

# 南方深证成份交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 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、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国工商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、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 06 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细
- 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- 7.13 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	南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	南方深证成份 ETF 联接

基金主代码	202017	
前端交易代码	202017	
后端交易代码	202018	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 12 月 9 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	366,623,595.05 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	深成联接 A	深成联接 C
下属分级基金的交易代码	202017	004345
报告期末下属分级基金的份额总额	365,160,024.49 份	1,463,570.56 份

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

### 目标基金基本情况

基金名称	深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159,903
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 4 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 2 月 2 日
基金管理人名称	南方基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

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

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于深成 ETF，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，以深成 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资深成 ETF。本基金并不参与深成 ETF 的管理。 为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于深成 ETF。其余资产可投

	<p>资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。</p> <p>在正常市场情况下，本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p>
业绩比较基准	深证成份指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，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。

### 目标基金产品说明

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，原则上采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。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。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证成份指数。如果指数编制单位变更或停止深证成份指数的编制及发布、或深证成份指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致深证成份指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	鲍文革
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95588
传真	0755-82763889	010-66105798
注册地址	深圳市福田区福田街道福华一路	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	六号免税商务大厦 31-33 层	
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	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
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	2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日	2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日
	深成联接 A	深成联接 C
本期已实现收益	329.21	108.29
本期利润	13,886,151.18	78,922.45
加权平均基金份额本期利润	0.0374	0.1228
本期加权平均净值利润率	4.43%	-0.03%
本期基金份额净值增长率	4.42%	2.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017 年 06 月 30 日）	报告期末（2017 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	-48,740,094.64	-195,385.43
期末可供分配基金份额利润	-0.1335	-0.1335
期末基金资产净值	316,419,929.85	1,268,185.13
期末基金份额净值	0.8665	0.8665
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2017 年 06 月 30 日）	报告期末（2017 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	-13.35%	2.19%

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

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 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

深成联接 A						
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	6.70	0.79	6.40	0.79	0.30	0.00
过去三个月	1.62	0.83	0.93	0.83	0.69	0.00
过去六个月	4.42	0.79	3.32	0.79	1.10	0.00
过去一年	2.36	0.84	0.42	0.84	1.94	0.00
过去三年	45.00	1.85	41.88	1.87	3.12	-0.02
自基金合同生效起至今	-13.35	1.59	-21.42	1.60	8.07	-0.01
深成联接 C						
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	6.67	0.78	6.40	0.79	0.27	-0.01
过去三个月	1.64	0.83	0.93	0.83	0.71	0.00



自基金合同生效起至今	2.19	0.78	1.28	0.78	0.91	0.00
------------	------	------	------	------	------	------

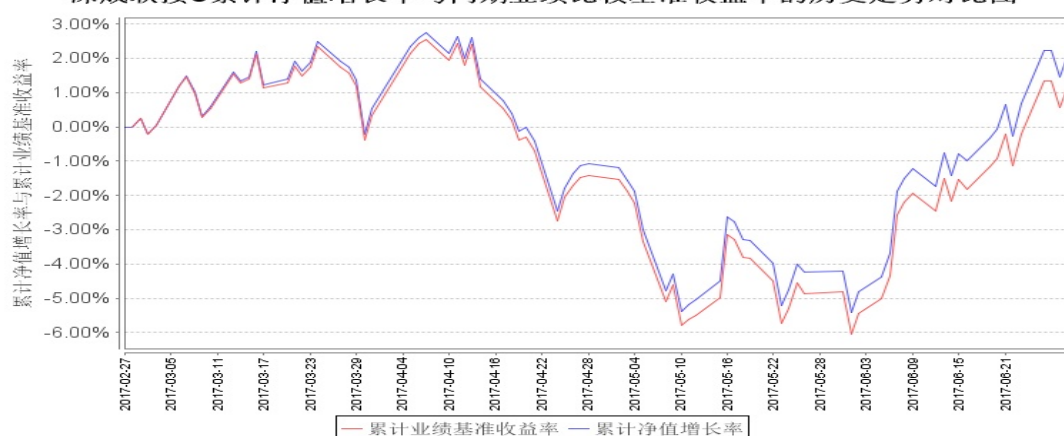
注：本基金 2017 年 2 月 20 日发布公告，增加 C 类收费模式，原收费模式称为 A 类。

### 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

深成联接A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



深成联接C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：本基金 2017 年 2 月 23 日新增 C 类份额。

## § 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		
孙伟	本基金基金经理	2016 年 8 月 19 日		7	管理学学士，具有基金从业资格、金融分析师（CFA）资格、注册会计师（CPA）资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010 年 2 月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员；2014 年 12 月至 2015 年 5 月，担任南方恒生 ETF 的基金经理助理；2015 年 5 月至 2016 年 7 月，任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 7 月至今，任改革基金、高铁基金、500 信息基金经理；2016 年 5 月至今，任南方创业板 ETF、南方创业板 ETF 联接基金经理；2016 年 8 月至今，任 500 信息联接、深成 ETF、南方深成基金经理；2017 年 3 月至今，任南方全指证券 ETF 联接、南方中证全指证券 ETF 基金经理；2017 年 6 月至今，任南方中证银行 ETF、南方银行联接基金经理。

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《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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、投资比例及投资组合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

深证成指本报告期上涨 3.46%。  
期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

- （1）接受申购赎回所带来的股票仓位偏离，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- （2）本基金大额换购目标 ETF 所带来的成份股权重偏离，对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行应对；
- （3）报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；
- （4）根据指数半年度成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 份额本报告期跟踪误差为 0.70%，并取得了超越业绩基准 1.10% 的跟踪正偏离，较为理想地完成了投资目标。

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 0.8665 元，份额净值增长率为 4.42%，同期业绩基准增长率为 3.32%；本基金 C 份额净值为 0.8665 元，报告期内，份额净值增长率为 2.19%，同期业绩基准增长率为 1.28%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济增长仍将面临较大压力。7 月的全国金融工作会议明确释放了去经济杠杆，加强监管和坚定稳健货币政策的信号。美联储相对较快地启动缩表，年内第三次加息概率有所提升，或将对人民币汇率造成一定压力。随着大盘蓝筹和中小成长走势的分化加剧，新的估值平衡正在重建中。

深证成指于 15 年 5 月正式扩容，成分股由 40 只增至 500 只，在传统支柱产业外更全面纳入新兴成长行业公司。自 15 年 6 月市盈率达到 57 倍高点至 17 年 8 月初，指数估值已跌去一半左右，28 倍的最新市盈率已处于扩容后的历史低位。展望下半年，深证成指有望在估值及业绩间找到新的平衡点。

#### 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、量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等。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，同一类别每一基金份额享有同等分配权；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合相关基金分红条件的前提下，本基金每类基金份额的收益分配每年最多 6 次，各基金份额类别每次基金收益分配比例不得低于该类基金份额基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；本基金 A 类基金份额收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金分红或将现金分红按除权日的该类基金份额净值自动转为对应类别的基金份额进行再

