

# 深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2017 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 01 月 01 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

## 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
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 过去三年基金的利润分配情况.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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遵规守信情况的说明.....	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.....	13
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
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.....	14
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
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
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
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>47</b>

8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
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.....	64
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.....	64
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.....	64
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.....	64
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
8.12 投资组合报告附注.....	64
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>65</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
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.....	66
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>67</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>67</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
11.4 基金投资策略的改变.....	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
11.8 其他重大事件.....	70
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>70</b>
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.....	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>71</b>
13.1 备查文件目录.....	71
13.2 存放地点.....	71
13.3 查阅方式.....	71

## 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	南方基金管理股份有限公司
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	379,154,507.00 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	本基金为完全被动式指数基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证成份指数。如果指数编制单位变更或停止深证成份指数的编制及发布、或深证成份指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致深证成份指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,变更本基金的标的指数。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
		郭明
		010-66105799
		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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金年度报告备置地点	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	-17,447,257.18	-55,815,139.01	934,216,855.43
本期利润	48,645,736.05	-114,097,089.64	442,160,825.53
加权平均基金份额本期利润	0.1156	-0.2397	0.5086
本期加权平均净值利润率	10.15%	-21.70%	38.56%
本期基金份额净值增长率	10.38%	-18.70%	15.36%
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	-59,732,639.95	-123,490,433.87	-9,640,125.50
期末可供分配基金份额利润	-0.1575	-0.2701	-0.0205
期末基金资产净值	454,122,828.12	496,075,834.91	626,189,343.36

期末基金份额净值	1.1977	1.0851	1.3347
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	-11.63%	-19.93%	-1.52%

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。

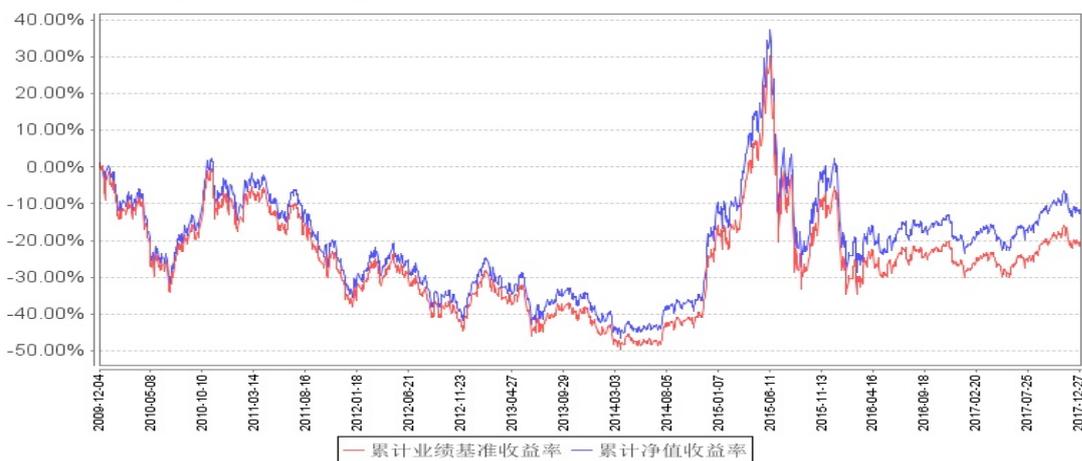
## 3.2 基金净值表现

### 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
过去三个月	-0.28%	0.99%	-0.42%	0.99%	0.14%	0.00%
过去六个月	5.41%	0.90%	4.85%	0.90%	0.56%	0.00%
过去一年	10.38%	0.87%	8.48%	0.87%	1.90%	0.00%
过去三年	3.52%	1.88%	0.23%	1.92%	3.29%	-0.04%
过去五年	28.59%	1.69%	21.10%	1.72%	7.49%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	-11.63%	1.62%	-20.49%	1.65%	8.86%	-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

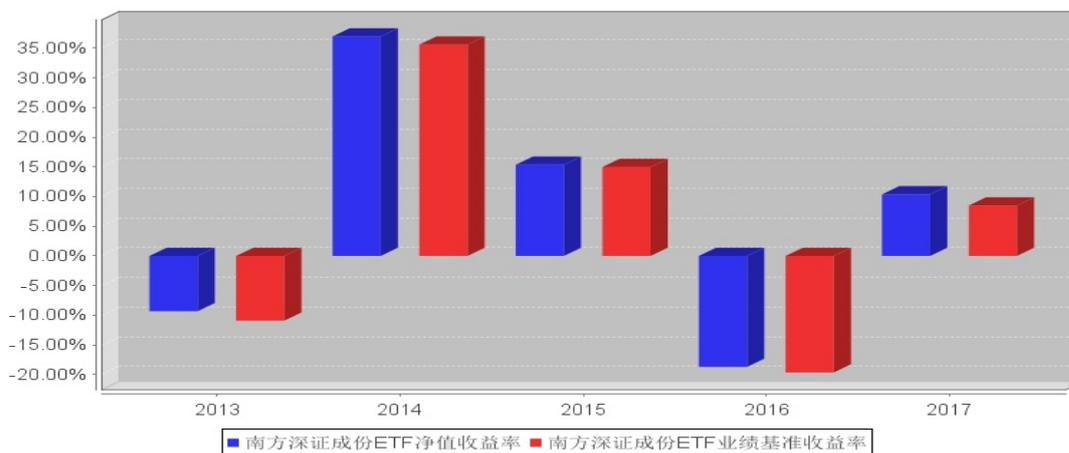
南方深证成份ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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%。

### 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

南方深证成份ETF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

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

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。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或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

#### 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

深证成指本报告期上涨8.48%。

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 0.25%和 1.9%，理想地完成了投资目标。积极参与网下新股申购对基金超越业绩基准收益贡献明显。

截至报告期末，本基金份额净值为 1.1977 元，报告期内，份额净值增长率为 10.38%，同期业绩基准增长率为 8.48%。

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 2018 年，宏观层面，预计经济增长仍将保持良好韧性，在人民币对美元汇率持续走强、通胀较为温和的大背景下，利率上行空间不大，对权益市场的边际负面影响亦较为有限。市场层面，在市场成熟度提升趋势下，预计基本面优秀和估值具有安全边际的公司将继续受到投资者青睐；但随着大盘蓝筹和中小成长走势的分化加剧，新的估值平衡正在重建中。

深证成指于 15 年 5 月正式扩容，成分股由 40 只增至 500 只，在传统支柱产业外更全面纳入新兴成长行业公司。自 15 年 6 月高点至本报告期末，指数估值已跌去一半以上，市盈率已处于扩容后的历史低位。展望 2018 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。基金管理人对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。

#### 4.9 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

无。

#### 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

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，深证成份交易型开放式指数证券投资基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在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，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股份有限公司编制和披露的深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2017 年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 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 22812 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	深证成份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>我们审计了深证成份交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“深证成份 ETF 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则和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,公允反映了深证成份 ETF 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>
形成审计意见的基础	<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。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于深证成份 ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>深证成份 ETF 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深证成份 ETF 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深证成份 ETF 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深证成份 ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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,</p>

