

上证380交易型开放式指数证券投资基金2 017年年度报告

2017年12月31日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018年03月29日

重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2017年1月1日起至12月31日止。

目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标	错误!未定义书签。
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	错误!未定义书签。
4.10 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.....	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	20
§ 8 投资组合报告	44

8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	44
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	57
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	57
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	57
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
8.12 投资组合报告附注.....	58
§ 9 基金份额持有人信息.....	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	60
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
9.4 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.....	61
§ 10 开放式基金份额变动.....	61
§ 11 重大事件揭示.....	61
11.1 基金份额持有人大会决议.....	61
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
11.4 基金投资策略的改变.....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
11.8 其他重大事件.....	64
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
12.1 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.....	64
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§ 13 备查文件目录.....	65
13.1 备查文件目录.....	65
13.2 存放地点.....	65
13.3 查阅方式.....	65

基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证380交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方上证380ETF
场内简称	380ETF
基金主代码	510290
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年9月16日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	142,448,915.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011年11月8日

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

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金,采用完全复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为上证380指数,简称380指数。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	常克川	田青
	联系电话	0755-82763888	010-67595096
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-8899	010-67595096
传真		0755-82763889	010-66275853
注册地址		深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街一号院一号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		张海波	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年1月1日-2017年12月31日）	报告期（2016年1月1日-2016年12月31日）	报告期（2015年1月1日-2015年12月31日）
本期已实现收益	12,774,974.42	-9,864,698.88	-5,583,915.32

本期利润	12,857,370.03	-48,964,055.37	8,241,848.33
加权平均基金份额本期利润	0.0815	-0.2746	0.0416
本期加权平均净值利润率	5.15%	-18.38%	2.33%
本期基金份额净值增长率	4.54%	-16.41%	38.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2017年12月31日)	报告期(2016年12月31日)	报告期(2015年12月31日)
期末可供分配利润	66,419,054.05	64,818,058.16	72,806,790.12
期末可供分配基金份额利润	0.4663	0.3848	0.4374
期末基金资产净值	229,185,540.86	259,253,426.09	306,487,944.53
期末基金份额净值	1.6089	1.5391	1.8413
3.1.3 累计期末指标	报告期(2017年12月31日)	报告期(2016年12月31日)	报告期(2015年12月31日)
基金份额累计净值增长率	60.89%	53.91%	84.13%

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

2. 期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

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

3.2 基金净值表现

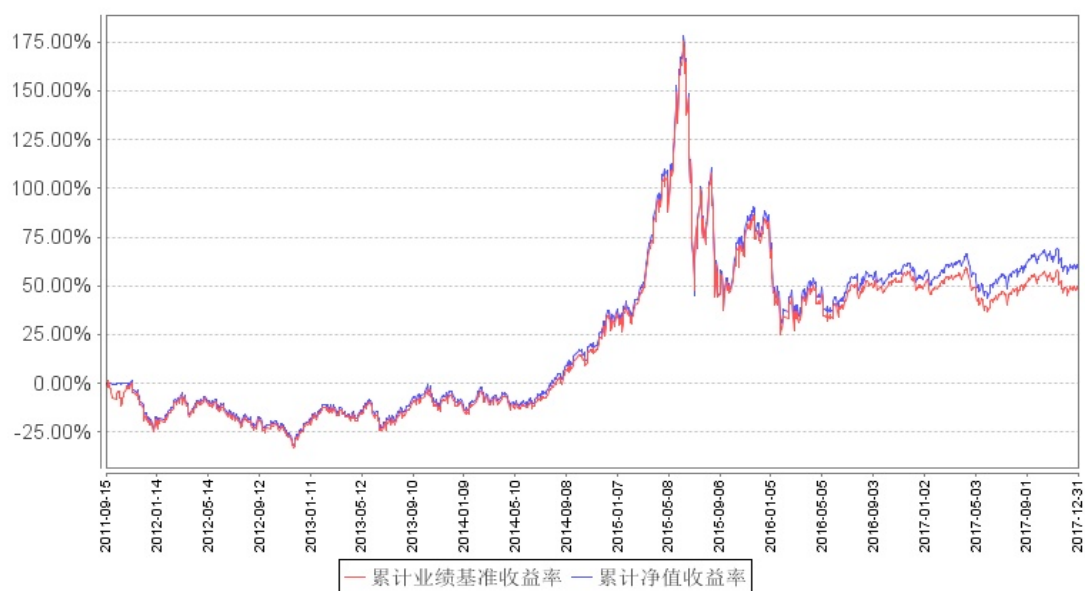
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率标准差 ②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-2.48%	0.97%	-3.04%	0.98%	0.56%	-0.01%
过去六个月	3.99%	0.90%	2.56%	0.91%	1.43%	-0.01%

过去一年	4.54%	0.87%	0.56%	0.88%	3.98%	-0.01%
过去三年	20.81%	2.15%	14.52%	2.11%	6.29%	0.04%
过去五年	100.04%	1.85%	89.26%	1.82%	10.78%	0.03%
自基金合同 生效起至今	60.89%	1.76%	49.79%	1.75%	11.10%	0.01%

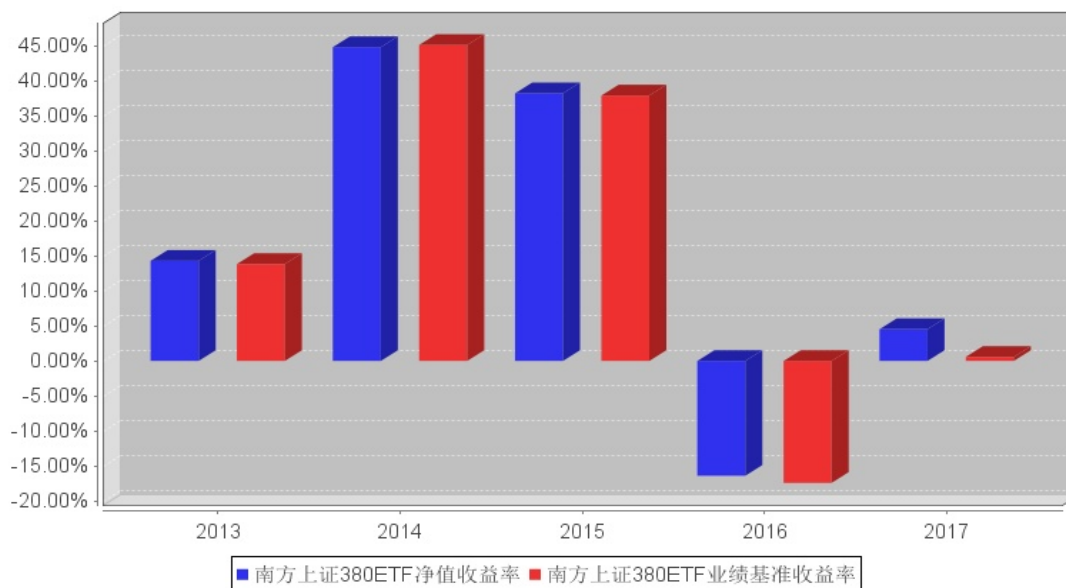
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方上证380ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方上证380ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018年1月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司，注册资本金3亿元人民币。目前股权结构：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%及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，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超7,200亿元，旗下管理153只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周豪	本基金基金经理、南方中证100指数证券投资基金的基金经理	2016年8月19日	-	9	北京大学软件工程专业硕士，具有基金从业资格。2008年7月加入南方基金信息技术部，长期负责指数基金及ETF基金的投研及系统支持工作；2015年6月，任数量化投资部高级研究员；2016年4月至今，任500工业ETF、500原材料ETF基金经理；2016年8月至今，任380ETF、南方380、小康ETF、南方小康、互联基金基金经理；2016年9月至今，任1000ETF基金经理；2017年8月至今，任南方有色金属基金经理；2017年9月至今，任南方有色金属联接基金经理。