投资；若投资者不选择，本基金 A 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；目前本基金 H 类基金份额收益分配方式仅为现金分红；如未来条件允许，本基金 H 类基金份额可增加红利再投资的收益分配方式供 H 类基金份额持有人选择，该项调整须经基金管理人与基金托管人协商一致并报中国证监会备案并公告后实施，无需召开基金份额持有人大会审议；增加红利再投资的收益分配后，如 H 类基金份额持有人未选择，本基金 H 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

#### **4.8 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深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，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，南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、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，南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接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深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2017 年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：南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.4.1	15,744,970.92	16,664,396.75
结算备付金		942,189.83	38.82
存出保证金		3,860.83	3,114.56
交易性金融资产	6.4.4.2	301,687,473.19	297,700,966.53
其中：股票投资		1,365,462.15	1,092,548.52
基金投资		300,322,011.04	296,608,418.01
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	14,000,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.4.5	881.87	1,691.73
应收股利		-	-
应收申购款		38,055.17	32,373.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	28,436.06
资产总计		332,417,431.81	314,431,017.49
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		14,000,596.66	196,708.11
应付赎回款		536,816.07	129,571.84
应付管理人报酬		8,402.31	8,933.44
应付托管费		1,680.46	1,786.70
应付销售服务费		413.59	-
应付交易费用	6.4.4.7	1,077.15	2,811.34
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	180,330.59	355,232.78
负债合计		14,729,316.83	695,044.21
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.4.9	366,623,595.05	378,088,340.31
未分配利润	6.4.4.10	-48,935,480.07	-64,352,367.03
所有者权益合计		317,688,114.98	313,735,973.28
负债和所有者权益总计		332,417,431.81	314,431,017.49

注：1、报告截止日 2017 年 06 月 30 日，基金份额总额 366,623,595.05 份，其中 A 类基金份额总额 365,160,024.49 份，基金份额净值 0.8665 元，C 类基金份额总额 1,463,570.56 份，基金份额净值 0.8665 元。

## 6.2 利润表

会计主体：南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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
<b>一、收入</b>		14,218,618.37	-62,410,779.86
1. 利息收入		189,194.32	77,757.78
其中：存款利息收入	6.4.4.11	32,172.42	77,757.70
债券利息收入		-	0.08
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		157,021.90	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		51,794.20	-836,964.01
其中：股票投资收益	6.4.4.12	116,202.55	-485,423.24
基金投资收益	6.4.4.13	-94,991.30	-365,424.53
债券投资收益	6.4.4.14	-	-
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	30,582.95	13,883.76
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	13,964,636.13	-61,670,605.29
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	12, 993. 72	19, 031. 66
<b>减：二、费用</b>		253, 544. 74	255, 664. 14
1. 管理人报酬	6. 4. 7. 2. 1	46, 451. 37	57, 471. 21
2. 托管费	6. 4. 7. 2. 2	9, 290. 27	11, 494. 25
3. 销售服务费	6. 4. 7. 2. 3	708. 37	-
4. 交易费用	6. 4. 4. 20	18, 462. 43	6, 393. 15
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	178, 632. 30	180, 305. 53
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		13, 965, 073. 63	-62, 666, 444. 00
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		13, 965, 073. 63	-62, 666, 444. 00

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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）	378, 088, 340. 31	-64, 352, 367. 03	313, 735, 973. 28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	13, 965, 073. 63	13, 965, 073. 63
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）	-11, 464, 745. 26	1, 451, 813. 33	-10, 012, 931. 93
其中：1. 基金申购款	18, 085, 557. 80	-3, 126, 150. 11	14, 959, 407. 69
2. 基金赎回款	-29, 550, 303. 06	4, 577, 963. 44	-24, 972, 339. 62
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）	366, 623, 595. 05	-48, 935, 480. 07	317, 688, 114. 98



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）	388,780,178.24	3,532,751.04	392,312,929.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-62,666,444.00	-62,666,444.00
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）	7,747,977.48	-1,731,337.00	6,016,640.48
其中：1. 基金申购款	33,168,949.54	-6,230,414.50	26,938,535.04
2. 基金赎回款	-25,420,972.06	4,499,077.50	-20,921,894.56
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）	396,528,155.72	-60,865,029.96	335,663,125.76

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 基金基本情况

### 6.4.2 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。

### 6.4.3 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.3.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.3.2 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。

#### 6.4.3.3 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。

#### 6.4.4 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。

#### 6.4.5 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.5.1 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	15,744,970.92
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	15,744,970.92

#### 6.4.5.2 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	1,307,493.43	1,365,462.15	57,968.72
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	293,898,952.60	300,322,011.04	6,423,058.44
其他	-	-	-
合计	295,206,446.03	301,687,473.19	6,481,027.16

#### 6.4.5.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 6.4.5.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	14,000,000.00	-
合计	14,000,000.00	-

#### 6.4.5.5 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	498.74
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	381.60
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	1.53
合计	881.87

#### 6.4.5.6 其他资产

注：无。

#### 6.4.5.7 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	1,077.15
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,077.15

#### 6.4.5.8 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	1,810.29
预提费用	178,520.30
合计	180,330.59

#### 6.4.5.9 实收基金

金额单位：人民币元

深成联接 A		
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	378,088,340.31	378,088,340.31
本期申购	16,466,517.49	16,466,517.49
本期赎回(以“-”号填列)	-29,394,833.31	-29,394,833.31
本期末	365,160,024.49	365,160,024.49
深成联接 C		
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	-	-

本期申购	1,619,040.31	1,619,040.31
本期赎回（以“-”号填列）	-155,469.75	-155,469.75
本期末	1,463,570.56	1,463,570.56

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.5.10 未分配利润

单位：人民币元

深成联接 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	67,992,181.24	-132,344,548.27	-64,352,367.03
本期利润	329.21	13,885,821.97	13,886,151.18
本期基金份额交易产生的变动数	-2,323,382.77	4,049,503.98	1,726,121.21
其中：基金申购款	2,957,353.06	-5,784,086.50	-2,826,733.44
基金赎回款	-5,280,735.83	9,833,590.48	4,552,854.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	65,669,127.68	-114,409,222.32	-48,740,094.64
深成联接 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	108.29	78,814.16	78,922.45
本期基金份额交易产生的变动数	263,107.20	-537,415.08	-274,307.88
其中：基金申购款	291,017.47	-590,434.14	-299,416.67
基金赎回款	-27,910.27	53,019.06	25,108.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	263,215.49	-458,600.92	-195,385.43

#### 6.4.5.11 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	25,732.74
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	6,296.11
其他	143.57
合计	32,172.42