	<p>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，就可能对深证成份 ETF 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深证成份 ETF 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 3 月 23 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 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 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	561,384.51	2,147,311.06
结算备付金		11,643.54	27,406.12
存出保证金		2,607.93	2,033.39
交易性金融资产	7.4.7.2	454,182,128.03	494,995,095.82
其中：股票投资		453,742,328.03	494,995,095.82
基金投资		-	-
债券投资		439,800.00	-
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	136.89	352.85
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		454,757,900.90	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12月31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	7.4.7.3	-	-
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		192,179.60	213,273.78
应付托管费		38,435.93	42,654.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	457.25	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	7.4.7.8	404,000.00	484,672.78
负债合计		635,072.78	1,096,364.33
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	513,855,468.07	619,566,268.78
未分配利润	7.4.7.10	-59,732,639.95	-123,490,433.87
所有者权益合计		454,122,828.12	496,075,834.91
负债和所有者权益总计		454,757,900.90	497,172,199.24

注:报告截止日 2017 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.1977 元, 基金份额总额 379,154,507.00 份。

## 7.2 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 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		52,203,709.19	-110,125,376.67
1.利息收入		11,355.39	28,733.44
其中：存款利息收入	7.4.7.11	11,149.71	28,436.02
债券利息收入		97.73	72.42
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		107.95	225.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-13,903,099.81	-51,781,686.02
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-19,173,633.39	-57,375,722.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	9,880.68	25,566.59
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
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	5,260,652.90	5,568,469.93
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	66,092,993.23	-58,281,950.63
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	2,460.38	-90,473.46
减：二、费用		3,557,973.14	3,971,712.97
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,397,311.14	2,629,978.52
2. 托管费	7.4.10.2.2	479,462.18	525,995.64
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	66,733.82	175,746.65
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	614,466.00	639,992.16
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		48,645,736.05	-114,097,089.64

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		48,645,736.05	-114,097,089.64

### 7.3 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）	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）	-	48,645,736.05	48,645,736.05
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）	-105,710,800.71	15,112,057.87	-90,598,742.84
其中：1.基金申购款	12,197,400.07	-2,009,999.03	10,187,401.04
2.基金赎回款	-117,908,200.78	17,122,056.90	-100,786,143.88
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）	513,855,468.07	-59,732,639.95	454,122,828.12
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）	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）	-	-114,097,089.64	-114,097,089.64
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）	-16,263,200.08	246,781.27	-16,016,418.81
其中：1.基金申购款	130,105,600.85	-27,179,038.26	102,926,562.59
2.基金赎回款	-146,368,800.93	27,425,819.53	-118,942,981.40
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）	619,566,268.78	-123,490,433.87	496,075,834.91

注:-

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

深证成份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[2009]1066号《关于核准深证成份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《深证成份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

4,127,252,482.00 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(2009)第 263 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 12 月 4 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 4,127,538,537.00 份基金份额, 其中通过代销机构网上现金及直销机构网下现金认购部分的认购资金利息折合 286,055.00 元份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《深证成份交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定, 本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司确定 2010 年 1 月 13 日为本基金的基金份额折算日。当日深证成份指数收盘值为 13,016.557 点, 本基金的基金资产净值为 3,964,290,323.04 元, 折算前基金份额总额为 4,127,538,537.00 份, 折算前基金份额净值为 0.960 元。根据基金份额折算公式, 基金份额折算比例为 0.73786718, 折算后基金份额总额为 3,045,554,507.00 份, 折算后基金份额净值为 1.302 元。本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司已根据上述折算比例, 对所有基金份额持有人认购的基金份额进行了折算, 并由本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2010 年 1 月 15 日完成了变更登记。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2010]38 号审核同意, 本基金于 2010 年 2 月 2 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《深证成份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深证成份指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化; 主要投资范围为标的指数的成份股和备选成份股, 该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%; 本基金可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下, 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%。本基金的业绩比较基准为深证成份指数。

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 2009 年 12 月 9 日募集成立了南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“南方深证成份 ETF 联接基金”)。南方深证成份 ETF 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》、《深证成份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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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，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	561,384.51	2,147,311.06
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	561,384.51	2,147,311.06

##### 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	484,502,345.77	453,742,328.03	-30,760,017.74
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	439,800.00	439,800.00
	银行间市场	-	-
	-	-	-
	合计	439,800.00	439,800.00
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	484,942,145.77	454,182,128.03	-30,760,017.74
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	591,848,106.79	494,995,095.82	-96,853,010.97
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	591,848,106.79	494,995,095.82	-96,853,010.97

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: 2,140.00 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。

##### 7.4.7.4.1 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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	83.65	333.54
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	5.20	18.41
应收债券利息	46.84	-
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	1.20	0.90
合计	136.89	352.85

#### 7.4.7.6 其他资产

注:无余额。

#### 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	457.25	35,005.30
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	457.25	35,005.30

#### 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	-	-
应退替代款	-	874.72
预提费用	354,000.00	355,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
可退替代款	-	78,798.06
合计	404,000.00	484,672.78

注:1.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。

2.应退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

#### 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	457,154,507.00	619,566,268.78
本期申购	9,000,000.00	12,197,400.07
本期赎回（以“-”号填列）	-87,000,000.00	-117,908,200.78

本期末	379,154,507.00	513,855,468.07
-----	----------------	----------------

#### 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	158,144,115.80	-281,634,549.67	-123,490,433.87
本期利润	-17,447,257.18	66,092,993.23	48,645,736.05
本期基金份额交易产生的变动数	-24,955,049.70	40,067,107.57	15,112,057.87
其中：基金申购款	2,955,120.01	-4,965,119.04	-2,009,999.03
基金赎回款	-27,910,169.71	45,032,226.61	17,122,056.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	115,741,808.92	-175,474,448.87	-59,732,639.95

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	9,747.05	26,147.46
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	1,361.69	2,106.36
其他	40.97	182.20
合计	11,149.71	28,436.02

#### 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	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
股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,170,760.98	-28,480,625.14
股票投资收益——赎回差价收入	-11,002,872.41	-28,895,097.40
股票投资收益——申购差价收入		
合计	-19,173,633.39	-57,375,722.54

## 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	49,724,780.68	126,750,220.04
减：卖出股票成本 总额	57,895,541.66	155,230,845.18
买卖股票差价收入	-8,170,760.98	-28,480,625.14

注

## 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	100,786,143.88	118,942,981.40
减：现金支付赎回款 总额	-848,352.12	2,249,748.40
减：赎回股票成本总 额	112,637,368.41	145,588,330.40
赎回差价收入	-11,002,872.41	-28,895,097.40

## 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	152,031.57	147,839.01
减：卖出债券（、债转股及债 券到期兑付）成本总额	142,100.00	122,200.00
减：应收利息总额	50.89	72.42
买卖债券差价收入	9,880.68	25,566.59

## 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	5,260,652.90	5,568,469.93
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,260,652.90	5,568,469.93

**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	66,092,993.23	-58,281,950.63
股票投资	66,092,993.23	-58,281,950.63
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	66,092,993.23	-58,281,950.63

注:本基金本年度公允价值变动收益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动收益为-2,140.00元(2016度:2,140.00元)。

**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	-	-
替代损益收入	2,460.38	-90,473.46

转换费	-	-
其他	-	-
合计	2,460.38	-90,473.46

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	66,733.82	175,746.65
银行间市场交易费用	-	-
合计	66,733.82	175,746.65

#### 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
指数使用费	200,000.00	224,590.16
上市年费	-	-
银行费用	466.00	402.00
上市费	60,000.00	60,000.00
其他	-	-
合计	614,466.00	639,992.16

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。于2016年3月31日前,标的指数许可使用费的收取下限为年化人民币300,000元;自2016年4月1日起,标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币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
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: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	96,987,936.49	100.00	87,707,375.71	33.79

