

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 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
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、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	15
4.10 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.....	15
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
§ 8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	51
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	66
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	66

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	66
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	66
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	66
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	66
8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	67
8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	67
8.13 投资组合报告附注.....	67
§9 基金份额持有人信息.....	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	69
§10 开放式基金份额变动.....	70
§11 重大事件揭示.....	71
11.1 基金份额持有人大会决议.....	71
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	71
11.4 基金投资策略的改变.....	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	72
11.8 其他重大事件.....	74
§12 备查文件目录.....	77
12.1 备查文件目录.....	77
12.2 存放地点.....	77
12.3 查阅方式.....	77

§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	378,088,340.31 份

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	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。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

	<p>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偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p>
业绩比较基准	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，从而使使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p>
业绩比较基准	<p>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。</p> <p>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。</p>
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	郭明
	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		张海波	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	南方基金管理有限公司	深圳市福田区中心区福华一路 6 号免税商务大厦塔楼 31-33 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-428,728.69	295,299,154.33	-117,709,516.18
本期利润	-68,378,453.45	299,221,069.68	318,515,098.52
加权平均基金份额本期利润	-0.1743	0.4114	0.1887
本期加权平均净值利润率	-20.76%	41.34%	29.75%
本期基金份额净值增长率	-17.77%	15.13%	35.49%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	-64,352,367.03	3,532,751.04	-310,213,587.97
期末可供分配基金份额利润	-0.1702	0.0091	-0.2328
期末基金资产净值	313,735,973.28	392,312,929.28	1,168,231,840.06
期末基金份额净值	0.8298	1.0091	0.8765
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	-17.02%	0.91%	-12.35%

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、本基金自 2010 年 7 月 2 日起基金份额净值的计算位数由小数点后 3 位变更为小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

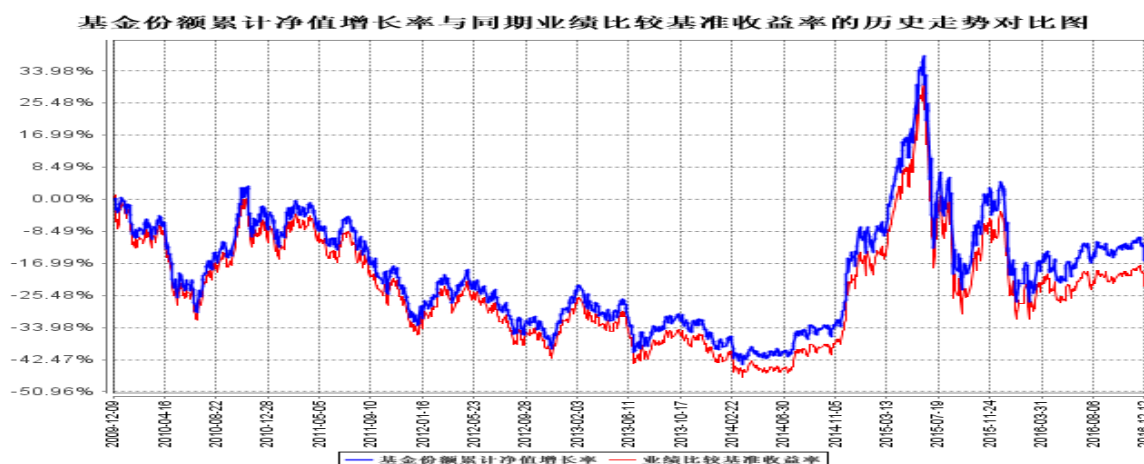
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

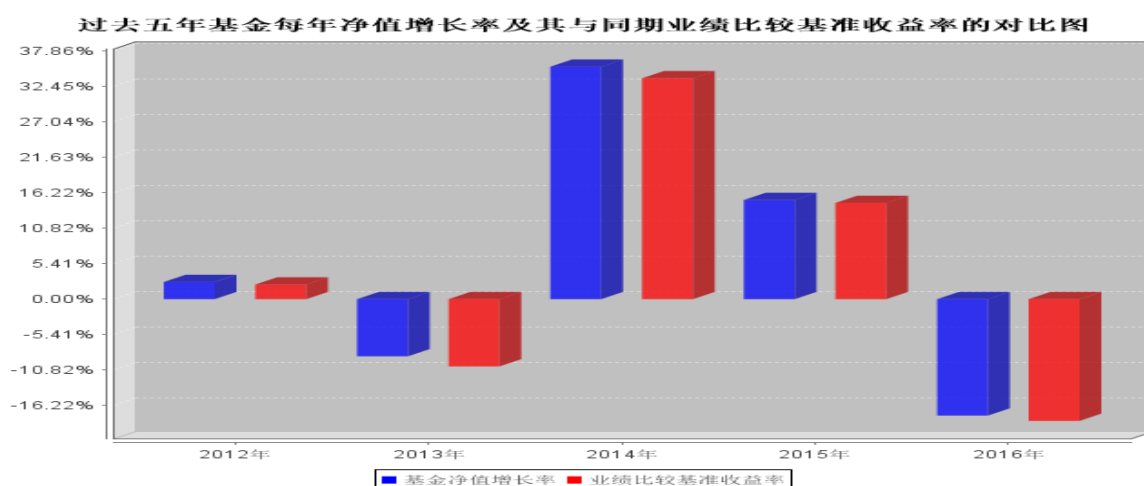
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.46%	0.80%	-3.50%	0.81%	0.04%	-0.01%
过去六个月	-1.97%	0.89%	-2.80%	0.89%	0.83%	0.00%

过去一年	-17.77%	1.77%	-18.59%	1.71%	0.82%	0.06%
过去三年	28.27%	1.88%	24.85%	1.89%	3.42%	-0.01%
过去五年	20.14%	1.69%	14.54%	1.70%	5.60%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-17.02%	1.62%	-23.94%	1.64%	6.92%	-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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模近6,500亿元，旗下管理116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	2016年 11月 25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，现任资产配置部副总监、FOF投资决策委员会委员兼秘书；2010年8月至2016年11月，任小康ETF及南方小康基金经理；2013年4月至2016年11月，任南方深成及南方深成ETF的基金经理；2013年5月至2016年11月，任南方上证380ETF及联接基金的基金经理；2015年7月至2016年11月，任南方互联基金的基金经理。
孙伟	本基金基金经理	2016年 8月 19日	-	6年	管理学学士，具有基金从业资格、金融分析师（CFA）资格、注册会计师（CPA）资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事

