

南方中证互联网指数分级证券投资基金 2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 30 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 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。

本报告期自 2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
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.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
12,865.61	35
§8 投资组合报告	38
8.1 期末基金资产组合情况.....	38
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45

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	45
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	45
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	45
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
8.12 投资组合报告附注	46
§9 基金份额持有人信息	47
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
9.2 期末上市基金前十名持有人	47
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§10 开放式基金份额变动	48
§11 重大事件揭示	49
11.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
11.4 基金投资策略的改变	49
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
11.8 其他重大事件	50
§12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证互联网指数分级证券投资基金		
基金简称	南方中证互联网指数分级		
场内简称	互联基金		
基金主代码	160137		
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）		
基金合同生效日	2015 年 7 月 1 日		
基金管理人	南方基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	356,689,088.33 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	2015 年 7 月 13 日		
下属分级基金的基金简称	南方中证互联网指数分级	互联 A 级	互联 B 级
下属分级基金的场内简称	互联基金	互联 A 级	互联 B 级
下属分级基金的交易代码	160137	150297	150298
报告期末下属分级基金份额总额	323,153,653.33 份	16,767,717.00 份	16,767,718.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。
投资策略	<p>本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，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，并辅之以金融衍生产品投资管理等，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p>
业绩比较基准	中证互联网指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

下属分级基金的风险收益特征	互联基金属于股票型基金，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。	互联网A份额为稳健收益类份额，具有低预期风险且预期收益相对较低的特征。	互联网B份额为积极收益类份额，具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。
---------------	---------------------------------------------------------------------------------------	-------------------------------------	-------------------------------------

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	林葛
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-68121816
注册地址		深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层	北京东城区建国门内大街69号
办公地址		深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层	北京复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座9层
邮政编码		518048	100031
法定代表人		吴万善	刘士余

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街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	2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-25,467,482.84
本期利润	-10,964,882.44
加权平均基金份额本期利润	-0.0258
本期加权平均净值利润率	-2.77%
本期基金份额净值增长率	-4.73%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末
期末可供分配利润	-22,541,995.24
期末可供分配基金份额利润	-0.0632
期末基金资产净值	339,831,703.50
期末基金份额净值	0.9527
3.1.3 累计期末指标	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-4.73%

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. 本基金合同生效日为 2015 年 7 月 1 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。

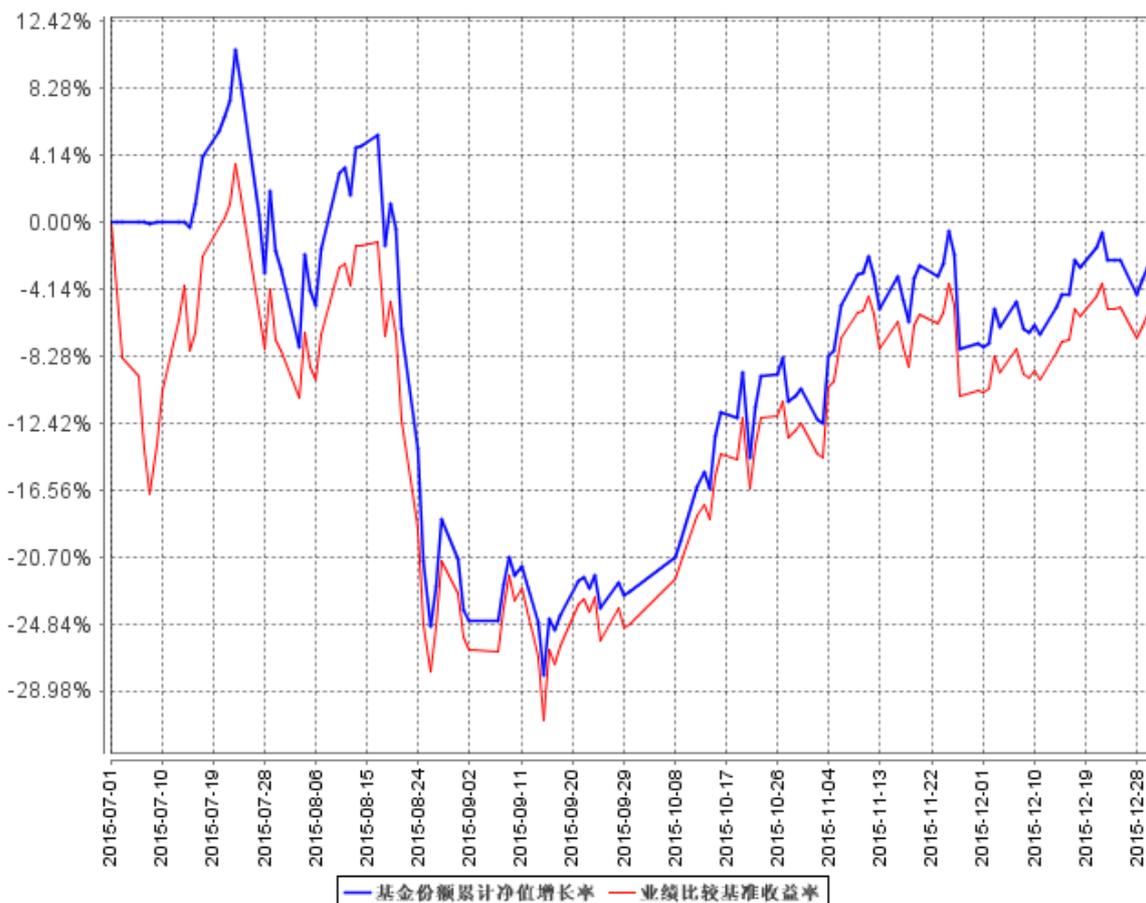
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	23.50%	2.09%	22.98%	1.99%	0.52%	0.10%
自基金合同生效起至今	-4.73%	2.75%	-7.56%	2.88%	2.83%	-0.13%

