

南方开元沪深 300 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：中国工商银行股份有限公司

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	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
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	725,199,451.00 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 年 4 月 11 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“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	95, 588
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	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	4,783,651.43
本期利润	124,070,516.58
加权平均基金份额本期利润	0.1684
本期加权平均净值利润率	11.87%
本期基金份额净值增长率	12.48%
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	277,300,751.71
期末可供分配基金份额利润	0.3824
期末基金资产净值	1,104,468,197.35
期末基金份额净值	1.5230
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	44.06%

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。

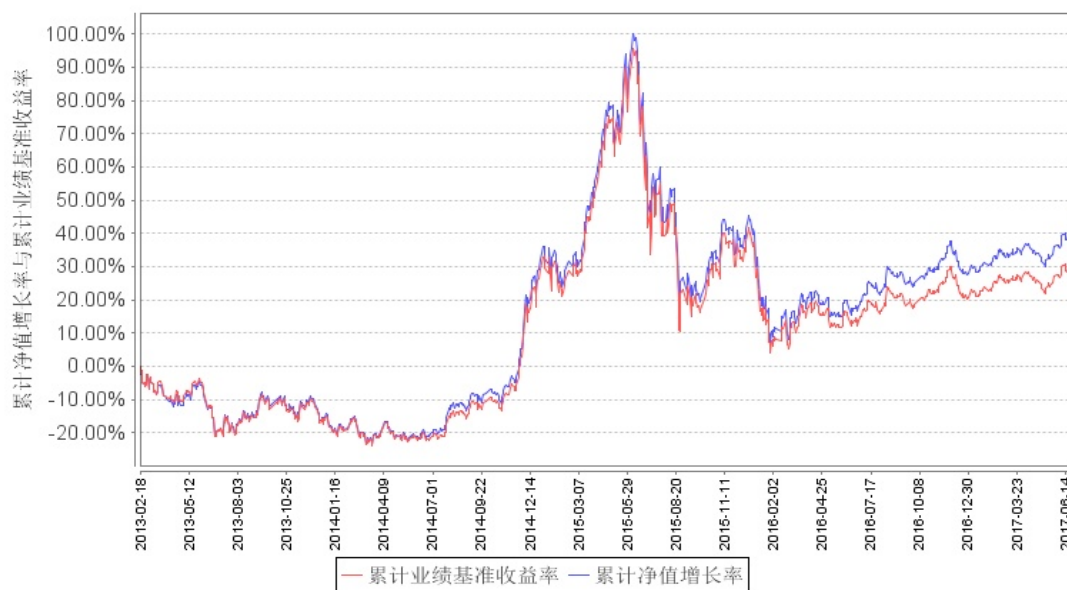
3.2 基金净值表现

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	5.59	0.65	4.98	0.68	0.61	-0.03
过去三个月	7.14	0.61	6.10	0.62	1.04	-0.01
过去六个月	12.48	0.56	10.78	0.57	1.70	-0.01
过去一年	20.52	0.67	16.26	0.67	4.26	0.00
过去三年	79.39	1.75	69.36	1.75	10.03	0.00
自基金合同 生效起至今	44.06	1.61	33.95	1.62	10.11	-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



- 注： 1. 本基金建仓期为三个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。
2. 本基金转型日期为 2013 年 2 月 18 日。
3. 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。

§ 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		
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 5 月 17 日		12	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，曾任南方基金量化投资部基金经理助理，现任指数投资部、数量化投资部负责人；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。

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《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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。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，两两组合同单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占优比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 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

报告期内，沪深 300 指数涨 10.78%。

期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”、“ETF 现金流精算系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本 ETF 基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

- ① 大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- ② 报告期内指数成份股（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

③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；

④6 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

自本基金上市以来至报告期末年化跟踪误差为 0.471%，较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过 2% 的投资目标。

截至报告期末，本基金份额净值为 1.5230 元，报告期内，份额净值增长率为 12.48%，同期业绩基准增长率为 10.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内，经济面稳增长力度开始重新回升，地方债发行增速转正，特别是中长期信贷支持经济增长的力度加大，三四线房地产销售连续超预期，对下半年经济或有支撑。海外来看，美国经济复苏预期回落，美元指数偏弱，年内人民币贬值压力迅速减小，给国内的货币政策创造了较大的回旋空间。经济回落、通胀压力不大，将给权益市场带来一定的转机。

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。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。

4.8 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 2017 半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：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	3,393,410.16	441,744.99
结算备付金		1,053,700.00	5,327,021.29
存出保证金		1,397,820.89	1,259,747.71
交易性金融资产	6.4.4.2	1,100,195,695.56	997,907,406.60
其中：股票投资		1,100,195,695.56	997,907,406.60
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		97,348.44	346,593.61
应收利息	6.4.4.5	1,107.01	1,428.47
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		1,106,139,082.06	1,005,283,942.67
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		70,591.20	5,548.93
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		441,372.06	435,639.06
应付托管费		88,274.41	87,127.79
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	13,911.41	15,786.70
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	1,056,735.63	1,120,232.28
负债合计		1,670,884.71	1,664,334.76
所有者权益:			
实收基金	6.4.4.9	827,167,445.64	845,417,154.91
未分配利润	6.4.4.10	277,300,751.71	158,202,453.00
所有者权益合计		1,104,468,197.35	1,003,619,607.91
负债和所有者权益总计		1,106,139,082.06	1,005,283,942.67