	理			<p>务所深圳分所审计部。2010 年 2 月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员；2014 年 12 月至 2015 年 5 月，担任南方恒生 ETF 的基金经理助理；2015 年 5 月至 2016 年 7 月，任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 7 月至今，任改革基金、高铁基金、500 信息基金经理；2016 年 5 月至今，任南方创业板 ETF、南方创业板 ETF 联接基金经理；2016 年 8 月至今，任 500 信息联接、深成 ETF、南方深成基金经理。</p>
--	---	--	--	---

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，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为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，相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本年度深证成指在1月份大跌25.64%，2月份见全年低点后开始缓步抬升、振幅收窄，并于12月再次出现了快速调整，最终全年收跌19.64%。

期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本年度跟踪误差和正偏离分别为 0.93%和 1.87%，理想地完成了投资目标。

截至报告期末，本基金份额净值为 0.8298 元，报告期内，份额净值增长率为-17.77%，同期业绩基准增长率为-18.59%。

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。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，全球流动性拐点出现的趋势越来越明显，各国都面临无风险利率上升的压力，此外，发达国家民粹主义和保守主义普遍抬头。特朗普美国新政府的经济复兴计划有利于我国出口，但贸易保护措施和制造业回流政策又不利于我国长期发展格局，且美国利率的持续回升将给国内利率带来较大压力。另一方面，从估值、盈利和跨境比较角度看，权益类资产经历三轮大幅下跌后，投资性价比已经大幅提高，但后市行情能否走好较为依赖投资者风险偏好的提升。

深证成指选取深圳证券市场中市值规模与流动性综合排名前 500 的 A 股组成样本股，随着经济转型不断深化，深证成指中新兴产业的权重在持续提高，凸显了深圳市场以科技、新兴为核心的行业结构特点。投资者可通过本基金或南方深成 ETF 分享指数收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展情况，围绕重合规守底线、抓规范促发展，坚持从保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，积极推动主动合规风控管理，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展情况，不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，并开展了互联网金融相关业务风险自查、信息技术专项自查等多项内控自查工作，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性，推动公司合规、内控体系的健全完善；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，持续完善投资合规风控制度流程和系统，积极配合各类新产品、新业务，重点加强内幕交易防控以及对高风险品种和业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，有效确保投研交易业务的合规开展；针对新出台的法律法规和

监管要求，积极组织了多项法律法规、职业道德培训以及合规考试，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况，督促落实销售适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；深入贯彻风险为本的反洗钱工作原则，优化反洗钱资源配置，加大反洗钱投入力度，购置外部专业机构制裁名单数据库，积极推进符合基金业务特征的可疑交易监控模型和方法，健全创新业务洗钱风险评估机制，各项反洗钱工作进一步完善；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总经理、研究部总监、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，同一类别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，本基金每类基金份额的收益分配每年最多 6 次，各基金份额类别每次基金收益分配比例不得低于该类基金份额基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；本基金 A 类基金份额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该类基金份额净值自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金 A 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；目前本基金 H 类基金份额收益分配方式仅为现金分红；如未来条件允许，本基金 H 类基金份额可增加红利再投资

的收益分配方式供 H 类基金份额持有人选择，该项调整须经基金管理人与基金托管人协商一致并报中国证监会备案并公告后实施，无需召开基金份额持有人大会审议；增加红利再投资的收益分配后，如 H 类基金份额持有人未选择，本基金 H 类基金份额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。。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 21499 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附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(以下简称“深证成份 ETF 联接基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是深证成份 ETF 联接基金 的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册</p>

	<p>会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述深证成份 ETF 联接基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了深证成份 ETF 联接基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	薛竞 陈熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	中国 · 上海市
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	16,664,396.75	21,735,714.30
结算备付金		38.82	-
存出保证金		3,114.56	92,121.16
交易性金融资产	7.4.7.2	297,700,966.53	370,974,921.47
其中：股票投资		1,092,548.52	2,168,706.18
基金投资		296,608,418.01	368,806,215.29
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,691.73	4,971.51
应收股利		-	-
应收申购款		32,373.04	40,921.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	28,436.06	-
资产总计		314,431,017.49	392,848,649.95
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		196,708.11	-
应付赎回款		129,571.84	445,188.70
应付管理人报酬		8,933.44	11,402.64
应付托管费		1,786.70	2,280.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,811.34	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	7.4.7.8	355,232.78	74,378.52
负债合计		695,044.21	535,720.67
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	378,088,340.31	388,780,178.24
未分配利润	7.4.7.10	-64,352,367.03	3,532,751.04
所有者权益合计		313,735,973.28	392,312,929.28
负债和所有者权益总计		314,431,017.49	392,848,649.95

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 378,088,340.31 份(均为 A 类基金份额)，A 类基金份额净值 0.8298 元；无 H 类基金份额。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至	2015 年 1 月 1 日至

		2016年12月31日	2015年12月31日
一、收入		-67,842,769.06	301,885,894.53
1.利息收入		166,747.00	341,908.81
其中：存款利息收入	7.4.7.11	141,260.38	341,908.81
债券利息收入		0.80	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		25,485.82	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-95,979.36	297,116,080.26
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-179,285.04	1,415,113.52
基金投资收益	7.4.7.13	37,263.19	295,589,871.87
债券投资收益	7.4.7.14	324.75	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	45,717.74	111,094.87
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-67,949,724.76	3,921,915.35
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	36,188.06	505,990.11
减：二、费用		535,684.39	2,664,824.85
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	126,779.91	237,146.98
2. 托管费	7.4.10.2.2	25,356.02	47,429.40
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	27,162.13	1,998,452.67
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 其他费用	7.4.7.20	356,386.33	381,795.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-68,378,453.45	299,221,069.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-68,378,453.45	299,221,069.68

7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	-68,378,453.45	-68,378,453.45
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）	-10,691,837.93	493,335.38	-10,198,502.55
其中：1.基金申购款	49,921,287.16	-8,479,149.46	41,442,137.70
2.基金赎回款	-60,613,125.09	8,972,484.84	-51,640,640.25
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)	378,088,340.31	-64,352,367.03	313,735,973.28
项目	上年度可比期间		
	2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,332,798,617.99	-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)	-	299,221,069.68	299,221,069.68
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)	-944,018,439.75	-131,121,540.71	-1,075,139,980.46
其中：1.基金申购款	326,385,558.66	-11,628,697.72	314,756,860.94
2.基金赎回款	-1,270,403,998.41	-119,492,842.99	-1,389,896,841.40
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)	388,780,178.24	3,532,751.04	392,312,929.28

