	15.00	26,200	474,627.91	357,368.00	-
000987	越秀金控	2016 年 8 月 29 日	重大事项	14.49	2017 年 1 月 9 日	15.94	24,400	403,923.10	353,556.00	-
000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大事项	12.50	-	-	25,500	466,489.64	318,750.00	-

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。

7.4.12.4 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪深证成份指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权

重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代,力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会,负责制定风险管理的宏观政策,审议通过风险控制的总体措施等;在管理层层面设立风险控制委员会,讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施;在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估,督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

7.4.12.5 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行,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)

7.4.12.6 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。

7.4.12.7 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。

7.4.12.7.1 利率风险

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

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

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

7.4.12.7.1.1 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	2,147,311.06	-	-	-	2,147,311.06
结算备付金	27,406.12	-	-	-	27,406.12
存出保证金	2,033.39	-	-	-	2,033.39
交易性金融资产	-	-	-	494,995,095.82	494,995,095.82
应收利息	-	-	-	352.85	352.85
资产总计	2,176,750.57	-	-	494,995,448.67	497,172,199.24
负债					
应付证券清算款	-	-	-	320,757.72	320,757.72
应付管理人报酬	-	-	-	213,273.78	213,273.78
应付托管费	-	-	-	42,654.75	42,654.75
应付交易费用	-	-	-	35,005.30	35,005.30
其他负债	-	-	-	484,672.78	484,672.78
负债总计	-	-	-	1,096,364.33	1,096,364.33
利率敏感度缺口	2,176,750.57	-	-	-493,899,084.34	496,075,834.91
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,558,730.82	-	-	-	11,558,730.82
结算备付金	65,058.20	-	-	-	65,058.20
存出保证金	89,389.80	-	-	-	89,389.80
交易性金融资产	-	-	-	-624,978,907.28	624,978,907.28
应收利息	-	-	-	2,399.97	2,399.97
资产总计	11,713,178.82	-	-	-624,981,307.25	636,694,486.07
负债					
应付证券清算款	-	-	-	9,927,903.35	9,927,903.35
应付管理人报酬	-	-	-	272,948.92	272,948.92
应付托管费	-	-	-	54,589.77	54,589.77
应付交易费用	-	-	-	9,051.96	9,051.96

其他负债	-	-	-	240,648.71	240,648.71
负债总计	-	-	-	10,505,142.71	10,505,142.71
利率敏感度缺口	11,713,178.82	-	-	-614,476,164.54	626,189,343.36

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。

7.4.12.7.1.2 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）。

7.4.12.7.2 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。

7.4.12.7.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，深证成份指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%，新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例不高于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.12.7.3.1 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	494,995,095.82	99.78	624,978,907.28	99.81
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	494,995,095.82	99.78	624,978,907.28	99.81

7.4.12.7.3.2 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%	24,370,000.00	30,420,000.00
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-24,370,000.00	-30,420,000.00	

7.4.13 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 102,926,562.59 元(2015 年度: 3,194,341,726.84 元), 其中包括以股票支付的申购款 95,286,658.50 元和以现金支付的申购款 7,639,904.09 元(2015 年度: 其中包括以股票支付的申购款 2,915,271,001.47 元和以现金支付的申购款 279,070,725.37 元)。

(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 462,111,744.24 元，属于第二层次的余额为 32,883,351.58 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 562,481,966.24 元，第二层次 62,496,941.04 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	494,995,095.82	99.56
	其中：股票	494,995,095.82	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	2,174,717.18	0.44
7	其他各项资产	2,386.24	0.00
8	合计	497,172,199.24	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	14,415,699.80	2.91
B	采矿业	7,024,921.40	1.42
C	制造业	287,738,124.90	58.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,930,589.70	1.60

E	建筑业	10,708,475.70	2.16
F	批发和零售业	12,789,507.40	2.58
G	交通运输、仓储和邮政业	1,964,406.00	0.40
H	住宿和餐饮业	0.00	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	59,780,005.50	12.05
J	金融业	34,464,947.50	6.95
K	房地产业	24,874,042.90	5.01
L	租赁和商务服务业	8,065,973.30	1.63
M	科学研究和技术服务业	582,582.00	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	6,652,917.90	1.34
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	-
P	教育	0.00	-
Q	卫生和社会工作	3,637,110.80	0.73
R	文化、体育和娱乐业	12,379,684.10	2.50
S	综合	1,696,409.12	0.34
	合计	494,705,398.02	99.72

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	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	280,740.60	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00

H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,817.20	0.00
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	287,557.80	0.06

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：无。

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	000333	美的集团	376,407	10,603,385.19	2.14
2	000651	格力电器	402,640	9,912,996.80	2.00
3	300498	温氏股份	255,920	9,013,502.40	1.82
4	000002	万科 A	348,958	7,171,086.90	1.45
5	000001	平安银行	713,412	6,492,049.20	1.31
6	000725	京东方 A	2,149,842	6,148,548.12	1.24
7	000858	五粮液	156,341	5,390,637.68	1.09