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《上证380交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为5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，相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内上证380指数上涨0.56%。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) 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) 根据指数每半年度成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.6089元，报告期内，份额净值增长率为4.54%，同期业绩基准增长率为0.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017年市场风格变化明显，大盘蓝筹股受到投资者持续追捧，而中小盘股票整体表现羸弱，

展望2018年，尽管市场风格预计仍然会持续一定的时间，不过随着大盘蓝筹股的大幅上涨，其估值优势正在逐步降低，同时国内外经济企稳，国内还处于经济转型关键时期，预计权益市场总体仍将保持稳健态势。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展情况，坚持从保护基金持有人利益出发，树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础”的合规理念，继续致力于合规与内控机制的完善，积极推动主动合规风控管理，持续加强业务风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程，并积极开展形式丰富的合规培训与考试，加强员工行为规范检查、加大合规问责力度，强化全员合规、主动合规理念；对公司投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务开展了定期稽核、专项稽核及多项自查，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，排查业务中的风险点并完善内控措施，促进公司业务合规运作、稳健经营；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，持续完善投资合规风控制度流程和系统，加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控，有效确保投研交易业务合规运作；积极参与新产品、新业务合规评估工作，保障新产品、新业务合规开展；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况，督促落实投资者适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；继续按照风险为本的原则积极开展各项反洗钱工作，进一步升级反洗钱业务系统，优化其他反洗钱资源配置，重点推进《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》的具体落实工作，加强业务部门反洗钱风险评估频率，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第22836号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	上证380交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了上证380交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“上证380ETF基金”)的财务报表，包括2017年12月31日的资产负债表，2017年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准</p>

	<p>则在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了上证380ETF基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于上证380ETF基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>上证380ETF基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司,以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估上证380ETF基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算上证380ETF基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督上证380ETF基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现</p>

	<p>由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对上证380ETF基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致上证380ETF基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	薛 竞 陈 熹
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
审计报告日期	2018年03月23日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：上证380交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	718,834.32	1,118,075.39

结算备付金		22,422.87	-
存出保证金		3,067.75	1,515.33
交易性金融资产	7.4.7.2	228,984,511.45	258,604,736.46
其中：股票投资		228,835,511.45	258,604,736.46
基金投资		-	-
债券投资		149,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	15,940.01
应收利息	7.4.7.5	165.14	246.34
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		229,729,001.53	259,740,513.53
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		96,468.19	111,569.45
应付托管费		19,293.65	22,313.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,896.43	63,248.25
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	421,802.40	289,955.86
负债合计		543,460.67	487,087.44
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	142,448,915.00	168,448,915.00
未分配利润	7.4.7.10	86,736,625.86	90,804,511.09
所有者权益合计		229,185,540.86	259,253,426.09
负债和所有者权益总计		229,729,001.53	259,740,513.53

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额净值1.6089元，基金份额总额142,448,915.00份。

7.2 利润表

会计主体：上证380交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日
一、收入		15,118,478.54	-46,524,445.19
1. 利息收入		16,418.13	28,988.19
其中：存款利息收入	7.4.7.11	16,361.94	28,880.00
债券利息收入		56.19	108.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		14,982,039.45	-7,391,606.63
其中：股票投资收益	7.4.7.12	12,140,788.67	-9,656,216.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	39,216.36	66,057.71
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,802,034.42	2,198,552.36
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	82,395.61	-39,099,356.49
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	37,625.35	-62,470.26
减：二、费用		2,261,108.51	2,439,610.18
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,248,374.56	1,331,975.38
2. 托管费	7.4.10.2.2	249,674.89	266,395.10
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	115,603.23	159,654.08
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	647,455.83	681,585.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,857,370.03	-48,964,055.37

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,857,370.03	-48,964,055.37

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证380交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	168,448,915.00	90,804,511.09	259,253,426.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	12,857,370.03	12,857,370.03
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）	-26,000,000.00	-16,925,255.26	-42,925,255.26
其中：1. 基金申购款	78,000,000.00	46,780,570.71	124,780,570.71
2. 基金赎回款	-104,000,000.00	-63,705,825.97	-167,705,825.97
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）	142,448,915.00	86,736,625.86	229,185,540.86
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	166,448,915.00	140,039,029.53	306,487,944.53
二、本期经营活动产生的基金净值变	-	-48,964,055.37	-48,964,055.37

动数（本期净利润）			
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）	2,000,000.00	-270,463.07	1,729,536.93
其中：1. 基金申购款	68,000,000.00	30,424,524.20	98,424,524.20
2. 基金赎回款	-66,000,000.00	-30,694,987.27	-96,694,987.27
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）	168,448,915.00	90,804,511.09	259,253,426.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

上证380交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]1096号《关于核准上证380交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司,已于2018年1月4日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证380交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币330,429,892.00元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第381号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证380交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2011年9月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为330,448,915.00份基金份额,其中通过直销机构网下现金认购部分的认购资金利息折合19,023.00份基金份额。本基金的基金管理人为

南方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证380交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数上证380指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%，年跟踪误差不超过2%。本基金主要投资于标的指数的成份股和备选成份股；本基金也可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、新股、债券、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为上证380指数。

本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司以本基金为目标ETF，于2011年9月20日募集成立了上证380交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“上证380ETF联接基金”)。上证380ETF联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于2018年3月23日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证380交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，基金管理人可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配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。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
活期存款	718,834.32	1,118,075.39
定期存款	-	-
其中：存款期限小于1个月	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月-1年	-	-
其他存款	-	-
合计	718,834.32	1,118,075.39

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	229,352,466.25	228,835,511.45	-516,954.80
贵金属投资- 金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	149,000.00	149,000.00
	银行间市场	-	-
	-	-	-
	合计	149,000.00	149,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	229,501,466.25	228,984,511.45	-516,954.80
项目	上年度末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	259,204,086.87	258,604,736.46	-599,350.41
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	259,204,086.87	258,604,736.46	-599,350.41

