

南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券 投资基金联接基金 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：中国工商银行股份有限公司

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及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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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 1 月 1 日起至 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.....	7
§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.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	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.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§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.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	42
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53

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	53
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	53
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	53
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	53
8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
8.13 投资组合报告附注	54
§9 基金份额持有人信息	55
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
9.3 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	55
§10 开放式基金份额变动	55
§11 重大事件揭示	56
11.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
11.4 基金投资策略的改变	56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
11.8 其他重大事件	58
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	南方开元沪深 300ETF 联接
基金主代码	202015
前端交易代码	202015
后端交易代码	202016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 3 月 25 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	754,684,759.42 份
基金合同存续期	不定期

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“南方 300 联接”。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159925
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年2月18日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013年4月11日
基金管理人名称	南方基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、非成份股、新股、权证、债券资产、资产支持证券、固定收益类资产、现金资产、货币市场工具、衍生工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。在正常市场情况下，本基金力争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%。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属股票型联接基金，预期风险与预期收益水平高于混合基金、

	债券基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，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。
--	--

2.2.1 目标基金产品说明

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	本基金为被动式指数基金，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。 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	本基金的业绩比较基准为标的指数：沪深 300 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，主要采用指数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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	洪渊
	联系电话	0755-82763888	010-66105799
	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798
注册地址		深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		吴万善	姜建清

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	南方基金管理有限公司	深圳市福田中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层

§ 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	2014 年	2013 年
本期已实现收益	870,279,655.18	63,546,586.70	-384,764,956.94
本期利润	281,437,510.94	568,803,794.86	-151,159,771.06
加权平均基金份额本期利润	0.2923	0.3892	-0.0555
本期加权平均净值利润率	21.25%	46.35%	-6.49%
本期基金份额净值增长率	3.95%	51.40%	-6.12%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	220,644,232.25	-191,412,809.75	-287,317,453.40
期末可供分配基金份额利润	0.2924	-0.1286	-0.1788
期末基金资产净值	975,328,991.67	1,850,603,024.17	1,319,186,579.01
期末基金份额净值	1.2924	1.2433	0.8212
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	47.37%	41.77%	-6.36%

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

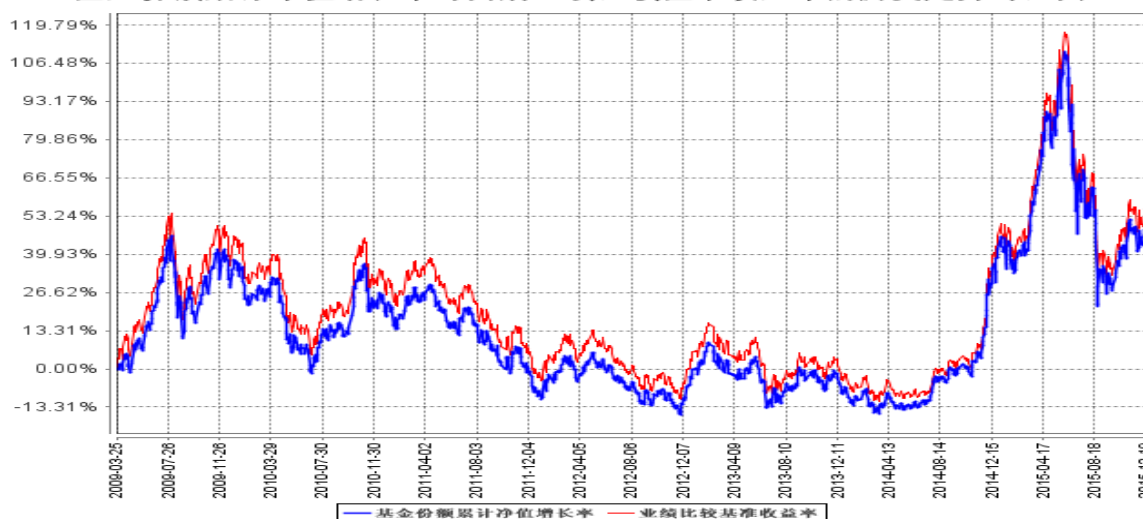
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去三个月	14.87%	1.59%	15.65%	1.59%	-0.78%	0.00%
过去六个月	-16.54%	2.56%	-15.64%	2.54%	-0.90%	0.02%
过去一年	3.95%	2.38%	5.70%	2.36%	-1.75%	0.02%
过去三年	47.75%	1.71%	45.97%	1.70%	1.78%	0.01%
过去五年	21.76%	1.53%	19.60%	1.53%	2.16%	0.00%
自基金合同生效起至今	47.37%	1.56%	54.56%	1.57%	-7.19%	-0.01%

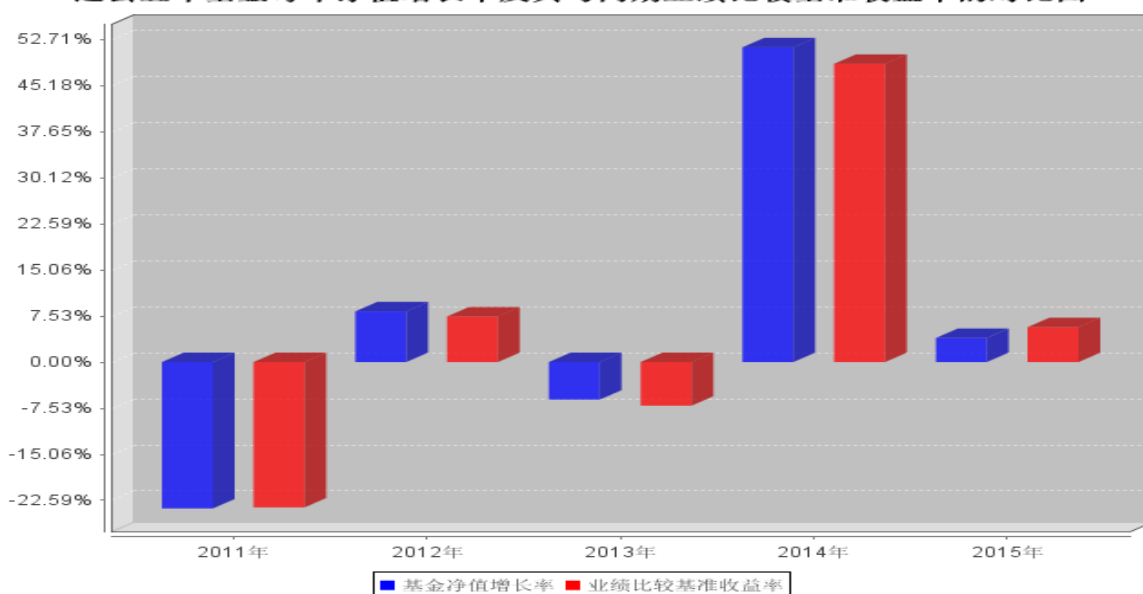
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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

