

上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
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.....	10
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3 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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	45
7.7 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.....	45
7.8 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.....	45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	48
§10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	51
§11 备查文件目录.....	52
11.1 备查文件目录.....	52
11.2 存放地点.....	52
11.3 查阅方式.....	52

§2 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	178,448,915.00 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	<p>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。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> <p>本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金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。</p>
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	鲍文革	田青
	联系电话	0755-82763888	010-67595096
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tianqingl.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		吴万善	王洪章

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
---------------	---------------------------------------

本期已实现收益	-12,403,112.83
本期利润	-62,071,450.11
加权平均基金份额本期利润	-0.3394
本期加权平均净值利润率	-23.60%
本期基金份额净值增长率	-20.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	65,999,001.20
期末可供分配基金份额利润	0.3698
期末基金资产净值	261,900,680.11
期末基金份额净值	1.4677
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	46.77%

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.33%	1.41%	2.95%	1.44%	0.38%	-0.03%
过去三个月	-1.53%	1.55%	-2.05%	1.57%	0.52%	-0.02%
过去六个月	-20.29%	2.47%	-20.88%	2.50%	0.59%	-0.03%
过去一年	-31.61%	3.13%	-33.37%	3.04%	1.76%	0.09%
过去三年	89.04%	2.24%	88.06%	2.20%	0.98%	0.04%
自基金合同生效起至今	46.77%	1.96%	42.70%	1.95%	4.07%	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

基金份额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



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

南方基金总部设在深圳，注册资本3亿元人民币。股东结构为：华泰证券股份有限公司（45%）；深圳市投资控股有限公司（30%）；厦门国际信托有限公司（15%）；兴业证券股份有限公司（10%）。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模超过5,600亿元，旗下

管理 96 只开放式基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柯晓	本基金基金经理	2013 年 5 月 17 日	-	19 年	美国纽约大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾先后担任美国美林证券公司助理副总裁、招商证券首席产品策略师。2006 年加入南方基金，任首席产品设计师；2010 年 8 月至今，任小康 ETF 及南方小康基金经理；2013 年 4 月至今，任南方深成及南方深成 ETF 的基金经理；2013 年 5 月至今，任南方上证 380ETF 及联接基金的基金经理；2015 年 7 月至今，任南方互联基金的基金经理。
杨德龙	本基金基金经理	2011 年 9 月 16 日	2016 年 3 月 4 日	10 年	北京大学经济学硕士、清华大学工学学士，具有基金从业资格。2006 年加入南方基金，担任研究部高级行业研究员、首席策略分析师；2010 年 8 月至 2013 年 4 月，任小康 ETF 及南方小康基金经理；2011 年 9 月至 2016 年 3 月，任南方上证 380ETF 及联接基金基金经理；2013 年 3 月至 2016 年 3 月，任南方策略基金经理；2013 年 4 月至 2016 年 3 月，任南方 300 基金经理；2013 年 4 月至 2016 年 3 月，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2014 年 12 月至 2016 年 3 月，任南方恒生 ETF 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，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“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《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，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

公司每季度对旗下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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 1 次，是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

我们认为，指数化投资不同于主动式投资，后者强调通过各自不同的投资理念去寻找超越市场的投资机会，而前者的宗旨是尽量拟合标的指数的走势，为投资者提供一个跟踪指数的投资工具。同时，ETF 基金又不同于普通指数基金，由于 ETF 的可上市交易属性，全市场的投资者都将根据基金管理人每日公告的申购赎回清单进行申赎及跨市场操作，这就使得 ETF 基金管理人必须更加注重风险控制，一丝疏漏都可能导致严重的后果。也正因为深知此理，我们专门针对 ETF 的投资管理制定了科学、严谨的操作流程，使得流程中的每位人员，都清楚的知道自己在什么时点需要完成什么工作。ETF 管理团队除基金经理之外，还由数量投资分析师、交易管理人员、IT 人员等组成，为 ETF 基金的投资管理提供研究、交易、系统及其相关工作的快速支持响应。

对于本基金而言，本报告期跟踪误差的主要来源包括：①大额申购赎回（如联接基金的大比

例换购)所带来的成份股权重偏离,对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行应对;②指数成份股调整所带来的跟踪误差是不容忽视的,是本基金跟踪误差的另一主要来源。为此,本基金管理组提前进行了全面模拟测算,并制定了周密的调仓方案,从实施结果来看,本基金成份股调仓较为成功。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金自上市日至本报告期末的指数跟踪期间,相对于标的指数的年化跟踪误差为 1.090%,较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过 2%的投资目标。

截至报告期末,本基金份额净值为 1.4677 元,报告期内,份额净值增长率为-20.29%,同期业绩基准增长率为-20.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年下半年,全球资本市场的稳定性因素对于国内的宏观经济以及 A 股的影响增大,国内经济转型进入攻坚期。受制于美联储的加息和人民币汇率的波动,我们认为货币政策进一步放松的空间有限。但在央行的灵活操作下,市场流动性还是比较宽裕的。A 股在过去 3 年,以创业板为代表的新兴成长板块是明显跑赢以沪深 300 为代表的价值蓝筹,但在今年价值蓝筹的表现是稍好于新兴成长板块的,体现了均值回归的理念。

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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括副总经理、研究部总监、量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等等。其中,超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验,且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值价格的最终决策。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。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，本报告期内本基金未有收益分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.4.1	2,762,361.38	4,881,156.41
结算备付金		-	94,431.25
存出保证金		2,564.31	68,397.54
交易性金融资产	6.4.4.2	259,432,922.34	301,942,431.60
其中：股票投资		259,432,922.34	301,942,431.60
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		-	58,245.22
应收利息	6.4.4.5	526.87	1,156.36
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	78,866.48	-
资产总计		262,277,241.38	307,045,818.38
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,813.59	123,843.00
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		105,622.54	133,831.12
应付托管费		21,124.52	26,766.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	7,520.92	11,727.77
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	239,479.70	261,705.71
负债合计		376,561.27	557,873.85
所有者权益：			
实收基金	6.4.4.9	178,448,915.00	166,448,915.00
未分配利润	6.4.4.10	83,451,765.11	140,039,029.53
所有者权益合计		261,900,680.11	306,487,944.53
负债和所有者权益总计		262,277,241.38	307,045,818.38

