

深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	48
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末上市基金前十名持有人	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	50
§9 开放式基金份额变动	50
§10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	53
§11 备查文件目录	53
11.1 备查文件目录	53
11.2 存放地点	54
11.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方深证成份 ETF
场内简称	深成 ETF
基金主代码	159903
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 4 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
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	484,154,507.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 2 月 2 日

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

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整或成份股发生配股、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，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为深证成份指数。如果指数编制单位变更或停止深证成份指数的编制及发布、或深证成份指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致深证成份指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	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	易会满

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-31,209,439.65
本期利润	-100,559,401.71
加权平均基金份额本期利润	-0.2039
本期加权平均净值利润率	-18.98%
本期基金份额净值增长率	-16.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-115,053,022.97

期末可供分配基金份额利润	-0.2376
期末基金资产净值	541,105,446.03
期末基金份额净值	1.1176
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-17.54%

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

2. 期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

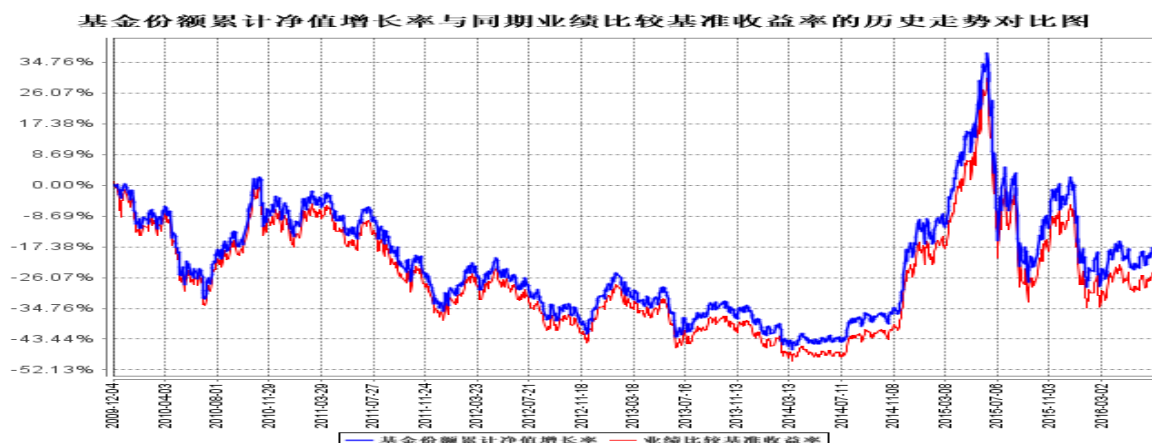
3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.44%	1.42%	3.25%	1.44%	0.19%	-0.02%
过去三个月	0.79%	1.49%	0.33%	1.52%	0.46%	-0.03%
过去六个月	-16.27%	2.34%	-17.17%	2.39%	0.90%	-0.05%
过去一年	-24.36%	2.63%	-26.84%	2.70%	2.48%	-0.07%
过去三年	40.92%	1.99%	36.33%	2.03%	4.59%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-17.54%	1.74%	-24.45%	1.78%	6.91%	-0.04%

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 5,600 亿元，旗下一管理 96 只开放式基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柯晓	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日	-	19 年	美国纽约大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾先后担任美国美林证券公司助理副总裁、招商证券首席产品策略师。2006 年加入南方基金，任首席产品设计师；2010 年 8 月至今，任小康 ETF 及南方小康基金经理；2013 年 4 月至今，任南方深成及南方深成 ETF 的基金经理；2013 年 5 月至今，任南方上证 380ETF 及联接基金的基金经理；2015 年 7 月至今，任南方互联基金的基金经理。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合同单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

例换购)所带来的成份股权重偏离,对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行应对;②指数成份股调整所带来的跟踪误差是不容忽视的,是本基金跟踪误差的另一主要来源,尤其是本次成份股扩容改造带来了一定的跟踪误差。为此,本基金管理组提前进行了全面模拟测算,并制定了周密的调仓方案,从实施结果来看,本基金成份股调仓较为成功。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金自上市日至本报告期末的指数跟踪期间,相对于标的指数的年化跟踪误差为 0.862%,较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过 2%的投资目标。

截至报告期末,本基金份额净值为 1.1176 元,报告期内,份额净值增长率为-16.27%,同期业绩基准增长率为-17.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。基金管理人根据基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益分配每年最多 12 次，每次基金收益分配比例不低于基金收益分配基准日可供分配利润的 5%。基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；本基金收益分配采取现金分红方式；《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对深证成份交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.4.1	3,191,394.03	11,558,730.82
结算备付金		63,841.28	65,058.20
存出保证金		5,608.16	89,389.80
交易性金融资产	6.4.4.2	539,150,084.75	624,978,907.28
其中：股票投资		539,100,484.75	624,978,907.28
基金投资		-	-
债券投资		49,600.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		25,198.98	-
应收利息	6.4.4.5	575.44	2,399.97
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		542,436,702.64	636,694,486.07
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		721,513.74	9,927,903.35
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		219,702.52	272,948.92
应付托管费		43,940.51	54,589.77
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.4.7	19,422.74	9,051.96
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	326,677.10	240,648.71
负债合计		1,331,256.61	10,505,142.71
所有者权益：			
实收基金	6.4.4.9	656,158,469.00	635,829,468.86
未分配利润	6.4.4.10	-115,053,022.97	-9,640,125.50
所有者权益合计		541,105,446.03	626,189,343.36
负债和所有者权益总计		542,436,702.64	636,694,486.07

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1176 元，基金份额总额 484,154,507.00 份。

6.2 利润表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-98,580,644.77	533,738,619.46
1.利息收入		22,256.22	73,608.57
其中：存款利息收入	6.4.4.11	22,243.72	73,608.57
债券利息收入		12.50	-
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）		-29,163,185.72	1,059,526,465.30
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-32,254,171.41	1,053,184,870.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.4.14	-	-
衍生工具收益	6.4.4.15	-	-
股利收益	6.4.4.16	3,090,985.69	6,341,594.50
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.17	-69,349,962.06	-527,324,363.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	-89,753.21	1,462,908.65
减：二、费用		1,978,756.94	7,143,394.43

1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	1,319,054.91	4,079,724.49
2. 托管费	6.4.7.2.2	263,810.98	815,944.94
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.4.19	69,021.95	1,779,012.36
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.4.20	326,869.10	468,712.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-100,559,401.71	526,595,225.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-100,559,401.71	526,595,225.03

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	635,829,468.86	-9,640,125.50	626,189,343.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-100,559,401.71	-100,559,401.71
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）	20,329,000.14	-4,853,495.76	15,475,504.38
其中：1. 基金申购款	105,710,800.68	-22,545,394.97	83,165,405.71
2. 基金赎回款	-85,381,800.54	17,691,899.21	-67,689,901.33
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）	656,158,469.00	-115,053,022.97	541,105,446.03
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,156,032,099.57	-315,390,173.40	1,840,641,926.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	526,595,225.03	526,595,225.03
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,296,583,629.30	-133,694,241.23	-1,430,277,870.53
其中：1. 基金申购款	2,590,727,777.57	205,900,938.14	2,796,628,715.71
2. 基金赎回款	-3,887,311,406.87	-339,595,179.37	-4,226,906,586.24
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）	859,448,470.27	77,510,810.40	936,959,280.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨小松

