

南方深证成份交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 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 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 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 | 7 |
| 2.5 其他相关资料 | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 8 |
| §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 | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 12 |
| §5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 13 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表 | 13 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 17 |
| §7 投资组合报告 | 34 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 34 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合 | 35 |
| 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 | 36 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 47 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 49 |
| 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 | 50 |
| 7.7 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 | 50 |
| 7.8 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 | 50 |
| 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 | 50 |
| 7.10 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 | 50 |
| 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 50 |
| 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 50 |

| | |
|--|-----------|
| 7.13 投资组合报告附注..... | 50 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 51 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 51 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 52 |
| 8.3 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..... | 52 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 52 |
| §10 重大事件揭示..... | 52 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 52 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 53 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 53 |
| 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..... | 53 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 53 |
| 10.8 其他重大事件..... | 54 |
| §11 备查文件目录..... | 56 |
| 11.1 备查文件目录..... | 56 |
| 11.2 存放地点..... | 56 |
| 11.3 查阅方式..... | 56 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------------|
| 基金名称 | 南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金 |
| 基金简称 | 南方深证成份 ETF 联接 |
| 基金主代码 | 202017 |
| 前端交易代码 | 202017 |
| 后端交易代码 | 202018 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009 年 12 月 9 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 | 396,528,155.72 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“南方深成”。

2.1.1 目标基金基本情况

| | |
|--------------|--------------------|
| 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 |
| 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 |

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 | 通过投资于深成 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | <p>本基金为完全被动式指数基金，以深成 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深成 ETF。本基金并不参与深成 ETF 的管理。</p> <p>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% 的资产投资于深成 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。</p> <p>在正常市场情况下，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%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪</p> |

| | |
|--------|---|
| | 偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 |
| 业绩比较基准 | 深证成份指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金属股票基金，预期风险与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 | <p>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。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> |
| 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 | | 深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层 | 北京市西城区复兴门内大街 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 | 南方基金管理有限公司 | 深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层 |

§ 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 | -995,838.71 |
| 本期利润 | -62,666,444.00 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1580 |
| 本期加权平均净值利润率 | -19.45% |
| 本期基金份额净值增长率 | -16.11% |
| 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 | -60,865,029.96 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1535 |
| 期末基金资产净值 | 335,663,125.76 |
| 期末基金份额净值 | 0.8465 |
| 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 | -15.35% |
|-------------|---------|

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、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、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）。

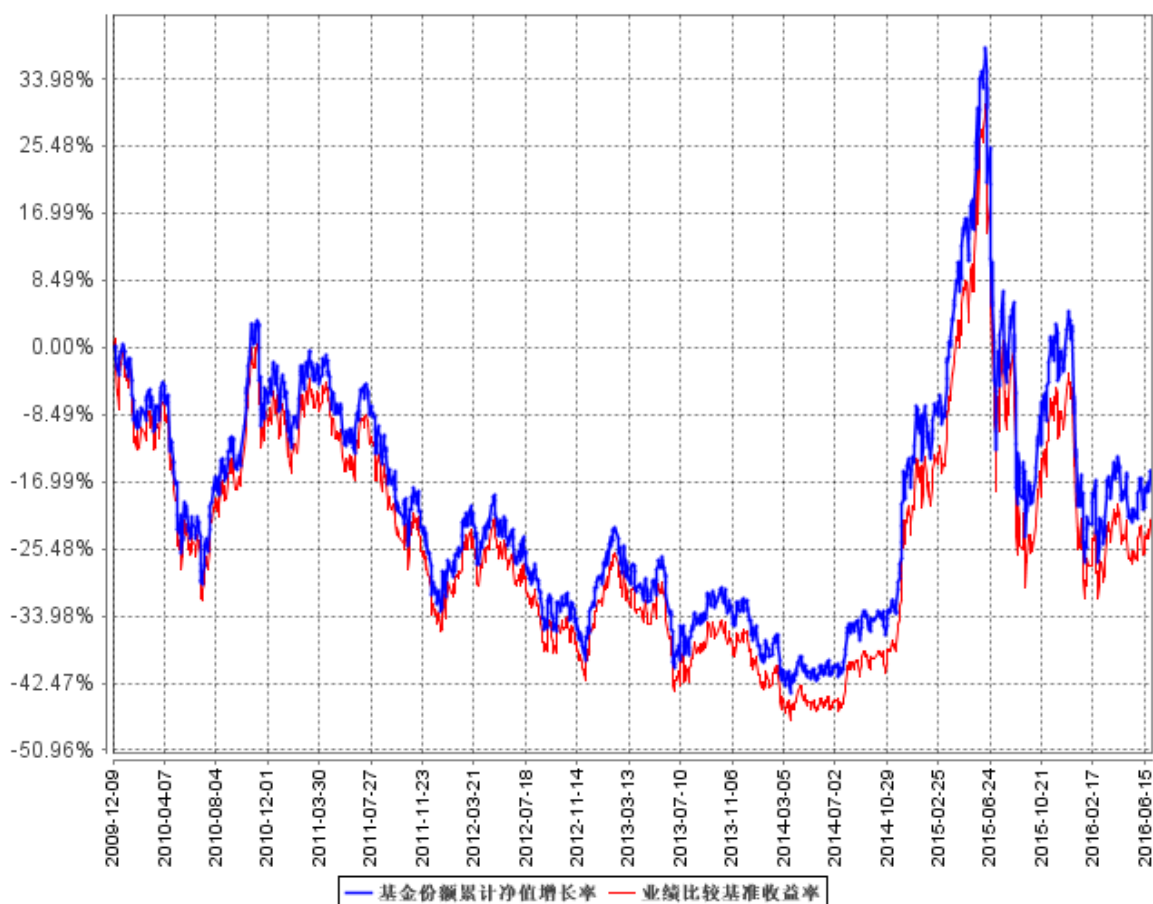
3.2 基金净值表现

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 | 3.74% | 1.45% | 3.10% | 1.37% | 0.64% | 0.08% |
| 过去三个月 | 1.10% | 1.52% | 0.35% | 1.44% | 0.75% | 0.08% |
| 过去六个月 | -16.11% | 2.37% | -16.24% | 2.27% | 0.13% | 0.10% |
| 过去一年 | -23.52% | 2.55% | -25.35% | 2.56% | 1.83% | -0.01% |
| 过去三年 | 38.79% | 1.91% | 35.30% | 1.93% | 3.49% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | -15.35% | 1.67% | -21.75% | 1.69% | 6.40% | -0.02% |

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

管理 96 只开放式基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|---------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 柯晓 | 本基金基金经理 | 2013 年 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；

3、2016 年 8 月 19 日，增聘孙伟为本基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方深证成份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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组间

单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 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。我们专门针对ETF及联接基金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及联接基金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本基金自身接受的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本基金大额换购目标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指数成份股调整所带来的跟踪误差，尤其是本次成份股扩容改造带来了一定的跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金自建仓结束至本报告期末的指数跟踪期间，相对于业绩基准的年化跟踪误差为1.037%，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0.8465元。报告期内，份额净值增长率为-16.11%，同期业绩基准增长率为-16.24%。

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。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总经理、研究部总监、量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：每一基金份额享有同等分配权；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；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，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合相关基金分红条件的前提下，本基金收益分配每年最多 6 次，每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金分红或将现金分红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；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托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，南方深证成份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深证成份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，南方深证成份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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理有限公司编制和披露的南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金 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：南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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 | 19,108,568.25 | 21,735,714.30 |
| 结算备付金 | | 25,659.28 | - |
| 存出保证金 | | 4,751.51 | 92,121.16 |
| 交易性金融资产 | 6.4.4.2 | 317,257,364.32 | 370,974,921.47 |
| 其中：股票投资 | | 4,416,685.52 | 2,168,706.18 |
| 基金投资 | | 312,840,378.80 | 368,806,215.29 |
| 债券投资 | | 300.00 | - |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 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 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.4.5 | 3,071.98 | 4,971.51 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 38,186.56 | 40,921.51 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.4.6 | - | - |
| 资产总计 | | 336,437,601.90 | 392,848,649.95 |
| 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 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 581,092.28 | 445,188.70 |
| 应付管理人报酬 | | 8,321.35 | 11,402.64 |
| 应付托管费 | | 1,664.26 | 2,280.53 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.4.7 | 868.40 | 2,470.28 |
| 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 | 182,529.85 | 74,378.52 |
| 负债合计 | | 774,476.14 | 535,720.67 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.4.9 | 396,528,155.72 | 388,780,178.24 |
| 未分配利润 | 6.4.4.10 | -60,865,029.96 | 3,532,751.04 |
| 所有者权益合计 | | 335,663,125.76 | 392,312,929.28 |
| 负债和所有者权益总计 | | 336,437,601.90 | 392,848,649.95 |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8465 元，基金份额总额 396,528,155.72 份。