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4677 元，基金份额总额 178,448,915.00 份。

6.2 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-60,937,119.78	116,258,922.59
1.利息收入		20,555.67	35,057.88
其中：存款利息收入	6.4.4.11	20,447.48	34,958.04
债券利息收入		108.19	99.84
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）		-11,214,258.80	167,660,571.26
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-12,846,435.01	166,017,530.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	66,057.71	240,190.03
资产支持证券投资收益	6.4.4.13.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.4.14	-	-
衍生工具收益	6.4.4.15	-	-
股利收益	6.4.4.16	1,566,118.50	1,402,851.11
3.公允价值变动收益（损失以	6.4.4.17	-49,668,337.28	-54,678,490.47

“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.4.18	-75,079.37	3,241,783.92
减:二、费用		1,134,330.33	1,578,425.91
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	654,836.44	878,119.57
2. 托管费	6.4.7.2.2	130,967.29	175,623.95
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.4.19	53,803.12	221,835.80
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.4.20	294,723.48	302,846.59
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-62,071,450.11	114,680,496.68
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-62,071,450.11	114,680,496.68

6.3 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: 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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动数(本期利润)	-	-62,071,450.11	-62,071,450.11
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)	12,000,000.00	5,484,185.69	17,484,185.69
其中: 1. 基金申购款	60,000,000.00	26,004,469.55	86,004,469.55
2. 基金赎回款	-48,000,000.00	-20,520,283.86	-68,520,283.86
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)	178,448,915.00	83,451,765.11	261,900,680.11
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	220,448,915.00	73,133,957.70	293,582,872.70
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	-	114,680,496.68	114,680,496.68
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)	30,000,000.00	99,261,845.76	129,261,845.76
其中：1.基金申购款	4,244,000,000.00	5,247,275,672.25	9,491,275,672.25
2.基金赎回款	-4,214,000,000.00	-5,148,013,826.49	-9,362,013,826.49
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)	250,448,915.00	287,076,300.14	537,525,215.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨小松

徐超

徐超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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补充政策的通知》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。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，股权的股息、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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

6.4.4 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	2,762,361.38
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,762,361.38

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	270,601,253.54	259,432,922.34	-11,168,331.20
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	270,601,253.54	259,432,922.34	-11,168,331.20

注：于 2016 年 6 月 30 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 0.00。

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.4.4 买入返售金融资产

6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	525.67
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.20
合计	526.87

6.4.4.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	78,866.48
合计	78,866.48

6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	7,520.92
银行间市场应付交易费用	-
合计	7,520.92

6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	208,850.46
指数使用费	19,493.14

应退替代款	899.10
可退替代款	10,237.00
合计	239,479.70

6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	166,448,915.00	166,448,915.00
本期申购	60,000,000.00	60,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-48,000,000.00	-48,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期末	178,448,915.00	178,448,915.00

6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	72,806,790.12	67,232,239.41	140,039,029.53
本期利润	-12,403,112.83	-49,668,337.28	-62,071,450.11
本期基金份额交易产生的变动数	5,595,323.91	-111,138.22	5,484,185.69
其中：基金申购款	25,298,839.23	705,630.32	26,004,469.55
基金赎回款	-19,703,515.32	-816,768.54	-20,520,283.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	65,999,001.20	17,452,763.91	83,451,765.11

6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
	活期存款利息收入
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	633.21
其他	-
合计	20,447.48

6.4.4.12 股票投资收益**6.4.4.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-6,055,576.46
股票投资收益——赎回差价收入	-6,790,858.55
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-12,846,435.01

6.4.4.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	38,251,891.96
减：卖出股票成本总额	44,307,468.42
买卖股票差价收入	-6,055,576.46

6.4.4.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
赎回基金份额对价总额	68,520,283.86
减：现金支付赎回款总额	-231,184.14
减：赎回股票成本总额	75,542,326.55
赎回差价收入	-6,790,858.55

6.4.4.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	518,165.90
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	452,000.00
减：应收利息总额	108.19
买卖债券差价收入	66,057.71

6.4.4.13.1 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.4.14 贵金属投资收益

注：无。

6.4.4.15 衍生工具收益

注：无。

6.4.4.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,566,118.50
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,566,118.50

6.4.4.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-49,668,337.28
——股票投资	-49,668,337.28
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-49,668,337.28

注：本基金本报告期公允价值变动收益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益 0.00 元(上年度可比期间：40,157.81 元)。

6.4.4.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
----	----------------------------

基金赎回费收入	-
替代损益	-75,079.37
合计	-75,079.37

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。

6.4.4.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	53,803.12
银行间市场交易费用	-
合计	53,803.12

6.4.4.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	149,179.94
上市年费	29,835.26
银行费用	974.47
指数使用费	84,898.55
其他	-
合计	294,723.48

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(基金设立首季不受收取下限的限制)。

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国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
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

注：无。

6.4.7.1.2 债券交易

注：无。

6.4.7.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.7.1.4 权证交易

注：无。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金总 额的比例
华泰证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			

	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金总 额的比例
华泰证券	20,503.00	25.57%	20,503.00	24.20%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年 6月30日	2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	654,836.44	878,119.57
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.5% / 当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年 6月30日	2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	130,967.29	175,623.95

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 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：无。

6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015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	142,399,941.00	79.8000%	128,399,941.00	77.1400%