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]1066号《关于核准深证成份交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方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》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集3,272,001,140.97元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第276号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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》于2009年12月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,272,356,687.80份基金份额,其中认购资金利息折合355,546.83元基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《关于南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金增设H类基金份额类别并修改基金合同的公告》以及更新的《南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》的有关规定,自2016年8月30日起,本基金根据销售区域的不同,将基金份额分为不同的类别。在中国内地销售的、为中国内地投资者设立的份额,称为A类基金份额;在中国香港地区销售的、为中国香港投资者设立的份额,称为H类基金份额。本基金A类基金份额、H类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。除非基金管理人在未来条件成熟后另行公告开通相关业务,本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

本基金为深证成份交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标ETF”)的联接基金。目标ETF是采用完全复制法实现对深证成份指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争使本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%,年跟踪误差不超过4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方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》的有关规定,本基金的投资范围为深证成份交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标ETF”)、深证成份指数成份股和备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%,权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金业绩比较基准为:深证成份指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 2017 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和基金投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本

基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认

金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，A 类基金份

额的基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；H类基金份额的收益分配仅采用现金方式。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2015]125号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别，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该内地基金分配利息时按照7%的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照10%的税率代扣代缴所得税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
活期存款	16,664,396.75	21,735,714.30
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计:	16,664,396.75	21,735,714.30

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,117,091.54	1,092,548.52	-24,543.02
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	304,067,483.98	296,608,418.01	-7,459,065.97
其他	-	-	-
合计	305,184,575.52	297,700,966.53	-7,483,608.99
项目	上年度末		
	2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,292,336.79	2,168,706.18	-123,630.61
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		308,216,468.91	368,806,215.29	60,589,746.38
其他		-	-	-
合计		310,508,805.70	370,974,921.47	60,466,115.77

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

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

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,690.33	4,926.46
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	-	3.55
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1.40	41.50
合计	1,691.73	4,971.51

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
其他应收款	28,436.06	-
待摊费用	-	-
合计	28,436.06	-

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,811.34	2,470.28
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,811.34	2,470.28

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付赎回费	232.78	1,017.88
预提费用	355,000.00	73,360.64
合计	355,232.78	74,378.52

7.4.7.9 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 12 月 31 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	49,921,287.16	49,921,287.16

本期赎回(以“-”号填列)	-60,613,125.09	-60,613,125.09
本期末	378,088,340.31	378,088,340.31

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. H 类份额尚未开放申购赎回业务。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	70,332,968.44	-66,800,217.40	3,532,751.04
本期利润	-428,728.69	-67,949,724.76	-68,378,453.45
本期基金份额交易产生的变动数	-1,912,058.51	2,405,393.89	493,335.38
其中：基金申购款	8,988,813.99	-17,467,963.45	-8,479,149.46
基金赎回款	-10,900,872.50	19,873,357.34	8,972,484.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	67,992,181.24	-132,344,548.27	-64,352,367.03

7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	140,478.50	323,923.64
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	233.39	12,570.09
其他	548.49	5,415.08
合计	141,260.38	341,908.81

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至 2016年12月31日	2015年1月1日至2015年 12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	164,664.37	2,382,575.41
股票投资收益——申购差价收入	-343,949.41	-967,461.89
合计	-179,285.04	1,415,113.52

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至 2016年12月31日	2015年1月1日至 2015年12月31日
卖出股票成交总额	19,978,186.04	1,017,622,225.41
减：卖出股票成本总额	19,813,521.67	1,015,239,650.00
买卖股票差价收入	164,664.37	2,382,575.41

7.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至 2016年12月31日	2015年1月1日至2015年 12月31日
申购基金份额总额	19,239,300.00	143,937,300.00
减：现金支付申购款总额	1,344,643.10	5,062,557.03
减：申购股票成本总额	18,238,606.31	139,842,204.86
申购差价收入	-343,949.41	-967,461.89

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	23,414,716.52	1,176,116,432.92
减：卖出/赎回基金成本总额	23,377,453.33	880,526,561.05
基金投资收益	37,263.19	295,589,871.87

7.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年 12月31日	2015年1月1日至2015年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	1,825.55	-
减：卖出债券（、债转股及债 券到期兑付）成本总额	1,500.00	-
减：应收利息总额	0.80	-
买卖债券差价收入	324.75	-

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	45,717.74	111,094.87
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	45,717.74	111,094.87

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
1. 交易性金融资产	-67,949,724.76	3,921,915.35
——股票投资	99,087.59	-173,984.27
——债券投资	-	-
——基金投资	-68,048,812.35	4,095,899.62
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-67,949,724.76	3,921,915.35

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
基金赎回费收入	24,898.68	372,955.45
基金转换费收入	11,289.38	133,034.66
合计	36,188.06	505,990.11

注：1. A类基金份额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；H类基金份额赎回费率为0.125%，赎回费全额归入基金资产。

2. A类基金份额的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费两部分构成，其中赎回费部分的25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
交易所市场交易费用	27,162.13	1,998,452.67
银行间市场交易费用	-	-
合计	27,162.13	1,998,452.67

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
审计费用	55,000.00	72,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行划款手续费	198.00	310.00
指数使用费	1,188.33	9,485.80
合计	356,386.33	381,795.80

注：于2016年3月31日前，指数使用费为支付给标的指数供应商的指数授权使用费，按前一日基金资产净值扣除所持有深证成份交易型开放式指数证券投资基金部分资产后的余额（若为负数，则取零）的0.02%的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数授权使用费不设最低下限金额。自2016年4月1日起，本基金不再支付标的指数的指数使用费。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

1. 根据《关于南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金增设C类基金份额并修改基金合同的公告》，自2017年2月23日起，本基金根据申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取前端申购费用的称为A类基金份额；从

本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用的称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，并分别计算基金份额净值。

2. 财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**7.4.10.1.1 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12月 31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
华泰证券	33,795,911.52	100.00%	516,230,064.57	44.79%

