

# 深证成份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、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 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	深证成份交易型开放式指数证券投资基金
------	--------------------

基金简称	南方深证成份 ETF
场内简称	深成 ETF
基金主代码	159903
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 4 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	433,154,507.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 2 月 2 日

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

## 2.2 基金产品说明

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

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	鲍文革	郭明
	联系电话	0755-82763888	010-66105799

电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-889-8899	95588
传真	0755-82763889	010-66105798
注册地址	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	张海波	易会满

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金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	北京市西城区太平桥大街 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	-1,851,591.97
本期利润	22,973,090.12
加权平均基金份额本期利润	0.0519
本期加权平均净值利润率	4.73%
本期基金份额净值增长率	4.71%
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	-94,909,549.13
期末可供分配基金份额利润	-0.2191
期末基金资产净值	492,130,319.43
期末基金份额净值	1.1362
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	-16.16%

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。

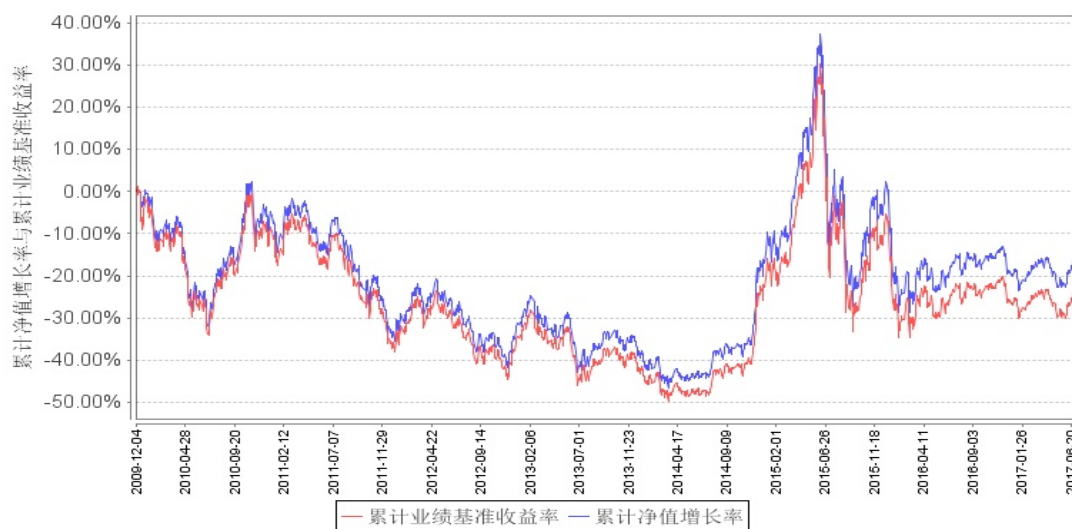
### 3.2 基金净值表现

#### 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

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	7.07	0.83	6.74	0.83	0.33	0.00
过去三个月	1.72	0.88	0.97	0.88	0.75	0.00
过去六个月	4.71	0.83	3.46	0.84	1.25	-0.01
过去一年	1.66	0.88	0.38	0.89	1.28	-0.01
过去三年	47.08	1.93	43.39	1.97	3.69	-0.04
自基金合同 生效起至今	-16.16	1.66	-23.48	1.69	7.32	-0.03

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

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：基金合同中关于基金投资比例的约定，本基金将全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现，正常情况下，本基金的指数化投资比例不低于基金资产净值的 95%。

## § 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	<p>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。</p> <p>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</p>



					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《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金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

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”、“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（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离。

(3) 根据指数半年度成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期跟踪误差和正偏离分别为 0.23% 和 1.25%，理想地完成了投资目标。

截至报告期末，本基金份额净值为 1.1362 元，报告期内，份额净值增长率为 4.71%，同期业绩基准增长率为 3.46%。

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

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

#### 4.8 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 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：深证成份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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.4.1	1,282,809.07	2,147,311.06
结算备付金		8,973.92	27,406.12
存出保证金		2,774.14	2,033.39
交易性金融资产	6.4.4.2	491,328,264.52	494,995,095.82
其中：股票投资		491,328,264.52	494,995,095.82
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		-	-
应收利息	6.4.4.5	298.00	352.85
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		492,623,119.65	497,172,199.24
<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		-	320,757.72
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		194,886.05	213,273.78
应付托管费		38,977.21	42,654.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	663.88	35,005.30
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	258,273.08	484,672.78
负债合计		492,800.22	1,096,364.33
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.4.9	587,039,868.56	619,566,268.78
未分配利润	6.4.4.10	-94,909,549.13	-123,490,433.87
所有者权益合计		492,130,319.43	496,075,834.91
负债和所有者权益总计		492,623,119.65	497,172,199.24

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1362 元，基金份额总额 433,154,507.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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>		24,737,422.48	-98,580,644.77
1. 利息收入		4,805.92	22,256.22
其中：存款利息收入	6.4.4.11	4,805.92	22,243.72
债券利息收入		-	12.50
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）		-94,277.47	-29,163,185.72
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-3,180,753.40	-32,254,171.41
基金投资收益	6.4.4.13	-	-
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	3,086,475.93	3,090,985.69
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	24,824,682.09	-69,349,962.06
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	2,211.94	-89,753.21
<b>减：二、费用</b>		1,764,332.36	1,978,756.94

1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	1,202,486.76	1,319,054.91
2. 托管费	6.4.7.2.2	240,497.32	263,810.98
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.4.20	12,825.20	69,021.95
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	308,523.08	326,869.10
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		22,973,090.12	-100,559,401.71
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		22,973,090.12	-100,559,401.71

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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）	619,566,268.78	-123,490,433.87	496,075,834.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	22,973,090.12	22,973,090.12
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）	-32,526,400.22	5,607,794.62	-26,918,605.60
其中：1. 基金申购款	8,131,600.05	-1,664,054.17	6,467,545.88
2. 基金赎回款	-40,658,000.27	7,271,848.79	-33,386,151.48
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）	587,039,868.56	-94,909,549.13	492,130,319.43
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）	635,829,468.86	-9,640,125.50	626,189,343.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-100,559,401.71	-100,559,401.71
三、本期基金份额交易产生的	20,329,000.14	-4,853,495.76	15,475,504.38

基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	105,710,800.68	-22,545,394.97	83,165,405.71
2. 基金赎回款	-85,381,800.54	17,691,899.21	-67,689,901.33
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)	656,158,469.00	-115,053,022.97	541,105,446.03

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	1,282,809.07
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	1,282,809.07

##### 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	563,356,593.40	491,328,264.52	-72,028,328.88
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	563,356,593.40	491,328,264.52	-72,028,328.88