注：上证380ETF联接基金和华泰证券投资本基金相关的费用按基金合同和更新的招募说明书的有关规定以及与券商约定的席位佣金费率支付。

6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,762,361.38	19,814.27	15,654,953.83	28,823.44

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

6.4.8 利润分配情况**6.4.8.1 利润分配情况——非货币市场基金**

注：无。

6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600654	中安消	2016年5月19日	重大事项停牌	18.54	2016年8月8日	20.39	93,100	2,742,481.98	1,726,074.00	-
600166	福田汽车	2016年6月30日	重大事项停牌	5.52	2016年7月1日	5.62	262,000	1,535,288.81	1,446,240.00	-
601168	西部矿业	2016年2月1日	重大事项停牌	5.93	2016年7月22日	6.52	211,974	1,444,959.66	1,257,005.82	-
600497	驰宏锌锗	2016年6月13日	重大事项停牌	9.97	2016年7月11日	10.97	115,400	1,129,434.72	1,150,538.00	-
600511	国药股份	2016年2月18日	重大事项停牌	27.42	2016年8月4日	30.16	31,025	998,767.05	850,705.50	-
600634	中技控股	2016年6月22日	重大事项停牌	14.41	-	-	44,700	923,084.73	644,127.00	-
600577	精达股份	2016年5月3日	重大事项停牌	4.18	-	-	132,400	628,430.17	553,432.00	-
600614	鼎立股份	2016年4月26日	重大事项停牌	8.14	-	-	66,300	647,073.49	539,682.00	-
600545	新疆城建	2016年5月31日	重大事项停牌	6.91	-	-	62,900	687,965.13	434,639.00	-
600321	国栋建设	2016年5月	重大事项停牌	4.02	-	-	106,700	524,683.10	428,934.00	-

		6 日								
600318	新力金融	2016 年 3 月 24 日	重大 事项 停牌	26.84	-	-	15,900	401,596.00	426,756.00	-
600636	三爱富	2016 年 5 月 9 日	重大 事项 停牌	13.86	-	-	30,030	398,800.58	416,215.80	-
600173	卧龙地产	2016 年 4 月 25 日	重大 事项 停牌	8.28	-	-	50,100	308,940.79	414,828.00	-
600640	号百控股	2016 年 4 月 18 日	重大 事项 停牌	16.79	2016 年 8 月 22 日	18.44	23,700	454,148.16	397,923.00	-
600295	鄂尔多斯	2016 年 6 月 30 日	重大 事项 停牌	7.89	2016 年 7 月 14 日	8.46	28,673	223,306.73	226,229.97	-

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，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。监察稽核部和风险管理部对公司总经理负责。

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

6.4.10.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2015 年 12 月 31 日：同）。

6.4.10.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险来自调整基金投资

组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.8 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所持有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(2015 年 12 月 31 日：同)。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.10.4 市场风险

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

6.4.10.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金等，其余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。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,762,361.38	-	-	-	2,762,361.38
存出保证金	2,564.31	-	-	-	2,564.31
交易性金融资产	-	-	-	259,432,922.34	259,432,922.34
应收利息	-	-	-	526.87	526.87
其他资产	-	-	-	78,866.48	78,866.48
资产总计	2,764,925.69	-	-	259,512,315.69	262,277,241.38
负债					

应付证券清算款	-	-	-	2,813.59	2,813.59
应付管理人报酬	-	-	-	105,622.54	105,622.54
应付托管费	-	-	-	21,124.52	21,124.52
应付交易费用	-	-	-	7,520.92	7,520.92
其他负债	-	-	-	239,479.70	239,479.70
负债总计	-	-	-	376,561.27	376,561.27
利率敏感度缺口	2,764,925.69	-	-	-259,135,754.42	261,900,680.11
上年度末 2015 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	4,881,156.41	-	-	-	4,881,156.41
结算备付金	94,431.25	-	-	-	94,431.25
存出保证金	68,397.54	-	-	-	68,397.54
交易性金融资产	-	-	-	301,942,431.60	301,942,431.60
应收证券清算款	-	-	-	58,245.22	58,245.22
应收利息	-	-	-	1,156.36	1,156.36
资产总计	5,043,985.20	-	-	-302,001,833.18	307,045,818.38
负债					
应付证券清算款	-	-	-	123,843.00	123,843.00
应付管理人报酬	-	-	-	133,831.12	133,831.12
应付托管费	-	-	-	26,766.25	26,766.25
应付交易费用	-	-	-	11,727.77	11,727.77
其他负债	-	-	-	261,705.71	261,705.71
负债总计	-	-	-	557,873.85	557,873.85
利率敏感度缺口	5,043,985.20	-	-	-301,443,959.33	306,487,944.53

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

6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.4.3 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 指数指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	259,432,922.34	99.06	301,942,431.60	98.52
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	259,432,922.34	99.06	301,942,431.60	98.52

6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	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：人民币万元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 1,297	增加约 1,578
2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 1,297	减少约 1,578	

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	259,432,922.34	98.92
	其中：股票	259,432,922.34	98.92
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,762,361.38	1.05
7	其他各项资产	81,957.66	0.03
8	合计	262,277,241.38	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	913,051.40	0.35
B	采矿业	14,085,848.84	5.38
C	制造业	152,551,143.80	58.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,337,745.95	5.09
E	建筑业	7,686,115.62	2.93
F	批发和零售业	19,965,395.57	7.62
G	交通运输、仓储和邮政业	16,874,195.33	6.44
H	住宿和餐饮业	733,643.96	0.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,576,246.89	4.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	8,371,417.91	3.20
L	租赁和商务服务业	1,653,974.16	0.63
M	科学研究和技术服务业	1,273,801.00	0.49
N	水利、环境和公共设施管理业	1,123,990.54	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	412,453.94	0.16
Q	卫生和社会工作	676,606.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	4,508,836.58	1.72