#### 6.4.5.12 股票投资收益

##### 6.4.5.12.1 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	149,224.11
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-33,021.56
合计	116,202.55

#### 6.4.5.12.2 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	14,557,229.03
减：卖出股票成本总额	14,408,004.92
买卖股票差价收入	149,224.11

#### 6.4.5.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日 至 2017年6月30日
申购基金份额对价总额	3,177,600.00
减：现金支付申购款总额	-17,929.08
减：申购股票成本总额	3,228,550.64
申购差价收入	-33,021.56

#### 6.4.5.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日 至 2017年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	13,251,140.08
减：卖出/赎回基金成本总额	13,346,131.38
基金投资收益	-94,991.30

#### 6.4.5.14 债券投资收益

注：无。

##### 6.4.5.14.1 资产支持证券投资收益

注：无。

**6.4.5.15 贵金属投资收益**

注：无。

**6.4.5.16 衍生工具收益**

注：无。

**6.4.5.17 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	30,582.95
基金投资产生的股利收益	-
合计	30,582.95

**6.4.5.18 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	13,964,636.13
股票投资	82,511.72
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	13,882,124.41
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
其他	-
合计	13,964,636.13

**6.4.5.19 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	10,005.86
补差费归资产	2,987.86
合计	12,993.72

**6.4.5.20 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	18,462.43
银行间市场交易费用	-
合计	18,462.43

#### 6.4.5.21 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	29,752.78
信息披露费	148,767.52
银行费用	112.00
合计	178,632.30

#### 6.4.6 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.6.1 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。

##### 6.4.6.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 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。

##### 6.4.7.2 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、注册登记机构、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、基金代销机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
深证成份交易型开放式指数证券投资基金（“目标ETF”）	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。



## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.8.1.1 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	18,969,041.48	100.00	14,366,725.58	100.00

## 6.4.8.1.2 权证交易

注：无。

## 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	1,897.58	100.00	1,077.15	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	1,437.08	100.00	868.40	100.00

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。

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 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	46,451.37	57,471.21
其中：支付销售机构的客户维护费	73,238.20	152,983.15

注：本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，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扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.5% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产}) \times 0.5\% / \text{当年天数}。$$

### 6.4.8.2.2 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	9,290.27	11,494.25

注：本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，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扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.1% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产}) \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	深成联接 A	深成联接 C	合计

南方基金	-	708.37	708.37
合计	-	708.37	708.37

支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.40%。销售服务费的计算公式为：  
日销售服务费 = 前一日对应类别基金资产净值 X 约定年费率 / 当年天数。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间无各关联方投资本基金的情况。

##### 6.4.8.4.2 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

注：无。

#### 6.4.8.5 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	15,744,970.92	25,732.74	19,108,568.25	77,216.51

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 264,321,432.00 份目标 ETF 基金份额(2016 年 12 月 31 日 270,321,432 份)，占其份额的比例为 62.02%(2015 年 12 月 31 日：59.13%)。

## 6.4.9 利润分配情况

### 6.4.9.1 利润分配情况

注：本基金本报告期内无利润分配。

## 6.4.10 期末本基金持有的流通受限证券

### 6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

### 6.4.10.2 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
002075	沙钢股份	2016-09-19	重大资产重组	16.12		-	3,300	51,722.00	53,196.00	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.27		-	6,300	52,113.51	52,101.00	-
300088	长信科技	2016-09-12	重大资产重组	15.75		-	3,100	47,493.15	48,825.00	-
002426	胜利精密	2017-01-16	拟披露重大事项	7.68		-	3,250	25,374.79	24,960.00	-
002168	深圳惠程	2017-01-23	重大资产重组	16.99		-	1,300	21,884.90	22,087.00	-
002049	紫光国芯	2017-02-20	重大资产重组	30.82	2017-07-17	27.74	600	18,528.00	18,492.00	-
002025	航天电器	2016-09-12	重大事项	24.95	2017-07-04	22.46	600	14,893.60	14,970.00	-
300134	大富科技	2017-02-09	重大资产重组	23.36		-	600	14,016.00	14,016.00	-
000503	海虹控股	2017-05-11	重大资产重组	24.93		-	500	14,631.12	12,465.00	-
300367	东方网力	2016-12-15	重大资产重组	20.00	2017-07-03	18.01	600	12,024.00	12,000.00	-
300364	中文在线	2017-02-13	重大资产重组	37.28		-	300	11,184.00	11,184.00	-
300104	乐视网	2017-04-17	重大资产重组	30.68		-	300	9,504.78	9,204.00	-
002642	荣之联	2017-04-10	重大事项	25.06	2017-07-07	22.54	300	7,305.60	7,518.00	-
002505	大康	2017-	重大资	3.50		-	2,100	7,388.89	7,350.00	-

	农业	03-13	产重组							
000034	神州数码	2017-03-21	重大资产重组	24.45	2017-07-18	22.01	300	7,143.00	7,335.00	-
002600	江粉磁材	2017-02-27	重大资产重组	11.46		-	600	6,876.00	6,876.00	-
000100	TCL集团	2017-04-21	重大事项	3.43	2017-07-26	3.72	2,000	7,069.30	6,860.00	-
300271	华宇软件	2017-06-22	拟披露重大事项	16.59	2017-07-04	16.80	400	6,527.10	6,636.00	-
002128	露天煤业	2017-03-17	重大资产重组	8.70		-	700	6,339.20	6,090.00	-
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项	10.24	2017-08-02	11.36	550	5,870.44	5,632.00	-
000656	金科股份	2017-05-05	重大资产重组	6.54	2017-07-05	5.92	800	5,156.04	5,232.00	-
300098	高新兴	2017-06-22	拟披露重大事项	12.90	2017-07-03	13.18	400	4,796.07	5,160.00	-
000887	中鼎股份	2017-04-27	重大资产重组	22.09	2017-07-14	19.88	200	4,573.22	4,418.00	-
300413	快乐购	2017-04-05	重大资产重组	20.29		-	200	4,277.33	4,058.00	-
002681	奋达科技	2017-06-22	重大事项	12.59	2017-07-03	12.70	300	4,018.30	3,777.00	-
002625	龙生股份	2017-04-13	重大资产重组	36.36		-	100	3,628.50	3,636.00	-
002358	森源电气	2017-05-12	重大资产重组	17.02	2017-07-12	16.68	200	3,594.66	3,404.00	-
002252	上海莱士	2017-04-21	重大事项	20.24		-	160	3,233.80	3,238.40	-
002610	爱康科技	2017-05-12	重大事项	2.44	2017-08-02	2.44	1,200	3,246.03	2,928.00	-
000693	ST华泽	2016-03-01	重大事项	12.50		-	200	2,500.00	2,500.00	-
002143	印纪传媒	2017-04-18	重大资产重组	24.93		-	100	3,144.50	2,493.00	-
300267	尔康制药	2017-05-10	重大事项	11.46		-	200	2,448.44	2,292.00	-
002619	巨龙管业	2017-05-24	重大资产重组	6.37		-	340	2,856.94	2,165.80	-
300075	数字政通	2017-06-29	重大事项	20.94	2017-07-17	18.86	100	2,240.59	2,094.00	-

