

南方开元沪深 300 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 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.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
§ 6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息.....	19

6.2 审计报告的基本内容.....	19
§7 年度财务报表.....	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告.....	56
8.1 期末基金资产组合情况.....	56
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	56
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.....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	72
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	72
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	72
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	72
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	73
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	73
8.12 投资组合报告附注.....	73
§9 基金份额持有人信息.....	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	75
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	75
9.3 期末上市基金前十名持有人.....	75
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	76
9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	76
§10 开放式基金份额变动.....	77
§11 重大事件揭示.....	78
11.1 基金份额持有人大会决议.....	78
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	78

11.4 基金投资策略的改变.....	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	78
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	79
11.8 其他重大事件.....	81
§12 备查文件目录.....	84
12.1 备查文件目录.....	84
12.2 存放地点.....	84
12.3 查阅方式.....	84

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方开元沪深 300ETF
场内简称	南方 300
基金主代码	159925
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2013 年 2 月 18 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	741,199,451.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013-04-11

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方 300”。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金为被动式指数基金，采用指数复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> <p>本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数：沪深 300 指数。

风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
--------	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	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)	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6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	-32,076,088.01	1,074,906,284.61	58,783,480.95
本期利润	-104,794,664.23	346,871,462.35	776,479,120.22
加权平均基金份额本期利润	-0.1271	0.3198	0.4252
本期加权平均净值利润率	-9.81%	20.57%	46.15%
本期基金份额净值增长率	-8.57%	5.93%	54.37%
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	158,202,453.00	285,596,332.72	-223,541,605.35
期末可供分配基金份额利润	0.2134	0.3403	-0.1317
期末基金资产净值	1,003,619,607.91	1,242,792,956.84	2,372,643,754.49
期末基金份额净值	1.3540	1.4809	1.3980
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	28.07%	41.39%	32.23%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人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. 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）。

4. 本基金已于 2013 年 3 月 11 日对原开元证券投资基金退市时的基金份额进行了折算，基金折算比例为 1:0.876726296。

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

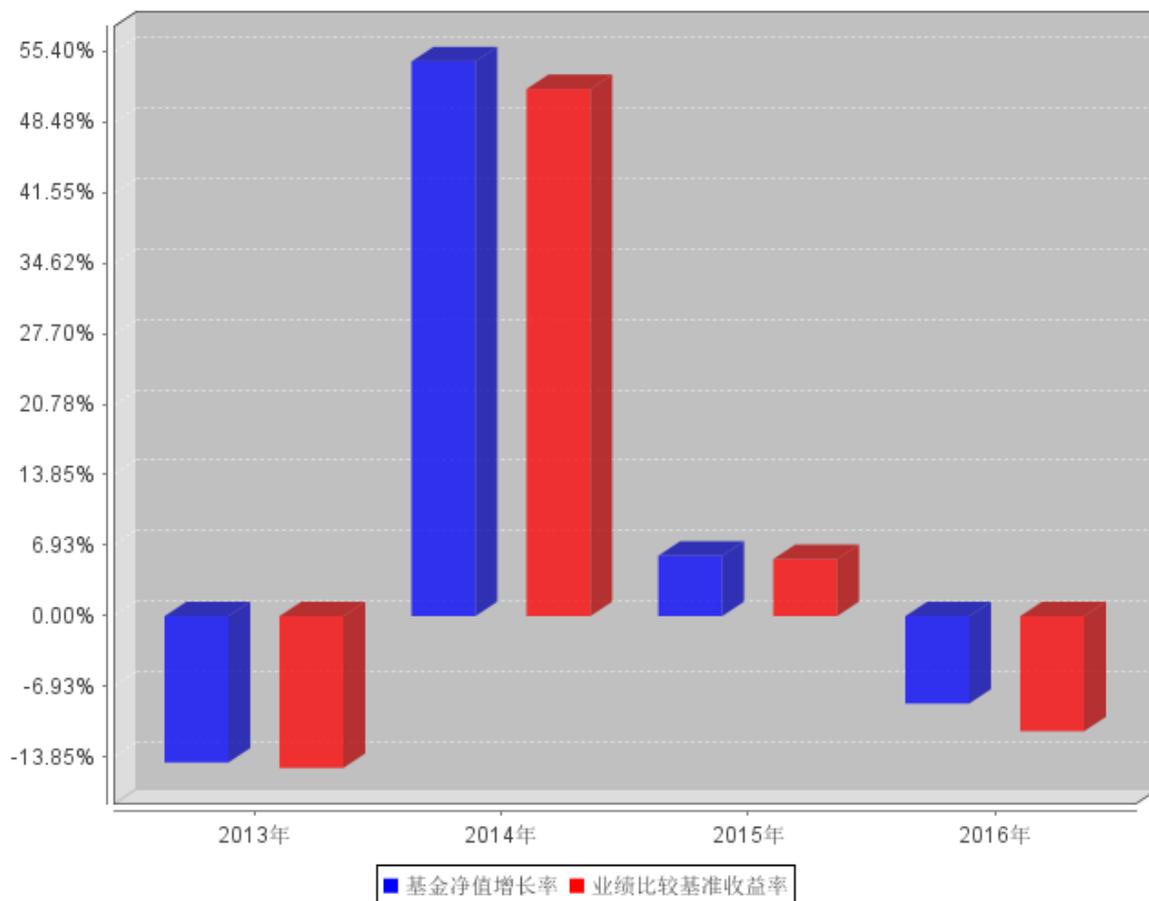
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.24%	0.71%	1.75%	0.71%	0.49%	0.00%
过去六个月	7.15%	0.75%	4.95%	0.75%	2.20%	0.00%
过去一年	-8.57%	1.40%	-11.28%	1.40%	2.71%	0.00%
过去三年	49.51%	1.79%	42.06%	1.79%	7.45%	0.00%
自基金合同 生效起至今	28.07%	1.70%	20.92%	1.71%	7.15%	-0.01%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 自基金转型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：1. 本基金转型日期为 2013 年 2 月 18 日。
 2. 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		
罗文杰	本基金基 金经理	2013 年 5 月 17 日	-	11 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有中国基金从业资格。曾先后任职于美国 Open Link Financial 公司、摩根斯坦利公司，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理，现任数量化投资部总监助理；2013 年 5 月至 2015 年 6 月，任南方策略基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500 基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方 300 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2014 年 10 月至今，任 500 医药基金经理；