S	综合	4,688,454.85	1.79
	合计	259,432,922.34	99.06

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600584	长电科技	116,284	2,359,402.36	0.90
2	600867	通化东宝	107,100	2,215,899.00	0.85
3	600309	万华化学	121,800	2,107,140.00	0.80
4	600718	东软集团	111,500	2,042,680.00	0.78
5	600522	DR 中天科	206,000	2,018,800.00	0.77
6	600201	生物股份	64,362	1,759,013.46	0.67
7	600654	中安消	93,100	1,726,074.00	0.66
8	600398	海澜之家	151,242	1,709,034.60	0.65
9	600521	华海药业	69,388	1,687,516.16	0.64
10	600525	长园集团	118,385	1,639,632.25	0.63
11	600682	南京新百	55,776	1,587,942.72	0.61
12	601012	隆基股份	119,455	1,558,887.75	0.60
13	600436	片仔癀	33,795	1,521,112.95	0.58
14	600699	均胜电子	38,900	1,489,870.00	0.57
15	600642	申能股份	255,444	1,466,248.56	0.56
16	600879	航天电子	93,700	1,459,846.00	0.56
17	601098	中南传媒	80,600	1,459,666.00	0.56
18	600256	广汇能源	353,000	1,447,300.00	0.55
19	600166	福田汽车	262,000	1,446,240.00	0.55
20	601238	广汽集团	61,560	1,446,044.40	0.55
21	600549	厦门钨业	48,500	1,440,935.00	0.55
22	600498	烽火通信	58,700	1,425,236.00	0.54
23	600482	中国动力	43,412	1,422,611.24	0.54
24	600664	哈药股份	167,869	1,391,634.01	0.53
25	600122	宏图高科	103,600	1,386,168.00	0.53
26	603019	中科曙光	33,700	1,341,934.00	0.51
27	600635	大众公用	221,512	1,335,717.36	0.51

28	600143	金发科技	201,117	1,295,193.48	0.49
29	601021	春秋航空	26,900	1,289,586.00	0.49
30	600373	中文传媒	62,100	1,288,575.00	0.49
31	601168	西部矿业	211,974	1,257,005.82	0.48
32	600138	中青旅	65,013	1,256,051.16	0.48
33	600418	江淮汽车	98,900	1,254,052.00	0.48
34	600487	亨通光电	98,337	1,237,079.46	0.47
35	600170	上海建工	320,200	1,226,366.00	0.47
36	600673	东阳光科	193,992	1,212,450.00	0.46
37	600388	龙净环保	96,007	1,205,847.92	0.46
38	600312	平高电气	76,596	1,199,493.36	0.46
39	600200	江苏吴中	60,300	1,168,011.00	0.45
40	600497	驰宏锌锗	115,400	1,150,538.00	0.44
41	600172	黄河旋风	62,240	1,147,083.20	0.44
42	600594	益佰制药	71,126	1,136,593.48	0.43
43	600410	华胜天成	100,844	1,131,469.68	0.43
44	600435	北方导航	84,000	1,118,040.00	0.43
45	600038	中直股份	26,433	1,096,440.84	0.42
46	601992	金隅股份	140,900	1,091,975.00	0.42
47	600687	刚泰控股	66,740	1,085,192.40	0.41
48	600884	杉杉股份	63,000	1,084,230.00	0.41
49	600811	东方集团	161,050	1,072,593.00	0.41
50	600499	科达洁能	63,400	1,072,094.00	0.41
51	600601	方正科技	246,300	1,059,090.00	0.40
52	600500	中化国际	116,900	1,056,776.00	0.40
53	600008	首创股份	270,500	1,052,245.00	0.40
54	600171	上海贝岭	60,520	1,051,232.40	0.40
55	600366	宁波韵升	43,900	1,047,893.00	0.40
56	600176	中国巨石	109,248	1,045,503.36	0.40
57	600755	厦门国贸	130,788	1,039,764.60	0.40
58	603000	人民网	62,000	1,029,820.00	0.39
59	600343	航天动力	43,000	1,022,540.00	0.39
60	600711	盛屯矿业	135,300	1,001,220.00	0.38
61	600391	成发科技	25,900	995,855.00	0.38
62	600881	亚泰集团	204,224	984,359.68	0.38
63	600863	内蒙华电	325,878	984,151.56	0.38
64	600651	飞乐音响	77,386	979,706.76	0.37
65	600216	浙江医药	73,535	969,926.65	0.37
66	600611	大众交通	140,326	955,620.06	0.36

67	603766	隆鑫通用	47,077	951,896.94	0.36
68	600528	中铁二局	81,900	950,859.00	0.36
69	601311	骆驼股份	47,800	948,830.00	0.36
70	600667	太极实业	93,595	935,014.05	0.36
71	600990	四创电子	10,776	934,171.44	0.36
72	603288	海天味业	30,400	924,160.00	0.35
73	600885	宏发股份	29,900	918,229.00	0.35
74	600787	中储股份	123,400	916,862.00	0.35
75	600572	康恩贝	140,872	912,850.56	0.35
76	600600	青岛啤酒	31,157	905,733.99	0.35
77	600056	中国医药	56,860	901,799.60	0.34
78	600666	奥瑞德	25,900	900,284.00	0.34
79	600988	赤峰黄金	48,100	897,065.00	0.34
80	601880	大连港	150,950	892,114.50	0.34
81	600562	国睿科技	25,985	891,025.65	0.34
82	600206	有研新材	66,200	890,390.00	0.34
83	601958	金铂股份	108,700	885,905.00	0.34
84	601699	潞安环能	135,200	884,208.00	0.34
85	600597	光明乳业	69,300	878,724.00	0.34
86	600426	华鲁恒升	97,848	862,040.88	0.33
87	600260	凯乐科技	52,600	860,536.00	0.33
88	600348	阳泉煤业	135,000	859,950.00	0.33
89	601058	赛轮金宇	257,440	859,849.60	0.33
90	600511	国药股份	31,025	850,705.50	0.32
91	600422	昆药集团	61,952	845,025.28	0.32
92	600073	上海梅林	73,740	844,323.00	0.32
93	600017	日照港	207,100	838,755.00	0.32
94	600582	天地科技	185,760	835,920.00	0.32
95	601877	正泰电器	44,269	834,470.65	0.32
96	601777	力帆股份	70,518	829,996.86	0.32
97	600536	中国软件	33,294	829,686.48	0.32
98	600648	外高桥	41,900	825,849.00	0.32
99	600298	安琪酵母	46,273	825,510.32	0.32
100	600717	天津港	94,300	819,467.00	0.31
101	600380	健康元	89,095	817,892.10	0.31
102	600571	信雅达	14,782	814,783.84	0.31
103	600580	卧龙电气	72,382	811,402.22	0.31
104	601808	中海油服	66,700	810,405.00	0.31
105	600039	四川路桥	204,886	807,250.84	0.31

