

# 上证380交易型开放式指数证券投资基金2 017年年度报告摘要

2017年12月31日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018年03月29日

## 重要提示

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告期自2017年1月1日起至12月31日止。

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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

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

### 2.2 基金产品说明

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

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	常克川	田青
	联系电话	0755-82763888	010-67595096
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-8899	010-67595096
传真		0755-82763889	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年1月1日-2017年12月31日）	报告期（2016年1月1日-2016年12月31日）	报告期（2015年1月1日-2015年12月31日）
本期已实现收益	12,774,974.42	-9,864,698.88	-5,583,915.32
本期利润	12,857,370.03	-48,964,055.37	8,241,848.33
加权平均基金份额本期利润	0.0815	-0.2746	0.0416
本期基金份额净值增长率	4.54%	-16.41%	38.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2017年12月31日)	报告期(2016年12月31日)	报告期(2015年12月31日)
期末可供分配基金份额利润	0.4663	0.3848	0.4374
期末基金资产净值	229,185,540.86	259,253,426.09	306,487,944.53
期末基金份额净值	1.6089	1.5391	1.8413

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

2. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（

为期末余额，不是当期发生数）。

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

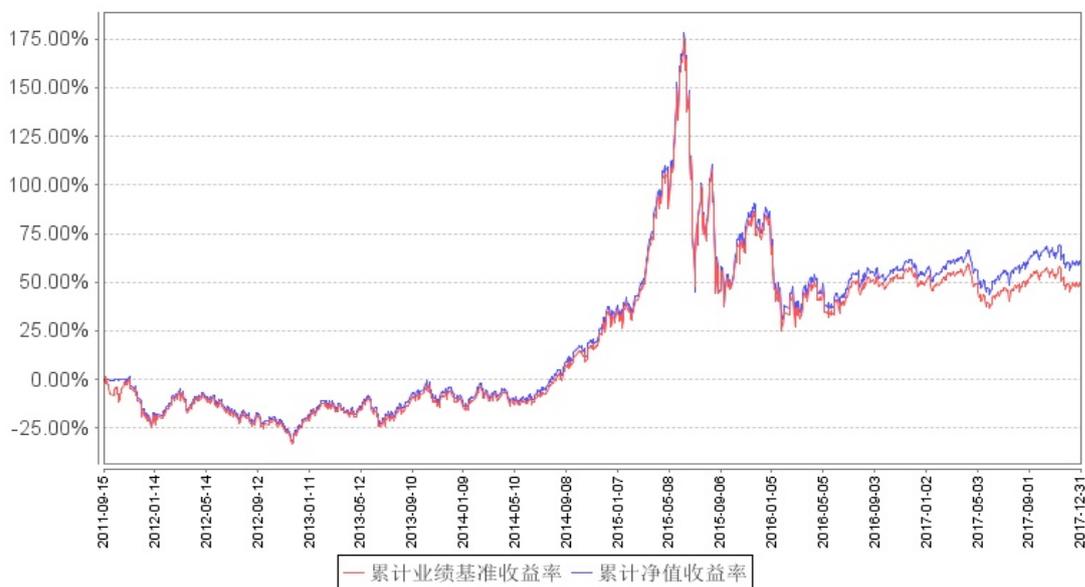
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	-2.48%	0.97%	-3.04%	0.98%	0.56%	-0.01%
过去六个月	3.99%	0.90%	2.56%	0.91%	1.43%	-0.01%
过去一年	4.54%	0.87%	0.56%	0.88%	3.98%	-0.01%
过去三年	20.81%	2.15%	14.52%	2.11%	6.29%	0.04%
过去五年	100.04%	1.85%	89.26%	1.82%	10.78%	0.03%
自基金合同 生效起至今	60.89%	1.76%	49.79%	1.75%	11.10%	0.01%