002399	海普瑞	2017-04-28	重大事项	20.23		-	100	2,072.00	2,023.00	-
300291	华录百纳	2017-04-19	重大资产重组	20.02		-	100	2,020.17	2,002.00	-
300085	银之杰	2017-06-30	重大事项	18.50	2017-07-07	18.88	100	1,920.50	1,850.00	-
000099	中信海直	2017-05-04	重大资产重组	11.26		-	100	1,170.67	1,126.00	-

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。

### 6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## 6.4.11 金融工具风险及管理

### 6.4.11.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为完全被动式指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资及债券投资。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“紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”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，将风险控制可在承受的范围

#### 6.4.11.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2016 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.11.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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、组合在短期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。本基金所持目标 ETF 份额能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出，所持股票和债券均在证券交易所上市，除附注 6.4.10 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，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.11.4 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。

##### 6.4.11.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.11.4.1.1 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	15,744,970.92	-	-	-	15,744,970.92
结算备付金	942,189.83	-	-	-	942,189.83
存出保证金	3,860.83	-	-	-	3,860.83
交易性金融资产	-	-	-	301,687,473.19	301,687,473.19
买入返售金融资产	14,000,000.00	-	-	-	14,000,000.00
应收利息	-	-	-	881.87	881.87
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	2,667.38	-	-	35,387.79	38,055.17
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	30,693,688.96	-	-	301,723,742.85	332,417,431.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	536,816.07	536,816.07



应付管理人报酬	-	-	-	8,402.31	8,402.31
应付托管费	-	-	-	1,680.46	1,680.46
应付证券清算款	-	-	-	14,000,596.66	14,000,596.66
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	413.59	413.59
应付交易费用	-	-	-	1,077.15	1,077.15
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	180,330.59	180,330.59
负债总计	-	-	-	14,729,316.83	14,729,316.83
利率敏感度缺口	30,693,688.96	-	-	286,994,426.02	317,688,114.98
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	16,664,396.75	-	-	-	16,664,396.75
结算备付金	38.82	-	-	-	38.82
存出保证金	3,114.56	-	-	-	3,114.56
交易性金融资产	-	-	-	297,700,966.53	297,700,966.53
应收利息	-	-	-	1,691.73	1,691.73
应收申购款	13,945.01	-	-	18,428.03	32,373.04
其他资产	-	-	-	28,436.06	28,436.06
资产总计	16,681,495.14	-	-	297,749,522.35	314,431,017.49
负债					
应付证券清算款	-	-	-	196,708.11	196,708.11
应付赎回款	-	-	-	129,571.84	129,571.84
应付管理人报酬	-	-	-	8,933.44	8,933.44
应付托管费	-	-	-	1,786.70	1,786.70
应付交易费用	-	-	-	2,811.34	2,811.34
其他负债	-	-	-	355,232.78	355,232.78
负债总计	-	-	-	695,044.21	695,044.21
利率敏感度缺口	16,681,495.14	-	-	297,054,478.14	313,735,973.28

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。

#### 6.4.11.4.1.2 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)。

#### 6.4.11.4.2 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。本基金主要投资于能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出的目标 ETF 份额，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。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。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。

#### 6.4.11.4.2.1 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	1,365,462.15	0.43	1,092,548.52	0.35
交易性金融资产 —基金投资	300,322,011.04	94.53	296,608,418.01	94.54
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	301,687,473.19	94.96	297,700,966.53	94.89

#### 6.4.11.4.2.2 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	1. 业绩比较基准上升 5%	67,720.00	15,600,000.00

	2. 业绩比较基准下降 5%	-67,720.00	-15,600,000.00
--	----------------	------------	----------------

#### 6.4.12 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	1,365,462.15	0.41
	其中：股票	1,365,462.15	0.41
2	基金投资	300,322,011.04	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	14,000,000.00	4.21
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,687,160.75	5.02
-	-	-	-
-	其他各项资产	42,797.87	0.01

-	合计	332,417,431.81	100.00
---	----	----------------	--------

## 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

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	32,850.00	0.01
B	采矿业	17,509.00	0.01
C	制造业	895,810.82	0.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,756.00	-
E	建筑业	21,808.70	0.01
F	批发和零售业	35,864.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	6,000.00	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	142,477.97	0.04
J	金融业	65,065.00	0.02
K	房地产业	54,064.00	0.02
L	租赁和商务服务业	18,471.86	0.01
M	科学研究和技术服务业	926.00	-
N	水利、环境和公共设施管理业	20,380.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,129.00	-
R	文化、体育和娱乐业	26,761.00	0.01
S	综合	2,588.80	-
	合计	1,365,462.15	0.43

### 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	002075	沙钢股份	3,300	53,196.00	0.02
2	002129	中环股份	6,300	52,101.00	0.02
3	300088	长信科技	3,100	48,825.00	0.02
4	000651	格力电器	800	32,936.00	0.01
5	000333	美的集团	700	30,128.00	0.01
6	002426	胜利精密	3,250	24,960.00	0.01

7	002168	深圳惠程	1,300	22,087.00	0.01
8	002415	海康威视	600	19,380.00	0.01
9	002049	紫光国芯	600	18,492.00	0.01
10	000725	京东方 A	4,400	18,304.00	0.01
11	000002	万科 A	700	17,479.00	0.01
12	000858	五粮液	300	16,698.00	0.01
13	002025	航天电器	600	14,970.00	0.00
14	300498	温氏股份	600	14,064.00	0.00
15	300134	大富科技	600	14,016.00	0.00
16	000001	平安银行	1,400	13,146.00	0.00
17	000503	海虹控股	500	12,465.00	0.00
18	300367	东方网力	600	12,000.00	0.00
19	002450	康得新	499	11,237.48	0.00
20	300364	中文在线	300	11,184.00	0.00
21	000063	中兴通讯	400	9,496.00	0.00
22	300104	乐视网	300	9,204.00	0.00
23	002304	洋河股份	100	8,681.00	0.00
24	000776	广发证券	500	8,625.00	0.00
25	000028	国药一致	100	8,090.00	0.00
26	002230	科大讯飞	200	7,980.00	0.00
27	002642	荣之联	300	7,518.00	0.00
28	300072	三聚环保	200	7,410.00	0.00
29	002505	大康农业	2,100	7,350.00	0.00
30	000034	神州数码	300	7,335.00	0.00
31	000423	东阿阿胶	100	7,189.00	0.00
32	002008	大族激光	200	6,928.00	0.00
33	002600	江粉磁材	600	6,876.00	0.00
34	000100	TCL 集团	2,000	6,860.00	0.00
35	002236	大华股份	300	6,843.00	0.00
36	000513	丽珠集团	100	6,810.00	0.00
37	002024	苏宁云商	600	6,750.00	0.00
38	300271	华宇软件	400	6,636.00	0.00
39	000338	潍柴动力	500	6,600.00	0.00
40	001979	招商蛇口	300	6,408.00	0.00
41	300059	东方财富	520	6,250.40	0.00
42	000166	申万宏源	1,100	6,160.00	0.00
43	002128	露天煤业	700	6,090.00	0.00
44	000069	华侨城 A	600	6,036.00	0.00
45	300024	机器人	300	5,850.00	0.00
46	002475	立讯精密	200	5,848.00	0.00
47	002142	宁波银行	300	5,790.00	0.00
48	002241	歌尔股份	300	5,784.00	0.00