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对比图



注：1、南方沪深 300 指数基金份额持有人大会于 2013 年 4 月 17 日审议通过了《关于南方沪深 300 指数证券投资基金变更投资范围及其相关事项的议案》，同意将南方沪深 300 指数证券投资基金变更为南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。基金管理人已收到中国证券监督管理委员会《关于核准南方沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金投资范围等事项决议的批复》（证监许可[2013]674 号），新基金合同于 2013 年 5 月 16 日生效。

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。

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		
杨德龙	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日	-	9 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 月至今，任南方上证 380ETF 及联接基金基金经理；2013 年 3 月至今，任南方策略基金经理；2013 年 4 月至今，任

					南方 300 基金经理；2013 年 4 月至今，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2014 年 12 月至今，任南方恒生 ETF 基金经理。
罗文杰	本基金经理	2013 年 5 月 17 日	-	10 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有中国基金从业资格。曾先后任职于美国 Open Link Financial 公司、摩根斯坦利公司，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，任南方基金数量化投资部基金经理助理；2013 年 5 月至 2015 年 6 月，任南方策略基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500 基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方 300 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2014 年 10 月至今，任 500 医药基金经理；2015 年 2 月至今，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。

3. 从 2016 年 3 月 4 日起，杨德龙先生不再担任本基金基金经理。

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《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为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购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

报告期内，沪深300指数涨5.58%。

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”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接受申购赎回所带来的股票仓位偏离，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- ②本基金大额赎回目标ETF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；
- ③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

整体仓位的微小偏离；

④股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；

⑤报告期间，我们根据指数每半年度成份股调整进行了基金调仓，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，从实施结果来看，效果良好，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

自本基金建仓完毕至报告期末年化跟踪误差为 0.722%，较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过 4% 的投资目标。

截至报告期末，本基金份额净值为 1.2924 元，报告期内，份额净值增长率为 3.95%，同期业绩基准增长率为 5.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年，国内经济结构转型、产业升级加速推进，预期利率水平仍下行，宽松货币政策逻辑不变，投资方面将导致资产配置荒。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人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

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；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，本报告期末有收益分配事项。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人——南方基金管理有限公司在南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 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(2015)第 21254 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	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(原南方沪深 300 指数证券投资基金)全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“南方开元沪深 300ETF 联接基金”)的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
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开元沪深 300ETF 联接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, 上述南方开元沪深 300ETF 联接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, 公允反映了南方开元沪深 300ETF 联接基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度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: 南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	15,767,938.83	101,747,872.31
结算备付金		39,939,530.62	8,373,234.96

存出保证金		5,272,783.28	217,660.89
交易性金融资产	7.4.7.2	908,992,718.30	1,759,790,469.05
其中：股票投资		22,015,928.20	19,097,118.55
基金投资		886,976,790.10	1,740,693,350.50
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		10,510,796.57	-
应收利息	7.4.7.5	17,587.48	23,657.30
应收股利		-	-
应收申购款		116,812.49	11,917,700.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		980,618,167.57	1,882,070,594.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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		-	7,725,603.63
应付赎回款		3,365,296.87	21,814,892.78
应付管理人报酬		56,675.22	67,302.05
应付托管费		11,335.03	13,460.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,660,146.94	1,386,712.15
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	195,721.84	459,599.62
负债合计		5,289,175.90	31,467,570.66
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	754,684,759.42	1,488,479,410.58
未分配利润	7.4.7.10	220,644,232.25	362,123,613.59
所有者权益合计		975,328,991.67	1,850,603,024.17
负债和所有者权益总计		980,618,167.57	1,882,070,594.83

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2924 元，基金份额总额 754,684,759.42 份。

7.2 利润表

会计主体：南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		290,359,355.83	571,571,857.04
1.利息收入		695,325.47	602,042.90
其中：存款利息收入	7.4.7.11	695,319.51	602,007.23
债券利息收入		5.96	35.67
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）		874,123,788.62	65,030,667.07
其中：股票投资收益	7.4.7.12	18,896,895.70	24,856,129.73
基金投资收益	7.4.7.13	858,645,002.03	41,490,296.26
债券投资收益	7.4.7.14	22,525.04	11,546.79
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-4,822,440.00	-2,545,830.00
股利收益	7.4.7.16	1,381,805.85	1,218,524.29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-588,842,144.24	505,257,208.16
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	4,382,385.98	681,938.91
减：二、费用		8,921,844.89	2,768,062.18
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	711,727.34	561,320.83
2. 托管费	7.4.10.2.2	142,345.40	112,264.10
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	7,676,310.15	1,703,193.75
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	391,462.00	391,283.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		281,437,510.94	568,803,794.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		281,437,510.94	568,803,794.86

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 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）	1,488,479,410.58	362,123,613.59	1,850,603,024.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	281,437,510.94	281,437,510.94
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）	-733,794,651.16	-422,916,892.28	-1,156,711,543.44
其中：1.基金申购款	2,134,331,650.82	981,929,837.45	3,116,261,488.27
2.基金赎回款	-2,868,126,301.98	-1,404,846,729.73	-4,272,973,031.71
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）	754,684,759.42	220,644,232.25	975,328,991.67
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	1,606,504,032.41	-287,317,453.40	1,319,186,579.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	568,803,794.86	568,803,794.86
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）	-118,024,621.83	80,637,272.13	-37,387,349.70
其中：1.基金申购款	1,091,170,276.61	-37,984,909.31	1,053,185,367.30
2.基金赎回款	-1,209,194,898.44	118,622,181.44	-1,090,572,717.00
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）	1,488,479,410.58	362,123,613.59	1,850,603,024.17

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

南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(原南方沪深 300 指数证券投资基金)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]第 127 号《关于核准南方沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》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《南方沪深 300 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,580,626,128.17 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 053 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方沪深 300 指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 3 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,580,754,997.47 份基金份额,其中认购资金利息折合 128,869.30 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金基金份额持有人大会于 2013 年 4 月 17 日以现场方式审议通过的《关于南方沪深 300 指数证券投资基金变更投资范围及其相关事项的议案》、经中国证监会证监许可[2013]674 号《关于核准南方沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金投资范围等事项决议的批复》核准,自 2013 年 5 月 16 日起,原基金南方沪深 300 指数证券投资基金更名为南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》自 2013 年 5 月 16 日起生效,原《南方沪深 300 指数证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

本基金为南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对沪深 300 指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争控制本基金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%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，于 2013 年 5 月 16 日前，本基金的标的指数为沪深 300 指数，基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中，沪深 300 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金还可以投资于经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定，自 2013 年 5 月 16 日起，本基金的标的指数为沪深 300 指数，基金资产主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%（已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内）。本基金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，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金转型后的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 X95%+银行活期款利率（税后）X5%。

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》、《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的基金投资、股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的

经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，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。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。。

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

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外，其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