注：于2017年12月31日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为零（

2016年12月31日：968.00元)。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	143.14	245.57
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	11.11	-
应收债券利息	9.35	-
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	1.54	0.77
合计	165.14	246.34

7.4.7.6 其他资产

注：无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	5,896.43	63,248.25
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	5,896.43	63,248.25

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	354,000.00	255,000.00
应付指数使用费	50,000.00	20,213.86

应付指数使用费	-	-
可退替代款	17,802.40	14,742.00
合计	421,802.40	289,955.86

注:可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时,替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

7.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	168,448,915.00	168,448,915.00
本期申购	78,000,000.00	78,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-104,000,000.00	-104,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	142,448,915.00	142,448,915.00

7.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	64,818,058.16	25,986,452.93	90,804,511.09
本期利润	12,774,974.42	82,395.61	12,857,370.03
本期基金份额交易产生的变动数	-11,173,978.53	-5,751,276.73	-16,925,255.26
其中:基金申购款	33,284,520.97	13,496,049.74	46,780,570.71
基金赎回款	-44,458,499.50	-19,247,326.47	-63,705,825.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	66,419,054.05	20,317,571.81	86,736,625.86

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日
活期存款利息收入	15,199.22	27,669.55
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	1,097.67	1,210.45
其他	65.05	-

合计	16,361.94	28,880.00
----	-----------	-----------

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日 至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日 至 2016年12月31日
股票投资收益—— 买卖股票差价收入	9,056,747.13	-3,434,709.74
股票投资收益—— 赎回差价收入	3,084,041.54	-6,221,506.96
合计	12,140,788.67	-9,656,216.70

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日 至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日 至 2016年12月31日
卖出股票成交总额	70,756,454.77	74,393,860.19
减：卖出股票成本 总额	61,699,707.64	77,828,569.93
买卖股票差价收入	9,056,747.13	-3,434,709.74

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日 至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日 至 2016年12月31日
赎回基金份额对价总 额	167,705,825.97	96,694,987.27
减：现金支付赎回款 总额	-183,616.03	-321,497.73
减：赎回股票成本总 额	164,805,400.46	103,237,991.96
赎回差价收入	3,084,041.54	-6,221,506.96

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日 至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日 至 2016年12月31日
卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成交总 额	335,263.20	518,165.90
减：卖出债券（、债转 股及债券到期兑付）成 本总额	296,000.00	452,000.00
减：应收利息总额	46.84	108.19
买卖债券差价收入	39,216.36	66,057.71

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日 至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日 至 2016年12月31日
股票投资产生的股利收 益	2,802,034.42	2,198,552.36
基金投资产生的股利收 益	-	-
合计	2,802,034.42	2,198,552.36

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日 至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日 至 2016年12月31日
1. 交易性金融资产	82,395.61	-39,099,356.49
股票投资	82,395.61	-39,099,356.49

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	82,395.61	-39,099,356.49

注：本基金本年度公允价值变动收益-股票投资中包含的可退替代款产生的公允价值变动收益为-968.00元(2016年度：968.00无)。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	37,625.35	-62,470.26
转换费	-	-
合计	37,625.35	-62,470.26

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

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日
交易所市场交易费用	115,603.23	159,654.08
银行间市场交易费用	-	-
合计	115,603.23	159,654.08

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日
审计费用	54,000.00	55,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
账户维护费	-	360.00

指数使用费	229,786.14	264,485.75
银行费用	3,669.69	1,739.87
上市年费	60,000.00	60,000.00
上市费	-	-
其他	-	-
合计	647,455.83	681,585.62

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

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司
南方上证380交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“上证380ETF联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注:1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》,公司名称由“南方基金管理有限公司”变更为“南方基金管理股份有限公司”,公司股权结构等事项未发生变化,并已于2018年1月4日在深圳市市场监督管理局完成相应变更登记手续。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华泰证券	146,333,028.12	100.00	67,335,886.43	43.41

7.4.10.1.2 权证交易

注：无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	31,874.19	100.00	5,896.43	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	62,707.13	87.72	62,707.13	99.14

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	1,248,374.56	1,331,975.38
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0.50%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 0.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至 2017年12月31日	2016年1月1日至 2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	249,674.89	266,395.10

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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 0.10% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

关联方名称	本期末		上年度末	
	2017年12月31日		2016年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
上证380ETF联接基金	114,399,941.00	80.31%	138,399,941.00	82.16%

注：上证380ETF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。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	718,834.32	15,199.22	1,118,075.39	27,669.55

注:本基金由基金托管人中国建设银行保管的银行存款,按银行约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
7.4.12.1.2 受限证券类别:债券										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110041	蒙电转债	2017-12-22	2018-01-09	新债未上市	100.00	100.00	840	84,000.00	84,000.00	-
110042	航电转债	2017-12-25	2018-01-15	新债未上市	100.00	100.00	650	65,000.00	65,000.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量（ 股）	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
600309	万华化学	2017-12-05	重大资产重组	37.94	-	-	121,120	2,401,808.43	4,595,292.80	
600525	长园集团	2017-12-25	重大事项未公告	15.79	2018-01-10	17.30	118,205	1,778,903.94	1,866,456.95	
600666	奥瑞德	2017-04-27	重大事项	17.40	-	-	60,960	1,177,933.70	1,060,704.00	
600614	鹏起科技	2017-12-26	重大事项未公告	10.16	-	-	94,800	1,039,521.68	963,168.00	
600685	中船防务	2017-09-27	重大资产重组	26.66	2018-3-21	24.05	27,400	786,923.49	730,484.00	
600664	哈药股份	2017-09-28	重大资产重组	05.81	2018-02-27	6.00	125,569	967,932.83	729,555.89	
600226	瀚叶股份	2017-11-28	重大资产重组	05.93	-	-	106,222	788,801.35	629,896.46	
600239	云南城投	2017-06-26	重大资产重组	05.22	2018-01-17	5.74	105,820	428,474.17	552,380.40	
600162	香江控股	2017-11-10	重大资产重组	03.37	2018-01-12	3.71	145,415	573,650.58	490,048.55	
600273	嘉化能源	2017-10-26	重大资产重组	09.53	2018-03-07	10.00	50,700	461,656.42	483,171.00	
600818	中	2017-10-19	重大	22.83	2018-02-07	20.55	9,400	344,635.50	214,602.00	

	路股份		资产重组							
600829	人民同泰	2017-09-28	重大资产重组	12.24	2018-02-27	12.00	14,600	213,501.03	178,704.00	
601313	江南嘉捷	2017-12-21	重大事项未公告	45.97	2018-01-02	49.00	94	1,121.45	4,321.18	注1
600903	贵州燃气	2017-12-28	交易异常波动	16.86	2018-01-02	16.01	28	61.88	472.08	

注1.