					2015 年 2 月至今，任南方恒生 ETF 基金经理； 2016 年 12 月至今，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理。
杨德龙	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日	2016 年 3 月 4 日	10 年	北京大学经济学硕士、清华大学工学学士，具有基金从业资格。2006 年加入南方基金，担任研究部高级行业研究员、首席策略分析师； 2010 年 8 月至 2013 年 4 月，任小康 ETF 及南方小康基金经理；2011 年 9 月至 2016 年 3 月，任南方上证 380ETF 及联接基金基金经理；2013 年 3 月至 2016 年 3 月，任南方策略基金经理； 2013 年 4 月至 2016 年 3 月，任南方 300 基金经理；2013 年 4 月至 2016 年 3 月，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2014 年 12 月至 2016 年 3 月，任南方恒生 ETF 基金经理。

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“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《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实守信、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

报告期内，沪深 300 指数跌 11.28%。

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”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接受申购赎回所带来的股票仓位偏离，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- ②本基金大额换购目标 ETF 所带来的成份股权重偏离，对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行应对；
- ③报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；
- ④股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；
- ⑤6 月中和 12 月中，我们根据指数每半年度成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，

跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自本基金建仓完毕至报告期末年化跟踪误差为 0.781%，较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过 4% 的投资目标。

截至报告期末，本基金份额净值为 1.3540 元，报告期内，份额净值增长率为-8.57%，同期业绩基准增长率为 11.28%。

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，国内经济阶段企稳、通胀压力有所回升，货币政策将更加中性，综合看，权益市场预期将有一个较好的表现。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展情况，围绕重合规守底线、抓规范促发展，坚持从保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，积极推动主动合规风控管理，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展情况，不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，并开展了互联网金融相关业务风险自查、信息技术专项自查等多项内控自查工作，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，推动公司合规、内控体系的健全完善；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，持续完善投资合规风控制度流程和系统，积极配合各类新产品、新业务，重点加强内幕交易防控以及对高风险品种和业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，有效确保投研交易业务的合规开展；针对新出台的法律法规和监管要求，积极组织了多项法律法规、职业道德培训以及合规考试，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况，督促落实销售适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；深入贯彻风险为本的反洗钱工作原则，优化反洗钱资源配置，加大反洗钱投入力度，购置外部专业机构制裁名单数据库，积极推进符合基金业务特征

的可疑交易监控模型和方法，健全创新业务洗钱风险评估机制，各项反洗钱工作进一步完善；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总经理、研究部总监、量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益分配每年最多 12 次，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定。基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；本基金收益分配采取现金分红方式；基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2016 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 21468 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	南方开元沪深 300 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	我们审计了后附的南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“南方开元沪深 300ETF 基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是南方开元沪深 300ETF 基金的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、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; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括

	<p>对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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，上述南方开元沪深 300ETF 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，公允反映了南方开元沪深 300ETF 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	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼	
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：南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 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	441,744.99	3,161,476.12
结算备付金		5,327,021.29	4,054,552.78
存出保证金		1,259,747.71	1,223,149.83
交易性金融资产	7.4.7.2	997,907,406.60	1,236,042,763.55
其中：股票投资		997,907,406.60	1,236,042,763.55
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		346,593.61	381.05
应收利息	7.4.7.5	1,428.47	2,869.22
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		1,005,283,942.67	1,244,485,192.55
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		5,548.93	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		435,639.06	527,473.09
应付托管费		87,127.79	105,494.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	15,786.70	29,789.88
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,120,232.28	1,029,478.10
负债合计		1,664,334.76	1,692,235.71
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	845,417,154.91	957,196,624.12
未分配利润	7.4.7.10	158,202,453.00	285,596,332.72
所有者权益合计		1,003,619,607.91	1,242,792,956.84
负债和所有者权益总计		1,005,283,942.67	1,244,485,192.55

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3540 元，基金份额总额

741,199,451.00 份。

7.2 利润表

会计主体：南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
一、收入		-97,354,276.73	358,733,583.70
1.利息收入		52,040.99	105,759.64
其中：存款利息收入	7.4.7.11	47,419.38	105,651.84
债券利息收入		120.37	107.80
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,501.24	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-24,628,087.16	1,085,092,083.36
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-48,689,027.62	1,066,990,405.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	34,409.93	466,851.60
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-462,144.00	-5,577,900.00
股利收益	7.4.7.15	24,488,674.53	23,212,725.98
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-72,718,576.22	-728,034,822.26
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-59,654.34	1,570,562.96
减：二、费用		7,440,387.50	11,862,121.35
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,351,414.55	8,438,338.50
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,070,282.97	1,687,667.69

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	246,170.10	778,173.80
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	772,519.88	957,941.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-104,794,664.23	346,871,462.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-104,794,664.23	346,871,462.35

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 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）	957,196,624.12	285,596,332.72	1,242,792,956.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-104,794,664.23	-104,794,664.23
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）	-111,779,469.21	-22,599,215.49	-134,378,684.70
其中：1.基金申购款	152,841,315.01	13,609,436.18	166,450,751.19
2.基金赎回款	-264,620,784.22	-36,208,651.67	-300,829,435.89

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）	845,417,154.91	158,202,453.00	1,003,619,607.91
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）	1,935,837,283.04	436,806,471.45	2,372,643,754.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	346,871,462.35	346,871,462.35
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）	-978,640,658.92	-498,081,601.08	-1,476,722,260.00
其中：1. 基金申购款	1,108,669,837.13	606,420,777.21	1,715,090,614.34
2. 基金赎回款	-2,087,310,496.05	-1,104,502,378.29	-3,191,812,874.34
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）	957,196,624.12	285,596,332.72	1,242,792,956.84

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：

<u>杨小松</u>	<u>徐超</u>	<u>徐超</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金是根据原开元证券投资基金(以下简称“基金开元”)基金份额持有人大会 2013 年 1 月 4 日决议通过的《关于开元证券投资基金转型有关事项的议案》，并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[2013]61 号《关于核准开元证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》核准，由原基金基金开元转型而来。原基金基金开元为契约型封闭式基金，于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市，存续期限为 15 年期，至 2013 年 3 月 27 日止。根据深交所深证上[2013] 55 号《终止上市通知书》，原基金基金开元于 2013 年 2 月 8 日提前终止上市权利登记。自 2013 年 2 月 18 日起，原基金基金开元终止上市，并更名为南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)。原《开元证券投资基金基金合同》失效，《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期间不定。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。