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

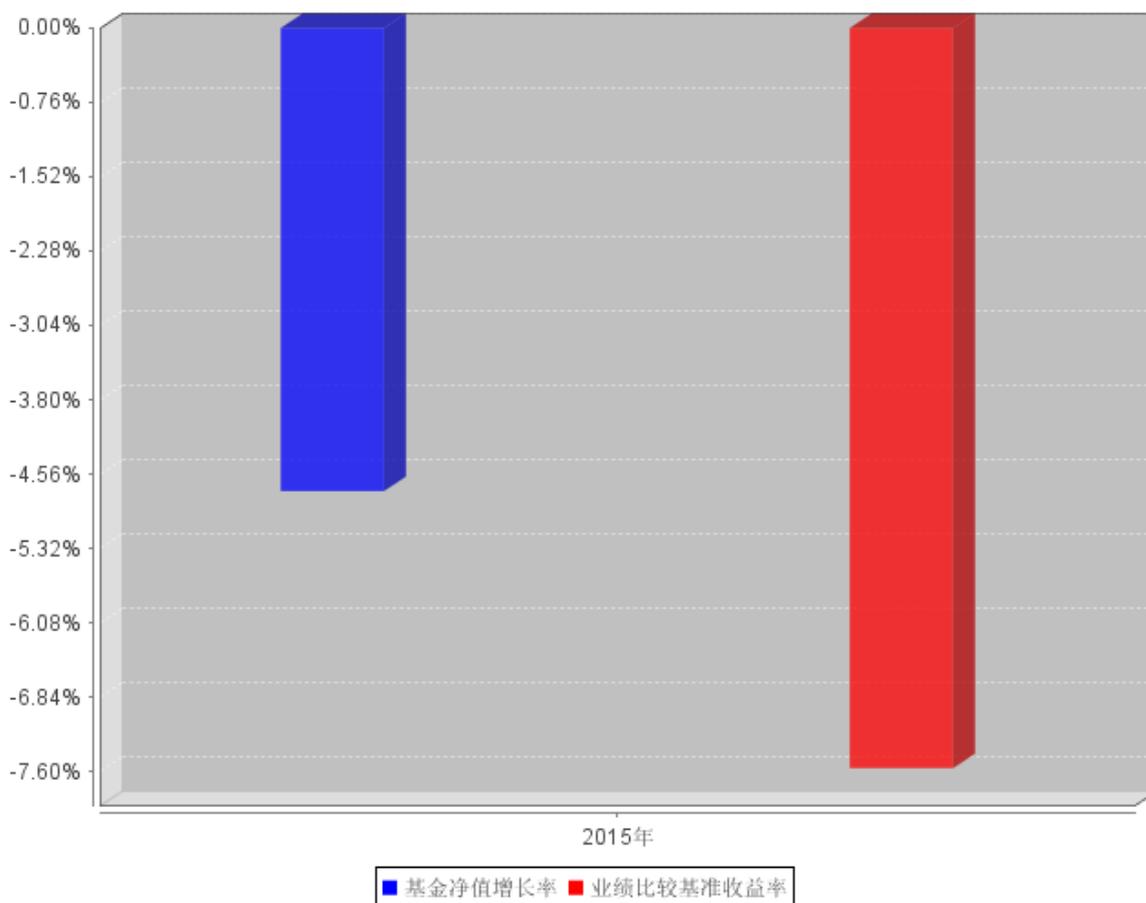
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金合同生效日至本报告期末不满一年。本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，截至本报告期末已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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。

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 5,000 亿元，旗下管理 85 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	2015 年 7 月 1 日	-	18 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。

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《南方中证互联网指数分级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，没有发生损害基金持有人利益的情形。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9次，其中5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，2次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致，2次是由于投资组合的投资策略需要，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

本基金系指数分级基金，在7月初成立时，有接近20%的指数成份股处于停牌状态。考虑到本基金规模较小，而近期市场波动较大。根据基金合同规定，基金建仓期在6个月之内。因此，我们决定寻找合适的市场机会谨慎建仓。截至12月底，本基金完成建仓，投资效果较好，建仓期内本基金净值增长率超越基金的业绩比较基准。

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 0.9527 元，报告期内，份额净值增长率为-4.73%，同期业绩基准增长率为-7.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年，中央经济工作重点将在适度扩大总需求的同时，着力加强供给侧结构性改革，着力提高供给体系质量和效率，增强经济持续增长动力，推动我国社会生产力水平实现整体跃升。展望 2016 年全年，A 股市场将逐步实现震荡牛市，震荡来源于估值提升后市场波动加大。蓝筹股和小盘股均有机会，但驱动因素不同。近期险资频频举牌地产、金融、消费等领域优质蓝筹股，根本原因是在低利率背景下，蓝筹股的分红收益率很有吸引力，预计在 2015 年底上演的上市公司控股权之争可能在 2016 年更常见，这也表明产业资本对于蓝筹股长期投资价值的认可。

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，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，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，本基金管理人开展了基金管理公司合规风险全面自查、分级基金折算自查等多项内控自查工作，制定或修订了合规手册、公平交易操作指引、股票池管理制度等内部制度，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；针对新出台的法律法规和监管要求，积极组织了多项法律法规、职业道德培训以及合规考试，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；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；完成各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；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，不断提高内部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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在存续期内，本基金不进行收益分配。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方中证互联网指数分级证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，南方中证互联网指数分级证券投资基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方中证互联网指数分级证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、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。