8	000776	广发证券	255,959	4,315,468.74	0.87
9	002415	海康威视	167,021	3,976,770.01	0.80
10	002450	康得新	202,809	3,875,679.99	0.78
11	002024	苏宁云商	324,551	3,716,108.95	0.75
12	000166	申万宏源	566,869	3,542,931.25	0.71
13	300104	乐视网	94,893	3,397,169.40	0.68
14	002304	洋河股份	46,661	3,294,266.60	0.66
15	000063	中兴通讯	198,733	3,169,791.35	0.64
16	300059	东方财富	182,772	3,094,329.96	0.62
17	000783	长江证券	300,119	3,070,217.37	0.62
18	000538	云南白药	37,886	2,885,018.90	0.58
19	002673	西部证券	130,840	2,717,546.80	0.55
20	001979	招商蛇口	165,627	2,714,626.53	0.55
21	000625	长安汽车	181,698	2,714,568.12	0.55
22	000413	东旭光电	237,100	2,669,746.00	0.54
23	000503	海虹控股	60,950	2,562,947.50	0.52
24	002142	宁波银行	149,625	2,489,760.00	0.50
25	002736	国信证券	154,500	2,402,475.00	0.48
26	002202	金风科技	140,036	2,396,015.96	0.48
27	000768	中航飞机	112,290	2,387,285.40	0.48
28	000423	东阿阿胶	44,271	2,384,878.77	0.48
29	300070	碧水源	133,026	2,330,615.52	0.47
30	002594	比亚迪	46,836	2,326,812.48	0.47
31	000100	TCL 集团	693,671	2,289,114.30	0.46
32	300017	网宿科技	42,242	2,264,593.62	0.46
33	300072	三聚环保	48,764	2,257,285.56	0.46
34	300024	机器人	104,890	2,242,548.20	0.45
35	002456	欧菲光	65,001	2,228,234.28	0.45

36	002230	科大讯飞	80,780	2,188,330.20	0.44
37	000839	中信国安	228,550	2,098,089.00	0.42
38	000728	国元证券	104,964	2,088,783.60	0.42
39	002739	万达院线	38,100	2,060,067.00	0.42
40	000338	潍柴动力	202,404	2,015,943.84	0.41
41	000568	泸州老窖	60,092	1,983,036.00	0.40
42	002241	歌尔股份	74,105	1,965,264.60	0.40
43	000069	华侨城 A	273,149	1,898,385.55	0.38
44	002065	东华软件	80,200	1,868,660.00	0.38
45	000157	中联重科	403,127	1,830,196.58	0.37
46	300124	汇川技术	88,194	1,792,984.02	0.36
47	000623	吉林敖东	57,729	1,789,021.71	0.36
48	000793	华闻传媒	157,600	1,779,304.00	0.36
49	002466	天齐锂业	54,280	1,761,386.00	0.36
50	002252	上海莱士	75,780	1,749,760.20	0.35
51	000895	双汇发展	82,724	1,731,413.32	0.35
52	002236	大华股份	125,378	1,715,171.04	0.35
53	300136	信维通信	59,760	1,703,160.00	0.34
54	000540	中天城投	244,600	1,695,078.00	0.34
55	000009	中国宝安	163,464	1,693,487.04	0.34
56	002007	华兰生物	46,900	1,676,675.00	0.34
57	300315	掌趣科技	181,200	1,674,288.00	0.34
58	000630	铜陵有色	541,800	1,668,744.00	0.34
59	002008	大族激光	72,900	1,647,540.00	0.33
60	002475	立讯精密	76,145	1,580,008.75	0.32
61	002465	海格通信	135,500	1,578,575.00	0.32
62	000686	东北证券	126,000	1,557,360.00	0.31
63	300027	华谊兄弟	137,175	1,508,925.00	0.30

64	000060	中金岭南	134,030	1,494,434.50	0.30
65	000826	启迪桑德	44,507	1,467,840.86	0.30
66	300408	三环集团	91,700	1,456,196.00	0.29
67	000917	电广传媒	99,200	1,427,488.00	0.29
68	000887	中鼎股份	54,500	1,413,730.00	0.29
69	000876	新希望	175,552	1,413,193.60	0.28
70	000661	长春高新	12,400	1,386,940.00	0.28
71	000656	金科股份	263,100	1,378,644.00	0.28
72	002405	四维图新	71,231	1,378,319.85	0.28
73	000559	万向钱潮	103,800	1,376,388.00	0.28
74	002085	万丰奥威	69,540	1,374,110.40	0.28
75	000963	华东医药	18,982	1,368,032.74	0.28
76	000750	国海证券	196,150	1,367,165.50	0.28
77	002310	东方园林	96,550	1,366,182.50	0.28
78	002183	怡亚通	124,740	1,354,676.40	0.27
79	300088	长信科技	85,402	1,349,351.60	0.27
80	300003	乐普医疗	74,200	1,330,406.00	0.27
81	002500	山西证券	109,000	1,310,180.00	0.26
82	002426	胜利精密	157,100	1,299,217.00	0.26
83	002385	大北农	182,850	1,298,235.00	0.26
84	002407	多氟多	47,200	1,288,088.00	0.26
85	002044	美年健康	96,700	1,274,506.00	0.26
86	000425	徐工机械	376,008	1,270,907.04	0.26
87	000748	长城信息	62,400	1,267,344.00	0.26
88	000709	河钢股份	377,000	1,259,180.00	0.25
89	300168	万达信息	61,546	1,244,460.12	0.25
90	002340	格林美	188,200	1,232,710.00	0.25
91	002074	国轩高科	39,600	1,227,204.00	0.25