原基金基金开元于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 1,853,841,542.50 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《关于南方开元沪深 300ETF 基金集中申购结果和原基金开元份额折算结果的公告》的有关规定，本基金以 2013 年 3 月 11 日为基金份额折算基准日对投资人持有的原基金基金开元份额进行了折算，折算比例为 0.876726296，并于 2013 年 3 月 13 日完成了变更登记。

本基金于基金合同生效后自 2013 年 2 月 25 日至 2013 年 3 月 11 日期间内开放集中申购，共募集人民币 2,205,746,859.00 元(含集中申购募集股票市值)，其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息 69,869.00 元，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(2013)第 146 号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2013 年 3 月 11 日基金份额折算后的基金份额净值 1.0000 元折合为 2,205,746,859.00 份基金份额，其中包括集中申购资金利息

折合的 69,869.00 份基金份额，并于 2013 年 3 月 15 日进行了确认登记。

经深交所深证上字[2013]111 号文审核同意，本基金 3,959,199,451.00 份基金份额于 2013 年 4 月 11 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《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数沪深 300 指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。本基金主要投资于标的指数的成份股和备选成份股；为更好地实现投资目标，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）、一级市场新股或增发的股票、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。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为沪深 300 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，根据《南方沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的约定于 2013 年 4 月 17 日召开基金份额持有人大会审议通过《关于南方沪深 300 指数证券投资基金变更投资范围及其相关事项的议案》，并经中国证监会证监许可[2013]674 号《关于核准南方沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金投资范围等事项决议的批复》核准，于 2013 年 5 月 16 日将管理的南方沪深 300 指数证券投资基金变更为南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“南方开元沪深 300ETF 联接基金”）。南方开元沪深 300ETF 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》、《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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。

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、债券投资和衍生工具(主要为股指期货)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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(主要为股指期货)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

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、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券

的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，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	441,744.99	3,161,476.12
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	441,744.99	3,161,476.12

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	1,073,385,710.88	997,907,406.60	-75,478,304.28

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		1,073,385,710.88	997,907,406.60	-75,478,304.28
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		1,239,150,371.61	1,236,042,763.55	-3,107,608.06
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		1,239,150,371.61	1,236,042,763.55	-3,107,608.06

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

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		
	合同/名义金	公允价值	备注

	额	资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	6,218,220.00	-	-	
股指期货	6,218,220.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	6,218,220.00	-	-	
项目	上年度末			
	2015 年 12 月 31 日			
	合同/名义金	公允价值		备注
额	资产	负债		
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	5,453,940.00	-	-	
股指期货	5,453,940.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	5,453,940.00	-	-	

注：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：股指期货合约 IF1701，持仓量 6，合约市值 5,925,600.00，公允价值变动-292,620.00。

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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	上年度末
----	-----	------

	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	481.28	524.23
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	940.29	2,315.19
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	6.90	29.80
合计	1,428.47	2,869.22

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	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	15,786.70	29,789.88
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	15,786.70	29,789.88

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	750,000.00	750,000.00
应付赎回费	-	-

预提费用	291,000.00	191,000.00
指数使用费	79,232.28	88,478.10
可退替代款	-	-
应退替代款	-	-
合计	1,120,232.28	1,029,478.10

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	839,199,451.00	957,196,624.12
本期申购	134,000,000.00	152,841,315.01
本期赎回(以“-”号填列)	-232,000,000.00	-264,620,784.22
本期末	741,199,451.00	845,417,154.91

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	803,831,735.68	-518,235,402.96	285,596,332.72
本期利润	-32,076,088.01	-72,718,576.22	-104,794,664.23
本期基金份额交易产生的变动数	-91,499,818.24	68,900,602.75	-22,599,215.49
其中：基金申购款	126,187,920.41	-112,578,484.23	13,609,436.18
基金赎回款	-217,687,738.65	181,479,086.98	-36,208,651.67

本期已分配利润	-	-	-
本期末	680,255,829.43	-522,053,376.43	158,202,453.00

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	15,005.79	38,101.84
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	32,080.02	66,715.41
其他	333.57	834.59
合计	47,419.38	105,651.84

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	-10,128,662.95	148,243,856.97
股票投资收益——赎回差价收入	-38,560,364.67	918,746,548.81
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-48,689,027.62	1,066,990,405.78

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	175,253,117.90	501,463,384.68
减：卖出股票成本总额	185,381,780.85	353,219,527.71
买卖股票差价收入	-10,128,662.95	148,243,856.97

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	300,829,435.89	3,191,812,874.34
减：现金支付赎回款总额	-723,300.11	49,429,395.34
减：赎回股票成本总额	340,113,100.67	2,223,636,930.19
赎回差价收入	-38,560,364.67	918,746,548.81

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	423,530.30	1,830,959.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总	389,000.00	1,364,000.00

额		
减：应收利息总额	120.37	107.80
买卖债券差价收入	34,409.93	466,851.60

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间收益金额 2015年1月1日至2015年12月 31日
股指期货-投资收益	-462,144.00	-5,577,900.00

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
股票投资产生的股利收益	24,488,674.53	23,212,725.98
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	24,488,674.53	23,212,725.98

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
1. 交易性金融资产	-72,370,696.22	-728,090,082.26
——股票投资	-72,370,696.22	-728,090,082.26
——债券投资	-	-

——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-347,880.00	55,260.00
——权证投资	-347,880.00	55,260.00
3. 其他	-	-
合计	-72,718,576.22	-728,034,822.26

注：本基金本期及上年度可比期间公允价值变动收益-股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动收益零元(2015年12月31日：-119,052.11元)。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-59,654.34	1,570,562.96
合计	-59,654.34	1,570,562.96

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 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	246,170.10	778,173.80
银行间市场交易费用	-	-
合计	246,170.10	778,173.80

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	91,000.00	91,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
银行汇划费	435.00	641.00
指数使用费	321,084.88	506,300.36
银行费用	-	-
合计	772,519.88	957,941.36

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000 元。

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
南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“南方开元沪深 300ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

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	219,097,905.03	60.72%	22,498,545.49	2.49%

7.4.10.1.2 权证交易

注：无。

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	21,910.24	60.72%	15,185.38	96.19%
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	19,909.07	8.79%	-	-

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后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 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
	当期发生的基金应支付的管理费	5,351,414.55
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	1,070,282.97	1,687,667.69

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发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本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
南方开元沪深	524,944,419.00	70.8200%	598,944,419.00	71.3700%