基金管理人负责人

徐超

主管会计工作负责人

徐超

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、 财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入 亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

6.4.4 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	3, 191, 394. 03
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—

其他存款	-
合计：	3,191,394.03

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	647,021,507.15	539,100,484.75	-107,921,022.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	49,600.00	49,600.00
	银行间市场	-	-
	合计	49,600.00	49,600.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	647,071,107.15	539,150,084.75	-107,921,022.40

注：股票投资的公允价值和公允价值变动均包含可退替代款的估值增值。

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 买入返售金融资产

6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	544.22
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	16.47
应收债券利息	12.50
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	2.25
合计	575.44

6.4.4.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	19,422.74
银行间市场应付交易费用	—
合计	19,422.74

6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提费用	212,332.12
指数使用费	114,344.98
应退替代款	—
可退替代款	—
合计	326,677.10

注：①应退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

②可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	469,154,507.00	635,829,468.86
本期申购	78,000,000.00	105,710,800.68
本期赎回(以“-”号填列)	-63,000,000.00	-85,381,800.54
本期末	484,154,507.00	656,158,469.00

6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	217,278,246.88	-226,918,372.38	-9,640,125.50
本期利润	-31,209,439.65	-69,349,962.06	-100,559,401.71
本期基金份额交易产生的变动数	7,259,151.39	-12,112,647.15	-4,853,495.76
其中：基金申购款	34,599,293.12	-57,144,688.09	-22,545,394.97
基金赎回款	-27,340,141.73	45,032,040.94	17,691,899.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	193,327,958.62	-308,380,981.59	-115,053,022.97

6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	20,800.54
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,284.80
其他	158.38
合计	22,243.72

6.4.4.12 股票投资收益

6.4.4.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

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

股票投资收益——买卖股票差价收入	-12,003,730.04
股票投资收益——赎回差价收入	-20,250,441.37
合计	-32,254,171.41

6.4.4.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	49,450,062.24
减：卖出股票成本总额	61,453,792.28
买卖股票差价收入	-12,003,730.04

6.4.4.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	67,689,901.33
减：现金支付赎回款总额	2,098,180.33
减：赎回股票成本总额	85,842,162.37
赎回差价收入	-20,250,441.37

6.4.4.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.4.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无买卖资产支持证券投资收益。

6.4.4.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.4.15 衍生工具收益

本基金本报告期无买卖权证差价收入

6.4.4.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,090,985.69

基金投资产生的股利收益	-
合计	3,090,985.69

6.4.4.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-69,349,962.06
——股票投资	-69,349,962.06
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-69,349,962.06

6.4.4.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	-89,753.21
合计	-89,753.21

注：替代损益指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购日估值的差额。

6.4.4.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	69,021.95
银行间市场交易费用	-
合计	69,021.95

6.4.4.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	33,316.92
信息披露费	149,179.94
上市年费	29,835.26
银行费用	192.00
指数使用费	114,344.98
合计	326,869.10

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.5.1 或有事项**

无。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司（“南方基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“深成 ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易**

无。

6.4.7.1.1 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金总 额的比例
华泰证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金总 额的比例
华泰证券	2,101.62	0.59%	2,101.62	0.49%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。

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

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,319,054.91	4,079,724.49
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.5% / 当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	263,810.98	815,944.94

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

6.4.7.2.3 销售服务费

无。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

无。

6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例
南方深证成份 ETF 联接基金	282,321,432.00	58.3123%	276,321,432.00	58.9000%

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

6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	3,191,394.03	20,800.54	1,559,443.09	58,925.42

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

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

注：本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单价	复牌日期	复牌 开盘单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科 A	2015 年 12 月 21 日	重大事项	24.43	2016 年 7 月 4 日	21.99	884,858	12,233,872.71	21,617,080.94	-
000651	格力电器	2016 年 2 月 22 日	重大事项	19.22	-	-	470,240	10,525,500.66	9,038,012.80	-
000728	国元证券	2016 年 6 月 8 日	重大事项	16.72	2016 年 7 月 8 日	17.37	117,864	2,972,990.60	1,970,686.08	-
002065	东华软件	2015 年 12 月 22 日	重大事项	25.10	2016 年 7 月 4 日	22.59	77,000	2,339,035.10	1,932,700.00	-
002465	海格通信	2016 年 6 月 13 日	重大事项	12.44	-	-	154,500	2,546,713.60	1,921,980.00	-
000718	苏宁环球	2016 年 1 月 4 日	重大事项	13.09	2016 年 7 月 18 日	11.78	97,296	1,067,176.96	1,273,604.64	-
000415	渤海金控	2016 年 2 月 1 日	重大事项	6.82	2016 年 08 月 11 日	7.50	172,360	1,605,662.11	1,175,495.20	-
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	重大事项	8.29	-	-	137,420	2,461,689.21	1,139,211.80	-
300142	沃森生物	2016 年 3 月 22 日	重大事项	11.16	-	-	98,500	1,321,388.85	1,099,260.00	-
000806	银河生物	2016 年 1 月 12 日	重大事项	19.44	2016 年 7 月 12 日	17.50	56,100	1,388,315.58	1,090,584.00	-
002280	联络互动	2016 年 4 月 25 日	重大事项	19.71	-	-	54,875	1,089,852.71	1,081,586.25	-
000547	航天发展	2016 年 4 月 19 日	重大事项	15.36	-	-	68,900	1,475,661.67	1,058,304.00	-
000511	*ST 烯碳	2016 年 4 月 26 日	重大事项	8.92	-	-	109,300	1,234,237.82	974,956.00	-
000629	*ST 钨钛	2016 年 5 月 26 日	重大事项	2.39	-	-	376,659	1,576,886.65	900,215.01	-
300166	东方国信	2016 年 6 月 8 日	重大事项	27.47	-	-	31,678	998,324.15	870,194.66	-
002266	浙富控股	2016 年 5 月 25 日	重大事项	5.35	-	-	141,430	1,441,569.13	756,650.50	-
002089	新海宜	2016 年 1 月 8 日	重大事项	16.88	2016 年 7 月 18 日	18.55	40,500	888,199.78	683,640.00	-