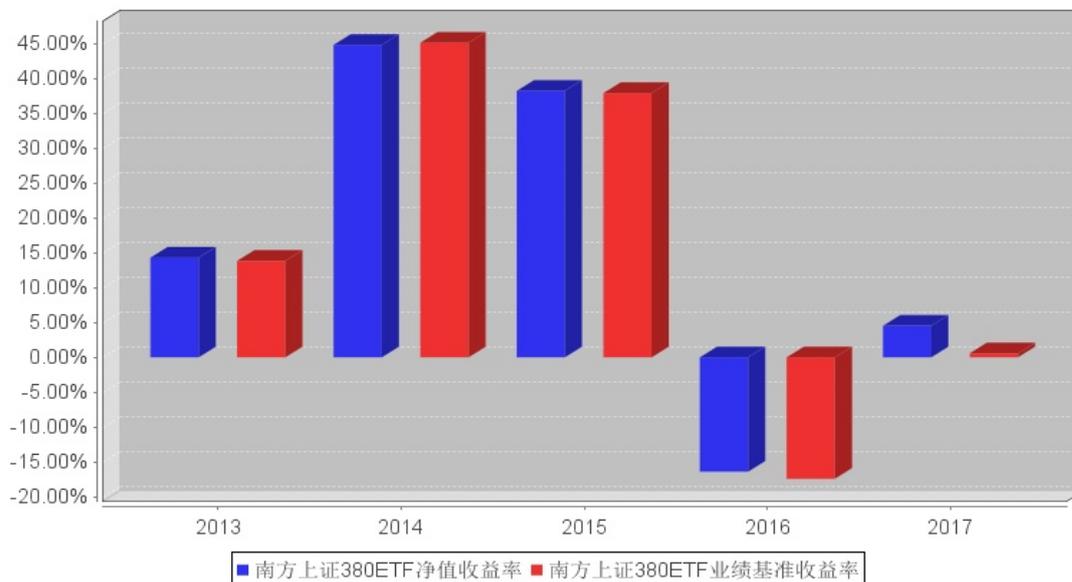
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方上证380ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方上证380ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018年1月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司，注册资本金3亿元人民币。目前股权结构：华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——

南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超7,200亿元，旗下管理153只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金和专户理财投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《上证380交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤

勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为5次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数型基金成份股调整所致，相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内上证380指数上涨0.56%。期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”、“ETF现金流精算系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管

理流程，确保了本ETF基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

- （1）申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- （2）报告期内指数成份股（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离。
- （3）根据指数每半年度成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017年市场风格变化明显，大盘蓝筹股受到投资者持续追捧，而中小盘股票整体表现羸弱，展望2018年，尽管市场风格预计仍然会持续一定的时间，不过随着大盘蓝筹股的大幅上涨，其估值优势正在逐步降低，同时国内外经济企稳，国内还处于经济转型关键时期，预计权益市场总体仍将保持稳健态势。

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

#### 4.6 管理人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

#### 4.7 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，本报告期本基金未有分配事项。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

本基金2017年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2018)第22836号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：上证380交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	718,834.32	1,118,075.39
结算备付金		22,422.87	-
存出保证金		3,067.75	1,515.33
交易性金融资产	7.4.7.2	228,984,511.45	258,604,736.46
其中：股票投资		228,835,511.45	258,604,736.46
基金投资		-	-
债券投资		149,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	15,940.01
应收利息	7.4.7.5	165.14	246.34
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		229,729,001.53	259,740,513.53

负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
<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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		96,468.19	111,569.45
应付托管费		19,293.65	22,313.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,896.43	63,248.25
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	421,802.40	289,955.86
负债合计		543,460.67	487,087.44
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	142,448,915.00	168,448,915.00
未分配利润	7.4.7.10	86,736,625.86	90,804,511.09
所有者权益合计		229,185,540.86	259,253,426.09
负债和所有者权益总计		229,729,001.53	259,740,513.53

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

## 7.2 利润表

会计主体: 上证380交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2017年1月1日 至 2017年12月31日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2017年1月1日 至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日 至 2016年12月31日
一、收入		15,118,478.54	-46,524,445.19
1. 利息收入		16,418.13	28,988.19
其中: 存款利息收入	7.4.7.11	16,361.94	28,880.00
债券利息收入		56.19	108.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		14,982,039.45	-7,391,606.63
其中：股票投资收益	7.4.7.12	12,140,788.67	-9,656,216.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	39,216.36	66,057.71
资产支持证券投资 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	2,802,034.42	2,198,552.36
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	82,395.61	-39,099,356.49
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	37,625.35	-62,470.26
减：二、费用		2,261,108.51	2,439,610.18
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,248,374.56	1,331,975.38
2. 托管费	7.4.10.2.2	249,674.89	266,395.10
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	115,603.23	159,654.08
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	647,455.83	681,585.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,857,370.03	-48,964,055.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,857,370.03	-48,964,055.37

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证380交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权	168,448,915.00	90,804,511.09	259,253,426.09

益（基金净值）			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	12,857,370.03	12,857,370.03
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-26,000,000.00	-16,925,255.26	-42,925,255.26
其中：1. 基金申购款	78,000,000.00	46,780,570.71	124,780,570.71
2. 基金赎回款	-104,000,000.00	-63,705,825.97	-167,705,825.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	142,448,915.00	86,736,625.86	229,185,540.86
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	166,448,915.00	140,039,029.53	306,487,944.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-48,964,055.37	-48,964,055.37
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,000,000.00	-270,463.07	1,729,536.93
其中：1. 基金申购款	68,000,000.00	30,424,524.20	98,424,524.20
2. 基金赎回款	-66,000,000.00	-30,694,987.27	-96,694,987.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者权益（基金净值）	168,448,915.00	90,804,511.09	259,253,426.09
-----------------	----------------	---------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