300ETF 联接 基金				
-----------------	--	--	--	--

注：南方开元沪深 300ETF 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国工商银行	441,744.99	15,005.79	3,161,476.12

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位： 股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
601375	中原证券	2016 年 12 月	2017 年 1 月 3 日	新股未 上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-

		20 日								
603228	景旺电子	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股未 上市	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股未 上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
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	-
603689	皖天然气	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股未 上市	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股未 上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股未 上市	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
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	-
603186	华正新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 3 日	新股未 上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016 年	2017 年	新股未	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-

		12月 27日	1月5日	上市						
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	651,491	6,750,827.33	4,071,818.75	-
300104	乐视网	2016年 12月7日	重大资 产重组	35.80	2017 年1月 16日	36.88	110,100	6,706,054.57	3,941,580.00	-
600649	城投控股	2016年 12月6日	重大资 产重组	20.34	-	-	165,496	1,905,262.08	3,366,188.64	-

601727	上海电气	2016 年 8 月 31 日	重大事 项未公 告	8.42	-	-	327,300	4,350,875.71	2,755,866.00	-
600406	国电南瑞	2016 年 12 月 28 日	重大事 项未公 告	16.63	-	-	157,857	2,764,282.74	2,625,161.91	-
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大事 项未公 告	14.60	-	-	158,229	3,826,974.05	2,310,143.40	-
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	319,630	2,997,890.11	2,227,821.10	-
000540	中天城投	2016 年 11 月 28 日	重大资 产重组	6.93	2017 年 1 月 3 日	7.00	314,100	2,743,961.69	2,176,713.00	-
600654	中安消	2016 年 12 月 14 日	重大资 产重组	17.43	-	-	83,300	1,608,880.00	1,451,919.00	-
600875	东方电气	2016 年 12 月 9 日	重大事 项	10.79	-	-	133,261	2,281,301.67	1,437,886.19	-
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	重大事 项	8.27	-	-	145,618	2,028,468.46	1,204,260.86	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪沪深 300 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，跟踪沪深 300 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，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，将风险控制在此可承受的范围内。本基金是指数型基金，紧密跟踪沪深 300 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，跟踪沪深 300 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，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)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制

不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的投资股指期货，以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。

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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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	441,744.99	-	-	-	441,744.99

结算备付金	5,327,021.29	-	-	-	5,327,021.29
存出保证金	15,371.71	-	-	1,244,376.00	1,259,747.71
交易性金融资产	-	-	-	997,907,406.60	997,907,406.60
应收证券清算款	-	-	-	346,593.61	346,593.61
应收利息	-	-	-	1,428.47	1,428.47
资产总计	5,784,137.99	-	-	999,499,804.68	1,005,283,942.67
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	435,639.06	435,639.06
应付托管费	-	-	-	87,127.79	87,127.79
应付交易费用	-	-	-	15,786.70	15,786.70
其他负债	-	-	-	1,120,232.28	1,120,232.28
应付证券清算款	-	-	-	5,548.93	5,548.93
负债总计	-	-	-	1,664,334.76	1,664,334.76
利率敏感度缺口	5,784,137.99	-	-	997,835,469.92	1,003,619,607.91
上年度末 2015年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,161,476.12	-	-	-	3,161,476.12
结算备付金	4,054,552.78	-	-	-	4,054,552.78
存出保证金	1,223,149.83	-	-	-	1,223,149.83
交易性金融资产	-	-	-	1,236,042,763.55	1,236,042,763.55
应收证券清算款	-	-	-	381.05	381.05
应收利息	-	-	-	2,869.22	2,869.22
资产总计	8,439,178.73	-	-	1,236,046,013.82	1,244,485,192.55
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	527,473.09	527,473.09
应付托管费	-	-	-	105,494.64	105,494.64
应付交易费用	-	-	-	29,789.88	29,789.88

其他负债	-	-	-	1,029,478.10	1,029,478.10
负债总计	-	-	-	1,692,235.71	1,692,235.71
利率敏感度缺口	8,439,178.73	-	-	-1,234,353,778.11	1,242,792,956.84

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

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，跟踪沪深 300 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，沪深 300 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	公允价值	占基金资 产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	997,907,406.60	99.43	1,236,042,763.55	99.46
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	997,907,406.60	99.43	1,236,042,763.55	99.46

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%	49,590,000.00	62,030,000.00
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-49,590,000.00	-62,030,000.00

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 166,450,751.19 元(2015 年度: 1,715,090,614.34 元), 其中包括以股票支付的申购款 164,803,864.57 元和以现金支付的申购款 1,646,886.62 元(2015 年度: 其中包括以股票支付的申购款 1,666,391,058.46 元和以现金支付的申购款 48,699,555.88 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 969,868,653.42 元，属于第二层次的余额为 28,038,753.18 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 1,167,098,268.03 元，第二层次 68,944,495.52 元，无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(3)除基金申购款和公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	997,907,406.60	99.27
	其中：股票	997,907,406.60	99.27
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	5,768,766.28	0.57
7	其他各项资产	1,607,769.79	0.16
8	合计	1,005,283,942.67	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	2,952,257.92	0.29
B	采矿业	34,648,996.33	3.45
C	制造业	324,692,747.54	32.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,177,188.17	2.71
E	建筑业	46,866,861.45	4.67
F	批发和零售业	21,612,937.15	2.15

G	交通运输、仓储和邮政业	28,706,037.39	2.86
H	住宿和餐饮业	512,604.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	65,034,226.05	6.48
J	金融业	353,208,446.07	35.19
K	房地产业	52,369,398.69	5.22
L	租赁和商务服务业	11,408,050.68	1.14
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,865,086.85	0.78
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,304,776.20	0.13
R	文化、体育和娱乐业	13,505,941.11	1.35
S	综合	4,628,683.18	0.46
	合计	996,494,238.78	99.29

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	982,655.80	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,665.70	0.00
E	建筑业	22,852.06	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	19,522.06	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	241,692.20	0.02
J	金融业	106,780.00	0.01

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	1,413,167.82	0.14

8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	1,173,414	41,574,058.02	4.14
2	601166	兴业银行	1,444,585	23,315,601.90	2.32
3	600016	民生银行	2,560,820	23,252,245.60	2.32
4	600036	招商银行	1,117,242	19,663,459.20	1.96
5	600519	贵州茅台	54,405	18,179,430.75	1.81
6	601328	交通银行	2,977,334	17,179,217.18	1.71
7	600000	浦发银行	937,007	15,188,883.47	1.51
8	000002	万科 A	737,613	15,157,947.15	1.51
9	601668	中国建筑	1,625,430	14,401,309.80	1.43
10	600837	海通证券	876,946	13,811,899.50	1.38