002672	东江环保	2016 年 5 月 23 日	重大事项	17.33	2016 年 7 月 15 日	19.06	38,400	827,664.20	665,472.00	-
002630	华西能源	2016 年 6 月 23 日	重大事项	11.06	-	-	59,900	808,362.61	662,494.00	-
002663	普邦园林	2016 年 4 月 28 日	重大事项	7.36	-	-	87,300	687,298.20	642,528.00	-
000975	银泰资源	2016 年 4 月 19 日	重大事项	15.00	-	-	41,100	677,266.48	616,500.00	-
002190	成飞集成	2016 年 4 月 21 日	重大事项	35.44	2016 年 7 月 12 日	38.98	17,200	799,731.64	609,568.00	-
002555	三七互娱	2016 年 3 月 10 日	重大事项	18.10	2016 年 8 月 16 日	19.91	33,200	772,719.21	600,920.00	-
002249	大洋电机	2016 年 6 月 8 日	重大事项	11.97	2016 年 7 月 28 日	10.77	50,034	602,923.38	598,906.98	-
000401	冀东水泥	2016 年 4 月 6 日	重大事项	10.90	2016 年 7 月 14 日	11.32	54,500	720,879.18	594,050.00	-
300032	金龙机电	2016 年 6 月 28 日	重大事项	20.10	2016 年 7 月 7 日	19.80	29,200	847,005.16	586,920.00	-
002373	千方科技	2016 年 5 月 12 日	重大事项	14.94	2016 年 8 月 16 日	16.43	38,800	713,112.79	579,672.00	-
002052	同洲电子	2016 年 1 月 12 日	重大事项	10.03	-	-	52,934	762,174.88	530,928.02	-
300111	向日葵	2016 年 6 月 14 日	重大事项	4.90	-	-	97,700	607,684.35	478,730.00	-
002432	九安医疗	2016 年 6 月 20 日	重大事项	18.14	2016 年 7 月 13 日	19.95	22,300	593,876.86	404,522.00	-
002071	长城影视	2016 年 6 月 16 日	重大事项	13.64	-	-	28,400	518,381.41	387,376.00	-
300052	中青宝	2016 年 6 月 8 日	重大事项	22.03	-	-	16,000	515,836.02	352,480.00	-
000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大事项	12.50	-	-	25,500	466,489.64	318,750.00	-
300413	快乐购	2016 年 6 月 20 日	重大事项	24.35	-	-	9,100	331,828.65	221,585.00	-
000553	沙隆达 A	2015 年 8 月 5 日	重大事项	10.68	-	-	19,700	297,824.83	210,396.00	-

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

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪深证成份指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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

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

6.4.10.2 信用风险

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发

行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单一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。

6.4.10.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

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 6.4.9 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所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。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.10.4 市场风险

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

6.4.10.4.1 利率风险

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

本基金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、存出保证金和债券投资等。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,191,394.03	-	-	-	3,191,394.03
结算备付金	63,841.28	-	-	-	63,841.28
存出保证金	5,608.16	-	-	-	5,608.16
交易性金融资产	49,600.00	-	-	539,100,484.75	539,150,084.75
应收利息	-	-	-	575.44	575.44
其他资产	-	-	-	25,198.98	25,198.98
资产总计	3,310,443.47	-	-	539,126,259.17	542,436,702.64
负债					
应付证券清算款	-	-	-	721,513.74	721,513.74
应付管理人报酬	-	-	-	219,702.52	219,702.52
应付托管费	-	-	-	43,940.51	43,940.51
应付交易费用	-	-	-	19,422.74	19,422.74
其他负债	-	-	-	326,677.10	326,677.10
负债总计	-	-	-	1,331,256.61	1,331,256.61
利率敏感度缺口	3,310,443.47	-	-	537,795,002.56	541,105,446.03
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,558,730.82	-	-	-	11,558,730.82
结算备付金	65,058.20	-	-	-	65,058.20
存出保证金	89,389.80	-	-	-	89,389.80
交易性金融资产	-	-	-	624,978,907.28	624,978,907.28
应收利息	-	-	-	2,399.97	2,399.97
资产总计	11,713,178.82	-	-	624,981,307.25	636,694,486.07
负债					
应付证券清算款	-	-	-	9,927,903.35	9,927,903.35
应付管理人报酬	-	-	-	272,948.92	272,948.92
应付托管费	-	-	-	54,589.77	54,589.77
应付交易费用	-	-	-	9,051.96	9,051.96
其他负债	-	-	-	240,648.71	240,648.71
负债总计	-	-	-	10,505,142.71	10,505,142.71
利率敏感度缺口	11,713,178.82	-	-	614,476,164.54	626,189,343.36

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

6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 06 月 30 日，本基金持有可转债公允价值 49,600.00 元，占基金净资产比例为 0.0092%（2015 年 12 月 31 日：未持有交易型债券投资），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015 年 12 月 31 日：同）。

6.4.10.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.10.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法跟踪深证成份指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，深证成份指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%，新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例不高于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	539,100,484.75	99.63	624,978,907.28	99.81
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	539,100,484.75	99.63	624,978,907.28	99.81

6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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（2016年6月 30日）	上年度末（2015年12月 31日）
	业绩比较基准上升 5%	增加约 2,644	增加约 3,042
	业绩比较基准下降 5%	减少约 2,644	减少约 3,042

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	539,100,484.75	99.38
	其中：股票	539,100,484.75	99.38
2	固定收益投资	49,600.00	0.01
	其中：债券	49,600.00	0.01
	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	3,255,235.31	0.60
7	其他各项资产	31,382.58	0.01
8	合计	542,436,702.64	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值，而 7.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	7,475,387.40	1.38
B	采矿业	8,017,907.01	1.48

C	制造业	303,297,741.63	56.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,201,190.80	1.52
E	建筑业	9,555,064.68	1.77
F	批发和零售业	14,225,133.16	2.63
G	交通运输、仓储和邮政业	1,761,714.00	0.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	71,805,602.95	13.27
J	金融业	35,430,924.52	6.55
K	房地产业	42,054,951.14	7.77
L	租赁和商务服务业	10,033,879.54	1.85
M	科学研究和技术服务业	1,178,080.00	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	7,562,673.33	1.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,924,022.84	0.54
R	文化、体育和娱乐业	13,373,125.35	2.47
S	综合	2,203,086.40	0.41
	合计	539,100,484.75	99.63

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资。

7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万科 A	884,858	21,617,080.94	3.99
2	000651	格力电器	470,240	9,038,012.80	1.67
3	000333	美的集团	309,707	7,346,250.04	1.36
4	000001	平安银行	771,012	6,707,804.40	1.24
5	000858	五粮液	180,041	5,856,733.73	1.08
6	000725	京东方 A	2,401,542	5,547,562.02	1.03

