

上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 08 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录

- 1.1 重要提示
- 1.2 目录

§2 基金简介

- 2.1 基金基本情况
- 2.2 基金产品说明
- 2.3 基金管理人和基金托管人
- 2.4 信息披露方式
- 2.5 其他相关资料

§3 主要财务指标和基金净值表现

- 3.1 主要会计数据和财务指标
- 3.2 基金净值表现
- 3.3 其他指标

§4 管理人报告

- 4.1 基金管理人及基金经理情况
- 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明
- 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
- 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
- 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
- 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
- 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
- 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

§5 托管人报告

- 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明
- 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
- 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

- 6.1 资产负债表
- 6.2 利润表
- 6.3 所有者权益（基金净值）变动表
- 6.4 报表附注

§7 投资组合报告

- 7.1 期末基金资产组合情况
- 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
- 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
- 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

- 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
- 7.6 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
- 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
- 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
- 7.9 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
- 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- 7.12 投资组合报告附注

§ 8 基金份额持有人信息

- 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
- 8.2 期末上市基金前十名持有人
- 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
- 8.4 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
- 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

§ 9 开放式基金份额变动

§ 10 重大事件揭示

- 10.1 基金份额持有人大会决议
- 10.2 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
- 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
- 10.4 基金投资策略的改变
- 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
- 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
- 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
- 10.8 其他重大事件

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

- 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况
- 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

§ 12 备查文件目录

- 12.1 备查文件目录
- 12.2 存放地点
- 12.3 查阅方式

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方上证 380ETF
场内简称	380ETF
基金主代码	510290
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 16 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	162,448,915.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 11 月 8 日

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“380ETF”。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。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。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为上证 380 指数，简称 380 指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数

	的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
--	--------------------------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	鲍文革	田青
	联系电话	0755-82763888	010-67595096
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-8899	010-67595096
传真		0755-82763889	010-66275853
注册地址		深圳市福田区中心区福华一路六号 免税商务大厦塔楼 31、32、33 层 整层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区中心区福华一路六号 免税商务大厦塔楼 31、32、33 层 整层	北京市西城区闹市口大街一 号院一号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		张海波	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网 网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	南方基金管理有限公司	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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2017 年 1 月 1 日-2017 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	6,855,820.65
本期利润	2,247,196.61
加权平均基金份额本期利润	0.0136
本期加权平均净值利润率	0.87%
本期基金份额净值增长率	0.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017 年 06 月 30 日）

期末可供分配利润	69,233,990.85
期末可供分配基金份额利润	0.4262
期末基金资产净值	251,347,073.04
期末基金份额净值	1.5472
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2017 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	54.72%

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。

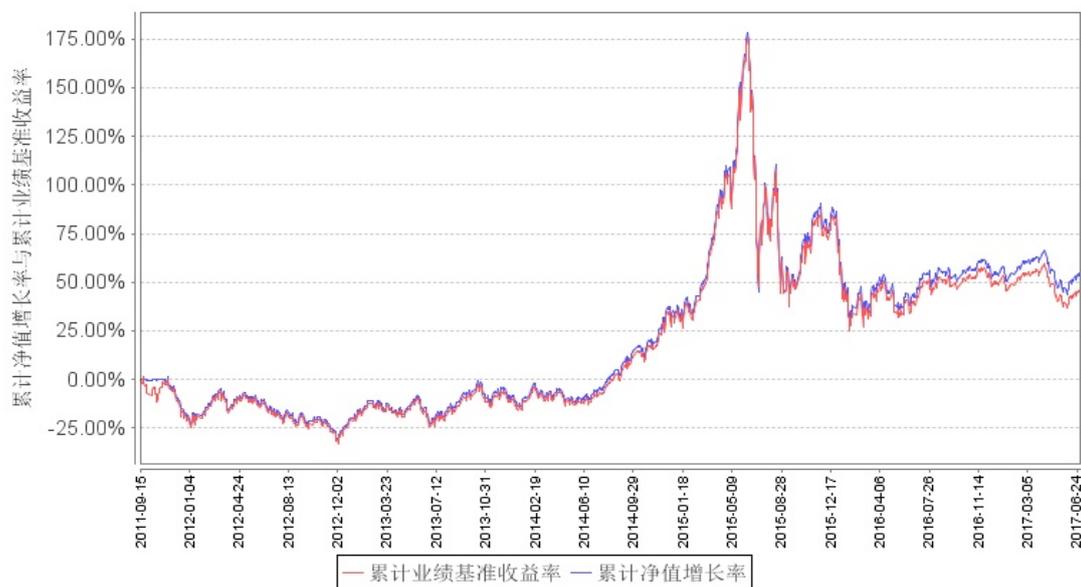
3.2 基金净值表现

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	净值增长率① (%)	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 (%)
过去一个月	5.57	0.87	5.11	0.88	0.46	-0.01
过去三个月	-3.66	1.00	-4.97	1.00	1.31	0.00
过去六个月	0.53	0.84	-1.95	0.85	2.48	-0.01
过去一年	5.42	0.88	2.32	0.88	3.10	0.00
过去三年	66.98	2.18	61.36	2.13	5.62	0.05
自基金合同 生效起至今	54.72	1.82	46.05	1.81	8.67	0.01

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

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



§ 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）管理资产规模超过 6,500 亿元，旗下管理 134 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		
周豪	本基金基	2016年8月19		9	北京大学软件工程

	金经理	日			专业硕士,具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金信息技术部,长期负责指数基金及 ETF 基金的投研及系统支持工作; 2015 年 6 月,任数量化投资部高级研究员; 2016 年 4 月至今,任 500 工业 ETF、500 原材料 ETF 基金经理; 2016 年 8 月至今,任 380ETF、南方 380、小康 ETF、南方小康、互联基金基金经理; 2016 年 9 月至今,任 1000ETF 基金经理。
--	-----	---	--	--	--

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金持有人利益。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 公平交易制度的执行情况

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

公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析,对本报告期内,两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占优比等因素进行

了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 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 2 次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数型基金成份股调整所致。

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

本报告期内上证 380 指数下跌 1.95%。

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) 申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- (2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离。
- (3) 根据指数半年度成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.5472 元，报告期内，份额净值增长率为 0.53%，同期业绩基准增长率为-1.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观来看，国内经济企稳，随着供给侧改革、“一带一路”战略深化，经济有望保持稳中求进的发展态势，对市场形成长期支撑；另一方面，金融去杠杆、加强监管仍是主基调，同时国际政治、经济环境也面临较大不确定性，预计下半年行情将以存量博弈为主，维持震荡格局。