49	000783	长江证券	600	5,682.00	0.00
50	002013	中航机电	550	5,632.00	0.00
51	000413	东旭光电	500	5,610.00	0.00
52	002456	欧菲光	300	5,451.00	0.00
53	002466	天齐锂业	100	5,435.00	0.00
54	002736	国信证券	400	5,300.00	0.00
55	000656	金科股份	800	5,232.00	0.00
56	000049	德赛电池	100	5,181.00	0.00
57	300098	高新兴	400	5,160.00	0.00
58	002673	西部证券	360	5,119.20	0.00
59	000568	泸州老窖	100	5,058.00	0.00
60	002594	比亚迪	100	4,995.00	0.00
61	000895	双汇发展	200	4,750.00	0.00
62	002085	万丰奥威	240	4,668.00	0.00
63	002202	金风科技	300	4,641.00	0.00
64	002460	赣锋锂业	100	4,625.00	0.00
65	000997	新大陆	200	4,538.00	0.00
66	000839	中信国安	450	4,495.50	0.00
67	300003	乐普医疗	200	4,422.00	0.00
68	000887	中鼎股份	200	4,418.00	0.00
69	000998	隆平高科	200	4,404.00	0.00
70	002007	华兰生物	120	4,380.00	0.00
71	002065	东华软件	200	4,358.00	0.00
72	000625	长安汽车	300	4,326.00	0.00
73	300408	三环集团	200	4,198.00	0.00
74	002310	东方园林	250	4,180.00	0.00
75	002572	索菲亚	100	4,100.00	0.00
76	300413	快乐购	200	4,058.00	0.00
77	300136	信维通信	100	4,002.00	0.00
78	002508	老板电器	90	3,913.20	0.00
79	002681	奋达科技	300	3,777.00	0.00
80	002179	中航光电	120	3,742.80	0.00
81	300070	碧水源	200	3,730.00	0.00
82	300226	上海钢联	100	3,720.00	0.00
83	000869	张裕 A	100	3,720.00	0.00
84	002271	东方雨虹	100	3,710.00	0.00
85	000768	中航飞机	200	3,688.00	0.00
86	002311	海大集团	200	3,654.00	0.00
87	002625	龙生股份	100	3,636.00	0.00
88	300017	网宿科技	299	3,608.93	0.00
89	000157	中联重科	800	3,592.00	0.00
90	002294	信立泰	100	3,566.00	0.00

91	000826	启迪桑德	100	3,512.00	0.00
92	300115	长盈精密	120	3,501.60	0.00
93	000540	中天城投	500	3,475.00	0.00
94	002095	生意宝	100	3,456.00	0.00
95	000623	吉林敖东	150	3,433.50	0.00
96	002358	森源电气	200	3,404.00	0.00
97	002044	美年健康	200	3,400.00	0.00
98	002422	科伦药业	200	3,304.00	0.00
99	000876	新希望	400	3,288.00	0.00
100	002252	上海莱士	160	3,238.40	0.00
101	002340	格林美	530	3,206.50	0.00
102	000559	万向钱潮	300	3,186.00	0.00
103	000999	华润三九	100	3,175.00	0.00
104	000786	北新建材	200	3,168.00	0.00
105	300244	迪安诊断	100	3,146.00	0.00
106	000630	铜陵有色	1,100	3,124.00	0.00
107	000066	长城电脑	344	3,099.44	0.00
108	300266	兴源环境	100	3,072.00	0.00
109	000728	国元证券	250	3,055.00	0.00
110	000793	华闻传媒	300	3,036.00	0.00
111	000686	东北证券	300	3,015.00	0.00
112	000970	中科三环	200	2,956.00	0.00
113	000709	河钢股份	700	2,933.00	0.00
114	002610	爱康科技	1,200	2,928.00	0.00
115	000988	华工科技	200	2,918.00	0.00
116	300203	聚光科技	100	2,812.00	0.00
117	002027	分众传媒	200	2,752.00	0.00
118	000750	国海证券	500	2,750.00	0.00
119	002714	牧原股份	100	2,722.00	0.00
120	000061	农产品	300	2,718.00	0.00
121	000415	渤海金控	400	2,692.00	0.00
122	300113	顺网科技	100	2,690.00	0.00
123	002491	通鼎互联	200	2,688.00	0.00
124	002717	岭南园林	100	2,680.00	0.00
125	000778	新兴铸管	400	2,680.00	0.00
126	000425	徐工机械	700	2,625.00	0.00
127	000581	威孚高科	100	2,590.00	0.00
128	002183	怡亚通	300	2,589.00	0.00
129	000009	中国宝安	320	2,588.80	0.00
130	000488	晨鸣纸业	200	2,580.00	0.00
131	002555	三七互娱	100	2,557.00	0.00
132	300124	汇川技术	100	2,554.00	0.00