7	300104	乐视网	96,793	5,121,317.63	0.95
8	000776	广发证券	295,259	4,948,540.84	0.91
9	002024	苏宁云商	424,951	4,614,967.86	0.85
10	300059	东方财富	205,372	4,559,258.40	0.84
11	002450	康得新	250,609	4,285,413.90	0.79
12	002415	海康威视	192,321	4,127,208.66	0.76
13	002304	洋河股份	54,061	3,888,067.12	0.72
14	000783	长江证券	328,919	3,815,460.40	0.71
15	002594	比亚迪	53,536	3,266,231.36	0.60
16	000063	中兴通讯	225,833	3,238,445.22	0.60
17	300017	网宿科技	46,742	3,141,062.40	0.58
18	002736	国信证券	177,800	3,067,050.00	0.57
19	001979	招商蛇口	204,927	2,920,209.75	0.54
20	000423	东阿阿胶	54,371	2,872,419.93	0.53
21	000625	长安汽车	209,098	2,858,369.66	0.53
22	000166	申万宏源	338,040	2,842,916.40	0.53
23	000100	TCL 集团	863,371	2,840,490.59	0.52
24	000503	海虹控股	70,250	2,824,752.50	0.52
25	002230	科大讯飞	85,880	2,821,158.00	0.52
26	300024	机器人	107,790	2,736,788.10	0.51
27	000538	云南白药	42,386	2,725,419.80	0.50
28	002466	天齐锂业	61,980	2,645,926.20	0.49
29	002673	西部证券	100,840	2,607,722.40	0.48
30	002142	宁波银行	173,825	2,569,133.50	0.47
31	002241	歌尔声学	85,605	2,455,151.40	0.45
32	002202	金风科技	160,236	2,424,370.68	0.45
33	002739	万达院线	29,000	2,317,100.00	0.43
34	000768	中航飞机	116,990	2,303,533.10	0.43
35	000839	中信国安	107,400	2,288,694.00	0.42
36	000402	金融街	226,263	2,199,276.36	0.41
37	300070	碧水源	147,326	2,192,210.88	0.41
38	002456	欧菲光	74,201	2,188,929.50	0.40
39	000069	华侨城 A	335,849	2,149,433.60	0.40
40	002252	上海莱士	55,878	2,105,483.04	0.39
41	300027	华谊兄弟	155,075	2,099,715.50	0.39
42	000568	泸州老窖	69,092	2,052,032.40	0.38
43	002407	多氟多	47,800	2,035,802.00	0.38
44	000895	双汇发展	94,624	1,975,749.12	0.37
45	000728	国元证券	117,864	1,970,686.08	0.36

46	002405	四维图新	78,831	1,939,242.60	0.36
47	002065	东华软件	77,000	1,932,700.00	0.36
48	002465	海格通信	154,500	1,921,980.00	0.36
49	000157	中联重科	463,627	1,914,779.51	0.35
50	002500	山西证券	115,000	1,904,400.00	0.35
51	002183	怡亚通	132,740	1,900,836.80	0.35
52	002008	大族激光	83,100	1,898,004.00	0.35
53	002340	格林美	214,100	1,877,657.00	0.35
54	000686	东北证券	144,300	1,862,913.00	0.34
55	300124	汇川技术	95,894	1,860,343.60	0.34
56	300408	三环集团	103,500	1,858,860.00	0.34
57	000559	万向钱潮	118,800	1,853,280.00	0.34
58	000917	电广传媒	111,700	1,846,401.00	0.34
59	300003	乐普医疗	100,800	1,838,592.00	0.34
60	002236	大华股份	139,978	1,833,711.80	0.34
61	000623	吉林敖东	71,229	1,777,163.55	0.33
62	000413	东旭光电	206,700	1,775,553.00	0.33
63	000009	中国宝安	129,329	1,771,807.30	0.33
64	300168	万达信息	67,146	1,745,124.54	0.32
65	000338	潍柴动力	223,304	1,744,004.24	0.32
66	000876	新希望	202,052	1,681,072.64	0.31
67	002007	华兰生物	53,500	1,679,900.00	0.31
68	002475	立讯精密	84,345	1,657,379.25	0.31
69	000793	华闻传媒	166,300	1,643,044.00	0.30
70	002385	大北农	201,250	1,622,075.00	0.30
71	000750	国海证券	214,450	1,584,785.50	0.29
72	300033	同花顺	19,300	1,571,985.00	0.29
73	000826	启迪桑德	51,307	1,567,428.85	0.29
74	000630	铜陵有色	616,900	1,566,926.00	0.29
75	300072	三聚环保	55,364	1,530,260.96	0.28
76	000540	中天城投	243,900	1,519,497.00	0.28
77	002176	江特电机	98,200	1,512,280.00	0.28
78	000661	长春高新	14,000	1,493,520.00	0.28
79	000061	农产品	122,600	1,490,816.00	0.28
80	000963	华东医药	22,082	1,488,326.80	0.28
81	300315	掌趣科技	138,600	1,453,914.00	0.27
82	000012	南玻 A	124,800	1,430,208.00	0.26
83	002049	同方国芯	32,213	1,415,761.35	0.26
84	002030	达安基因	50,602	1,406,735.60	0.26

85	000060	中金岭南	134,830	1,406,276.90	0.26
86	000977	浪潮信息	58,700	1,376,515.00	0.25
87	000748	长城信息	69,400	1,361,628.00	0.25
88	300253	卫宁健康	54,540	1,347,138.00	0.25
89	300136	信维通信	64,080	1,343,116.80	0.25
90	000425	徐工机械	438,308	1,341,222.48	0.25
91	002081	金螳螂	131,526	1,317,890.52	0.24
92	000887	中鼎股份	59,600	1,317,756.00	0.24
93	300113	顺网科技	34,682	1,316,528.72	0.24
94	002439	启明星辰	50,500	1,304,415.00	0.24
95	300058	蓝色光标	134,034	1,301,470.14	0.24
96	002292	奥飞娱乐	43,300	1,296,835.00	0.24
97	000997	新大陆	64,680	1,296,187.20	0.24
98	000988	华工科技	64,600	1,295,230.00	0.24
99	002085	万丰奥威	75,340	1,295,094.60	0.24
100	000792	盐湖股份	60,923	1,285,475.30	0.24
101	000970	中科三环	88,000	1,276,880.00	0.24
102	002400	省广股份	90,320	1,276,221.60	0.24
103	000718	苏宁环球	97,296	1,273,604.64	0.24
104	002508	老板电器	34,200	1,257,534.00	0.23
105	000709	河钢股份	453,800	1,257,026.00	0.23
106	002426	胜利精密	126,600	1,247,010.00	0.23
107	000983	西山煤电	152,500	1,242,875.00	0.23
108	000998	隆平高科	65,100	1,235,598.00	0.23
109	300144	宋城演艺	49,570	1,234,788.70	0.23
110	002038	双鹭药业	40,900	1,234,362.00	0.23
111	002179	中航光电	28,477	1,233,623.64	0.23
112	000050	深天马 A	59,100	1,233,417.00	0.23
113	300088	长信科技	80,702	1,200,038.74	0.22
114	300498	温氏股份	33,120	1,199,606.40	0.22
115	002273	水晶光电	42,000	1,175,580.00	0.22
116	000415	渤海金控	172,360	1,175,495.20	0.22
117	300015	爱尔眼科	32,092	1,172,320.76	0.22
118	000738	中航动控	43,750	1,155,000.00	0.21
119	002152	广电运通	69,500	1,142,580.00	0.21
120	000656	金科股份	298,900	1,141,798.00	0.21
121	002701	奥瑞金	129,200	1,140,836.00	0.21
122	000046	泛海控股	112,712	1,139,518.32	0.21
123	002129	中环股份	137,420	1,139,211.80	0.21