92	000998	隆平高科	56,800	1,217,224.00	0.25
93	002572	索菲亚	22,332	1,209,501.12	0.24
94	300156	神雾环保	47,983	1,200,054.83	0.24
95	300058	蓝色光标	116,334	1,183,116.78	0.24
96	002400	省广股份	85,720	1,182,078.80	0.24
97	002366	台海核电	21,530	1,154,438.60	0.23
98	300115	长盈精密	44,140	1,150,288.40	0.23
99	300033	同花顺	16,700	1,148,626.00	0.23
100	002460	赣锋锂业	43,000	1,139,930.00	0.23
101	000983	西山煤电	134,700	1,139,562.00	0.23
102	002508	老板电器	30,800	1,133,440.00	0.23
103	300266	兴源环境	20,650	1,133,272.00	0.23
104	002081	金螳螂	115,326	1,129,041.54	0.23
105	000997	新大陆	57,680	1,120,722.40	0.23
106	000402	金融街	108,663	1,119,228.90	0.23
107	002092	中泰化学	92,300	1,116,830.00	0.23
108	002027	分众传媒	77,800	1,110,206.00	0.22
109	300144	宋城演艺	52,970	1,109,191.80	0.22
110	000977	浪潮信息	51,700	1,096,040.00	0.22
111	300296	利亚德	32,400	1,092,528.00	0.22
112	000415	渤海金控	152,760	1,092,234.00	0.22
113	000581	威孚高科	48,451	1,087,240.44	0.22
114	000516	国际医学	136,700	1,079,930.00	0.22
115	002129	中环股份	129,420	1,070,303.40	0.22
116	002049	紫光国芯	32,313	1,064,390.22	0.21
117	002075	沙钢股份	65,800	1,060,696.00	0.21
118	002168	深圳惠程	66,800	1,059,448.00	0.21
119	000690	宝新能源	112,100	1,039,167.00	0.21

120	002176	江特电机	86,400	1,030,752.00	0.21
121	000970	中科三环	76,700	1,023,945.00	0.21
122	000930	中粮生化	76,100	1,022,784.00	0.21
123	002131	利欧股份	63,800	1,017,610.00	0.21
124	000039	中集集团	69,500	1,016,090.00	0.20
125	000792	盐湖股份	53,223	1,014,962.61	0.20
126	002030	达安基因	43,602	1,011,566.40	0.20
127	000400	许继电气	55,500	1,007,325.00	0.20
128	000547	航天发展	64,900	996,864.00	0.20
129	000050	深天马 A	52,900	995,578.00	0.20
130	002470	金正大	125,500	991,450.00	0.20
131	002292	奥飞娱乐	43,600	989,720.00	0.20
132	000712	锦龙股份	42,000	984,480.00	0.20
133	002701	奥瑞金	113,300	978,912.00	0.20
134	000738	中航动控	39,550	978,467.00	0.20
135	000778	新兴铸管	186,532	964,370.44	0.19
136	002271	东方雨虹	44,300	960,867.00	0.19
137	002038	双鹭药业	35,900	958,889.00	0.19
138	002004	华邦健康	105,700	958,699.00	0.19
139	300253	卫宁健康	48,840	956,775.60	0.19
140	002573	清新环境	54,600	953,862.00	0.19
141	002422	科伦药业	58,778	947,501.36	0.19
142	002439	启明星辰	45,400	943,866.00	0.19
143	000939	凯迪生态	73,300	943,371.00	0.19
144	000598	兴蓉环境	162,100	933,696.00	0.19
145	002343	慈文传媒	20,600	930,502.00	0.19
146	000059	华锦股份	78,100	929,390.00	0.19
147	000008	神州高铁	99,700	929,204.00	0.19

148	002179	中航光电	25,477	924,560.33	0.19
149	000046	泛海控股	99,512	924,466.48	0.19
150	002013	中航机电	50,335	920,627.15	0.19
151	300159	新研股份	67,700	919,366.00	0.19
152	000566	海南海药	71,700	911,307.00	0.18
153	300142	沃森生物	83,500	910,150.00	0.18
154	002250	联化科技	56,100	907,698.00	0.18
155	002195	二三四五	79,300	897,676.00	0.18
156	000960	锡业股份	68,400	897,408.00	0.18
157	000697	炼石有色	38,100	895,731.00	0.18
158	002273	水晶光电	44,800	891,520.00	0.18
159	000988	华工科技	56,300	881,095.00	0.18
160	002353	杰瑞股份	43,287	878,726.10	0.18
161	002221	东华能源	70,700	875,973.00	0.18
162	000961	中南建设	84,200	875,680.00	0.18
163	000758	中色股份	109,160	872,188.40	0.18
164	000592	平潭发展	129,000	872,040.00	0.18
165	002311	海大集团	57,940	871,997.00	0.18
166	002185	华天科技	72,070	870,605.60	0.18
167	300015	爱尔眼科	28,692	857,890.80	0.17
168	002665	首航节能	97,690	855,764.40	0.17
169	300134	大富科技	33,669	853,845.84	0.17
170	000878	云南铜业	72,196	852,634.76	0.17
171	000806	银河生物	53,800	852,192.00	0.17
172	002018	华信国际	83,790	852,144.30	0.17
173	300244	迪安诊断	26,596	851,072.00	0.17
174	000012	南玻 A	74,800	848,232.00	0.17
175	300113	顺网科技	31,382	843,861.98	0.17