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有限公司编制和披露的南方中证互联网指数分级证券投资基金 2015 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(2016)第 21296 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	南方中证互联网指数分级证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的南方中证互联网指数分级证券投资基金（以下简称“南方中证互联网指数基金”）的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 7 月 1 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间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。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是南方中证互联网指数基金 的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和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财务报表，并使其实现公允反映； (2) 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。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 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。
审计意见段	我们认为，上述南方中证互联网指数基金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

	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，公允反映了南方中证互联网指数基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	薛 竞	陈 熹
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)	
会计师事务所的地址	中国 · 上海市	
审计报告日期	2016 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方中证互联网指数分级证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	25,237,590.38
结算备付金		291,993.83
存出保证金		444,753.68
交易性金融资产	7.4.7.2	315,403,087.46
其中：股票投资		315,403,087.46
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	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	5,844.84
应收股利		-
应收申购款		25,873.36
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		341,409,143.55
负债和所有者权益	附注号	本期末 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	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		913,661.50
应付管理人报酬		302,108.74
应付托管费		66,463.92
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	97,146.17
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	198,059.72
负债合计		1,577,440.05
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	356,689,088.33
未分配利润	7.4.7.10	-16,857,384.83
所有者权益合计		339,831,703.50
负债和所有者权益总计		341,409,143.55

注：1、报告截止日 2015 年 12 月 31 日，南方中证互联网指数分级基础份额净值 0.9527 元，互联 A 级份额净值 1.0302 元，互联 B 级份额净值 0.8752 元；基金份额总额 356,689,088.33 份，其中南方中证互联网指数分级基础份额 323,153,653.33 份，互联 A 级份额 16,767,717.00 份，互联 B 级份额 16,767,718.00 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：南方中证互联网指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-7,726,477.76
1.利息收入		441,993.83
其中：存款利息收入	7.4.7.11	440,402.16
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,591.67

其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-23,146,432.54
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-23,260,591.18
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	114,158.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	14,502,600.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	475,360.55
减：二、费用		3,238,404.68
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,949,941.41
2. 托管费	7.4.10.2.2	428,987.11
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	516,072.21
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.19	343,403.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,964,882.44
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,964,882.44

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证互联网指数分级证券投资基金

本报告期：2015年7月1日（基金合同生效日）至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月1日（基金合同生效日）至2015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）	611,872,014.42	-	611,872,014.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,964,882.44	-10,964,882.44
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）	-255,182,926.09	-5,892,502.39	-261,075,428.48

其中：1. 基金申购款	132,458,391.27	-13,605,954.77	118,852,436.50
2. 基金赎回款	-387,641,317.36	7,713,452.38	-379,927,864.98
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）	356,689,088.33	-16,857,384.83	339,831,703.50

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 基金基本情况

南方中证互联网指数分级证券投资基金(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[2015]887号《关于准予南方中证互联网指数分级证券投资基金注册的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证互联网指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,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611,691,590.41元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第792号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中证互联网指数分级证券投资基金基金合同》于2015年7月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为611,872,014.42份基金份额,其中认购资金利息折合180,424.01份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《南方中证互联网指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金的基金份额包括南方中证互联网指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“南方互联网份额”)、南方中证互联网指数分级证券投资基金之A份额(以下简称“互联网A份额”)及南方中证互联网指数分级证券投资基金之B份额(以下简称“互联网B份额”)。本基金通过场外、场内两种方式公开发售南方互联网份额。投资人场外认购所得的南方互联网份额,不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的南方互联网份额,将按1:1的基金份额配比自动分离为互联网A份额和互联网B份额。互联网A份额和互联网B份额的数量保持1:1的比例不变。基金合同生效后,南方互联网份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回,但是不进行上市交易。在满足上市条件的情

况下，互联网 A 份额和互联网 B 份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内南方互联网份额与互联网 A 份额和互联网 B 份额之间可以按照规定约定的规则进行场内份额的配对转换，包括包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份场内南方互联网份额按照 1：1 的份额配比转换成 1 份互联网 A 份额与 1 份互联网 B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份互联网 A 份额与 1 份互联网 B 份额按照 1：1 的基金份额配比转换成 2 份场内南方互联网份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：南方互联网份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为南方互联网份额、互联网 A 份额和互联网 B 份额数量的总和。本基金每份互联网 A 份额与每份互联网 B 份额构成一对份额组合，该份额组合的基金份额参考净值之和等于 2 份南方互联网份额的基金份额净值之和。互联网 A 份额的约定收益率为一年期银行定期存款利率(税后)+4.0%，互联网 A 份额的份额净值每日按该约定年收益率逐日计算，计算出互联网 A 份额的基金份额参考净值后，根据南方互联网份额的基金份额净值与互联网 A 份额、互联网 B 份额之间的基金份额参考净值关系，可以计算出互联网 B 份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内每年 12 月 1 日(若该日为非工作日，则顺延至下一个工作日；基金合同生效不足 6 个月的除外)，本基金将进行基金的定期份额折算：定期份额折算后互联网 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.0000 元，基金份额折算基准日折算前互联网 A 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分将折算为场内南方互联网份额分配给互联网 A 份额持有人。南方互联网份额持有人持有的每 2 份南方互联网份额将按 1 份互联网 A 份额获得新增南方互联网份额的分配。持有场外南方互联网份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外南方互联网份额的分配；持有场内南方互联网份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内南方互联网份额的分配。经过上述份额折算后，南方互联网份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，互联网 A 份额和互联网 B 份额的份额配比保持 1：1 的比例。互联网 B 份额不参与定期份额折算，每次定期份额折算不改变互联网 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上的定期份额折算外，当南方互联网份额的基金份额净值大于或等于 1.5000 元时，或当互联网 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时，本基金将以该日后的次一交易日为本基金不定期折算基准日，进行不定期份额折算：份额折算后本基金将确保互联网 A 份额和互联网 B 份额的比例为 1：1，份额折算后互联网 A 份额的基金份额参考净值、互联网 B 份额的基金份额参考净值和南方互联网份额的基金份额净值均调整为 1.0000 元。当南方互联网份额的基金份额净