#### 6.4.4.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 6.4.4.4 买入返售金融资产

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	293.32
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	3.60
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	1.08
合计	298.00

#### 6.4.4.6 其他资产

注：无。

#### 6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	663.88
银行间市场应付交易费用	-
合计	663.88

#### 6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

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

#### 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	457,154,507.00	619,566,268.78
本期申购	6,000,000.00	8,131,600.05
本期赎回 (以“-”号填列)	-30,000,000.00	-40,658,000.27
本期末	433,154,507.00	587,039,868.56

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	158,144,115.80	-281,634,549.67	-123,490,433.87
本期利润	-1,851,591.97	24,824,682.09	22,973,090.12
本期基金份额交易产生的变动数	-8,193,182.01	13,800,976.63	5,607,794.62
其中：基金申购款	2,035,440.68	-3,699,494.85	-1,664,054.17
基金赎回款	-10,228,622.69	17,500,471.48	7,271,848.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	148,099,341.82	-243,008,890.95	-94,909,549.13

#### 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	4,044.14
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	743.80	
其他	17.98	
合计	4,805.92	

#### 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	2,460,517.88
股票投资收益——赎回差价收入	-5,641,271.28	
股票投资收益——申购差价收入	-	
合计	-3,180,753.40	

**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	8,720,863.66
减：卖出股票成本总额	6,260,345.78
买卖股票差价收入	2,460,517.88

**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	33,386,151.48
减：现金支付赎回款总额	-323,860.52
减：赎回股票成本总额	39,351,283.28
赎回差价收入	-5,641,271.28

**6.4.4.13 基金投资收益**

注：无。

**6.4.4.14 债券投资收益**

注：无。

**6.4.4.14.1 资产支持证券投资收益**

注：无。

**6.4.4.15 贵金属投资收益**

注：无。

**6.4.4.16 衍生工具收益**

注：无。

**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	3,086,475.93
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,086,475.93

**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	24,824,682.09

股票投资	24,824,682.09
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
-	-
其他	-
合计	24,824,682.09

#### 6.4.4.19 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	-
替代损益	2,211.94
合计	2,211.94

#### 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	12,825.20
银行间市场交易费用	-
合计	12,825.20

#### 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	29,752.78
信息披露费	148,767.52
银行费用	250.00
其他	129,752.78
合计	308,523.08

### 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
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
南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“南方深证成份 ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

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	18,853,215.65	100.00	-	-

#### 6.4.7.1.2 权证交易

注：无。

#### 6.4.7.1.3 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	1,839.66	100.00	663.88	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)

华泰证券	-	-	-	-
------	---	---	---	---

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.7.2 关联方报酬

##### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,202,486.76	1,319,054.91
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.5% / 当年天数。

##### 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	240,497.32	263,810.98

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

##### 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：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。

##### 6.4.7.4 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：本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

#### 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 (%)
南方深证成份 ETF联接基金	264,321,432.00	61.02	273,321,432.00	59.79

注：南方深证成份 ETF 联接基金投资本基金相关的费用按基金合同和更新的招募说明书的有关规定以及与券商约定的席位佣金费率支付。

#### 6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,282,809.07	4,044.14	3,191,394.03	20,800.54

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。

#### 6.4.7.6 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

注：本基金本报告期内无利润分配。

#### 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	2017年	2017-07-05	新股认	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

	电子	06 月 27 日		购						
--	----	--------------	--	---	--	--	--	--	--	--

## 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
300104	乐视网	2017-04-17	重大资产重组	30.68		-	93,993	4,727,801.71	2,883,705.24	-
000100	TCL集团	2017-04-21	重大事项	3.43	2017-07-26	3.72	654,171	3,144,007.14	2,243,806.53	-
000656	金科股份	2017-05-05	重大资产重组	6.54	2017-07-05	5.92	250,000	1,545,298.74	1,635,000.00	-
000503	海虹控股	2017-05-11	重大资产重组	24.93		-	57,950	2,633,102.76	1,444,693.50	-
002252	上海莱士	2017-04-21	重大事项	20.24		-	71,280	1,472,353.08	1,442,707.20	-
300088	长信科技	2016-09-12	重大资产重组	15.75		-	81,402	1,068,116.91	1,282,081.50	-
002426	胜利精密	2017-01-16	拟披露重大事项	7.68		-	149,100	1,433,093.97	1,145,088.00	-
000887	中鼎股份	2017-04-27	重大资产重组	22.09	2017-07-14	19.88	49,800	1,384,704.50	1,100,082.00	-
002168	深圳惠程	2017-01-23	重大资产重组	16.99		-	63,400	830,391.32	1,077,166.00	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.27		-	121,420	2,121,272.67	1,004,143.40	-
002075	沙钢股份	2016-09-19	重大资产重组	16.12		-	60,200	607,019.11	970,424.00	-
002049	紫光国芯	2017-02-20	重大资产重组	30.82	2017-07-17	27.74	30,813	1,391,105.30	949,656.66	-
300134	大富科技	2017-02-09	重大资产	23.36		-	32,169	968,167.87	751,467.84	-



			重组								
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项	10.33	2017-08-02	11.36	71,752	792,988.63	741,198.16	-	
300367	东方网力	2016-12-15	重大资产重组	20.00	2017-07-03	18.01	35,000	928,205.75	700,000.00	-	
300271	华宇软件	2017-06-22	拟披露重大事项	16.59	2017-07-04	16.80	38,340	873,876.24	636,060.60	-	
300267	尔康制药	2017-05-10	重大事项	11.46		-	54,900	905,499.36	629,154.00	-	
002642	荣之联	2017-04-10	重大事项	25.06	2017-07-07	22.54	24,000	749,062.17	601,440.00	-	
000034	神州数码	2017-03-21	重大资产重组	24.45	2017-07-18	22.01	24,185	537,157.08	591,323.25	-	
300291	华录百纳	2017-04-19	重大资产重组	20.02		-	29,053	973,467.93	581,641.06	-	
002399	海普瑞	2017-04-28	重大事项	20.23		-	28,220	632,663.51	570,890.60	-	
002025	航天电器	2016-09-12	重大事项	24.95	2017-07-04	22.46	21,690	547,948.04	541,165.50	-	
300098	高新兴	2017-06-22	拟披露重大事项	12.90	2017-07-03	13.18	38,400	602,772.93	495,360.00	-	
002505	大康农业	2017-03-13	重大资产重组	3.50		-	136,710	562,901.00	478,485.00	-	
002600	江粉磁材	2017-02-27	重大资产重组	11.46		-	40,200	411,891.12	460,692.00	-	
300075	数字政通	2017-06-29	重大事项	20.94	2017-07-17	18.86	21,000	563,410.41	439,740.00	-	
002358	森源电气	2017-05-12	重大资产重组	17.02	2017-07-12	16.68	25,600	523,170.34	435,712.00	-	
002128	露天煤业	2017-03-17	重大资产重组	8.70		-	49,900	497,620.81	434,130.00	-	
300364	中文在线	2017-02-13	重大资产	37.28		-	11,600	602,013.71	432,448.00	-	