11	000333	美的集团	487,372	13,729,269.24	1.37
12	600030	中信证券	852,892	13,697,445.52	1.36
13	601169	北京银行	1,318,341	12,867,008.16	1.28
14	601288	农业银行	4,142,374	12,841,359.40	1.28
15	000651	格力电器	521,464	12,838,443.68	1.28
16	600887	伊利股份	657,198	11,566,684.80	1.15
17	601398	工商银行	2,337,200	10,307,052.00	1.03
18	601766	中国中车	993,368	9,705,205.36	0.97
19	601601	中国太保	340,564	9,457,462.28	0.94
20	601211	国泰君安	495,700	9,215,063.00	0.92
21	600900	长江电力	715,203	9,054,469.98	0.90
22	000001	平安银行	930,311	8,465,830.10	0.84
23	600104	上汽集团	358,441	8,405,441.45	0.84
24	601988	中国银行	2,283,955	7,856,805.20	0.78
25	000725	京东方 A	2,575,382	7,365,592.52	0.73
26	601390	中国中铁	807,792	7,157,037.12	0.71
27	000858	五粮液	205,670	7,091,501.60	0.71
28	601989	中国重工	994,835	7,053,380.15	0.70
29	600048	保利地产	771,009	7,039,312.17	0.70
30	600276	恒瑞医药	152,584	6,942,572.00	0.69
31	601818	光大银行	1,725,585	6,747,037.35	0.67
32	600050	中国联通	918,789	6,716,347.59	0.67
33	601688	华泰证券	354,000	6,322,440.00	0.63
34	600015	华夏银行	579,036	6,282,540.60	0.63
35	600028	中国石化	1,139,057	6,162,298.37	0.61
36	601186	中国铁建	498,703	5,964,487.88	0.59
37	600518	康美药业	321,713	5,742,577.05	0.57
38	000776	广发证券	320,769	5,408,165.34	0.54

39	600958	东方证券	337,300	5,238,269.00	0.52
40	002450	康得新	267,296	5,108,026.56	0.51
41	002415	海康威视	198,333	4,722,308.73	0.47
42	002024	苏宁云商	403,536	4,620,487.20	0.46
43	002304	洋河股份	65,273	4,608,273.80	0.46
44	601006	大秦铁路	644,406	4,562,394.48	0.45
45	601628	中国人寿	180,553	4,349,521.77	0.43
46	601009	南京银行	393,958	4,270,504.72	0.43
47	001979	招商蛇口	256,984	4,211,967.76	0.42
48	000538	云南白药	55,117	4,197,159.55	0.42
49	601857	中国石油	526,343	4,184,426.85	0.42
50	002736	国信证券	266,600	4,145,630.00	0.41
51	000063	中兴通讯	257,775	4,111,511.25	0.41
52	000166	申万宏源	651,491	4,071,818.75	0.41
53	600795	国电电力	1,277,630	4,050,087.10	0.40
54	600999	招商证券	247,895	4,048,125.35	0.40
55	601899	紫金矿业	1,198,787	4,003,948.58	0.40
56	601939	建设银行	727,724	3,958,818.56	0.39
57	601336	新华保险	90,335	3,954,866.30	0.39
58	300104	乐视网	110,100	3,941,580.00	0.39
59	300059	东方财富	231,320	3,916,247.60	0.39
60	601377	兴业证券	508,017	3,886,330.05	0.39
61	601099	太平洋	738,590	3,803,738.50	0.38
62	000783	长江证券	359,542	3,678,114.66	0.37
63	600585	海螺水泥	216,753	3,676,130.88	0.37
64	601985	中国核电	506,000	3,572,360.00	0.36
65	300070	碧水源	203,097	3,558,259.44	0.35
66	002142	宁波银行	211,292	3,515,898.88	0.35

67	601088	中国神华	214,430	3,469,477.40	0.35
68	600019	宝钢股份	534,868	3,396,411.80	0.34
69	601901	方正证券	446,041	3,389,911.60	0.34
70	601788	光大证券	211,700	3,385,083.00	0.34
71	600649	城投控股	165,496	3,366,188.64	0.34
72	600637	东方明珠	142,289	3,315,333.70	0.33
73	000503	海虹控股	77,900	3,275,695.00	0.33
74	600690	青岛海尔	330,406	3,264,411.28	0.33
75	601669	中国电建	447,142	3,246,250.92	0.32
76	600089	特变电工	351,504	3,209,231.52	0.32
77	000768	中航飞机	149,989	3,188,766.14	0.32
78	600383	金地集团	243,853	3,160,334.88	0.31
79	000625	长安汽车	211,350	3,157,569.00	0.31
80	002673	西部证券	151,458	3,145,782.66	0.31
81	000423	东阿阿胶	56,701	3,054,482.87	0.30
82	601555	东吴证券	227,593	3,020,159.11	0.30
83	601600	中国铝业	712,598	3,007,163.56	0.30
84	600109	国金证券	229,390	2,988,951.70	0.30
85	600705	中航资本	486,360	2,976,523.20	0.30
86	300072	三聚环保	64,300	2,976,447.00	0.30
87	600703	三安光电	220,953	2,958,560.67	0.29
88	600010	包钢股份	1,058,590	2,953,466.10	0.29
89	600886	国投电力	441,239	2,943,064.13	0.29
90	600547	山东黄金	80,488	2,938,616.88	0.29
91	002594	比亚迪	59,017	2,931,964.56	0.29
92	600535	天士力	70,298	2,916,664.02	0.29
93	002202	金风科技	169,588	2,901,650.68	0.29
94	600111	北方稀土	236,194	2,898,100.38	0.29