##### 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	9,658.82	100.00	457.25	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	8,769.47	33.79	8,769.47	25.05

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定, 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	2,397,311.14	2,629,978.52
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 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托管费	479,462.18	525,995.64

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 0.10%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固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 2017年12月31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	237,321,432.00	62.59	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。

**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 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	
	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	561,384.51	9,747.05	2,147,311.06	26,147.46

注:本基金由基金托管人中国工商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**

注:无。

**7.4.12 期末(2017年12月31日)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
002466	天齐锂业	2017-12-26	2018-01-03	新股未上市	11.06	53.21	6,507	71,967.42	346,237.47	-
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-

## 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
128024	宁行转债	2017-12-05	2018-01-12	新债未上市	100.00	100.00	3,075	307,500.00	307,500.00	-
128028	赣锋转债	2017-12-21	2018-01-19	新债未上市	100.00	100.00	437	43,700.00	43,700.00	-
123004	铁汉转债	2017-12-18	2018-01-26	新债未上市	100.00	100.00	433	43,300.00	43,300.00	-
128029	太阳转债	2017-12-22	2018-01-16	新债未上市	100.00	100.00	383	38,300.00	38,300.00	-
128027	崇达转债	2017-12-15	2018-01-22	新债未上市	100.00	100.00	70	7,000.00	7,000.00	-

## 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
300104	乐视网	2017-04-17	重大资产重组	15.33	2018-1-24	13.8	165,286	4,144,334.29	2,533,834.38	-
002739	万达电影	2017-07-04	重大资产重组	52.04	-	-	31,100	2,636,911.29	1,618,444.00	-
000540	中天金融	2017-08-21	重大资产重组	7.35	-	-	188,400	1,876,431.39	1,384,740.00	-

300156	神雾环保	2017-07-17	重大资产重组	24.16	2018-1-17	21.74	38,883	638,880.34	939,413.28	-
002470	金正大	2017-10-25	重大事项	9.15	2018-2-9	8.24	99,900	1,002,289.79	914,085.00	-
002366	台海核电	2017-12-06	重大资产重组	26.45	-	-	34,460	1,019,189.36	911,467.00	-
300383	光环新网	2017-11-07	拟披露重大事项	13.19	2018-3-19	14.51	63,600	1,119,190.23	838,884.00	-
000930	中粮生化	2017-10-24	重大资产重组	13.34	-	-	60,100	969,966.76	801,734.00	-
002075	沙钢股份	2016-09-19	重大资产重组	16.12	-	-	46,900	472,910.27	756,028.00	-
002168	深圳惠程	2017-12-19	拟披露重大事项	13.76	-	-	54,000	707,655.48	743,040.00	-
000566	海南海药	2017-11-22	重大资产重组	12.89	-	-	57,034	938,109.69	735,168.26	-
000547	航天发展	2017-10-30	重大事项	10.83	-	-	67,000	1,351,782.24	725,610.00	-
000006	深振业A	2017-09-11	重大资产重组	9.85	2018-3-8	8.87	66,200	777,531.08	652,070.00	-
300159	新研股份	2017-11-23	重大资产重组	10.40	2018-3-22	9.36	61,000	923,811.37	634,400.00	-
000592	平潭发展	2017-08-09	重大资产重组	5.75	2018-1-29	5.7	102,600	1,128,789.64	589,950.00	-
002004	华邦健康	2017-12-14	重大事项	6.73	2018-3-14	7.3	87,600	1,157,134.99	589,548.00	-
000926	福星股份	2017-12-26	重大事项	10.89	2018-1-10	11.98	53,900	687,763.16	586,971.00	-
000031	中粮地产	2017-07-24	重大资产重组	8.00	-	-	72,941	997,997.50	583,528.00	-
000939	凯迪生态	2017-11-16	重大资产重组	4.99	-	-	114,800	824,299.91	572,852.00	-
000979	中弘股份	2017-09-07	重大资产重组	1.94	2018-2-14	1.75	292,716	859,697.03	567,869.04	-
300090	盛运环保	2017-12-01	重大资产重组	9.24	-	-	57,208	635,269.28	528,601.92	-
002512	达华智能	2017-12-06	拟披露重大事项	18.07	2018-3-6	16.26	27,600	498,178.40	498,732.00	-
000806	银河生物	2017-07-18	重大资产重组	10.76	2018-1-18	10.01	43,300	1,018,085.78	465,908.00	-

300134	大富科技	2017-12-18	拟披露重大事项	16.45	2018-3-19	14.81	27,169	814,738.51	446,930.05	-
000034	神州数码	2017-09-29	重大资产重组	21.60	-	-	20,385	452,757.75	440,316.00	-
000156	华数传媒	2017-12-26	重大事项	11.40	-	-	33,500	957,271.87	381,900.00	-
000766	通化金马	2017-11-24	重大资产重组	13.60	-	-	27,871	490,135.91	379,045.60	-
002130	沃尔核材	2017-12-25	重大事项	5.76	2018-1-10	6.15	64,800	660,656.52	373,248.00	-
300010	立思辰	2017-11-17	拟披露重大事项	11.17	2018-2-22	10.05	30,400	776,317.80	339,568.00	-
000693	*ST 华泽	2016-03-01	重大事项	12.50	2018-3-21	11.88	25,500	466,489.64	318,750.00	-
002358	森源电气	2017-12-07	重大资产重组	14.86	2018-3-7	15.05	20,100	408,114.34	298,686.00	-
300116	坚瑞沃能	2017-12-18	重大资产重组	7.62	-	-	38,900	353,410.67	296,418.00	-
300216	千山药机	2017-12-25	重大事项	15.95	2018-1-18	14.36	17,800	834,594.00	283,910.00	-
000615	京汉股份	2017-12-26	重大事项	9.76	2018-1-10	10.74	26,500	370,984.56	258,640.00	-
002625	光启技术	2017-12-20	重大事项	28.07	2018-1-4	30.88	9,200	426,966.71	258,244.00	-
300292	吴通控股	2017-12-04	重大资产重组	5.67	2018-3-5	5.72	41,600	358,473.44	235,872.00	-
300364	中文在线	2017-12-28	拟披露重大事项	9.23	2018-1-5	10	25,264	522,184.11	233,186.72	-
000564	供销大集	2017-11-28	重大资产重组	4.78	-	-	32,800	213,466.22	156,784.00	-
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项	41.55	2018-1-2	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项	35.26	2018-1-2	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

注: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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 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；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 0.10% (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	561,384.51	-	-	-	561,384.51
结算备付金	11,643.54	-	-	-	11,643.54
存出保证金	2,607.93	-	-	-	2,607.93
交易性金融资产	-	38,300.00	401,500.00	453,742,328.03	454,182,128.03
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	136.89	136.89
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	575,635.98	38,300.00	401,500.00	453,742,464.92	454,757,900.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	192,179.60	192,179.60
应付托管费	-	-	-	38,435.93	38,435.93
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	-	-	-	457.25	457.25
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	404,000.00	404,000.00
负债总计	-	-	-	635,072.78	635,072.78
利率敏感度缺口	575,635.98	38,300.00	401,500.00	453,107,392.14	454,122,828.12
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 0.10%(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。

##### 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	453,742,328.03	99.92	494,995,095.82	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	453,742,328.03	99.92	494,995,095.82	99.78

##### 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%	22,601,693.15	24,366,991.02
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-22,601,693.15	-24,366,991.02