值大于或等于 1.5000 元时,基金份额折算基准日折算前南方互联网份额的基金份额净值及互联网 A 份额、互联网 B 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分均将折算为南方互联网份额分别分配给南方互联网份额、互联网 A 份额和互联网 B 份额的持有人。当互联网 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时,南方互联网份额、互联网 A 份额和互联网 B 份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]338 号核准,本基金互联网 A 份额 55,638,584 份基金份额与互联网 B 份额 55,638,585 份基金份额于 2015 年 7 月 13 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的南方互联网份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其分拆为互联网 A 份额和互联网 B 份额即可上市流通;对于托管在场外的南方互联网份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为互联网 A 份额和互联网 B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证互联网指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求与业绩比较基准相似的回报。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。此外,本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具。本基金 80%以上的基金资产投资于股票,其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:中证互联网指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率(税后) \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 2016 年 3 月 25 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》、《南方中证互联网指数分级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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

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公允价值变动计入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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

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

在存续期内，本基金(包括南方互联网份额、互联网 A 份额、互联网 B 份额)不进行收益分配。

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

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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[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[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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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。

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 2015 年 12 月 31 日
活期存款	25,237,590.38
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	25,237,590.38

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	300,900,487.06	315,403,087.46	14,502,600.40
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	300,900,487.06	315,403,087.46	14,502,600.40
----	----------------	----------------	---------------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应收活期存款利息	5,513.24
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	131.40
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	200.20
合计	5,844.84

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	97,146.17
银行间市场应付交易费用	-
合计	97,146.17

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,443.40
预提费用	194,616.32
合计	198,059.72

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	611,872,014.42	611,872,014.42
本期申购	132,458,391.27	132,458,391.27
本期赎回(以“-”号填列)	-387,641,317.36	-387,641,317.36
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	356,689,088.33	356,689,088.33

注：1. 本基金自 2015 年 6 月 15 日至 2015 年 6 月 26 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 611,691,590.41 元。根据《南方中证互联网指数分级证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 180,424.01 元在本基金成立后，折算为 180,424.01 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《南方中证互联网指数分级证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金互联基金份额于 2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 7 月 12 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务和赎回业务自 2015 年 7 月 13 日起开始办理。

3. 截至 2015 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的互联 A 级份额为 16,767,717.00 份、互联 B 级份额为 16,767,718.00 份，托管在场内未上市交易的互联基金份额为 2,781,664.00 份、托管在场外未上市交易的互联基金份额为 320,371,989.33 份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。互联基金份额与互联 A 级份额、互联 B 级份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。

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
----	-------	-------	---------

基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-25,467,482.84	14,502,600.40	-10,964,882.44
本期基金份额交易产生的变动数	2,925,487.60	-8,817,989.99	-5,892,502.39
其中：基金申购款	-8,706,913.66	-4,899,041.11	-13,605,954.77
基金赎回款	11,632,401.26	-3,918,948.88	7,713,452.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-22,541,995.24	5,684,610.41	-16,857,384.83

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年7月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	431,150.88
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	7,667.23
其他	1,584.05
合计	440,402.16

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015年7月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出股票成交总额	323,622,785.91
减：卖出股票成本总额	346,883,377.09
买卖股票差价收入	-23,260,591.18

7.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	114,158.64
基金投资产生的股利收益	-
合计	114,158.64

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	14,502,600.40
——股票投资	14,502,600.40
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	14,502,600.40

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	474,920.54
其他	440.01
合计	475,360.55

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	516,072.21
银行间市场交易费用	-
合计	516,072.21

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	55,000.00
信息披露费	120,000.00
其他	520.00
上市年费	60,000.00
银行费用	8,117.63
帐户维护费	150.00
中证指数费	99,616.32
合计	343,403.95

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 0.02% 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(自然季度)人民币 50,000.00 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，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
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

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。

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

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。

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	
	2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
当期发生的基金应支付的管理费	1,949,941.41	
其中:支付销售机构的客户维护费	682,606.06	

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 1.00%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 1.00% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
当期发生的基金应支付的托管费	428,987.11	

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22%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 0.22% / 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：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及报告期内无关联方投资情况。

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	
	2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	25,237,590.38	431,150.88

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

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：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2015 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