6.2 利润表

会计主体：南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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 | 上年度可比期间 2015年1月1日至 |
|-----|-----|------------------|-----------------------|
|-----|-----|------------------|-----------------------|

| | | 2016 年 6 月 30 日 | 2015 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|-----------|-----------------|-----------------|
| 一、收入 | | -62,410,779.86 | 348,561,315.47 |
| 1.利息收入 | | 77,757.78 | 255,169.18 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.4.11 | 77,757.70 | 255,169.18 |
| 债券利息收入 | | 0.08 | - |
| 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） | | -836,964.01 | 286,787,767.29 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.4.12 | -485,423.24 | 1,802,691.03 |
| 基金投资收益 | 6.4.4.13 | -365,424.53 | 284,887,855.72 |
| 债券投资收益 | 6.4.4.14 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.4.15 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.4.16 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.4.17 | 13,883.76 | 97,220.54 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.4.18 | -61,670,605.29 | 61,083,064.73 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.4.19 | 19,031.66 | 435,314.27 |
| 减：二、费用 | | 255,664.14 | 2,290,388.98 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.7.2.1 | 57,471.21 | 163,112.81 |
| 2. 托管费 | 6.4.7.2.2 | 11,494.25 | 32,622.55 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.7.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.4.20 | 6,393.15 | 1,911,926.55 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | 6.4.4.21 | 180,305.53 | 182,727.07 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -62,666,444.00 | 346,270,926.49 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -62,666,444.00 | 346,270,926.49 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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） | 388,780,178.24 | 3,532,751.04 | 392,312,929.28 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -62,666,444.00 | -62,666,444.00 |
| 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） | 7,747,977.48 | -1,731,337.00 | 6,016,640.48 |
| 其中：1. 基金申购款 | 33,168,949.54 | -6,230,414.50 | 26,938,535.04 |
| 2. 基金赎回款 | -25,420,972.06 | 4,499,077.50 | -20,921,894.56 |
| 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） | 396,528,155.72 | -60,865,029.96 | 335,663,125.76 |
| | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | | |
| 项目 | 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） | 1,332,798,617.99 | -164,566,777.93 | 1,168,231,840.06 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 346,270,926.49 | 346,270,926.49 |
| 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） | -877,498,746.99 | -133,058,292.70 | -1,010,557,039.69 |
| 其中：1. 基金申购款 | 279,983,173.46 | -9,098,312.65 | 270,884,860.81 |
| 2. 基金赎回款 | -1,157,481,920.45 | -123,959,980.05 | -1,281,441,900.50 |
| 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） | 455,299,871.00 | 48,645,855.86 | 503,945,726.86 |

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：

| | | |
|------------|-----------|-----------|
| <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 |

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

本报告期无会计估计变更。

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 | 19,108,568.25 |
| 定期存款 | - |
| 其中:存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 19,108,568.25 |

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 | 4,296,150.01 | 4,416,685.52 | 120,535.51 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 300.00 | 300.00 |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | 300.00 | 300.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - |

| | | | |
|----|----------------|----------------|---------------|
| 基金 | 314,165,403.83 | 312,840,378.80 | -1,325,025.03 |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 318,461,853.84 | 317,257,364.32 | -1,204,489.52 |

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

注：无余额。

6.4.4.4 买入返售金融资产

注：无余额。

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 | 3,053.16 |
| 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 | 16.85 |
| 应收债券利息 | 0.08 |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 1.89 |
| 合计 | 3,071.98 |

6.4.4.6 其他资产

注：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 | 868.40 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 868.40 |

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 | 2,326.32 |
| 应付指数使用费 | 1,188.33 |
| 预提费用 | 179,015.20 |
| 合计 | 182,529.85 |

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 | 388,780,178.24 | 388,780,178.24 |
| 本期申购 | 33,168,949.54 | 33,168,949.54 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -25,420,972.06 | -25,420,972.06 |
| 本期末 | 396,528,155.72 | 396,528,155.72 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

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 | 70,332,968.44 | -66,800,217.40 | 3,532,751.04 |
| 本期利润 | -995,838.71 | -61,670,605.29 | -62,666,444.00 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,403,500.30 | -3,134,837.30 | -1,731,337.00 |
| 其中：基金申购款 | 5,979,042.28 | -12,209,456.78 | -6,230,414.50 |
| 基金赎回款 | -4,575,541.98 | 9,074,619.48 | 4,499,077.50 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 70,740,630.03 | -131,605,659.99 | -60,865,029.96 |

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 | 77,216.51 |
| 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 | 176.07 |
| 其他 | 365.12 |

| | |
|----|-----------|
| 合计 | 77,757.70 |
|----|-----------|

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 | -291,180.88 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | -194,242.36 |
| 合计 | -485,423.24 |

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 | 3,193,424.10 |
| 减：卖出股票成本总额 | 3,484,604.98 |
| 买卖股票差价收入 | -291,180.88 |

6.4.4.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.4.12.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 申购基金份额总额 | 15,972,868.40 |
| 减：现金支付申购款总额 | 1,165,610.48 |
| 减：申购股票成本总额 | 15,001,500.28 |
| 申购差价收入 | -194,242.36 |

6.4.4.13 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额 | 9,658,508.95 |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 10,023,933.48 |

| | |
|--------|-------------|
| 基金投资收益 | -365,424.53 |
|--------|-------------|

6.4.4.14 债券投资收益

注：无。

6.4.4.15 贵金属投资收益

注：无。

6.4.4.16 衍生工具收益

注：无。

6.4.4.17 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 | 13,883.76 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 13,883.76 |

6.4.4.18 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 | -61,670,605.29 |
| ——股票投资 | 244,166.12 |
| ——债券投资 | - |
| ——基金投资 | -61,914,771.41 |
| ——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 | -61,670,605.29 |

6.4.4.19 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 | 11,993.69 |
| 基金转换费收入 | 7,037.97 |
| 合计 | 19,031.66 |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。2. 本基金的转换费用由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.4.20 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 | 6,393.15 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 6,393.15 |

6.4.4.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 29,835.26 |
| 信息披露费 | 149,179.94 |
| 银行划款手续费 | 102.00 |
| 指数使用费 | 1,188.33 |
| 合计 | 180,305.53 |

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(“南方基金公司”) | 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、基金代销机构 |
| 华泰证券股份有限公司(“华泰证券”) | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 深证成份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 |

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

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 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日 | |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 |
| 华泰证券 | 14,366,725.58 | 100.00% | 435,312,350.64 | 40.62% |

6.4.7.1.2 债券交易

注：无。

6.4.7.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.7.1.4 基金交易

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 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日 | |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期基金 成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金 成交总额的比例 |
| 华泰证券 | 22,547,468.35 | 87.93% | 544,736,630.17 | 44.65% |

注：2016 上半年度基金成交金额中包括基金申购赎回 22,547,468.35 元，基金二级市场买卖 0.00 元(2015 上半年度基金成交金额中包括基金申购赎回 462,323,742.98 元，基金二级市场买卖 82,412,887.19 元)。

6.4.7.1.5 权证交易

注：无。

6.4.7.1.6 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 | 1,437.08 | 100.00% | 868.40 | 100.00% |
| 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 | 262,857.10 | 32.18% | 167,700.93 | 35.98% |

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

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

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 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 | 57,471.21 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 152,983.15 | 462,358.07 |

注：本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付基金管理人南方基金管理有限公司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。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 11,494.25 | 32,622.55 |

注：本基金基金资产中投资于目标 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) × 0.1% / 当年天数。

6.4.7.2.3 销售服务费

注：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

注：无。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.4.2 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

注：无。

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 | 19,108,568.25 | 77,216.51 | 25,045,767.49 | 240,736.60 |

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。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 282,321,432 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 58.31%。

6.4.8 利润分配情况

6.4.8.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：无。

6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.9.1.2 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
|---------------------|------|-----------|-----------|--------|--------|--------|--------------|--------|--------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：张) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 127003 | 海印转债 | 2016年6月8日 | 2016年7月1日 | 认购新债 | 100.00 | 100.00 | 3 | 300.00 | 300.00 | - |