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、权益研究部总监、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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。在收益评价日，基金管理人计算基金份额净值增长率和标的指数同期增长率。基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；本基金每年收益分配次数最多为 12 次，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定。基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；本基金收益分配采取现金分红方式；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未有收益分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：上证 380 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.4.1	2,125,036.75	1,118,075.39
结算备付金		28,642.17	-
存出保证金		5,656.47	1,515.33
交易性金融资产	6.4.4.2	249,358,144.01	258,604,736.46
其中：股票投资		249,358,144.01	258,604,736.46
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	6.4.4.3	-	-

资产			
买入返售 金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券 清算款		222,218.14	15,940.01
应收利息	6.4.4.5	587.00	246.34
应收股利		-	-
应收申购 款		-	-
递延所得 税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		251,740,284.54	259,740,513.53
负债和所 有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金 融负债		-	-
衍生金融 负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购 金融资产 款		-	-
应付证券 清算款		-	-
应付赎回 款		-	-
应付管理 人报酬		101,110.59	111,569.45
应付托管 费		20,222.13	22,313.88
应付销售 服务费		-	-
应付交易 费用	6.4.4.7	12,971.20	63,248.25
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得 税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	258,907.58	289,955.86
负债合计		393,211.50	487,087.44
所有者权			

益：			
实收基金	6.4.4.9	162,448,915.00	168,448,915.00
未分配利润	6.4.4.10	88,898,158.04	90,804,511.09
所有者权益合计		251,347,073.04	259,253,426.09
负债和所有者权益总计		251,740,284.54	259,740,513.53

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5472 元，基金份额总额 162,448,915.00 份。

6.2 利润表

会计主体：上证 380 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		3,423,026.07	-60,937,119.78
1. 利息收入		9,693.25	20,555.67
其中：存款利息收入	6.4.4.11	9,685.22	20,447.48
债券利息收入		8.03	108.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,981,734.85	-11,214,258.80
其中：股票投资收益	6.4.4.12	6,043,102.17	-12,846,435.01
基金投资收益	6.4.4.13	-	-
债券投资收益	6.4.4.14	2,789.17	66,057.71
资产支持证券投资收益	6.4.4.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.4.15	-	-
衍生工具收益	6.4.4.16	-	-
股利收益	6.4.4.17	1,935,843.51	1,566,118.50

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	-4,608,624.04	-49,668,337.28
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.19	40,222.01	-75,079.37
减：二、费用		1,175,829.46	1,134,330.33
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	638,405.41	654,836.44
2. 托管费	6.4.7.2.2	127,681.07	130,967.29
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.4.20	69,791.01	53,803.12
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.4.21	339,951.97	294,723.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,247,196.61	-62,071,450.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,247,196.61	-62,071,450.11

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证 380 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	168,448,915.00	90,804,511.09	259,253,426.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	2,247,196.61	2,247,196.61
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）	-6,000,000.00	-4,153,549.66	-10,153,549.66
其中：1. 基金申购款	56,000,000.00	32,722,219.79	88,722,219.79
2. 基金赎回	-62,000,000.00	-36,875,769.45	-98,875,769.45

回款			
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)	162,448,915.00	88,898,158.04	251,347,073.04
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	166,448,915.00	140,039,029.53	306,487,944.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-62,071,450.11	-62,071,450.11
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)	12,000,000.00	5,484,185.69	17,484,185.69
其中:1.基金申购款	60,000,000.00	26,004,469.55	86,004,469.55
2.基金赎回款	-48,000,000.00	-20,520,283.86	-68,520,283.86
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)	178,448,915.00	83,451,765.11	261,900,680.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

杨小松

徐超

徐超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.2.2 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。

6.4.2.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 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。

6.4.4 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	2,125,036.75
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限 1 个月以内	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	2,125,036.75

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	254,566,118.46	249,358,144.01	-5,207,974.45
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	254,566,118.46	249,358,144.01	-5,207,974.45

注：于 2017 年 6 月 30 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 0.00。

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.4.4 买入返售金融资产

6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	571.60
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	12.90
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	2.50
合计	587.00

6.4.4.6 其他资产

注：无。

6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	12,971.20
银行间市场应付交易费用	-
合计	12,971.20

6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	208,273.08
其他	-
应付指数使用费	50,000.00
应退替代款	-
可退替代款	634.50
合计	258,907.58

6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	168,448,915.00	168,448,915.00
本期申购	56,000,000.00	56,000,000.00

本期赎回（以“-”号填列）	-62,000,000.00	-62,000,000.00
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	162,448,915.00	162,448,915.00

6.4.4.10 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	64,818,058.16	25,986,452.93	90,804,511.09
本期利润	6,855,820.65	-4,608,624.04	2,247,196.61
本期基金份额交易产生的变动数	-2,439,887.96	-1,713,661.70	-4,153,549.66
其中：基金申购款	23,327,876.17	9,394,343.62	32,722,219.79
基金赎回款	-25,767,764.13	-11,108,005.32	-36,875,769.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	69,233,990.85	19,664,167.19	88,898,158.04

6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	8,993.66
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	663.30
其他	28.26
合计	9,685.22

6.4.4.12 股票投资收益

6.4.4.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,738,787.16
股票投资收益——赎回差价收入	1,304,315.01
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	6,043,102.17

6.4.4.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	37,701,787.74
减：卖出股票成本总额	32,963,000.58
买卖股票差价收入	4,738,787.16

6.4.4.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	98,875,769.45
减：现金支付赎回款总额	-7,808.55
减：赎回股票成本总额	97,579,262.99
赎回差价收入	1,304,315.01

6.4.4.13 债券投资收益

6.4.4.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	39,797.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	37,000.00
减：应收利息总额	8.03
买卖债券差价收入	2,789.17

6.4.4.13.2 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.4.14 贵金属投资收益

注：无。

6.4.4.15 衍生工具收益

注：无。

6.4.4.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,935,843.51
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,935,843.51

6.4.4.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-4,608,624.04
股票投资	-4,608,624.04
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
其他	-
合计	-4,608,624.04