133	002092	中泰化学	200	2,540.00	0.00
134	002019	亿帆医药	150	2,502.00	0.00
135	000693	ST 华泽	200	2,500.00	0.00
136	002143	印纪传媒	100	2,493.00	0.00
137	300142	沃森生物	200	2,472.00	0.00
138	002384	东山精密	100	2,470.00	0.00
139	000566	海南海药	185	2,453.10	0.00
140	300315	掌趣科技	300	2,448.00	0.00
141	300027	华谊兄弟	300	2,427.00	0.00
142	300347	泰格医药	100	2,420.00	0.00
143	002223	鱼跃医疗	100	2,368.00	0.00
144	002004	华邦健康	300	2,349.00	0.00
145	000402	金融街	200	2,344.00	0.00
146	002577	雷柏科技	100	2,297.00	0.00
147	300267	尔康制药	200	2,292.00	0.00
148	002544	杰赛科技	100	2,280.00	0.00
149	002153	石基信息	100	2,273.00	0.00
150	000917	电广传媒	200	2,260.00	0.00
151	002470	金正大	300	2,259.00	0.00
152	000060	中金岭南	200	2,240.00	0.00
153	002595	豪迈科技	100	2,223.00	0.00
154	002281	光迅科技	100	2,222.00	0.00
155	002407	多氟多	100	2,199.00	0.00
156	002081	金螳螂	200	2,196.00	0.00
157	002185	华天科技	300	2,172.00	0.00
158	002619	巨龙管业	340	2,165.80	0.00
159	000930	中粮生化	200	2,156.00	0.00
160	300355	蒙草生态	200	2,148.00	0.00
161	002465	海格通信	200	2,148.00	0.00
162	300257	开山股份	100	2,108.00	0.00
163	000088	盐田港	200	2,102.00	0.00
164	002782	可立克	100	2,095.00	0.00
165	300075	数字政通	100	2,094.00	0.00
166	300144	宋城演艺	100	2,087.00	0.00
167	002048	宁波华翔	100	2,086.00	0.00
168	002273	水晶光电	100	2,063.00	0.00
169	300294	博雅生物	50	2,062.00	0.00
170	000050	深天马 A	100	2,057.00	0.00
171	002399	海普瑞	100	2,023.00	0.00
172	002268	卫士通	120	2,018.40	0.00
173	000883	湖北能源	400	2,008.00	0.00
174	000059	华锦股份	200	2,002.00	0.00



175	300291	华录百纳	100	2,002.00	0.00
176	000860	顺鑫农业	100	2,001.00	0.00
177	000777	中核科技	100	1,996.00	0.00
178	002405	四维图新	100	1,976.00	0.00
179	002146	荣盛发展	200	1,974.00	0.00
180	300009	安科生物	120	1,969.20	0.00
181	002001	新和成	100	1,941.00	0.00
182	002396	星网锐捷	100	1,935.00	0.00
183	002716	金贵银业	100	1,919.00	0.00
184	002500	山西证券	200	1,916.00	0.00
185	002385	大北农	300	1,887.00	0.00
186	002573	清新环境	100	1,882.00	0.00
187	002410	广联达	100	1,880.00	0.00
188	300296	利亚德	100	1,880.00	0.00
189	002191	劲嘉股份	200	1,872.00	0.00
190	000089	深圳机场	200	1,870.00	0.00
191	000012	南玻 A	200	1,866.00	0.00
192	002439	启明星辰	100	1,860.00	0.00
193	002138	顺络电子	100	1,858.00	0.00
194	300085	银之杰	100	1,850.00	0.00
195	300055	万邦达	100	1,840.00	0.00
196	300324	旋极信息	100	1,824.00	0.00
197	000078	海王生物	300	1,809.00	0.00
198	000039	中集集团	100	1,803.00	0.00
199	300014	亿纬锂能	99	1,796.85	0.00
200	000400	许继电气	100	1,796.00	0.00
201	300133	华策影视	160	1,792.00	0.00
202	002375	亚厦股份	200	1,782.00	0.00
203	000006	深振业 A	200	1,762.00	0.00
204	000983	西山煤电	200	1,754.00	0.00
205	002603	以岭药业	100	1,746.00	0.00
206	000046	泛海控股	200	1,746.00	0.00
207	000671	阳光城	300	1,746.00	0.00
208	300433	蓝思科技	60	1,745.40	0.00
209	000825	太钢不锈	400	1,740.00	0.00
210	002022	科华生物	100	1,737.00	0.00
211	000977	浪潮信息	100	1,732.00	0.00
212	002665	首航节能	240	1,728.00	0.00
213	002354	天神娱乐	80	1,720.00	0.00
214	300253	卫宁健康	220	1,718.20	0.00
215	002195	二三四五	240	1,716.00	0.00
216	300377	赢时胜	150	1,708.50	0.00

217	002292	奥飞娱乐	100	1,690.00	0.00
218	002672	东江环保	100	1,689.00	0.00
219	000598	兴蓉环境	300	1,686.00	0.00
220	300002	神州泰岳	200	1,668.00	0.00
221	000732	泰禾集团	100	1,668.00	0.00
222	002051	中工国际	80	1,658.40	0.00
223	000592	平潭发展	300	1,656.00	0.00
224	002036	联创电子	100	1,650.00	0.00
225	002131	利欧股份	500	1,645.00	0.00
226	300251	光线传媒	200	1,638.00	0.00
227	300156	神雾环保	50	1,638.00	0.00
228	000712	锦龙股份	100	1,637.00	0.00
229	300036	超图软件	100	1,635.00	0.00
230	002050	三花智控	100	1,632.00	0.00
231	000627	天茂集团	200	1,616.00	0.00
232	002512	达华智能	100	1,615.00	0.00
233	002583	海能达	100	1,609.00	0.00
234	002285	世联行	200	1,604.00	0.00
235	300011	鼎汉技术	100	1,600.00	0.00
236	000766	通化金马	100	1,598.00	0.00
237	000733	振华科技	100	1,590.00	0.00
238	002353	杰瑞股份	100	1,582.00	0.00
239	002668	奥马电器	80	1,576.00	0.00
240	000979	中弘股份	600	1,572.00	0.00
241	000792	盐湖股份	150	1,567.50	0.00
242	002002	鸿达兴业	200	1,566.00	0.00
243	300058	蓝色光标	200	1,564.00	0.00
244	002444	巨星科技	100	1,558.00	0.00
245	002303	美盈森	200	1,544.00	0.00
246	000939	凯迪生态	300	1,530.00	0.00
247	002010	传化股份	100	1,526.00	0.00
248	000031	中粮地产	200	1,506.00	0.00
249	000519	江南红箭	119	1,499.40	0.00
250	000156	华数传媒	100	1,491.00	0.00
251	002643	万润股份	100	1,476.00	0.00
252	002078	太阳纸业	200	1,470.00	0.00
253	002266	浙富控股	300	1,464.00	0.00
254	000008	神州高铁	200	1,456.00	0.00
255	300168	万达信息	100	1,455.00	0.00
256	000807	云铝股份	200	1,444.00	0.00
257	002250	联化科技	100	1,430.00	0.00
258	000601	韶能股份	200	1,426.00	0.00