根据江南嘉捷电梯股份有限公司2018年2月2日发布的《关于拟变更公司证券代码和证券简称的提示性公告》，江南嘉捷电梯股份有限公司第四届董事会第十三次会议审议通过了《关于变更公司证券代码和证券简称的议案》，同意江南嘉捷电梯股份有限公司证券代码由“601313”申请变更为“601360”；证券简称由“江南嘉捷”变更为“三六零”。新证券代码和证券简称启用日期为2018年2月28日。

2. 本基金截至2017年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注:无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于2017年12月31日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.07%(2016年12月31日：无)。

7.4.13.3 流动性风险

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

于2017年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自2017年10月1日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	718,834.32	-	-	-	718,834.32
结算备付金	22,422.87	-	-	-	22,422.87
存出保证金	3,067.75	-	-	-	3,067.75
交易性金融资产	-	-	149,000.00	228,835,511.45	228,984,511.45
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	165.14	165.14
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
资产总计	744,324.94	-	149,000.00	228,835,676.59	229,729,001.53
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	96,468.19	96,468.19
应付托管费	-	-	-	19,293.65	19,293.65
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	-	-	-	5,896.43	5,896.43
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	421,802.40	421,802.40
负债总计	-	-	-	543,460.67	543,460.67
利率敏感度缺口	744,324.94	-	149,000.00	228,292,215.92	229,185,540.86
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,118,075.39	-	-	-	1,118,075.39
存出保证金	1,515.33	-	-	-	1,515.33
交易性金融资产	-	-	-	-258,604,736.46	258,604,736.46
应收利息	-	-	-	246.34	246.34
应收证券清算款	-	-	-	15,940.01	15,940.01
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
资产总计	1,119,590.72	-	-	-258,620,922.81	259,740,513.53
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	111,569.45	111,569.45
应付托管费	-	-	-	22,313.88	22,313.88
应付交易费用	-	-	-	63,248.25	63,248.25
其他负债	-	-	-	289,955.86	289,955.86
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	487,087.44	487,087.44
利率敏感度缺口	1,119,590.72	-	-	-258,133,835.37	259,253,426.09

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于2017年12月31日本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.07%（2016年12月31日：无），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）。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31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	228,835,511.45	99.85	258,604,736.46	99.75
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	228,835,511.45	99.85	258,604,736.46	99.75

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
	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12月31日)	上年度末 (2016年12月31日)
分析	1. 业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	11,332,079.07	12,753,883.50
	2. 业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	-11,332,079.07	-12,753,883.50

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于本年度,本基金申购基金份额的对价总额为124,780,570.71元(2016年度:98,424,524.20元),其中包括以股票支付的申购款116,552,123.56元和以现金支付的申购款8,228,447.15元(2016年度:其中包括以股票支付的申购款94,741,564.00元和以现金支付的申购款3,682,960.20元)。

(2) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2017年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为216,299,357.69元,属于第二层次的余额为12,685,153.76元,无属于第三层次的余额(2016年12月31日:第一层次241,278,034.84元,第二层次17,326,701.62元,无第三层次)

。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2017年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 增值税

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，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。

根据财政部、国家税务总局于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。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至2017年12月31日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)

除基金申购款、公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	228,835,511.45	99.61
	其中：股票	228,835,511.45	99.61
2	固定收益投资	149,000.00	0.06
	其中：债券	149,000.00	0.06
	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	741,257.19	0.32
7	其他各项资产	3,232.89	0.00
8	合计	229,729,001.53	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。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资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	483,635.10	0.21
B	采矿业	10,077,692.73	4.40
C	制造业	136,814,459.22	59.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,037,607.34	5.69
E	建筑业	5,945,199.74	2.59
F	批发和零售业	16,320,978.30	7.12
G	交通运输、仓储和邮政业	14,859,823.21	6.48
H	住宿和餐饮业	740,274.00	0.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,513,857.84	2.41
J	金融业	158,286.00	0.07
K	房地产业	8,631,644.53	3.77
L	租赁和商务服务业	1,922,317.31	0.84
M	科学研究和技术服务业	810,395.00	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	2,362,434.82	1.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	325,606.56	0.14
Q	卫生和社会工作	555,904.00	0.24

R	文化、体育和娱乐业	3,590,053.00	1.57
S	综合	1,607,458.68	0.70
	合计	223,757,627.38	97.63

8.2.2 报告期末积极投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,665,578.93	2.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,890.88	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,942.76	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	377,471.50	0.16
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,077,884.07	2.22

8.2.3 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600487	亨通光电	85,337	3,449,321.54	1.50
2	603288	海天味业	48,400	2,603,920.00	1.14
3	600201	生物股份	80,667	2,560,370.58	1.12
4	600176	中国巨石	157,118	2,559,452.22	1.12
5	600867	通化东宝	107,440	2,459,301.60	1.07
6	600352	浙江龙盛	204,300	2,392,353.00	1.04
7	603799	华友钴业	26,500	2,126,095.00	0.93
8	600674	川投能源	197,400	2,009,532.00	0.88
9	600525	长园集团	118,205	1,866,456.95	0.81
10	600584	长电科技	85,384	1,821,240.72	0.79
11	601333	广深铁路	304,200	1,694,394.00	0.74
12	600521	华海药业	56,088	1,689,370.56	0.74
13	600438	通威股份	139,300	1,686,923.00	0.74
14	603019	中科曙光	40,400	1,625,696.00	0.71
15	600426	华鲁恒升	101,762	1,620,051.04	0.71
16	600398	海澜之家	161,242	1,564,047.40	0.68
17	600298	安琪酵母	44,373	1,451,884.56	0.63
18	600498	烽火通信	50,000	1,441,500.00	0.63
19	600779	水井坊	30,700	1,436,760.00	0.63
20	600642	申能股份	244,944	1,435,371.84	0.63
21	601168	西部矿业	170,974	1,401,986.80	0.61
22	600004	白云机场	92,785	1,363,939.50	0.60
23	600682	南京新百	35,776	1,351,975.04	0.59
24	600879	航天电子	170,700	1,338,288.00	0.58
25	600388	龙净环保	76,607	1,325,301.10	0.58
26	601233	桐昆股份	58,339	1,312,044.11	0.57
27	600499	科达洁能	113,200	1,255,388.00	0.55
28	600567	山鹰纸业	285,747	1,240,141.98	0.54
29	600872	中炬高新	49,905	1,235,647.80	0.54
30	600600	青岛啤酒	31,157	1,225,404.81	0.53
31	600811	东方集团	266,575	1,220,913.50	0.53
32	600583	海油工程	198,000	1,217,700.00	0.53
33	600056	中国医药	47,960	1,193,724.40	0.52
34	600885	宏发股份	28,600	1,183,182.00	0.52
35	600166	福田汽车	418,800	1,176,828.00	0.51
36	600755	厦门国贸	111,388	1,125,018.80	0.49
37	600418	江淮汽车	118,900	1,124,794.00	0.49