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 |
|--------|--------|------------|--------|--------|------------|--------|-------|-----------|-----------|----|
| 000401 | 冀东水泥 | 2016年4月6日 | 重大事项停牌 | 10.90 | 2016年7月14日 | 11.32 | 300 | 3,270.00 | 3,270.00 | - |
| 000415 | 渤海金控 | 2016年2月1日 | 重大事项停牌 | 6.82 | 2016年8月11日 | 7.50 | 1,100 | 7,502.00 | 7,502.00 | - |
| 000511 | *ST 烯碳 | 2016年4月26日 | 重大事项停牌 | 8.92 | - | - | 2,600 | 23,417.65 | 23,192.00 | - |
| 000547 | 航天发展 | 2016年4月19日 | 重大事项停牌 | 15.36 | - | - | 400 | 6,144.00 | 6,144.00 | - |
| 000553 | 沙隆达A | 2015年8月5日 | 重大事项停牌 | 10.68 | - | - | 200 | 2,140.00 | 2,136.00 | - |
| 000629 | *ST 钒钛 | 2016年5月26日 | 重大事项停牌 | 2.39 | - | - | 2,400 | 5,736.00 | 5,736.00 | - |
| 000693 | ST 华泽 | 2016年3月1日 | 重大事项停牌 | 12.50 | - | - | 200 | 2,500.00 | 2,500.00 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|----------|---------------------|----------------|-------|--------------------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 000718 | 苏宁 环球 | 2016年 1月4 日 | 重大 事项 停牌 | 13.09 | 2016年 7月18 日 | 11.78 | 700 | 9,163.00 | 9,163.00 | - |
| 000728 | 国元 证券 | 2016年 6月8 日 | 重大 事项 停牌 | 16.72 | 2016年 7月8 日 | 17.37 | 1,400 | 22,785.00 | 23,408.00 | - |
| 000806 | 银河 生物 | 2016年 1月12 日 | 重大 事项 停牌 | 19.44 | 2016年 7月12 日 | 17.50 | 400 | 7,776.00 | 7,776.00 | - |
| 000975 | 银泰 资源 | 2016年 4月19 日 | 重大 事项 停牌 | 14.39 | - | - | 300 | 4,500.00 | 4,317.00 | - |
| 002052 | 同洲 电子 | 2016年 1月12 日 | 重大 事项 停牌 | 10.03 | - | - | 3,600 | 41,277.40 | 36,108.00 | - |
| 002065 | 东华 软件 | 2015年 12月 22日 | 重大 事项 停牌 | 18.72 | 2016年 7月4 日 | 22.59 | 600 | 15,060.00 | 11,232.00 | - |
| 002071 | 长城 影视 | 2016年 6月16 日 | 重大 事项 停牌 | 13.64 | - | - | 400 | 5,395.00 | 5,456.00 | - |
| 002089 | 新海 宜 | 2016年 1月8 日 | 重大 事项 停牌 | 17.71 | 2016年 7月18 日 | 18.55 | 300 | 5,064.00 | 5,313.00 | - |
| 002129 | 中环 股份 | 2016年 4月25 日 | 重大 事项 停牌 | 8.29 | - | - | 900 | 7,461.00 | 7,461.00 | - |
| 002190 | 成飞 集成 | 2016年 4月21 日 | 重大 事项 停牌 | 35.44 | 2016年 7月12 日 | 38.98 | 100 | 3,544.00 | 3,544.00 | - |
| 002249 | 大洋 电机 | 2016年 6月8 日 | 重大 事项 停牌 | 11.97 | 2016年 7月28 日 | 10.77 | 600 | 6,417.75 | 7,182.00 | - |
| 002266 | 浙富 控股 | 2016年 5月25 日 | 重大 事项 停牌 | 5.35 | - | - | 1,800 | 9,659.25 | 9,630.00 | - |
| 002280 | 联络 互动 | 2016年 4月25 日 | 重大 事项 停牌 | 21.03 | - | - | 400 | 7,884.00 | 8,412.00 | - |
| 002373 | 千方 科技 | 2016年 5月12 日 | 重大 事项 停牌 | 14.94 | 2016年 8月16 日 | 16.43 | 300 | 4,482.00 | 4,482.00 | - |
| 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 | 200 | 3,514.75 | 3,628.00 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|--------|-------|------------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| | | 日 | 停牌 | | 日 | | | | | |
| 002465 | 海格通信 | 2016年6月13日 | 重大事项停牌 | 12.44 | - | - | 2,000 | 23,875.00 | 24,880.00 | - |
| 002555 | 三七互娱 | 2016年3月10日 | 重大事项停牌 | 18.10 | 2016年8月16日 | 19.91 | 200 | 3,620.00 | 3,620.00 | - |
| 002630 | 华西能源 | 2016年4月25日 | 重大事项停牌 | 11.53 | - | - | 400 | 4,424.00 | 4,612.00 | - |
| 002663 | 普邦园林 | 2016年4月28日 | 重大事项停牌 | 7.36 | - | - | 600 | 4,416.00 | 4,416.00 | - |
| 002672 | 东江环保 | 2016年5月23日 | 重大事项停牌 | 17.33 | 2016年7月15日 | 19.06 | 200 | 3,466.00 | 3,466.00 | - |
| 300032 | 金龙机电 | 2016年6月28日 | 重大事项停牌 | 20.10 | 2016年7月7日 | 19.80 | 400 | 7,441.00 | 8,040.00 | - |
| 300052 | 中青宝 | 2016年6月8日 | 重大事项停牌 | 22.03 | - | - | 200 | 4,247.75 | 4,406.00 | - |
| 300111 | 向日葵 | 2016年6月14日 | 重大事项停牌 | 4.90 | - | - | 1,200 | 5,958.00 | 5,880.00 | - |
| 300142 | 沃森生物 | 2016年3月22日 | 重大事项停牌 | 11.16 | - | - | 600 | 6,696.00 | 6,696.00 | - |
| 300166 | 东方国信 | 2016年6月8日 | 重大事项停牌 | 27.47 | - | - | 400 | 10,412.00 | 10,988.00 | - |
| 300413 | 快乐购 | 2016年6月20日 | 重大事项停牌 | 24.35 | - | - | 200 | 4,951.00 | 4,870.00 | - |

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。本基金为完全被动式指数型基金，紧密跟踪标的指数，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。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资及债券投资。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。

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，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。

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，所持股票和债券均在证券交易所上市，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。

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 | 19,108,568.25 | - | - | - | 19,108,568.25 |
| 结算备付金 | 25,659.28 | - | - | - | 25,659.28 |
| 存出保证金 | 4,751.51 | - | - | - | 4,751.51 |
| 交易性金融资产 | - | - | 300.00 | 317,257,064.32 | 317,257,364.32 |
| 应收利息 | - | - | - | 3,071.98 | 3,071.98 |
| 应收申购款 | 21,109.94 | - | - | 17,076.62 | 38,186.56 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 19,160,088.98 | - | 300.00 | 317,277,212.92 | 336,437,601.90 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 581,092.28 | 581,092.28 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 8,321.35 | 8,321.35 |
| 应付托管费 | - | - | - | 1,664.26 | 1,664.26 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 868.40 | 868.40 |
| 其他负债 | - | - | - | 182,529.85 | 182,529.85 |
| 负债总计 | - | - | - | 774,476.14 | 774,476.14 |
| 利率敏感度缺口 | 19,160,088.98 | - | 300.00 | 316,502,736.78 | 335,663,125.76 |
| 上年度末 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |

| | | | | | |
|------------------|---------------|---|---|----------------|----------------|
| 2015 年 12 月 31 日 | | | | | |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 21,735,714.30 | - | - | - | 21,735,714.30 |
| 存出保证金 | 92,121.16 | - | - | - | 92,121.16 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 370,974,921.47 | 370,974,921.47 |
| 应收利息 | - | - | - | 4,971.51 | 4,971.51 |
| 应收申购款 | 249.94 | - | - | 40,671.57 | 40,921.51 |
| 资产总计 | 21,828,085.40 | - | - | 371,020,564.55 | 392,848,649.95 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 445,188.70 | 445,188.70 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 11,402.64 | 11,402.64 |
| 应付托管费 | - | - | - | 2,280.53 | 2,280.53 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 2,470.28 | 2,470.28 |
| 其他负债 | - | - | - | 74,378.52 | 74,378.52 |
| 负债总计 | - | - | - | 535,720.67 | 535,720.67 |
| 利率敏感度缺口 | 21,828,085.40 | - | - | 370,484,843.88 | 392,312,929.28 |

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 6 月 30 日，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。本基金主要投资于能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出的目标 ETF 份额，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。

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 | 4,416,685.52 | 1.32 | 2,168,706.18 | 0.55 |
| 交易性金融资产-基金投资 | 312,840,378.80 | 93.20 | 368,806,215.29 | 94.01 |
| 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 | 317,257,064.32 | 94.52 | 370,974,921.47 | 94.56 |

6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除深证成份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（2016年6月30日） | 上年度末（2015年12月31日） |
| | 1. 深证成份指数上升 5% | | 约 1,661 |
| 2. 深证成份指数下降 5% | | 约-1,661 | 约-1,801 |

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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 | 4,416,685.52 | 1.31 |
| | 其中：股票 | 4,416,685.52 | 1.31 |
| 2 | 基金投资 | 312,840,378.80 | 92.99 |
| 3 | 固定收益投资 | 300.00 | 0.00 |
| | 其中：债券 | 300.00 | 0.00 |
| | 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 | 19,134,227.53 | 5.69 |
| 8 | 其他各项资产 | 46,010.05 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 336,437,601.90 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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 | 66,424.80 | 0.02 |
| B | 采矿业 | 70,834.00 | 0.02 |
| C | 制造业 | 2,612,014.69 | 0.78 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 77,926.00 | 0.02 |
| E | 建筑业 | 82,736.70 | 0.02 |
| F | 批发和零售业 | 115,096.00 | 0.03 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 16,714.00 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 552,637.00 | 0.16 |
| J | 金融业 | 338,996.50 | 0.10 |
| K | 房地产业 | 183,665.75 | 0.05 |
| L | 租赁和商务服务业 | 85,232.20 | 0.03 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 11,820.00 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 62,467.68 | 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 | 26,261.00 | 0.01 |