259	300182	捷成股份	149	1,424.44	0.00
260	000762	西藏矿业	100	1,417.00	0.00
261	300026	红日药业	300	1,413.00	0.00
262	000758	中色股份	200	1,402.00	0.00
263	300101	振芯科技	100	1,400.00	0.00
264	000959	首钢股份	200	1,398.00	0.00
265	300032	金龙机电	100	1,395.00	0.00
266	002589	瑞康医药	90	1,386.00	0.00
267	300020	银江股份	100	1,384.00	0.00
268	002043	兔宝宝	100	1,384.00	0.00
269	300146	汤臣倍健	100	1,374.00	0.00
270	002018	华信国际	200	1,370.00	0.00
271	300077	国民技术	100	1,369.00	0.00
272	300096	易联众	100	1,368.00	0.00
273	002373	千方科技	100	1,364.00	0.00
274	000960	锡业股份	100	1,361.00	0.00
275	002570	贝因美	100	1,360.00	0.00
276	300383	光环新网	100	1,356.00	0.00
277	300292	吴通控股	200	1,354.00	0.00
278	002089	新海宜	200	1,354.00	0.00
279	000806	银河生物	100	1,350.00	0.00
280	002482	广田集团	150	1,348.50	0.00
281	000027	深圳能源	200	1,346.00	0.00
282	300053	欧比特	100	1,345.00	0.00
283	000729	燕京啤酒	200	1,344.00	0.00
284	002477	雏鹰农牧	300	1,329.00	0.00
285	002041	登海种业	100	1,325.00	0.00
286	300159	新研股份	100	1,324.00	0.00
287	300310	宜通世纪	100	1,322.00	0.00
288	000878	云南铜业	100	1,319.00	0.00
289	300359	全通教育	100	1,307.00	0.00
290	002400	省广股份	162	1,300.86	0.00
291	002130	沃尔核材	200	1,286.00	0.00
292	002445	中南文化	100	1,285.00	0.00
293	300178	腾邦国际	100	1,280.00	0.00
294	002701	奥瑞金	200	1,278.00	0.00
295	002052	同洲电子	200	1,268.00	0.00
296	000975	银泰资源	100	1,263.00	0.00
297	300339	润和软件	100	1,260.00	0.00
298	000600	建投能源	100	1,227.00	0.00
299	002421	达实智能	200	1,224.00	0.00
300	000937	冀中能源	200	1,224.00	0.00

301	000926	福星股份	100	1,220.00	0.00
302	300273	和佳股份	100	1,216.00	0.00
303	000810	创维数字	100	1,213.00	0.00
304	000650	仁和药业	200	1,196.00	0.00
305	000690	宝新能源	200	1,196.00	0.00
306	300207	欣旺达	100	1,179.00	0.00
307	000718	苏宁环球	200	1,172.00	0.00
308	002261	拓维信息	100	1,171.00	0.00
309	000957	中通客车	100	1,170.00	0.00
310	300079	数码视讯	200	1,170.00	0.00
311	000543	皖能电力	200	1,166.00	0.00
312	300015	爱尔眼科	50	1,163.00	0.00
313	000987	越秀金控	100	1,163.00	0.00
314	002630	华西能源	100	1,159.00	0.00
315	002488	金固股份	100	1,157.00	0.00
316	002501	利源精制	100	1,137.00	0.00
317	000727	华东科技	400	1,132.00	0.00
318	000898	鞍钢股份	200	1,132.00	0.00
319	000099	中信海直	100	1,126.00	0.00
320	300228	富瑞特装	100	1,126.00	0.00
321	000516	国际医学	200	1,114.00	0.00
322	002123	梦网荣信	100	1,111.00	0.00
323	000090	天健集团	100	1,110.00	0.00
324	002699	美盛文化	80	1,104.00	0.00
325	002431	棕榈股份	100	1,102.00	0.00
326	000685	中山公用	100	1,095.00	0.00
327	002221	东华能源	100	1,091.00	0.00
328	002280	联络互动	100	1,088.00	0.00
329	002298	中电鑫龙	100	1,087.00	0.00
330	000882	华联股份	300	1,083.00	0.00
331	000829	天音控股	100	1,080.00	0.00
332	002416	爱施德	100	1,079.00	0.00
333	300116	坚瑞消防	100	1,075.00	0.00
334	300166	东方国信	80	1,074.40	0.00
335	002108	沧州明珠	80	1,068.00	0.00
336	002428	云南锗业	100	1,068.00	0.00
337	000539	粤电力 A	200	1,066.00	0.00
338	002237	恒邦股份	100	1,049.00	0.00
339	000547	航天发展	100	1,045.00	0.00
340	300185	通裕重工	400	1,044.00	0.00
341	300170	汉得信息	100	1,031.00	0.00
342	300147	香雪制药	100	1,027.00	0.00

343	002023	海特高新	100	1,027.00	0.00
344	002156	通富微电	100	1,018.00	0.00
345	000800	一汽轿车	100	1,017.00	0.00
346	002106	莱宝高科	100	1,013.00	0.00
347	000875	吉电股份	200	1,010.00	0.00
348	002276	万马股份	100	1,009.00	0.00
349	000848	承德露露	100	998.00	0.00
350	000667	美好置业	300	993.00	0.00
351	002217	合力泰	100	988.00	0.00
352	000751	锌业股份	200	982.00	0.00
353	002471	中超控股	200	978.00	0.00
354	000961	中南建设	150	978.00	0.00
355	002329	皇氏集团	100	961.00	0.00
356	002155	湖南黄金	100	957.00	0.00
357	000801	四川九洲	100	957.00	0.00
358	300431	暴风集团	40	953.20	0.00
359	300090	盛运环保	100	947.00	0.00
360	002104	恒宝股份	100	939.00	0.00
361	002031	巨轮智能	300	933.00	0.00
362	300012	华测检测	200	926.00	0.00
363	300083	劲胜精密	100	924.00	0.00
364	300287	飞利信	100	918.00	0.00
365	000541	佛山照明	100	911.00	0.00
366	002463	沪电股份	200	910.00	0.00
367	000851	高鸿股份	100	909.00	0.00
368	002245	澳洋顺昌	100	902.00	0.00
369	000426	兴业矿业	100	902.00	0.00
370	000902	新洋丰	100	900.00	0.00
371	000969	安泰科技	100	873.00	0.00
372	002176	江特电机	100	872.00	0.00
373	002390	信邦制药	100	871.00	0.00
374	002047	宝鹰股份	100	864.00	0.00
375	002121	科陆电子	100	860.00	0.00
376	000021	深科技	100	858.00	0.00
377	002073	软控股份	100	848.00	0.00
378	002563	森马服饰	100	848.00	0.00
379	300043	星辉娱乐	100	821.00	0.00
380	002318	久立特材	100	818.00	0.00
381	002161	远望谷	100	810.00	0.00
382	300197	铁汉生态	60	796.80	0.00
383	002467	二六三	100	792.00	0.00
384	000973	佛塑科技	100	772.00	0.00