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	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	15,767,938.83	101,747,872.31
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	15,767,938.83	101,747,872.31

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		21,680,894.41	22,015,928.20	335,033.79
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		891,064,519.86	886,976,790.10	-4,087,729.76
其他		-	-	-
合计		912,745,414.27	908,992,718.30	-3,752,695.97
项目	上年度末 2014年12月31日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		17,911,284.82	19,097,118.55	1,185,833.73
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		1,157,101,795.96	1,740,693,350.50	583,591,554.54
其他		-	-	-
合计		1,175,013,080.78	1,759,790,469.05	584,777,388.27

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按估值日目标 ETF 的份额净值确定公允价值。

本基金可采用股票组合申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 份额的买卖。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	22,348,860.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	22,348,860.00	-	-	
项目	上年度末 2014年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	

货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	

注：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0 元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0 元。于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

股指期货投资

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF1601	IF1601	20	22,036,800.00	-312,060.00
减：可抵销期货暂收款				-312,060.00
股指期货投资净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度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	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	6,115.42	19,922.15
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	11,181.86	3,637.15
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	290.20	98.00
合计	17,587.48	23,657.30

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

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	上年度末 2014 年 12 月 31 日

交易所市场应付交易费用	1,660,146.94	1,386,712.15
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,660,146.94	1,386,712.15

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	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付赎回费	3,440.27	47,686.66
预提费用	191,000.00	391,000.00
应付后端申购费	1,281.57	20,912.96
合计	195,721.84	459,599.62

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,488,479,410.58	1,488,479,410.58
本期申购	2,134,331,650.82	2,134,331,650.82
本期赎回(以“-”号填列)	-2,868,126,301.98	-2,868,126,301.98
本期末	754,684,759.42	754,684,759.42

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-191,412,809.75	553,536,423.34	362,123,613.59
本期利润	870,279,655.18	-588,842,144.24	281,437,510.94
本期基金份额交易产生的变动数	-63,945,349.57	-358,971,542.71	-422,916,892.28
其中：基金申购款	828,041,450.29	153,888,387.16	981,929,837.45
基金赎回款	-891,986,799.86	-512,859,929.87	-1,404,846,729.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	614,921,495.86	-394,277,263.61	220,644,232.25

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	470,750.57	432,258.42
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	214,104.65	165,195.00
其他	10,464.29	4,553.81
合计	695,319.51	602,007.23

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	18,980,724.35	15,105,336.31
股票投资收益——申购差价收入	-83,828.65	9,750,793.42
合计	18,896,895.70	24,856,129.73

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,862,730,582.70	576,654,440.26
减：卖出股票成本总额	2,843,749,858.35	561,549,103.95
买卖股票差价收入	18,980,724.35	15,105,336.31

7.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
申购基金份额总额	1,712,044,200.00	492,179,800.00
减：现金支付申购款总额	48,696,360.88	19,228,865.54

减：申购股票成本总额	1,663,431,667.77	463,200,141.04
申购差价收入	-83,828.65	9,750,793.42

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	2,848,256,353.52	501,550,205.34
减：卖出/赎回基金成本总额	1,989,611,351.49	460,059,909.08
基金投资收益	858,645,002.03	41,490,296.26

7.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	78,531.00	125,709.11
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	56,000.00	114,096.78
减：应收利息总额	5.96	65.54
买卖债券差价收入	22,525.04	11,546.79

7.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
权证投资收益	-	-
股指期货-投资收益	-4,822,440.00	-2,545,830.00

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,381,805.85	1,218,524.29
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,381,805.85	1,218,524.29

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-588,530,084.24	505,257,208.16
——股票投资	-850,799.94	1,289,232.28
——债券投资	-	1,640.60
——基金投资	-587,679,284.30	503,966,335.28
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-312,060.00	-
——权证投资	-312,060.00	-
3. 其他	-	-
合计	-588,842,144.24	505,257,208.16

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	3,722,111.21	576,253.39
基金转换费收入	660,274.77	105,685.52
合计	4,382,385.98	681,938.91

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费归入基金财产的比例不得低于 25%。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中赎回费部分归入基金财产的比例不得低于 25%。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	7,676,310.15	1,703,193.75
银行间市场交易费用	-	-
合计	7,676,310.15	1,703,193.75

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
审计费用	91,000.00	91,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行费用	462.00	283.50
合计	391,462.00	391,283.50

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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（“兴业证券”）	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
南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（“目标 ETF”）	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。

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 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015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	1,204,847.17	28.60%	1,082,846.57	65.23%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	188,243.13	19.94%	276,237.44	19.92%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	711,727.34	561,320.83
其中：支付销售机构的客户维护费	1,330,793.39	1,325,497.78

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，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扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.5% 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 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 0.5% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	142,345.40	112,264.10

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，支付基金托管人中国工商银行的托

管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数,则取零)的 0.1%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-前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产)X0.1%/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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
基金合同生效日(2009年3月25日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	158,401,143.38
期间申购/买入总份额	35,833,870.85	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	158,401,143.38
期末持有的基金份额	35,833,870.85	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.7500%	-

注:基金管理人南方基金本会计期间申购本基金的交易委托华泰证券办理,适用费率为每笔1,000元。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年12月31日		2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	15,767,938.83	470,750.57	101,747,872.31	432,258.42

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,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

金额单位：人民币元

本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
兴业证券	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
兴业证券	110025	国金转债	老股东配售	70	7,000.00

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有 598,944,419.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 71.37% (2014 年 12 月 31 日，本基金持有 1,245,131,152.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 73.36%)。

7.4.11 利润分配情况**7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金本报告期内及上年度可比期间无利润分配。

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**

本基金本报告期末及上年度可比期末无因认购新发/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
000002	万科 A	2015 年 12 月 18 日	重大资产重组	24.43	-	-	40,700	769,880.20	994,301.00	-
300104	乐视网	2015 年 12 月 7 日	重大资产重组	58.80	-	-	13,800	707,462.33	811,440.00	-
600271	航天信息	2015 年 10 月 12 日	重大资产重组	71.47	-	-	8,600	480,470.21	614,642.00	-