注：本基金本报告期公允价值变动收益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益-968.00 元(上年度可比期间：0.00 元)。

6.4.4.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	40,222.01
合计	40,222.01

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。

6.4.4.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	69,791.01
银行间市场交易费用	-
合计	69,791.01

6.4.4.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,767.52
指数使用费	129,786.14
银行费用	1,892.75
上市费	29,752.78
合计	339,951.97

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

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“上证 380ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 6 月 30 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	78,720,752.64	100.00	-	-

6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
华泰证券	76,787.16	100.00	-	-

6.4.7.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.7.1.4 权证交易

注：无。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30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	25,112.91	100.00	12,971.20	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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	-	-	-	-

注：： 1. 上述佣金按市场佣金率计算，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。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	638,405.41	654,836.44
其中：支付销售机构的客户维护费	81,846.55	-

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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.5\% / \text{当年天数}$ 。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	127,681.07	130,967.29

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}$ 。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.7.4.2 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：人民币元

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
上证 380ETF 联接基金	132,399,941.00	81.50	138,399,941.00	82.16

注：： 上证 380ETF 联接基金和华泰证券投资本基金相关的费用按基金合同和更新的招募说明书的有关规定以及与券商约定的席位佣金费率支付。

6.4.7.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	2,125,036.75	8,993.66	2,762,361.38	19,814.27

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 利润分配情况

6.4.8.1 利润分配情况

注：无。

6.4.9 期末本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.12.1.1 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：)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新股认购	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新股认购	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新股认购	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新股认购	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-

6.4.9.2 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
600666	奥瑞德	2017-04-27	重大资产重组	17.40	-	-	72,540	1,418,718.94	1,262,196.00	-
600673	东阳光科	2016-11-15	重大资产重组	7.29	-	-	136,892	996,518.57	997,942.68	-
600655	豫园商城	2016-12-20	重大资产重组	11.32	-	-	80,900	907,629.31	915,788.00	-
600490	鹏欣资源	2017-02-21	重大资产重组	7.91	-	-	108,700	839,665.05	859,817.00	-
600172	黄河旋风	2017-06-30	重要事项未公告	8.23	2017-07-14	8.00	100,972	944,402.75	830,999.56	-
600255	鑫科材料	2017-06-26	重要事项未公告	4.04	-	-	179,000	814,486.42	723,160.00	-
600634	富控互动	2017-04-19	重大资产重组	18.03	2017-07-17	17.21	38,000	761,891.17	685,140.00	-
600568	中珠医疗	2017-04-25	重大资产重组	19.16	2017-07-27	6.15	34,700	888,156.25	664,852.00	-
600239	云南城投	2017-06-26	重要事项未公告	5.22	-	-	112,820	456,817.77	588,920.40	-
600577	精达股份	2017-06-26	重大资产重组	4.80	2017-07-10	4.50	117,800	580,686.06	565,440.00	-
600277	亿利洁能	2017-03-06	重大资产重组	7.83	-	-	67,688	614,915.35	529,997.04	-
600559	XD 老白干	2017-01-23	重大资产重组	22.69	-	-	22,332	475,141.15	506,713.08	-
600289	XD 亿阳信	2017-05-10	重要事项未公告	10.94	2017-08-18	12.03	43,775	618,748.19	478,898.50	-
601069	西部黄金	2017-04-17	重大资产重组	26.26	-	-	18,100	393,511.26	475,306.00	-
600460	士兰微	2017-05-12	重大资产重组	6.07	2017-08-15	6.68	73,845	466,274.15	448,239.15	-
601001	大同煤业	2017-06-22	重要事项未公告	5.25	2017-07-21	5.78	84,071	485,292.43	441,372.75	-
603126	中材	2017-	重要事	16.46	-	-	24,500	331,044.8	403,270.0	-

	节能	06-27	项未公告					3	0	
600636	*ST 爱富	2016-05-09	重大资产重组	13.86	-	-	28,530	379,379.70	395,425.80	-
600657	信达地产	2017-02-20	重大资产重组	5.76	2017-08-10	6.19	60,300	367,347.69	347,328.00	-
600318	新力金融	2017-04-27	公司申请停牌对相关事项进行核查	10.73	2017-08-08	11.50	28,600	377,092.34	306,878.00	-
600468	百利电气	2017-05-16	重大资产重组	6.50	-	-	32,205	284,982.19	209,332.50	-
603861	XD 白云电	2017-06-15	重大资产重组	24.27	-	-	8,300	222,071.61	201,441.00	-
601313	江南嘉捷	2017-06-12	重大资产重组	8.79	-	-	8,994	107,300.86	79,057.26	-

注：： 本基金截至 2017 年 6 月 30 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪上证 380 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪上证 380 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体

系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部对公司总经理负责。

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。

6.4.10.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。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，且通过分散化投资以分散信用风险。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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2016 年 12 月 31 日：同）。

6.4.10.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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

基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.8 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 2017 年 6 月 30 日，本基金所持有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（2016 年 12 月 31 日：同）。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。

6.4.10.4 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。

6.4.10.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金等，其余金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,125,036.75	-	-	-	2,125,036.75
结算备付金	28,642.17	-	-	-	28,642.17
存出保证金	5,656.47	-	-	-	5,656.47
交易性金融资产	-	-	-	249,358,144.01	249,358,144.01
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	587	587
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	222,218.14	222,218.14
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,159,335.39	-	-	249,580,949.15	251,740,284.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	101,110.59	101,110.59
应付托管费	-	-	-	20,222.13	20,222.13

应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	12,971.20	12,971.20
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	258,907.58	258,907.58
负债总计	-	-	-	393,211.50	393,211.50
利率敏感度缺口	2,159,335.39	-	-	-249,187,737.65	251,347,073.04
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,118,075.39	-	-	-	1,118,075.39
存出保证金	1,515.33	-	-	-	1,515.33
交易性金融资产	-	-	-	258,604,736.46	258,604,736.46
应收利息	-	-	-	246.34	246.34
应收证券清算款	-	-	-	15,940.01	15,940.01
资产总计	1,119,590.72	-	-	258,620,922.81	259,740,513.53
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	111,569.45	111,569.45
应付托管费	-	-	-	22,313.88	22,313.88
应付交易费用	-	-	-	63,248.25	63,248.25
其他负债	-	-	-	289,955.86	289,955.86
负债总计	-	-	-	487,087.44	487,087.44
利率敏感度缺口	1,119,590.72	-	-	258,133,835.37	259,253,426.09