95	600660	福耀玻璃	151,969	2,831,182.47	0.28
96	002456	欧菲光	82,380	2,823,986.40	0.28
97	600066	宇通客车	143,951	2,820,000.09	0.28
98	600009	上海机场	104,440	2,769,748.80	0.28
99	600893	中航动力	84,441	2,764,598.34	0.28
100	601727	上海电气	327,300	2,755,866.00	0.27
101	002739	万达院线	50,900	2,752,163.00	0.27
102	300017	网宿科技	51,331	2,751,854.91	0.27
103	600068	葛洲坝	299,365	2,751,164.35	0.27
104	000839	中信国安	297,300	2,729,214.00	0.27
105	600804	鹏博士	122,581	2,688,201.33	0.27
106	002230	科大讯飞	99,205	2,687,463.45	0.27
107	600029	南方航空	380,500	2,671,110.00	0.27
108	600100	同方股份	192,692	2,668,784.20	0.27
109	002241	歌尔股份	99,332	2,634,284.64	0.26
110	600406	国电南瑞	157,857	2,625,161.91	0.26
111	000100	TCL 集团	794,199	2,620,856.70	0.26
112	000338	潍柴动力	262,430	2,613,802.80	0.26
113	600415	小商品城	294,890	2,550,798.50	0.25
114	000728	国元证券	127,666	2,540,553.40	0.25
115	300024	机器人	118,340	2,530,109.20	0.25
116	600570	恒生电子	53,527	2,523,262.78	0.25
117	600196	复星医药	108,980	2,521,797.20	0.25
118	600309	万华化学	117,122	2,521,636.66	0.25
119	600031	三一重工	412,331	2,515,219.10	0.25
120	601800	中国交建	165,487	2,513,747.53	0.25
121	000568	泸州老窖	75,934	2,505,822.00	0.25
122	002252	上海莱士	107,580	2,484,022.20	0.25

123	000069	华侨城 A	355,743	2,472,413.85	0.25
124	000793	华闻传媒	218,470	2,466,526.30	0.25
125	601618	中国中冶	527,867	2,459,860.22	0.25
126	601607	上海医药	124,989	2,444,784.84	0.24
127	000009	中国宝安	232,902	2,412,864.72	0.24
128	000623	吉林敖东	77,573	2,403,987.27	0.24
129	600023	浙能电力	442,100	2,400,603.00	0.24
130	601198	东兴证券	119,500	2,397,170.00	0.24
131	600271	航天信息	120,076	2,395,516.20	0.24
132	600739	辽宁成大	132,661	2,382,591.56	0.24
133	002065	东华软件	102,127	2,379,559.10	0.24
134	600867	通化东宝	107,818	2,364,448.74	0.24
135	600177	雅戈尔	166,413	2,326,453.74	0.23
136	600221	海南航空	712,396	2,322,410.96	0.23
137	600485	信威集团	158,229	2,310,143.40	0.23
138	600340	华夏幸福	96,130	2,297,507.00	0.23
139	600606	绿地控股	263,700	2,296,827.00	0.23
140	601888	中国国旅	52,878	2,294,905.20	0.23
141	000413	东旭光电	203,189	2,287,908.14	0.23
142	600352	浙江龙盛	246,796	2,272,991.16	0.23
143	600489	中金黄金	186,945	2,260,165.05	0.23
144	600115	东方航空	318,914	2,254,721.98	0.22
145	600820	隧道股份	204,500	2,251,545.00	0.22
146	000895	双汇发展	107,295	2,245,684.35	0.22
147	000630	铜陵有色	725,265	2,233,816.20	0.22
148	000750	国海证券	319,630	2,227,821.10	0.22
149	600369	西南证券	305,816	2,180,468.08	0.22
150	600741	华域汽车	136,704	2,180,428.80	0.22

151	000540	中天城投	314,100	2,176,713.00	0.22
152	601919	中远海控	413,700	2,167,788.00	0.22
153	002465	海格通信	186,024	2,167,179.60	0.22
154	601018	宁波港	428,269	2,167,041.14	0.22
155	002007	华兰生物	60,527	2,163,840.25	0.22
156	000157	中联重科	476,043	2,161,235.22	0.22
157	600157	永泰能源	538,670	2,160,066.70	0.22
158	002236	大华股份	157,063	2,148,621.84	0.21
159	601998	中信银行	332,132	2,128,966.12	0.21
160	600816	安信信托	89,800	2,121,076.00	0.21
161	300124	汇川技术	104,276	2,119,931.08	0.21
162	600718	东软集团	107,760	2,118,561.60	0.21
163	002466	天齐锂业	64,700	2,099,515.00	0.21
164	002008	大族激光	92,439	2,089,121.40	0.21
165	600674	川投能源	238,432	2,074,358.40	0.21
166	600150	中国船舶	74,644	2,060,920.84	0.21
167	601933	永辉超市	414,796	2,036,648.36	0.20
168	600118	中国卫星	64,085	2,002,015.40	0.20
169	601111	中国国航	277,131	1,995,343.20	0.20
170	300027	华谊兄弟	181,096	1,992,056.00	0.20
171	600153	建发股份	184,345	1,972,491.50	0.20
172	002085	万丰奥威	98,800	1,952,288.00	0.19
173	300315	掌趣科技	210,200	1,942,248.00	0.19
174	002475	立讯精密	91,888	1,906,676.00	0.19
175	600959	江苏有线	168,300	1,901,790.00	0.19
176	000963	华东医药	26,287	1,894,504.09	0.19
177	000686	东北证券	152,133	1,880,363.88	0.19
178	600061	国投安信	120,100	1,874,761.00	0.19

179	000060	中金岭南	167,929	1,872,408.35	0.19
180	600085	同仁堂	59,488	1,866,733.44	0.19
181	600005	武钢股份	546,900	1,864,929.00	0.19
182	601333	广深铁路	367,519	1,863,321.33	0.19
183	000826	启迪桑德	55,622	1,834,413.56	0.18
184	600170	上海建工	386,399	1,827,667.27	0.18
185	000876	新希望	225,698	1,816,868.90	0.18
186	600018	上港集团	351,582	1,800,099.84	0.18
187	000917	电广传媒	122,904	1,768,588.56	0.18
188	600583	海油工程	239,629	1,768,462.02	0.18
189	600663	陆家嘴	79,477	1,758,826.01	0.18
190	002183	怡亚通	159,100	1,727,826.00	0.17
191	002081	金螳螂	171,761	1,681,540.19	0.17
192	600839	四川长虹	400,164	1,672,685.52	0.17
193	600588	用友网络	79,315	1,651,338.30	0.16
194	000559	万向钱潮	124,230	1,647,289.80	0.16
195	002310	东方园林	116,000	1,641,400.00	0.16
196	300033	同花顺	23,300	1,602,574.00	0.16
197	600256	广汇能源	339,245	1,584,274.15	0.16
198	002385	大北农	222,208	1,577,676.80	0.16
199	300168	万达信息	77,600	1,569,072.00	0.16
200	603993	洛阳钼业	420,730	1,565,115.60	0.16
201	600208	新湖中宝	372,764	1,550,698.24	0.15
202	300058	蓝色光标	151,541	1,541,171.97	0.15
203	000425	徐工机械	455,585	1,539,877.30	0.15
204	601718	际华集团	167,100	1,538,991.00	0.15
205	000709	河钢股份	459,983	1,536,343.22	0.15
206	000792	盐湖股份	80,464	1,534,448.48	0.15