7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	42,654,003.61	100.00%	648,343,094.71	48.99%

注：2016年度基金成交金额中包括基金申购赎回42,654,003.61元，无基金二级市场买卖金额。

(2015年度基金成交金额中包括基金申购赎回561,439,707.52元，基金二级市场买卖86,903,387.19元)。

7.4.10.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.4 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12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券	3,380.02	100.00%	2,811.34	100.00%

关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券	270,949.17	32.84%	2,470.28	100.00%

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	126,779.91	237,146.98
其中：支付销售机构的客户维护费	320,403.82	649,886.41

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 0.50% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产}) \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	25,356.02	47,429.40

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:

$$\text{日托管费} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产}) \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间无各关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国工商银行	16,664,396.75	140,478.50	21,735,714.30

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管, 按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末, 本基金持有 270,321,432 份目标 ETF 基金份额(2015 年 12 月 31 日 276,321,432 份), 占其份额的比例为 59.13%(2015 年 12 月 31 日: 58.90%)。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末(2016 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002129	中环股份	2016年 4月25日	重大事项	8.27	-	-	3,300	27,305.49	27,291.00	-
300088	长信科技	2016年 9月12日	重大资产重组	15.80	-	-	1,600	23,553.34	25,280.00	-
000547	航天发展	2016年 4月19日	重大资产重组	15.36	2017年 1月3日	16.90	1,600	24,576.00	24,576.00	-
000050	深天马A	2016年 9月12日	重大资产重组	18.82	2017年 3月23日	20.70	1,200	24,469.89	22,584.00	-
000748	长城信息	2016年 11月1日	重大资产重组	20.31	-	-	1,000	20,948.86	20,310.00	注1
002075	沙钢股份	2016年 9月19日	重大资产重组	16.12	-	-	1,200	17,557.33	19,344.00	-
000540	中天城投	2016年 11月28日	重大资产重组	6.93	2017年 1月3日	7.00	2,000	13,425.80	13,860.00	-
002071	长城影视	2016年 6月15日	重大资产重组	13.64	2017年 1月3日	15.00	1,000	13,589.17	13,640.00	-
000887	中鼎股份	2016年 11月18日	重大资产重组	25.94	2017年 2月15日	23.99	500	12,044.06	12,970.00	-
002396	星网锐捷	2016年 9月12日	重大事项未公告	19.70	2017年 2月21日	18.35	600	11,801.08	11,820.00	-
000829	天音控股	2016年 9月29日	重大事项	11.28	-	-	1,000	12,789.03	11,280.00	-

000563	陕国投 A	2016 年 10 月 14 日	重大资 产重组	7.48	2017 年 1 月 18 日	6.73	1,500	8,525.48	11,220.00	-
002400	省广股份	2016 年 11 月 28 日	重大事 项	13.79	-	-	640	9,327.57	8,825.60	-
000987	越秀金控	2016 年 8 月 29 日	重大资 产重组	14.49	2017 年 1 月 9 日	15.94	600	8,019.97	8,694.00	-
000516	国际医学	2016 年 12 月 5 日	重大资 产重组	7.90	-	-	1,100	7,235.76	8,690.00	-
002440	闰土股份	2016 年 10 月 21 日	重大资 产重组	16.34	2017 年 1 月 12 日	15.22	500	8,013.70	8,170.00	-
000727	华东科技	2016 年 11 月 17 日	重大资 产重组	3.37	2017 年 2 月 15 日	3.47	2,400	8,601.31	8,088.00	-
002025	航天电器	2016 年 9 月 12 日	重大资 产重组	25.20	-	-	300	7,295.87	7,560.00	-
300104	乐视网	2016 年 12 月 7 日	重大资 产重组	35.80	2017 年 1 月 16 日	36.88	200	9,684.96	7,160.00	-
000697	炼石有色	2016 年 11 月 17 日	重大资 产重组	23.51	-	-	300	6,921.95	7,053.00	-
300212	易华录	2016 年 11 月 30 日	重大资 产重组	34.00	-	-	200	7,240.31	6,800.00	-
002151	北斗星通	2016 年 11 月 16 日	重大资 产重组	31.90	2017 年 1 月 12 日	31.00	200	6,473.27	6,380.00	-
300098	高新兴	2016 年 11 月 17 日	重大资 产重组	15.84	2017 年 1 月 23 日	14.26	400	5,915.40	6,336.00	-
000558	莱茵体育	2016 年 10 月 17 日	重大资 产重组	14.75	-	-	400	6,332.55	5,900.00	-

002602	世纪华通	2016 年 12 月 15 日	重大事 项	46.89	2017 年 1 月 9 日	50.00	100	2,288.50	4,689.00	-
300005	探路者	2016 年 11 月 28 日	重大资 产重组	16.69	2017 年 2 月 6 日	15.02	200	3,347.92	3,338.00	-
000750	国海证券	2016 年 12 月 15 日	重大事 项	6.97	2017 年 1 月 20 日	6.27	450	3,424.44	3,136.50	-
002681	奋达科技	2016 年 12 月 19 日	重大资 产重组	12.93	-	-	200	3,174.89	2,586.00	-
000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大事 项	12.50	-	-	200	2,500.00	2,500.00	-
000166	申万宏源	2016 年 12 月 21 日	重大事 项	6.25	2017 年 1 月 26 日	6.29	285	1,817.05	1,781.25	-

注：1. 根据长城信息产业股份有限公司(以下简称“长城信息”)于 2016 年 10 月 25 日公布的《关于中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并公司事宜的提示性公告》和中国长城计算机深圳股份有限公司(以下简称“长城电脑”)于 2017 年 1 月 20 日公布的《中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并长城信息产业股份有限公司及重大资产置换和发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易报告书(修订稿)》，长城电脑将向长城信息全体股东发行 A 股股票，以换股比例 1: 0.5424 取得长城信息股东持有的长城信息全部股票，吸收合并长城信息；长城信息自 2016 年 11 月 1 日起连续停牌。换股合并后新增的长城电脑股票于 2017 年 1 月 18 日上市流通，当日开盘单价为 10.63 元。长城信息人民币普通股股票自 2017 年 1 月 18 日起终止上市并摘牌。