38	600183	生益科技	65,160	1,124,661.60	0.49
39	600325	华发股份	152,000	1,118,720.00	0.49
40	600260	凯乐科技	38,100	1,109,091.00	0.48
41	600787	中储股份	98,500	1,083,500.00	0.47
42	600027	华电国际	291,800	1,082,578.00	0.47
43	600138	中青旅	51,813	1,081,337.31	0.47
44	600666	奥瑞德	60,960	1,060,704.00	0.46
45	600673	东阳光科	154,792	1,044,846.00	0.46
46	600460	士兰微	67,045	1,034,504.35	0.45
47	601877	正泰电器	38,569	1,008,579.35	0.44
48	600490	鹏欣资源	118,800	1,007,424.00	0.44
49	600175	美都能源	192,516	1,006,858.68	0.44
50	600038	中直股份	21,233	987,971.49	0.43
51	600884	杉杉股份	50,300	974,814.00	0.43
52	600978	宜华生活	106,400	972,496.00	0.42
53	600655	豫园股份	90,100	967,674.00	0.42
54	600062	华润双鹤	38,999	965,225.25	0.42
55	600143	金发科技	146,817	964,587.69	0.42
56	600614	鹏起科技	94,800	963,168.00	0.42
57	601222	林洋能源	94,972	963,016.08	0.42
58	601000	唐山港	204,125	961,428.75	0.42
59	600998	九州通	50,500	956,975.00	0.42
60	600236	桂冠电力	163,200	938,400.00	0.41
61	600970	中材国际	94,780	937,374.20	0.41
62	600346	恒力股份	76,000	937,080.00	0.41
63	601231	环旭电子	58,426	921,378.02	0.40
64	600711	盛屯矿业	107,900	916,071.00	0.40
65	601238	广汽集团	36,560	901,569.60	0.39
66	601098	中南传媒	64,300	893,127.00	0.39
67	600409	三友化工	92,961	891,495.99	0.39
68	600125	铁龙物流	81,848	885,595.36	0.39
69	600240	华业资本	102,000	875,160.00	0.38
70	600856	中天能源	74,300	868,567.00	0.38
71	600161	天坛生物	30,020	864,275.80	0.38
72	600373	中文传媒	49,600	839,728.00	0.37
73	600566	济川药业	21,900	835,485.00	0.36
74	600568	中珠医疗	107,260	833,410.20	0.36
75	600635	大众公用	174,312	833,211.36	0.36
76	600486	扬农化工	16,767	833,152.23	0.36
77	600410	华胜天成	79,044	831,542.88	0.36
78	600597	光明乳业	54,800	830,220.00	0.36
79	600122	宏图高科	83,200	806,208.00	0.35

80	601021	春秋航空	21,610	805,404.70	0.35
81	600572	康恩贝	113,072	799,419.04	0.35
82	600348	阳泉煤业	107,900	796,302.00	0.35
83	600500	中化国际	93,800	793,548.00	0.35
84	600717	天津港	75,400	790,946.00	0.35
85	600267	海正药业	52,160	789,702.40	0.34
86	600171	上海贝岭	48,520	789,420.40	0.34
87	600172	黄河旋风	89,972	789,054.44	0.34
88	600477	杭萧钢构	73,950	789,046.50	0.34
89	600380	健康元	70,495	788,839.05	0.34
90	601200	上海环境	31,500	785,610.00	0.34
91	601880	大连港	278,775	777,782.25	0.34
92	600863	内蒙华电	261,578	776,886.66	0.34
93	600881	亚泰集团	146,324	772,590.72	0.34
94	600511	国药股份	27,425	762,415.00	0.33
95	600026	中远海能	123,200	753,984.00	0.33
96	601636	旗滨集团	120,703	753,186.72	0.33
97	600416	湘电股份	59,400	741,906.00	0.32
98	603885	吉祥航空	48,340	739,118.60	0.32
99	600967	内蒙一机	60,892	733,748.60	0.32
100	600559	老白干酒	23,632	731,883.04	0.32
101	600685	中船防务	27,400	730,484.00	0.32
102	600664	哈药股份	125,569	729,555.89	0.32
103	600633	浙数文化	46,900	712,880.00	0.31
104	600835	上海机电	28,890	707,805.00	0.31
105	601058	赛轮金宇	194,640	702,650.40	0.31
106	603369	今世缘	45,050	698,725.50	0.30
107	600216	浙江医药	51,935	698,006.40	0.30
108	600446	金证股份	44,900	679,786.00	0.30
109	600667	太极实业	75,595	677,331.20	0.30
110	603766	隆鑫通用	95,193	668,254.86	0.29
111	600823	世茂股份	135,160	667,690.40	0.29
112	600803	新奥股份	44,400	666,888.00	0.29
113	601666	平煤股份	105,711	665,979.30	0.29
114	600693	东百集团	64,500	661,770.00	0.29
115	600039	四川路桥	162,586	661,725.02	0.29
116	600323	瀚蓝环境	41,277	658,368.15	0.29
117	603111	康尼机电	48,200	650,700.00	0.28
118	600372	中航电子	47,500	650,275.00	0.28
119	600086	东方金钰	60,800	647,520.00	0.28
120	600326	西藏天路	62,370	639,916.20	0.28
121	600230	沧州大化	15,000	637,500.00	0.28

122	603077	和邦生物	318,214	636,428.00	0.28
123	600206	有研新材	52,900	633,742.00	0.28
124	600185	格力地产	110,900	629,912.00	0.27
125	600226	瀚叶股份	106,222	629,896.46	0.27
126	601958	金钼股份	86,800	627,564.00	0.27
127	600563	法拉电子	12,227	621,253.87	0.27
128	600648	外高桥	33,514	620,009.00	0.27
129	601799	星宇股份	12,400	613,800.00	0.27
130	600366	宁波韵升	35,000	613,200.00	0.27
131	600312	平高电气	61,096	610,349.04	0.27
132	603899	晨光文具	24,742	610,137.72	0.27
133	600507	方大特钢	47,750	605,947.50	0.26
134	601678	滨化股份	74,610	605,833.20	0.26
135	600255	梦舟股份	158,500	603,885.00	0.26
136	600200	江苏吴中	52,000	600,600.00	0.26
137	603939	益丰药房	13,000	591,240.00	0.26
138	600594	益佰制药	56,826	580,761.72	0.25
139	600393	粤泰股份	91,000	576,940.00	0.25
140	600720	祁连山	55,741	576,919.35	0.25
141	600859	王府井	28,048	572,179.20	0.25
142	600651	飞乐音响	62,286	569,916.90	0.25
143	600123	兰花科创	61,500	563,955.00	0.25
144	600270	外运发展	32,498	561,565.44	0.24
145	600611	大众交通	112,226	558,885.48	0.24
146	600993	马应龙	27,208	557,219.84	0.24
147	600763	通策医疗	17,200	555,904.00	0.24
148	600116	三峡水利	62,350	554,915.00	0.24
149	600729	重庆百货	22,070	553,074.20	0.24
150	600239	云南城投	105,820	552,380.40	0.24
151	603000	人民网	49,800	539,334.00	0.24
152	600491	龙元建设	56,800	536,760.00	0.23
153	600269	赣粤高速	104,700	536,064.00	0.23
154	600141	兴发集团	31,700	535,730.00	0.23
155	600694	大商股份	15,873	535,396.29	0.23
156	600502	安徽水利	77,490	533,906.10	0.23
157	603588	高能环境	41,600	529,152.00	0.23
158	600708	光明地产	76,850	526,422.50	0.23
159	600557	康缘药业	38,827	523,387.96	0.23
160	600565	迪马股份	130,400	521,600.00	0.23
161	600756	浪潮软件	29,200	519,468.00	0.23
162	600562	国睿科技	21,585	518,255.85	0.23
163	600210	紫江企业	108,800	517,888.00	0.23