207	002426	胜利精密	185,400	1,533,258.00	0.15
208	600297	广汇汽车	178,700	1,529,672.00	0.15
209	600688	上海石化	237,421	1,528,991.24	0.15
210	600362	江西铜业	89,895	1,503,943.35	0.15
211	600895	张江高科	83,900	1,486,708.00	0.15
212	002074	国轩高科	47,500	1,472,025.00	0.15
213	002500	山西证券	122,443	1,471,764.86	0.15
214	600332	白云山	60,979	1,462,276.42	0.15
215	600060	海信电器	85,058	1,456,192.96	0.15
216	600654	中安消	83,300	1,451,919.00	0.14
217	000983	西山煤电	170,800	1,444,968.00	0.14
218	601633	长城汽车	130,593	1,444,358.58	0.14
219	600875	东方电气	133,261	1,437,886.19	0.14
220	000415	渤海金控	201,000	1,437,150.00	0.14
221	600498	烽火通信	56,700	1,429,407.00	0.14
222	601866	中远海发	343,563	1,401,737.04	0.14
223	601258	庞大集团	505,954	1,401,492.58	0.14
224	600074	保千里	105,700	1,399,468.00	0.14
225	600737	中粮屯河	111,200	1,385,552.00	0.14
226	600252	中恒集团	301,037	1,378,749.46	0.14
227	000977	浪潮信息	65,000	1,378,000.00	0.14
228	300002	神州泰岳	148,800	1,374,912.00	0.14
229	600446	金证股份	54,200	1,362,046.00	0.14
230	002470	金正大	169,984	1,342,873.60	0.13
231	600666	奥瑞德	49,800	1,342,110.00	0.13
232	000402	金融街	129,654	1,335,436.20	0.13
233	300144	宋城演艺	63,000	1,319,220.00	0.13
234	600376	首开股份	111,700	1,319,177.00	0.13

235	600873	梅花生物	201,920	1,316,518.40	0.13
236	300015	爱尔眼科	43,638	1,304,776.20	0.13
237	002049	紫光国芯	39,400	1,297,836.00	0.13
238	002292	奥飞娱乐	56,709	1,287,294.30	0.13
239	600704	物产中大	124,330	1,284,328.90	0.13
240	601216	君正集团	274,096	1,274,546.40	0.13
241	600827	百联股份	86,848	1,247,137.28	0.12
242	600038	中直股份	25,600	1,239,552.00	0.12
243	000738	中航动控	49,600	1,227,104.00	0.12
244	000778	新兴铸管	236,632	1,223,387.44	0.12
245	600373	中文传媒	59,800	1,207,960.00	0.12
246	002129	中环股份	145,618	1,204,260.86	0.12
247	000039	中集集团	81,990	1,198,693.80	0.12
248	002195	二三四五	104,600	1,184,072.00	0.12
249	002152	广电运通	87,700	1,164,656.00	0.12
250	600037	歌华有线	75,400	1,155,128.00	0.12
251	601155	新城控股	98,000	1,151,500.00	0.11
252	600482	中国动力	37,700	1,151,358.00	0.11
253	300182	捷成股份	111,000	1,144,410.00	0.11
254	000712	锦龙股份	48,500	1,136,840.00	0.11
255	000718	苏宁环球	131,500	1,134,845.00	0.11
256	601872	招商轮船	229,500	1,133,730.00	0.11
257	600021	上海电力	92,800	1,126,592.00	0.11
258	000156	华数传媒	62,173	1,113,518.43	0.11
259	002131	利欧股份	69,700	1,111,715.00	0.11
260	002146	荣盛发展	141,234	1,108,686.90	0.11
261	600008	首创股份	260,960	1,072,545.60	0.11
262	600372	中航电子	57,245	1,062,467.20	0.11

263	000627	天茂集团	138,400	1,058,760.00	0.11
264	603000	人民网	59,940	1,058,540.40	0.11
265	600685	中船防务	35,600	1,057,320.00	0.11
266	601225	陕西煤业	216,610	1,050,558.50	0.10
267	002714	牧原股份	44,800	1,042,944.00	0.10
268	002299	圣农发展	48,100	1,020,682.00	0.10
269	002174	游族网络	37,300	986,585.00	0.10
270	601611	中国核建	56,900	978,111.00	0.10
271	000671	阳光城	175,400	976,978.00	0.10
272	601021	春秋航空	26,100	958,914.00	0.10
273	000800	一汽轿车	88,092	957,560.04	0.10
274	002027	分众传媒	66,300	946,101.00	0.09
275	300146	汤臣倍健	78,860	941,588.40	0.09
276	300251	光线传媒	95,340	930,518.40	0.09
277	000938	紫光股份	15,900	912,501.00	0.09
278	000061	农产品	73,573	910,098.01	0.09
279	002797	第一创业	26,100	908,280.00	0.09
280	600582	天地科技	179,300	891,121.00	0.09
281	601118	海南橡胶	127,677	888,631.92	0.09
282	000027	深圳能源	128,800	884,856.00	0.09
283	002424	贵州百灵	45,900	869,346.00	0.09
284	601928	凤凰传媒	82,669	865,544.43	0.09
285	300133	华策影视	75,633	858,434.55	0.09
286	601877	正泰电器	42,900	858,000.00	0.09
287	002153	石基信息	34,686	845,297.82	0.08
288	000008	神州高铁	89,500	834,140.00	0.08
289	600871	石化油服	195,600	801,960.00	0.08
290	601958	金钼股份	104,827	801,926.55	0.08