注：本进行本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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	2015-12-07	重大资产重组	58.80	未知	未知	122,035	5,868,205.22	7,175,658.00	-
600271	航天信息	2015-10-12	重大资产重组	71.47	未知	未知	80,900	5,002,060.58	5,781,923.00	-
002465	海格通信	2015-12-30	重大事项	16.69	2016-02-04	15.02	199,700	2,852,345.62	3,332,993.00	-
002174	游族网络	2015-07-23	重大资产重组	84.39	2016-02-15	80.58	34,715	2,854,409.00	2,929,598.85	-
002065	东华软件	2015-12-22	重大事项	25.10	未知	未知	94,095	2,197,319.61	2,361,784.50	-
002049	同方国芯	2015-12-11	重大资产重组	60.15	2016-03-11	54.14	29,600	1,135,329.18	1,780,440.00	-
000712	锦龙股份	2015-12-25	重大事项	29.12	2016-01-04	28.00	53,300	1,378,437.13	1,552,096.00	-
300010	立思辰	2015-12-30	重大事项	31.90	2016-01-08	28.71	47,800	1,779,678.82	1,524,820.00	-
002544	杰赛科技	2015-08-31	重大资产重组	41.42	未知	未知	32,000	871,237.22	1,325,440.00	-
300043	互动娱乐	2015-12-17	重大事项	15.80	未知	未知	74,900	1,111,141.55	1,183,420.00	-
000829	天音控股	2015-11-09	重大资产重组	12.22	未知	未知	90,561	1,006,778.33	1,106,655.42	-
600572	康恩贝	2015-12-29	重要事项	13.36	2016-01-04	13.18	79,700	1,045,147.04	1,064,792.00	-
600880	博瑞传播	2015-09-16	重大资产重组	11.37	2016-01-18	8.25	82,176	959,298.39	934,341.12	-

300324	旋极信息	2015-12-01	重大资产重组	50.58	2016-03-10	44.33	16,500	456,739.95	834,570.00	-
600699	均胜电子	2015-11-04	重大资产重组	31.25	2016-03-10	29.00	26,300	880,044.43	821,875.00	-
002678	珠江钢琴	2015-12-21	非公开发行	17.21	2016-01-19	15.49	22,984	360,543.40	395,554.64	-

注：本基金截至 2015 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

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。从本基金所分拆的两类基金份额来看，南方互联 A 份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征；南方互联 B 份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，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。

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 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资。

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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 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，其余均能按照本基金的基金管理人的持有意图，以合理价格适时变现。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。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合

约到期现金流量。

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、结算备付金和存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	25,237,590.38	-	-	-	25,237,590.38
结算备付金	291,993.83	-	-	-	291,993.83
存出保证金	444,753.68	-	-	-	444,753.68
交易性金融资产	-	-	-	315,403,087.46	315,403,087.46
应收利息	-	-	-	5,844.84	5,844.84
应收申购款	13,007.75	-	-	12,865.61	25,873.36
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	25,987,345.64	-	-	315,421,797.91	341,409,143.55
负债					
应付赎回款	-	-	-	913,661.50	913,661.50
应付管理人报酬	-	-	-	302,108.74	302,108.74
应付托管费	-	-	-	66,463.92	66,463.92
应付交易费用	-	-	-	97,146.17	97,146.17
其他负债	-	-	-	198,059.72	198,059.72
负债总计	-	-	-	1,577,440.05	1,577,440.05
利率敏感度缺口	25,987,345.64	-	-	313,844,357.86	339,831,703.50

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2015 年 12 月 31 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。

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或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金采用被动式指数化投资方法，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或成份股发生配股、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，力求降低跟踪误差。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 80%以上，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 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，包括 VaR (Value at Risk) 指标等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 2015 年 12 月 31 日
----	-------------------------

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	315,403,087.46	92.81
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	315,403,087.46	92.81

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	
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(2015年12月31日)
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 1,602
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 1,602

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) 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 2015 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 281,297,125.93 元,属于第二层次的余额为 34,105,961.53 元,无属于第三层次的余额。

(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 2015 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。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，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	315,403,087.46	92.38
	其中：股票	315,403,087.46	92.38
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	25,529,584.21	7.48
7	其他各项资产	476,471.88	0.14
8	合计	341,409,143.55	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	95,816,956.57	28.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,141,606.00	0.92
F	批发和零售业	21,112,428.92	6.21
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	114,562,906.31	33.71
J	金融业	36,321,961.00	10.69
K	房地产业	8,777,099.87	2.58
L	租赁和商务服务业	9,286,313.90	2.73
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	2,529,559.62	0.74
R	文化、体育和娱乐业	22,198,993.27	6.53
S	综合	1,655,262.00	0.49
	合计	315,403,087.46	92.81

8.2.2 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的股票。

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	占基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	976,400	16,667,148.00	4.90
2	000725	京东方 A	2,764,200	8,209,674.00	2.42
3	600637	东方明珠	213,865	8,103,344.85	2.38

4	000001	平安银行	665,800	7,982,942.00	2.35
5	300104	乐视网	122,035	7,175,658.00	2.11
6	002024	苏宁云商	515,300	6,930,785.00	2.04
7	300059	东方财富	129,400	6,732,682.00	1.98
8	600050	中国联通	986,300	6,095,334.00	1.79
9	600271	航天信息	80,900	5,781,923.00	1.70
10	000851	高鸿股份	328,000	5,126,640.00	1.51
11	000063	中兴通讯	274,320	5,110,581.60	1.50
12	002415	海康威视	142,000	4,883,380.00	1.44
13	300027	华谊兄弟	113,000	4,687,240.00	1.38
14	000100	TCL 集团	994,000	4,234,440.00	1.25
15	601555	东吴证券	251,300	4,038,391.00	1.19
16	002230	科大讯飞	104,619	3,876,133.95	1.14
17	600100	同方股份	206,900	3,740,752.00	1.10
18	002241	歌尔声学	106,600	3,688,360.00	1.09
19	600570	恒生电子	57,500	3,505,775.00	1.03
20	000917	电广传媒	131,900	3,503,264.00	1.03
21	300017	网宿科技	56,800	3,407,432.00	1.00
22	600109	国金证券	211,000	3,401,320.00	1.00
23	002465	海格通信	199,700	3,332,993.00	0.98
24	600718	东软集团	101,200	3,142,260.00	0.92
25	002292	奥飞动漫	60,471	3,126,955.41	0.92
26	600804	鹏博士	130,300	3,090,716.00	0.91
27	002236	大华股份	80,986	2,988,383.40	0.88
28	600177	雅戈尔	181,300	2,951,564.00	0.87
29	002174	游族网络	34,715	2,929,598.85	0.86
30	000793	华闻传媒	190,800	2,867,724.00	0.84
31	600446	金证股份	58,000	2,853,020.00	0.84
32	000503	海虹控股	83,700	2,803,113.00	0.82
33	601998	中信银行	371,200	2,680,064.00	0.79
34	601607	上海医药	134,200	2,671,922.00	0.79
35	300058	蓝色光标	179,830	2,648,895.90	0.78
36	002456	欧菲光	83,900	2,602,578.00	0.77
37	002405	四维图新	66,200	2,568,560.00	0.76
38	600839	四川长虹	429,400	2,486,226.00	0.73
39	300315	掌趣科技	176,200	2,466,800.00	0.73
40	601933	永辉超市	236,481	2,388,458.10	0.70
41	002065	东华软件	94,095	2,361,784.50	0.69
42	002385	大北农	190,650	2,327,836.50	0.68