164	600582	天地科技	111,360	517,824.00	0.23
165	603188	亚邦股份	31,200	517,608.00	0.23
166	600874	创业环保	39,050	508,040.50	0.22
167	600765	中航重机	42,200	507,244.00	0.22
168	600420	现代制药	39,800	506,256.00	0.22
169	601311	骆驼股份	38,100	504,825.00	0.22
170	600495	晋西车轴	75,888	503,137.44	0.22
171	600742	一汽富维	30,400	501,904.00	0.22
172	600188	兖州煤业	34,554	501,724.08	0.22
173	600990	四创电子	8,576	498,179.84	0.22
174	600988	赤峰黄金	76,800	494,592.00	0.22
175	601567	三星医疗	50,925	493,972.50	0.22
176	600587	新华医疗	29,306	492,047.74	0.21
177	600668	尖峰集团	30,980	490,723.20	0.21
178	601016	节能风电	149,059	490,404.11	0.21
179	600162	香江控股	145,415	490,048.55	0.21
180	600337	美克家居	80,966	489,844.30	0.21
181	600338	西藏珠峰	11,700	487,305.00	0.21
182	603883	老百姓	7,700	485,023.00	0.21
183	600641	万业企业	36,100	483,740.00	0.21
184	600273	嘉化能源	50,700	483,171.00	0.21
185	601689	拓普集团	19,500	482,430.00	0.21
186	601908	京运通	89,500	482,405.00	0.21
187	600277	亿利洁能	74,388	479,058.72	0.21
188	600073	上海梅林	58,840	477,780.80	0.21
189	600687	刚泰控股	40,040	472,872.40	0.21
190	600400	红豆股份	65,490	470,873.10	0.21
191	600971	恒源煤电	44,800	467,264.00	0.20
192	600197	伊力特	19,950	467,229.00	0.20
193	600580	卧龙电气	58,282	466,838.82	0.20
194	600612	老凤祥	11,333	466,466.28	0.20
195	600284	浦东建设	50,072	465,669.60	0.20
196	600754	锦江股份	14,400	464,976.00	0.20
197	600596	新安股份	50,649	464,957.82	0.20
198	600577	精达股份	122,800	461,728.00	0.20
199	600399	抚顺特钢	82,100	459,760.00	0.20
200	601002	晋亿实业	42,800	459,244.00	0.20
201	603008	喜临门	24,800	458,552.00	0.20
202	601001	大同煤业	75,471	456,599.55	0.20
203	600422	昆药集团	49,752	455,230.80	0.20
204	603816	顾家家居	7,700	454,069.00	0.20
205	600578	京能电力	121,800	450,660.00	0.20

206	603515	欧普照明	10,500	449,820.00	0.20
207	603833	欧派家居	3,800	448,590.00	0.20
208	600343	航天动力	34,300	443,499.00	0.19
209	600536	中国软件	26,594	440,130.70	0.19
210	600377	宁沪高速	44,450	437,832.50	0.19
211	600458	时代新材	43,340	436,433.80	0.19
212	600846	同济科技	45,124	434,544.12	0.19
213	600261	阳光照明	78,612	433,938.24	0.19
214	600428	中远海特	77,323	433,782.03	0.19
215	600623	华谊集团	50,449	430,329.97	0.19
216	600072	中船科技	33,000	429,990.00	0.19
217	601777	力帆股份	58,418	424,114.68	0.19
218	600006	东风汽车	72,300	422,955.00	0.18
219	600335	国机汽车	36,925	415,037.00	0.18
220	600391	航发科技	20,900	411,939.00	0.18
221	601700	风范股份	51,050	410,442.00	0.18
222	600750	江中药业	16,107	410,406.36	0.18
223	600280	中央商场	51,956	408,893.72	0.18
224	600395	盘江股份	59,300	407,391.00	0.18
225	600075	新疆天业	52,300	406,371.00	0.18
226	603368	柳州医药	8,370	400,671.90	0.17
227	600439	瑞贝卡	71,480	399,573.20	0.17
228	600363	联创光电	31,800	399,408.00	0.17
229	603658	安图生物	7,500	399,150.00	0.17
230	600285	羚锐制药	42,777	397,826.10	0.17
231	600020	中原高速	81,453	395,861.58	0.17
232	600517	置信电气	60,756	393,091.32	0.17
233	601890	亚星锚链	60,500	390,225.00	0.17
234	600987	航民股份	34,100	384,648.00	0.17
235	603328	依顿电子	26,800	384,580.00	0.17
236	600305	恒顺醋业	32,600	384,354.00	0.17
237	603198	迎驾贡酒	21,700	381,703.00	0.17
238	600657	信达地产	68,300	381,114.00	0.17
239	600329	中新药业	25,595	380,597.65	0.17
240	600986	科达股份	34,600	379,216.00	0.17
241	600757	长江传媒	54,500	378,775.00	0.17
242	603338	浙江鼎力	4,800	377,472.00	0.16
243	600114	东睦股份	23,781	376,453.23	0.16
244	603556	海兴电力	10,300	374,920.00	0.16
245	600850	华东电脑	18,930	373,299.60	0.16
246	603128	华贸物流	45,000	368,550.00	0.16
247	600862	中航高科	37,800	365,904.00	0.16