2. 本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的

比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2015 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持目标 ETF 份额能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出，所持股票和债券均在证券交易所上市，除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	16,664,396.75	-	-	-	16,664,396.75
结算备付金	38.82	-	-	-	38.82
存出保证金	3,114.56	-	-	-	3,114.56
交易性金融资产	-	-	-	297,700,966.53	297,700,966.53
应收利息	-	-	-	1,691.73	1,691.73
应收申购款	13,945.01	-	-	18,428.03	32,373.04
其他资产	-	-	-	28,436.06	28,436.06
资产总计	16,681,495.14	-	-	297,749,522.35	314,431,017.49
负债					
应付证券清算款	-	-	-	196,708.11	196,708.11
应付赎回款	-	-	-	129,571.84	129,571.84
应付管理人报酬	-	-	-	8,933.44	8,933.44
应付托管费	-	-	-	1,786.70	1,786.70
应付交易费用	-	-	-	2,811.34	2,811.34
其他负债	-	-	-	355,232.78	355,232.78
负债总计	-	-	-	695,044.21	695,044.21
利率敏感度缺口	16,681,495.14	-	-	297,054,478.14	313,735,973.28
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	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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 年 12 月 31 日：同），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）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出的目标 ETF 份额，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金

投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	1,092,548.52	0.35	2,168,706.18	0.55
交易性金融资产-基金投资	296,608,418.01	94.54	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	297,700,966.53	94.89	370,974,921.47	94.56

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2016年 12月31日)	上年度末(2015年 12月31日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	15,600,000.00	18,010,000.00
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-15,600,000.00	-18,010,000.00	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 297,379,104.18 元，属于第二层次的余额为 321,862.35 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 369,923,517.67 元，第二层次 1,051,403.80 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,092,548.52	0.35
	其中：股票	1,092,548.52	0.35
2	基金投资	296,608,418.01	94.33
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,664,435.57	5.30
8	其他各项资产	65,615.39	0.02
9	合计	314,431,017.49	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	12,563.80	0.00
B	采矿业	18,542.00	0.01
C	制造业	702,874.49	0.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供	17,377.00	0.01

	应业		
E	建筑业	23,962.40	0.01
F	批发和零售业	40,220.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,397.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	100,699.19	0.03
J	金融业	44,409.75	0.01
K	房地产业	48,327.37	0.02
L	租赁和商务服务业	23,650.60	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,225.72	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,990.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	34,958.00	0.01
S	综合	4,351.20	0.00
	合计	1,092,548.52	0.35

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000538	云南白药	1,100	83,765.00	0.03
2	002129	中环股份	3,300	27,291.00	0.01

3	300088	长信科技	1,600	25,280.00	0.01
4	000547	航天发展	1,600	24,576.00	0.01
5	000050	深天马 A	1,200	22,584.00	0.01
6	000748	长城信息	1,000	20,310.00	0.01
7	002075	沙钢股份	1,200	19,344.00	0.01
8	000540	中天城投	2,000	13,860.00	0.00
9	002071	长城影视	1,000	13,640.00	0.00
10	000887	中鼎股份	500	12,970.00	0.00
11	002396	星网锐捷	600	11,820.00	0.00
12	000829	天音控股	1,000	11,280.00	0.00
13	000563	陕国投 A	1,500	11,220.00	0.00
14	002400	省广股份	640	8,825.60	0.00
15	000987	越秀金控	600	8,694.00	0.00
16	000516	国际医学	1,100	8,690.00	0.00
17	002440	闰土股份	500	8,170.00	0.00
18	000727	华东科技	2,400	8,088.00	0.00
19	002025	航天电器	300	7,560.00	0.00
20	300104	乐视网	200	7,160.00	0.00
21	002304	洋河股份	100	7,060.00	0.00
22	000697	炼石有色	300	7,053.00	0.00
23	002456	欧菲光	200	6,856.00	0.00
24	300212	易华录	200	6,800.00	0.00
25	300059	东方财富	400	6,772.00	0.00
26	000568	泸州老窖	200	6,600.00	0.00
27	300024	机器人	300	6,414.00	0.00
28	002151	北斗星通	200	6,380.00	0.00
29	300098	高新兴	400	6,336.00	0.00
30	001979	招商蛇口	383	6,277.37	0.00

31	002673	西部证券	300	6,231.00	0.00
32	000100	TCL 集团	1,800	5,940.00	0.00
33	000558	莱茵体育	400	5,900.00	0.00
34	300266	兴源环境	100	5,488.00	0.00
35	002572	索菲亚	100	5,416.00	0.00
36	000423	东阿阿胶	100	5,387.00	0.00
37	002202	金风科技	300	5,133.00	0.00
38	300070	碧水源	286	5,010.72	0.00
39	000338	潍柴动力	500	4,980.00	0.00
40	002594	比亚迪	100	4,968.00	0.00
41	000651	格力电器	200	4,924.00	0.00
42	002602	世纪华通	100	4,689.00	0.00
43	002736	国信证券	300	4,665.00	0.00
44	002065	东华软件	200	4,660.00	0.00
45	300072	三聚环保	100	4,629.00	0.00
46	002195	二三四五	400	4,528.00	0.00
47	002343	慈文传媒	100	4,517.00	0.00
48	000793	华闻传媒	400	4,516.00	0.00
49	000413	东旭光电	400	4,504.00	0.00
50	000625	长安汽车	300	4,482.00	0.00
51	300027	华谊兄弟	400	4,400.00	0.00
52	000009	中国宝安	420	4,351.20	0.00
53	002007	华兰生物	120	4,290.00	0.00
54	000768	中航飞机	200	4,252.00	0.00
55	000503	海虹控股	100	4,205.00	0.00
56	000069	华侨城 A	600	4,170.00	0.00
57	000839	中信国安	450	4,131.00	0.00
58	000157	中联重科	900	4,086.00	0.00