43	300003	乐普医疗	56,679	2,187,809.40	0.64
44	002439	启明星辰	67,600	2,163,200.00	0.64
45	600588	用友网络	67,900	2,159,899.00	0.64
46	000977	浪潮信息	66,900	2,121,399.00	0.62
47	002400	省广股份	84,200	2,117,630.00	0.62
48	600158	中体产业	78,516	2,047,697.28	0.60
49	601098	中南传媒	83,616	1,998,422.40	0.59
50	600410	华胜天成	74,700	1,980,297.00	0.58
51	600522	中天科技	85,100	1,948,790.00	0.57
52	000997	新大陆	76,392	1,934,245.44	0.57
53	002081	金螳螂	102,500	1,914,700.00	0.56
54	300168	万达信息	56,411	1,868,896.43	0.55
55	002153	石基信息	12,371	1,868,021.00	0.55
56	300253	卫宁软件	44,500	1,863,660.00	0.55
57	002475	立讯精密	58,072	1,855,400.40	0.55
58	000540	中天城投	200,200	1,825,824.00	0.54
59	300002	神州泰岳	138,600	1,815,660.00	0.53
60	600060	海信电器	91,300	1,795,871.00	0.53
61	002049	同方国芯	29,600	1,780,440.00	0.52
62	300033	同花顺	25,000	1,776,250.00	0.52
63	600037	歌华有线	80,932	1,742,465.96	0.51
64	600498	烽火通信	60,900	1,736,259.00	0.51
65	002268	卫士通	30,200	1,697,542.00	0.50
66	600770	综艺股份	90,600	1,655,262.00	0.49
67	002104	恒宝股份	66,441	1,593,919.59	0.47
68	000547	航天发展	83,100	1,583,055.00	0.47
69	600601	方正科技	255,500	1,578,990.00	0.46
70	600138	中青旅	67,400	1,571,094.00	0.46
71	601929	吉视传媒	253,200	1,564,776.00	0.46
72	000712	锦龙股份	53,300	1,552,096.00	0.46
73	300251	光线传媒	51,195	1,550,696.55	0.46
74	300010	立思辰	47,800	1,524,820.00	0.45
75	600198	大唐电信	61,500	1,517,205.00	0.45
76	300133	华策影视	50,780	1,512,736.20	0.45
77	600373	中文传媒	64,100	1,505,709.00	0.44
78	601216	君正集团	128,600	1,472,470.00	0.43
79	002657	中科金财	18,400	1,471,816.00	0.43
80	300291	华录百纳	41,200	1,466,720.00	0.43
81	603000	人民网	64,300	1,466,683.00	0.43

82	300015	爱尔眼科	45,739	1,444,437.62	0.43
83	002410	广联达	78,711	1,430,965.98	0.42
84	601928	凤凰传媒	88,744	1,413,691.92	0.42
85	000050	深天马 A	65,901	1,397,760.21	0.41
86	300085	银之杰	24,500	1,369,550.00	0.40
87	300170	汉得信息	67,500	1,339,875.00	0.39
88	002544	杰赛科技	32,000	1,325,440.00	0.39
89	002223	鱼跃医疗	34,000	1,307,300.00	0.38
90	600633	浙报传媒	69,200	1,303,036.00	0.38
91	300216	千山药机	29,400	1,295,952.00	0.38
92	600536	中国软件	34,500	1,244,760.00	0.37
93	002375	亚厦股份	77,800	1,226,906.00	0.36
94	002055	得润电子	31,400	1,213,924.00	0.36
95	600587	新华医疗	33,100	1,202,523.00	0.35
96	601519	大智慧	92,491	1,185,734.62	0.35
97	300043	互动娱乐	74,900	1,183,420.00	0.35
98	002373	千方科技	25,700	1,175,775.00	0.35
99	002063	远光软件	55,569	1,174,728.66	0.35
100	300273	和佳股份	55,000	1,149,500.00	0.34
101	002642	荣之联	19,800	1,146,222.00	0.34
102	002195	二三四五	30,350	1,122,950.00	0.33
103	000829	天音控股	90,561	1,106,655.42	0.33
104	300178	腾邦国际	37,600	1,094,160.00	0.32
105	002285	世联行	67,333	1,092,814.59	0.32
106	300115	长盈精密	32,400	1,087,668.00	0.32
107	300347	泰格医药	35,300	1,085,122.00	0.32
108	002095	生意宝	14,700	1,081,773.00	0.32
109	600572	康恩贝	79,700	1,064,792.00	0.31
110	300166	东方国信	32,800	1,050,584.00	0.31
111	000021	深科技	85,500	1,031,130.00	0.30
112	300359	全通教育	11,806	1,016,732.72	0.30
113	002261	拓维信息	26,000	1,011,400.00	0.30
114	002344	海宁皮城	65,100	998,634.00	0.29
115	002555	顺荣三七	20,400	996,744.00	0.29
116	000008	神州高铁	84,200	991,876.00	0.29
117	300288	朗玛信息	15,740	971,472.80	0.29
118	002603	以岭药业	52,300	948,199.00	0.28
119	002429	兆驰股份	74,600	946,674.00	0.28
120	600880	博瑞传播	82,176	934,341.12	0.27