| | | | |
|---|-----------|--------------|------|
| R | 文化、体育和娱乐业 | 94,227.20 | 0.03 |
| S | 综合 | 19,632.00 | 0.01 |
| | 合计 | 4,416,685.52 | 1.32 |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 | 000333 | 美的集团 | 3,000 | 71,160.00 | 0.02 |
| 2 | 000001 | 平安银行 | 7,200 | 62,640.00 | 0.02 |
| 3 | 000858 | 五粮液 | 1,600 | 52,048.00 | 0.02 |
| 4 | 000725 | 京东方 A | 22,500 | 51,975.00 | 0.02 |
| 5 | 000776 | 广发证券 | 2,800 | 46,928.00 | 0.01 |
| 6 | 002024 | 苏宁云商 | 4,000 | 43,440.00 | 0.01 |
| 7 | 300059 | 东方财富 | 1,900 | 42,180.00 | 0.01 |
| 8 | 002450 | 康得新 | 2,399 | 41,022.90 | 0.01 |
| 9 | 002415 | 海康威视 | 1,800 | 38,628.00 | 0.01 |
| 10 | 002052 | 同洲电子 | 3,600 | 36,108.00 | 0.01 |
| 11 | 000783 | 长江证券 | 3,100 | 35,960.00 | 0.01 |
| 12 | 300104 | 乐视网 | 600 | 31,746.00 | 0.01 |
| 13 | 000519 | 江南红箭 | 2,419 | 30,745.49 | 0.01 |
| 14 | 000063 | 中兴通讯 | 2,100 | 30,114.00 | 0.01 |
| 15 | 002304 | 洋河股份 | 400 | 28,768.00 | 0.01 |
| 16 | 001979 | 招商蛇口 | 1,983 | 28,257.75 | 0.01 |
| 17 | 002736 | 国信证券 | 1,600 | 27,600.00 | 0.01 |
| 18 | 002131 | 利欧股份 | 1,600 | 27,344.00 | 0.01 |
| 19 | 300017 | 网宿科技 | 400 | 26,880.00 | 0.01 |
| 20 | 000100 | TCL 集团 | 8,100 | 26,649.00 | 0.01 |
| 21 | 000166 | 申万宏源 | 3,100 | 26,071.00 | 0.01 |
| 22 | 000625 | 长安汽车 | 1,900 | 25,973.00 | 0.01 |
| 23 | 000538 | 云南白药 | 400 | 25,720.00 | 0.01 |
| 24 | 300024 | 机器人 | 1,000 | 25,390.00 | 0.01 |
| 25 | 002465 | 海格通信 | 2,000 | 24,880.00 | 0.01 |
| 26 | 002466 | 天齐锂业 | 580 | 24,760.20 | 0.01 |
| 27 | 002594 | 比亚迪 | 400 | 24,404.00 | 0.01 |
| 28 | 000503 | 海虹控股 | 600 | 24,126.00 | 0.01 |
| 29 | 002142 | 宁波银行 | 1,600 | 23,648.00 | 0.01 |
| 30 | 000728 | 国元证券 | 1,400 | 23,408.00 | 0.01 |
| 31 | 002673 | 西部证券 | 900 | 23,274.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|-------|-----------|------|
| 32 | 000511 | *ST 烯碳 | 2,600 | 23,192.00 | 0.01 |
| 33 | 002230 | 科大讯飞 | 700 | 22,995.00 | 0.01 |
| 34 | 002202 | 金风科技 | 1,500 | 22,695.00 | 0.01 |
| 35 | 002252 | 上海莱士 | 600 | 22,608.00 | 0.01 |
| 36 | 000839 | 中信国安 | 1,000 | 21,310.00 | 0.01 |
| 37 | 000423 | 东阿阿胶 | 400 | 21,132.00 | 0.01 |
| 38 | 002456 | 欧菲光 | 700 | 20,650.00 | 0.01 |
| 39 | 300070 | 碧水源 | 1,386 | 20,623.68 | 0.01 |
| 40 | 000402 | 金融街 | 2,100 | 20,412.00 | 0.01 |
| 41 | 300027 | 华谊兄弟 | 1,500 | 20,310.00 | 0.01 |
| 42 | 002241 | 歌尔声学 | 700 | 20,076.00 | 0.01 |
| 43 | 000069 | 华侨城 A | 3,100 | 19,840.00 | 0.01 |
| 44 | 000768 | 中航飞机 | 1,000 | 19,690.00 | 0.01 |
| 45 | 002407 | 多氟多 | 450 | 19,165.50 | 0.01 |
| 46 | 000895 | 双汇发展 | 900 | 18,792.00 | 0.01 |
| 47 | 002340 | 格林美 | 2,100 | 18,417.00 | 0.01 |
| 48 | 300408 | 三环集团 | 1,000 | 17,960.00 | 0.01 |
| 49 | 000568 | 泸州老窖 | 600 | 17,820.00 | 0.01 |
| 50 | 000157 | 中联重科 | 4,300 | 17,759.00 | 0.01 |
| 51 | 000623 | 吉林敖东 | 700 | 17,465.00 | 0.01 |
| 52 | 300124 | 汇川技术 | 900 | 17,460.00 | 0.01 |
| 53 | 002183 | 怡亚通 | 1,200 | 17,184.00 | 0.01 |
| 54 | 000559 | 万向钱潮 | 1,100 | 17,160.00 | 0.01 |
| 55 | 002236 | 大华股份 | 1,300 | 17,030.00 | 0.01 |
| 56 | 000686 | 东北证券 | 1,300 | 16,783.00 | 0.00 |
| 57 | 002500 | 山西证券 | 1,000 | 16,560.00 | 0.00 |
| 58 | 000009 | 中国宝安 | 1,200 | 16,440.00 | 0.00 |
| 59 | 300003 | 乐普医疗 | 900 | 16,416.00 | 0.00 |
| 60 | 000338 | 潍柴动力 | 2,100 | 16,401.00 | 0.00 |
| 61 | 000413 | 东旭光电 | 1,900 | 16,321.00 | 0.00 |
| 62 | 002008 | 大族激光 | 700 | 15,988.00 | 0.00 |
| 63 | 000793 | 华闻传媒 | 1,600 | 15,808.00 | 0.00 |
| 63 | 000876 | 新希望 | 1,900 | 15,808.00 | 0.00 |
| 64 | 002475 | 立讯精密 | 800 | 15,720.00 | 0.00 |
| 65 | 300168 | 万达信息 | 600 | 15,594.00 | 0.00 |
| 66 | 002385 | 大北农 | 1,900 | 15,314.00 | 0.00 |
| 67 | 000750 | 国海证券 | 2,050 | 15,149.50 | 0.00 |
| 68 | 000630 | 铜陵有色 | 5,800 | 14,732.00 | 0.00 |
| 69 | 000061 | 农产品 | 1,200 | 14,592.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-------|-----------|------|
| 70 | 300136 | 信维通信 | 680 | 14,252.80 | 0.00 |
| 71 | 000977 | 浪潮信息 | 600 | 14,070.00 | 0.00 |
| 72 | 002176 | 江特电机 | 900 | 13,860.00 | 0.00 |
| 73 | 000012 | 南玻 A | 1,200 | 13,752.00 | 0.00 |
| 74 | 000540 | 中天城投 | 2,200 | 13,706.00 | 0.00 |
| 75 | 300315 | 掌趣科技 | 1,300 | 13,637.00 | 0.00 |
| 76 | 000060 | 中金岭南 | 1,300 | 13,559.00 | 0.00 |
| 77 | 002007 | 华兰生物 | 420 | 13,188.00 | 0.00 |
| 78 | 002049 | 同方国芯 | 300 | 13,185.00 | 0.00 |
| 79 | 000970 | 中科三环 | 900 | 13,059.00 | 0.00 |
| 80 | 002179 | 中航光电 | 300 | 12,996.00 | 0.00 |
| 81 | 000792 | 盐湖股份 | 600 | 12,660.00 | 0.00 |
| 82 | 000425 | 徐工机械 | 4,100 | 12,546.00 | 0.00 |
| 83 | 000050 | 深天马 A | 600 | 12,522.00 | 0.00 |
| 84 | 300498 | 温氏股份 | 340 | 12,314.80 | 0.00 |
| 85 | 002405 | 四维图新 | 500 | 12,300.00 | 0.00 |
| 86 | 000983 | 西山煤电 | 1,500 | 12,225.00 | 0.00 |
| 87 | 000826 | 启迪桑德 | 400 | 12,220.00 | 0.00 |
| 88 | 002038 | 双鹭药业 | 400 | 12,072.00 | 0.00 |
| 89 | 002085 | 万丰奥威 | 700 | 12,033.00 | 0.00 |
| 90 | 000988 | 华工科技 | 600 | 12,030.00 | 0.00 |
| 91 | 002081 | 金螳螂 | 1,200 | 12,024.00 | 0.00 |
| 92 | 002292 | 奥飞娱乐 | 400 | 11,980.00 | 0.00 |
| 93 | 002030 | 达安基因 | 430 | 11,954.00 | 0.00 |
| 94 | 000709 | 河钢股份 | 4,300 | 11,911.00 | 0.00 |
| 95 | 300077 | 国民技术 | 600 | 11,880.00 | 0.00 |
| 96 | 002400 | 省广股份 | 840 | 11,869.20 | 0.00 |
| 97 | 000748 | 长城信息 | 600 | 11,772.00 | 0.00 |
| 98 | 300058 | 蓝色光标 | 1,200 | 11,652.00 | 0.00 |
| 99 | 000917 | 电广传媒 | 700 | 11,571.00 | 0.00 |
| 100 | 000998 | 隆平高科 | 600 | 11,388.00 | 0.00 |
| 101 | 002426 | 胜利精密 | 1,150 | 11,327.50 | 0.00 |
| 102 | 002065 | 东华软件 | 600 | 11,232.00 | 0.00 |
| 103 | 002273 | 水晶光电 | 400 | 11,196.00 | 0.00 |
| 104 | 300072 | 三聚环保 | 400 | 11,056.00 | 0.00 |
| 105 | 300166 | 东方国信 | 400 | 10,988.00 | 0.00 |
| 106 | 300015 | 爱尔眼科 | 300 | 10,959.00 | 0.00 |
| 107 | 300055 | 万邦达 | 600 | 10,926.00 | 0.00 |
| 108 | 300159 | 新研股份 | 600 | 10,830.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 109 | 000656 | 金科股份 | 2,800 | 10,696.00 | 0.00 |
| 110 | 002152 | 广电运通 | 650 | 10,686.00 | 0.00 |
| 111 | 000661 | 长春高新 | 100 | 10,668.00 | 0.00 |
| 112 | 002701 | 奥瑞金 | 1,200 | 10,596.00 | 0.00 |
| 113 | 000738 | 中航动控 | 400 | 10,560.00 | 0.00 |
| 114 | 300088 | 长信科技 | 700 | 10,409.00 | 0.00 |
| 115 | 000078 | 海王生物 | 1,400 | 10,402.00 | 0.00 |
| 116 | 002108 | 沧州明珠 | 400 | 10,360.00 | 0.00 |
| 116 | 002299 | 圣农发展 | 400 | 10,360.00 | 0.00 |
| 117 | 300079 | 数码视讯 | 1,200 | 10,284.00 | 0.00 |
| 118 | 300133 | 华策影视 | 660 | 10,276.20 | 0.00 |
| 119 | 000046 | 泛海控股 | 1,000 | 10,110.00 | 0.00 |
| 120 | 000581 | 威孚高科 | 500 | 10,080.00 | 0.00 |
| 121 | 000410 | 沈阳机床 | 600 | 10,068.00 | 0.00 |
| 122 | 300144 | 宋城演艺 | 400 | 9,964.00 | 0.00 |
| 123 | 300367 | 东方网力 | 400 | 9,932.00 | 0.00 |
| 124 | 000039 | 中集集团 | 700 | 9,919.00 | 0.00 |
| 125 | 000762 | 西藏矿业 | 400 | 9,888.00 | 0.00 |
| 126 | 300253 | 卫宁健康 | 400 | 9,880.00 | 0.00 |
| 127 | 002168 | 深圳惠程 | 700 | 9,856.00 | 0.00 |
| 128 | 002221 | 东华能源 | 800 | 9,752.00 | 0.00 |
| 129 | 002470 | 金正大 | 1,200 | 9,660.00 | 0.00 |
| 130 | 002266 | 浙富控股 | 1,800 | 9,630.00 | 0.00 |
| 131 | 002544 | 杰赛科技 | 300 | 9,621.00 | 0.00 |
| 132 | 300002 | 神州泰岳 | 900 | 9,576.00 | 0.00 |
| 133 | 002310 | 东方园林 | 400 | 9,568.00 | 0.00 |
| 134 | 002223 | 鱼跃医疗 | 300 | 9,516.00 | 0.00 |
| 135 | 000671 | 阳光城 | 1,600 | 9,504.00 | 0.00 |
| 135 | 000598 | 兴蓉环境 | 1,800 | 9,504.00 | 0.00 |
| 136 | 300216 | 千山药机 | 300 | 9,489.00 | 0.00 |
| 137 | 002311 | 海大集团 | 600 | 9,462.00 | 0.00 |
| 138 | 000031 | 中粮地产 | 1,000 | 9,430.00 | 0.00 |
| 139 | 000758 | 中色股份 | 1,200 | 9,300.00 | 0.00 |
| 140 | 000400 | 许继电气 | 600 | 9,264.00 | 0.00 |
| 141 | 300156 | 神雾环保 | 450 | 9,261.00 | 0.00 |
| 142 | 002422 | 科伦药业 | 600 | 9,246.00 | 0.00 |
| 143 | 002018 | 华信国际 | 970 | 9,215.00 | 0.00 |
| 144 | 002055 | 得润电子 | 300 | 9,186.00 | 0.00 |
| 145 | 000718 | 苏宁环球 | 700 | 9,163.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 146 | 002048 | 宁波华翔 | 400 | 9,148.00 | 0.00 |
| 147 | 000697 | 炼石有色 | 400 | 9,140.00 | 0.00 |
| 148 | 002004 | 华邦健康 | 1,000 | 9,130.00 | 0.00 |
| 149 | 300170 | 汉得信息 | 600 | 9,108.00 | 0.00 |
| 149 | 000729 | 燕京啤酒 | 1,200 | 9,108.00 | 0.00 |
| 150 | 300134 | 大富科技 | 300 | 8,988.00 | 0.00 |
| 151 | 000887 | 中鼎股份 | 400 | 8,844.00 | 0.00 |
| 152 | 000778 | 新兴铸管 | 1,900 | 8,816.00 | 0.00 |
| 153 | 000930 | 中粮生化 | 800 | 8,784.00 | 0.00 |
| 154 | 300068 | 南都电源 | 400 | 8,744.00 | 0.00 |
| 155 | 000566 | 海南海药 | 800 | 8,728.00 | 0.00 |
| 156 | 300347 | 泰格医药 | 300 | 8,706.00 | 0.00 |
| 157 | 300001 | 特锐德 | 400 | 8,676.00 | 0.00 |
| 158 | 300115 | 长盈精密 | 420 | 8,652.00 | 0.00 |
| 159 | 300267 | 尔康制药 | 600 | 8,592.00 | 0.00 |
| 159 | 002250 | 联化科技 | 600 | 8,592.00 | 0.00 |
| 159 | 002075 | 沙钢股份 | 600 | 8,592.00 | 0.00 |
| 160 | 002638 | 勤上光电 | 400 | 8,588.00 | 0.00 |
| 161 | 300324 | 旋极信息 | 400 | 8,584.00 | 0.00 |
| 162 | 002410 | 广联达 | 600 | 8,580.00 | 0.00 |
| 163 | 002022 | 科华生物 | 400 | 8,524.00 | 0.00 |
| 164 | 002001 | 新和成 | 400 | 8,452.00 | 0.00 |
| 165 | 002280 | 联络互动 | 400 | 8,412.00 | 0.00 |
| 166 | 300010 | 立思辰 | 400 | 8,392.00 | 0.00 |
| 167 | 300101 | 振芯科技 | 300 | 8,379.00 | 0.00 |
| 168 | 000883 | 湖北能源 | 1,800 | 8,334.00 | 0.00 |
| 169 | 000712 | 锦龙股份 | 400 | 8,304.00 | 0.00 |
| 170 | 002261 | 拓维信息 | 600 | 8,298.00 | 0.00 |
| 171 | 000979 | 中弘股份 | 3,000 | 8,220.00 | 0.00 |
| 172 | 300053 | 欧比特 | 450 | 8,167.50 | 0.00 |
| 173 | 002326 | 永太科技 | 400 | 8,160.00 | 0.00 |
| 173 | 002294 | 信立泰 | 300 | 8,160.00 | 0.00 |
| 174 | 300033 | 同花顺 | 100 | 8,145.00 | 0.00 |
| 175 | 300199 | 翰宇药业 | 400 | 8,140.00 | 0.00 |
| 176 | 000690 | 宝新能源 | 1,200 | 8,136.00 | 0.00 |
| 177 | 002444 | 巨星科技 | 400 | 8,128.00 | 0.00 |
| 178 | 300146 | 汤臣倍健 | 600 | 8,124.00 | 0.00 |
| 179 | 002191 | 劲嘉股份 | 700 | 8,113.00 | 0.00 |
| 180 | 000960 | 锡业股份 | 700 | 8,092.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 181 | 002146 | 荣盛发展 | 1,200 | 8,064.00 | 0.00 |
| 182 | 300032 | 金龙机电 | 400 | 8,040.00 | 0.00 |
| 182 | 300287 | 飞利信 | 600 | 8,040.00 | 0.00 |
| 183 | 000997 | 新大陆 | 400 | 8,016.00 | 0.00 |
| 184 | 000829 | 天音控股 | 600 | 8,010.00 | 0.00 |
| 185 | 002739 | 万达院线 | 100 | 7,990.00 | 0.00 |
| 186 | 002276 | 万马股份 | 400 | 7,924.00 | 0.00 |
| 187 | 300203 | 聚光科技 | 300 | 7,920.00 | 0.00 |
| 187 | 000687 | 华讯方舟 | 400 | 7,920.00 | 0.00 |
| 188 | 002153 | 石基信息 | 300 | 7,914.00 | 0.00 |
| 189 | 002155 | 湖南黄金 | 600 | 7,902.00 | 0.00 |
| 190 | 000806 | 银河生物 | 400 | 7,776.00 | 0.00 |
| 191 | 002439 | 启明星辰 | 300 | 7,749.00 | 0.00 |
| 192 | 000627 | 天茂集团 | 1,000 | 7,730.00 | 0.00 |
| 193 | 002353 | 杰瑞股份 | 400 | 7,712.00 | 0.00 |
| 194 | 000021 | 深科技 | 700 | 7,707.00 | 0.00 |
| 195 | 300207 | 欣旺达 | 300 | 7,701.00 | 0.00 |
| 196 | 300075 | 数字政通 | 300 | 7,695.00 | 0.00 |
| 197 | 300273 | 和佳股份 | 400 | 7,660.00 | 0.00 |
| 198 | 000066 | 长城电脑 | 600 | 7,650.00 | 0.00 |
| 198 | 000089 | 深圳机场 | 900 | 7,650.00 | 0.00 |
| 199 | 001696 | 宗申动力 | 700 | 7,644.00 | 0.00 |
| 200 | 000800 | 一汽轿车 | 700 | 7,616.00 | 0.00 |
| 201 | 300113 | 顺网科技 | 200 | 7,592.00 | 0.00 |
| 202 | 002312 | 三泰控股 | 400 | 7,580.00 | 0.00 |
| 203 | 300271 | 华宇软件 | 400 | 7,568.00 | 0.00 |
| 204 | 002474 | 榕基软件 | 400 | 7,560.00 | 0.00 |
| 204 | 002501 | 利源精制 | 700 | 7,560.00 | 0.00 |
| 205 | 002185 | 华天科技 | 590 | 7,510.70 | 0.00 |
| 206 | 000415 | 渤海金控 | 1,100 | 7,502.00 | 0.00 |
| 207 | 002129 | 中环股份 | 900 | 7,461.00 | 0.00 |
| 208 | 000592 | 平潭发展 | 1,100 | 7,458.00 | 0.00 |
| 209 | 300020 | 银江股份 | 400 | 7,440.00 | 0.00 |
| 210 | 300012 | 华测检测 | 600 | 7,428.00 | 0.00 |
| 211 | 002665 | 首航节能 | 940 | 7,416.60 | 0.00 |
| 212 | 002025 | 航天电器 | 300 | 7,407.00 | 0.00 |
| 213 | 002067 | 景兴纸业 | 900 | 7,389.00 | 0.00 |