<u>杨小松</u>	<u>徐超</u>	<u>徐超</u>
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 会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相一致的说明

#### 7.4.1.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.1.2 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。

#### 7.4.1.3 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。

### 7.4.2 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。

### 7.4.3 关联方关系

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

注:1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

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

#### 7.4.4.1.2 权证交易

注:无。

#### 7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

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

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

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,248,374.56	1,331,975.38
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注:支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

##### 7.4.4.2.2 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	249,674.89	266,395.10

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.4.4.1 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。

##### 7.4.4.4.2 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 (%)
上证380ETF联接基金	114,399,941.00	80.31%	138,399,941.00	82.16%

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

#### 7.4.4.5 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
中国建设银行股份有限公司	718,834.32	15,199.22	1,118,075.39	27,669.55

注:本基金由基金托管人中国建设银行保管的银行存款,按银行约定利率计息。

#### 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

#### 7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.5 期末本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

## 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
110041	蒙电转债	2017-12-22	2018-01-09	新债未上市	100.00	100.00	840	84,000.00	84,000.00	-
110042	航电转债	2017-12-25	2018-01-15	新债未上市	100.00	100.00	650	65,000.00	65,000.00	-

## 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600309	万华化学	2017-12-05	重大资产重组	37.94	-	-	121,120	2,401,808.43	4,595,292.80	
600525	长园集团	2017-12-25	重大事项未公告	15.79	2018-01-10	17.30	118,205	1,778,903.94	1,866,456.95	
600666	奥瑞德	2017-04-27	重大事项	17.40	-	-	60,960	1,177,933.70	1,060,704.00	
600614	鹏起	2017-12-26	重大事项	10.16	-	-	94,800	1,039,521.68	963,168.00	

	科技		未公告								
600685	中船防务	2017-09-27	重大资产重组	26.66	2018-3-21	24.05	27,400	786,923.49	730,484.00		
600664	哈药股份	2017-09-28	重大资产重组	05.81	2018-02-27	6.00	125,569	967,932.83	729,555.89		
600226	瀚叶股份	2017-11-28	重大资产重组	05.93	-	-	-106,222	788,801.35	629,896.46		
600239	云南城投	2017-06-26	重大资产重组	05.22	2018-01-17	5.74	105,820	428,474.17	552,380.40		
600162	香江控股	2017-11-10	重大资产重组	03.37	2018-01-12	3.71	145,415	573,650.58	490,048.55		
600273	嘉化能源	2017-10-26	重大资产重组	09.53	2018-03-07	10.00	50,700	461,656.42	483,171.00		
600818	中路股份	2017-10-19	重大资产重组	22.83	2018-02-07	20.55	9,400	344,635.50	214,602.00		
600829	人民同泰	2017-09-28	重大资产重组	12.24	2018-02-27	12.00	14,600	213,501.03	178,704.00		
601313	江南嘉捷	2017-12-21	重大事项未公告	45.97	2018-01-02	49.00	94	1,121.45	4,321.18	注1	
600903	贵州燃气	2017-12-28	交易异常波动	16.86	2018-01-02	16.01	28	61.88	472.08		

注1.

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

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

#### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注:无。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	228,835,511.45	99.61
	其中：股票	228,835,511.45	99.61
2	固定收益投资	149,000.00	0.06
	其中：债券	149,000.00	0.06
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	741,257.19	0.32
7	其他各项资产	3,232.89	0.00
8	合计	229,729,001.53	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而5.2的合计项中不含可退替代款估值增值。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	483,635.10	0.21
B	采矿业	10,077,692.73	4.40
C	制造业	136,814,459.22	59.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,037,607.34	5.69

E	建筑业	5,945,199.74	2.59
F	批发和零售业	16,320,978.30	7.12
G	交通运输、仓储和邮政业	14,859,823.21	6.48
H	住宿和餐饮业	740,274.00	0.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,513,857.84	2.41
J	金融业	158,286.00	0.07
K	房地产业	8,631,644.53	3.77
L	租赁和商务服务业	1,922,317.31	0.84
M	科学研究和技术服务业	810,395.00	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	2,362,434.82	1.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	325,606.56	0.14
Q	卫生和社会工作	555,904.00	0.24
R	文化、体育和娱乐业	3,590,053.00	1.57
S	综合	1,607,458.68	0.70
	合计	223,757,627.38	97.63

## 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,665,578.93	2.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,890.88	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,942.76	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	377,471.50	0.16
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,077,884.07	2.22