124	300077	国民技术	57,200	1,132,560.00	0.21
125	000039	中集集团	79,300	1,123,681.00	0.21
126	000581	威孚高科	55,551	1,119,908.16	0.21
127	300142	沃森生物	98,500	1,099,260.00	0.20
128	000078	海王生物	147,150	1,093,324.50	0.20
129	000806	银河生物	56,100	1,090,584.00	0.20
130	300055	万邦达	59,800	1,088,958.00	0.20
131	002280	联络互动	54,875	1,081,586.25	0.20
132	002108	沧州明珠	41,750	1,081,325.00	0.20
133	300002	神州泰岳	101,384	1,078,725.76	0.20
134	002310	东方园林	44,900	1,074,008.00	0.20
135	002299	圣农发展	41,100	1,064,490.00	0.20
136	002131	利欧股份	62,200	1,062,998.00	0.20
137	000547	航天发展	68,900	1,058,304.00	0.20
138	300251	光线传媒	91,320	1,055,659.20	0.20
139	300079	数码视讯	123,000	1,054,110.00	0.19
140	002001	新和成	49,430	1,044,455.90	0.19
141	300133	华策影视	67,078	1,044,404.46	0.19
142	300159	新研股份	57,700	1,041,485.00	0.19
143	000697	炼石有色	45,400	1,037,390.00	0.19
144	300156	神雾环保	50,283	1,034,824.14	0.19
145	002311	海大集团	64,840	1,022,526.80	0.19
146	002422	科伦药业	66,278	1,021,343.98	0.19
147	300324	旋极信息	47,500	1,019,350.00	0.19
148	002276	万马股份	51,400	1,018,234.00	0.19
149	002168	深圳惠程	72,200	1,016,576.00	0.19
150	002074	国轩高科	25,700	1,014,379.00	0.19
151	002221	东华能源	83,200	1,014,208.00	0.19
152	002004	华邦健康	110,900	1,012,517.00	0.19
153	002191	劲嘉股份	86,675	1,004,563.25	0.19
154	002470	金正大	124,600	1,003,030.00	0.19
155	000712	锦龙股份	48,300	1,002,708.00	0.19
156	300101	振芯科技	35,900	1,002,687.00	0.19
157	000031	中粮地产	105,941	999,023.63	0.18
158	002491	通鼎互联	58,500	998,010.00	0.18
159	000762	西藏矿业	40,200	993,744.00	0.18
160	000778	新兴铸管	213,532	990,788.48	0.18
161	000671	阳光城	166,590	989,544.60	0.18
162	002573	清新环境	58,400	988,128.00	0.18

163	000400	许继电气	63,800	985,072.00	0.18
164	000598	兴蓉环境	186,300	983,664.00	0.18
165	300244	迪安诊断	29,796	982,672.08	0.18
166	300367	东方网力	39,500	980,785.00	0.18
167	000511	*ST 烯碳	109,300	974,956.00	0.18
168	000758	中色股份	125,060	969,215.00	0.18
169	002353	杰瑞股份	49,387	952,181.36	0.18
170	000410	沈阳机床	56,600	949,748.00	0.18
171	002544	杰赛科技	29,600	949,272.00	0.18
172	000930	中粮生化	86,200	946,476.00	0.17
173	000729	燕京啤酒	123,800	939,642.00	0.17
174	002138	顺络电子	51,100	926,443.00	0.17
175	300170	汉得信息	60,950	925,221.00	0.17
176	300274	阳光电源	37,875	924,150.00	0.17
177	000999	华润三九	38,100	922,782.00	0.17
178	002018	华信国际	96,390	915,705.00	0.17
179	002048	宁波华翔	40,000	914,800.00	0.17
180	002155	湖南黄金	69,300	912,681.00	0.17
181	002023	海特高新	52,600	911,558.00	0.17
182	002444	巨星科技	44,400	902,208.00	0.17
183	300267	尔康制药	63,000	902,160.00	0.17
184	000629	*ST 钒钛	376,659	900,215.01	0.17
185	000901	航天科技	22,400	899,360.00	0.17
186	300068	南都电源	41,110	898,664.60	0.17
187	002271	东方雨虹	52,100	897,683.00	0.17
188	002308	威创股份	54,619	897,390.17	0.17
189	002294	信立泰	32,900	894,880.00	0.17
190	000566	海南海药	82,000	894,620.00	0.17
191	000800	一汽轿车	82,200	894,336.00	0.17
192	300273	和佳股份	46,530	891,049.50	0.16
193	002092	中泰化学	105,100	889,146.00	0.16
194	002410	广联达	62,119	888,301.70	0.16
195	000979	中弘股份	323,740	887,047.60	0.16
196	000860	顺鑫农业	37,300	886,994.00	0.16
197	300001	特锐德	40,800	884,952.00	0.16
198	000878	云南铜业	86,796	883,583.28	0.16
199	000938	紫光股份	14,500	882,760.00	0.16
200	000883	湖北能源	190,500	882,015.00	0.16
201	002104	恒宝股份	53,100	872,964.00	0.16

202	002326	永太科技	42,700	871,080.00	0.16
203	300166	东方国信	31,678	870,194.66	0.16
204	002261	拓维信息	62,900	869,907.00	0.16
205	300115	长盈精密	42,140	868,084.00	0.16
206	000690	宝新能源	127,800	866,484.00	0.16
207	300010	立思辰	41,200	864,376.00	0.16
208	002022	科华生物	40,501	863,076.31	0.16
209	000028	国药一致	13,200	859,320.00	0.16
210	002153	石基信息	32,485	856,954.30	0.16
211	002460	赣锋锂业	25,600	856,320.00	0.16
212	000627	天茂集团	110,400	853,392.00	0.16
213	002075	沙钢股份	59,400	850,608.00	0.16
214	002223	鱼跃医疗	26,800	850,096.00	0.16
215	002467	二六三	54,700	842,927.00	0.16
216	000021	深科技	76,400	841,164.00	0.16
217	002657	中科金财	15,300	840,582.00	0.16
218	000687	华讯方舟	42,400	839,520.00	0.16
219	002185	华天科技	65,880	838,652.40	0.15
220	000960	锡业股份	72,400	836,944.00	0.15
221	002268	卫士通	23,400	836,316.00	0.15
222	300271	华宇软件	43,840	829,452.80	0.15
223	000066	长城电脑	65,000	828,750.00	0.15
224	002146	荣盛发展	122,900	825,888.00	0.15
225	002312	三泰控股	43,475	823,851.25	0.15
226	002123	荣信股份	39,601	823,304.79	0.15
227	000829	天音控股	61,400	819,690.00	0.15
228	300216	千山药机	25,900	819,217.00	0.15
229	300199	翰宇药业	39,872	811,395.20	0.15
230	300020	银江股份	43,500	809,100.00	0.15
231	000089	深圳机场	95,100	808,350.00	0.15
232	002161	远望谷	54,252	807,812.28	0.15
233	002067	景兴纸业	98,230	806,468.30	0.15
234	002303	美盈森	65,600	806,224.00	0.15
235	300207	欣旺达	31,400	806,038.00	0.15
236	002174	游族网络	25,185	805,920.00	0.15
237	002489	浙江永强	101,600	804,672.00	0.15
238	000973	佛塑科技	77,000	803,880.00	0.15
239	300287	飞利信	59,800	801,320.00	0.15
240	002477	雏鹰农牧	133,700	798,189.00	0.15