121	600571	信雅达	15,400	909,832.00	0.27
122	002396	星网锐捷	37,650	909,247.50	0.27
123	000555	神州信息	21,328	897,908.80	0.26
124	002312	三泰控股	32,000	889,600.00	0.26
125	000979	中弘股份	214,800	859,200.00	0.25
126	002181	粤传媒	54,000	855,900.00	0.25
127	300324	旋极信息	16,500	834,570.00	0.25
128	600006	东风汽车	93,200	825,752.00	0.24
129	600699	均胜电子	26,300	821,875.00	0.24
130	002602	世纪华通	23,900	813,795.00	0.24
131	600180	瑞茂通	35,600	786,048.00	0.23
132	600757	长江传媒	70,500	774,090.00	0.23
133	600850	华东电脑	14,985	773,975.25	0.23
134	600998	九州通	38,324	751,150.40	0.22
135	002251	步步高	45,400	740,020.00	0.22
136	300226	上海钢联	14,475	733,882.50	0.22
137	600825	新华传媒	60,700	724,758.00	0.21
138	601801	皖新传媒	21,166	691,704.88	0.20
139	002354	天神娱乐	6,700	643,066.00	0.19
140	002416	爱施德	34,900	610,750.00	0.18
141	300369	绿盟科技	12,500	608,000.00	0.18
142	002503	搜于特	36,200	573,408.00	0.17
143	601231	环旭电子	38,002	549,508.92	0.16
144	000536	华映科技	36,300	535,062.00	0.16
145	000156	华数传媒	14,994	491,803.20	0.14
146	002678	珠江钢琴	22,984	395,554.64	0.12
147	300148	天舟文化	15,700	276,320.00	0.08

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	601166	兴业银行	25,214,145.66	7.42
2	000001	平安银行	12,520,177.74	3.68
3	002024	苏宁云商	11,710,434.00	3.45
4	000725	京东方 A	11,301,147.00	3.33
5	300059	东方财富	10,957,643.10	3.22
6	600050	中国联通	10,529,314.98	3.10
7	600637	东方明珠	10,470,568.36	3.08
8	300104	乐视网	8,274,916.15	2.44
9	002415	海康威视	7,953,833.38	2.34
10	000063	中兴通讯	7,718,572.90	2.27
11	000100	TCL 集团	7,534,115.00	2.22
12	002230	科大讯飞	6,453,315.96	1.90
13	600570	恒生电子	6,396,827.00	1.88
14	600839	四川长虹	5,896,988.00	1.74
15	600271	航天信息	5,678,623.00	1.67
16	000997	新大陆	5,623,367.44	1.65
17	300315	掌趣科技	5,613,771.00	1.65
18	300027	华谊兄弟	5,556,814.00	1.64
19	002312	三泰控股	5,464,022.00	1.61
20	600109	国金证券	5,332,946.20	1.57

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	10,916,046.30	3.21
2	300059	东方财富	5,133,386.10	1.51
3	002024	苏宁云商	5,054,472.00	1.49
4	300020	银江股份	4,775,078.37	1.41
5	000001	平安银行	4,631,441.65	1.36
6	002117	东港股份	4,573,815.66	1.35
7	300336	新文化	4,336,097.80	1.28
8	600640	号百控股	4,301,058.17	1.27
9	600158	中体产业	4,092,827.74	1.20
10	600050	中国联通	4,029,131.00	1.19

11	002315	焦点科技	4,018,275.79	1.18
12	601231	环旭电子	3,928,733.48	1.16
13	300295	三六五网	3,874,421.65	1.14
14	002564	天沃科技	3,753,517.00	1.10
15	002467	二六三	3,752,520.08	1.10
16	300226	上海钢联	3,670,072.98	1.08
17	002049	同方国芯	3,575,545.12	1.05
18	601801	皖新传媒	3,544,906.00	1.04
19	300369	绿盟科技	3,472,618.00	1.02
20	600373	中文传媒	3,407,268.60	1.00

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	647,783,864.15
卖出股票收入（成交）总额	323,622,785.91

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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投资。

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，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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	444,753.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,844.84
5	应收申购款	25,873.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	476,471.88

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

8.12.5.1 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	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	-------	----------

				净值比例 (%)	
1	600271	航天信息	5,781,923.00	1.70	重大资产重组
2	300104	乐视网	7,175,658.00	2.11	临时停牌

8.12.5.2 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的股票。

§ 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

份额单位：份

份额级别	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
南方中证互联网指数分级	8,895	36,329.81	572,173.73	0.18%	322,581,479.60	99.82%
互联 A 级	195	85,988.29	8,452,259.00	50.41%	8,315,458.00	49.59%
互联 B 级	616	27,220.32	116,025.00	0.69%	16,651,693.00	99.31%
合计	9,706	36,749.34	9,140,457.73	2.56%	347,548,630.60	97.44%