			组							
601018	宁波港	2015 年 8 月 4 日	重大资产重组	8.16	2016 年 2 月 22 日	7.34	51,600	421,081.99	421,056.00	-
600690	青岛海尔	2015 年 10 月 19 日	重大资产重组	9.92	2016 年 2 月 1 日	8.93	38,700	383,883.92	383,904.00	-
600153	建发股份	2015 年 6 月 29 日	重大资产重组	14.69	-	-	21,500	372,165.00	315,835.00	-
000876	新希望	2015 年 8 月 17 日	重大事项	18.99	2016 年 3 月 2 日	17.09	12,900	244,978.12	244,971.00	-
601377	兴业证券	2015 年 12 月 29 日	重大事项	11.00	2016 年 1 月 7 日	9.40	12,000	136,404.37	132,000.00	-
600578	京能电力	2015 年 11 月 5 日	重大资产重组	6.07	2016 年 2 月 23 日	6.07	17,200	104,382.38	104,404.00	-
600873	梅花生物	2015 年 12 月 17 日	重大事项	9.14	-	-	11,300	99,661.40	103,282.00	-
600649	城投控股	2015 年 12 月 30 日	重大资产重组	23.16	2016 年 1 月 7 日	20.84	4,300	96,344.28	99,588.00	-
002065	东华软件	2015 年 12 月 21 日	重大事项	25.10	-	-	3,789	88,565.17	95,103.90	-
002465	海格通信	2015 年 12 月 30 日	重大事项	16.69	2016 年 2 月 4 日	15.02	4,900	83,655.80	81,781.00	-
000712	锦龙股份	2015 年 12 月 25 日	重大事项	29.12	2016 年 1 月 4 日	28.00	1,600	46,007.53	46,592.00	-
600783	鲁信创投	2015 年 12 月 31 日	重大事项	39.07	2016 年 1 月 4 日	37.60	900	38,747.67	35,163.00	-

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

本基金本报告期末及上年度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

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为被动式指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和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。本基金投资的金融工具主要包括基金投资和股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”的风险收益目标。

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工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2014 年 12 月 31 日：同）。

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。本基金所持目标 ETF 份额能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出，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 2015 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，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、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	15,767,938.83	-	-	-	15,767,938.83
结算备付金	39,939,530.62	-	-	-	39,939,530.62
存出保证金	5,272,783.28	-	-	-	5,272,783.28

交易性金融资产	-	-	-	908,992,718.30	908,992,718.30
应收证券清算款	-	-	-	10,510,796.57	10,510,796.57
应收利息	-	-	-	17,587.48	17,587.48
应收申购款	41,591.65	-	-	75,220.84	116,812.49
资产总计	61,021,844.38	-	-	919,596,323.19	980,618,167.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,365,296.87	3,365,296.87
应付管理人报酬	-	-	-	56,675.22	56,675.22
应付托管费	-	-	-	11,335.03	11,335.03
应付交易费用	-	-	-	1,660,146.94	1,660,146.94
其他负债	-	-	-	195,721.84	195,721.84
负债总计	-	-	-	5,289,175.90	5,289,175.90
利率敏感度缺口	61,021,844.38	-	-	914,307,147.29	975,328,991.67
上年度末 2014 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	101,747,872.31	-	-	-	101,747,872.31
结算备付金	8,373,234.96	-	-	-	8,373,234.96
存出保证金	217,660.89	-	-	-	217,660.89
交易性金融资产	-	-	-	1,759,790,469.05	1,759,790,469.05
应收利息	-	-	-	23,657.30	23,657.30
应收申购款	440,364.41	-	-	11,477,335.91	11,917,700.32
资产总计	110,779,132.57	-	-	1,771,291,462.26	1,882,070,594.83
负债					
应付证券清算款	-	-	-	7,725,603.63	7,725,603.63
应付赎回款	-	-	-	21,814,892.78	21,814,892.78
应付管理人报酬	-	-	-	67,302.05	67,302.05
应付托管费	-	-	-	13,460.43	13,460.43
应付交易费用	-	-	-	1,386,712.15	1,386,712.15
其他负债	-	-	-	459,599.62	459,599.62
负债总计	-	-	-	31,467,570.66	31,467,570.66
利率敏感度缺口	110,779,132.57	-	-	1,739,823,891.60	1,850,603,024.17

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

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(2014 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出的目标 ETF 份额以及证券交易所上市的股票和债券，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。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 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	22,015,928.20	2.26	19,097,118.55	1.03
交易性金融资产-基金投资	886,976,790.10	90.94	1,740,693,350.50	94.06
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	908,992,718.30	93.20	1,759,790,469.05	95.09

注：交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标 ETF 份额。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5	增加约 4,690	增加约 8,751

	2. 沪深 300 指数下降 5	减少约 4,690	减少约 8,751
--	------------------	-----------	-----------

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 904,508,655.40 元，属于第二层次的余额为 4,484,062.90 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 1,758,996,392.05 元，第二层次 794,077.00，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。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 16 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 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	22,015,928.20	2.25
	其中：股票	22,015,928.20	2.25
2	基金投资	886,976,790.10	90.45
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	55,707,469.45	5.68
8	其他各项资产	15,917,979.82	1.62
9	合计	980,618,167.57	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	15,876.00	0.00
B	采矿业	595,623.89	0.06
C	制造业	7,468,189.67	0.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	812,906.42	0.08
E	建筑业	665,173.94	0.07

F	批发和零售业	700,109.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	1,083,356.40	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,977,368.38	0.20
J	金融业	6,070,468.91	0.62
K	房地产业	1,683,582.35	0.17
L	租赁和商务服务业	179,897.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	189,425.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,685.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	436,316.24	0.04
S	综合	113,950.00	0.01
	合计	22,015,928.20	2.26

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

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

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	000002	万科 A	40,700	994,301.00	0.10
2	300104	乐视网	13,800	811,440.00	0.08
3	601318	中国平安	19,120	688,320.00	0.07
4	600271	航天信息	8,600	614,642.00	0.06
5	600016	民生银行	52,152	502,745.28	0.05
6	601018	宁波港	51,600	421,056.00	0.04
7	600519	贵州茅台	1,871	408,233.49	0.04
8	601166	兴业银行	23,500	401,145.00	0.04
9	600690	青岛海尔	38,700	383,904.00	0.04
10	600036	招商银行	18,221	327,795.79	0.03
11	600153	建发股份	21,500	315,835.00	0.03

12	600000	浦发银行	16,470	300,906.90	0.03
13	601328	交通银行	41,600	267,904.00	0.03
14	600030	中信证券	13,802	267,068.70	0.03
15	000876	新希望	12,900	244,971.00	0.03
16	600837	海通证券	14,329	226,684.78	0.02
17	601288	农业银行	67,400	217,702.00	0.02
18	601766	中国中车	16,197	208,131.45	0.02
19	601169	北京银行	17,900	188,487.00	0.02
20	000651	格力电器	8,400	187,740.00	0.02
21	600887	伊利股份	10,696	175,735.28	0.02
22	601398	工商银行	38,100	174,498.00	0.02
23	601668	中国建筑	26,511	168,079.74	0.02
24	601601	中国太保	5,501	158,758.86	0.02
25	601989	中国重工	16,200	152,280.00	0.02
26	002153	石基信息	1,000	151,000.00	0.02
27	601988	中国银行	37,100	148,771.00	0.02
28	001979	招商蛇口	7,053	147,125.58	0.02
29	000538	云南白药	1,920	139,430.40	0.01
30	601377	兴业证券	12,000	132,000.00	0.01
31	300024	机器人	1,900	130,150.00	0.01
32	002292	奥飞动漫	2,500	129,275.00	0.01
33	000725	京东方 A	41,900	124,443.00	0.01
34	600637	东方明珠	3,262	123,597.18	0.01
35	600104	上汽集团	5,805	123,182.10	0.01
36	000333	美的集团	3,732	122,484.24	0.01
37	600048	保利地产	11,400	121,296.00	0.01
38	000001	平安银行	10,100	121,099.00	0.01
39	002739	万达院线	1,000	120,000.00	0.01
40	601818	光大银行	28,100	119,144.00	0.01
41	600900	长江电力	8,700	117,972.00	0.01
42	300059	东方财富	2,200	114,466.00	0.01
43	601688	华泰证券	5,800	114,376.00	0.01
44	600015	华夏银行	9,340	113,387.60	0.01
45	600999	招商证券	5,133	111,386.10	0.01
46	601390	中国中铁	9,900	108,108.00	0.01
47	002024	苏宁云商	7,800	104,910.00	0.01
48	600578	京能电力	17,200	104,404.00	0.01
49	600873	梅花生物	11,300	103,282.00	0.01
50	000776	广发证券	5,200	101,140.00	0.01