#### 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 2017 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 10,187,401.04 元(2016 年度：102,926,562.59 元)，其中包括以股票支付的申购款 10,094,888.00 元和以现金支付的申购款 92,513.04 元(2016 年度：其中包括以股票支付的申购款 95,286,658.50 元和以现金支付的申购款 7,639,904.09 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 429,442,425.76 元，属于第二层次的余额为 24,739,702.27 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 462,111,744.24 元，第二层次 32,883,351.58 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。

(3)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额确定做出规定。

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。

(4)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	453,742,328.03	99.78
	其中：股票	453,742,328.03	99.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	439,800.00	0.10
	其中：债券	439,800.00	0.10

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	573,028.05	0.13
8	其他各项资产	2,744.82	0.00
9	合计	454,757,900.90	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	10,928,613.50	2.41
B	采矿业	4,428,256.80	0.98
C	制造业	282,533,803.88	62.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,321,611.20	1.39
E	建筑业	8,630,576.96	1.90
F	批发和零售业	11,543,533.33	2.54
G	交通运输、仓储和邮政业	2,656,154.22	0.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,115,530.87	9.93
J	金融业	29,121,303.29	6.41
K	房地产业	23,794,895.97	5.24
L	租赁和商务服务业	6,675,982.46	1.47
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,825,503.17	1.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,093,048.92	0.90
R	文化、体育和娱乐业	7,904,993.94	1.74
S	综合	1,197,952.72	0.26
	合计	452,771,761.23	99.70

## 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	318,750.00	0.07
C	制造业	617,704.25	0.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.01
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	970,566.80	0.21

## 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	000333	美的集团	296,807	16,452,012.01	3.62
2	000651	格力电器	322,140	14,077,518.00	3.10
3	000858	五粮液	125,141	9,996,263.08	2.20
4	000725	京东方 A	1,713,842	9,923,145.18	2.18
5	000002	万科 A	274,858	8,537,089.48	1.88

6	002415	海康威视	216,781	8,454,459.00	1.86
7	000001	平安银行	571,212	7,597,119.60	1.67
8	300498	温氏股份	257,124	6,145,263.60	1.35
9	000063	中兴通讯	161,633	5,876,975.88	1.29
10	002304	洋河股份	37,961	4,365,515.00	0.96
11	002230	科大讯飞	68,880	4,073,563.20	0.90
12	002450	康得新	156,009	3,463,399.80	0.76
13	000776	广发证券	204,759	3,415,380.12	0.75
14	000568	泸州老窖	48,092	3,174,072.00	0.70
15	000538	云南白药	30,186	3,072,632.94	0.68
16	002024	苏宁易购	236,551	2,907,211.79	0.64
17	002008	大族激光	58,500	2,889,900.00	0.64
18	002142	宁波银行	155,883	2,776,276.23	0.61
19	002202	金风科技	145,397	2,740,733.45	0.60
20	000338	潍柴动力	323,708	2,699,724.72	0.59
21	300136	信维通信	52,360	2,654,652.00	0.58
22	002466	天齐锂业	49,887	2,654,487.27	0.58
23	002456	欧菲科技	128,602	2,647,915.18	0.58
24	300059	东方财富	201,186	2,605,358.70	0.57
25	001979	招商蛇口	132,627	2,594,184.12	0.57
26	300104	乐视网	165,286	2,533,834.38	0.56
27	002027	分众传媒	179,380	2,525,670.40	0.56
28	002594	比亚迪	38,536	2,506,766.80	0.55
29	002236	大华股份	107,578	2,483,976.02	0.55
30	002460	赣锋锂业	34,300	2,461,025.00	0.54
31	000166	申万宏源	445,269	2,391,094.53	0.53
32	002241	歌尔股份	133,410	2,314,663.50	0.51
33	000100	TCL 集团	554,471	2,162,436.90	0.48
34	002475	立讯精密	91,617	2,147,502.48	0.47
35	000423	东阿阿胶	35,171	2,119,756.17	0.47
36	300072	三聚环保	60,046	2,109,415.98	0.46
37	000503	海虹控股	48,750	2,104,050.00	0.46
38	300124	汇川技术	71,094	2,063,147.88	0.45
39	000069	华侨城 A	218,749	1,857,179.01	0.41
40	000625	长安汽车	145,198	1,829,494.80	0.40
41	000661	长春高新	9,900	1,811,700.00	0.40
42	300070	碧水源	103,126	1,791,298.62	0.39
43	000413	东旭光电	190,100	1,783,138.00	0.39
44	000839	中信国安	183,250	1,757,367.50	0.39
45	000895	双汇发展	66,224	1,754,936.00	0.39
46	000783	长江证券	221,919	1,746,502.53	0.38
47	002044	美年健康	79,700	1,743,039.00	0.38

48	002252	上海莱士	84,880	1,684,868.00	0.37
49	000963	华东医药	30,464	1,641,400.32	0.36
50	002739	万达电影	31,100	1,618,444.00	0.36
51	002673	西部证券	130,654	1,609,657.28	0.35
52	300024	机器人	83,790	1,576,927.80	0.35
53	002508	老板电器	32,560	1,566,136.00	0.34
54	002310	东方园林	75,850	1,529,894.50	0.34
55	002405	四维图新	57,631	1,520,882.09	0.33
56	000768	中航飞机	89,890	1,518,242.10	0.33
57	300003	乐普医疗	62,000	1,497,920.00	0.33
58	300408	三环集团	73,300	1,477,728.00	0.33
59	002085	万丰奥威	81,888	1,465,795.20	0.32
60	002081	金螳螂	94,226	1,443,542.32	0.32
61	000157	中联重科	319,427	1,427,838.69	0.31
62	002271	东方雨虹	35,500	1,418,580.00	0.31
63	002797	第一创业	144,240	1,413,552.00	0.31
64	002340	格林美	195,800	1,407,802.00	0.31
65	000728	国元证券	126,596	1,392,556.00	0.31
66	000425	徐工机械	300,108	1,389,500.04	0.31
67	000540	中天金融	188,400	1,384,740.00	0.30
68	000998	隆平高科	52,600	1,352,872.00	0.30
69	002129	中环股份	117,220	1,346,857.80	0.30
70	002736	国信证券	123,400	1,338,890.00	0.29
71	000623	吉林敖东	59,268	1,333,530.00	0.29
72	002572	索菲亚	35,764	1,316,115.20	0.29
73	000792	盐湖股份	93,934	1,306,621.94	0.29
74	000786	北新建材	57,900	1,302,750.00	0.29
75	002001	新和成	34,030	1,295,181.80	0.29
76	000039	中集集团	56,200	1,284,170.00	0.28
77	000793	华闻传媒	127,000	1,271,270.00	0.28
78	000630	铜陵有色	433,200	1,264,944.00	0.28
79	002049	紫光国芯	26,213	1,257,961.87	0.28
80	002714	牧原股份	23,300	1,231,638.00	0.27
81	000050	深天马 A	61,400	1,210,194.00	0.27
82	002422	科伦药业	48,178	1,199,632.20	0.26
83	000060	中金岭南	107,230	1,197,759.10	0.26
84	300142	沃森生物	65,500	1,195,375.00	0.26
85	000709	河钢股份	300,900	1,173,510.00	0.26
86	000826	启迪桑德	35,507	1,172,441.14	0.26
87	002146	荣盛发展	121,200	1,155,036.00	0.25
88	300017	网宿科技	105,745	1,125,126.80	0.25
89	300015	爱尔眼科	36,438	1,122,290.40	0.25