106	600161	天坛生物	29,000	805,910.00	0.31
107	600557	康缘药业	48,527	792,445.91	0.30
108	600267	海正药业	65,060	790,479.00	0.30
109	600210	紫江企业	136,800	787,968.00	0.30
110	600967	北方创业	73,892	785,471.96	0.30
111	601231	环旭电子	73,326	784,588.20	0.30
112	600120	浙江东方	35,699	775,025.29	0.30
113	600871	石化油服	201,800	774,912.00	0.30
114	600872	中炬高新	62,605	772,545.70	0.30
115	600756	浪潮软件	25,400	764,540.00	0.29
116	600765	中航重机	52,400	763,992.00	0.29
117	600694	大商股份	19,773	761,655.96	0.29
118	603369	今世缘	56,350	756,217.00	0.29
119	600175	美都能源	160,616	754,895.20	0.29
120	601010	XD 文峰股	145,088	753,006.72	0.29
121	600183	生益科技	80,660	747,718.20	0.29
122	600730	中国高科	52,700	744,651.00	0.28
123	600970	中材国际	118,180	744,534.00	0.28
124	600169	太原重工	190,400	742,560.00	0.28
125	600662	强生控股	70,900	742,323.00	0.28
126	600433	冠豪高新	85,900	742,176.00	0.28
127	600062	华润双鹤	40,566	739,112.52	0.28
128	600587	新华医疗	31,906	736,709.54	0.28
129	600086	东方金钰	76,000	735,680.00	0.28
130	600736	苏州高新	80,427	734,298.51	0.28
131	600754	锦江股份	21,926	733,643.96	0.28
132	600416	湘电股份	58,400	728,248.00	0.28
133	600517	置信电气	76,056	723,292.56	0.28
134	600869	智慧能源	70,174	722,792.20	0.28
135	601689	拓普集团	21,900	721,605.00	0.28
136	600783	鲁信创投	33,385	721,449.85	0.28
137	600567	山鹰纸业	253,647	720,357.48	0.28
138	600098	广州发展	91,874	718,454.68	0.27
139	601000	唐山港	183,825	713,241.00	0.27
140	600537	亿晶光电	92,402	712,419.42	0.27
141	600363	联创光电	39,900	710,619.00	0.27
142	600289	亿阳信通	50,775	710,342.25	0.27
143	600270	外运发展	40,598	710,059.02	0.27
144	600566	济川药业	27,500	707,850.00	0.27

145	600559	老白干酒	29,432	705,190.72	0.27
146	600685	中船防务	27,800	705,008.00	0.27
147	600993	马应龙	33,808	704,220.64	0.27
148	600458	时代新材	45,040	701,723.20	0.27
149	603188	亚邦股份	39,000	700,440.00	0.27
150	601222	林洋能源	16,735	700,359.75	0.27
151	600409	三友化工	103,761	699,349.14	0.27
152	600277	亿利洁能	117,288	697,863.60	0.27
153	600495	晋西车轴	94,888	695,529.04	0.27
154	600835	上海机电	36,190	694,486.10	0.27
155	600261	阳光照明	97,812	690,552.72	0.26
156	600255	鑫科材料	158,900	689,626.00	0.26
157	600563	法拉电子	15,127	688,581.04	0.26
158	600729	重庆百货	27,370	678,776.00	0.26
159	600763	通策医疗	21,700	676,606.00	0.26
160	600850	华东电脑	23,530	675,075.70	0.26
161	600650	锦江投资	22,300	674,575.00	0.26
162	600578	京能电力	156,100	668,108.00	0.26
163	600862	中航高科	47,100	667,878.00	0.26
164	600460	士兰微	83,945	665,683.85	0.25
165	600805	悦达投资	76,360	662,804.80	0.25
166	600399	抚顺特钢	102,100	660,587.00	0.25
167	600337	美克家居	50,620	658,566.20	0.25
168	600323	瀚蓝环境	51,577	654,512.13	0.25
169	600125	铁龙物流	102,548	653,230.76	0.25
170	600894	广日股份	49,000	653,170.00	0.25
171	603118	共进股份	16,000	651,040.00	0.25
172	600284	浦东建设	62,272	650,119.68	0.25
173	600634	中技控股	44,700	644,127.00	0.25
174	600750	江中药业	20,207	642,582.60	0.25
175	600112	天成控股	57,196	638,307.36	0.24
176	600004	白云机场	51,621	632,873.46	0.24
177	600351	亚宝药业	61,833	620,184.99	0.24
178	601717	郑煤机	108,700	619,590.00	0.24
179	600826	兰生股份	23,603	617,926.54	0.24
180	600859	王府井	40,448	616,427.52	0.24
181	600823	世茂股份	90,600	615,174.00	0.23
182	600459	贵研铂业	20,573	614,721.24	0.23
183	600527	江南高纤	89,998	613,786.36	0.23