			重组								
300085	银之杰	2017-06-30	重大事项	18.50	2017-07-07	18.88	23,270	895,267.64	430,495.00	-	
002625	龙生股份	2017-04-13	重大资产重组	36.36		-	10,700	503,313.63	389,052.00	-	
002610	爱康科技	2017-05-12	重大事项	2.44	2017-08-02	2.44	154,200	501,012.21	376,248.00	-	
000099	中信海直	2017-05-04	重大资产重组	11.26		-	33,200	562,211.16	373,832.00	-	
002143	印纪传媒	2017-04-18	重大资产重组	24.93		-	14,500	470,793.84	361,485.00	-	
300413	快乐购	2017-04-05	重大资产重组	20.29		-	17,700	535,729.86	359,133.00	-	
002681	奋达科技	2017-06-22	重大事项	12.59	2017-07-03	12.70	28,140	441,220.71	354,282.60	-	
000693	ST 华泽	2016-03-01	重大事项	12.50		-	25,500	466,489.64	318,750.00	-	
002619	巨龙管业	2017-05-24	重大资产重组	6.37		-	30,080	288,433.03	191,609.60	-	

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

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。

### 6.4.10 金融工具风险及管理

#### 6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由

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

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

#### 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，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)

#### 6.4.10.3 流动性风险

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性

比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 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，本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

#### 6.4.10.4 市场风险

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

##### 6.4.10.4.1 利率风险

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

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

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

##### 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	1,282,809.07	-	-	-	1,282,809.07
结算备付金	8,973.92	-	-	-	8,973.92
存出保证金	2,774.14	-	-	-	2,774.14
交易性金融资产	-	-	-	491,328,264.52	491,328,264.52
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	298.00	298.00
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	1,294,557.13			491,328,562.52	492,623,119.65
负债					
应付赎回款					
应付管理人报酬				194,886.05	194,886.05
应付托管费				38,977.21	38,977.21
应付证券清算款					
卖出回购金融资产款					
应付销售服务费					
应付交易费用				663.88	663.88
应付利息					
应付利润					
其他负债				258,273.08	258,273.08
负债总计				492,800.22	492,800.22
利率敏感度缺口	1,294,557.13			490,835,762.30	492,130,319.43
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	2,147,311.06				2,147,311.06
结算备付金	27,406.12				27,406.12
存出保证金	2,033.39				2,033.39
交易性金融资产				494,995,095.82	494,995,095.82
应收利息				352.85	352.85
资产总计	2,176,750.57			494,995,448.67	497,172,199.24
负债					
应付证券清算款				320,757.72	320,757.72
应付管理人报酬				213,273.78	213,273.78
应付托管费				42,654.75	42,654.75
应付交易费用				35,005.30	35,005.30
其他负债				484,672.78	484,672.78
负债总计				1,096,364.33	1,096,364.33
利率敏感度缺口	2,176,750.57			493,899,084.34	496,075,834.91

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和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

#### 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	491,328,264.52	99.84	494,992,955.82	99.78
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	491,328,264.52	99.84	494,992,955.82	99.78

#### 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	1. 业绩比较基准上升 5%	24,350,000.00	24,370,000.00
	2. 业绩比较基准下降 5%	-24,350,000.00	-24,370,000.00

#### 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	491,328,264.52	99.74
	其中：股票	491,328,264.52	99.74
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	1,291,782.99	0.26
-	-	-	-
-	其他各项资产	3,072.14	0.00
-	合计	492,623,119.65	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	11,582,495.06	2.35
B	采矿业	5,575,255.60	1.13

C	制造业	291,382,966.67	59.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,836,035.30	1.39
E	建筑业	9,128,374.64	1.85
F	批发和零售业	12,188,199.30	2.48
G	交通运输、仓储和邮政业	1,795,671.00	0.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,787,217.72	10.12
J	金融业	30,703,774.66	6.24
K	房地产业	25,187,948.39	5.12
L	租赁和商务服务业	6,556,509.10	1.33
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,489,456.08	1.93
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,897,548.04	0.79
R	文化、体育和娱乐业	9,433,033.11	1.92
S	综合	1,264,984.76	0.26
	合计	474,809,469.43	96.48

#### 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	563,654.00	0.11
C	制造业	11,022,959.07	2.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	726,012.00	0.15
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	373,832.00	0.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,451,899.22	0.50
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	317,440.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	444,480.00	0.09
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	618,518.80	0.13
S	综合	-	-
	合计	16,518,795.09	3.36



## 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	000651	格力电器	384,940	15,847,979.80	3.22
2	000333	美的集团	360,307	15,507,613.28	3.15
3	000725	京东方 A	2,055,342	8,550,222.72	1.74
4	000858	五粮液	149,441	8,317,886.06	1.69
5	000002	万科 A	332,758	8,308,967.26	1.69
6	002415	海康威视	239,481	7,735,236.30	1.57
7	300498	温氏股份	295,424	6,924,738.56	1.41
8	000001	平安银行	682,012	6,404,092.68	1.30
9	000063	中兴通讯	189,933	4,509,009.42	0.92
10	002450	康得新	193,809	4,364,578.68	0.89
11	000776	广发证券	244,659	4,220,367.75	0.86
12	002304	洋河股份	44,661	3,877,021.41	0.79
13	002024	苏宁云商	310,251	3,490,323.75	0.71
14	001979	招商蛇口	158,227	3,379,728.72	0.69
15	000538	云南白药	35,586	3,339,746.10	0.68
16	002230	科大讯飞	77,280	3,083,472.00	0.63
17	000423	东阿阿胶	42,271	3,038,862.19	0.62
18	000568	泸州老窖	57,492	2,907,945.36	0.59
19	000166	申万宏源	518,869	2,905,666.40	0.59
20	300104	乐视网	93,993	2,883,705.24	0.59
21	002456	欧菲光	155,502	2,825,471.34	0.57
22	002466	天齐锂业	51,880	2,819,678.00	0.57
23	002142	宁波银行	143,025	2,760,382.50	0.56
24	002241	歌尔股份	142,210	2,741,808.80	0.56
25	002236	大华股份	119,878	2,734,417.18	0.56
26	000783	长江证券	287,219	2,719,963.93	0.55
27	000069	华侨城 A	261,049	2,626,152.94	0.53
28	300072	三聚环保	69,946	2,591,499.30	0.53
29	000338	潍柴动力	193,504	2,554,252.80	0.52
30	000413	东旭光电	227,200	2,549,184.00	0.52
31	300059	东方财富	211,186	2,538,455.72	0.52
32	000625	长安汽车	173,598	2,503,283.16	0.51
33	002008	大族激光	69,700	2,414,408.00	0.49
34	300070	碧水源	127,226	2,372,764.90	0.48