90	000977	浪潮信息	56,430	1,121,828.40	0.25
91	002294	信立泰	24,800	1,120,712.00	0.25
92	300266	兴源环境	40,400	1,090,800.00	0.24
93	000983	西山煤电	107,500	1,090,050.00	0.24
94	002179	中航光电	27,430	1,080,193.40	0.24
95	002311	海大集团	46,140	1,079,676.00	0.24
96	002050	三花智控	57,200	1,049,048.00	0.23
97	000008	神州高铁	119,800	1,048,250.00	0.23
98	000876	新希望	140,352	1,045,622.40	0.23
99	002092	中泰化学	78,400	1,043,504.00	0.23
100	300088	长信科技	132,604	1,038,289.32	0.23
101	002465	海格通信	108,200	1,037,638.00	0.23
102	300296	利亚德	52,800	1,029,072.00	0.23
103	002500	山西证券	111,400	1,027,108.00	0.23
104	000418	小天鹅 A	15,000	1,017,750.00	0.22
105	000488	晨鸣纸业	61,000	1,016,870.00	0.22
106	002074	国轩高科	45,600	1,015,056.00	0.22
107	002573	清新环境	44,000	1,000,120.00	0.22
108	002007	华兰生物	37,200	999,936.00	0.22
109	300433	蓝思科技	33,040	986,244.00	0.22
110	002185	华天科技	115,440	983,548.80	0.22
111	002065	东华软件	118,100	968,420.00	0.21
112	000559	万向钱潮	95,340	967,701.00	0.21
113	300027	华谊兄弟	110,775	967,065.75	0.21
114	002176	江特电机	85,400	966,728.00	0.21
115	002558	巨人网络	26,200	964,160.00	0.21
116	000690	宝新能源	119,600	956,800.00	0.21
117	000066	中国长城	130,238	949,435.02	0.21
118	000009	中国宝安	131,164	948,315.72	0.21
119	000750	国海证券	193,450	947,905.00	0.21
120	300156	神雾环保	38,883	939,413.28	0.21
121	000402	金融街	84,263	936,161.93	0.21
122	000581	威孚高科	38,851	932,424.00	0.21
123	002470	金正大	99,900	914,085.00	0.20
124	300355	蒙草生态	72,860	913,664.40	0.20
125	300274	阳光电源	48,635	912,878.95	0.20
126	002366	台海核电	34,460	911,467.00	0.20
127	000671	阳光城	114,690	902,610.30	0.20
128	000887	中鼎股份	49,300	895,781.00	0.20
129	002038	双鹭药业	28,900	895,033.00	0.20
130	000046	泛海控股	119,712	893,051.52	0.20
131	002385	大北农	147,050	891,123.00	0.20

132	300122	智飞生物	31,600	887,012.00	0.20
133	000686	东北证券	100,500	881,385.00	0.19
134	002019	亿帆医药	39,500	878,875.00	0.19
135	000970	中科三环	61,100	878,618.00	0.19
136	000656	金科股份	176,400	873,180.00	0.19
137	300055	万邦达	40,900	860,127.00	0.19
138	002410	广联达	43,319	849,052.40	0.19
139	300144	宋城演艺	45,370	846,604.20	0.19
140	002273	水晶光电	35,800	844,522.00	0.19
141	002583	海能达	45,520	842,575.20	0.19
142	000513	丽珠集团	12,678	842,453.10	0.19
143	002439	启明星辰	36,000	840,600.00	0.19
144	300383	光环新网	63,600	838,884.00	0.18
145	000997	新大陆	45,980	824,421.40	0.18
146	000933	神火股份	80,700	819,105.00	0.18
147	000878	云南铜业	57,496	815,868.24	0.18
148	300315	掌趣科技	146,100	812,316.00	0.18
149	002384	东山精密	28,500	811,110.00	0.18
150	000961	中南建设	126,300	809,583.00	0.18
151	000930	中粮生化	60,100	801,734.00	0.18
152	002217	合力泰	78,300	783,000.00	0.17
153	300146	汤臣倍健	51,800	778,036.00	0.17
154	002244	滨江集团	97,700	776,715.00	0.17
155	000778	新兴铸管	148,732	776,381.04	0.17
156	002223	鱼跃医疗	39,600	776,160.00	0.17
157	002407	多氟多	38,000	775,960.00	0.17
158	000825	太钢不锈	156,200	774,752.00	0.17
159	002195	二三四五	132,540	774,033.60	0.17
160	300182	捷成股份	89,759	772,824.99	0.17
161	300009	安科生物	29,650	768,824.50	0.17
162	002078	太阳纸业	82,800	768,384.00	0.17
163	002600	领益智造	90,900	760,833.00	0.17
164	002075	沙钢股份	46,900	756,028.00	0.17
165	002493	荣盛石化	52,200	749,070.00	0.16
166	002168	深圳惠程	54,000	743,040.00	0.16
167	000988	华工科技	44,800	742,784.00	0.16
168	002426	胜利精密	126,900	739,827.00	0.16
169	000807	云铝股份	72,300	739,629.00	0.16
170	300203	聚光科技	20,800	739,440.00	0.16
171	000566	海南海药	57,034	735,168.26	0.16
172	000938	紫光股份	10,200	734,706.00	0.16
173	000999	华润三九	26,800	728,960.00	0.16

174	300197	铁汉生态	59,754	726,011.10	0.16
175	000547	航天发展	67,000	725,610.00	0.16
176	300115	长盈精密	36,140	725,329.80	0.16
177	300347	泰格医药	20,600	724,708.00	0.16
178	000697	炼石有色	31,400	723,456.00	0.16
179	002280	联络互动	94,375	722,912.50	0.16
180	000917	电广传媒	79,700	722,082.00	0.16
181	000732	泰禾集团	36,000	720,720.00	0.16
182	000960	锡业股份	54,600	720,720.00	0.16
183	002183	怡亚通	100,240	706,692.00	0.16
184	000598	兴蓉环境	129,900	705,357.00	0.16
185	002408	齐翔腾达	55,300	701,204.00	0.15
186	000415	渤海金控	121,460	699,609.60	0.15
187	002221	东华能源	56,800	693,528.00	0.15
188	300166	东方国信	54,323	681,753.65	0.15
189	300418	昆仑万维	33,100	680,867.00	0.15
190	300251	光线传媒	64,820	677,369.00	0.15
191	300168	万达信息	49,746	670,576.08	0.15
192	300033	同花顺	13,400	669,732.00	0.15
193	002048	宁波华翔	28,000	666,400.00	0.15
194	002013	中航机电	61,752	666,304.08	0.15
195	002373	千方科技	45,300	663,645.00	0.15
196	002517	恺英网络	29,500	655,195.00	0.14
197	002285	世联行	58,570	653,055.50	0.14
198	000006	深振业 A	66,200	652,070.00	0.14
199	002030	达安基因	34,902	648,479.16	0.14
200	002281	光迅科技	22,000	646,800.00	0.14
201	000883	湖北能源	138,200	639,866.00	0.14
202	300159	新研股份	61,000	634,400.00	0.14
203	300450	先导智能	11,100	632,367.00	0.14
204	300014	亿纬锂能	32,121	629,892.81	0.14
205	000078	海王生物	105,750	623,925.00	0.14
206	002268	卫士通	26,900	619,238.00	0.14
207	000627	天茂集团	76,900	615,200.00	0.14
208	000800	一汽轿车	57,100	614,396.00	0.14
209	002051	中工国际	33,248	612,760.64	0.13
210	002127	南极电商	50,000	609,500.00	0.13
211	000898	鞍钢股份	95,853	608,666.55	0.13
212	002138	顺络电子	36,700	608,486.00	0.13
213	002343	慈文传媒	16,900	601,809.00	0.13
214	000729	燕京啤酒	89,100	600,534.00	0.13
215	002610	爱康科技	253,200	600,084.00	0.13