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。

6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2017 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2016 年 12 月 31 日：同)。

6.4.10.4.2 其他价格风险

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

市场整体波动的影响。 本基金采用完全复制法，跟踪上证 380 指数指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，上证 380 指数指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.10.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016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	249,358,144.01	99.21	258,604,736.46	99.75
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	249,358,144.01	99.21	258,604,736.46	99.75

6.4.10.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升 5%	12,400,000.00	12,750,000.00

	业绩比较基准下降 5%	-12,400,000.00	-12,750,000.00
--	----------------	----------------	----------------

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。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 投资组合报告

7.1 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	249,358,144.01	99.05
	其中：股票	249,358,144.01	99.05
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	2,153,678.92	0.86
-	-	-	-
-	其他各项资产	228,461.61	0.09

-	合计	251,740,284.54	100.00
---	----	----------------	--------

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（指数投资部分）

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	588,192.70	0.23
B	采矿业	11,492,022.54	4.57
C	制造业	146,938,137.96	58.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,171,825.75	6.43
E	建筑业	5,683,553.28	2.26
F	批发和零售业	18,569,198.65	7.39
G	交通运输、仓储和邮政业	16,018,410.86	6.37
H	住宿和餐饮业	439,020.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,493,707.48	2.58
J	金融业	1,103,538.00	0.44
K	房地产业	8,149,267.23	3.24
L	租赁和商务服务业	5,470,063.78	2.18
M	科学研究和技术服务业	1,009,488.00	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	1,800,515.00	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	311,293.53	0.12
Q	卫生和社会工作	491,764.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	5,314,767.00	2.11
S	综合	1,403,439.60	0.56
	合计	247,448,205.36	98.45

报告期末按行业分类的境内股票投资组合（积极投资部分）

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	917,920.65	0.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和	-	-

	邮政业		
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	685,140.00	0.27
J	金融业	306,878.00	0.12
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	1,909,938.65	0.76

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600309	万华化学	138,920	3,978,668.80	1.58
2	600660	福耀玻璃	142,500	3,710,700.00	1.48
3	601888	中国国旅	99,200	2,989,888.00	1.19
4	600487	亨通光电	88,337	2,477,852.85	0.99
5	603288	海天味业	55,000	2,242,900.00	0.89
6	600867	通化东宝	121,440	2,215,065.60	0.88
7	600201	生物股份	62,262	2,214,659.34	0.88
8	600352	浙江龙盛	231,400	2,205,242.00	0.88
9	600674	川投能源	223,700	2,196,734.00	0.87
10	600176	中国巨石	178,018	1,954,637.64	0.78
11	600436	片仔癀	30,595	1,867,518.80	0.74
12	600525	长园集团	133,805	1,818,409.95	0.72
13	600642	申能股份	277,644	1,749,157.20	0.70
14	600398	海澜之家	182,642	1,733,272.58	0.69
15	600682	南京新百	44,576	1,644,854.40	0.65
16	600004	白云机场	87,021	1,606,407.66	0.64

17	600027	华电国际	331,100	1,599,213.00	0.64
18	600584	长电科技	96,784	1,553,383.20	0.62
19	601168	西部矿业	193,774	1,490,122.06	0.59
20	600879	航天电子	165,800	1,457,382.00	0.58
21	600998	九州通	67,000	1,444,520.00	0.57
22	600056	中国医药	54,260	1,408,047.00	0.56
23	600583	海油工程	224,700	1,402,128.00	0.56
24	601098	中南传媒	73,000	1,360,720.00	0.54
25	600426	华鲁恒升	115,262	1,353,175.88	0.54
26	600388	龙净环保	86,907	1,349,665.71	0.54
27	600166	福田汽车	474,500	1,347,580.00	0.54
28	600498	烽火通信	53,100	1,346,085.00	0.54
29	600521	华海药业	63,588	1,337,891.52	0.53
30	600161	天坛生物	34,120	1,324,197.20	0.53
31	600256	广汇能源	318,300	1,317,762.00	0.52
32	600373	中文传媒	55,800	1,311,858.00	0.52
33	600666	奥瑞德	72,540	1,262,196.00	0.50
34	600600	青岛啤酒	35,357	1,241,030.70	0.49
35	600138	中青旅	58,913	1,240,707.78	0.49
36	601000	唐山港	231,625	1,209,082.50	0.48
37	600260	凯乐科技	47,500	1,203,650.00	0.48
38	600614	鹏起科技	107,600	1,183,600.00	0.47
39	600511	国药股份	31,025	1,124,346.00	0.45
40	601997	贵阳银行	69,800	1,103,538.00	0.44
41	603019	中科曙光	39,200	1,103,088.00	0.44
42	600038	中直股份	23,833	1,090,836.41	0.43
43	600298	安琪酵母	41,873	1,083,254.51	0.43
44	600885	宏发股份	27,100	1,081,019.00	0.43
45	600755	厦门国贸	117,888	1,075,138.56	0.43
46	600635	大众公用	196,712	1,072,080.40	0.43
47	600717	天津港	85,100	1,062,899.00	0.42
48	600409	三友化工	104,861	1,055,950.27	0.42
49	600240	华业资本	115,300	1,044,618.00	0.42
50	600872	中炬高新	56,705	1,037,701.50	0.41
51	601231	环旭电子	66,026	1,037,268.46	0.41
52	600122	宏图高科	93,400	1,036,740.00	0.41
53	600633	浙数文化	52,900	1,022,028.00	0.41
54	601238	广汽集团	39,060	1,017,903.60	0.40
55	600500	中化国际	105,900	1,012,404.00	0.40
56	600418	江淮汽车	95,800	1,010,690.00	0.40
57	600062	华润双鹤	36,666	1,005,748.38	0.40
58	600673	东阳光科	136,892	997,942.68	0.40