59	300159	新研股份	300	4,074.00	0.00
60	300124	汇川技术	200	4,066.00	0.00
61	300168	万达信息	200	4,044.00	0.00
62	000630	铜陵有色	1,300	4,004.00	0.00
63	000728	国元证券	200	3,980.00	0.00
64	000559	万向钱潮	300	3,978.00	0.00
65	002085	万丰奥威	200	3,952.00	0.00
66	002405	四维图新	200	3,870.00	0.00
67	002036	联创电子	200	3,832.00	0.00
68	300156	神雾环保	150	3,751.50	0.00
69	002252	上海莱士	160	3,694.40	0.00
70	002663	普邦股份	600	3,642.00	0.00
71	000001	平安银行	400	3,640.00	0.00
72	002465	海格通信	300	3,495.00	0.00
73	300090	盛运环保	300	3,480.00	0.00
74	000858	五粮液	100	3,448.00	0.00
75	000725	京东方 A	1,200	3,432.00	0.00
76	000425	徐工机械	1,000	3,380.00	0.00
76	000592	平潭发展	500	3,380.00	0.00
77	000060	中金岭南	300	3,345.00	0.00
78	300005	探路者	200	3,338.00	0.00
79	300238	冠昊生物	100	3,335.00	0.00
80	000826	启迪桑德	100	3,298.00	0.00
81	300197	铁汉生态	260	3,296.80	0.00
82	000519	江南红箭	219	3,263.10	0.00
83	300077	国民技术	200	3,250.00	0.00
84	002250	联化科技	200	3,236.00	0.00
85	002422	科伦药业	200	3,224.00	0.00

86	000876	新希望	400	3,220.00	0.00
87	002131	利欧股份	200	3,190.00	0.00
88	300408	三环集团	200	3,176.00	0.00
89	002168	深圳惠程	200	3,172.00	0.00
90	000656	金科股份	600	3,144.00	0.00
91	002268	卫士通	100	3,142.00	0.00
92	000750	国海证券	450	3,136.50	0.00
93	300115	长盈精密	120	3,127.20	0.00
94	000623	吉林敖东	100	3,099.00	0.00
95	300058	蓝色光标	300	3,051.00	0.00
96	002030	达安基因	130	3,016.00	0.00
97	002276	万马股份	200	3,006.00	0.00
98	002123	梦网荣信	200	3,000.00	0.00
99	300015	爱尔眼科	100	2,990.00	0.00
100	002390	信邦制药	300	2,967.00	0.00
101	002081	金螳螂	300	2,937.00	0.00
102	000039	中集集团	200	2,924.00	0.00
103	300014	亿纬锂能	100	2,920.00	0.00
104	000917	电广传媒	200	2,878.00	0.00
105	000415	渤海金控	400	2,860.00	0.00
106	000062	深圳华强	100	2,841.00	0.00
107	002385	大北农	400	2,840.00	0.00
108	002130	沃尔核材	200	2,824.00	0.00
108	002329	皇氏集团	200	2,824.00	0.00
109	000333	美的集团	100	2,817.00	0.00
110	000690	宝新能源	300	2,781.00	0.00
111	300315	掌趣科技	300	2,772.00	0.00
112	002023	海特高新	200	2,768.00	0.00

113	002373	千方科技	200	2,760.00	0.00
114	002431	棕榈股份	300	2,748.00	0.00
115	002236	大华股份	200	2,736.00	0.00
116	002004	华邦健康	300	2,721.00	0.00
117	002474	榕基软件	200	2,712.00	0.00
118	002230	科大讯飞	100	2,709.00	0.00
119	000930	中粮生化	200	2,688.00	0.00
120	000709	河钢股份	800	2,672.00	0.00
121	002038	双鹭药业	100	2,671.00	0.00
122	000970	中科三环	200	2,670.00	0.00
123	002241	歌尔股份	100	2,652.00	0.00
124	002460	赣锋锂业	100	2,651.00	0.00
125	000960	锡业股份	200	2,624.00	0.00
126	002340	格林美	400	2,620.00	0.00
127	000961	中南建设	250	2,600.00	0.00
128	002466	天齐锂业	80	2,596.00	0.00
129	002701	奥瑞金	300	2,592.00	0.00
130	002681	奋达科技	200	2,586.00	0.00
131	300182	捷成股份	249	2,567.19	0.00
132	000983	西山煤电	300	2,538.00	0.00
133	300134	大富科技	100	2,536.00	0.00
134	000693	ST 华泽	200	2,500.00	0.00
135	000061	农产品	200	2,474.00	0.00
136	000999	华润三九	100	2,473.00	0.00
137	000686	东北证券	200	2,472.00	0.00
138	300202	聚龙股份	100	2,460.00	0.00
139	002092	中泰化学	200	2,420.00	0.00
140	002500	山西证券	200	2,404.00	0.00

141	300146	汤臣倍健	200	2,388.00	0.00
142	002176	江特电机	200	2,386.00	0.00
143	002261	拓维信息	200	2,384.00	0.00
144	002146	荣盛发展	300	2,355.00	0.00
145	002229	鸿博股份	100	2,354.00	0.00
146	002714	牧原股份	100	2,328.00	0.00
147	002161	远望谷	200	2,306.00	0.00
148	000598	兴蓉环境	400	2,304.00	0.00
149	300413	快乐购	100	2,298.00	0.00
150	002019	亿帆医药	150	2,293.50	0.00
151	002024	苏宁云商	200	2,290.00	0.00
151	002155	湖南黄金	200	2,290.00	0.00
152	002414	高德红外	100	2,278.00	0.00
153	002292	奥飞娱乐	100	2,270.00	0.00
154	000012	南玻 A	200	2,268.00	0.00
155	002008	大族激光	100	2,260.00	0.00
156	000581	威孚高科	100	2,244.00	0.00
157	002052	同洲电子	200	2,240.00	0.00
158	300291	华录百纳	100	2,228.00	0.00
159	000685	中山公用	200	2,226.00	0.00
160	002048	宁波华翔	100	2,214.00	0.00
161	002183	怡亚通	200	2,172.00	0.00
162	002271	东方雨虹	100	2,169.00	0.00
163	300079	数码视讯	300	2,148.00	0.00
164	000998	隆平高科	100	2,143.00	0.00
165	300188	美亚柏科	100	2,139.00	0.00
166	000801	四川九洲	200	2,126.00	0.00
167	002310	东方园林	150	2,122.50	0.00