注： 报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5230 元，基金份额总额

725,199,451.00 份。

6.2 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：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		127,674,383.27	-177,494,708.71
1. 利息收入		21,184.20	26,622.50
其中：存款利息收入	6.4.4.11	21,070.93	26,553.70
债券利息收入		113.27	68.80
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）		8,366,333.92	-26,316,774.34
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-588,028.37	-35,595,425.49
基金投资收益	6.4.4.13	-	-
债券投资收益	6.4.4.14	19,266.73	25,057.19
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	-164,338.00	-787,380.00
股利收益	6.4.4.17	9,099,433.56	10,040,973.96
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	119,286,865.15	-151,144,902.53
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	-	-59,654.34

减：二、费用		3,603,866.69	3,660,108.17
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	2,589,156.68	2,631,530.15
2. 托管费	6.4.7.2.2	517,831.36	526,306.08
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.4.20	113,192.38	115,441.87
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	383,686.27	386,830.07
三、利润总额（亏 损总额以“-”号填 列）		124,070,516.58	-181,154,816.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏 损以“-”号填列）		124,070,516.58	-181,154,816.88

6.3 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：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）	845,417,154.91	158,202,453.00	1,003,619,607.91
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数（本期 净利润）	-	124,070,516.58	124,070,516.58
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）	-18,249,709.27	-4,972,217.87	-23,221,927.14
其中：1. 基金申 购款	6,843,640.97	1,417,529.64	8,261,170.61
2. 基金赎 回款	-25,093,350.24	-6,389,747.51	-31,483,097.75
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)	827,167,445.64	277,300,751.71	1,104,468,197.35
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)	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(本期净利润)	-	-181,154,816.88	-181,154,816.88
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)	22,812,136.54	1,299,823.41	24,111,959.95
其中:1.基金申购款	136,872,819.40	10,915,997.86	147,788,817.26
2.基金赎回款	-114,060,682.86	-9,616,174.45	-123,676,857.31
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)	980,008,760.66	105,741,339.25	1,085,750,099.91

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	3,393,410.16
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	3,393,410.16

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

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	1,056,893,694.69	1,100,195,695.56	43,302,000.87
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	1,056,893,694.69	1,100,195,695.56	43,302,000.87

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍 生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
货币衍 生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
权益衍	6,351,380.00	-	-	-

生工具				
：股指期货 货	6,351,380.00	-	-	-
其他衍 生工具	-	-	-	-
合计	6,351,380.00	-	-	-

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。

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	611.59
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	487.68
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	7.74
合计	1,107.01

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	13,911.41
银行间市场应付交易费用	-
合计	13,911.41

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	228,108.87
其他	750,000.00
应付指数使用费	78,626.76
应退替代款	-
可退替代款	-
合计	1,056,735.63

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。

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	741,199,451.00	845,417,154.91
本期申购	6,000,000.00	6,843,640.97
本期赎回（以“-”号填列）	-22,000,000.00	-25,093,350.24
-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	725,199,451.00	827,167,445.64

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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	680,255,829.43	-522,053,376.43	158,202,453.00
本期利润	4,783,651.43	119,286,865.15	124,070,516.58
本期基金份额交易产生的变动数	-14,775,381.40	9,803,163.53	-4,972,217.87
其中：基金申购款	5,513,869.84	-4,096,340.20	1,417,529.64
基金赎回款	-20,289,251.24	13,899,503.73	-6,389,747.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	670,264,099.46	-392,963,347.75	277,300,751.71

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	5,603.28
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	15,317.35
其他	150.30
合计	21,070.93

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	175,483.02
股票投资收益——赎回差价收入	-763,511.39
合计	-588,028.37

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	79,101,969.95
减：卖出股票成本总额	78,926,486.93
买卖股票差价收入	175,483.02

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	31,483,097.75
减：现金支付赎回款总额	142,390.75
减：赎回股票成本总额	32,104,218.39
赎回差价收入	-763,511.39

6.4.4.13 基金投资收益

注：无。

6.4.4.14 债券投资收益

6.4.4.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日
卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成交总 额	1,311,380.00
减：卖出债券（、债转 股及债券到期兑付）成 本总额	1,292,000.00
减：应收利息总额	113.27
买卖债券差价收入	19,266.73

6.4.4.15 贵金属投资收益

注：无。

6.4.4.16 衍生工具收益

6.4.4.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.4.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2017年1月1日至2017年6月30日
股指期货-投资收益	-164,338.00

6.4.4.17 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	9,099,433.56
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,099,433.56

6.4.4.18 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	118,780,305.15
股票投资	118,780,305.15

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	506,560.00
权证投资	-
期货	506,560.00
其他	-
合计	119,286,865.15

6.4.4.19 其他收入

注：无。

6.4.4.20 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	113,192.38
银行间市场交易费用	-
合计	113,192.38

6.4.4.21 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	49,588.57
信息披露费	148,767.52
指数使用费	155,349.40
银行费用	228.00
上市费	29,752.78
合计	383,686.27