51	600276	恒瑞医药	2,057	101,039.84	0.01
52	600649	城投控股	4,300	99,588.00	0.01
53	000423	东阿阿胶	1,900	99,370.00	0.01
54	002065	东华软件	3,789	95,103.90	0.01
55	600518	康美药业	5,500	93,225.00	0.01
56	000858	五粮液	3,400	92,752.00	0.01
57	600050	中国联通	15,000	92,700.00	0.01
58	600028	中国石化	18,533	91,923.68	0.01
59	601006	大秦铁路	10,514	90,630.68	0.01
60	002450	康得新	2,300	87,630.00	0.01
61	000166	申万宏源	7,824	83,795.04	0.01
62	601628	中国人寿	2,915	82,523.65	0.01
63	601186	中国铁建	6,100	82,228.00	0.01
64	000963	华东医药	1,000	81,960.00	0.01
65	002465	海格通信	4,900	81,781.00	0.01
66	000063	中兴通讯	4,200	78,246.00	0.01
67	601985	中国核电	8,200	78,228.00	0.01
68	000826	启迪桑德	1,900	75,278.00	0.01
69	000783	长江证券	5,900	73,278.00	0.01
70	002415	海康威视	2,100	72,219.00	0.01
71	601857	中国石油	8,600	71,810.00	0.01
72	002304	洋河股份	1,044	71,555.76	0.01
73	002594	比亚迪	1,100	70,840.00	0.01
74	300027	华谊兄弟	1,700	70,516.00	0.01
75	601901	方正证券	7,200	69,120.00	0.01
76	600795	国电电力	17,400	68,382.00	0.01
77	601939	建设银行	11,800	68,204.00	0.01
78	000625	长安汽车	4,001	67,896.97	0.01
79	002673	西部证券	2,000	65,820.00	0.01
80	600011	华能国际	7,419	64,767.87	0.01
81	601211	国泰君安	2,700	64,530.00	0.01
82	000100	TCL 集团	15,100	64,326.00	0.01
83	002202	金风科技	2,800	63,812.00	0.01
84	600010	包钢股份	17,200	62,092.00	0.01
85	601009	南京银行	3,500	61,950.00	0.01
86	601099	太平洋	6,300	61,866.00	0.01
87	601555	东吴证券	3,800	61,066.00	0.01
88	002475	立讯精密	1,900	60,705.00	0.01
88	600585	海螺水泥	3,550	60,705.00	0.01

89	601727	上海电气	5,200	60,008.00	0.01
90	002230	科大讯飞	1,600	59,280.00	0.01
91	600705	中航资本	3,800	59,204.00	0.01
92	601899	紫金矿业	16,700	58,784.00	0.01
93	601669	中国电建	7,300	58,619.00	0.01
94	600893	中航动力	1,300	58,539.00	0.01
95	600332	白云山	1,900	57,513.00	0.01
96	601336	新华保险	1,101	57,483.21	0.01
97	000069	华侨城 A	6,500	57,200.00	0.01
98	600340	华夏幸福	1,854	56,954.88	0.01
99	300070	碧水源	1,100	56,947.00	0.01
100	601198	东兴证券	1,900	56,943.00	0.01
101	600703	三安光电	2,314	56,183.92	0.01
102	600485	信威集团	2,100	56,175.00	0.01
103	600100	同方股份	3,100	56,048.00	0.01
104	300315	掌趣科技	4,000	56,000.00	0.01
105	601919	中国远洋	6,200	55,924.00	0.01
106	002241	歌尔声学	1,600	55,360.00	0.01
107	600383	金地集团	3,981	54,937.80	0.01
108	601021	春秋航空	900	54,900.00	0.01
109	600111	北方稀土	3,906	54,762.12	0.01
110	603885	吉祥航空	1,600	54,672.00	0.01
111	600089	特变电工	4,619	54,365.63	0.01
112	300017	网宿科技	900	53,991.00	0.01
113	600085	同仁堂	1,192	53,175.12	0.01
114	600029	南方航空	6,200	53,134.00	0.01
115	000917	电广传媒	2,000	53,120.00	0.01
116	002142	宁波银行	3,400	52,734.00	0.01
117	601088	中国神华	3,500	52,395.00	0.01
118	601618	中国中冶	8,600	51,772.00	0.01
119	600066	宇通客车	2,300	51,727.00	0.01
120	600109	国金证券	3,200	51,584.00	0.01
121	600886	国投电力	5,993	50,041.55	0.01
122	600369	西南证券	5,040	49,896.00	0.01
123	000768	中航飞机	2,000	49,540.00	0.01
124	600570	恒生电子	800	48,776.00	0.01
125	600019	宝钢股份	8,700	48,546.00	0.00
126	600009	上海机场	1,636	48,294.72	0.00
127	601600	中国铝业	9,700	48,209.00	0.00