| 214 | 002303 | 美盈森 | 600 | 7,374.00 | 0.00 |
| 215 | 002508 | 老板电器 | 200 | 7,354.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 216 | 300274 | 阳光电源 | 300 | 7,320.00 | 0.00 |
| 217 | 000601 | 韶能股份 | 700 | 7,315.00 | 0.00 |
| 218 | 000973 | 佛塑科技 | 700 | 7,308.00 | 0.00 |
| 219 | 000999 | 华润三九 | 300 | 7,266.00 | 0.00 |
| 220 | 300202 | 聚龙股份 | 300 | 7,263.00 | 0.00 |
| 221 | 002138 | 顺络电子 | 400 | 7,252.00 | 0.00 |
| 222 | 002073 | 软控股份 | 600 | 7,230.00 | 0.00 |
| 223 | 002583 | 海能达 | 600 | 7,224.00 | 0.00 |
| 224 | 002249 | 大洋电机 | 600 | 7,182.00 | 0.00 |
| 225 | 002477 | 雏鹰农牧 | 1,200 | 7,164.00 | 0.00 |
| 226 | 000543 | 皖能电力 | 1,000 | 7,140.00 | 0.00 |
| 227 | 000860 | 顺鑫农业 | 300 | 7,134.00 | 0.00 |
| 228 | 002489 | 浙江永强 | 900 | 7,128.00 | 0.00 |
| 229 | 000878 | 云南铜业 | 700 | 7,126.00 | 0.00 |
| 230 | 000777 | 中核科技 | 300 | 7,068.00 | 0.00 |
| 231 | 300291 | 华录百纳 | 300 | 7,059.00 | 0.00 |
| 232 | 000848 | 承德露露 | 590 | 7,050.50 | 0.00 |
| 233 | 002121 | 科陆电子 | 600 | 7,050.00 | 0.00 |
| 234 | 300011 | 鼎汉技术 | 300 | 7,041.00 | 0.00 |
| 235 | 000926 | 福星股份 | 600 | 7,038.00 | 0.00 |
| 236 | 002047 | 宝鹰股份 | 700 | 7,000.00 | 0.00 |
| 237 | 300026 | 红日药业 | 400 | 6,956.00 | 0.00 |
| 238 | 300251 | 光线传媒 | 600 | 6,936.00 | 0.00 |
| 239 | 002023 | 海特高新 | 400 | 6,932.00 | 0.00 |
| 240 | 002019 | 亿帆鑫富 | 450 | 6,921.00 | 0.00 |
| 241 | 002690 | 美亚光电 | 300 | 6,912.00 | 0.00 |
| 242 | 002431 | 棕榈股份 | 600 | 6,900.00 | 0.00 |
| 243 | 002271 | 东方雨虹 | 400 | 6,892.00 | 0.00 |
| 244 | 002424 | 贵州百灵 | 400 | 6,880.00 | 0.00 |
| 245 | 002428 | 云南锗业 | 400 | 6,872.00 | 0.00 |
| 246 | 300182 | 捷成股份 | 400 | 6,844.00 | 0.00 |
| 247 | 002491 | 通鼎互联 | 400 | 6,824.00 | 0.00 |
| 248 | 000667 | 美好集团 | 1,900 | 6,783.00 | 0.00 |
| 249 | 002375 | 亚厦股份 | 600 | 6,780.00 | 0.00 |
| 250 | 002573 | 清新环境 | 400 | 6,768.00 | 0.00 |
| 251 | 002050 | 三花股份 | 700 | 6,755.00 | 0.00 |
| 252 | 000733 | 振华科技 | 300 | 6,750.00 | 0.00 |
| 253 | 000518 | 四环生物 | 1,000 | 6,740.00 | 0.00 |
| 253 | 000963 | 华东医药 | 100 | 6,740.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-------|----------|------|
| 254 | 300142 | 沃森生物 | 600 | 6,696.00 | 0.00 |
| 255 | 002051 | 中工国际 | 340 | 6,687.80 | 0.00 |
| 256 | 002099 | 海翔药业 | 700 | 6,664.00 | 0.00 |
| 257 | 000825 | 太钢不锈 | 2,100 | 6,636.00 | 0.00 |
| 258 | 000006 | 深振业 A | 900 | 6,633.00 | 0.00 |
| 259 | 300244 | 迪安诊断 | 200 | 6,596.00 | 0.00 |
| 260 | 002104 | 恒宝股份 | 400 | 6,576.00 | 0.00 |
| 261 | 002308 | 威创股份 | 400 | 6,572.00 | 0.00 |
| 262 | 000028 | 国药一致 | 100 | 6,510.00 | 0.00 |
| 263 | 000516 | 国际医学 | 1,100 | 6,435.00 | 0.00 |
| 264 | 002130 | 沃尔核材 | 400 | 6,432.00 | 0.00 |
| 265 | 002595 | 豪迈科技 | 300 | 6,411.00 | 0.00 |
| 266 | 000616 | 海航投资 | 1,200 | 6,408.00 | 0.00 |
| 267 | 000027 | 深圳能源 | 1,000 | 6,380.00 | 0.00 |
| 268 | 000786 | 北新建材 | 700 | 6,356.00 | 0.00 |
| 269 | 000488 | 晨鸣纸业 | 800 | 6,352.00 | 0.00 |
| 270 | 000939 | 凯迪生态 | 700 | 6,265.00 | 0.00 |
| 271 | 000902 | 新洋丰 | 500 | 6,255.00 | 0.00 |
| 272 | 002123 | 荣信股份 | 300 | 6,237.00 | 0.00 |
| 273 | 000685 | 中山公用 | 600 | 6,228.00 | 0.00 |
| 274 | 002063 | 远光软件 | 400 | 6,180.00 | 0.00 |
| 275 | 002588 | 史丹利 | 500 | 6,175.00 | 0.00 |
| 276 | 000541 | 佛山照明 | 600 | 6,174.00 | 0.00 |
| 277 | 000587 | 金洲慈航 | 400 | 6,172.00 | 0.00 |
| 278 | 002467 | 二六三 | 400 | 6,164.00 | 0.00 |
| 279 | 000547 | 航天发展 | 400 | 6,144.00 | 0.00 |
| 280 | 000938 | 紫光股份 | 100 | 6,088.00 | 0.00 |
| 281 | 300085 | 银之杰 | 200 | 5,980.00 | 0.00 |
| 282 | 002384 | 东山精密 | 300 | 5,958.00 | 0.00 |
| 283 | 002161 | 远望谷 | 400 | 5,956.00 | 0.00 |
| 284 | 002440 | 闰土股份 | 400 | 5,940.00 | 0.00 |
| 285 | 002092 | 中泰化学 | 700 | 5,922.00 | 0.00 |
| 286 | 002177 | 御银股份 | 600 | 5,910.00 | 0.00 |
| 286 | 000816 | 智慧农业 | 1,000 | 5,910.00 | 0.00 |
| 286 | 002396 | 星网锐捷 | 300 | 5,910.00 | 0.00 |
| 287 | 300147 | 香雪制药 | 400 | 5,892.00 | 0.00 |
| 288 | 300111 | 向日葵 | 1,200 | 5,880.00 | 0.00 |
| 289 | 000666 | 经纬纺机 | 300 | 5,850.00 | 0.00 |
| 290 | 002550 | 千红制药 | 700 | 5,838.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|-------|----------|------|
| 291 | 000732 | 泰禾集团 | 300 | 5,832.00 | 0.00 |
| 292 | 002197 | 证通电子 | 300 | 5,766.00 | 0.00 |
| 293 | 300178 | 腾邦国际 | 300 | 5,760.00 | 0.00 |
| 294 | 000629 | *ST 钒钛 | 2,400 | 5,736.00 | 0.00 |
| 295 | 000650 | 仁和药业 | 700 | 5,712.00 | 0.00 |
| 296 | 300043 | 互动娱乐 | 400 | 5,668.00 | 0.00 |
| 297 | 300171 | 东富龙 | 300 | 5,664.00 | 0.00 |
| 298 | 002522 | 浙江众成 | 300 | 5,625.00 | 0.00 |
| 299 | 300433 | 蓝思科技 | 200 | 5,624.00 | 0.00 |
| 300 | 000969 | 安泰科技 | 400 | 5,612.00 | 0.00 |
| 301 | 000875 | 吉电股份 | 1,000 | 5,610.00 | 0.00 |
| 302 | 002095 | 生意宝 | 100 | 5,599.00 | 0.00 |
| 303 | 000156 | 华数传媒 | 300 | 5,565.00 | 0.00 |
| 304 | 000158 | 常山股份 | 400 | 5,556.00 | 0.00 |
| 305 | 002390 | 信邦制药 | 600 | 5,544.00 | 0.00 |
| 306 | 000751 | 锌业股份 | 1,000 | 5,530.00 | 0.00 |
| 307 | 002657 | 中科金财 | 100 | 5,494.00 | 0.00 |
| 308 | 002339 | 积成电子 | 300 | 5,472.00 | 0.00 |
| 309 | 002071 | 长城影视 | 400 | 5,456.00 | 0.00 |
| 310 | 002242 | 九阳股份 | 300 | 5,454.00 | 0.00 |
| 311 | 002285 | 世联行 | 700 | 5,453.00 | 0.00 |
| 312 | 002013 | 中航机电 | 400 | 5,392.00 | 0.00 |
| 313 | 002376 | 新北洋 | 400 | 5,344.00 | 0.00 |
| 314 | 002366 | 台海核电 | 100 | 5,331.00 | 0.00 |
| 315 | 000961 | 中南建设 | 950 | 5,329.50 | 0.00 |
| 316 | 000937 | 冀中能源 | 1,000 | 5,320.00 | 0.00 |
| 317 | 002005 | 德豪润达 | 900 | 5,319.00 | 0.00 |
| 318 | 002089 | 新海宜 | 300 | 5,313.00 | 0.00 |
| 319 | 002463 | 沪电股份 | 1,000 | 5,280.00 | 0.00 |
| 320 | 002642 | 荣之联 | 200 | 5,262.00 | 0.00 |
| 321 | 002421 | 达实智能 | 300 | 5,241.00 | 0.00 |
| 322 | 000600 | 建投能源 | 600 | 5,238.00 | 0.00 |
| 323 | 000099 | 中信海直 | 400 | 5,200.00 | 0.00 |
| 324 | 000572 | 海马汽车 | 1,000 | 5,190.00 | 0.00 |
| 325 | 000851 | 高鸿股份 | 400 | 5,156.00 | 0.00 |
| 326 | 002237 | 恒邦股份 | 400 | 5,152.00 | 0.00 |
| 327 | 002570 | 贝因美 | 400 | 5,116.00 | 0.00 |
| 328 | 300005 | 探路者 | 300 | 5,115.00 | 0.00 |
| 329 | 002577 | 雷柏科技 | 100 | 5,105.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-------|----------|------|
| 330 | 002056 | 横店东磁 | 300 | 5,100.00 | 0.00 |
| 331 | 002681 | 奋达科技 | 300 | 5,064.00 | 0.00 |
| 332 | 002714 | 牧原股份 | 100 | 5,053.00 | 0.00 |
| 333 | 300226 | 上海钢联 | 100 | 5,040.00 | 0.00 |
| 334 | 002429 | 兆驰股份 | 600 | 5,028.00 | 0.00 |
| 335 | 000898 | 鞍钢股份 | 1,300 | 4,979.00 | 0.00 |
| 336 | 000558 | 莱茵体育 | 300 | 4,962.00 | 0.00 |
| 337 | 300257 | 开山股份 | 300 | 4,956.00 | 0.00 |
| 338 | 002298 | 中电鑫龙 | 300 | 4,950.00 | 0.00 |
| 339 | 000563 | 陕国投 A | 900 | 4,941.00 | 0.00 |
| 340 | 000801 | 四川九洲 | 400 | 4,928.00 | 0.00 |
| 341 | 002195 | 二三四五 | 400 | 4,916.00 | 0.00 |
| 342 | 300413 | 快乐购 | 200 | 4,870.00 | 0.00 |
| 343 | 300090 | 盛运环保 | 600 | 4,854.00 | 0.00 |
| 344 | 002603 | 以岭药业 | 300 | 4,773.00 | 0.00 |
| 345 | 002106 | 莱宝高科 | 400 | 4,752.00 | 0.00 |
| 346 | 002527 | 新时达 | 300 | 4,740.00 | 0.00 |
| 347 | 300197 | 铁汉生态 | 340 | 4,712.40 | 0.00 |
| 348 | 002244 | 滨江集团 | 700 | 4,690.00 | 0.00 |
| 349 | 002041 | 登海种业 | 300 | 4,662.00 | 0.00 |
| 350 | 002773 | 康弘药业 | 100 | 4,655.00 | 0.00 |
| 351 | 000897 | 津滨发展 | 1,200 | 4,644.00 | 0.00 |
| 352 | 300122 | 智飞生物 | 300 | 4,641.00 | 0.00 |
| 353 | 002358 | 森源电气 | 300 | 4,629.00 | 0.00 |
| 354 | 002318 | 久立特材 | 400 | 4,628.00 | 0.00 |
| 355 | 002630 | 华西能源 | 400 | 4,612.00 | 0.00 |
| 356 | 000513 | 丽珠集团 | 100 | 4,611.00 | 0.00 |
| 357 | 000652 | 泰达股份 | 1,000 | 4,600.00 | 0.00 |
| 358 | 002217 | 合力泰 | 300 | 4,590.00 | 0.00 |
| 359 | 000807 | 云铝股份 | 700 | 4,585.00 | 0.00 |
| 360 | 000528 | 柳工 | 700 | 4,536.00 | 0.00 |
| 361 | 002556 | 辉隆股份 | 300 | 4,533.00 | 0.00 |
| 362 | 000830 | 鲁西化工 | 1,000 | 4,520.00 | 0.00 |
| 363 | 000539 | 粤电力 A | 900 | 4,518.00 | 0.00 |
| 364 | 000735 | 罗牛山 | 700 | 4,515.00 | 0.00 |
| 365 | 002011 | 盾安环境 | 400 | 4,512.00 | 0.00 |
| 366 | 002128 | 露天煤业 | 600 | 4,506.00 | 0.00 |
| 367 | 002373 | 千方科技 | 300 | 4,482.00 | 0.00 |
| 368 | 000861 | 海印股份 | 900 | 4,446.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 369 | 002663 | 普邦园林 | 600 | 4,416.00 | 0.00 |
| 370 | 300052 | 中青宝 | 200 | 4,406.00 | 0.00 |
| 371 | 002269 | 美邦服饰 | 1,000 | 4,400.00 | 0.00 |
| 372 | 002625 | 龙生股份 | 100 | 4,398.00 | 0.00 |
| 373 | 002178 | 延华智能 | 400 | 4,392.00 | 0.00 |
| 373 | 002078 | 太阳纸业 | 900 | 4,392.00 | 0.00 |
| 374 | 300238 | 冠昊生物 | 100 | 4,388.00 | 0.00 |
| 375 | 002028 | 思源电气 | 400 | 4,380.00 | 0.00 |
| 376 | 002437 | 誉衡药业 | 500 | 4,350.00 | 0.00 |
| 377 | 002154 | 报喜鸟 | 900 | 4,347.00 | 0.00 |
| 378 | 002498 | 汉缆股份 | 1,000 | 4,340.00 | 0.00 |
| 379 | 002563 | 森马服饰 | 400 | 4,332.00 | 0.00 |
| 380 | 000975 | 银泰资源 | 300 | 4,317.00 | 0.00 |
| 381 | 300369 | 绿盟科技 | 100 | 4,231.00 | 0.00 |
| 382 | 000090 | 天健集团 | 480 | 4,224.00 | 0.00 |
| 383 | 000049 | 德赛电池 | 100 | 4,194.00 | 0.00 |
| 384 | 002482 | 广田股份 | 550 | 4,169.00 | 0.00 |
| 385 | 002215 | 诺普信 | 400 | 4,136.00 | 0.00 |
| 386 | 300039 | 上海凯宝 | 400 | 4,068.00 | 0.00 |
| 387 | 002029 | 七匹狼 | 400 | 4,060.00 | 0.00 |
| 388 | 000869 | 张裕 A | 100 | 4,018.00 | 0.00 |
| 389 | 000901 | 航天科技 | 100 | 4,015.00 | 0.00 |
| 390 | 002433 | 太安堂 | 400 | 4,008.00 | 0.00 |
| 391 | 002649 | 博彦科技 | 100 | 3,957.00 | 0.00 |
| 392 | 002074 | 国轩高科 | 100 | 3,947.00 | 0.00 |
| 393 | 002344 | 海宁皮城 | 400 | 3,900.00 | 0.00 |
| 394 | 000088 | 盐田港 | 600 | 3,864.00 | 0.00 |
| 395 | 300352 | 北信源 | 200 | 3,734.00 | 0.00 |
| 396 | 002093 | 国脉科技 | 300 | 3,723.00 | 0.00 |
| 397 | 000620 | 新华联 | 400 | 3,660.00 | 0.00 |
| 398 | 002493 | 荣盛石化 | 300 | 3,636.00 | 0.00 |
| 399 | 002432 | 九安医疗 | 200 | 3,628.00 | 0.00 |
| 400 | 300288 | 朗玛信息 | 100 | 3,626.00 | 0.00 |
| 401 | 002555 | 三七互娱 | 200 | 3,620.00 | 0.00 |
| 402 | 300074 | 华平股份 | 300 | 3,600.00 | 0.00 |
| 403 | 300339 | 润和软件 | 100 | 3,584.00 | 0.00 |
| 404 | 002268 | 卫士通 | 100 | 3,574.00 | 0.00 |
| 405 | 002368 | 太极股份 | 100 | 3,553.00 | 0.00 |
| 406 | 002190 | 成飞集成 | 100 | 3,544.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-----|----------|------|
| 407 | 002505 | 大康农业 | 900 | 3,510.00 | 0.00 |
| 408 | 002399 | 海普瑞 | 200 | 3,492.00 | 0.00 |
| 409 | 002672 | 东江环保 | 200 | 3,466.00 | 0.00 |
| 410 | 300228 | 富瑞特装 | 200 | 3,400.00 | 0.00 |
| 411 | 002170 | 芭田股份 | 400 | 3,376.00 | 0.00 |
| 412 | 002151 | 北斗星通 | 100 | 3,366.00 | 0.00 |
| 413 | 002181 | 粤传媒 | 400 | 3,284.00 | 0.00 |
| 414 | 000401 | 冀东水泥 | 300 | 3,270.00 | 0.00 |
| 415 | 000767 | 漳泽电力 | 900 | 3,258.00 | 0.00 |
| 416 | 300295 | 三六五网 | 100 | 3,250.00 | 0.00 |
| 417 | 000555 | 神州信息 | 100 | 3,239.00 | 0.00 |
| 418 | 002174 | 游族网络 | 100 | 3,200.00 | 0.00 |
| 419 | 000931 | 中关村 | 400 | 3,192.00 | 0.00 |
| 420 | 300152 | 科融环境 | 400 | 3,016.00 | 0.00 |
| 421 | 300212 | 易华录 | 100 | 2,977.00 | 0.00 |
| 422 | 000062 | 深圳华强 | 100 | 2,700.00 | 0.00 |
| 423 | 002414 | 高德红外 | 100 | 2,697.00 | 0.00 |
| 424 | 000987 | 广州友谊 | 200 | 2,580.00 | 0.00 |
| 425 | 002229 | 鸿博股份 | 100 | 2,508.00 | 0.00 |
| 426 | 000693 | ST 华泽 | 200 | 2,500.00 | 0.00 |
| 427 | 300336 | 新文化 | 100 | 2,498.00 | 0.00 |
| 428 | 000681 | 视觉中国 | 100 | 2,365.00 | 0.00 |
| 429 | 002143 | 印纪传媒 | 100 | 2,343.00 | 0.00 |
| 430 | 002551 | 尚荣医疗 | 100 | 2,338.00 | 0.00 |
| 431 | 002568 | 百润股份 | 100 | 2,200.00 | 0.00 |
| 432 | 300229 | 拓尔思 | 100 | 2,138.00 | 0.00 |
| 433 | 000553 | 沙隆达 A | 200 | 2,136.00 | 0.00 |
| 434 | 000996 | 中国中期 | 100 | 2,068.00 | 0.00 |
| 435 | 000727 | 华东科技 | 600 | 1,980.00 | 0.00 |
| 436 | 002698 | 博实股份 | 100 | 1,926.00 | 0.00 |
| 437 | 002658 | 雪迪龙 | 100 | 1,739.00 | 0.00 |
| 438 | 002653 | 海思科 | 100 | 1,602.00 | 0.00 |
| 439 | 300205 | 天喻信息 | 100 | 1,479.00 | 0.00 |