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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
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

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 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	161,217,567.05	100.00	56,277,717.28	32.45

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	2,603,238.41	100.00	-	-

6.4.7.1.3 权证交易

注：无。

6.4.7.1.4 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	16,121.81	100.00	13,310.09	95.68
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	5,627.86	32.45	5,627.86	11.94

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	2,589,156.68	2,631,530.15
其中：支付销售机 构的客户维护费	187,182.55	-

注：支付基金管理人南方基金管理有限公司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	517,831.36	526,306.08

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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}$ 。

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(%)
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	520,944,419.00	71.83	524,944,419.00	70.82

注：南方开元沪深 300ETF 联接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
中国工商银行股份有限公司	3,393,410.16	5,603.28	1,213,325.39	6,668.00

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：本期无利润分配。

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
002879	长缆科技	2017年06月05日	2017-07-07	新股认购	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年06月15日	2017-07-17	新股认购	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300671	富满电子	2017年06月27日	2017-07-05	新股认购	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603305	旭升股份	2017年06月30日	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年06月27日	2017-07-05	新股认购	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017年06月23日	2017-07-03	新股认购	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
603933	睿能科技	2017年06月28日	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
600050	中国联通	2017-04-05	重要事项未公告	7.47	2017-08-21	8.22	903,389	5,247,898.03	6,748,315.83	-
601989	中国重工	2017-05-31	重大资产重组	6.21	-	-	985,535	10,274,798.16	6,120,172.35	-
601088	中国神华	2017-06-05	重要事项未公告	22.29	-	-	212,430	3,778,707.35	4,735,064.70	-

600795	国电电力	2017-06-05	重大资产重组	3.60	-	-	1,266,030	5,089,440.63	4,557,708.00	-
300104	乐视网	2017-04-17	重大资产重组	30.68	-	-	126,900	7,186,899.07	3,893,292.00	-
000100	TCL集团	2017-04-21	重大事项	3.43	2017-07-26	3.72	782,999	3,323,409.07	2,685,686.57	-
600100	XD 同方股	2017-04-21	重大资产重组	14.12	-	-	190,092	3,050,245.47	2,684,099.04	-
601727	上海电气	2017-06-22	重要公告	7.57	2017-07-03	7.54	330,400	4,285,519.45	2,501,128.00	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大资产重组	14.59	-	-	154,829	3,733,568.98	2,258,955.11	-
601919	中远海控	2017-05-17	重大资产重组	5.35	2017-07-26	5.89	409,800	4,311,926.66	2,192,430.00	-
002252	上海莱士	2017-04-21	重大事项	20.24	-	-	106,280	2,010,126.52	2,151,107.20	-
000503	海虹控股	2017-05-11	重大资产重组	24.93	-	-	77,100	2,707,450.67	1,922,103.00	-
600959	江苏有线	2017-06-19	重要事项未公告	10.57	-	-	163,600	2,150,318.70	1,729,252.00	-
002426	胜利精密	2017-01-16	拟披露重大事项	7.68	-	-	181,200	1,752,807.99	1,391,616.00	-
600666	奥瑞德	2017-04-27	重大资产重组	17.40	-	-	79,480	1,560,560.79	1,382,952.00	-
002049	紫光国芯	2017-02-20	重大资产重组	30.82	2017-07-17	27.74	38,700	1,301,994.72	1,192,734.00	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.27	-	-	143,218	1,988,410.77	1,184,412.86	-
601872	XD 招商轮	2017-05-02	重要事项未公告	5.16	-	-	227,200	1,556,035.50	1,172,352.00	-

600654	*ST 中安	2017-06-07	重大资产重组	13.48	-	-	82,100	1,584,596.55	1,106,708.00	-
601608	中信重工	2017-04-19	重要事项未公告	5.54	2017-07-26	5.26	138,800	928,758.57	768,952.00	-
603501	韦尔股份	2017-06-05	重大资产重组	20.15	-	-	57	400.14	1,148.55	-

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

注：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

本基金为交易型开放式指数基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现。本基金投资的金融工具主要为股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现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目标。

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，将风险控制可在可承受的范围内。

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工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

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 6.4.9 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，其余金融资产均能以合理价格适时变现。

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。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

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	3,393,410.16	-	-	-	3,393,410.16
结算备付金	1,053,700.00	-	-	-	1,053,700.00
存出保证金	19,103.69	-	-	1,378,717.20	1,397,820.89
交易性金融资产	-	-	-	1,100,195,695.56	1,100,195,695.56
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,107.01	1,107.01
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	97,348.44	97,348.44
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,466,213.85	-	-	1,101,672,868.21	1,106,139,082.06
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	441,372.06	441,372.06
应付托管费	-	-	-	88,274.41	88,274.41
应付证券清算款	-	-	-	70,591.20	70,591.20
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	13,911.41	13,911.41
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,056,735.63	1,056,735.63
负债总计	-	-	-	1,670,884.71	1,670,884.71
利率敏感度缺口	4,466,213.85	-	-	1,100,001,983.50	1,104,468,197.35
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	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

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 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2016 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(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。

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	1,100,195,695.56	99.61	997,907,406.60	99.43
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	1,100,195,695.56	99.61	997,907,406.60	99.43