176	002001	新和成	43,030	843,388.00	0.17
177	300055	万邦达	51,300	840,294.00	0.17
178	002294	信立泰	28,600	836,264.00	0.17
179	300418	昆仑万维	38,700	835,920.00	0.17
180	002223	鱼跃医疗	26,900	834,438.00	0.17
181	300431	暴风集团	18,100	832,600.00	0.17
182	300090	盛运环保	71,708	831,812.80	0.17
183	300002	神州泰岳	89,984	831,452.16	0.17
184	000031	中粮地产	92,341	823,681.72	0.17
185	300383	光环新网	33,000	823,680.00	0.17
186	000999	华润三九	33,300	823,509.00	0.17
187	000078	海王生物	130,550	822,465.00	0.17
188	300077	国民技术	50,400	819,000.00	0.17
189	000671	阳光城	146,990	818,734.30	0.17
190	000718	苏宁环球	94,396	814,637.48	0.16
191	002051	中工国际	35,240	807,700.80	0.16
192	002138	顺络电子	46,600	806,646.00	0.16
193	002152	广电运通	60,600	804,768.00	0.16
194	002146	荣盛发展	102,500	804,625.00	0.16
195	002491	通鼎互联	51,600	801,864.00	0.16
196	000727	华东科技	237,400	800,038.00	0.16
197	000732	泰禾集团	45,200	799,588.00	0.16
198	002191	劲嘉股份	76,775	799,227.75	0.16
199	002544	杰赛科技	28,400	799,176.00	0.16
200	300203	聚光科技	26,000	794,300.00	0.16
201	300324	旋极信息	41,000	792,530.00	0.16
202	000883	湖北能源	173,000	792,340.00	0.16
203	300251	光线传媒	81,020	790,755.20	0.16

204	002410	广联达	54,119	790,137.40	0.16
205	000488	晨鸣纸业	76,100	788,396.00	0.16
206	002299	圣农发展	37,100	787,262.00	0.16
207	000061	农产品	63,500	785,495.00	0.16
208	000006	深振业 A	83,100	785,295.00	0.16
209	000800	一汽轿车	71,700	779,379.00	0.16
210	000729	燕京啤酒	111,500	774,925.00	0.16
211	300079	数码视讯	108,200	774,712.00	0.16
212	002602	世纪华通	16,500	773,685.00	0.16
213	002048	宁波华翔	34,900	772,686.00	0.16
214	000825	太钢不锈	194,900	767,906.00	0.15
215	002501	利源精制	62,305	764,482.35	0.15
216	002276	万马股份	50,800	763,524.00	0.15
217	000028	国药一致	11,400	762,660.00	0.15
218	300197	铁汉生态	59,954	760,216.72	0.15
219	300216	千山药机	22,400	760,032.00	0.15
220	300267	尔康制药	58,100	758,205.00	0.15
221	300146	汤臣倍健	63,500	758,190.00	0.15
222	300273	和佳股份	44,330	756,269.80	0.15
223	002050	三花智控	68,400	755,136.00	0.15
224	000518	四环生物	84,900	753,912.00	0.15
225	000156	华数传媒	42,000	752,220.00	0.15
226	000519	江南红箭	50,399	750,945.10	0.15
227	000786	北新建材	72,600	747,054.00	0.15
228	000979	中弘股份	282,840	746,697.60	0.15
229	300287	飞利信	62,700	746,130.00	0.15
230	002023	海特高新	53,800	744,592.00	0.15
231	002019	亿帆医药	48,600	743,094.00	0.15

232	300026	红日药业	136,800	742,824.00	0.15
233	002108	沧州明珠	36,450	742,486.50	0.15
234	002583	海能达	56,120	741,345.20	0.15
235	002104	恒宝股份	62,600	738,054.00	0.15
236	000627	天茂集团	96,200	735,930.00	0.15
237	002477	雏鹰农牧	146,500	735,430.00	0.15
238	000860	顺鑫农业	33,400	734,800.00	0.15
239	002266	浙富控股	127,430	733,996.80	0.15
240	300271	华宇软件	42,040	733,598.00	0.15
241	300367	东方网力	36,600	733,464.00	0.15
242	000938	紫光股份	12,700	728,853.00	0.15
243	300068	南都电源	37,610	724,744.70	0.15
244	300182	捷成股份	69,659	718,184.29	0.14
245	002373	千方科技	51,900	716,220.00	0.14
246	002424	贵州百灵	37,600	712,144.00	0.14
247	002022	科华生物	35,601	712,020.00	0.14
248	000513	丽珠集团	11,960	711,620.00	0.14
249	300199	翰宇药业	39,572	711,504.56	0.14
250	002797	第一创业	20,400	709,920.00	0.14
251	002281	光迅科技	9,000	706,500.00	0.14
252	000543	皖能电力	92,570	704,457.70	0.14
253	002368	太极股份	23,000	704,030.00	0.14
254	002280	联络互动	50,375	703,738.75	0.14
255	300207	欣旺达	50,500	701,950.00	0.14
256	002155	湖南黄金	61,100	699,595.00	0.14
257	000066	长城电脑	56,100	697,884.00	0.14
258	002153	石基信息	28,585	696,616.45	0.14
259	002384	东山精密	35,500	696,155.00	0.14

260	002078	太阳纸业	103,900	694,052.00	0.14
261	002123	梦网荣信	45,901	688,515.00	0.14
262	000027	深圳能源	100,000	687,000.00	0.14
263	002522	浙江众成	38,100	685,419.00	0.14
264	300291	华录百纳	30,753	685,176.84	0.14
265	000975	银泰资源	43,800	685,032.00	0.14
266	300020	银江股份	43,200	681,696.00	0.14
267	000563	陕国投 A	91,000	680,680.00	0.14
268	002390	信邦制药	68,650	678,948.50	0.14
269	000601	韶能股份	78,800	676,892.00	0.14
270	300133	华策影视	59,078	670,535.30	0.14
271	002714	牧原股份	28,800	670,464.00	0.14
272	000882	华联股份	146,700	670,419.00	0.14
273	000667	美好置业	181,500	669,735.00	0.14
274	002657	中科金财	15,500	668,980.00	0.13
275	002217	合力泰	37,300	667,670.00	0.13
276	002489	浙江永强	88,000	666,160.00	0.13
277	300352	北信源	34,260	664,986.60	0.13
278	000089	深圳机场	82,800	662,400.00	0.13
279	002444	巨星科技	42,400	661,440.00	0.13
280	002268	卫士通	21,000	659,820.00	0.13
281	300170	汉得信息	55,850	659,588.50	0.13
282	300166	东方国信	31,678	658,585.62	0.13
283	002640	跨境通	35,800	655,140.00	0.13
284	300347	泰格医药	24,200	653,642.00	0.13
285	300122	智飞生物	39,600	652,212.00	0.13
286	002052	同洲电子	58,134	651,100.80	0.13
287	002036	联创电子	33,900	649,524.00	0.13