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 | 000001 | 平安银行 | 166,600.00 | 0.04 |
| 2 | 000725 | 京东方 A | 147,980.00 | 0.04 |
| 3 | 002024 | 苏宁云商 | 121,716.00 | 0.03 |
| 4 | 000858 | 五粮液 | 118,006.00 | 0.03 |
| 5 | 000776 | 广发证券 | 113,600.00 | 0.03 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 112,514.00 | 0.03 |
| 7 | 000651 | 格力电器 | 112,230.00 | 0.03 |
| 8 | 002415 | 海康威视 | 91,108.00 | 0.02 |
| 9 | 000783 | 长江证券 | 84,355.00 | 0.02 |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 83,933.00 | 0.02 |
| 11 | 000063 | 中兴通讯 | 82,614.00 | 0.02 |
| 12 | 001979 | 招商蛇口 | 78,143.00 | 0.02 |
| 13 | 000625 | 长安汽车 | 77,192.00 | 0.02 |
| 14 | 002304 | 洋河股份 | 77,058.00 | 0.02 |
| 15 | 000100 | TCL 集团 | 75,492.00 | 0.02 |
| 16 | 000538 | 云南白药 | 72,417.00 | 0.02 |
| 17 | 300017 | 网宿科技 | 71,925.00 | 0.02 |
| 18 | 000166 | 申万宏源 | 71,484.00 | 0.02 |
| 19 | 002594 | 比亚迪 | 70,152.00 | 0.02 |
| 20 | 002736 | 国信证券 | 68,950.00 | 0.02 |