168	000977	浪潮信息	100	2,120.00	0.00
169	002690	美亚光电	100	2,116.00	0.00
170	002467	二六三	200	2,104.00	0.00
171	002665	首航节能	240	2,102.40	0.00
172	300144	宋城演艺	100	2,094.00	0.00
173	000895	双汇发展	100	2,093.00	0.00
174	002191	劲嘉股份	200	2,082.00	0.00
175	002439	启明星辰	100	2,079.00	0.00
176	002475	立讯精密	100	2,075.00	0.00
177	000488	晨鸣纸业	200	2,072.00	0.00
178	000778	新兴铸管	400	2,068.00	0.00
179	002426	胜利精密	250	2,067.50	0.00
180	000027	深圳能源	300	2,061.00	0.00
181	000402	金融街	200	2,060.00	0.00
182	002353	杰瑞股份	100	2,030.00	0.00
183	002568	百润股份	100	2,024.00	0.00
184	002022	科华生物	100	2,000.00	0.00
184	300222	科大智能	100	2,000.00	0.00
185	002152	广电运通	150	1,992.00	0.00
186	002421	达实智能	300	1,974.00	0.00
187	000825	太钢不锈	500	1,970.00	0.00
188	002384	东山精密	100	1,961.00	0.00
189	002001	新和成	100	1,960.00	0.00
190	300253	卫宁健康	100	1,959.00	0.00
191	000997	新大陆	100	1,943.00	0.00
192	300352	北信源	100	1,941.00	0.00
193	002358	森源电气	100	1,918.00	0.00
194	000792	盐湖股份	100	1,907.00	0.00

195	000681	视觉中国	100	1,906.00	0.00
196	002450	康得新	99	1,891.89	0.00
197	002041	登海种业	100	1,888.00	0.00
198	001696	宗申动力	200	1,880.00	0.00
199	000046	泛海控股	200	1,858.00	0.00
200	300002	神州泰岳	200	1,848.00	0.00
201	000883	湖北能源	400	1,832.00	0.00
202	002640	跨境通	100	1,830.00	0.00
203	002013	中航机电	100	1,829.00	0.00
204	000882	华联股份	400	1,828.00	0.00
205	000400	许继电气	100	1,815.00	0.00
206	002481	双塔食品	200	1,814.00	0.00
207	300003	乐普医疗	100	1,793.00	0.00
208	000733	振华科技	100	1,785.00	0.00
209	000031	中粮地产	200	1,784.00	0.00
210	000166	申万宏源	285	1,781.25	0.00
211	000732	泰禾集团	100	1,769.00	0.00
212	002573	清新环境	100	1,747.00	0.00
213	000090	天健集团	180	1,738.80	0.00
214	300001	特锐德	100	1,734.00	0.00
215	002138	顺络电子	100	1,731.00	0.00
216	300257	开山股份	100	1,716.00	0.00
217	000751	锌业股份	300	1,707.00	0.00
218	300273	和佳股份	100	1,706.00	0.00
219	000762	西藏矿业	100	1,703.00	0.00
220	000620	新华联	200	1,696.00	0.00
221	000776	广发证券	100	1,686.00	0.00
222	000671	阳光城	300	1,671.00	0.00

223	002142	宁波银行	100	1,664.00	0.00
224	300055	万邦达	100	1,638.00	0.00
225	300032	金龙机电	100	1,609.00	0.00
226	000758	中色股份	200	1,598.00	0.00
227	000806	银河生物	100	1,584.00	0.00
228	002470	金正大	200	1,580.00	0.00
229	000988	华工科技	100	1,565.00	0.00
230	002444	巨星科技	100	1,560.00	0.00
231	002432	九安医疗	100	1,553.00	0.00
232	002493	荣盛石化	100	1,542.00	0.00
233	000627	天茂集团	200	1,530.00	0.00
234	002285	世联行	200	1,520.00	0.00
235	000898	鞍钢股份	300	1,512.00	0.00
236	002311	海大集团	100	1,505.00	0.00
237	002224	三力士	100	1,504.00	0.00
238	002416	爱施德	100	1,473.00	0.00
239	002463	沪电股份	300	1,434.00	0.00
240	002027	分众传媒	100	1,427.00	0.00
241	000088	盐田港	200	1,426.00	0.00
242	002089	新海宜	100	1,419.00	0.00
243	002505	大康农业	400	1,416.00	0.00
244	000650	仁和药业	200	1,410.00	0.00
245	300498	温氏股份	40	1,408.80	0.00
246	002284	亚太股份	100	1,407.00	0.00
247	002280	联络互动	100	1,397.00	0.00
248	002244	滨江集团	200	1,396.00	0.00
249	002056	横店东磁	100	1,391.00	0.00
250	300207	欣旺达	100	1,390.00	0.00

251	002482	广田集团	150	1,387.50	0.00
252	002298	中电鑫龙	100	1,381.00	0.00
253	002407	多氟多	50	1,364.50	0.00
254	002031	巨轮智能	400	1,364.00	0.00
255	002583	海能达	100	1,321.00	0.00
256	000875	吉电股份	200	1,314.00	0.00
256	002063	远光软件	100	1,314.00	0.00
257	002570	贝因美	100	1,312.00	0.00
258	300267	尔康制药	100	1,305.00	0.00
259	002498	汉缆股份	300	1,290.00	0.00
259	300147	香雪制药	100	1,290.00	0.00
260	000939	凯迪生态	100	1,287.00	0.00
261	300228	富瑞特装	100	1,279.00	0.00
262	000566	海南海药	100	1,271.00	0.00
263	002428	云南锗业	100	1,267.00	0.00
264	000078	海王生物	200	1,260.00	0.00
265	000158	常山股份	100	1,250.00	0.00
266	000066	长城电脑	100	1,244.00	0.00
267	002221	东华能源	100	1,239.00	0.00
268	002501	利源精制	100	1,227.00	0.00
269	002471	中超控股	200	1,212.00	0.00
270	000878	云南铜业	100	1,181.00	0.00
271	002002	鸿达兴业	160	1,174.40	0.00
272	000099	中信海直	100	1,171.00	0.00
273	000851	高鸿股份	100	1,166.00	0.00
274	002413	雷科防务	100	1,158.00	0.00
275	002043	兔宝宝	100	1,157.00	0.00
276	002005	德豪润达	200	1,150.00	0.00