184	600395	盘江股份	74,300	613,718.00	0.23
185	600552	凯盛科技	30,150	610,236.00	0.23
186	600491	龙元建设	71,100	610,038.00	0.23
187	600116	三峡水利	77,950	606,451.00	0.23
188	600438	通威股份	95,100	604,836.00	0.23
189	600502	安徽水利	81,490	600,581.30	0.23
190	603609	禾丰牧业	37,300	590,459.00	0.23
191	601890	亚星锚链	64,900	589,941.00	0.23
192	600612	老凤祥	14,433	589,588.05	0.23
193	600641	万业企业	45,200	586,244.00	0.22
194	600400	红豆股份	63,900	580,212.00	0.22
195	600668	XD 尖峰集	38,680	579,426.40	0.22
196	600106	重庆路桥	81,806	579,186.48	0.22
197	600420	现代制药	19,350	578,565.00	0.22
198	600496	精工钢构	135,617	577,728.42	0.22
199	600285	羚锐制药	53,377	575,937.83	0.22
200	600626	XD 申达股	55,800	575,856.00	0.22
201	600831	广电网络	44,250	573,480.00	0.22
202	603308	应流股份	22,800	573,192.00	0.22
203	600063	皖维高新	129,300	572,799.00	0.22
204	600486	扬农化工	20,867	571,755.80	0.22
205	600269	赣粤高速	131,000	569,850.00	0.22
206	600185	格力地产	91,200	566,352.00	0.22
207	600628	新世界	47,787	563,886.60	0.22
208	600775	南京熊猫	37,700	563,615.00	0.22
209	600012	皖通高速	39,312	561,768.48	0.21
210	600300	维维股份	93,800	557,172.00	0.21
211	603508	思维列控	5,600	556,696.00	0.21
212	603368	柳州医药	6,400	555,648.00	0.21
213	600846	同济科技	56,124	555,627.60	0.21
214	600292	远达环保	43,780	554,692.60	0.21
215	600577	精达股份	132,400	553,432.00	0.21
216	600123	兰花科创	76,900	552,142.00	0.21
217	600236	桂冠电力	81,700	549,024.00	0.21
218	603077	和邦生物	111,470	548,432.40	0.21
219	603899	晨光文具	30,742	544,133.40	0.21
220	601666	平煤股份	132,511	541,969.99	0.21
221	600428	中远航运	96,323	540,372.03	0.21
222	600614	鼎立股份	66,300	539,682.00	0.21

223	601886	江河集团	51,814	532,129.78	0.20
224	600405	动力源	39,400	529,536.00	0.20
225	600114	东睦股份	31,381	527,514.61	0.20
226	600509	天富能源	71,200	523,320.00	0.20
227	600282	南钢股份	222,300	522,405.00	0.20
228	600273	嘉化能源	58,600	522,126.00	0.20
229	600481	双良节能	90,946	521,120.58	0.20
230	600624	复旦复华	41,330	520,758.00	0.20
231	600180	瑞茂通	34,200	516,762.00	0.20
232	601908	京运通	67,200	515,424.00	0.20
233	601001	大同煤业	94,071	505,161.27	0.19
234	600794	保税科技	93,560	502,417.20	0.19
235	601069	西部黄金	21,500	499,015.00	0.19
236	601799	星宇股份	10,800	494,856.00	0.19
237	600824	益民集团	82,879	494,787.63	0.19
238	600586	金晶科技	114,600	492,780.00	0.19
239	600033	福建高速	154,000	488,180.00	0.19
240	600761	安徽合力	48,365	488,002.85	0.19
241	603328	依顿电子	16,500	487,410.00	0.19
242	600297	广汇汽车	55,600	484,276.00	0.18
243	600188	XD 兖州煤	44,254	484,138.76	0.18
244	601126	四方股份	45,610	480,273.30	0.18
245	600965	福成股份	36,730	476,755.40	0.18
246	601801	皖新传媒	40,800	476,136.00	0.18
247	600742	一汽富维	38,100	475,869.00	0.18
248	600526	菲达环保	36,900	475,272.00	0.18
249	601678	滨化股份	93,310	474,947.90	0.18
250	600621	华鑫股份	47,100	471,942.00	0.18
251	601369	陕鼓动力	73,626	469,733.88	0.18
252	603806	福斯特	9,000	469,710.00	0.18
253	600720	祁连山	69,641	467,291.11	0.18
254	600305	恒顺醋业	40,500	466,560.00	0.18
255	600825	新华传媒	58,550	465,472.50	0.18
256	600377	宁沪高速	55,750	464,955.00	0.18
257	601002	晋亿实业	53,400	464,580.00	0.18
258	600007	中国国贸	22,973	464,054.60	0.18
259	601700	风范股份	63,650	464,008.50	0.18
260	600479	千金药业	27,450	463,630.50	0.18
261	600748	上实发展	48,000	462,720.00	0.18