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(附注 7.4.1)上升 5%	54,760,000.00	49,590,000.00
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-54,760,000.00	-49,590,000.00

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	1,100,195,695.56	99.46
	其中：股票	1,100,195,695.56	99.46
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	4,447,110.16	0.40
-	-	-	-
-	其他各项资产	1,496,276.34	0.14
-	合计	1,106,139,082.06	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	2,635,268.36	0.24
B	采矿业	35,411,504.35	3.21
C	制造业	392,515,475.22	35.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,889,519.28	2.71
E	建筑业	50,864,900.07	4.61
F	批发和零售业	23,714,811.93	2.15
G	交通运输、仓储和邮政业	32,097,230.72	2.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,303,310.48	5.10
J	金融业	377,489,097.85	34.18
K	房地产业	58,529,792.06	5.30
L	租赁和商务服务业	9,622,061.44	0.87
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,076,684.27	0.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,170,900.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	12,658,480.67	1.15
S	综合	3,212,306.18	0.29
	合计	1,096,191,342.88	99.25

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	2,890,005.06	0.26
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	1,114,347.62	0.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,004,352.68	0.36

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	601318	中国平安	1,142,314	56,670,197.54	5.13
2	600036	招商银行	1,087,642	26,005,520.22	2.35
3	600519	贵州茅台	53,005	25,010,409.25	2.26
4	601166	兴业银行	1,314,385	22,160,531.10	2.01
5	000651	格力电器	507,464	20,892,292.88	1.89
6	000333	美的集团	477,272	20,541,786.88	1.86
7	600016	民生银行	2,493,020	20,492,624.40	1.86
8	000002	万科A	717,813	17,923,790.61	1.62
9	601328	交通银行	2,897,334	17,847,577.44	1.62
10	601668	中国建筑	1,581,530	15,309,210.40	1.39
11	600000	浦发银行	1,185,419	14,995,550.35	1.36
12	601288	农业银行	4,031,074	14,189,380.48	1.28
13	600030	中信证券	829,992	14,126,463.84	1.28
14	600887	伊利股份	640,998	13,839,146.82	1.25
15	600837	海通证券	853,346	12,672,188.10	1.15
16	002415	海康威视	389,259	12,573,065.70	1.14
17	601398	工商银行	2,274,400	11,940,600.00	1.08
18	601169	北京银行	1,282,841	11,763,651.97	1.07
19	600104	上汽集团	369,641	11,477,353.05	1.04
20	601601	中国太保	331,464	11,226,685.68	1.02
21	000858	五粮液	200,170	11,141,462.20	1.01
22	600900	长江电力	696,003	10,704,526.14	0.97

23	000725	京东方 A	2,506,082	10,425,301.12	0.94
24	601766	中国中车	1,026,168	10,384,820.16	0.94
25	601211	国泰君安	475,500	9,752,505.00	0.88
26	600276	恒瑞医药	178,181	9,014,176.79	0.82
27	000001	平安银行	905,311	8,500,870.29	0.77
28	601988	中国银行	2,222,555	8,223,453.50	0.74
29	600048	保利地产	750,309	7,480,580.73	0.68
30	601390	中国中铁	786,092	6,815,417.64	0.62
31	600518	康美药业	313,013	6,804,902.62	0.62
32	601818	光大银行	1,679,185	6,800,699.25	0.62
33	600050	中国联通	903,389	6,748,315.83	0.61
34	600028	中国石化	1,108,457	6,573,150.01	0.60
35	600019	宝钢股份	932,285	6,255,632.35	0.57
36	600015	华夏银行	675,923	6,232,010.06	0.56
37	601688	华泰证券	344,400	6,164,760.00	0.56
38	601989	中国重工	985,535	6,120,172.35	0.55
39	000063	中兴通讯	250,875	5,955,772.50	0.54
40	002450	康得新	260,496	5,866,369.92	0.53
41	601186	中国铁建	485,203	5,836,992.09	0.53
42	002304	洋河股份	63,573	5,518,772.13	0.50
43	000776	广发证券	312,069	5,383,190.25	0.49
44	001979	招商蛇口	250,084	5,341,794.24	0.48
45	601006	大秦铁路	627,106	5,261,419.34	0.48
46	000538	云南白药	54,917	5,153,960.45	0.47
47	600703	三安光电	258,053	5,083,644.10	0.46
48	600690	青岛海尔	321,506	4,838,665.30	0.44
49	600585	海螺水泥	210,853	4,792,688.69	0.43
50	601628	中国人寿	175,653	4,739,117.94	0.43
51	601088	中国神华	212,430	4,735,064.70	0.43
52	600958	东方证券	328,300	4,566,653.00	0.41
53	600795	国电电力	1,266,030	4,557,708.00	0.41
54	601336	新华保险	87,935	4,519,859.00	0.41
55	002024	苏宁云商	392,736	4,418,280.00	0.40
56	601939	建设银行	708,024	4,354,347.60	0.39
57	601901	方正证券	434,041	4,310,027.13	0.39
58	601009	南京银行	383,358	4,297,443.18	0.39
59	600340	华夏幸福	124,630	4,185,075.40	0.38
60	600999	招商证券	241,195	4,153,377.90	0.38
61	600309	万华化学	144,166	4,128,914.24	0.37
62	002230	科大讯飞	102,505	4,089,949.50	0.37
63	600089	特变电工	394,771	4,077,984.43	0.37
64	600741	华域汽车	166,204	4,028,784.96	0.36