241	002250	联化科技	55,700	797,624.00	0.15
242	001696	宗申动力	73,000	797,160.00	0.15
243	300182	捷成股份	46,450	794,759.50	0.15
244	300433	蓝思科技	28,200	792,984.00	0.15
245	000592	平潭发展	115,300	781,734.00	0.14
246	300203	聚光科技	29,600	781,440.00	0.14
247	300238	冠昊生物	17,800	781,064.00	0.14
248	002501	利源精制	72,105	778,734.00	0.14
249	002051	中工国际	39,540	777,751.80	0.14
250	002055	得润电子	25,400	777,748.00	0.14
251	002050	三花股份	80,200	773,930.00	0.14
252	002714	牧原股份	15,300	773,109.00	0.14
253	300146	汤臣倍健	57,000	771,780.00	0.14
254	000601	韶能股份	73,800	771,210.00	0.14
255	002474	榕基软件	40,800	771,120.00	0.14
256	002368	太极股份	21,700	771,001.00	0.14
257	000516	国际医学	131,700	770,445.00	0.14
258	300347	泰格医药	26,500	769,030.00	0.14
259	002583	海能达	63,820	768,392.80	0.14
260	000969	安泰科技	54,500	764,635.00	0.14
261	300291	华录百纳	32,453	763,619.09	0.14
262	002073	软控股份	62,900	757,945.00	0.14
263	002375	亚厦股份	67,050	757,665.00	0.14
264	000543	皖能电力	106,070	757,339.80	0.14
265	002266	浙富控股	141,430	756,650.50	0.14
266	000786	北新建材	83,200	755,456.00	0.14
267	002642	荣之联	28,700	755,097.00	0.14
268	002428	云南锗业	43,900	754,202.00	0.14
269	000667	美好集团	209,600	748,272.00	0.14
270	002424	贵州百灵	43,200	743,040.00	0.14
271	300026	红日药业	42,300	735,597.00	0.14
272	300053	欧比特	40,350	732,352.50	0.14
273	002047	宝鹰股份	73,000	730,000.00	0.13
274	000027	深圳能源	114,300	729,234.00	0.13
275	300085	银之杰	24,370	728,663.00	0.13
276	002665	首航节能	91,890	725,012.10	0.13
277	300418	昆仑万维	25,600	723,712.00	0.13
278	000733	振华科技	32,100	722,250.00	0.13
279	300134	大富科技	23,869	715,115.24	0.13

280	002121	科陆电子	60,550	711,462.50	0.13
281	300431	暴风科技	9,800	710,500.00	0.13
282	000518	四环生物	105,300	709,722.00	0.13
283	300012	华测检测	57,200	708,136.00	0.13
284	000825	太钢不锈	223,700	706,892.00	0.13
285	000650	仁和药业	86,239	703,710.24	0.13
286	002013	中航机电	52,035	701,431.80	0.13
287	300043	互动娱乐	49,500	701,415.00	0.13
288	002522	浙江众成	37,400	701,250.00	0.13
289	000777	中核科技	29,700	699,732.00	0.13
290	000006	深振业 A	94,700	697,939.00	0.13
291	000156	华数传媒	37,600	697,480.00	0.13
292	002063	远光软件	45,017	695,512.65	0.13
293	300383	光环新网	18,200	689,780.00	0.13
294	000488	晨鸣纸业	86,800	689,192.00	0.13
295	002572	索菲亚	12,300	689,046.00	0.13
296	002099	海翔药业	72,100	686,392.00	0.13
297	000848	承德露露	57,365	685,511.75	0.13
298	002089	新海宜	40,500	683,640.00	0.13
299	000816	智慧农业	112,800	666,648.00	0.12
300	002285	世联行	85,570	666,590.30	0.12
301	002570	贝因美	52,100	666,359.00	0.12
302	002672	东江环保	38,400	665,472.00	0.12
303	000926	福星股份	56,600	663,918.00	0.12
304	002630	华西能源	59,900	662,494.00	0.12
305	000616	海航投资	123,300	658,422.00	0.12
306	002773	康弘药业	14,100	656,355.00	0.12
307	002056	横店东磁	38,600	656,200.00	0.12
308	002237	恒邦股份	50,900	655,592.00	0.12
309	000902	新洋丰	52,202	653,047.02	0.12
310	300147	香雪制药	44,240	651,655.20	0.12
311	002130	沃尔核材	40,400	649,632.00	0.12
312	000587	金洲慈航	42,000	648,060.00	0.12
313	002019	亿帆鑫富	42,100	647,498.00	0.12
314	002437	誉衡药业	74,100	644,670.00	0.12
315	002431	棕榈股份	55,950	643,425.00	0.12
316	002663	普邦园林	87,300	642,528.00	0.12
317	000851	高鸿股份	49,800	641,922.00	0.12
318	000939	凯迪生态	71,700	641,715.00	0.12

319	002384	东山精密	32,300	641,478.00	0.12
320	000875	吉电股份	114,200	640,662.00	0.12
321	002550	千红制药	76,600	638,844.00	0.12
322	000751	锌业股份	115,020	636,060.60	0.12
323	002390	信邦制药	68,650	634,326.00	0.12
324	002440	闰土股份	42,704	634,154.40	0.12
325	002595	豪迈科技	29,600	632,552.00	0.12
326	000519	江南红箭	49,099	624,048.29	0.12
327	002318	久立特材	53,800	622,466.00	0.12
328	000541	佛山照明	60,480	622,339.20	0.12
329	000558	莱茵体育	37,500	620,250.00	0.11
330	000975	银泰资源	41,100	616,500.00	0.11
331	000555	神州信息	19,000	615,410.00	0.11
332	002106	莱宝高科	51,800	615,384.00	0.11
333	002025	航天电器	24,890	614,534.10	0.11
334	300075	数字政通	23,800	610,470.00	0.11
335	002190	成飞集成	17,200	609,568.00	0.11
336	002396	星网锐捷	30,800	606,760.00	0.11
337	002366	台海核电	11,330	604,002.30	0.11
338	002217	合力泰	39,400	602,820.00	0.11
339	000513	丽珠集团	13,060	602,196.60	0.11
340	300178	腾邦国际	31,300	600,960.00	0.11
341	002555	三七互娱	33,200	600,920.00	0.11
342	000572	海马汽车	115,700	600,483.00	0.11
343	300122	智飞生物	38,800	600,236.00	0.11
344	002421	达实智能	34,300	599,221.00	0.11
345	002249	大洋电机	50,034	598,906.98	0.11
346	002177	御银股份	60,800	598,880.00	0.11
347	002224	三力士	25,700	594,955.00	0.11
348	000666	经纬纺机	30,500	594,750.00	0.11
349	002638	勤上光电	27,700	594,719.00	0.11
350	000401	冀东水泥	54,500	594,050.00	0.11
351	002588	史丹利	47,600	587,860.00	0.11
352	000732	泰禾集团	30,200	587,088.00	0.11
353	300032	金龙机电	29,200	586,920.00	0.11
354	300202	聚龙股份	24,200	585,882.00	0.11
355	000685	中山公用	56,340	584,809.20	0.11
356	002011	盾安环境	51,700	583,176.00	0.11
357	002603	以岭药业	36,600	582,306.00	0.11