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 8.3.1

#### 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600487	亨通光电	85,337	3,449,321.54	1.50
2	603288	海天味业	48,400	2,603,920.00	1.14
3	600201	生物股份	80,667	2,560,370.58	1.12
4	600176	中国巨石	157,118	2,559,452.22	1.12
5	600867	通化东宝	107,440	2,459,301.60	1.07
6	600352	浙江龙盛	204,300	2,392,353.00	1.04
7	603799	华友钴业	26,500	2,126,095.00	0.93
8	600674	川投能源	197,400	2,009,532.00	0.88
9	600525	长园集团	118,205	1,866,456.95	0.81
10	600584	长电科技	85,384	1,821,240.72	0.79

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于<http://www.nffund.com>的年度报告正文。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600309	万华化学	121,120	4,595,292.80	2.00
2	600289	亿阳信通	37,975	377,471.50	0.16
3	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.02
4	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.01

5	603329	上海雅仕	1,182	17,942.76	0.01
6	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.01
7	603655	朗博科技	880	8,184.00	0.00
8	601313	江南嘉捷	94	4,321.18	0.00
9	600903	贵州燃气	28	472.08	0.00
10	600025	华能水电	52	275.60	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600352	浙江龙盛	2,219,943.00	0.86
2	600674	川投能源	2,217,104.38	0.86
3	603799	华友钴业	2,204,646.00	0.85
4	601333	广深铁路	1,550,286.00	0.60
5	600779	水井坊	1,456,302.00	0.56
6	600998	九州通	1,450,666.17	0.56
7	600490	鹏欣资源	1,343,810.00	0.52
8	603288	海天味业	1,247,479.00	0.48
9	601997	贵阳银行	1,134,042.00	0.44
10	600325	华发股份	1,112,223.20	0.43
11	600240	华业资本	1,091,680.00	0.42
12	600978	宜华生活	977,392.00	0.38
13	600346	恒力股份	933,971.00	0.36
14	600372	中航电子	833,680.00	0.32
15	600004	白云机场	776,858.00	0.30
16	601200	上海环境	765,736.00	0.30
17	600176	中国巨石	732,208.00	0.28
18	600446	金证股份	714,371.00	0.28
19	600438	通威股份	697,976.40	0.27
20	600693	东百集团	690,676.00	0.27

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

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601888	中国国旅	3,849,941.54	1.49
2	600660	福耀玻璃	3,566,766.46	1.38
3	601012	隆基股份	1,912,700.56	0.74
4	600436	片仔癀	1,776,043.15	0.69

5	601992	金隅股份	1,774,906.98	0.68
6	600008	首创股份	1,732,135.92	0.67
7	600170	上海建工	1,585,750.29	0.61
8	600718	东软集团	1,556,065.54	0.60
9	600497	驰宏锌锗	1,520,737.00	0.59
10	600256	广汇能源	1,447,764.00	0.56
11	600282	南钢股份	1,030,945.00	0.40
12	600809	山西汾酒	928,974.00	0.36
13	601997	贵阳银行	896,633.00	0.35
14	600017	日照港	824,284.00	0.32
15	601808	中海油服	696,358.00	0.27
16	600169	太原重工	681,463.36	0.26
17	600634	富控互动	666,879.00	0.26
18	600496	精工钢构	609,627.79	0.24
19	601010	文峰股份	551,014.72	0.21
20	600033	福建高速	550,365.00	0.21

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	80,101,363.92
卖出股票收入(成交)总额	70,756,454.77

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

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

**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

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

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

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

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**8.12.2**

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

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

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.6 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

#### 8.12.7 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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

#### 8.12.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

#### 9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

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

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

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	方正证券股份有限公司	3,380,041.00	2.37
2	泰康资产强化回报混合型养老金产品—中国建设银行股份有限公司	1,923,300.00	1.35
3	中国建设银行股份有限公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	1,611,200.00	1.13
4	中国石油天然气集团公司企业年金计划—中国工商银行股份有	1,572,800.00	1.10

	限公司		
5	郑州煤炭工业（集团）有限责任公司企业年金计划—中国建设银行股份有限公司	1,220,400.00	0.86
6	胡海燕	1,073,900.00	0.75
7	北京无限立通通讯技术有限责任公司	609,600.00	0.43
8	山西焦煤集团有限责任公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	576,800.00	0.40
9	王一一	499,000.00	0.35
10	杜敏声	351,800.00	0.25
11	中国建设银行股份有限公司—南方上证380交易型开放式指数证券	114,399,941.00	80.31

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

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

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

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

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

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	146,333,028.12	100.00%	31,874.19	100.00%	
中邮证券	1	-	-	-	-	
第一创业	1	-	-	-	-	
国金证券	1	-	-	-	-	

宏信证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
诚浩证券	1	-	-	-	-	-

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

A: 选择标准

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

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

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

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

## § 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(%)
南方上证380交易型开放式	1	20170101-201712	138,399,941.00	2,000,000.00	26,000,000.00	114,399,941.00	80.31

指数证券 投资基金 联接基金		31					
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注：申购份额包含红利在投资和份额折算。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。