291	600648	外高桥	40,466	798,798.84	0.08
292	601608	中信重工	141,000	791,010.00	0.08
293	600783	鲁信创投	32,233	729,110.46	0.07
294	603885	吉祥航空	27,800	647,740.00	0.06
295	000555	神州信息	29,900	634,777.00	0.06
296	300085	银之杰	29,700	620,730.00	0.06
297	601127	小康股份	19,400	518,756.00	0.05
298	600754	锦江股份	17,400	512,604.00	0.05
299	600188	兖州煤业	41,688	452,731.68	0.05
300	002568	百润股份	19,500	394,680.00	0.04

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	12,500	234,875.00	0.02%
2	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.01%
3	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.01%
4	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.01%
5	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	0.01%
6	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.01%
7	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.01%
8	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.01%
9	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.01%
10	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.01%
11	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.01%
12	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00%
13	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00%

14	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00%
15	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00%
16	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00%
17	603239	N 仙通	924	29,059.80	0.00%
18	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00%
19	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00%
20	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00%
21	603929	N 亚翔	2,193	15,592.23	0.00%
22	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00%
23	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00%
24	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00%
25	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00%
26	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00%
27	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00%
28	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	601211	国泰君安	6,611,707.22	0.53
2	600958	东方证券	4,363,460.13	0.35
3	000333	美的集团	4,321,767.28	0.35
4	002739	万达院线	3,882,143.00	0.31
5	601328	交通银行	3,047,946.00	0.25
6	300072	三聚环保	3,030,261.00	0.24
7	600900	长江电力	2,927,562.93	0.24

8	000839	中信国安	2,702,950.90	0.22
9	600606	绿地控股	2,643,159.00	0.21
10	002183	怡亚通	2,522,770.17	0.20
11	002736	国信证券	2,498,722.00	0.20
12	002466	天齐锂业	2,470,907.00	0.20
13	600061	国投安信	2,461,881.00	0.20
14	600446	金证股份	2,337,482.00	0.19
15	300168	万达信息	2,296,149.00	0.18
16	600519	贵州茅台	1,999,087.30	0.16
17	002085	万丰奥威	1,991,606.00	0.16
18	600816	安信信托	1,947,560.94	0.16
19	600074	保千里	1,945,581.20	0.16
20	601198	东兴证券	1,869,921.00	0.15

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	600016	民生银行	8,531,287.05	0.69
2	600000	浦发银行	6,785,729.40	0.55
3	600011	华能国际	3,548,357.62	0.29
4	000002	万科 A	3,235,483.00	0.26
5	601318	中国平安	2,713,295.00	0.22
6	300003	乐普医疗	2,111,718.31	0.17
7	600315	上海家化	1,935,012.81	0.16
8	601229	上海银行	1,903,775.64	0.15
9	600637	东方明珠	1,855,551.44	0.15

10	601398	工商银行	1,817,656.00	0.15
11	000046	泛海控股	1,769,196.00	0.14
12	002422	科伦药业	1,757,923.28	0.14
13	601106	中国一重	1,749,886.32	0.14
14	002024	苏宁云商	1,687,489.00	0.14
15	600398	海澜之家	1,684,254.77	0.14
16	600549	厦门钨业	1,637,780.16	0.13
17	601238	广汽集团	1,636,730.00	0.13
18	002038	双鹭药业	1,581,812.02	0.13
19	601166	兴业银行	1,562,198.00	0.13
20	600642	申能股份	1,556,867.16	0.13

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	194,439,063.54
卖出股票收入（成交）总额	175,253,117.90

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1701	IF1701	6	5,925,600.00	-292,620.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-292,620.00
股指期货投资本期收益（元）					-462,144.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-347,880.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体除海通证券(600837)，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 日海通证券股份有限公司（下称海通证券，股票代码：600837）《海通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》，海通证券于近日收到了《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（【2016】127 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 28,653,000.00 元，并处以 85,959,000.00 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	1,259,747.71
2	应收证券清算款	346,593.61
3	应收股利	-
4	应收利息	1,428.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,607,769.79

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601375	中原证券	106,780.00	0.01	新股锁定
2	603228	景旺电子	80,851.56	0.01	新股锁定

§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
22,152	33,459.71	530,052,924.00	71.51%	211,146,527.00	28.49%

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－南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基 金联接基金	524,944,419.00	70.82%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行－南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

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	杨京京	4,206,454.00	0.57%
2	刘剑	2,500,000.00	0.34%
3	国信证券股份有限公司	1,984,885.00	0.27%
4	毛燕蓉	1,700,000.00	0.23%
5	黄爱萍	1,612,873.00	0.22%
6	孙奇峰	1,435,720.00	0.19%
7	陈淑兰	1,335,254.00	0.18%
8	蔡景玲	1,277,829.00	0.17%
9	徐国忠	1,227,417.00	0.17%

10	王宏图	1,180,000.00	0.16%
11	中国工商银行－南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基 金	524,944,419.00	70.82%

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（2013年2月18日）基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	839,199,451.00
本报告期基金总申购份额	134,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	232,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	741,199,451.00

§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 91,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 4 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	219,097,905.03	60.72%	21,910.17	60.72%	-
申万宏源	2	141,747,885.33	39.28%	14,174.99	39.28%	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

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

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

A：选择标准

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

B：选择流程

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

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	77,452.00	18.29%	16,400,000.00	100.00%	-	-
申万宏源	346,078.30	81.71%	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证券报、上海 证券报、证券 时报	2016 年 10 月 25 日
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	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招 募说明书（更新）（2016 年第 2 号）	中国证券报、上海 证券报、证券 时报	2016 年 9 月 21 日
4	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招 募说明书（更新）摘要（2016 年第 2 号）	中国证券报、上海 证券报、证券 时报	2016 年 9 月 21 日
5	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金	中国证券报、上	2016 年 8 月 29 日

	2016 年半年度报告（摘要）	海证券报、证券时报	
6	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 29 日
7	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 7 月 21 日
8	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 20 日
9	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
10	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 30 日
11	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 30 日
12	南方基金管理有限公司电子交易赎回转认/申购业务规则	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 28 日
13	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2016 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 25 日
14	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）（2016 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 25 日

15	关于南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金变更基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 5 日
16	南方基金关于临时暂停电子直销实时赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 15 日
17	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 21 日
18	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
19	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
20	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日
21	关于南方基金管理有限公司旗下部分基金净值揭示异常的提示	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日
22	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日
23	南方基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 4 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立开元证券投资基金的文件。
- 2、《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。
- 3、《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。
- 4、《开元证券投资基金基金合同》。
- 5、《开元证券投资基金托管协议》。
- 6、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 7、报告期内在选定报刊披露的各项公告。

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>