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 | 000839 | 中信国安 | 194,923.00 | 0.05 |
| 2 | 002310 | 东方园林 | 107,396.00 | 0.03 |
| 3 | 002219 | 恒康医疗 | 99,449.00 | 0.03 |
| 4 | 000748 | 长城信息 | 90,190.00 | 0.02 |
| 5 | 002191 | 劲嘉股份 | 81,858.00 | 0.02 |
| 6 | 002018 | 华信国际 | 80,331.00 | 0.02 |
| 7 | 300134 | 大富科技 | 75,201.00 | 0.02 |
| 8 | 000066 | 长城电脑 | 56,098.00 | 0.01 |

| | | | | |
|----|--------|------|-----------|------|
| 9 | 300028 | 金亚科技 | 55,328.00 | 0.01 |
| 10 | 002384 | 东山精密 | 52,525.96 | 0.01 |
| 11 | 300168 | 万达信息 | 44,822.00 | 0.01 |
| 12 | 000426 | 兴业矿业 | 44,160.00 | 0.01 |
| 13 | 002235 | 安妮股份 | 42,531.50 | 0.01 |
| 14 | 300020 | 银江股份 | 42,342.00 | 0.01 |
| 15 | 000851 | 高鸿股份 | 34,822.00 | 0.01 |
| 16 | 001979 | 招商蛇口 | 33,220.00 | 0.01 |
| 17 | 002665 | 首航节能 | 32,670.00 | 0.01 |
| 18 | 000876 | 新希望 | 32,154.00 | 0.01 |
| 19 | 002638 | 勤上光电 | 29,302.00 | 0.01 |
| 20 | 002309 | 中利科技 | 26,964.00 | 0.01 |