385	002588	史丹利	100	769.00	0.00
386	002429	兆驰股份	250	767.50	0.00
387	000518	四环生物	100	765.00	0.00
388	000558	莱茵体育	100	760.00	0.00
389	001696	宗申动力	100	757.00	0.00
390	002056	横店东磁	100	750.00	0.00
391	002797	第一创业	80	736.80	0.00
392	002498	汉缆股份	200	732.00	0.00
393	002325	洪涛股份	100	730.00	0.00
394	002437	誉衡药业	100	728.00	0.00
395	000620	新华联	100	711.00	0.00
396	002244	滨江集团	100	692.00	0.00
397	002481	双塔食品	100	667.00	0.00
398	002099	海翔药业	100	666.00	0.00
399	002249	大洋电机	100	658.00	0.00
400	002030	达安基因	30	653.70	0.00
401	002489	浙江永强	100	638.00	0.00
402	002152	广电运通	75	623.25	0.00
403	000795	英洛华	100	621.00	0.00
404	002145	中核钛白	100	608.00	0.00
405	002550	千红制药	100	594.00	0.00
406	002067	景兴纸业	100	587.00	0.00
407	300352	北信源	100	577.00	0.00
408	002229	鸿博股份	50	560.00	0.00
409	002663	普邦股份	100	543.00	0.00
410	000563	陕国投 A	100	517.00	0.00
411	002493	荣盛石化	50	488.00	0.00
412	002005	德豪润达	100	477.00	0.00
413	002157	正邦科技	100	455.00	0.00
414	300274	阳光电源	40	443.60	0.00
415	300078	思创医惠	20	214.60	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	000333	美的集团	153,662.00	0.05
2	000651	格力电器	143,972.00	0.05
3	300498	温氏股份	95,794.00	0.03
4	000725	京东方 A	92,363.20	0.03

5	000858	五粮液	83,280.00	0.03
6	000002	万科 A	82,688.00	0.03
7	002415	海康威视	75,159.00	0.02
8	000001	平安银行	74,899.00	0.02
9	002304	洋河股份	50,215.00	0.02
10	000776	广发证券	50,125.00	0.02
11	002450	康得新	46,850.00	0.01
12	000063	中兴通讯	41,815.00	0.01
13	002024	苏宁云商	39,110.00	0.01
14	000538	云南白药	34,786.00	0.01
15	000783	长江证券	33,142.00	0.01
16	001979	招商蛇口	31,840.00	0.01
17	000166	申万宏源	29,471.00	0.01
18	002594	比亚迪	29,226.00	0.01
19	000568	泸州老窖	27,735.00	0.01
20	000423	东阿阿胶	25,880.00	0.01

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	000333	美的集团	409,252.00	0.13
2	000651	格力电器	379,940.00	0.12
3	300498	温氏股份	252,453.00	0.08
4	000725	京东方 A	229,382.00	0.07
5	000002	万科 A	227,337.00	0.07
6	000858	五粮液	214,188.00	0.07
7	000001	平安银行	200,392.00	0.06
8	002415	海康威视	173,811.00	0.06
9	000538	云南白药	167,509.00	0.05
10	000776	广发证券	134,569.00	0.04
11	002304	洋河股份	127,798.00	0.04
12	002450	康得新	116,459.00	0.04
13	000063	中兴通讯	109,403.00	0.03
14	002024	苏宁云商	105,564.00	0.03
15	001979	招商蛇口	95,983.14	0.03
16	000166	申万宏源	92,567.65	0.03
17	000783	长江证券	89,105.00	0.03
18	000568	泸州老窖	82,447.00	0.03

19	000423	东阿阿胶	81,807.00	0.03
20	300059	东方财富	81,800.00	0.03

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	4,433,048.11
卖出股票收入（成交）总额	14,557,229.03

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所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	深成ETF	ETF	交易型开放式	南方基金管理有限公司	300,322,011.04	94.53

#### 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

#### 7.12 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。



## 7.13 投资组合报告附注

### 7.13.1 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除广发证券(000776)，本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。根据 2016 年 11 月 28 日广发证券股份有限公司（下称广发证券，股票代码：000776）《广发证券股份有限公司关于收到中国证券监督管理委员会的公告》，广发证券于近日收到了《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（【2016】128 号），依据《证券公司监督管理条例》相关规定，对广发证券责令改正，给予警告，没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 7.13.2 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。

### 7.13.3 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	3,860.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	881.87
5	应收申购款	38,055.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	其他	-
-	合计	42,797.87

### 7.13.4 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。

### 7.13.5 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002075	沙钢股份	53,196.00	0.02	重大资产重组
2	002129	中环股份	52,101.00	0.02	重大事项
3	300088	长信科技	48,825.00	0.02	重大资产重组

4	002426	胜利精密	24,960.00	0.01	拟披露重大事项
5	002168	深圳惠程	22,087.00	0.01	重大资产重组
6	002049	紫光国芯	18,492.00	0.01	重大资产重组

## § 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

份额级别	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(%)
深成联接 A	14,155	25,797.25	416,922.15	0.11	364,743,102.34	99.89	-	-
深成联接 C	15	97,571.37	-	-	1,463,570.56	100.00	-	-
合计	14,170	25,873.22	416,922.15	0.11	366,206,672.90	99.89	-	-

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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	深成联接 A	294,279.12	0.0800
	深成联接 C	11.76	0.0000
	合计	294,290.88	0.0800

注：：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金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）。

### 8.3 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	深成联接 A	-
	深成联接 C	-
	合计	-

本基金基金经理持有本开放式基金	深成联接 A	0~10
	深成联接 C	-
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	深成联接 A	深成联接 C
基金合同生效日（2009 年 12 月 9 日）基金份额总额	3,272,356,687.80	-
本报告期期初基金份额总额	378,088,340.31	-
本报告期基金总申购份额	16,466,517.49	1,619,040.31
减：本报告期基金总赎回份额	29,394,833.31	155,469.75
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	365,160,024.49	1,463,570.56

## § 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	18,969,041.48	100.00	1,897.58	100.00	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	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 (%)
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	1,051,700,000.00	100.00	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-2-20
2	南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-2-20
3	关于南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金增设 C 类基金份额并修改基金合同的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-2-20
4	南方基金关于旗下部分基金增加中原银行为代销	中国证券报、上海证	2017-2-23

	机构及开通相关业务的公告	券报、证券时报	
5	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-2-23
6	南方基金关于旗下部分基金增加植信基金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-2-15
7	南方基金关于旗下部分基金增加肯特瑞财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-1-11
8	南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书（更新）（2016年第3号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-1-13
9	南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书（更新）摘要（2016年第3号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-1-13
10	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-4-23
11	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-1-13
12	南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金C类份额开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-2-20
13	南方基金关于旗下部分基金增加金斧子为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-1-6
14	南方基金关于旗下部分基金增加萧山农商银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-3-6
15	南方基金关于旗下部分基金增加广东南粤银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-3-22
16	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-4-5
17	南方基金关于旗下部分基金增加华夏财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-3-15
18	南方基金关于继续开展直销柜台部分指数型基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-3-1
19	南方基金关于旗下部分基金增加大河财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-4-6
20	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-5-24
21	南方基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低申购金额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-6-12

## § 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

注：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深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件。
- 2、深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同。
- 3、深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金托管协议。
- 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。
- 6、深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金半年度报告原文。

### 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>