59	600143	金发科技	164,917	994,449.51	0.40
60	600567	山鹰纸业	276,247	988,964.26	0.39
61	600594	益佰制药	64,126	978,562.76	0.39
62	600312	平高电气	68,596	942,509.04	0.37
63	600811	东方集团	144,550	942,466.00	0.37
64	600566	济川药业	24,600	935,538.00	0.37
65	600884	杉杉股份	56,800	935,496.00	0.37
66	600967	内蒙一机	68,392	932,182.96	0.37
67	600372	中航电子	53,400	927,558.00	0.37
68	601880	大连港	312,975	926,406.00	0.37
69	600970	中材国际	106,480	925,311.20	0.37
70	600026	中远海能	138,400	917,592.00	0.37
71	600655	豫园商城	80,900	915,788.00	0.36
72	600685	中船防务	33,400	914,492.00	0.36
73	600499	科达洁能	114,200	906,748.00	0.36
74	600183	生益科技	73,360	905,262.40	0.36
75	600856	中天能源	80,300	904,178.00	0.36
76	600664	哈药股份	154,269	896,302.89	0.36
77	600863	内蒙华电	293,778	884,271.78	0.35
78	600787	中储股份	111,300	880,383.00	0.35
79	600572	康恩贝	126,972	878,646.24	0.35
80	601877	正泰电器	43,469	873,292.21	0.35
81	600874	创业环保	44,150	864,015.50	0.34
82	600490	鹏欣资源	108,700	859,817.00	0.34
83	600881	亚泰集团	165,024	838,321.92	0.33
84	600172	黄河旋风	100,972	830,999.56	0.33
85	600125	铁龙物流	92,448	828,334.08	0.33
86	603077	和邦生物	162,370	826,463.30	0.33
87	600348	阳泉煤业	121,600	824,448.00	0.33
88	601021	春秋航空	24,310	817,545.30	0.33
89	600477	杭萧钢构	53,500	816,410.00	0.32
90	600711	盛屯矿业	121,100	804,104.00	0.32
91	600486	扬农化工	18,967	800,597.07	0.32
92	600597	光明乳业	62,500	796,875.00	0.32
93	600410	华胜天成	89,844	796,017.84	0.32
94	601058	赛轮金宇	232,040	793,576.80	0.32
95	600416	湘电股份	57,700	790,490.00	0.31
96	603766	隆鑫通用	106,893	778,181.04	0.31
97	600687	刚泰控股	60,240	775,891.20	0.31
98	600582	天地科技	168,260	772,313.40	0.31
99	600200	江苏吴中	58,400	770,880.00	0.31
100	600226	瀚叶股份	87,230	770,240.90	0.31

101	600039	四川路桥	183,286	762,469.76	0.30
102	600210	紫江企业	123,300	757,062.00	0.30
103	600282	南钢股份	201,300	746,823.00	0.30
104	600823	世茂股份	151,760	743,624.00	0.30
105	603000	人民网	56,200	740,154.00	0.29
106	601689	拓普集团	22,100	740,129.00	0.29
107	600086	东方金钰	68,300	738,323.00	0.29
108	600557	康缘药业	43,927	729,627.47	0.29
109	600380	健康元	80,195	728,170.60	0.29
110	600255	鑫科材料	179,000	723,160.00	0.29
111	600648	外高桥	38,614	715,131.28	0.28
112	600420	现代制药	45,100	707,619.00	0.28
113	600502	安徽水利	91,890	706,634.10	0.28
114	601958	金钼股份	98,400	705,528.00	0.28
115	600366	宁波韵升	39,700	700,308.00	0.28
116	600611	大众交通	126,526	698,423.52	0.28
117	600270	外运发展	36,798	696,586.14	0.28
118	600694	大商股份	17,873	696,510.81	0.28
119	600835	上海机电	32,790	693,180.60	0.28
120	600491	龙元建设	64,100	687,793.00	0.27
121	600267	海正药业	58,860	687,484.80	0.27
122	600803	新奥股份	49,900	685,626.00	0.27
123	600563	法拉电子	13,727	678,251.07	0.27
124	600323	瀚蓝环境	46,677	677,283.27	0.27
125	600343	航天动力	38,900	674,526.00	0.27
126	600116	三峡水利	60,150	674,281.50	0.27
127	600562	国睿科技	24,285	668,808.90	0.27
128	601678	滨化股份	96,110	667,964.50	0.27
129	600993	马应龙	30,608	666,642.24	0.27
130	600568	中珠医疗	34,700	664,852.00	0.26
131	600729	重庆百货	24,770	664,826.80	0.26
132	600742	一汽富维	34,400	657,384.00	0.26
133	600438	通威股份	117,800	657,324.00	0.26
134	600098	广州发展	82,774	654,742.34	0.26
135	600765	中航重机	47,400	653,172.00	0.26
136	600756	浪潮软件	32,800	649,112.00	0.26
137	600623	华谊集团	56,849	641,825.21	0.26
138	600073	上海梅林	66,740	637,367.00	0.25
139	600422	昆药集团	56,152	636,763.68	0.25
140	600750	江中药业	18,307	636,168.25	0.25
141	600300	维维股份	118,900	634,926.00	0.25
142	600175	美都能源	145,416	632,559.60	0.25

143	601666	平煤股份	120,011	632,457.97	0.25
144	603588	高能环境	40,300	628,680.00	0.25
145	600391	航发科技	23,400	626,418.00	0.25
146	600612	老凤祥	12,733	623,535.01	0.25
147	600273	嘉化能源	66,400	622,832.00	0.25
148	601016	节能风电	168,100	618,608.00	0.25
149	600269	赣粤高速	118,600	617,906.00	0.25
150	600162	香江控股	172,015	617,533.85	0.25
151	603188	亚邦股份	35,200	613,888.00	0.24
152	601636	旗滨集团	135,803	612,471.53	0.24
153	601311	骆驼股份	43,100	610,296.00	0.24
154	600990	四创电子	9,776	606,014.24	0.24
155	600495	晋西车轴	85,888	605,510.40	0.24
156	600284	浦东建设	56,372	604,307.84	0.24
157	600668	尖峰集团	34,980	600,956.40	0.24
158	600651	飞乐音响	70,586	597,863.42	0.24
159	600667	太极实业	85,595	596,597.15	0.24
160	600337	美克家居	105,566	596,447.90	0.24
161	600326	西藏天路	53,900	595,056.00	0.24
162	601890	亚星锚链	67,900	590,051.00	0.23
163	600239	云南城投	112,820	588,920.40	0.23
164	600578	京能电力	137,100	588,159.00	0.23
165	600587	新华医疗	33,006	586,846.68	0.23
166	600216	浙江医药	58,735	582,063.85	0.23
167	600261	阳光照明	88,512	581,523.84	0.23
168	600536	中国软件	30,094	576,601.04	0.23
169	600399	抚顺特钢	92,400	576,576.00	0.23
170	600761	安徽合力	43,965	575,941.50	0.23
171	600708	光明地产	86,650	575,356.00	0.23
172	600185	格力地产	83,800	569,002.00	0.23
173	600577	精达股份	117,800	565,440.00	0.22
174	601801	皖新传媒	40,400	558,328.00	0.22
175	600458	时代新材	48,740	558,073.00	0.22
176	600171	上海贝岭	54,720	556,502.40	0.22
177	600988	赤峰黄金	43,500	554,625.00	0.22
178	603885	吉祥航空	36,440	553,159.20	0.22
179	603111	康尼机电	45,000	549,000.00	0.22
180	600428	中远海特	87,223	542,527.06	0.22
181	600285	羚锐制药	48,177	541,027.71	0.22
182	603368	柳州医药	9,370	536,432.50	0.21
183	600123	兰花科创	69,600	530,352.00	0.21
184	601222	林洋能源	71,372	530,293.96	0.21