65	000423	东阿阿胶	55,201	3,968,399.89	0.36
66	002142	宁波银行	205,592	3,967,925.60	0.36
67	601857	中国石油	512,143	3,938,379.67	0.36
68	300104	乐视网	126,900	3,893,292.00	0.35
69	600660	福耀玻璃	147,869	3,850,508.76	0.35
70	601985	中国核电	492,300	3,844,863.00	0.35
71	601669	中国电建	483,942	3,832,820.64	0.35
72	600009	上海机场	101,640	3,792,188.40	0.34
73	601899	紫金矿业	1,093,987	3,752,375.41	0.34
74	000568	泸州老窖	73,934	3,739,581.72	0.34
75	002241	歌尔股份	193,564	3,731,913.92	0.34
76	300070	碧水源	198,297	3,698,239.05	0.33
77	601377	兴业证券	494,217	3,672,032.31	0.33
78	002456	欧菲光	200,500	3,643,085.00	0.33
79	000166	申万宏源	634,491	3,553,149.60	0.32
80	601607	上海医药	121,689	3,514,378.32	0.32
81	300072	三聚环保	94,600	3,504,930.00	0.32
82	002236	大华股份	152,863	3,486,805.03	0.32
83	000069	华侨城 A	346,043	3,481,192.58	0.32
84	002736	国信证券	259,400	3,437,050.00	0.31
85	002466	天齐锂业	62,900	3,418,615.00	0.31
86	600886	国投电力	429,239	3,390,988.10	0.31
87	000338	潍柴动力	255,330	3,370,356.00	0.31
88	000783	长江证券	349,742	3,312,056.74	0.30
89	600196	复星医药	106,080	3,287,419.20	0.30
90	600031	三一重工	403,731	3,282,333.03	0.30
91	600068	葛洲坝	291,365	3,274,942.60	0.30
92	300059	东方财富	271,344	3,261,554.88	0.30
93	600029	南方航空	370,200	3,220,740.00	0.29
94	600010	包钢股份	1,441,686	3,157,292.34	0.29
95	601600	中国铝业	693,298	3,133,706.96	0.28
96	002008	大族激光	90,039	3,118,950.96	0.28
97	601888	中国国旅	102,956	3,103,093.84	0.28
98	600066	宇通客车	140,051	3,076,920.47	0.28
99	601788	光大证券	206,000	3,075,580.00	0.28
100	600637	东方明珠	139,289	3,018,392.63	0.27
101	600606	绿地控股	384,800	3,009,136.00	0.27
102	000625	长安汽车	205,650	2,965,473.00	0.27
103	000839	中信国安	289,300	2,890,107.00	0.26
104	601099	太平洋	718,590	2,888,731.80	0.26
105	002594	比亚迪	57,317	2,862,984.15	0.26
106	601933	永辉超市	403,596	2,857,459.68	0.26

107	601555	东吴证券	253,093	2,842,234.39	0.26
108	600535	天士力	68,398	2,841,252.92	0.26
109	601618	中国中冶	564,667	2,828,981.67	0.26
110	600893	航发动力	102,741	2,804,829.30	0.25
111	000413	东旭光电	247,289	2,774,582.58	0.25
112	600383	金地集团	237,953	2,729,320.91	0.25
113	600522	中天科技	226,300	2,726,915.00	0.25
114	600406	国电南瑞	153,657	2,712,046.05	0.25
115	000768	中航飞机	145,989	2,692,037.16	0.24
116	300124	汇川技术	105,376	2,691,303.04	0.24
117	000100	TCL 集团	782,999	2,685,686.57	0.24
118	600100	XD 同方股	190,092	2,684,099.04	0.24
119	600705	中航资本	473,260	2,673,919.00	0.24
120	002673	西部证券	184,607	2,625,111.54	0.24
121	600109	国金证券	223,290	2,616,958.80	0.24
122	002475	立讯精密	89,388	2,613,705.12	0.24
123	600816	安信信托	192,260	2,612,813.40	0.24
124	600111	北方稀土	229,894	2,604,699.02	0.24
125	601800	中国交建	160,987	2,558,083.43	0.23
126	002202	金风科技	164,988	2,552,364.36	0.23
127	000963	华东医药	51,274	2,548,317.80	0.23
128	002739	万达院线	49,500	2,523,015.00	0.23
129	601727	上海电气	330,400	2,501,128.00	0.23
130	000895	双汇发展	104,395	2,479,381.25	0.22
131	600570	恒生电子	52,127	2,433,288.36	0.22
132	600271	航天信息	117,876	2,432,960.64	0.22
133	601018	宁波港	416,669	2,354,179.85	0.21
134	600023	浙能电力	430,300	2,349,438.00	0.21
135	600739	辽宁成大	129,061	2,326,969.83	0.21
136	600177	雅戈尔	226,558	2,292,766.96	0.21
137	600352	浙江龙盛	240,096	2,288,114.88	0.21
138	600674	川投能源	232,032	2,278,554.24	0.21
139	000728	国元证券	186,399	2,277,795.78	0.21
140	601992	金隅股份	351,700	2,275,499.00	0.21
141	600547	山东黄金	78,288	2,264,871.84	0.21
142	600485	信威集团	154,829	2,258,955.11	0.20
143	300024	机器人	115,140	2,245,230.00	0.20
144	000623	吉林敖东	98,045	2,244,250.05	0.20
145	601225	陕西煤业	316,310	2,236,311.70	0.20
146	600221	海航控股	693,296	2,232,413.12	0.20
147	601919	中远海控	409,800	2,192,430.00	0.20
148	002508	老板电器	50,083	2,177,608.84	0.20