216	002640	跨境通	31,300	599,082.00	0.13
217	002624	完美世界	17,900	598,934.00	0.13
218	002153	石基信息	22,385	596,784.10	0.13
219	002440	闰土股份	30,304	596,685.76	0.13
220	002491	通鼎互联	47,300	595,980.00	0.13
221	002383	合众思壮	29,700	594,891.00	0.13
222	000059	华锦股份	62,400	594,672.00	0.13
223	000592	平潭发展	102,600	589,950.00	0.13
224	002004	华邦健康	87,600	589,548.00	0.13
225	000012	南玻A	69,540	587,613.00	0.13
226	000926	福星股份	53,900	586,971.00	0.13
227	002056	横店东磁	54,800	586,360.00	0.13
228	000031	中粮地产	72,941	583,528.00	0.13
229	000400	许继电气	44,100	581,679.00	0.13
230	000089	深圳机场	66,400	577,680.00	0.13
231	000939	凯迪生态	114,800	572,852.00	0.13
232	300145	中金环境	47,700	570,015.00	0.13
233	000979	中弘股份	292,716	567,869.04	0.13
234	000712	锦龙股份	33,400	567,132.00	0.12
235	002191	劲嘉股份	61,075	564,943.75	0.12
236	002601	龙蟠佰利	35,000	560,700.00	0.12
237	002108	沧州明珠	49,305	560,104.80	0.12
238	000758	中色股份	87,060	559,795.80	0.12
239	002444	巨星科技	40,100	554,583.00	0.12
240	000028	国药一致	9,200	554,300.00	0.12
241	002701	奥瑞金	88,600	553,750.00	0.12
242	002292	奥飞娱乐	38,700	553,023.00	0.12
243	000596	古井贡酒	8,400	551,628.00	0.12
244	002152	广电运通	74,100	551,304.00	0.12
245	000975	银泰资源	41,200	550,432.00	0.12
246	002174	游族网络	24,485	546,015.50	0.12
247	002249	大洋电机	78,234	545,290.98	0.12
248	002389	南洋科技	25,700	543,041.00	0.12
249	000703	恒逸石化	25,100	541,407.00	0.12
250	300058	蓝色光标	98,034	541,147.68	0.12
251	300113	顺网科技	29,182	533,738.78	0.12
252	300170	汉得信息	44,650	531,335.00	0.12
253	300090	盛运环保	57,208	528,601.92	0.12
254	300287	飞利信	71,000	526,110.00	0.12
255	002477	雏鹰农牧	117,500	521,700.00	0.11
256	002665	首航节能	78,290	521,411.40	0.11
257	002131	利欧股份	199,843	519,591.80	0.11

258	002501	利源精制	50,105	519,588.85	0.11
259	000021	深科技	53,400	519,582.00	0.11
260	000516	国际医学	106,200	519,318.00	0.11
261	002371	北方华创	12,500	518,000.00	0.11
262	300133	华策影视	47,778	517,913.52	0.11
263	000860	顺鑫农业	26,900	516,749.00	0.11
264	300002	神州泰岳	83,484	510,922.08	0.11
265	300199	翰宇药业	31,372	510,736.16	0.11
266	300253	卫宁健康	75,856	508,993.76	0.11
267	300244	迪安诊断	21,296	503,011.52	0.11
268	300271	华宇软件	33,540	499,075.20	0.11
269	002512	达华智能	27,600	498,732.00	0.11
270	002352	顺丰控股	9,900	498,564.00	0.11
271	002396	星网锐捷	22,900	494,411.00	0.11
272	300068	南都电源	30,610	492,208.80	0.11
273	002709	天赐材料	10,700	492,093.00	0.11
274	300324	旋极信息	33,400	488,642.00	0.11
275	000738	航发控制	31,950	488,515.50	0.11
276	002589	瑞康医药	36,260	487,697.00	0.11
277	000027	深圳能源	80,300	486,618.00	0.11
278	002555	三七互娱	23,500	482,690.00	0.11
279	002018	华信国际	67,390	476,447.30	0.10
280	002151	北斗星通	14,800	473,896.00	0.10
281	002595	豪迈科技	24,500	471,870.00	0.10
282	002155	湖南黄金	48,600	471,420.00	0.10
283	002506	协鑫集成	110,300	470,981.00	0.10
284	002128	露天煤业	42,300	468,684.00	0.10
285	002424	贵州百灵	30,300	466,620.00	0.10
286	000806	银河生物	43,300	465,908.00	0.10
287	300026	红日药业	108,800	463,488.00	0.10
288	002672	东江环保	28,300	459,875.00	0.10
289	002421	达实智能	76,000	459,800.00	0.10
290	002390	信邦制药	54,250	458,412.50	0.10
291	002630	华西能源	42,000	457,800.00	0.10
292	002400	省广股份	85,766	457,132.78	0.10
293	002670	国盛金控	23,500	457,075.00	0.10
294	300053	欧比特	31,950	455,607.00	0.10
295	002602	世纪华通	13,400	455,332.00	0.10
296	002635	安洁科技	17,400	453,966.00	0.10
297	002354	天神娱乐	26,520	453,492.00	0.10
298	002002	鸿达兴业	66,257	453,197.88	0.10
299	002431	棕榈股份	53,950	453,180.00	0.10

300	000601	韶能股份	62,900	452,880.00	0.10
301	000718	苏宁环球	103,996	450,302.68	0.10
302	300073	当升科技	17,100	449,559.00	0.10
303	002468	申通快递	18,200	449,358.00	0.10
304	000685	中山公用	43,740	448,335.00	0.10
305	002411	必康股份	16,800	448,056.00	0.10
306	002353	杰瑞股份	34,087	447,221.44	0.10
307	300134	大富科技	27,169	446,930.05	0.10
308	300367	东方网力	29,600	446,368.00	0.10
309	300207	欣旺达	45,700	446,032.00	0.10
310	000518	四环生物	65,200	445,968.00	0.10
311	002023	海特高新	43,200	445,392.00	0.10
312	300413	快乐购	14,900	444,765.00	0.10
313	002036	联创电子	27,400	444,702.00	0.10
314	000762	西藏矿业	28,300	444,310.00	0.10
315	000937	冀中能源	76,200	443,484.00	0.10
316	000877	天山股份	42,600	443,040.00	0.10
317	002250	联化科技	41,700	442,854.00	0.10
318	000902	新洋丰	45,202	442,075.56	0.10
319	002603	以岭药业	28,400	441,904.00	0.10
320	002266	浙富控股	101,930	441,356.90	0.10
321	300496	中科创达	13,654	441,297.28	0.10
322	000667	美好置业	144,900	440,496.00	0.10
323	000034	神州数码	20,385	440,316.00	0.10
324	002245	澳洋顺昌	42,900	439,725.00	0.10
325	002104	恒宝股份	49,900	437,623.00	0.10
326	000727	华东科技	183,000	435,540.00	0.10
327	000563	陕国投 A	102,200	434,350.00	0.10
328	002043	兔宝宝	35,300	432,778.00	0.10
329	000612	焦作万方	46,000	432,400.00	0.10
330	300083	劲胜智能	56,800	431,112.00	0.09
331	002716	金贵银业	22,800	430,236.00	0.09
332	002299	圣农发展	29,800	429,120.00	0.09
333	300098	高新兴	31,900	424,270.00	0.09
334	002368	太极股份	16,700	423,679.00	0.09
335	300459	金科文化	37,900	421,827.00	0.09
336	002145	中核钛白	70,200	420,498.00	0.09
337	002489	浙江永强	69,900	420,099.00	0.09
338	000751	锌业股份	81,220	416,658.60	0.09
339	000587	金洲慈航	59,400	415,800.00	0.09
340	300001	特锐德	30,300	414,807.00	0.09
341	000848	承德露露	43,565	412,124.90	0.09