185	603883	老百姓	10,900	530,285.00	0.21
186	600986	科达股份	39,100	530,196.00	0.21
187	600277	亿利洁能	67,688	529,997.04	0.21
188	600236	桂冠电力	92,000	524,400.00	0.21
189	600329	中新药业	28,895	523,288.45	0.21
190	600517	置信电气	68,856	521,239.92	0.21
191	601233	桐昆股份	37,539	520,290.54	0.21
192	600206	有研新材	59,700	518,196.00	0.21
193	600894	广日股份	43,700	517,408.00	0.21
194	600662	强生控股	64,200	515,526.00	0.21
195	600736	苏州高新	72,827	514,886.89	0.20
196	601777	力帆股份	63,818	513,096.72	0.20
197	603888	新华网	15,800	511,762.00	0.20
198	600859	王府井	31,548	509,500.20	0.20
199	600559	XD 老白干	22,332	506,713.08	0.20
200	600400	红豆股份	73,590	506,299.20	0.20
201	600363	联创光电	36,100	505,761.00	0.20
202	603369	今世缘	38,250	504,900.00	0.20
203	603556	海兴电力	11,500	504,735.00	0.20
204	603008	喜临门	27,900	496,899.00	0.20
205	600377	宁沪高速	50,450	494,410.00	0.20
206	600720	祁连山	63,141	494,394.03	0.20
207	603816	顾家家居	8,400	493,752.00	0.20
208	600395	盘江股份	67,300	493,309.00	0.20
209	600763	通策医疗	19,600	491,764.00	0.20
210	603160	汇顶科技	4,900	491,470.00	0.20
211	603899	晨光文具	28,142	489,670.80	0.19
212	601908	京运通	101,000	484,800.00	0.19
213	603355	莱克电气	8,200	481,914.00	0.19
214	600758	红阳能源	53,900	481,866.00	0.19
215	600012	皖通高速	35,612	481,118.12	0.19
216	601886	江河集团	46,914	480,868.50	0.19
217	600289	XD 亿阳信	43,775	478,898.50	0.19
218	600626	申达股份	50,600	477,158.00	0.19
219	600006	东风汽车	81,300	475,605.00	0.19
220	601069	西部黄金	18,100	475,306.00	0.19
221	600439	瑞贝卡	80,480	474,027.20	0.19
222	600188	兖州煤业	38,654	473,124.96	0.19
223	601126	四方股份	49,610	468,318.40	0.19
224	600405	动力源	58,004	467,512.24	0.19
225	600596	新安股份	55,249	466,854.05	0.19
226	600105	永鼎股份	57,600	464,832.00	0.18

227	603198	迎驾贡酒	24,400	464,332.00	0.18
228	600280	中央商场	58,356	462,763.08	0.18
229	600093	易见股份	34,300	460,649.00	0.18
230	600020	中原高速	91,353	460,419.12	0.18
231	600757	长江传媒	61,600	460,152.00	0.18
232	600053	九鼎投资	13,158	460,003.68	0.18
233	600641	万业企业	41,000	457,560.00	0.18
234	600869	智慧能源	67,674	455,446.02	0.18
235	600114	东睦股份	25,981	454,667.50	0.18
236	600507	方大特钢	53,250	454,222.50	0.18
237	600850	华东电脑	21,130	451,548.10	0.18
238	601567	三星医疗	43,325	451,446.50	0.18
239	600460	士兰微	73,845	448,239.15	0.18
240	600580	卧龙电气	65,482	446,587.24	0.18
241	600054	黄山旅游	26,066	445,728.60	0.18
242	600141	兴发集团	36,000	445,320.00	0.18
243	600684	珠江实业	50,600	445,280.00	0.18
244	601001	大同煤业	84,071	441,372.75	0.18
245	600754	锦江股份	16,200	439,020.00	0.17
246	600481	双良节能	82,346	437,257.26	0.17
247	600180	瑞茂通	31,000	435,240.00	0.17
248	600571	信雅达	31,264	434,569.60	0.17
249	603118	共进股份	31,820	433,706.60	0.17
250	600197	伊力特	22,150	432,589.50	0.17
251	600824	益民集团	74,979	428,879.88	0.17
252	600292	远达环保	39,680	427,750.40	0.17
253	600350	山东高速	68,450	424,390.00	0.17
254	600433	冠豪高新	76,600	422,832.00	0.17
255	600007	中国国贸	20,273	421,881.13	0.17
256	600195	中牧股份	21,616	419,134.24	0.17
257	601158	重庆水务	58,600	418,990.00	0.17
258	600987	航民股份	32,300	418,608.00	0.17
259	601002	晋亿实业	47,800	413,470.00	0.16
260	600537	亿晶光电	82,702	411,855.96	0.16
261	600846	同济科技	50,224	410,330.08	0.16
262	600531	豫光金铅	55,400	407,744.00	0.16
263	600387	海越股份	31,400	407,258.00	0.16
264	600862	中航高科	42,000	406,980.00	0.16
265	603126	中材节能	24,500	403,270.00	0.16
266	603979	金诚信	22,740	402,952.80	0.16
267	600748	上实发展	55,600	400,320.00	0.16
268	600743	华远地产	94,274	397,836.28	0.16