35	300136	信维通信	57,360	2,295,547.20	0.47
36	000100	TCL 集团	654,171	2,243,806.53	0.46
37	002594	比亚迪	44,736	2,234,563.20	0.45
38	002673	西部证券	155,754	2,214,821.88	0.45
39	000839	中信国安	218,550	2,183,314.50	0.44
40	300124	汇川技术	84,294	2,152,868.76	0.44
41	002475	立讯精密	72,845	2,129,987.80	0.43
42	002202	金风科技	133,936	2,071,989.92	0.42
43	000768	中航飞机	107,390	1,980,271.60	0.40
44	300024	机器人	100,390	1,957,605.00	0.40
45	002736	国信证券	147,700	1,957,025.00	0.40
46	002460	赣锋锂业	41,100	1,900,875.00	0.39
47	000895	双汇发展	79,024	1,876,820.00	0.38
48	002739	万达院线	36,400	1,855,308.00	0.38
49	300408	三环集团	87,700	1,840,823.00	0.37
50	000728	国元证券	150,496	1,839,061.12	0.37
51	000963	华东医药	36,364	1,807,290.80	0.37
52	002572	索菲亚	42,864	1,757,424.00	0.36
53	000157	中联重科	385,427	1,730,567.23	0.35
54	002065	东华软件	76,700	1,671,293.00	0.34
55	002508	老板电器	38,260	1,663,544.80	0.34
56	300003	乐普医疗	74,400	1,644,984.00	0.33
57	000623	吉林敖东	71,768	1,642,769.52	0.33
58	002007	华兰生物	44,800	1,635,200.00	0.33
59	000656	金科股份	250,000	1,635,000.00	0.33
60	002044	美年健康	93,100	1,582,700.00	0.32
61	002271	东方雨虹	42,400	1,573,040.00	0.32
62	000540	中天城投	223,500	1,553,325.00	0.32
63	002085	万丰奥威	79,788	1,551,876.60	0.32
64	002310	东方园林	92,550	1,547,436.00	0.31
65	000793	华闻传媒	150,700	1,525,084.00	0.31
66	000661	长春高新	11,800	1,523,498.00	0.31
67	000709	河钢股份	360,300	1,509,657.00	0.31
68	300156	神雾环保	45,883	1,503,127.08	0.31
69	000826	启迪桑德	42,507	1,492,845.84	0.30
70	000630	铜陵有色	518,000	1,471,120.00	0.30
71	300017	网宿科技	121,045	1,461,013.15	0.30
72	000503	海虹控股	57,950	1,444,693.50	0.29
73	002252	上海莱士	71,280	1,442,707.20	0.29
74	000060	中金岭南	128,230	1,436,176.00	0.29
75	000066	长城电脑	158,238	1,425,724.38	0.29
76	300315	掌趣科技	173,500	1,415,760.00	0.29

77	002340	格林美	233,900	1,415,095.00	0.29
78	002465	海格通信	129,600	1,391,904.00	0.28
79	000876	新希望	167,752	1,378,921.44	0.28
80	000750	国海证券	246,350	1,354,925.00	0.28
81	000425	徐工机械	359,508	1,348,155.00	0.27
82	002405	四维图新	68,031	1,344,292.56	0.27
83	300088	长信科技	81,402	1,282,081.50	0.26
84	000559	万向钱潮	119,140	1,265,266.80	0.26
85	000009	中国宝安	156,364	1,264,984.76	0.26
86	000997	新大陆	55,080	1,249,765.20	0.25
87	300115	长盈精密	42,240	1,232,563.20	0.25
88	000402	金融街	103,863	1,217,274.36	0.25
89	300266	兴源环境	39,500	1,213,440.00	0.25
90	002081	金螳螂	110,326	1,211,379.48	0.25
91	000686	东北证券	120,400	1,210,020.00	0.25
92	000581	威孚高科	46,351	1,200,490.90	0.24
93	000039	中集集团	66,400	1,197,192.00	0.24
94	002074	国轩高科	37,900	1,195,745.00	0.24
95	000998	隆平高科	54,300	1,195,686.00	0.24
96	000778	新兴铸管	178,332	1,194,824.40	0.24
97	300296	利亚德	62,300	1,171,240.00	0.24
98	002426	胜利精密	149,100	1,145,088.00	0.23
99	000983	西山煤电	128,800	1,129,576.00	0.23
100	002092	中泰化学	88,200	1,120,140.00	0.23
101	000786	北新建材	69,500	1,100,880.00	0.22
102	000887	中鼎股份	49,800	1,100,082.00	0.22
103	002385	大北农	174,750	1,099,177.50	0.22
104	000970	中科三环	73,300	1,083,374.00	0.22
105	002168	深圳惠程	63,400	1,077,166.00	0.22
106	000917	电广传媒	94,900	1,072,370.00	0.22
107	002050	三花智控	65,300	1,065,696.00	0.22
108	300027	华谊兄弟	131,175	1,061,205.75	0.22
109	300144	宋城演艺	50,670	1,057,482.90	0.21
110	002183	怡亚通	119,240	1,029,041.20	0.21
111	002027	分众传媒	74,600	1,026,496.00	0.21
112	000999	华润三九	31,900	1,012,825.00	0.21
113	000050	深天马 A	49,200	1,012,044.00	0.21
114	002311	海大集团	55,340	1,011,061.80	0.21
115	002129	中环股份	121,420	1,004,143.40	0.20
116	002038	双鹭药业	34,400	1,002,760.00	0.20
117	002185	华天科技	137,940	998,685.60	0.20
118	002500	山西证券	104,200	998,236.00	0.20