262	600551	时代出版	23,100	461,076.00	0.18
263	601233	桐昆股份	41,439	450,027.54	0.17
264	600776	东方通信	53,612	449,804.68	0.17
265	600387	海越股份	34,700	448,671.00	0.17
266	603699	纽威股份	25,263	448,165.62	0.17
267	603883	老百姓	9,000	447,660.00	0.17
268	600020	中原高速	100,953	446,212.26	0.17
269	600501	航天晨光	24,150	444,360.00	0.17
270	600596	新安股份	60,949	444,318.21	0.17
271	600195	中牧股份	24,116	441,322.80	0.17
272	600329	中新药业	25,495	440,298.65	0.17
273	603686	龙马环卫	12,000	437,640.00	0.17
274	600480	凌云股份	31,000	437,100.00	0.17
275	600257	大湖股份	39,200	436,296.00	0.17
276	600280	中央商场	64,456	435,722.56	0.17
277	600545	新疆城建	62,900	434,639.00	0.17
278	600396	金山股份	82,708	433,389.92	0.17
279	600676	交运股份	48,518	433,265.74	0.17
280	600987	航民股份	35,700	432,684.00	0.17
281	603169	兰石重装	34,500	429,870.00	0.16
282	600386	北巴传媒	22,989	428,974.74	0.16
283	600321	国栋建设	106,700	428,934.00	0.16
284	600135	乐凯胶片	25,100	427,202.00	0.16
285	600318	新力金融	15,900	426,756.00	0.16
286	603008	喜临门	24,800	426,312.00	0.16
287	603600	永艺股份	7,100	426,000.00	0.16
288	600657	信达地产	85,500	425,790.00	0.16
289	603567	珍宝岛	19,400	423,890.00	0.16
290	601515	东风股份	37,460	423,298.00	0.16
291	600251	XD冠农股	52,800	422,400.00	0.16
292	600439	瑞贝卡	74,150	420,430.50	0.16
293	600684	珠江实业	55,900	419,809.00	0.16
294	600818	中路股份	13,400	416,874.00	0.16
295	600636	三爱富	30,030	416,215.80	0.16
296	601158	重庆水务	64,700	416,021.00	0.16
297	600173	卧龙地产	50,100	414,828.00	0.16
298	601208	东材科技	48,550	414,131.50	0.16
299	600864	哈投股份	36,800	413,264.00	0.16
300	600661	新南洋	14,699	412,453.94	0.16

301	600141	兴发集团	35,700	411,264.00	0.16
302	600973	宝胜股份	52,000	409,760.00	0.16
303	603885	吉祥航空	15,600	409,500.00	0.16
304	601218	吉鑫科技	77,900	408,196.00	0.16
305	600350	山东高速	75,550	400,415.00	0.15
306	600640	号百控股	23,700	397,923.00	0.15
307	600483	福能股份	34,800	394,980.00	0.15
308	601139	深圳燃气	48,900	391,200.00	0.15
309	600239	云南城投	84,080	390,131.20	0.15
310	600803	新奥股份	33,300	388,944.00	0.15
311	600874	创业环保	50,050	388,888.50	0.15
312	600743	华远地产	81,595	385,944.35	0.15
313	603128	华贸物流	39,300	385,533.00	0.15
314	600310	桂东电力	46,700	383,407.00	0.15
315	601789	宁波建工	66,000	381,480.00	0.15
316	603698	航天工程	13,800	378,672.00	0.14
317	600054	黄山旅游	23,466	377,567.94	0.14
318	600617	国新能源	32,800	375,888.00	0.14
319	600708	光明地产	44,400	372,516.00	0.14
320	600197	伊力特	24,750	372,240.00	0.14
321	600119	长江投资	24,100	366,079.00	0.14
322	601636	旗滨集团	113,303	360,303.54	0.14
323	600326	西藏天路	44,800	359,296.00	0.14
324	600335	国机汽车	32,025	359,000.25	0.14
325	600888	新疆众和	50,392	358,791.04	0.14
326	600088	中视传媒	15,089	357,911.08	0.14
327	601107	四川成渝	72,827	356,852.30	0.14
328	601226	华电重工	38,900	356,713.00	0.14
329	603939	益丰药房	10,900	355,558.00	0.14
330	603555	贵人鸟	13,900	346,527.00	0.13
331	600397	安源煤业	77,800	343,876.00	0.13
332	600801	华新水泥	54,363	343,030.53	0.13
333	600162	香江控股	81,615	341,966.85	0.13
334	600814	杭州解百	32,100	339,939.00	0.13
335	600468	百利电气	23,670	334,930.50	0.13
336	600830	香溢融通	35,700	334,866.00	0.13
337	603306	华懋科技	9,650	332,249.50	0.13
338	601313	江南嘉捷	22,794	330,057.12	0.13
339	601199	江南水务	41,948	326,355.44	0.12

340	600697	欧亚集团	10,735	318,400.10	0.12
341	603898	好莱客	10,100	314,009.00	0.12
342	600327	大东方	35,150	313,538.00	0.12
343	600381	ST 春天	22,900	313,501.00	0.12
344	600168	武汉控股	31,700	309,392.00	0.12
345	600101	明星电力	25,420	307,327.80	0.12
346	600510	黑牡丹	35,220	307,118.40	0.12
347	601567	三星医疗	20,725	305,693.75	0.12
348	603979	金诚信	12,700	304,673.00	0.12
349	603126	中材节能	27,400	301,948.00	0.12
350	600449	宁夏建材	32,192	290,371.84	0.11
351	601968	宝钢包装	28,100	288,306.00	0.11
352	600507	方大特钢	59,550	285,840.00	0.11
353	600897	厦门空港	13,399	280,843.04	0.11
354	600845	宝信软件	12,474	278,294.94	0.11
355	600278	东方创业	17,600	273,680.00	0.10
356	601969	海南矿业	24,300	272,646.00	0.10
357	603818	曲美家居	16,400	262,400.00	0.10
358	603669	灵康药业	8,800	255,464.00	0.10
359	600548	深高速	32,100	250,059.00	0.10
360	603589	口子窖	6,800	246,228.00	0.09
361	603338	浙江鼎力	5,300	244,330.00	0.09
362	601015	陕西黑猫	20,900	241,813.00	0.09
363	600981	汇鸿集团	28,600	241,098.00	0.09
364	603168	莎普爱思	5,402	237,688.00	0.09
365	603599	广信股份	12,600	236,502.00	0.09
366	600629	华建集团	12,400	236,468.00	0.09
367	600613	神奇制药	16,200	231,660.00	0.09
368	603866	桃李面包	5,100	228,276.00	0.09
369	600081	东风科技	14,000	226,380.00	0.09
370	600295	鄂尔多斯	28,673	226,229.97	0.09
371	601016	节能风电	22,500	223,425.00	0.09
372	601368	绿城水务	16,500	216,975.00	0.08
373	603355	莱克电气	5,400	205,740.00	0.08
374	600917	重庆燃气	20,000	199,000.00	0.08
375	601038	一拖股份	20,800	196,976.00	0.08
376	603568	伟明环保	8,300	191,730.00	0.07
377	603025	大豪科技	5,600	187,992.00	0.07
378	603997	继峰股份	9,500	187,530.00	0.07