128	601788	光大证券	2,100	48,174.00	0.00
129	600352	浙江龙盛	4,100	47,724.00	0.00
130	600739	辽宁成大	2,100	47,460.00	0.00
131	600038	中直股份	900	47,457.00	0.00
132	600804	鹏博士	2,000	47,440.00	0.00
133	000728	国元证券	2,100	47,439.00	0.00
134	600535	天士力	1,154	47,221.68	0.00
135	000581	威孚高科	1,900	47,044.00	0.00
136	600372	中航电子	1,900	46,797.00	0.00
137	000712	锦龙股份	1,600	46,592.00	0.00
138	600196	复星医药	1,950	45,805.50	0.00
139	600115	东方航空	6,000	45,660.00	0.00
140	600177	雅戈尔	2,800	45,584.00	0.00
141	000559	万向钱潮	2,000	45,260.00	0.00
142	601866	中海集运	6,400	45,056.00	0.00
143	600031	三一重工	6,800	44,744.00	0.00
144	002236	大华股份	1,200	44,280.00	0.00
145	600415	小商品城	4,800	44,112.00	0.00
146	000793	华闻传媒	2,900	43,587.00	0.00
147	000503	海虹控股	1,300	43,537.00	0.00
148	600718	东软集团	1,400	43,470.00	0.00
149	600406	国电南瑞	2,606	43,468.08	0.00
150	600118	中国卫星	1,011	43,007.94	0.00
151	600958	东方证券	1,800	41,922.00	0.00
152	300124	汇川技术	887	41,866.40	0.00
153	600150	中国船舶	1,200	41,796.00	0.00
154	601888	中国国旅	700	41,517.00	0.00
155	002736	国信证券	2,100	41,475.00	0.00
156	000009	中国宝安	2,300	41,308.00	0.00
157	000157	中联重科	7,700	41,195.00	0.00
158	600674	川投能源	3,800	40,888.00	0.00
159	000338	潍柴动力	4,220	40,765.20	0.00
160	600221	海南航空	10,400	40,456.00	0.00
161	601998	中信银行	5,600	40,432.00	0.00
162	002456	欧菲光	1,300	40,326.00	0.00
163	000623	吉林敖东	1,300	40,235.00	0.00
164	601607	上海医药	2,000	39,820.00	0.00
165	300058	蓝色光标	2,700	39,771.00	0.00
166	002252	上海莱士	1,000	39,770.00	0.00

167	600315	上海家化	1,000	39,490.00	0.00
168	601111	中国国航	4,600	39,468.00	0.00
169	002008	大族激光	1,500	38,835.00	0.00
170	600068	葛洲坝	4,900	38,563.00	0.00
171	600867	通化东宝	1,400	38,038.00	0.00
172	600839	四川长虹	6,500	37,635.00	0.00
173	600895	张江高科	1,300	37,479.00	0.00
174	603288	海天味业	1,055	37,294.25	0.00
175	600018	上港集团	5,700	36,936.00	0.00
176	000686	东北证券	2,100	36,750.00	0.00
177	000895	双汇发展	1,798	36,697.18	0.00
178	600256	广汇能源	5,500	36,685.00	0.00
179	601106	中国一重	4,600	36,662.00	0.00
180	600660	福耀玻璃	2,400	36,456.00	0.00
181	601933	永辉超市	3,600	36,360.00	0.00
182	601800	中国交建	2,700	36,207.00	0.00
183	000156	华数传媒	1,100	36,080.00	0.00
184	600252	中恒集团	4,900	35,966.00	0.00
185	600023	浙能电力	4,800	35,952.00	0.00
186	002385	大北农	2,900	35,409.00	0.00
187	600783	鲁信创投	900	35,163.00	0.00
188	600583	海油工程	3,900	34,905.00	0.00
189	300003	乐普医疗	900	34,740.00	0.00
190	600309	万华化学	1,900	33,915.00	0.00
191	002500	山西证券	2,200	33,528.00	0.00
192	600398	海澜之家	2,400	33,504.00	0.00
193	600663	陆家嘴	664	33,292.96	0.00
194	000568	泸州老窖	1,199	32,516.88	0.00
195	000060	中金岭南	2,300	32,269.00	0.00
196	000425	徐工机械	7,500	31,875.00	0.00
197	002399	海普瑞	900	31,833.00	0.00
198	601098	中南传媒	1,300	31,070.00	0.00
199	601718	际华集团	2,700	30,969.00	0.00
200	000750	国海证券	2,400	30,840.00	0.00
201	600588	用友网络	962	30,601.22	0.00
202	000402	金融街	2,621	30,220.13	0.00
203	600642	申能股份	4,000	30,200.00	0.00
204	000046	泛海控股	2,400	30,120.00	0.00
205	601333	广深铁路	6,000	30,060.00	0.00

206	600027	华电国际	4,300	29,240.00	0.00
207	600741	华域汽车	1,732	29,201.52	0.00
208	000413	东旭光电	3,200	29,056.00	0.00
209	600820	隧道股份	2,700	28,728.00	0.00
210	600875	东方电气	2,100	28,623.00	0.00
211	600157	永泰能源	5,945	28,357.65	0.00
212	300144	宋城演艺	1,000	28,300.00	0.00
213	002129	中环股份	2,300	28,106.00	0.00
214	002081	金螳螂	1,500	28,020.00	0.00
215	000415	渤海租赁	3,100	27,962.00	0.00
216	002422	科伦药业	1,500	27,900.00	0.00
217	000629	攀钢钒钛	7,600	27,892.00	0.00
218	002146	荣盛发展	2,900	27,637.00	0.00
219	600060	海信电器	1,400	27,538.00	0.00
220	300002	神州泰岳	2,100	27,510.00	0.00
221	000039	中集集团	1,300	27,300.00	0.00
222	601991	大唐发电	5,300	27,242.00	0.00
223	000061	农产品	1,500	26,535.00	0.00
224	601633	长城汽车	2,200	26,488.00	0.00
225	601872	招商轮船	3,700	26,233.00	0.00
226	600489	中金黄金	2,600	25,818.00	0.00
227	000792	盐湖股份	1,000	25,680.00	0.00
228	000778	新兴铸管	3,900	25,311.00	0.00
229	600688	上海石化	3,900	25,272.00	0.00
230	600547	山东黄金	1,200	25,200.00	0.00
231	000738	中航动控	790	24,979.80	0.00
232	000709	河北钢铁	7,500	24,975.00	0.00
233	000831	五矿稀土	1,200	24,840.00	0.00
234	600005	武钢股份	7,100	24,637.00	0.00
235	601179	中国西电	3,600	24,516.00	0.00
236	000630	铜陵有色	6,700	23,986.00	0.00
237	601117	中国化学	3,480	23,977.20	0.00
238	300015	爱尔眼科	750	23,685.00	0.00
239	600362	江西铜业	1,500	23,610.00	0.00
240	600373	中文传媒	1,000	23,490.00	0.00
241	002038	双鹭药业	700	23,450.00	0.00
242	600208	新湖中宝	4,900	23,373.00	0.00
243	000883	湖北能源	3,800	23,332.00	0.00
244	600863	内蒙华电	5,200	23,244.00	0.00