269	600459	贵研铂业	18,373	395,570.69	0.16
270	600838	上海九百	32,400	391,716.00	0.16
271	600676	交运股份	52,218	389,024.10	0.15
272	601139	深圳燃气	44,500	384,925.00	0.15
273	601515	东风股份	33,960	383,748.00	0.15
274	603308	应流股份	26,500	383,190.00	0.15
275	600251	冠农股份	48,000	382,560.00	0.15
276	600826	兰生股份	21,103	381,964.30	0.15
277	603686	龙马环卫	11,100	381,840.00	0.15
278	600996	贵广网络	31,600	378,252.00	0.15
279	603169	兰石重装	30,900	375,435.00	0.15
280	600965	福成股份	32,930	375,072.70	0.15
281	603939	益丰药房	11,100	374,070.00	0.15
282	600305	恒顺醋业	36,300	372,438.00	0.15
283	600335	国机汽车	31,025	371,059.00	0.15
284	603108	润达医疗	23,260	370,531.80	0.15
285	601799	星宇股份	8,300	367,026.00	0.15
286	600888	新疆众和	59,350	366,783.00	0.15
287	600830	香溢融通	36,800	362,848.00	0.14
288	600831	广电网络	36,450	362,677.50	0.14
289	600299	安迪苏	29,800	362,666.00	0.14
290	603989	艾华集团	9,200	361,008.00	0.14
291	600650	锦江投资	20,000	358,800.00	0.14
292	600775	南京熊猫	34,200	349,524.00	0.14
293	600657	信达地产	60,300	347,328.00	0.14
294	603699	纽威股份	22,563	347,018.94	0.14
295	600973	宝胜股份	61,375	343,700.00	0.14
296	603128	华贸物流	40,100	343,256.00	0.14
297	600075	新疆天业	39,300	342,696.00	0.14
298	601700	风范股份	56,850	340,531.50	0.14
299	600526	菲达环保	33,000	340,230.00	0.14
300	600776	东方通信	48,712	330,267.36	0.13
301	600483	福能股份	31,600	327,692.00	0.13
302	603338	浙江鼎力	4,900	323,057.00	0.13
303	600119	长江投资	21,900	321,930.00	0.13
304	603898	好莱客	9,200	321,540.00	0.13
305	600551	时代出版	20,300	320,537.00	0.13
306	603698	航天工程	12,600	317,520.00	0.13
307	600661	新南洋	14,499	311,293.53	0.12
308	601107	四川成渝	65,127	307,399.44	0.12
309	600897	厦门空港	11,999	304,534.62	0.12
310	603258	电魂网络	7,300	299,592.00	0.12

311	603568	伟明环保	13,800	298,356.00	0.12
312	603868	飞科电器	4,800	296,832.00	0.12
313	601368	绿城水务	29,800	293,232.00	0.12
314	600173	卧龙地产	44,000	292,600.00	0.12
315	603618	杭电股份	28,100	291,397.00	0.12
316	600310	桂东电力	42,200	289,492.00	0.12
317	603567	珍宝岛	17,100	287,793.00	0.11
318	601789	宁波建工	58,800	286,356.00	0.11
319	600845	宝信软件	16,874	284,326.90	0.11
320	600617	国新能源	29,800	283,994.00	0.11
321	603328	依顿电子	19,900	281,585.00	0.11
322	601595	上海电影	11,300	281,144.00	0.11
323	603997	继峰股份	19,000	277,590.00	0.11
324	603306	华懋科技	8,750	276,850.00	0.11
325	600697	欧亚集团	9,735	274,137.60	0.11
326	600077	宋都股份	68,300	272,517.00	0.11
327	600386	北巴传媒	20,489	272,503.70	0.11
328	603528	多伦科技	18,900	271,593.00	0.11
329	600113	浙江东日	19,200	265,536.00	0.11
330	600864	XD 哈投股	31,800	264,258.00	0.11
331	603806	福斯特	8,200	262,482.00	0.10
332	601199	江南水务	38,148	262,076.76	0.10
333	600381	青海春天	20,800	261,664.00	0.10
334	600548	深高速	28,800	260,352.00	0.10
335	600814	杭州解百	28,700	258,874.00	0.10
336	600818	中路股份	12,100	255,068.00	0.10
337	603508	思维列控	4,800	253,824.00	0.10
338	603165	荣晟环保	3,800	252,130.00	0.10
339	600295	鄂尔多斯	24,573	250,644.60	0.10
340	601968	宝钢包装	34,000	247,860.00	0.10
341	600167	联美控股	11,600	246,384.00	0.10
342	603358	华达科技	4,800	243,168.00	0.10
343	600891	秋林集团	31,200	243,048.00	0.10
344	603228	景旺电子	5,000	241,250.00	0.10
345	603609	禾丰牧业	25,000	239,000.00	0.10
346	603818	曲美家居	14,800	235,764.00	0.09
347	601020	华钰矿业	10,600	233,518.00	0.09
348	603168	莎普爱思	9,923	231,602.82	0.09
349	603515	欧普照明	6,400	231,168.00	0.09
350	603599	广信股份	15,200	229,976.00	0.09
351	603727	博迈科	7,100	229,046.00	0.09
352	603866	桃李面包	6,400	227,712.00	0.09

353	600101	明星电力	23,020	226,747.00	0.09
354	601038	一拖股份	24,000	221,520.00	0.09
355	600829	人民同泰	17,800	219,652.00	0.09
356	603239	浙江仙通	8,200	213,446.00	0.08
357	601015	陕西黑猫	28,050	213,180.00	0.08
358	600975	新五丰	33,300	213,120.00	0.08
359	600613	神奇制药	19,400	210,490.00	0.08
360	603861	XD 白云电	8,300	201,441.00	0.08
361	603298	杭叉集团	9,400	194,862.00	0.08
362	603737	三棵树	3,000	192,390.00	0.08
363	603639	海利尔	3,600	191,232.00	0.08
364	603098	森特股份	8,100	186,948.00	0.07
365	603628	清源股份	8,300	185,090.00	0.07
366	600981	汇鸿集团	24,800	183,768.00	0.07
367	603658	安图生物	4,200	181,020.00	0.07
368	603669	灵康药业	8,000	178,560.00	0.07
369	600917	重庆燃气	17,700	166,911.00	0.07
370	603060	国检集团	6,700	166,026.00	0.07
371	603798	康普顿	6,100	163,114.00	0.06
372	603339	四方冷链	6,300	162,918.00	0.06
373	603877	太平鸟	5,800	162,342.00	0.06
374	600828	茂业商业	19,230	159,993.60	0.06
375	603585	苏利股份	4,550	156,747.50	0.06
376	603569	长久物流	4,500	150,435.00	0.06
377	603929	亚翔集成	6,500	146,380.00	0.06
378	603025	大豪科技	5,000	132,000.00	0.05
379	603600	永艺股份	7,550	124,273.00	0.05
380	603959	百利科技	6,800	122,672.00	0.05