358	300011	鼎汉技术	24,800	582,056.00	0.11
359	002399	海普瑞	33,320	581,767.20	0.11
360	300212	易华录	19,500	580,515.00	0.11
361	002005	德豪润达	98,200	580,362.00	0.11
362	002095	生意宝	10,360	580,056.40	0.11
363	002373	千方科技	38,800	579,672.00	0.11
364	000937	冀中能源	108,400	576,688.00	0.11
365	300496	中科创达	8,500	575,620.00	0.11
366	002463	沪电股份	108,900	574,992.00	0.11
367	300078	思创医惠	17,100	571,824.00	0.11
368	300257	开山股份	34,600	571,592.00	0.11
369	002151	北斗星通	16,900	568,854.00	0.11
370	002041	登海种业	36,550	567,987.00	0.10
371	002625	龙生股份	12,900	567,342.00	0.10
372	000961	中南建设	100,200	562,122.00	0.10
373	002376	新北洋	41,600	555,776.00	0.10
374	002563	森马服饰	51,200	554,496.00	0.10
375	000727	华东科技	168,000	554,400.00	0.10
376	000807	云铝股份	84,000	550,200.00	0.10
377	000600	建投能源	62,700	547,371.00	0.10
378	000158	常山股份	39,400	547,266.00	0.10
379	002690	美亚光电	23,735	546,854.40	0.10
380	000563	陕国投 A	99,600	546,804.00	0.10
381	002028	思源电气	49,860	545,967.00	0.10
382	002281	光迅科技	8,500	545,700.00	0.10
383	002505	大康农业	139,610	544,479.00	0.10
384	300226	上海钢联	10,800	544,320.00	0.10
385	002751	易尚展示	8,500	544,085.00	0.10
386	002681	奋达科技	32,040	540,835.20	0.10
387	000801	四川九洲	43,638	537,620.16	0.10
388	300228	富瑞特装	31,560	536,520.00	0.10
389	002429	兆驰股份	64,000	536,320.00	0.10
390	002195	二三四五	43,300	532,157.00	0.10
391	002052	同洲电子	52,934	530,928.02	0.10
392	002244	滨江集团	79,100	529,970.00	0.10
393	002339	积成电子	29,000	528,960.00	0.10
394	000898	鞍钢股份	138,053	528,742.99	0.10
395	002414	高德红外	19,600	528,612.00	0.10
396	300014	亿纬锂能	12,200	526,918.00	0.10

397	300339	润和软件	14,700	526,848.00	0.10
398	002298	中电鑫龙	31,600	521,400.00	0.10
399	300266	兴源环境	12,450	520,908.00	0.10
400	000897	津滨发展	134,000	518,580.00	0.10
401	300005	探路者	30,400	518,320.00	0.10
402	002551	尚荣医疗	22,136	517,539.68	0.10
403	002668	奥马电器	8,500	517,395.00	0.10
404	002358	森源电气	33,500	516,905.00	0.10
405	000099	中信海直	39,600	514,800.00	0.10
406	000528	柳工	78,900	511,272.00	0.09
407	002197	证通电子	26,600	511,252.00	0.09
408	002242	九阳股份	28,100	510,858.00	0.09
409	000735	罗牛山	79,100	510,195.00	0.09
410	300009	安科生物	17,000	507,960.00	0.09
411	300039	上海凯宝	49,800	506,466.00	0.09
412	300359	全通教育	17,000	504,220.00	0.09
413	300352	北信源	26,760	499,609.20	0.09
414	000049	德赛电池	11,900	499,086.00	0.09
415	002229	鸿博股份	19,800	496,584.00	0.09
416	002433	太安堂	49,260	493,585.20	0.09
417	000861	海印股份	98,720	487,676.80	0.09
418	002577	雷柏科技	9,540	487,017.00	0.09
419	000652	泰达股份	105,800	486,680.00	0.09
420	000062	深圳华强	18,008	486,216.00	0.09
421	000620	新华联	53,100	485,865.00	0.09
422	000681	视觉中国	20,500	484,825.00	0.09
423	300090	盛运环保	59,908	484,655.72	0.09
424	002269	美邦服饰	109,500	481,800.00	0.09
425	002343	慈文传媒	9,900	480,150.00	0.09
426	002093	国脉科技	38,600	479,026.00	0.09
427	300111	向日葵	97,700	478,730.00	0.09
428	300197	铁汉生态	34,426	477,144.36	0.09
429	002215	诺普信	45,800	473,572.00	0.09
430	000830	鲁西化工	104,600	472,792.00	0.09
431	002649	博彦科技	11,900	470,883.00	0.09
432	002178	延华智能	42,800	469,944.00	0.09
433	300171	东富龙	24,766	467,582.08	0.09
434	002498	汉缆股份	107,400	466,116.00	0.09
435	002029	七匹狼	45,900	465,885.00	0.09

436	000090	天健集团	52,860	465,168.00	0.09
437	002344	海宁皮城	47,500	463,125.00	0.09
438	000869	张裕 A	11,500	462,070.00	0.09
439	002154	报喜鸟	95,000	458,850.00	0.08
440	300369	绿盟科技	10,700	452,717.00	0.08
441	002527	新时达	28,650	452,670.00	0.08
442	002556	辉隆股份	29,900	451,789.00	0.08
443	002128	露天煤业	59,900	449,849.00	0.08
444	002078	太阳纸业	91,800	447,984.00	0.08
445	300364	中文在线	8,500	442,000.00	0.08
446	300336	新文化	17,580	439,148.40	0.08
447	000088	盐田港	68,100	438,564.00	0.08
448	000539	粤电力 A	87,240	437,944.80	0.08
449	002170	芭田股份	51,800	437,192.00	0.08
450	000931	中关村	54,045	431,279.10	0.08
451	002284	亚太股份	22,000	419,980.00	0.08
452	002482	广田股份	53,950	408,941.00	0.08
453	300098	高新兴	25,600	406,528.00	0.08
454	300288	朗玛信息	11,199	406,075.74	0.08
455	000996	中国中期	19,600	405,328.00	0.07
456	002432	九安医疗	22,300	404,522.00	0.07
457	300229	拓尔思	18,900	404,082.00	0.07
458	300074	华平股份	33,560	402,720.00	0.07
459	002698	博实股份	20,340	391,748.40	0.07
460	300096	易联众	21,300	390,642.00	0.07
461	300152	科融环境	51,500	388,310.00	0.07
462	002071	长城影视	28,400	387,376.00	0.07
463	002658	雪迪龙	22,200	386,058.00	0.07
464	002002	鸿达兴业	20,000	376,000.00	0.07
465	300295	三六五网	11,500	373,750.00	0.07
466	002517	恺英网络	8,400	370,272.00	0.07
467	000882	华联股份	89,600	365,568.00	0.07
468	000767	漳泽电力	99,100	358,742.00	0.07
469	002488	金固股份	17,000	357,340.00	0.07
470	002325	洪涛股份	38,700	355,653.00	0.07
471	002413	雷科防务	25,700	352,861.00	0.07
472	300052	中青宝	16,000	352,480.00	0.07
473	000987	广州友谊	27,300	352,170.00	0.07
474	300205	天喻信息	23,300	344,607.00	0.06