245	600827	百联股份	1,300	23,231.00	0.00
246	000800	一汽轿车	1,400	22,918.00	0.00
247	002353	杰瑞股份	900	22,842.00	0.00
248	603000	人民网	1,000	22,810.00	0.00
249	000598	兴蓉环境	3,200	22,784.00	0.00
250	601238	广汽集团	1,000	22,570.00	0.00
251	601216	君正集团	1,960	22,442.00	0.00
252	002470	金正大	1,100	22,374.00	0.00
253	601258	庞大集团	5,700	22,344.00	0.00
254	300146	汤臣倍健	580	22,330.00	0.00
255	600021	上海电力	1,500	22,080.00	0.00
256	002007	华兰生物	500	22,000.00	0.00
257	600170	上海建工	3,100	21,948.00	0.00
258	300133	华策影视	736	21,925.44	0.00
259	300251	光线传媒	720	21,808.80	0.00
260	601928	凤凰传媒	1,300	20,709.00	0.00
261	601992	金隅股份	2,200	20,614.00	0.00
262	000027	深圳能源	2,100	20,601.00	0.00
263	000729	燕京啤酒	2,500	20,575.00	0.00
264	600959	江苏有线	1,000	20,560.00	0.00
265	603993	洛阳钼业	4,600	20,516.00	0.00
266	002410	广联达	1,100	19,998.00	0.00
267	601898	中煤能源	3,300	19,965.00	0.00
268	000400	许继电气	1,000	19,430.00	0.00
269	000540	中天城投	2,100	19,152.00	0.00
270	000999	华润三九	700	19,110.00	0.00
271	002375	亚厦股份	1,200	18,924.00	0.00
272	600633	浙报传媒	1,000	18,830.00	0.00
273	002195	二三四五	500	18,500.00	0.00
274	600648	外高桥	700	18,389.00	0.00
275	600166	福田汽车	2,900	18,357.00	0.00
276	002294	信立泰	600	18,072.00	0.00
277	600008	首创股份	1,700	17,323.00	0.00
278	601225	陕西煤业	3,546	17,233.56	0.00
279	600717	天津港	1,500	16,905.00	0.00
280	000825	太钢不锈	4,100	16,810.00	0.00
281	600600	青岛啤酒	500	16,600.00	0.00
282	000983	西山煤电	2,700	16,416.00	0.00
283	600317	营口港	3,400	16,150.00	0.00

284	601118	海南橡胶	2,100	15,876.00	0.00
285	601808	中海油服	1,000	15,520.00	0.00
286	000898	鞍钢股份	3,200	15,264.00	0.00
287	601608	中信重工	2,100	14,385.00	0.00
288	601016	节能风电	900	14,202.00	0.00
289	601958	金钼股份	1,700	14,076.00	0.00
290	601699	潞安环能	2,100	13,482.00	0.00
291	600549	厦门钨业	700	13,167.00	0.00
292	000539	粤电力 A	1,600	11,760.00	0.00
293	601158	重庆水务	1,100	10,263.00	0.00
294	600998	九州通	500	9,800.00	0.00
295	000937	冀中能源	1,900	9,576.00	0.00
296	601969	海南矿业	600	8,454.00	0.00
297	600350	山东高速	1,100	7,821.00	0.00
298	601231	环旭电子	500	7,230.00	0.00
299	600188	兖州煤业	700	6,615.00	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	601318	中国平安	77,161,511.04	4.17
2	600036	招商银行	55,159,523.38	2.98
3	600016	民生银行	50,938,858.66	2.75
4	600030	中信证券	40,654,217.11	2.20
5	601166	兴业银行	37,316,862.72	2.02
6	600000	浦发银行	34,672,297.13	1.87
7	600837	海通证券	34,330,463.87	1.86
8	000002	万科 A	25,232,427.44	1.36
9	601988	中国银行	24,448,543.73	1.32
10	601668	中国建筑	23,094,606.57	1.25
11	601328	交通银行	22,196,217.96	1.20
12	601390	中国中铁	21,314,516.06	1.15
13	600519	贵州茅台	21,217,216.90	1.15
14	000651	格力电器	21,103,842.45	1.14

15	600887	伊利股份	20,279,448.02	1.10
16	601989	中国重工	18,921,890.76	1.02
17	601766	中国中车	18,405,686.00	0.99
18	601601	中国太保	18,147,281.91	0.98
19	601288	农业银行	17,490,800.00	0.95
20	000001	平安银行	17,245,887.04	0.93

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	601318	中国平安	113,830,984.74	6.15
2	600036	招商银行	81,166,365.54	4.39
3	600016	民生银行	76,175,261.97	4.12
4	600030	中信证券	62,184,447.17	3.36
5	601166	兴业银行	55,450,401.40	3.00
6	600000	浦发银行	52,265,295.19	2.82
7	600837	海通证券	51,702,551.00	2.79
8	000002	万科 A	37,839,583.17	2.04
9	601668	中国建筑	34,318,598.28	1.85
10	000651	格力电器	33,246,404.98	1.80
11	601988	中国银行	32,951,300.68	1.78
12	601328	交通银行	32,891,995.84	1.78
13	600519	贵州茅台	31,561,015.59	1.71
14	600887	伊利股份	31,115,007.75	1.68
15	601989	中国重工	28,410,042.11	1.54
16	601601	中国太保	27,419,084.75	1.48
17	601818	光大银行	27,081,790.71	1.46
18	601288	农业银行	26,175,458.48	1.41
19	000001	平安银行	25,768,853.24	1.39
20	601398	工商银行	24,287,561.06	1.31

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	1,870,493,666.91
卖出股票收入（成交）总额	2,862,730,582.70

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

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

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

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

本基金本报告期末投资贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	南方 300	股票型	交易型开放式	南方基金管理有限公司	886,976,790.10	90.94

8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1601	IF1601	20	22,036,800.00	-312,060.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-312,060.00
股指期货投资本期收益(元)					-4,822,440.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-312,060.00

8.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，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，利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票和目标 ETF 仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪标的指数的目的。

8.12 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。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1

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。

8.13.2

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。

8.13.3 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	5,272,783.28
2	应收证券清算款	10,510,796.57
3	应收股利	-
4	应收利息	17,587.48
5	应收申购款	116,812.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,917,979.82

8.13.4 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。

8.13.5 期末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	占基金资产净值比	流通受限情况说明
----	------	------	------------	----------	----------

			值	例 (%)	
1	000002	万科 A	994,301.00	0.10	重大资产重组
2	300104	乐视网	811,440.00	0.08	重大资产重组
3	600271	航天信息	614,642.00	0.06	重大资产重组
4	601018	宁波港	421,056.00	0.04	重大资产重组
5	600690	青岛海尔	383,904.00	0.04	重大资产重组

§ 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

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
37,882	19,921.99	155,719,871.02	20.63%	598,964,888.40	79.37%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	4,763,578.24	0.6312%

9.3 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

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2009 年 3 月 25 日) 基金份额总额	1,580,754,997.47
----------------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	1,488,479,410.58
本报告期基金总申购份额	2,134,331,650.82
减:本报告期基金总赎回份额	2,868,126,301.98
本报告期期末基金份额总额	754,684,759.42