119	300033	同花顺	16,000	995,360.00	0.20
120	002407	多氟多	45,200	993,948.00	0.20
121	002179	中航光电	31,730	989,658.70	0.20
122	002573	清新环境	52,200	982,404.00	0.20
123	000415	渤海金控	145,960	982,310.80	0.20
124	300142	沃森生物	79,400	981,384.00	0.20
125	002294	信立泰	27,300	973,518.00	0.20
126	002366	台海核电	20,730	972,444.30	0.20
127	002410	广联达	51,719	972,317.20	0.20
128	002075	沙钢股份	60,200	970,424.00	0.20
129	002146	荣盛发展	98,000	967,260.00	0.20
130	300015	爱尔眼科	41,138	956,869.88	0.19
131	000400	许继电气	53,100	953,676.00	0.19
132	002049	紫光国芯	30,813	949,656.66	0.19
133	000488	晨鸣纸业	72,800	939,120.00	0.19
134	002422	科伦药业	56,178	928,060.56	0.19
135	002195	二三四五	129,140	923,351.00	0.19
136	002223	鱼跃医疗	38,600	914,048.00	0.19
137	000878	云南铜业	68,996	910,057.24	0.18
138	000566	海南海药	68,534	908,760.84	0.18
139	002030	达安基因	41,702	908,686.58	0.18
140	002470	金正大	120,000	903,600.00	0.18
141	300055	万邦达	49,000	901,600.00	0.18
142	000960	锡业股份	65,500	891,455.00	0.18
143	000028	国药一致	11,000	889,900.00	0.18
144	002273	水晶光电	42,800	882,964.00	0.18
145	000598	兴蓉环境	155,000	871,100.00	0.18
146	300058	蓝色光标	111,234	869,849.88	0.18
147	002583	海能达	53,620	862,745.80	0.18
148	300159	新研股份	64,900	859,276.00	0.17
149	300383	光环新网	63,100	855,636.00	0.17
150	000977	浪潮信息	49,400	855,608.00	0.17
151	300168	万达信息	58,346	848,934.30	0.17
152	300418	昆仑万维	37,000	846,190.00	0.17
153	000547	航天发展	80,800	844,360.00	0.17
154	002051	中工国际	40,448	838,487.04	0.17
155	002384	东山精密	33,900	837,330.00	0.17
156	300146	汤臣倍健	60,800	835,392.00	0.17
157	002400	省广股份	103,966	834,846.98	0.17
158	000046	泛海控股	95,112	830,327.76	0.17
159	000883	湖北能源	165,400	830,308.00	0.17
160	002138	顺络电子	44,600	828,668.00	0.17

161	002217	合力泰	83,600	825,968.00	0.17
162	000671	阳光城	140,490	817,651.80	0.17
163	000825	太钢不锈	186,400	810,840.00	0.16
164	002439	启明星辰	43,400	807,240.00	0.16
165	300113	顺网科技	29,982	806,515.80	0.16
166	300355	蒙草生态	74,660	801,848.40	0.16
167	300244	迪安诊断	25,396	798,958.16	0.16
168	002001	新和成	41,130	798,333.30	0.16
169	000792	盐湖股份	76,334	797,690.30	0.16
170	002004	华邦健康	101,100	791,613.00	0.16
171	002108	沧州明珠	59,205	790,386.75	0.16
172	000988	华工科技	53,800	784,942.00	0.16
173	000930	中粮生化	72,800	784,784.00	0.16
174	000513	丽珠集团	11,460	780,426.00	0.16
175	002019	亿帆医药	46,500	775,620.00	0.16
176	000697	炼石有色	37,500	767,625.00	0.16
177	002491	通鼎互联	57,100	767,424.00	0.16
178	300197	铁汉生态	57,454	762,989.12	0.16
179	000078	海王生物	124,850	752,845.50	0.15
180	000059	华锦股份	75,200	752,752.00	0.15
181	300134	大富科技	32,169	751,467.84	0.15
182	002714	牧原股份	27,500	748,550.00	0.15
183	002635	安洁科技	20,600	746,132.00	0.15
184	002343	慈文传媒	19,700	745,842.00	0.15
185	000627	天茂集团	91,900	742,552.00	0.15
186	002013	中航机电	71,752	741,198.16	0.15
187	000089	深圳机场	79,100	739,585.00	0.15
188	000938	紫光股份	12,100	739,552.00	0.15
189	000738	中航动控	37,750	738,767.50	0.15
190	002221	东华能源	67,600	737,516.00	0.15
191	000758	中色股份	104,360	731,563.60	0.15
192	002640	跨境通	34,400	731,000.00	0.15
193	002078	太阳纸业	99,200	729,120.00	0.15
194	300122	智飞生物	37,900	724,269.00	0.15
195	002555	三七互娱	28,300	723,631.00	0.15
196	002431	棕榈股份	65,650	723,463.00	0.15
197	000732	泰禾集团	43,300	722,244.00	0.15
198	002152	广电运通	86,700	720,477.00	0.15
199	002176	江特电机	82,600	720,272.00	0.15
200	300002	神州泰岳	85,984	717,106.56	0.15
201	000729	燕京啤酒	106,600	716,352.00	0.15
202	000939	凯迪生态	140,400	716,040.00	0.15

203	300324	旋极信息	39,200	715,008.00	0.15
204	000979	中弘股份	270,340	708,290.80	0.14
205	000516	国际医学	126,800	706,276.00	0.14
206	002292	奥飞娱乐	41,700	704,730.00	0.14
207	002131	利欧股份	214,050	704,224.50	0.14
208	002250	联化科技	49,200	703,560.00	0.14
209	300203	聚光科技	24,900	700,188.00	0.14
210	300367	东方网力	35,000	700,000.00	0.14
211	000006	深振业 A	79,400	699,514.00	0.14
212	000008	神州高铁	96,000	698,880.00	0.14
213	002048	宁波华翔	33,400	696,724.00	0.14
214	000800	一汽轿车	68,500	696,645.00	0.14
215	300014	亿纬锂能	38,321	695,526.15	0.14
216	000806	银河生物	51,400	693,900.00	0.14
217	300253	卫宁健康	88,756	693,184.36	0.14
218	002701	奥瑞金	108,300	692,037.00	0.14
219	002191	劲嘉股份	73,475	687,726.00	0.14
220	000592	平潭发展	123,500	681,720.00	0.14
221	002373	千方科技	49,700	677,908.00	0.14
222	002501	利源精制	59,605	677,708.85	0.14
223	002424	贵州百灵	35,900	677,074.00	0.14
224	002665	首航节能	93,390	672,408.00	0.14
225	000012	南玻 A	71,500	667,095.00	0.14
226	002624	完美世界	19,400	665,420.00	0.14
227	000031	中粮地产	88,341	665,207.73	0.14
228	300077	国民技术	48,200	659,858.00	0.13
229	000712	锦龙股份	40,100	656,437.00	0.13
230	002353	杰瑞股份	41,387	654,742.34	0.13
231	300090	盛运环保	68,608	649,717.76	0.13
232	000898	鞍钢股份	114,753	649,501.98	0.13
233	300274	阳光电源	58,535	649,153.15	0.13
234	300166	东方国信	48,123	646,291.89	0.13
235	002589	瑞康医药	41,960	646,184.00	0.13
236	000600	建投能源	52,500	644,175.00	0.13
237	300433	蓝思科技	22,140	644,052.60	0.13
238	000027	深圳能源	95,500	642,715.00	0.13
239	000690	宝新能源	107,100	640,458.00	0.13
240	000860	顺鑫农业	32,000	640,320.00	0.13
241	300182	捷成股份	66,759	638,216.04	0.13
242	300271	华宇软件	38,340	636,060.60	0.13
243	300251	光线传媒	77,420	634,069.80	0.13
244	300133	华策影视	56,478	632,553.60	0.13