248	600459	贵研铂业	16,373	363,153.14	0.16
249	600350	山东高速	60,350	361,496.50	0.16
250	600894	广日股份	38,600	360,910.00	0.16
251	603355	莱克电气	7,300	359,744.00	0.16
252	600758	红阳能源	48,300	356,454.00	0.16
253	600012	皖通高速	31,612	347,732.00	0.15
254	600626	申达股份	45,100	346,368.00	0.15
255	601126	四方股份	44,210	346,164.30	0.15
256	600105	永鼎股份	51,300	334,476.00	0.15
257	601158	重庆水务	51,600	333,336.00	0.15
258	600684	珠江实业	53,900	333,102.00	0.15
259	601127	小康股份	16,500	331,815.00	0.14
260	603888	新华网	14,000	331,100.00	0.14
261	603612	索通发展	6,600	329,538.00	0.14
262	600054	黄山旅游	23,066	329,151.82	0.14
263	600405	动力源	50,404	328,634.08	0.14
264	603868	飞科电器	4,300	325,725.00	0.14
265	601139	深圳燃气	40,200	325,620.00	0.14
266	600661	新南洋	12,799	325,606.56	0.14
267	600093	易见股份	30,300	324,816.00	0.14
268	600295	鄂尔多斯	22,073	319,396.31	0.14
269	600748	上实发展	49,700	318,577.00	0.14
270	600531	豫光金铅	49,100	318,168.00	0.14
271	600965	福成股份	29,530	318,038.10	0.14
272	600292	远达环保	35,280	315,756.00	0.14
273	603989	艾华集团	8,200	315,044.00	0.14
274	600776	东方通信	43,412	313,868.76	0.14
275	603118	共进股份	35,520	311,510.40	0.14
276	600387	海越股份	29,200	310,396.00	0.14
277	600007	中国国贸	18,073	309,771.22	0.14
278	600743	华远地产	84,174	308,076.84	0.13
279	600864	哈投股份	38,300	304,102.00	0.13
280	600571	信雅达	27,764	296,797.16	0.13
281	600526	菲达环保	29,600	295,408.00	0.13
282	600481	双良节能	73,346	294,117.46	0.13
283	601515	东风股份	29,960	293,608.00	0.13
284	601020	华钰矿业	14,300	293,436.00	0.13
285	600180	瑞茂通	27,400	285,508.00	0.12
286	600838	上海九百	29,000	285,360.00	0.12
287	603686	龙马环卫	10,700	280,875.00	0.12
288	603618	杭电股份	31,200	280,800.00	0.12
289	600996	贵广网络	28,300	280,170.00	0.12

290	600053	九鼎投资	11,658	278,509.62	0.12
291	600973	宝胜股份	54,575	276,149.50	0.12
292	601069	西部黄金	17,400	276,138.00	0.12
293	600258	首旅酒店	10,200	275,298.00	0.12
294	603126	中材节能	27,700	270,352.00	0.12
295	600831	广电网络	32,950	269,201.50	0.12
296	600299	安迪苏	26,400	266,904.00	0.12
297	603599	广信股份	13,600	265,744.00	0.12
298	600119	长江投资	19,400	265,392.00	0.12
299	603568	伟明环保	12,500	263,125.00	0.11
300	603881	数据港	5,700	260,547.00	0.11
301	600077	宋都股份	73,000	259,880.00	0.11
302	600650	锦江投资	17,700	257,181.00	0.11
303	603898	好莱客	8,600	256,796.00	0.11
304	603108	润达医疗	20,760	254,310.00	0.11
305	603225	新凤鸣	7,100	254,180.00	0.11
306	600826	兰生股份	18,903	248,952.51	0.11
307	603806	福斯特	7,200	245,520.00	0.11
308	603306	华懋科技	8,550	245,043.00	0.11
309	600897	厦门空港	10,899	245,009.52	0.11
310	601368	绿城水务	26,500	240,620.00	0.10
311	600167	联美控股	10,300	240,196.00	0.10
312	603579	荣泰健康	3,800	239,362.00	0.10
313	601789	宁波建工	52,900	239,108.00	0.10
314	601015	陕西黑猫	22,750	237,282.50	0.10
315	603228	景旺电子	4,400	236,588.00	0.10
316	600548	深高速	26,100	234,378.00	0.10
317	600814	杭州解百	25,900	233,100.00	0.10
318	603169	兰石重装	27,500	230,725.00	0.10
319	603626	科森科技	8,000	227,280.00	0.10
320	603698	航天工程	11,300	225,661.00	0.10
321	600697	欧亚集团	8,535	219,520.20	0.10
322	603567	珍宝岛	15,500	219,015.00	0.10
323	600617	国新能源	26,500	218,890.00	0.10
324	603866	桃李面包	5,600	218,232.00	0.10
325	600818	中路股份	9,400	214,602.00	0.09
326	600551	时代出版	18,200	213,668.00	0.09
327	600891	秋林集团	27,900	212,598.00	0.09
328	603258	电魂网络	6,500	211,185.00	0.09
329	603387	基蛋生物	3,500	209,930.00	0.09
330	603300	华铁科技	25,800	209,754.00	0.09
331	600483	福能股份	27,600	208,656.00	0.09

332	603595	东尼电子	2,700	207,360.00	0.09
333	603728	鸣志电器	8,700	206,799.00	0.09
334	603233	大参林	4,000	206,640.00	0.09
335	601595	上海电影	10,000	203,900.00	0.09
336	603609	禾丰牧业	22,600	200,688.00	0.09
337	603528	多伦科技	22,500	198,675.00	0.09
338	603165	荣晟环保	3,400	194,990.00	0.09
339	601811	新华文轩	14,400	193,392.00	0.08
340	600310	桂东电力	37,200	192,324.00	0.08
341	603818	曲美家居	13,200	192,192.00	0.08
342	601199	江南水务	34,048	192,030.72	0.08
343	603997	继峰股份	17,000	191,590.00	0.08
344	603737	三棵树	2,700	191,403.00	0.08
345	603517	绝味食品	4,800	189,216.00	0.08
346	603959	百利科技	6,000	185,880.00	0.08
347	600829	人民同泰	14,600	178,704.00	0.08
348	600113	浙江东日	17,200	175,784.00	0.08
349	600917	重庆燃气	15,700	174,898.00	0.08
350	603113	金能科技	7,400	167,684.00	0.07
351	600975	新五丰	28,900	165,597.00	0.07
352	603358	华达科技	4,400	162,316.00	0.07
353	601128	常熟银行	22,200	158,286.00	0.07
354	603730	岱美股份	4,400	157,564.00	0.07
355	601858	中国科传	14,300	154,583.00	0.07
356	603929	亚翔集成	5,800	151,206.00	0.07
357	603639	海利尔	3,300	148,335.00	0.06
358	603727	博迈科	6,300	147,231.00	0.06
359	600613	神奇制药	17,400	145,464.00	0.06
360	600828	茂业商业	23,319	144,577.80	0.06
361	603603	博天环境	4,000	139,640.00	0.06
362	603669	灵康药业	7,000	138,600.00	0.06
363	603877	太平鸟	5,100	138,261.00	0.06
364	603757	大元泵业	2,300	137,471.00	0.06
365	603239	浙江仙通	7,200	137,232.00	0.06
366	603298	杭叉集团	8,400	134,316.00	0.06
367	603168	莎普爱思	9,023	134,172.01	0.06
368	603339	四方冷链	5,600	132,832.00	0.06
369	603025	大豪科技	4,500	132,390.00	0.06
370	603569	长久物流	5,400	130,626.00	0.06
371	603585	苏利股份	4,150	130,144.00	0.06
372	603060	国检集团	5,900	128,502.00	0.06
373	600981	汇鸿集团	21,800	126,004.00	0.05