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 | 11,173,301.48 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,193,424.10 |

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） | 300.00 | 0.00 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 300.00 | 0.00 |

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 | 3 | 300.00 | 0.00 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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 | 南方深证成份 ETF | 股票型 | 交易型开放式 | 南方基金管理有限公司 | 312,840,378.80 | 93.20 |

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注**7.13.1**

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。

7.13.2

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。

7.13.3 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 | 4,751.51 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,071.98 |
| 5 | 应收申购款 | 38,186.56 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 46,010.05 |

7.13.4 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。

7.13.5 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值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|---------------|----------|
| 1 | 002052 | 同洲电子 | 36,108.00 | 0.01 | 重大事项停牌 |

§ 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

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 |
| 14,945 | 26,532.50 | 1,045,635.02 | 0.26% | 395,482,520.70 | 99.74% |

8.2 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 | 274,158.77 | 0.0691% |

8.3 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 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2009年12月9日）基金份额总额 | 3,272,356,687.80 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 388,780,178.24 |
| 本报告期基金总申购份额 | 33,168,949.54 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 25,420,972.06 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 396,528,155.72 |

§ 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

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

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 | |
| 华泰证券 | 1 | 14,366,725.58 | 100.00% | 1,437.08 | 100.00% | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | | 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 |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - | 22,547,468.35 | 87.93% |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - | 3,094,783.48 | 12.07% |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

注：1、基金交易额中包括基金申购赎回和买入卖出成交金额，其中基金申购赎回金额 25,642,251.83 元，基金买入卖出金额 0.00 元。

2、本期租用证券公司交易单元无变更情况。

3、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交易单元：

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

10.8 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 | 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 | 2016 年 6 月 30 日 |
| 2 | 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 | 2016 年 6 月 30 日 |
| 3 | 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 | 2016 年 6 月 30 日 |
| 4 | 南方基金关于旗下部分基金增加余杭农村商业银行行为代销机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 6 月 23 日 |
| 5 | 南方基金关于旗下部分基金增加晋商银行和贵阳银行为代销机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 6 月 23 日 |
| 6 | 南方基金关于旗下部分基金增加泰隆银行为代销机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 6 月 3 日 |
| 7 | 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 | 2016 年 5 月 14 日 |

| | | | |
|----|---|------------------|------------|
| 8 | 南方基金关于旗下部分基金增加汇成基金为代销机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年5月13日 |
| 9 | 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 | 2016年5月10日 |
| 10 | 南方基金关于旗下部分基金增加徽商期货为代销机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年4月18日 |
| 11 | 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 |
| 12 | 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 | 2016年3月30日 |
| 13 | 南方基金关于旗下部分基金增加鼎信汇金为代销机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年3月9日 |
| 14 | 关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年2月18日 |
| 15 | 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 |
| 16 | 南方基金关于旗下部分基金增加陆金所资管、唐鼎耀华为代销机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年2月1日 |
| 17 | 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 | 2016年1月27日 |
| 18 | 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 |
| 19 | 南方基金关于旗下部分基金增加中证金牛为代销机构及开通相关业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年1月26日 |
| 20 | 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 |
| 21 | 关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年1月8日 |
| 22 | 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 |
| 23 | 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 |
| 24 | 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 | 2016年1月5日 |
| 25 | 南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年1月4日 |
| 26 | 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文件。
- 2、《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》。
- 3、《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》。
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

11.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

11.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>