475	300222	科大智能	12,500	342,375.00	0.06
476	002010	传化股份	17,100	338,409.00	0.06
477	002416	爱施德	17,000	337,620.00	0.06
478	002589	瑞康医药	10,900	334,739.00	0.06
479	002640	跨境通	18,900	333,018.00	0.06
480	002181	粤传媒	40,400	331,684.00	0.06
481	002721	金一文化	17,100	330,543.00	0.06
482	000693	ST 华泽	25,500	318,750.00	0.06
483	002143	印纪传媒	13,500	316,305.00	0.06
484	300333	兆日科技	13,100	311,780.00	0.06
485	002493	荣盛石化	24,500	296,940.00	0.05
486	002653	海思科	17,909	286,902.18	0.05
487	002699	美盛文化	8,500	283,815.00	0.05
488	002568	百润股份	12,900	283,800.00	0.05
489	002471	中超控股	46,100	283,515.00	0.05
490	002329	皇氏集团	18,900	283,311.00	0.05
491	300083	劲胜精密	34,000	280,840.00	0.05
492	300368	汇金股份	9,300	273,978.00	0.05
493	002481	双塔食品	37,400	273,020.00	0.05
494	002043	兔宝宝	26,200	262,786.00	0.05
495	002717	岭南园林	8,500	253,810.00	0.05
496	300188	美亚柏科	9,500	253,080.00	0.05
497	002036	联创电子	9,500	222,395.00	0.04
498	300413	快乐购	9,100	221,585.00	0.04
499	002741	光华科技	8,500	216,495.00	0.04
500	000553	沙隆达 A	19,700	210,396.00	0.04
501	002027	分众传媒	12,300	203,073.00	0.04
502	002602	世纪华通	9,800	181,594.00	0.03
503	002031	巨轮智能	30,700	138,764.00	0.03

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

本基金本报告期末未持有积极投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002739	万达院线	1,541,392.00	0.25
2	002368	太极股份	1,280,655.00	0.20
3	300408	三环集团	884,236.92	0.14
4	002460	赣锋锂业	857,257.00	0.14
5	002304	洋河股份	810,770.00	0.13
6	002736	国信证券	808,874.00	0.13
7	000630	铜陵有色	794,251.00	0.13
8	300418	昆仑万维	733,578.00	0.12
9	300431	暴风集团	698,098.00	0.11
10	300383	光环新网	691,971.00	0.11
11	002572	索菲亚	686,996.00	0.11
12	000748	长城信息	636,256.00	0.10
13	000156	华数传媒	627,068.00	0.10
14	002224	三力士	598,852.00	0.10
15	300496	中科创达	579,168.00	0.09
16	300078	思创医惠	578,117.00	0.09
17	002280	联络互动	558,512.42	0.09
18	002281	光迅科技	553,780.00	0.09
19	002075	沙钢股份	552,520.00	0.09
20	002751	易尚展示	544,385.00	0.09

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002681	奋达科技	1,179,153.00	0.19
2	000831	*ST 五稀	903,510.00	0.14
3	002219	恒康医疗	673,440.00	0.11
4	300183	东软载波	607,558.52	0.10
5	002309	中利科技	606,650.00	0.10
6	000596	古井贡酒	597,407.82	0.10
7	000915	山大华特	586,045.00	0.09
8	000933	*ST 神火	568,715.00	0.09

9	300034	钢研高纳	555,609.20	0.09
10	000651	格力电器	551,400.00	0.09
11	300054	鼎龙股份	549,432.00	0.09
12	002262	恩华药业	548,898.04	0.09
13	002317	众生药业	547,781.19	0.09
14	300157	恒泰艾普	546,192.03	0.09
15	000726	鲁泰 A	545,840.53	0.09
16	000680	山推股份	539,330.00	0.09
17	002079	苏州固锝	531,291.00	0.08
18	002480	新筑股份	530,905.45	0.08
19	002342	巨力索具	523,897.51	0.08
20	000900	现代投资	512,518.00	0.08

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	54,249,402.88
卖出股票收入（成交）总额	49,450,062.24

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	49,600.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	49,600.00	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127003	海印转债	496	49,600.00	0.01

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1**

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。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,608.16
2	应收证券清算款	25,198.98
3	应收股利	-
4	应收利息	575.44

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,382.58

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000002	万科 A	21,617,080.94	3.99	重大事项
2	000651	格力电器	9,038,012.80	1.67	重大事项

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

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期无积极投资。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
6,177	78,380.20	305,253,393.00	63.05%	178,901,114.00	36.95%

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
中国工商银行-南方深证成份交易型 开放式指数证券投资基金联接基金	282,321,432.00	58.31%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行-南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	国信证券股份有限公司融券专用证券账户	7,659,200.00	1.58%
2	陈维东	5,000,000.00	1.03%
3	华夏人寿保险股份有限公司-自有资金	4,030,665.00	0.83%
4	国信证券股份有限公司	3,588,800.00	0.74%
5	中国银河证券股份有限公司	2,991,100.00	0.62%
6	陈宏	2,614,300.00	0.54%
7	刘素坚	1,845,018.00	0.38%
8	耿力扬	1,500,000.00	0.31%
9	邬海滨	1,475,867.00	0.30%
10	凌燕	1,475,778.00	0.30%
	中国工商银行股份有限公司-南方深证成份交 易型开放式指数证券投资基金联接基金	282,321,432.00	58.31%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年12月4日）基金份额总额	4,127,538,537.00
本报告期期初基金份额总额	469,154,507.00
本报告期基金总申购份额	78,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	63,000,000.00
本报告期末基金份额总额	484,154,507.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人没有发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
申银万国	2	103,699,465.12	100.00%	10,370.78	100.00%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

华安证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序

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

A：选择标准

- (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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	其他公告关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 12 日
2	其他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	2016 年 3 月 31 日
3	其他公告南方基金关于临时暂停电子直销实时赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 4 日
4	其他公告南方基金管理有限公司电子交易赎回转认/申购业务规则	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 27 日
5	代销公告南方基金关于旗下深成 ETF 增加宏信证券、方正证券、恒泰证券和东吴证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 26 日
6	其他公告南方基金关于电子直销平台通过货币基金定投其他基金费率为 0 的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 15 日
7	其他公告南方基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 7 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 7 日
8	关于南方基金管理有限公司旗下部分基金净值揭示异常的提示	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日
9	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 5 日
10	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 4 日
11	南方基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 4 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 4 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立深证成份交易型开放式指数证券投资基金的文件
- 2、深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、深证成份交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件

5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告

11.2 存放地点

深圳市福田区福华 1 路 6 号免税商务大厦 31 至 33 楼

11.3 查阅方式

网站: <http://www.nffund.com>