379	603116	红蜻蜓	7,290	172,627.20	0.07
380	600623	华谊集团	8,649	171,336.69	0.07
381	600828	茂业商业	21,830	148,444.00	0.06

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	600867	通化东宝	2,291,957.60	0.75
2	600718	东软集团	2,030,615.10	0.66
3	600309	万华化学	2,020,350.00	0.66
4	600654	中安消	1,667,622.00	0.54
5	600256	广汇能源	1,557,772.00	0.51
6	600879	航天电子	1,380,384.00	0.45
7	600373	中文传媒	1,347,288.00	0.44
8	600170	上海建工	1,246,661.32	0.41
9	600418	江淮汽车	1,200,933.86	0.39
10	601992	金隅股份	1,184,319.00	0.39
11	600699	均胜电子	1,175,055.00	0.38
12	600978	宜华生活	1,053,594.00	0.34
13	600435	北方导航	982,180.00	0.32
14	600682	南京新百	978,153.24	0.32
15	600597	光明乳业	895,226.00	0.29
16	600717	天津港	869,639.00	0.28
17	601808	中海油服	868,651.00	0.28
18	600433	冠豪高新	805,759.50	0.26
19	600871	石化油服	796,284.00	0.26
20	600260	凯乐科技	776,555.00	0.25

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	600009	上海机场	3,154,717.83	1.03
2	601888	中国国旅	2,078,055.65	0.68
3	600446	金证股份	1,992,093.74	0.65
4	600079	人福医药	1,803,997.29	0.59
5	600978	宜华生活	1,558,939.86	0.51
6	600655	豫园商城	1,308,280.38	0.43
7	600565	迪马股份	1,130,631.00	0.37
8	600160	巨化股份	1,113,534.24	0.36
9	600026	中海发展	1,018,803.44	0.33
10	600058	五矿发展	1,001,368.40	0.33
11	600704	物产中大	983,330.36	0.32
12	600307	酒钢宏兴	941,111.12	0.31
13	600880	博瑞传播	805,719.60	0.26
14	600694	大商股份	577,485.00	0.19
15	600059	古越龙山	564,235.50	0.18
16	600963	岳阳林纸	530,252.30	0.17
17	600790	轻纺城	519,478.53	0.17
18	600132	重庆啤酒	461,870.48	0.15
19	600995	文山电力	457,873.50	0.15
20	600784	鲁银投资	449,051.44	0.15

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	44,121,350.99
卖出股票收入（成交）总额	38,251,891.96

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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投资。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1**

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	2,564.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	526.87
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	78,866.48
8	其他	-
9	合计	81,957.66

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600654	中安消	1,726,074.00	0.66	重大事项停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 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
1,179	151,356.16	155,080,928.00	86.90%	23,367,987.00	13.10%

8.1.2 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	142,399,941.00	79.80%

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。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	方正证券股份有限公司	2,272,023.00	1.27%
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	1.08%
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	0.90%
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	0.88%
5	中国石油化工集团公司企业年金计划－中国工商银行股份有限公司	1,397,600.00	0.78%
6	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	0.68%
7	胡海燕	1,073,900.00	0.60%
8	徐志焯	705,200.00	0.40%
9	北京无限立通通讯技术有限责任公司	609,600.00	0.34%
10	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	0.32%
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	142,399,941.00	79.80%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本公司的所有从业人员均未持有本基金份额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	166,448,915.00
本报告期基金总申购份额	60,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	48,000,000.00
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	178,448,915.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人没有发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	82,373,242.95	100.00%	8,237.44	100.00%	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
诚浩证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、为节约交易单元资源，我公司在交易所交易系统升级的基础上，对同一银行托管基金进行了席位整合。

2、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

- a、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- b、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；
- c、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- d、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交易单元：

- a、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；
- b、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；
- c、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
银河证券	518,165.90	100.00%	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
诚浩证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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（2016 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 21 日
2	上证 380 交易型开放式指数证券	中国证券报、上海	2016 年 4 月 21 日

	投资基金招募说明书（更新） （2016 年第 1 号）	证券报、证券时报	
3	关于淘宝基金理财平台和支付宝 基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 4 月 12 日
4	关于上证 380 交易型开放式指数 证券投资基金变更基金经理的公 告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 3 月 5 日
5	南方基金关于临时暂停电子直销 实时赎回业务的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 2 月 4 日
6	南方基金管理有限公司电子交易 赎回转认/申购业务规则	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 1 月 27 日
7	南方基金关于电子直销平台通过 货币基金定投其他基金费率为 0 的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 1 月 15 日
8	南方基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 7 日指数熔断实施期 间调整旗下部分基金开放时间的 公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 1 月 7 日
9	南方基金管理有限公司关于在指 数熔断实施期间调整旗下交易所 场内基金开放时间的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 1 月 5 日
10	南方基金管理有限公司关于在指 数熔断实施期间调整旗下部分基 金开放时间的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 1 月 4 日
11	南方基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 4 日指数熔断实施期 间调整旗下部分基金开放时间的 公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报	2016 年 1 月 4 日

§11 备查文件目录

11.1 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、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告

11.2 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

11.3 查阅方式

网站: <http://www.nffund.com>