149	002044	美年健康	127,700	2,170,900.00	0.20
150	600018	上港集团	342,082	2,168,799.88	0.20
151	002065	东华软件	99,327	2,164,335.33	0.20
152	000793	华闻传媒	212,770	2,153,232.40	0.19
153	002252	上海莱士	106,280	2,151,107.20	0.19
154	002007	华兰生物	58,827	2,147,185.50	0.19
155	600804	鹏博士	119,281	2,117,237.75	0.19
156	600115	东方航空	310,214	2,109,455.20	0.19
157	000157	中联重科	463,243	2,079,961.07	0.19
158	600415	小商品城	286,990	2,077,807.60	0.19
159	603993	洛阳钼业	409,730	2,073,233.80	0.19
160	000540	中天城投	297,200	2,065,540.00	0.19
161	601111	中国国航	210,031	2,047,802.25	0.19
162	600208	新湖中宝	453,364	2,040,138.00	0.18
163	601998	中信银行	323,132	2,032,500.28	0.18
164	600085	XD 同仁堂	57,888	2,023,764.48	0.18
165	600820	隧道股份	198,900	2,008,890.00	0.18
166	601198	东兴证券	116,300	2,005,012.00	0.18
167	002465	海格通信	181,024	1,944,197.76	0.18
168	600436	片仔癀	31,800	1,941,072.00	0.18
169	600153	建发股份	149,445	1,932,323.85	0.17
170	000503	海虹控股	77,100	1,922,103.00	0.17
171	000826	启迪桑德	54,022	1,897,252.64	0.17
172	000630	铜陵有色	665,965	1,891,340.60	0.17
173	002310	东方园林	112,900	1,887,688.00	0.17
174	000709	河钢股份	447,783	1,876,210.77	0.17
175	600157	永泰能源	524,070	1,870,929.90	0.17
176	600362	江西铜业	109,395	1,844,399.70	0.17
177	300017	网宿科技	152,261	1,837,790.27	0.17
178	002081	金螳螂	167,261	1,836,525.78	0.17
179	000009	中国宝安	226,602	1,833,210.18	0.17
180	000060	中金岭南	163,329	1,829,284.80	0.17
181	600663	陆家嘴	77,377	1,829,192.28	0.17
182	000876	新希望	222,198	1,826,467.56	0.17
183	600489	中金黄金	181,945	1,824,908.35	0.17
184	600061	国投安信	116,900	1,817,795.00	0.16
185	002146	荣盛发展	183,434	1,810,493.58	0.16
186	600170	上海建工	469,501	1,793,493.82	0.16
187	601229	上海银行	69,600	1,777,584.00	0.16
188	002027	分众传媒	129,000	1,775,040.00	0.16
189	601155	新城控股	95,300	1,766,862.00	0.16
190	002074	国轩高科	55,500	1,751,025.00	0.16

191	601216	君正集团	355,696	1,739,353.44	0.16
192	600118	中国卫星	62,385	1,736,798.40	0.16
193	600959	江苏有线	163,600	1,729,252.00	0.16
194	600332	白云山	59,279	1,721,462.16	0.16
195	600682	南京新百	46,500	1,715,850.00	0.16
196	002500	山西证券	178,943	1,714,273.94	0.16
197	000750	国海证券	311,130	1,711,215.00	0.15
198	600297	广汇汽车	226,180	1,703,135.40	0.15
199	601633	长城汽车	127,093	1,689,065.97	0.15
200	600008	首创股份	254,060	1,671,714.80	0.15
201	600369	西南证券	297,616	1,669,625.76	0.15
202	300315	掌趣科技	204,500	1,668,720.00	0.15
203	000425	徐工机械	443,385	1,662,693.75	0.15
204	600150	中国船舶	72,644	1,661,368.28	0.15
205	601333	广深铁路	357,519	1,615,985.88	0.15
206	300144	宋城演艺	76,600	1,598,642.00	0.14
207	000559	万向钱潮	145,176	1,541,769.12	0.14
208	000792	盐湖股份	146,896	1,535,063.20	0.14
209	600688	上海石化	231,021	1,527,048.81	0.14
210	000686	东北证券	148,033	1,487,731.65	0.13
211	002195	二三四五	207,780	1,485,627.00	0.13
212	000402	金融街	126,054	1,477,352.88	0.13
213	000983	西山煤电	166,100	1,456,697.00	0.13
214	600583	海油工程	233,029	1,454,100.96	0.13
215	601117	中国化学	208,000	1,453,920.00	0.13
216	600718	东软集团	91,760	1,426,868.00	0.13
217	300027	华谊兄弟	176,196	1,425,425.64	0.13
218	300033	同花顺	22,700	1,412,167.00	0.13
219	002411	必康股份	48,500	1,402,620.00	0.13
220	600649	城投控股	133,397	1,402,002.47	0.13
221	600498	烽火通信	55,200	1,399,320.00	0.13
222	002426	胜利精密	181,200	1,391,616.00	0.13
223	600895	张江高科	81,700	1,379,096.00	0.12
224	600827	百联股份	84,548	1,373,905.00	0.12
225	600256	广汇能源	330,245	1,367,214.30	0.12
226	600373	中文传媒	58,100	1,365,931.00	0.12
227	002385	大北农	216,108	1,359,319.32	0.12
228	000917	电广传媒	119,604	1,351,525.20	0.12
229	002183	怡亚通	156,400	1,349,732.00	0.12
230	600704	物产中大	181,645	1,324,192.05	0.12
231	600588	用友网络	77,215	1,321,920.80	0.12
232	600074	保千里	102,800	1,316,868.00	0.12