245	002444	巨星科技	40,500	630,990.00	0.13
246	002411	必康股份	21,800	630,456.00	0.13
247	300267	尔康制药	54,900	629,154.00	0.13
248	000807	云铝股份	86,500	624,530.00	0.13
249	002477	雏鹰农牧	140,100	620,643.00	0.13
250	000518	四环生物	81,100	620,415.00	0.13
251	002153	石基信息	27,285	620,188.05	0.13
252	002544	杰赛科技	27,200	620,160.00	0.13
253	000727	华东科技	218,900	619,487.00	0.13
254	002002	鸿达兴业	78,757	616,667.31	0.13
255	300026	红日药业	130,800	616,068.00	0.13
256	300257	开山股份	28,900	609,212.00	0.12
257	002368	太极股份	22,000	609,180.00	0.12
258	000519	江南红箭	48,299	608,567.40	0.12
259	300079	数码视讯	103,400	604,890.00	0.12
260	300068	南都电源	35,910	604,724.40	0.12
261	002642	荣之联	24,000	601,440.00	0.12
262	000156	华数传媒	40,200	599,382.00	0.12
263	002570	贝因美	43,900	597,040.00	0.12
264	000088	盐田港	56,800	596,968.00	0.12
265	002174	游族网络	18,785	596,611.60	0.12
266	002522	浙江众成	36,400	595,140.00	0.12
267	002266	浙富控股	121,930	595,018.40	0.12
268	002022	科华生物	34,101	592,334.37	0.12
269	000034	神州数码	24,185	591,323.25	0.12
270	000158	常山股份	37,300	589,340.00	0.12
271	300001	特锐德	35,100	588,276.00	0.12
272	300291	华录百纳	29,053	581,641.06	0.12
273	002043	兔宝宝	42,000	581,280.00	0.12
274	300199	翰宇药业	37,872	580,956.48	0.12
275	002630	华西能源	50,100	580,659.00	0.12
276	000926	福星股份	47,100	574,620.00	0.12
277	000685	中山公用	52,440	574,218.00	0.12
278	002244	滨江集团	82,900	573,668.00	0.12
279	000667	美好置业	173,300	573,623.00	0.12
280	002390	信邦制药	65,750	572,682.50	0.12
281	300020	银江股份	41,300	571,592.00	0.12
282	002281	光迅科技	25,700	571,054.00	0.12
283	002399	海普瑞	28,220	570,890.60	0.12
284	002603	以岭药业	32,600	569,196.00	0.12
285	002672	东江环保	33,700	569,193.00	0.12
286	300207	欣旺达	48,200	568,278.00	0.12

287	002643	万润股份	38,350	566,046.00	0.12
288	002104	恒宝股份	59,900	562,461.00	0.11
289	002285	世联行	70,070	561,961.40	0.11
290	300347	泰格医药	23,100	559,020.00	0.11
291	002155	湖南黄金	58,400	558,888.00	0.11
292	300294	博雅生物	13,550	558,802.00	0.11
293	002261	拓维信息	47,700	558,567.00	0.11
294	000829	天音控股	51,400	555,120.00	0.11
295	002602	世纪华通	15,300	554,778.00	0.11
296	300287	飞利信	60,400	554,472.00	0.11
297	002595	豪迈科技	24,800	551,304.00	0.11
298	000061	农产品	60,800	550,848.00	0.11
299	002421	达实智能	90,000	550,800.00	0.11
300	300170	汉得信息	53,350	550,038.50	0.11
301	002440	闰土股份	36,004	549,421.04	0.11
302	002018	华信国际	80,090	548,616.50	0.11
303	000687	华讯方舟	36,200	548,068.00	0.11
304	000021	深科技	63,500	544,830.00	0.11
305	002268	卫士通	32,200	541,604.00	0.11
306	002025	航天电器	21,690	541,165.50	0.11
307	000601	韶能股份	75,300	536,889.00	0.11
308	000937	冀中能源	87,700	536,724.00	0.11
309	002489	浙江永强	84,100	536,558.00	0.11
310	002036	联创电子	32,500	536,250.00	0.11
311	000975	银泰资源	41,900	529,197.00	0.11
312	002023	海特高新	51,500	528,905.00	0.11
313	000718	苏宁环球	90,196	528,548.56	0.11
314	000766	通化金马	33,071	528,474.58	0.11
315	002299	圣农发展	35,500	527,885.00	0.11
316	300009	安科生物	32,150	527,581.50	0.11
317	002709	天赐材料	12,800	526,976.00	0.11
318	000961	中南建设	80,500	524,860.00	0.11
319	000049	德赛电池	10,100	523,281.00	0.11
320	300216	千山药机	21,400	523,230.00	0.11
321	002280	联络互动	48,075	523,056.00	0.11
322	002089	新海宜	77,200	522,644.00	0.11
323	000587	金洲慈航	35,000	521,500.00	0.11
324	300118	东方日升	37,000	519,850.00	0.11
325	000848	承德露露	51,965	518,610.70	0.11
326	002047	宝鹰股份	60,000	518,400.00	0.11
327	000959	首钢股份	74,000	517,260.00	0.11
328	300053	欧比特	38,450	517,152.50	0.11