342	002608	江苏国信	40,500	411,480.00	0.09
343	000829	天音控股	43,300	411,350.00	0.09
344	300077	国民技术	40,900	409,000.00	0.09
345	002308	威创股份	33,519	408,931.80	0.09
346	002067	景兴纸业	69,230	407,764.70	0.09
347	002668	奥马电器	21,100	404,698.00	0.09
348	002428	云南锗业	33,400	403,138.00	0.09
349	002429	兆驰股份	112,600	403,108.00	0.09
350	300020	银江股份	34,300	401,310.00	0.09
351	002251	步步高	22,200	400,710.00	0.09
352	000426	兴业矿业	40,700	400,081.00	0.09
353	002436	兴森科技	67,600	398,164.00	0.09
354	002277	友阿股份	67,700	397,399.00	0.09
355	002157	正邦科技	69,100	395,943.00	0.09
356	300078	思创医惠	36,460	393,403.40	0.09
357	002025	航天电器	17,390	392,492.30	0.09
358	000061	农产品	50,900	389,894.00	0.09
359	002022	科华生物	28,501	387,898.61	0.09
360	002237	恒邦股份	36,500	387,630.00	0.09
361	002047	宝鹰股份	51,300	387,315.00	0.09
362	300101	振芯科技	28,800	386,496.00	0.09
363	300185	通裕重工	168,900	383,403.00	0.08
364	300431	暴风集团	17,541	382,393.80	0.08
365	300212	易华录	14,100	382,110.00	0.08
366	000156	华数传媒	33,500	381,900.00	0.08
367	000766	通化金马	27,871	379,045.60	0.08
368	002106	莱宝高科	37,200	378,324.00	0.08
369	000541	佛山照明	41,080	377,936.00	0.08
370	300118	东方日升	31,100	377,243.00	0.08
371	002437	誉衡药业	54,500	375,505.00	0.08
372	300310	宜通世纪	32,360	375,052.40	0.08
373	000980	众泰汽车	31,400	374,916.00	0.08
374	002130	沃尔核材	64,800	373,248.00	0.08
375	000543	皖能电力	73,570	369,321.40	0.08
376	000901	航天科技	15,800	369,088.00	0.08
377	000090	天健集团	36,760	369,070.40	0.08
378	002123	梦网集团	35,401	366,400.35	0.08
379	002302	西部建设	20,900	366,168.00	0.08
380	002399	海普瑞	23,920	365,497.60	0.08
381	300377	赢时胜	29,447	363,964.92	0.08
382	002055	得润电子	17,800	363,654.00	0.08
383	300079	数码科技	86,200	362,902.00	0.08

384	000088	盐田港	47,100	361,257.00	0.08
385	000882	华联股份	117,600	358,680.00	0.08
386	000969	安泰科技	40,200	357,378.00	0.08
387	002544	杰赛科技	22,500	353,925.00	0.08
388	002073	软控股份	44,200	353,600.00	0.08
389	002375	亚厦股份	46,850	352,312.00	0.08
390	300294	博雅生物	11,750	351,912.50	0.08
391	002276	万马股份	40,800	351,696.00	0.08
392	000600	建投能源	45,600	351,576.00	0.08
393	002657	中科金财	15,300	349,146.00	0.08
394	300036	超图软件	22,500	347,400.00	0.08
395	000680	山推股份	67,700	344,593.00	0.08
396	002643	万润股份	32,150	343,683.50	0.08
397	002089	新海宜	60,700	341,134.00	0.08
398	002326	永太科技	29,800	340,316.00	0.07
399	300010	立思辰	30,400	339,568.00	0.07
400	002699	美盛文化	18,620	337,208.20	0.07
401	002063	远光软件	31,717	337,151.71	0.07
402	002434	万里扬	32,000	336,000.00	0.07
403	300257	开山股份	24,000	336,000.00	0.07
404	000158	常山北明	42,170	334,829.80	0.07
405	000049	德赛电池	8,400	332,556.00	0.07
406	002180	纳思达	12,100	330,451.00	0.07
407	002010	传化智联	20,400	330,072.00	0.07
408	000687	华讯方舟	31,400	330,014.00	0.07
409	002505	大康农业	116,110	329,752.40	0.07
410	002120	韵达股份	7,199	329,570.22	0.07
411	002041	登海种业	25,550	328,317.50	0.07
412	002479	富春环保	33,700	327,227.00	0.07
413	000973	佛塑科技	54,000	323,460.00	0.07
414	300202	聚龙股份	18,000	323,100.00	0.07
415	001696	宗申动力	51,100	322,952.00	0.07
416	002261	拓维信息	41,600	321,984.00	0.07
417	000617	中油资本	21,400	321,000.00	0.07
418	300273	和佳股份	35,230	319,183.80	0.07
419	002642	荣之联	24,200	317,262.00	0.07
420	000620	新华联	55,300	315,210.00	0.07
421	002773	康弘药业	5,100	314,568.00	0.07
422	002303	美盈森	44,900	314,300.00	0.07
423	002099	海翔药业	54,300	313,854.00	0.07
424	300267	尔康制药	46,400	312,272.00	0.07
425	002413	雷科防务	31,200	312,000.00	0.07

426	002482	广田集团	38,750	310,775.00	0.07
427	000777	中核科技	20,700	308,430.00	0.07
428	000875	吉电股份	78,800	306,532.00	0.07
429	300458	全志科技	10,722	305,148.12	0.07
430	000519	中兵红箭	30,899	304,355.15	0.07
431	000018	神州长城	49,600	303,552.00	0.07
432	000957	中通客车	26,800	301,768.00	0.07
433	002358	森源电气	20,100	298,686.00	0.07
434	002147	新光圆成	22,910	296,455.40	0.07
435	300116	坚瑞沃能	38,900	296,418.00	0.07
436	000869	张裕A	7,900	296,250.00	0.07
437	000062	深圳华强	12,508	293,812.92	0.06
438	000851	高鸿股份	34,400	293,776.00	0.06
439	300376	易事特	38,800	293,716.00	0.06
440	002283	天润曲轴	51,300	293,436.00	0.06
441	000539	粤电力A	60,740	292,766.80	0.06
442	002242	九阳股份	17,200	291,884.00	0.06
443	002143	印纪传媒	22,020	290,664.00	0.06
444	300075	数字政通	17,800	288,004.00	0.06
445	002563	森马服饰	36,200	284,532.00	0.06
446	300216	千山药机	17,800	283,910.00	0.06
447	300037	新宙邦	13,500	281,610.00	0.06
448	000959	首钢股份	47,000	281,060.00	0.06
449	002503	搜于特	50,100	277,554.00	0.06
450	300352	北信源	69,450	276,411.00	0.06
451	300291	华录百纳	24,253	275,271.55	0.06
452	002522	浙江众成	30,800	271,040.00	0.06
453	300474	景嘉微	5,000	269,600.00	0.06
454	002224	三力士	30,700	266,476.00	0.06
455	002190	成飞集成	12,300	266,172.00	0.06
456	300304	云意电气	36,200	265,346.00	0.06
457	300222	科大智能	13,400	264,382.00	0.06
458	002325	洪涛股份	55,200	263,304.00	0.06
459	002284	亚太股份	29,200	262,216.00	0.06
460	002681	奋达科技	23,340	260,474.40	0.06
461	002474	榕基软件	30,800	259,336.00	0.06
462	000615	京汉股份	26,500	258,640.00	0.06
463	002625	光启技术	9,200	258,244.00	0.06
464	002052	同洲电子	46,034	257,790.40	0.06
465	002570	贝因美	35,700	257,040.00	0.06
466	300085	银之杰	18,770	255,272.00	0.06
467	000881	中广核技	19,100	249,637.00	0.05