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

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

根据南方基金管理有限公司第六届董事会第十四次会议审议通过，并向中国基金业协会报备，基金管理人于 2015 年 5 月 29 日发布公告，聘任常克川、李海鹏为公司副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 91,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 7 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
中投证券	13,129,973,457.75	66.17%	2,811,865.13	66.74%	-	
华泰证券	21,367,021,216.10	28.90%	1,204,847.17	28.60%	-	
浙商证券	154,395,537.97	3.26%	140,562.55	3.34%	-	
光大证券	45,402,965.92	0.96%	41,334.73	0.98%	-	
中银证券	33,212,991.67	0.70%	30,237.62	0.72%	-	
长江证券	-	-	-	-	-	
兴业证券	-	-	-	-	-	
银河证券	-	-	-	-	-	
湘财证券	-	-	-	-	-	
方正证券	-	-	-	-	-	
广州证券	-	-	-	-	-	
广发证券	-	-	-15,989.53	-0.38%	-	
国信证券	-	-	-	-	-	
申银万国	-	-	-	-	-	
国泰君安	-	-	-	-	-	
平安证券	-	-	-	-	-	

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中投证券	78,531.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	164,319,094.51	100.00%
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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。

11.8 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	其他公告南方基金关于继续开展直销柜台部分指数型基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年12月31日
2	代销公告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
3	代销公告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
4	代销公告南方基金关于旗下部分基金参加中国光大银行电子渠道基金定投申购费率	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015年12月31日

	优惠活动的公告		
5	代销公告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
6	代销公告南方基金关于旗下部分基金增加乐清农商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 12 月 30 日
7	其他公告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
8	其他公告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
9	代销公告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
10	代销公告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
11	代销公告南方基金关于旗下部分基金增加锦州银行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 12 月 9 日
12	代销公告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
13	其他公告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
14	南方基金关于旗下部分基金增加唐鼎耀华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 11 月 30 日
15	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
16	其他公告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
17	代销公告南方基金关于旗下部分基金增加长安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公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 23 日
18	代销公告南方基金关于旗下部分基金增加成都农商银行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 11 月 18 日
19	其他公告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
20	代销公告南方基金关于旗下部分基金增加平安证券为代销机构并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 11 月 10 日
21	其他公告南方基金管理有限公司关于降低	中国证券报、上海证	2015 年 11 月 9 日

	旗下部分开放式基金申购最低金额限制的公告	券报、证券时报	
22	代销公告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
23	其他公告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 10 月 20 日
24	代销公告南方基金关于旗下部分基金增加新浪仓石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 16 日
25	代销公告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
26	代销公告南方基金关于旗下部分基金增加桂林银行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 10 月 15 日
27	其他公告南方基金关于继续开展直销柜台部分指数型基金赎回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 14 日
28	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 10 月 13 日
29	南方基金关于旗下部分基金增加积木基金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 9 月 30 日
30	代销公告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
31	代销公告南方基金关于旗下部分基金增加中经北证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 21 日
32	代销公告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
33	代销公告南方基金关于旗下部分基金增加广东南粤银行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 9 月 11 日
34	代销公告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 9 月 1 日
35	其他公告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
36	其他公告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 25 日
37	其他公告关于修订公司旗下开放式指数基金基金合同有关基金关联交易限制等投资限制条款的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 12 日

38	代销公告南方基金关于旗下部分基金增加诺亚正行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 8 月 10 日
39	其他公告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
40	代销公告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 8 月 3 日
41	代销公告南方基金关于旗下部分基金参加浦发银行网上银行、手机银行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 8 月 3 日
42	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
43	代销公告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
44	其他公告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 7 月 28 日
45	其他公告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 7 月 24 日
46	代销公告南方基金关于旗下部分基金增加龙江银行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 22 日
47	其他公告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 7 月 21 日
48	代销公告南方基金关于旗下部分基金增加厦门鑫鼎盛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
49	代销公告南方基金关于旗下部分基金增加泰康人寿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 7 月 20 日
50	其他公告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
51	其他公告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 7 月 15 日
52	其他公告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 7 月 11 日
53	其他公告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 7 月 10 日
54	其他公告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
55	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 7 月 8 日

56	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 7 月 4 日
57	代销公告南方基金关于旗下部分基金增加深圳农村商业银行、天津银行、威海市商业银行、厦门银行、顺德农村商业银行和东莞农村商业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 1 日
58	代销公告南方基金关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、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 6 月 30 日
59	其他公告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 6 月 26 日
60	其他公告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 6 月 20 日
61	其他公告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 6 月 19 日
62	其他公告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 6 月 12 日
63	其他公告南方基金关于电子直销平台开通货币基金快速转购业务并实行 0 费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 8 日
64	代销公告南方基金关于旗下部分基金参加中国农业银行网上银行、手机银行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 6 月 1 日
65	管理人公告南方基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 29 日
66	其他公告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 5 月 27 日
67	其他公告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 5 月 23 日
68	代销公告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 5 月 18 日
69	代销公告南方基金关于旗下部分基金增加华融湘江银行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 5 月 15 日
70	南方基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 7 日
71	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 5 月 5 日
72	管理人公告南方基金管理有限公司深圳分公司负责人等信息变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 28 日
73	管理人公告南方基金管理有限公司关于公司高级管理人员在子公司兼职情况变更的	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 23 日

	公告		
74	管理人公告南方基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼任职务情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 18 日
75	其他公告南方基金管理有限公司关于旗下部分指数型基金开展赎回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 4 月 16 日
76	其他公告关于电子直销业务增加苏宁易购第三方支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 15 日
77	其他公告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 4 月 14 日
78	其他公告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 4 月 10 日
79	其他公告南方基金关于淘宝直营店销售手续费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 4 月 10 日
80	代销公告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 4 月 8 日
81	其他公告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 4 月 8 日
82	其他公告南方基金关于网上直销汇款交易申购旗下部分基金费率为 0 的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 2 日
83	代销公告南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子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 4 月 1 日
84	南方基金关于旗下部分基金增加增财基金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 3 月 31 日
85	南方基金关于旗下部分基金增加苏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 3 月 27 日
86	其他公告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 3 月 24 日
87	代销公告南方基金关于旗下部分基金增加联泰资产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 3 月 23 日
88	代销公告南方基金关于旗下部分基金增加西安银行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 3 月 23 日
89	其他公告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 3 月 20 日
90	其他公告南方基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 17 日
91	代销公告南方基金关于旗下部分基金增加	中国证券报、上海证	2015 年 3 月 12 日

	南海农商银行为代销机构及开通定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	券报、证券时报	
92	管理人公告南方基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低赎回限额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 2 月 25 日
93	其他公告南方基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼任职务情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 2 月 12 日
94	其他公告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 2 月 3 日
95	南方基金关于南方开元沪深 300ETF 联接基金参加中国农业银行网上银行与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 1 月 12 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沪深 300 指数证券投资基金的文件。
- 2、《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》。
- 3、《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》。
- 4、《南方沪深 300 指数证券投资基金基金合同》。
- 5、《南方沪深 300 指数证券投资基金托管协议》。
- 6、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 7、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>