7.3.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600634	富控互动	38,000	685,140.00	0.27
2	600636	*ST 爱富	28,530	395,425.80	0.16
3	600318	新力金融	28,600	306,878.00	0.12
4	600468	百利电气	32,205	209,332.50	0.08
5	601313	江南嘉捷	8,994	79,057.26	0.03
6	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
7	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
8	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.01
9	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01

10	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
11	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
12	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
13	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
14	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
15	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

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	600674	川投能源	2,158,575.38	0.83
2	600352	浙江龙盛	2,145,928.00	0.83
3	600998	九州通	1,334,342.17	0.51
4	603288	海天味业	1,180,061.00	0.46
5	601997	贵阳银行	1,104,751.00	0.43
6	600490	鹏欣资源	1,085,700.00	0.42
7	600240	华业资本	1,071,786.00	0.41
8	600372	中航电子	808,357.00	0.31
9	600004	白云机场	735,752.00	0.28
10	600176	中国巨石	678,822.00	0.26
11	603556	海兴电力	542,312.00	0.21
12	603888	新华网	537,951.00	0.21
13	600623	华谊集团	492,892.00	0.19
14	603160	汇顶科技	468,115.00	0.18
15	603816	顾家家居	457,392.00	0.18
16	600162	香江控股	453,903.00	0.18
17	600053	九鼎投资	443,940.78	0.17
18	600754	锦江股份	438,473.47	0.17
19	600758	红阳能源	436,046.00	0.17
20	600838	上海九百	413,572.00	0.16

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

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	601012	隆基股份	1,912,700.56	0.74
2	601992	金隅股份	1,774,906.98	0.68
3	600008	首创股份	1,732,135.92	0.67
4	600170	上海建工	1,585,750.29	0.61
5	600718	东软集团	1,556,065.54	0.60
6	600497	驰宏锌锗	1,520,737.00	0.59

7	600809	山西汾酒	928,974.00	0.36
8	600017	日照港	824,284.00	0.32
9	601808	中海油服	696,358.00	0.27
10	600169	太原重工	681,463.36	0.26
11	600496	精工钢构	609,627.79	0.24
12	601010	文峰股份	551,014.72	0.21
13	600033	福建高速	550,365.00	0.21
14	600480	凌云股份	502,818.00	0.19
15	601212	白银有色	496,020.40	0.19
16	600063	皖维高新	482,684.00	0.19
17	600586	金晶科技	471,880.00	0.18
18	600135	乐凯胶片	461,511.00	0.18
19	601881	中国银河	460,483.44	0.18
20	600552	凯盛科技	432,596.00	0.17

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。

7.4.3 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	41,018,964.90
卖出股票收入（成交）总额	37,701,787.74

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

7.12.3 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	5,656.47
2	应收证券清算款	222,218.14
3	应收股利	-
4	应收利息	587.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	228,461.61

7.12.4 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。

7.12.5 股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末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。

7.12.5.2 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	公司名称	流通受限部分的公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600634	富控互动	685,140.00	0.27	重大资产重组
2	600636	*ST 爱富	395,425.80	0.16	重大资产重组

3	600318	新力金融	306,878.00	0.12	公司申请停牌对相关事项进行核查
4	600468	百利电气	209,332.50	0.08	重大资产重组
5	601313	江南嘉捷	79,057.26	0.03	重大资产重组

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
992	163,758.99	142,244,545.00	87.56	20,204,370.00	12.44

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例（%）
1	泰康资产强化回报混合型养老金产品— 中国建设银行股份有限公司	1,923,300.00	1.18
2	中国建设银行股份有限公司企业年金计 划—中国工商银行股份有限公司	1,611,200.00	0.99
3	中国石油天然气集团公司企业年金计划 —中国工商银行股份有限公司	1,572,800.00	0.97
4	方正证券股份有限公司	1,342,241.00	0.83
5	郑州煤炭工业（集团）有限责任公司企业 年金计划—中国建设银行股份有限公司	1,220,400.00	0.75
6	胡海燕	1,073,900.00	0.66
7	何之成	856,800.00	0.53
8	北京无限立通通讯技术有限责任公司	609,600.00	0.38
9	山西焦煤集团有限责任公司企业年金计 划—中国工商银行股份有限公司	576,800.00	0.36
10	刘晓梅	550,000.00	0.34

11	中国建设银行股份有限公司－南方上证 380 交易型开放式指数证券	132,399,941.00	81.50
----	----------------------------------	----------------	-------

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本公司的所有从业人员均未持有本基金份额。

8.4 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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 9 月 16 日）	330,448,915.00
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	168,448,915.00
本报告期基金总申购份额	56,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	62,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	162,448,915.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

南方基金管理有限公司第七届董事会第二次会议已于 2017 年 1 月 23 日审议通过了《公司关于聘任公司副总经理、督察长和财务负责人的议案》，秦长奎因任期届满，工作调整的原因不再担任公司副总经理职务。

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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	1	78,720,752.64	100.00	25,112.91	100.00	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
诚浩证券	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

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

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

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

10.7.2 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
诚浩证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	76,787.16	100.00	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-

银泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于上证 380 交易型开放式指数证券投资基金、中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金增加部分券商为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 5 月 15 日
2	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 24 日
3	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）（2017 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 21 日
4	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 21 日
5	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 30 日
6	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 30 日
7	上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 19 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金	1	20170101-20170630	138,399,941.00	-	6,000,000.00	132,399,941.00	81.50

金联接基金							
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注：申购份额包含红利在投资和份额折算。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立上证 380 交易型开放式指数证券投资基金的文件
- 2、上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、上证 380 交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>