468	300043	星辉娱乐	40,600	248,472.00	0.05
469	002481	双塔食品	48,300	247,296.00	0.05
470	002110	三钢闽光	12,400	239,816.00	0.05
471	300292	吴通控股	41,600	235,872.00	0.05
472	300364	中文在线	25,264	233,186.72	0.05
473	000801	四川九洲	40,438	231,305.36	0.05
474	002695	煌上煌	13,600	230,928.00	0.05
475	300317	珈伟股份	14,700	230,202.00	0.05
476	002588	史丹利	33,900	226,791.00	0.05
477	300369	绿盟科技	24,399	222,030.90	0.05
478	000558	莱茵体育	43,800	216,810.00	0.05
479	002329	皇氏集团	33,000	215,160.00	0.05
480	000555	神州信息	18,000	211,500.00	0.05
481	300506	名家汇	9,400	209,150.00	0.05
482	300359	全通教育	21,200	204,792.00	0.05
483	002416	爱施德	21,300	201,711.00	0.04
484	300011	鼎汉技术	19,200	198,912.00	0.04
485	002619	艾格拉斯	30,080	192,512.00	0.04
486	002229	鸿博股份	20,450	192,230.00	0.04
487	300558	贝达药业	3,000	189,870.00	0.04
488	000987	越秀金控	19,200	189,120.00	0.04
489	000607	华媒控股	29,200	176,952.00	0.04
490	002568	百润股份	13,300	176,491.00	0.04
491	002831	裕同科技	3,000	167,640.00	0.04
492	300386	飞天诚信	10,500	166,530.00	0.04
493	000564	供销大集	32,800	156,784.00	0.03
494	300379	东方通	12,400	156,736.00	0.03
495	300368	汇金股份	14,800	126,984.00	0.03
496	002703	浙江世宝	15,250	126,270.00	0.03
497	002815	崇达技术	3,600	113,616.00	0.03
498	002782	可立克	7,800	109,356.00	0.02
499	002287	奇正藏药	3,000	101,640.00	0.02
500	002818	富森美	3,200	96,992.00	0.02

### 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	000693	*ST 华泽	25,500	318,750.00	0.07
2	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.06
3	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.04

4	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.01
5	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.01
6	300730	科创信息	821	34,112.55	0.01
7	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.01
8	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.00
9	002923	润都股份	954	16,227.54	0.00
10	300684	中石科技	827	11,528.38	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	002558	巨人网络	1,377,519.13	0.28
2	002797	第一创业	1,225,905.00	0.25
3	002027	分众传媒	990,134.30	0.20
4	300145	中金环境	807,573.52	0.16
5	000418	小天鹅 A	791,653.00	0.16
6	002127	南极电商	735,541.00	0.15
7	002354	天神娱乐	711,779.24	0.14
8	000933	神火股份	696,962.82	0.14
9	002408	齐翔腾达	689,957.00	0.14
10	300450	先导智能	675,437.00	0.14
11	000877	天山股份	659,995.00	0.13
12	002601	龙蟠佰利	659,476.00	0.13
13	002280	联络互动	628,088.00	0.13
14	002389	南洋科技	622,650.00	0.13
15	002352	顺丰控股	617,864.00	0.12
16	002506	协鑫集成	589,141.00	0.12
17	002434	万里扬	582,150.00	0.12
18	002608	江苏国信	573,151.00	0.12
19	002302	西部建设	562,988.00	0.11
20	002252	上海莱士	544,033.99	0.11

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

### 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	000333	美的集团	960,868.00	0.19

2	000651	格力电器	764,333.00	0.15
3	000002	万科A	529,413.00	0.11
4	000566	海南海药	505,355.00	0.10
5	002024	苏宁易购	470,910.00	0.09
6	300012	华测检测	448,595.00	0.09
7	002121	科陆电子	443,815.50	0.09
8	002463	沪电股份	442,012.00	0.09
9	000725	京东方A	439,986.00	0.09
10	002031	巨轮智能	438,651.00	0.09
11	300096	易联众	438,010.00	0.09
12	002663	普邦股份	435,305.00	0.09
13	000733	振华科技	430,347.00	0.09
14	000650	仁和药业	429,943.27	0.09
15	300238	冠昊生物	427,236.00	0.09
16	002156	通富微电	418,809.00	0.08
17	300005	探路者	408,240.00	0.08
18	002071	长城影视	405,314.00	0.08
19	300147	香雪制药	401,817.60	0.08
20	002005	德豪润达	401,063.00	0.08

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	51,824,917.05
卖出股票收入(成交)总额	49,724,780.68

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）	439,800.00	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	439,800.00	0.10

## 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	128024	宁行转债	3,075	307,500.00	0.07
2	128028	赣锋转债	437	43,700.00	0.01
3	123004	铁汉转债	433	43,300.00	0.01
4	128029	太阳转债	383	38,300.00	0.01
5	128027	崇达转债	70	7,000.00	0.00

## 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

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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	2,607.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	136.89
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,744.82

**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**

## 1、期末指数投资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。

## 2、期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注: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。

**§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 (%)
5,380	70,474.82	241,752,622.00	63.76	137,401,885.00	36.24

注: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(%)
中国工商银行股份有限公司—南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	237,321,432.00	62.59

注：9.1.1 机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行—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。

## 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	刘素坚	1,845,018.00	0.49
2	耿力扬	1,500,000.00	0.40
3	邬海滨	1,475,867.00	0.39
4	凌燕	1,475,778.00	0.39
5	杨悦文	1,418,265.00	0.37
6	高宝泉	1,378,600.00	0.36
7	刘春霞	1,344,657.00	0.35
8	王勇	1,200,000.00	0.32
9	章斌	1,151,301.00	0.30
10	屠文斌	1,129,300.00	0.30
	中国工商银行股份有限公司—南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	237,321,432.00	62.59

## 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（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	9,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	87,000,000.00
本报告期期末基金份额总额	379,154,507.00

## §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。

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。

## 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 54,000.00 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	3	96,987,936.49	100.00%	9,658.82	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。

### 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
东北证券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	1,000,000.00	100.00%	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	656,067.95	100.00%	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-

### 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	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年01月06日
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）摘要（2016年第2号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年01月06日
3	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年06月13日
4	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（2017年第1号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年07月07日
5	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）（2017年第1号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年07月07日
6	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
7	关于深证成份交易型开放式指数证券投资基金2018年1月2日暂停申购和赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年12月29日
8	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年12月30日
9	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

## §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 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
本基金联接基金	1	20170101-20171231	273,321,432.00	3,000,000.00	39,000,000.00	237,321,432.00	62.59
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

### 12.2 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>