374	603098	森特股份	7,100	125,954.00	0.05
375	603861	白云电器	7,500	125,925.00	0.05
376	603628	清源股份	7,300	103,222.00	0.05
377	603421	鼎信通讯	4,000	102,080.00	0.04
378	603803	瑞斯康达	5,400	100,386.00	0.04
379	603798	康普顿	5,400	97,146.00	0.04
380	603600	永艺股份	6,550	93,075.50	0.04

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600309	万华化学	121,120	4,595,292.80	2.00
2	600289	亿阳信通	37,975	377,471.50	0.16
3	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.02
4	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.01
5	603329	上海雅仕	1,182	17,942.76	0.01
6	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.01
7	603655	朗博科技	880	8,184.00	0.00
8	601313	江南嘉捷	94	4,321.18	0.00
9	600903	贵州燃气	28	472.08	0.00
10	600025	华能水电	52	275.60	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600352	浙江龙盛	2,219,943.00	0.86
2	600674	川投能源	2,217,104.38	0.86
3	603799	华友钴业	2,204,646.00	0.85
4	601333	广深铁路	1,550,286.00	0.60
5	600779	水井坊	1,456,302.00	0.56
6	600998	九州通	1,450,666.17	0.56
7	600490	鹏欣资源	1,343,810.00	0.52
8	603288	海天味业	1,247,479.00	0.48
9	601997	贵阳银行	1,134,042.00	0.44
10	600325	华发股份	1,112,223.20	0.43
11	600240	华业资本	1,091,680.00	0.42
12	600978	宜华生活	977,392.00	0.38
13	600346	恒力股份	933,971.00	0.36

14	600372	中航电子	833,680.00	0.32
15	600004	白云机场	776,858.00	0.30
16	601200	上海环境	765,736.00	0.30
17	600176	中国巨石	732,208.00	0.28
18	600446	金证股份	714,371.00	0.28
19	600438	通威股份	697,976.40	0.27
20	600693	东百集团	690,676.00	0.27

注:买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601888	中国国旅	3,849,941.54	1.49
2	600660	福耀玻璃	3,566,766.46	1.38
3	601012	隆基股份	1,912,700.56	0.74
4	600436	片仔癀	1,776,043.15	0.69
5	601992	金隅股份	1,774,906.98	0.68
6	600008	首创股份	1,732,135.92	0.67
7	600170	上海建工	1,585,750.29	0.61
8	600718	东软集团	1,556,065.54	0.60
9	600497	驰宏锌锗	1,520,737.00	0.59
10	600256	广汇能源	1,447,764.00	0.56
11	600282	南钢股份	1,030,945.00	0.40
12	600809	山西汾酒	928,974.00	0.36
13	601997	贵阳银行	896,633.00	0.35
14	600017	日照港	824,284.00	0.32
15	601808	中海油服	696,358.00	0.27
16	600169	太原重工	681,463.36	0.26
17	600634	富控互动	666,879.00	0.26
18	600496	精工钢构	609,627.79	0.24
19	601010	文峰股份	551,014.72	0.21
20	600033	福建高速	550,365.00	0.21

注:卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	80,101,363.92
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	70,756,454.77
--------------	---------------

注：>买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	149,000.00	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	149,000.00	0.07

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110041	蒙电转债	840	84,000.00	0.04
2	110042	航电转债	650	65,000.00	0.03

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体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。

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,067.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	165.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,232.89

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.6 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600525	长园集团	1,866,456.95	0.81	重大事项

8.12.7 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	公司名称	流通受限部分的公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600309	万华化学	4,595,292.80	2.01	重大资产重组
2	603161	科华控股	20,753.25	0.01	新股锁定

8.12.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
913	156,022.91	126,129,045.00	88.54	16,319,870.00	11.46

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。

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
中国建设银行股份有限公司—南方上证380交易型开放式指数证券投资基金联接基金	114,399,941.00	80.31

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国建设银行股份有限公司—南方上证380交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

9.2 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	方正证券股份有限公司	3,380,041.00	2.37
2	泰康资产强化回报混合型养老金产品—中国建设银行股份有限公司	1,923,300.00	1.35
3	中国建设银行股份有限公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	1,611,200.00	1.13
4	中国石油天然气集团公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	1,572,800.00	1.10
5	郑州煤炭工业（集团）有限责任公司企业年金计划—中国建设银行股份有限公司	1,220,400.00	0.86
6	胡海燕	1,073,900.00	0.75
7	北京无限立通通讯技术有限责任公司	609,600.00	0.43
8	山西焦煤集团有限责任公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	576,800.00	0.40
9	王一一	499,000.00	0.35
10	杜敏声	351,800.00	0.25
11	中国建设银行股份有限公司—南方上证380交易型开放式指数证券投资基金	114,399,941.00	80.31

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

9.4 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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年9月16日）基金份额总额	330,448,915.00
本报告期期初基金份额总额	168,448,915.00
本报告期基金总申购份额	78,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	104,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	142,448,915.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2017年1月23日南方基金管理有限公司第七届董事会第二次会议，审议通过秦长奎因任期届满，工作调整的原因不再担任公司副总经理职务。

2017年12月8日南方基金管理股份有限公司（筹）第一届董事会第一次会议，审议通过聘任史博担任公司副总经理。

2017年9月1日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用54,000元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为7年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	146,333,028.12	100.00%	31,874.19	100.00%	
中邮证券	1	-	-	-	-	
第一创业	1	-	-	-	-	
国金证券	1	-	-	-	-	
宏信证券	1	-	-	-	-	
开源证券	1	-	-	-	-	
民族证券	1	-	-	-	-	
申万宏源	1	-	-	-	-	
湘财证券	1	-	-	-	-	
银河证券	1	-	-	-	-	
银泰证券	1	-	-	-	-	
中山证券	1	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	
安信证券	1	-	-	-	-	
诚浩证券	1	-	-	-	-	

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

准和程序：

A：选择标准

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

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

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
诚浩证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	372,204.64	100.00%	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-

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

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理有限公司关于公司旗下证券投资基金缴纳增值税及其附加税费的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年12月30日
2	南方基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年12月26日
3	上证380交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）（2017年第2号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年10月20日
4	上证380交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017年第2号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年10月20日
5	南方基金关于上证380交易型开放式指数证券投资基金、中证南方小康产业交易型开放式指数证券投资基金增加部分券商为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年05月15日
6	上证380交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017年第1号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年04月21日
7	上证380交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）（2017年第1号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年04月21日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		超过20%的时间区间					(%)
南方上证380交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	20170101-20171231	138,399,941.00	2,000,000.00	26,000,000.00	114,399,941.00	80.31
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注：申购份额包含红利在投资和份额折算。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立上证380交易型开放式指数证券投资基金的文件。
- 2、上证380交易型开放式指数证券投资基金基金合同。
- 3、上证380交易型开放式指数证券投资基金托管协议。
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

13.2 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。

13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>

南方基金管理股份有限公司

2018年03月29日