233	000415	渤海金控	195,600	1,316,388.00	0.12
234	000008	神州高铁	177,700	1,293,656.00	0.12
235	600060	海信电器	82,758	1,255,438.86	0.11
236	002470	金正大	165,484	1,246,094.52	0.11
237	600376	首开股份	108,800	1,244,672.00	0.11
238	600919	江苏银行	133,900	1,243,931.00	0.11
239	601718	际华集团	138,800	1,220,052.00	0.11
240	601866	中远海发	334,563	1,204,426.80	0.11
241	002049	紫光国芯	38,700	1,192,734.00	0.11
242	002558	世纪游轮	25,580	1,182,307.60	0.11
243	002602	世纪华通	32,500	1,178,450.00	0.11
244	002352	鼎泰新材	22,100	1,174,836.00	0.11
245	601872	XD 招商轮	227,200	1,172,352.00	0.11
246	000959	首钢股份	167,300	1,169,427.00	0.11
247	600909	华安证券	114,500	1,155,305.00	0.10
248	002174	游族网络	36,300	1,152,888.00	0.10
249	601997	贵阳银行	72,700	1,149,387.00	0.10
250	600038	中直股份	24,900	1,139,673.00	0.10
251	002555	三七互娱	44,000	1,125,080.00	0.10
252	300168	万达信息	76,400	1,111,620.00	0.10
253	600977	中国电影	59,100	1,106,352.00	0.10
254	000977	浪潮信息	63,200	1,094,624.00	0.10
255	600021	上海电力	90,300	1,091,727.00	0.10
256	000627	天茂集团	134,600	1,087,568.00	0.10
257	600037	歌华有线	73,400	1,068,704.00	0.10
258	002152	广电运通	128,100	1,064,511.00	0.10
259	600737	中粮糖业	108,400	1,023,296.00	0.09
260	002714	牧原股份	36,600	996,252.00	0.09
261	000671	阳光城	170,700	993,474.00	0.09
262	600549	厦门钨业	45,600	979,944.00	0.09
263	002131	利欧股份	295,650	972,688.50	0.09
264	600372	中航电子	55,645	966,553.65	0.09
265	600685	中船防务	34,600	947,348.00	0.09
266	000738	中航动控	48,300	945,231.00	0.09
267	601118	海南橡胶	165,777	941,613.36	0.09
268	000938	紫光股份	15,400	941,248.00	0.09
269	000718	苏宁环球	160,000	937,600.00	0.08
270	002292	奥飞娱乐	55,209	933,032.10	0.08
271	600446	金证股份	52,800	928,224.00	0.08
272	600482	中国动力	36,700	928,143.00	0.08
273	601877	正泰电器	45,000	904,050.00	0.08
274	000156	华数传媒	60,473	901,652.43	0.08

275	601375	中原证券	84,600	851,076.00	0.08
276	601021	春秋航空	25,300	850,839.00	0.08
277	002424	贵州百灵	44,600	841,156.00	0.08
278	300133	华策影视	73,633	824,689.60	0.07
279	601881	中国银河	68,000	806,480.00	0.07
280	601608	中信重工	138,800	768,952.00	0.07
281	002153	石基信息	33,786	767,955.78	0.07
282	000961	中南建设	117,300	764,796.00	0.07
283	300251	光线传媒	92,740	759,540.60	0.07
284	601958	金钼股份	102,027	731,533.59	0.07
285	600233	圆通速递	35,700	699,363.00	0.06
286	002299	圣农发展	46,900	697,403.00	0.06
287	601163	三角轮胎	25,300	665,390.00	0.06
288	601611	中国核建	55,400	663,138.00	0.06
289	600871	石化油服	190,400	635,936.00	0.06
290	600926	杭州银行	42,500	631,125.00	0.06
291	601966	玲珑轮胎	25,400	569,722.00	0.05
292	603858	步长制药	7,900	565,956.00	0.05
293	603160	汇顶科技	5,200	521,560.00	0.05
294	000555	神州信息	30,500	509,350.00	0.05
295	600188	兖州煤业	40,588	496,797.12	0.04
296	601127	小康股份	18,800	375,060.00	0.03
297	002797	第一创业	40,660	374,478.60	0.03
298	002841	视源股份	4,700	348,834.00	0.03
299	002831	裕同科技	4,600	345,000.00	0.03
300	002839	张家港行	20,952	329,365.44	0.03