329	300273	和佳股份	42,430	515,948.80	0.10
330	000543	皖能电力	88,270	514,614.10	0.10
331	002517	恺英网络	14,500	510,255.00	0.10
332	300185	通裕重工	195,300	509,733.00	0.10
333	300073	当升科技	20,400	508,776.00	0.10
334	000901	航天科技	18,700	507,892.00	0.10
335	000882	华联股份	140,200	506,122.00	0.10
336	002396	星网锐捷	26,100	505,035.00	0.10
337	002375	亚厦股份	56,450	502,969.50	0.10
338	000777	中核科技	25,000	499,000.00	0.10
339	002716	金贵银业	25,900	497,021.00	0.10
340	000973	佛塑科技	64,200	495,624.00	0.10
341	300098	高新兴	38,400	495,360.00	0.10
342	002145	中核钛白	81,300	494,304.00	0.10
343	002326	永太科技	35,500	492,030.00	0.10
344	300431	暴风集团	20,641	491,875.03	0.10
345	002276	万马股份	48,600	490,374.00	0.10
346	000090	天健集团	44,160	490,176.00	0.10
347	002325	洪涛股份	67,000	489,100.00	0.10
348	002123	梦网荣信	44,001	488,851.11	0.10
349	002056	横店东磁	65,100	488,250.00	0.10
350	002354	天神娱乐	22,520	484,180.00	0.10
351	002055	得润电子	21,300	484,149.00	0.10
352	300116	坚瑞消防	44,900	482,675.00	0.10
353	002308	威创股份	36,919	481,792.95	0.10
354	002067	景兴纸业	82,030	481,516.10	0.10
355	002151	北斗星通	17,200	480,740.00	0.10
356	000762	西藏矿业	33,800	478,946.00	0.10
357	002505	大康农业	136,710	478,485.00	0.10
358	000875	吉电股份	94,300	476,215.00	0.10
359	000751	锌业股份	96,520	473,913.20	0.10
360	002512	达华智能	29,300	473,195.00	0.10
361	300352	北信源	81,950	472,851.50	0.10
362	300083	劲胜精密	51,100	472,164.00	0.10
363	002437	誉衡药业	64,700	471,016.00	0.10
364	002130	沃尔核材	72,900	468,747.00	0.10
365	000620	新华联	65,600	466,416.00	0.09
366	000902	新洋丰	51,702	465,318.00	0.09
367	001696	宗申动力	61,100	462,527.00	0.09
368	300010	立思辰	35,600	461,020.00	0.09
369	002600	江粉磁材	40,200	460,692.00	0.09
370	002237	恒邦股份	43,900	460,511.00	0.09

371	300496	中科创达	16,254	459,988.20	0.09
372	000801	四川九洲	48,038	459,723.66	0.09
373	002245	澳洋顺昌	50,900	459,118.00	0.09
374	300222	科大智能	20,000	453,800.00	0.09
375	002106	莱宝高科	44,600	451,798.00	0.09
376	000541	佛山照明	49,480	450,762.80	0.09
377	002073	软控股份	52,900	448,592.00	0.09
378	300075	数字政通	21,000	439,740.00	0.09
379	002358	森源电气	25,600	435,712.00	0.09
380	300078	思创医惠	40,460	434,135.80	0.09
381	002128	露天煤业	49,900	434,130.00	0.09
382	300364	中文在线	11,600	432,448.00	0.09
383	000563	陕国投 A	83,300	430,661.00	0.09
384	300085	银之杰	23,270	430,495.00	0.09
385	002657	中科金财	14,800	429,052.00	0.09
386	002482	广田集团	47,650	428,373.50	0.09
387	002428	云南锗业	40,100	428,268.00	0.09
388	300036	超图软件	25,900	423,465.00	0.09
389	002303	美盈森	54,800	423,056.00	0.09
390	002481	双塔食品	63,200	421,544.00	0.09
391	300101	振芯科技	30,100	421,400.00	0.09
392	300212	易华录	16,700	421,341.00	0.09
393	002413	雷科防务	37,400	418,880.00	0.09
394	002668	奥马电器	21,200	417,640.00	0.08
395	002099	海翔药业	62,400	415,584.00	0.08
396	002429	兆驰股份	134,800	413,836.00	0.08
397	000426	兴业矿业	45,300	408,606.00	0.08
398	002224	三力士	36,700	407,370.00	0.08
399	002041	登海种业	30,550	404,787.50	0.08
400	000558	莱茵体育	53,200	404,320.00	0.08
401	002242	九阳股份	20,400	401,268.00	0.08
402	002474	榕基软件	36,800	399,280.00	0.08
403	000969	安泰科技	45,700	398,961.00	0.08
404	300310	宜通世纪	30,160	398,715.20	0.08
405	002190	成飞集成	14,800	396,640.00	0.08
406	000062	深圳华强	14,908	395,509.24	0.08
407	002063	远光软件	37,617	391,969.14	0.08
408	000539	粤电力 A	73,040	389,303.20	0.08
409	002625	龙生股份	10,700	389,052.00	0.08
410	002329	皇氏集团	40,100	385,361.00	0.08
411	300377	赢时胜	33,547	382,100.33	0.08
412	002284	亚太股份	34,400	381,840.00	0.08

413	300292	吴通控股	55,900	378,443.00	0.08
414	000851	高鸿股份	41,400	376,326.00	0.08
415	002610	爱康科技	154,200	376,248.00	0.08
416	002180	艾派克	15,500	374,480.00	0.08
417	002010	传化股份	24,500	373,870.00	0.08
418	000957	中通客车	31,900	373,230.00	0.08
419	300043	星辉娱乐	45,200	371,092.00	0.08
420	300011	鼎汉技术	23,100	369,600.00	0.08
421	002563	森马服饰	43,500	368,880.00	0.07
422	002143	印纪传媒	14,500	361,485.00	0.07
423	000869	张裕 A	9,700	360,840.00	0.07
424	300413	快乐购	17,700	359,133.00	0.07
425	300037	新宙邦	15,600	358,488.00	0.07
426	002681	奋达科技	28,140	354,282.60	0.07
427	002052	同洲电子	55,634	352,719.56	0.07
428	002249	大洋电机	53,534	352,253.72	0.07
429	002371	七星电子	14,700	351,624.00	0.07
430	002695	煌上煌	16,100	343,896.00	0.07
431	300202	聚龙股份	20,600	340,312.00	0.07
432	300458	全志科技	12,622	332,463.48	0.07
433	000555	神州信息	19,300	322,310.00	0.07
434	002773	康弘药业	6,100	319,030.00	0.06
435	300359	全通教育	23,800	311,066.00	0.06
436	002588	史丹利	40,400	310,676.00	0.06
437	002699	美盛文化	22,320	308,016.00	0.06
438	002493	荣盛石化	30,000	292,800.00	0.06
439	002157	正邦科技	64,100	291,655.00	0.06
440	002797	第一创业	31,440	289,562.40	0.06
441	002416	爱施德	25,500	275,145.00	0.06
442	000987	越秀金控	23,200	269,816.00	0.05
443	002229	鸿博股份	24,050	269,360.00	0.05
444	002568	百润股份	15,300	254,286.00	0.05
445	300369	绿盟科技	20,699	228,930.94	0.05
446	300386	飞天诚信	12,700	225,933.00	0.05
447	300474	景嘉微	6,000	212,400.00	0.04
448	002782	可立克	9,500	199,025.00	0.04
449	300368	汇金股份	13,800	198,444.00	0.04
450	002703	浙江世宝	7,100	194,469.00	0.04
451	002619	巨龙管业	30,080	191,609.60	0.04
452	300506	名家汇	6,700	189,141.00	0.04