288	000875	吉电股份	98,700	648,459.00	0.13
289	002630	华西能源	52,500	647,325.00	0.13
290	300274	阳光电源	61,235	645,416.90	0.13
291	000901	航天科技	19,500	640,770.00	0.13
292	300001	特锐德	36,600	634,644.00	0.13
293	300118	东方日升	38,400	630,912.00	0.13
294	002440	闰土股份	38,604	630,789.36	0.13
295	002431	棕榈股份	68,650	628,834.00	0.13
296	002073	软控股份	55,300	627,655.00	0.13
297	300185	通裕重工	202,900	626,961.00	0.13
298	000926	福星股份	49,200	626,808.00	0.13
299	000021	深科技	66,300	625,209.00	0.13
300	002375	亚厦股份	59,050	624,749.00	0.13
301	002421	达实智能	94,700	623,126.00	0.13
302	002716	金贵银业	26,900	622,466.00	0.13
303	000829	天音控股	55,100	621,528.00	0.13
304	300010	立思辰	37,300	619,926.00	0.13
305	002589	瑞康医药	19,100	619,795.00	0.12
306	002672	东江环保	35,200	619,520.00	0.12
307	000937	冀中能源	91,800	618,732.00	0.12
308	300212	易华录	18,100	615,400.00	0.12
309	300098	高新兴	38,800	614,592.00	0.12
310	002411	必康股份	22,700	614,035.00	0.12
311	000685	中山公用	54,740	609,256.20	0.12
312	000902	新洋丰	54,102	609,188.52	0.12
313	300078	思创医惠	23,500	608,885.00	0.12
314	000848	承德露露	54,365	608,344.35	0.12
315	002326	永太科技	37,200	606,732.00	0.12

316	000807	云铝股份	90,500	606,350.00	0.12
317	002244	滨江集团	86,800	605,864.00	0.12
318	002002	鸿达兴业	82,457	605,234.38	0.12
319	000898	鞍钢股份	120,053	605,067.12	0.12
320	000766	通化金马	34,371	603,554.76	0.12
321	300458	全志科技	6,600	603,438.00	0.12
322	002041	登海种业	31,950	603,216.00	0.12
323	002570	贝因美	45,900	602,208.00	0.12
324	000762	西藏矿业	35,300	601,159.00	0.12
325	001696	宗申动力	63,900	600,660.00	0.12
326	002624	完美世界	20,100	598,779.00	0.12
327	002481	双塔食品	66,000	598,620.00	0.12
328	002261	拓维信息	49,900	594,808.00	0.12
329	002329	皇氏集团	41,900	591,628.00	0.12
330	002303	美盈森	57,300	589,044.00	0.12
331	002603	以岭药业	34,100	587,884.00	0.12
332	300014	亿纬锂能	20,100	586,920.00	0.12
333	000687	华讯方舟	38,200	586,752.00	0.12
334	000777	中核科技	26,200	586,356.00	0.12
335	002047	宝鹰股份	62,700	586,245.00	0.12
336	300101	振芯科技	31,500	584,010.00	0.12
337	300238	冠昊生物	17,500	583,625.00	0.12
338	002224	三力士	38,800	583,552.00	0.12
339	000620	新华联	68,700	582,576.00	0.12
340	002643	万润股份	16,000	580,800.00	0.12
341	300012	华测检测	50,200	579,810.00	0.12
342	000034	神州数码	25,885	577,753.20	0.12
343	000751	锌业股份	101,020	574,803.80	0.12

344	002067	景兴纸业	85,830	573,344.40	0.12
345	002089	新海宜	40,400	573,276.00	0.12
346	300053	欧比特	40,250	570,342.50	0.12
347	002308	威创股份	38,619	569,244.06	0.11
348	002668	奥马电器	8,000	567,600.00	0.11
349	002025	航天电器	22,490	566,748.00	0.11
350	002437	誉衡药业	68,200	564,014.00	0.11
351	002325	洪涛股份	70,300	563,103.00	0.11
352	000558	莱茵体育	38,100	561,975.00	0.11
353	002429	兆驰股份	56,400	561,744.00	0.11
354	002709	天赐材料	13,300	560,861.00	0.11
355	002285	世联行	73,270	556,852.00	0.11
356	002099	海翔药业	65,400	554,592.00	0.11
357	300009	安科生物	25,900	552,188.00	0.11
358	002161	远望谷	47,752	550,580.56	0.11
359	000587	金洲慈航	36,800	547,584.00	0.11
360	002595	豪迈科技	25,900	545,195.00	0.11
361	002399	海普瑞	29,920	545,142.40	0.11
362	002130	沃尔核材	38,100	537,972.00	0.11
363	002428	云南锗业	42,200	534,674.00	0.11
364	000801	四川九洲	50,238	534,029.94	0.11
365	000650	仁和药业	75,539	532,549.95	0.11
366	002396	星网锐捷	27,000	531,900.00	0.11
367	300202	聚龙股份	21,600	531,360.00	0.11
368	002237	恒邦股份	46,100	530,150.00	0.11
369	300433	蓝思科技	19,200	530,112.00	0.11
370	300294	博雅生物	9,400	529,690.00	0.11
371	002055	得润电子	22,300	528,733.00	0.11