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。

9.2 期末上市基金前十名持有人

互联 A 级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	海通资管—上海银行—海通赢家系列一月月赢集合资产管理计划	2,770,207.00	16.52%
2	陈杰	1,592,699.00	9.50%
3	易方达基金—农业银行—中油财务有限责任公司	1,132,000.00	6.75%
4	北京千石创富—国信证券—雁丰多策略资产管理计划	1,098,575.00	6.55%

5	北京千石创富—兴业银行—千石资本—道冲套利 12 号资产管理计	1,000,000.00	5.96%
6	北京快快网络技术有限公司	924,318.00	5.51%
7	弓淑华	750,036.00	4.47%
8	东方证券股份有限公司	400,000.00	2.39%
9	北京千石创富—工商银行—千石资本—雁丰多策略 2 号资产管理	386,431.00	2.30%
10	李怡名	325,426.00	1.94%

互联 B 级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	弓淑华	750,036.00	4.47%
2	高旋	700,000.00	4.17%
3	曹玉伟	542,300.00	3.23%
4	卢朝颂	524,200.00	3.13%
5	邹光明	500,009.00	2.98%
6	闫世辉	410,000.00	2.45%
7	李怡名	304,200.00	1.81%
8	赵向华	250,036.00	1.49%
9	柴月华	250,014.00	1.49%
10	黄启阶	244,204.00	1.46%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方中证互联网指数分级	106.76	0.0000%
	互联 A 级	-	-
	互联 B 级	-	-
	合计	106.76	0.0000%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金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）。

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

项目	南方中证互联网 指数分级	互联 A 级	互联 B 级
基金合同生效日(2015 年 7 月 1 日) 基金份额总额	611,872,014.42	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基 金总申购份额	132,458,391.27	-	-
减:基金合同生效日起至报告期期 末基金总赎回份额	387,641,317.36	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基 金拆分变动份额(份额减少以“-”填 列)	-33,535,435.00	16,767,717.00	16,767,718.00
本报告期期末基金份额总额	323,153,653.33	16,767,717.00	16,767,718.00

注:基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额包括本基金三级份额的配对转换份额及折算份额。

§ 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

本报告期内,基金管理人、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 55,000 元,该审计机构已提供审计服务的连续年限为 1 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、基金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	
银河证券	2	624,404,232.74	64.28%	62,445.69	64.28%	-
申万宏源	2	347,002,417.32	35.72%	34,700.48	35.72%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

注：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。

本基金本报告期租用证券公司交易单元情况如下：专用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专用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席位：

- (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。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方中证互联网指数分级证券投资基金之互联 A 级与互联 B 级上市交易公告书	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 8 日
2	关于开通南方中证互联网指数分级证券投资基金转托管及份额配对转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 8 日
3	南方中证互联网指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回及定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 8 日
4	关于京东电子交易平台实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 9 日
5	关于南方中证互联网指数分级证券投资基金	中国证券报、上海	2015 年 7 月 13 日

	参与部分代销机构开展的定投申购费率优惠活动的公告	证券报、证券时报	
6	关于南方中证互联网指数分级证券投资基金参与部分代销机构日常申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 13 日
7	南方中证互联网指数分级证券投资基金之互联 A 级与互联 B 级基金份额上市交易提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 13 日
8	南方基金关于电子直销平台相关业务调整费率优惠方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 15 日
9	南方基金关于旗下部分基金增加汇付金融为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 20 日
10	南方基金关于旗下部分基金增加江南农村商业银行、第一创业、大连银行、青岛银行和包商银行作为代销机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 30 日
11	南方基金关于旗下部分基金增加天风证券为代销机构及开通定投和转换业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 31 日
12	南方基金关于旗下部分基金增加中信建投期货为代销机构及通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 3 日
13	关于注意防范冒用南方基金名义进行的非法证券活动的提示	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 7 日
14	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	2015 年 8 月 26 日
15	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	2015 年 8 月 27 日
16	南方基金管理有限公司关于公司旗下开放式基金变更代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 9 月 12 日
17	南方基金关于旗下部分基金增加中信期货为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 9 月 23 日
18	南方基金关于旗下部分基金增加盈米财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 10 月 16 日
19	南方基金关于旗下部分基金增加新兰德为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 10 月 20 日
20	南方基金关于旗下部分基金增加泉州银行为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 4 日
21	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	2015 年 11 月 7 日
22	南方基金关于电子直销平台相关业务调整费率优惠方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 9 日

23	南方基金关于旗下部分基金增加陆金所资管为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 9 日
24	南方基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金申购最低金额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 9 日
25	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	2015 年 11 月 10 日
26	南方基金管理有限公司关于免收旗下部分分级基金之基础份额的场内申购费的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 12 日
27	关于电子直销业务调整通联支付申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 23 日
28	南方基金关于旗下部分基金增加富济财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 24 日
29	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	2015 年 11 月 25 日
30	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	2015 年 12 月 3 日
31	关于京东电子交易平台实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 4 日
32	南方基金关于旗下部分基金增加凯石财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 8 日
33	南方基金关于旗下部分基金增加大泰金石为代销机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 11 日
34	南方基金关于旗下部分基金增加济安财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 17 日
35	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	2015 年 12 月 18 日
36	南方基金关于旗下部分基金增加利得基金为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 23 日
37	南方基金关于电子直销平台相关业务调整费率优惠方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 29 日
38	南方基金关于旗下部分基金参加邮储银行个人网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 31 日
39	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行基金定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 31 日
40	南方基金关于旗下部分基金参加中国农业银行基金定投、基金组合申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 31 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证互联网指数分级证券投资基金的文件。
- 2、南方中证互联网指数分级证券投资基金基金合同。
- 3、南方中证互联网指数分级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。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路 6 号免税商务大厦 31-33 楼

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>