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	300012	华测检测	96,000	444,480.00	0.09
2	002121	科陆电子	51,550	443,330.00	0.09
3	002463	沪电股份	97,000	441,350.00	0.09
4	300096	易联众	32,200	440,496.00	0.09
5	002031	巨轮智能	140,400	436,644.00	0.09
6	002663	普邦股份	80,400	436,572.00	0.09
7	000650	仁和药业	72,239	431,989.22	0.09
8	000733	振华科技	26,900	427,710.00	0.09
9	300238	冠昊生物	16,700	423,345.00	0.09
10	002156	通富微电	41,300	420,434.00	0.09
11	002005	德豪润达	84,200	401,634.00	0.08
12	300147	香雪制药	38,940	399,913.80	0.08
13	002690	美亚光电	19,935	382,353.30	0.08
14	002550	千红制药	64,100	380,754.00	0.08
15	300228	富瑞特装	33,760	380,137.60	0.08
16	000099	中信海直	33,200	373,832.00	0.08
17	002467	二六三	46,700	369,864.00	0.08
18	002161	远望谷	45,652	369,781.20	0.08
19	002318	久立特材	44,600	364,828.00	0.07
20	002498	汉缆股份	99,500	364,170.00	0.07
21	300032	金龙机电	26,000	362,700.00	0.07
22	300226	上海钢联	9,600	357,120.00	0.07
23	002471	中超控股	71,500	349,635.00	0.07
24	300336	新文化	22,180	342,902.80	0.07
25	002095	生意宝	9,660	333,849.60	0.07
26	300188	美亚柏科	18,800	325,052.00	0.07
27	002721	金一文化	21,700	323,981.00	0.07
28	300339	润和软件	25,400	320,040.00	0.07
29	000693	ST 华泽	25,500	318,750.00	0.06
30	300178	腾邦国际	24,800	317,440.00	0.06
31	002445	中南文化	24,100	309,685.00	0.06
32	002298	中电鑫龙	27,400	297,838.00	0.06
33	002631	德尔未来	20,200	297,546.00	0.06
34	002414	高德红外	16,200	296,460.00	0.06
35	300432	富临精工	12,400	296,360.00	0.06
36	300221	银禧科技	21,200	294,680.00	0.06
37	002717	岭南园林	10,800	289,440.00	0.06
38	002488	金固股份	24,900	288,093.00	0.06
39	000810	创维数字	23,700	287,481.00	0.06
40	002197	证通电子	22,500	282,600.00	0.06

41	000795	英洛华	44,500	276,345.00	0.06
42	000681	视觉中国	17,600	275,616.00	0.06
43	002751	易尚展示	6,800	251,940.00	0.05
44	300191	潜能恒信	9,200	244,904.00	0.05
45	002432	九安医疗	18,900	217,917.00	0.04
46	002577	雷柏科技	9,340	214,539.80	0.04
47	002653	海思科	14,509	188,762.09	0.04
48	300516	久之洋	2,700	171,423.00	0.03
49	300512	中亚股份	6,000	121,680.00	0.02
50	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
51	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
52	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
53	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
54	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
55	300671	富满电子	942	7,639.62	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	002354	天神娱乐	546,138.24	0.11
2	002635	安洁科技	519,158.00	0.10
3	002156	通富微电	494,659.00	0.10
4	000566	海南海药	429,087.00	0.09
5	000750	国海证券	412,126.00	0.08
6	000547	航天发展	370,634.00	0.07
7	300496	中科创达	336,332.00	0.07
8	000333	美的集团	156,051.00	0.03
9	300104	乐视网	155,677.00	0.03
10	002491	通鼎互联	141,045.00	0.03
11	300498	温氏股份	139,085.00	0.03
12	000651	格力电器	134,516.00	0.03
13	002217	合力泰	130,726.00	0.03
14	002151	北斗星通	97,217.00	0.02
15	000002	万科 A	88,227.00	0.02
16	000725	京东方 A	88,160.00	0.02
17	300003	乐普医疗	76,736.00	0.02
18	000001	平安银行	72,305.00	0.01
19	000858	五粮液	70,088.00	0.01
20	002415	海康威视	67,827.00	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	000566	海南海药	463,148.00	0.09
2	300005	探路者	408,240.00	0.08
3	002071	长城影视	405,314.00	0.08
4	300616	尚品宅配	277,141.06	0.06
5	300625	三雄极光	220,244.04	0.04
6	002850	科达利	209,653.19	0.04
7	002852	道道全	198,148.90	0.04
8	300618	寒锐钴业	171,360.00	0.03
9	002867	周大生	156,686.16	0.03
10	000166	申万宏源	155,496.00	0.03
11	002851	麦格米特	137,306.12	0.03
12	300623	捷捷微电	130,533.32	0.03
13	002839	张家港行	128,583.76	0.03
14	300583	赛托生物	122,327.04	0.02
15	002841	视源股份	114,055.38	0.02
16	002833	弘亚数控	103,217.48	0.02
17	300641	正丹股份	102,266.54	0.02
18	002859	洁美科技	102,159.95	0.02
19	000538	云南白药	98,648.00	0.02
20	300627	华测导航	94,973.20	0.02

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	11,049,066.45
卖出股票收入（成交）总额	8,720,863.66

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 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。

### 7.11 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。

#### 7.12.2 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	2,774.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	298.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	其他	-
-	合计	3,072.14

#### 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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## § 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		南方深证成份交易型开 放式指数证券投资基金 联接基金	
		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 (%) )
5,875	73,728.43	279,913,203.00	64.62	153,241,304.00	35.38	264,321,432.00	61.02

注：1、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。

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

### 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	国信证券股份有限公司	7,500,000.00	1.73
2	国信证券股份有限公司融券专用证券账户	3,348,000.00	0.77
3	刘素坚	1,845,018.00	0.43
4	何凤珍	1,843,158.00	0.43
5	耿力扬	1,500,000.00	0.35
6	邬海滨	1,475,867.00	0.34
7	凌燕	1,475,778.00	0.34
8	杨悦文	1,418,265.00	0.33
9	中国银河证券股份有限公司	1,206,201.00	0.28
10	王勇	1,200,000.00	0.28
	南方深证成份交易型开放式指数证券投资 基金联接基金	264,321,432.00	61.02

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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



**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（2009年12月4日） 基金份额总额	4,127,538,537.00
本报告期期初基金份额总额	457,154,507.00
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	30,000,000.00
本报告期末基金份额总额	433,154,507.00

**§ 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	18,853,215.65	100.00	1,839.66	100.00	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-

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 (%)
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	南方基金关于深证成份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	2017-6-13
2	深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）（2016 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-1-6
3	深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2016 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-1-6

## § 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 (%)
南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	20170101-20170630	273,321,432.00	3,000,000.00	12,000,000.00	264,321,432.00	61.02
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

## § 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的文件。
- 2、深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同。
- 3、深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金托管协议。
- 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>