372	002106	莱宝高科	47,000	528,280.00	0.11
373	002610	爱康科技	161,200	527,124.00	0.11
374	000957	中通客车	33,100	525,297.00	0.11
375	300147	香雪制药	40,640	524,256.00	0.11
376	300096	易联众	33,600	523,824.00	0.11
377	300377	赢时胜	13,919	519,596.27	0.10
378	300257	开山股份	30,200	518,232.00	0.10
379	002174	游族网络	19,585	518,023.25	0.10
380	002474	榕基软件	38,200	517,992.00	0.10
381	002145	中核钛白	84,500	517,985.00	0.10
382	002063	远光软件	39,417	517,939.38	0.10
383	002358	森源电气	27,000	517,860.00	0.10
384	002467	二六三	48,800	513,376.00	0.10
385	002505	大康农业	144,910	512,981.40	0.10
386	002642	荣之联	25,500	512,550.00	0.10
387	300085	银之杰	24,370	509,333.00	0.10
388	000959	首钢股份	76,900	509,078.00	0.10
389	000541	佛山照明	51,680	508,531.20	0.10
390	002043	兔宝宝	43,900	507,923.00	0.10
391	300292	吴通控股	58,100	507,213.00	0.10
392	002517	恺英网络	15,100	506,756.00	0.10
393	002005	德豪润达	88,100	506,575.00	0.10
394	002284	亚太股份	36,000	506,520.00	0.10
395	000851	高鸿股份	43,400	506,044.00	0.10
396	002512	达华智能	30,900	504,597.00	0.10
397	002663	普邦股份	83,000	503,810.00	0.10
398	000973	佛塑科技	67,100	503,250.00	0.10
399	000969	安泰科技	47,700	502,758.00	0.10

400	000733	振华科技	28,100	501,585.00	0.10
401	300011	鼎汉技术	24,200	501,424.00	0.10
402	002031	巨轮智能	146,800	500,588.00	0.10
403	300359	全通教育	25,100	496,729.00	0.10
404	002143	印纪传媒	15,400	496,034.00	0.10
405	002190	成飞集成	15,400	492,492.00	0.10
406	300364	中文在线	12,400	490,048.00	0.10
407	000158	常山股份	39,100	488,750.00	0.10
408	000600	建投能源	54,900	487,512.00	0.10
409	300355	蒙草生态	48,500	486,455.00	0.10
410	002555	三七互娱	29,600	485,440.00	0.10
411	002463	沪电股份	101,400	484,692.00	0.10
412	002550	千红制药	67,100	484,462.00	0.10
413	002249	大洋电机	55,934	482,710.42	0.10
414	002010	传化智联	25,600	481,280.00	0.10
415	002588	史丹利	42,300	480,105.00	0.10
416	300043	星辉娱乐	47,200	478,608.00	0.10
417	002121	科陆电子	53,950	475,839.00	0.10
418	002695	煌上煌	16,800	475,608.00	0.10
419	300496	中科创达	9,054	473,343.12	0.10
420	002056	横店东磁	34,000	472,940.00	0.10
421	002245	澳洋顺昌	52,800	470,976.00	0.09
422	300036	超图软件	26,900	468,060.00	0.09
423	002563	森马服饰	45,500	467,285.00	0.09
424	002318	久立特材	46,600	466,000.00	0.09
425	002151	北斗星通	14,600	465,740.00	0.09
426	002482	广田集团	49,850	461,112.50	0.09
427	300073	当升科技	10,600	456,542.00	0.09

428	300336	新文化	23,180	455,487.00	0.09
429	002413	雷科防务	39,200	453,936.00	0.09
430	002471	中超控股	74,800	453,288.00	0.09
431	002128	露天煤业	52,700	453,220.00	0.09
432	002180	艾派克	16,100	452,732.00	0.09
433	300228	富瑞特装	35,260	450,975.40	0.09
434	300005	探路者	27,000	450,630.00	0.09
435	002498	汉缆股份	104,100	447,630.00	0.09
436	000090	天健集团	46,160	445,905.60	0.09
437	000049	德赛电池	10,600	445,730.00	0.09
438	002157	正邦科技	66,500	442,890.00	0.09
439	002690	美亚光电	20,835	440,868.60	0.09
440	002699	美盛文化	13,000	439,400.00	0.09
441	000062	深圳华强	15,408	437,741.28	0.09
442	300032	金龙机电	27,000	434,430.00	0.09
443	300221	银禧科技	22,000	434,280.00	0.09
444	002600	江粉磁材	42,400	434,176.00	0.09
445	002488	金固股份	26,000	431,600.00	0.09
446	002625	龙生股份	11,500	430,790.00	0.09
447	000555	神州信息	20,200	428,846.00	0.09
448	300413	快乐购	18,600	427,428.00	0.09
449	000088	盐田港	59,400	423,522.00	0.09
450	300310	宜通世纪	17,400	423,516.00	0.09
451	300222	科大智能	21,100	422,000.00	0.09
452	300116	坚瑞沃能	23,300	421,730.00	0.09
453	300188	美亚柏科	19,600	419,244.00	0.08
454	300178	腾邦国际	25,800	416,412.00	0.08
455	000426	兴业矿业	47,100	410,712.00	0.08