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	600666	奥瑞德	79,480	1,382,952.00	0.13
2	002129	中环股份	143,218	1,184,412.86	0.11
3	600654	*ST中安	82,100	1,106,708.00	0.10
4	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
5	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
6	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
7	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
8	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
9	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00

10	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
11	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
12	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
13	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
14	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
15	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
16	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
17	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
18	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
19	603501	韦尔股份	57	1,148.55	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	002456	欧菲光	4,576,568.63	0.46
2	002415	海康威视	3,058,790.93	0.30
3	600522	中天科技	2,638,440.00	0.26
4	601992	金隅股份	2,445,115.00	0.24
5	002508	老板电器	2,271,581.59	0.23
6	002044	美年健康	2,057,624.00	0.21
7	600436	片仔癀	1,808,884.00	0.18
8	601229	上海银行	1,754,990.00	0.17
9	600682	南京新百	1,726,816.00	0.17
10	601117	中国化学	1,406,232.00	0.14
11	002411	必康股份	1,379,235.00	0.14
12	600919	江苏银行	1,263,912.00	0.13
13	002558	世纪游轮	1,216,481.00	0.12
14	002352	鼎泰新材	1,182,727.00	0.12
15	600977	中国电影	1,177,977.00	0.12
16	002555	三七互娱	1,158,258.00	0.12
17	601997	贵阳银行	1,157,643.00	0.12
18	002602	世纪华通	1,156,057.00	0.12
19	000959	首钢股份	1,152,576.00	0.11
20	600909	华安证券	1,130,270.00	0.11

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	002456	欧菲光	4,493,605.32	0.45

2	600867	通化东宝	2,181,511.08	0.22
3	601166	兴业银行	2,104,815.10	0.21
4	002085	万丰奥威	1,780,530.61	0.18
5	000778	新兴铸管	1,672,584.88	0.17
6	601318	中国平安	1,559,026.88	0.16
7	601258	庞大集团	1,528,488.08	0.15
8	300015	爱尔眼科	1,424,681.44	0.14
9	000039	中集集团	1,387,786.67	0.14
10	600839	四川长虹	1,386,571.44	0.14
11	601200	上海环境	1,307,759.98	0.13
12	600875	东方电气	1,244,807.56	0.12
13	300002	神州泰岳	1,241,222.65	0.12
14	300058	蓝色光标	1,238,778.35	0.12
15	600252	中恒集团	1,206,672.74	0.12
16	600873	梅花生物	1,118,639.80	0.11
17	300182	捷成股份	1,089,774.85	0.11
18	300146	汤臣倍健	924,528.80	0.09
19	000027	深圳能源	883,221.23	0.09
20	000800	一汽轿车	858,812.16	0.09

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	81,648,868.62
卖出股票收入（成交）总额	79,101,969.95

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

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
IF1707	IF1707	6	6,565,320.00	213,940.00	-
公允价值变动总额合计(元)					213,940.00
股指期货投资本期收益(元)					-164,338.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					506,560.00

7.10.2 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。

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	1,397,820.89
2	应收证券清算款	97,348.44
3	应收股利	-
4	应收利息	1,107.01
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	1,496,276.34

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：本基金本报告期末指数投资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	600666	奥瑞德	1,382,952.00	0.13	重大资产重组
2	002129	中环股份	1,184,412.86	0.11	重大事项
3	600654	*ST 中安	1,106,708.00	0.10	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（%）	持有份额	占总份额比例（%）
21,195	34,215.59	527,528,062.00	72.74	197,671,389.00	27.26	—	—

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	杨京京	4,206,454.00	0.58
2	国信证券股份有限公司	3,387,748.00	0.47
3	刘剑	2,500,000.00	0.34
4	毛燕蓉	1,700,000.00	0.23
5	陈淑兰	1,335,254.00	0.18
6	蔡景玲	1,277,829.00	0.18
7	徐国忠	1,227,417.00	0.17
8	黄爱萍	1,153,320.00	0.16
9	王宏图	1,010,000.00	0.14
10	曹瑞生	943,357.00	0.13
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	520,944,419.00	71.83

	基金		
--	----	--	--

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（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	741,199,451.00
本报告期基金总申购份额	6,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	22,000,000.00
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	725,199,451.00

§ 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	3	161,217,567.05	100.00	16,121.81	100.00	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	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 (%)
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-

华泰证券	2,603,238.41	100.00	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	南方基金关于南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金增加华西证券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 5 日
2	南方开元沪深 300 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	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 30 日
4	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2016 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
5	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（2017 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 24 日
6	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）（2017 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 24 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 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 300 联接基金	1	20170101-20170630	524,944,419.00	6,000,000.00	10,000,000.00	520,944,419.00	71.83
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。							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准基金开元转型为南方 300 的批复。
- 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、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>