456	300226	上海钢联	10,100	408,242.00	0.08
457	000099	中信海直	34,800	407,508.00	0.08
458	300075	数字政通	21,800	406,352.00	0.08
459	000539	粤电力 A	76,340	406,128.80	0.08
460	002371	七星电子	15,200	404,320.00	0.08
461	300339	润和软件	13,200	403,920.00	0.08
462	002095	生意宝	10,060	402,802.40	0.08
463	002229	鸿博股份	17,000	400,180.00	0.08
464	300037	新宙邦	8,100	399,330.00	0.08
465	002298	中电鑫龙	28,900	399,109.00	0.08
466	002416	爱施德	26,800	394,764.00	0.08
467	300083	劲胜精密	53,500	393,225.00	0.08
468	002414	高德红外	17,200	391,816.00	0.08
469	002631	德尔未来	21,000	389,970.00	0.08
470	002197	证通电子	23,900	389,809.00	0.08
471	002242	九阳股份	21,300	384,039.00	0.08
472	002445	中南文化	25,500	382,755.00	0.08
473	002721	金一文化	22,700	378,636.00	0.08
474	002681	奋达科技	28,940	374,194.20	0.08
475	300369	绿盟科技	10,900	370,273.00	0.07
476	002773	康弘药业	6,500	369,135.00	0.07
477	000869	张裕 A	10,200	367,200.00	0.07
478	002071	长城影视	26,200	357,368.00	0.07
479	000987	越秀金控	24,400	353,556.00	0.07
480	000681	视觉中国	18,400	350,704.00	0.07
481	000810	创维数字	24,600	346,122.00	0.07
482	300506	名家汇	7,000	338,170.00	0.07
483	002751	易尚展示	7,200	334,368.00	0.07

484	300386	飞天诚信	13,200	334,092.00	0.07
485	300474	景嘉微	6,200	333,994.00	0.07
486	300191	潜能恒信	9,600	330,240.00	0.07
487	002493	荣盛石化	21,200	326,904.00	0.07
488	002568	百润股份	16,000	323,840.00	0.07
489	000693	ST 华泽	25,500	318,750.00	0.06
490	300368	汇金股份	14,500	316,390.00	0.06
491	300432	富临精工	12,900	314,760.00	0.06
492	002432	九安医疗	19,900	309,047.00	0.06
493	002619	巨龙管业	17,400	301,890.00	0.06
494	002577	雷柏科技	9,840	298,545.60	0.06
495	000795	英洛华	46,200	292,446.00	0.06
496	002717	岭南园林	11,200	290,976.00	0.06
497	300516	久之洋	2,800	272,328.00	0.05
498	002782	可立克	9,900	270,369.00	0.05
499	002653	海思科	15,209	237,716.67	0.05
500	002703	浙江世宝	7,400	228,068.00	0.05
501	300512	中亚股份	6,300	209,979.00	0.04
502	002312	三泰控股	513	4,488.75	0.00
503	000816	智慧农业	700	4,452.00	0.00
504	000666	经纬纺机	200	4,274.00	0.00
505	000410	沈阳机床	300	4,008.00	0.00
506	002649	博彦科技	100	3,890.00	0.00
507	002339	积成电子	200	3,808.00	0.00
508	002376	新北洋	300	3,720.00	0.00
509	000528	柳工	500	3,655.00	0.00
510	000735	罗牛山	500	3,580.00	0.00
511	000401	冀东水泥	300	3,570.00	0.00

512	002269	美邦服饰	700	3,507.00	0.00
513	002028	思源电气	260	3,426.80	0.00
514	000897	津滨发展	800	3,424.00	0.00
515	002344	海宁皮城	300	3,396.00	0.00
516	000830	鲁西化工	600	3,354.00	0.00
517	002215	诺普信	300	3,324.00	0.00
518	002093	国脉科技	300	3,321.00	0.00
519	000652	泰达股份	600	3,312.00	0.00
520	002154	报喜鸟	600	3,252.00	0.00
521	300039	上海凯宝	300	3,069.00	0.00
522	002177	御银股份	400	3,064.00	0.00
523	002029	七匹狼	300	3,063.00	0.00
524	000861	海印股份	620	3,007.00	0.00
525	000931	中关村	345	2,922.15	0.00
526	300295	三六五网	100	2,889.00	0.00
527	002011	盾安环境	300	2,856.00	0.00
528	002433	太安堂	260	2,818.40	0.00
529	002170	芭田股份	300	2,787.00	0.00
530	002178	延华智能	300	2,772.00	0.00
531	300288	朗玛信息	99	2,707.65	0.00
532	002556	辉隆股份	250	2,597.50	0.00
533	300171	东富龙	166	2,471.74	0.00
534	000996	中国中期	100	2,420.00	0.00
535	300052	中青宝	100	2,390.00	0.00
536	000767	漳泽电力	600	2,310.00	0.00
537	300152	科融环境	300	2,214.00	0.00
538	002698	博实股份	140	2,179.80	0.00
539	002527	新时达	150	2,011.50	0.00

540	002741	光华科技	100	1,952.00	0.00
541	002658	雪迪龙	100	1,720.00	0.00
542	300333	兆日科技	100	1,697.00	0.00
543	300229	拓尔思	100	1,651.00	0.00
544	002181	粤传媒	200	1,576.00	0.00
545	300074	华平股份	160	1,472.00	0.00
546	300205	天喻信息	100	1,434.00	0.00
547	002551	尚荣医疗	36	716.76	0.00

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	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.01
2	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.01
3	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.01
4	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.01
5	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
6	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
7	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
8	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
9	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
10	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	300498	温氏股份	8,290,733.78	1.32
2	002739	万达院线	2,623,340.64	0.42
3	000333	美的集团	2,326,282.68	0.37
4	002460	赣锋锂业	1,578,490.00	0.25
5	300431	暴风集团	1,404,080.00	0.22
6	002368	太极股份	1,384,543.00	0.22
7	002572	索菲亚	1,310,703.88	0.21
8	300383	光环新网	1,288,398.90	0.21
9	002027	分众传媒	1,269,802.00	0.20
10	002044	美年健康	1,263,086.71	0.20
11	300418	昆仑万维	1,244,529.52	0.20
12	002673	西部证券	1,162,242.00	0.19
13	300296	利亚德	1,097,799.00	0.18
14	002343	慈文传媒	1,038,512.00	0.17
15	300014	亿纬锂能	979,541.00	0.16
16	002224	三力士	978,380.00	0.16
17	000413	东旭光电	978,355.00	0.16
18	002074	国轩高科	966,224.00	0.15
19	300266	兴源环境	963,223.61	0.15
20	300078	思创医惠	962,377.00	0.15

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	000002	万科 A	9,975,197.00	1.59
2	000651	格力电器	1,977,727.00	0.32

3	000402	金融街	1,232,076.58	0.20
4	002681	奋达科技	1,197,334.00	0.19
5	002024	苏宁云商	1,073,531.00	0.17
6	000783	长江证券	1,069,440.88	0.17
7	000629	*ST 钒钛	1,044,065.50	0.17
8	002450	康得新	991,835.38	0.16
9	000831	*ST 五稀	903,510.00	0.14
10	002415	海康威视	816,076.00	0.13
11	000410	沈阳机床	808,534.00	0.13
12	000858	五粮液	793,568.00	0.13
13	000061	农产品	773,931.00	0.12
14	000725	京东方 A	768,230.00	0.12
15	000776	广发证券	762,202.60	0.12
16	000816	智慧农业	754,316.00	0.12
17	000001	平安银行	700,638.07	0.11
18	002312	三泰控股	694,828.00	0.11
19	000616	海航投资	692,048.00	0.11
20	000666	经纬纺机	688,716.00	0.11

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	133,457,452.25
卖出股票收入（成交）总额	126,750,220.04

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1**

本基金投资的前十名证券的发行主体除广发证券(000776)，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。根据2016年11月28日广发证券股份有限公司（下称广发证券，股票代码：000776）《广发证券股份有限公司关于收到中国证券监督管理委员会〈行政处罚决定书〉的公告》，广发证券于近日收到了《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（【2016】128号），依据《证券公司监督管理条例》相关规定，对广发证券责令改正，给予警告，没收违法所得6,805,135.75元，并处以20,415,407.25元罚款。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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	2,033.39
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	352.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,386.24

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：本基金本报告期指数投资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	300583	赛托生物	63,738.78	0.01	新股未上市

§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
5,973	76,536.83	289,082,052.00	63.24%	168,072,455.00	36.76%

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
中国工商银行-南方深证成份交易型 开放式指数证券投资基金联接基金	273,321,432.00	59.79%

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

9.3 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	国信证券股份有限公司	7,500,000.00	1.64%
2	陈维东	3,874,600.00	0.85%
3	田杰	3,621,936.00	0.79%
4	国信证券股份有限公司融券专用证券账户	3,348,100.00	0.73%
5	刘素坚	1,845,018.00	0.40%
6	耿力扬	1,500,000.00	0.33%
7	邬海滨	1,475,867.00	0.32%
8	凌燕	1,475,778.00	0.32%
9	王燕燕	1,439,379.00	0.31%
10	杨悦文	1,418,265.00	0.31%

	中国工商银行股份有限公司—南方深证成份交易型开放式指数证券投资	273,321,432.00	59.79%
--	---------------------------------	----------------	--------

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

9.5 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（2009年12月4日）基金份额总额	4,127,538,537.00
本报告期期初基金份额总额	469,154,507.00
本报告期基金总申购份额	96,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	108,000,000.00
本报告期期末基金份额总额	457,154,507.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据南方基金管理有限公司第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 55,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 6 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
申银万国	2	171,823,145.99	66.21%	17,183.87	66.21%	-
华泰证券	2	87,707,375.71	33.79%	8,769.47	33.79%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- (a) 公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- (b) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- (c) 公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- (d) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- (a) 服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- (b) 研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- (c) 资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国	147,839.01	100.00%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	1,000,000.00	100.00%	-	-

西部证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
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	深证成份交易型开放式指数证券投资 基金招募说明书（更新） （2015 年第 2 号）	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2016 年 1 月 8 日
2	深证成份交易型开放式指数证券投资 基金招募说明书（更新）摘要 （2015 年第 2 号）	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2016 年 1 月 8 日
3	深证成份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 7 月 7 日
4	深证成份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 7 月 7 日
5	关于深证成份交易型开放式指数证	中国证券报、上海证	2016 年 8 月 20 日

	券投资基金变更基金经理的公告	券报、证券时报	
6	关于深证成份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 26 日

备查文件目录

11.9 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立深证成份交易型开放式指数证券投资基金的文件。
- 2、深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同。
- 3、深证成份交易型开放式指数证券投资基金托管协议。
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

11.10 存放地点

深圳市福田区福华一路 6 号免税商务大厦 31-33 楼

11.11 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>