276	002237	恒邦股份	100	1,150.00	0.00
277	002073	软控股份	100	1,135.00	0.00
277	002588	史丹利	100	1,135.00	0.00
278	000902	新洋丰	100	1,126.00	0.00
279	002106	莱宝高科	100	1,124.00	0.00
280	300142	沃森生物	100	1,090.00	0.00
281	300026	红日药业	200	1,086.00	0.00
282	000539	粤电力A	200	1,064.00	0.00
283	000786	北新建材	100	1,029.00	0.00
284	002563	森马服饰	100	1,027.00	0.00
285	300043	星辉娱乐	100	1,014.00	0.00
286	000848	承德露露	90	1,007.10	0.00
287	002318	久立特材	100	1,000.00	0.00
288	300251	光线传媒	100	976.00	0.00
289	000006	深振业A	100	945.00	0.00
290	002047	宝鹰股份	100	935.00	0.00
291	002051	中工国际	40	916.80	0.00
292	000600	建投能源	100	888.00	0.00
293	002121	科陆电子	100	882.00	0.00
294	002249	大洋电机	100	863.00	0.00
295	002128	露天煤业	100	860.00	0.00
296	000601	韶能股份	100	859.00	0.00
297	002099	海翔药业	100	848.00	0.00
298	002437	誉衡药业	100	827.00	0.00
299	000089	深圳机场	100	800.00	0.00
300	000543	皖能电力	100	761.00	0.00
301	000973	佛塑科技	100	750.00	0.00
302	300083	劲胜精密	100	735.00	0.00

303	002550	千红制药	100	722.00	0.00
304	002018	华信国际	70	711.90	0.00
305	300053	欧比特	50	708.50	0.00
306	300133	华策影视	60	681.00	0.00
307	000807	云铝股份	100	670.00	0.00
308	002078	太阳纸业	100	668.00	0.00
309	002266	浙富控股	100	576.00	0.00
310	300274	阳光电源	40	421.60	0.00
311	000979	中弘股份	100	264.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	324,253.00	0.08
2	000001	平安银行	191,278.00	0.05
3	000002	万科 A	181,523.00	0.05
4	000725	京东方 A	164,100.00	0.04
5	000333	美的集团	144,928.00	0.04
6	000858	五粮液	141,427.00	0.04
7	002024	苏宁云商	129,493.00	0.03
8	000776	广发证券	123,622.00	0.03
9	002304	洋河股份	111,206.00	0.03
10	002415	海康威视	100,682.00	0.03
11	002594	比亚迪	99,089.00	0.03
12	300059	东方财富	95,636.00	0.02
13	000166	申万宏源	93,278.00	0.02

14	300017	网宿科技	93,101.00	0.02
15	000063	中兴通讯	90,177.00	0.02
16	000625	长安汽车	88,356.00	0.02
17	001979	招商蛇口	85,836.00	0.02
18	000783	长江证券	84,355.00	0.02
19	002673	西部证券	83,803.00	0.02
20	000423	东阿阿胶	83,430.00	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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000002	万科A	432,135.00	0.11
2	000002	万科A	432,135.00	0.11
3	000333	美的集团	319,812.00	0.08
4	000839	中信国安	266,668.00	0.07
5	000001	平安银行	245,446.00	0.06
6	000001	深发展A	245,446.00	0.06
7	000651	格力电器	226,888.00	0.06
8	000858	五粮液	211,757.00	0.05
9	000858	五粮液	211,757.00	0.05
10	000725	京东方A	202,855.00	0.05
11	000776	广发证券	168,620.00	0.04
12	002415	海康威视	158,165.00	0.04
13	002310	东方园林	154,522.00	0.04
14	002450	康得新	152,321.00	0.04
15	002024	苏宁电器	143,982.00	0.04

16	002024	苏宁云商	143,982.00	0.04
17	002304	洋河股份	133,084.40	0.03
18	300059	东方财富	129,820.00	0.03
19	000166	申万宏源	128,985.00	0.03
20	001979	招商蛇口	128,408.00	0.03

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	13,887,381.73
卖出股票收入（成交）总额	19,978,186.04

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 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	南方深成 ETF	股票型	交易型开放式	南方基金管理有限公司	296,608,418.01	94.54

8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1

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

8.13.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,114.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,691.73
5	应收申购款	32,373.04
6	其他应收款	28,436.06
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,615.39

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002129	中环股份	27,291.00	0.01	重大事项
2	300088	长信科技	25,280.00	0.01	重大资产重组
3	000547	航天发展	24,576.00	0.01	重大资产重组
4	000050	深天马 A	22,584.00	0.01	重大资产重组
5	000748	长城信息	20,310.00	0.01	重大资产重组
6	002075	沙钢股份	19,344.00	0.01	重大资产重组
7	000540	中天城投	13,860.00	0.00	重大资产重组
8	002071	长城影视	13,640.00	0.00	重大资产重组
9	000887	中鼎股份	12,970.00	0.00	重大资产重组

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
14,337	26,371.51	416,922.15	0.11%	377,671,418.16	99.89%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	283,645.88	0.0750%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (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	49, 921, 287. 16
减:本报告期基金总赎回份额	60, 613, 125. 09
本报告期期末基金份额总额	378, 088, 340. 31

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据南方基金管理有限公司第七届董事会第一次会议审议通过，并按规定向中国证券监督管理委员会深圳监管局备案，基金管理人于 2016 年 10 月 20 日发布公告，自 2016 年 10 月 18 日起，张海波先生担任本基金管理人董事长，吴万善先生不再担任本基金管理人董事长。

基金管理人于 2016 年 10 月 20 日发布公告，南方基金管理有限公司（以下简称“公司”）第六届董事会任期届满，根据《公司法》、《证券投资基金管理公司管理办法》等法律法规和《公司章程》的规定，公司股东会 2016 年第一次临时会议选举产生了公司第七届董事会。

根据南方基金管理有限公司第六届董事会第二十八次会议审议通过，并按规定向中国证券投资基金业协会报备，基金管理人于 2016 年 10 月 19 日发布公告，自 2016 年 10 月 17 日起，郑文祥先生不再担任本基金管理人副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 55,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 5 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	33,795,911.52	100.00%	3,380.02	100.00%	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期权证	成交金额	占当期基金

		成交总额 的比例		购 成交总 额的比例		成交总 额的比例		成交总额 的比例
华泰证 券	1,825.55	100.00%	-	-	-	-	42,654,003.61	100.00%
联合证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
民族证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
齐鲁证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君	-	-	-	-	-	-	-	-

安								
国信证 券								
海通证 券			118,000,000.00	100.00%				
华安证 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

42,654,003.61 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。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金变更基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 20 日

2	关于南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金变更基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 11 月 26 日
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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 30 日
4	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 30 日
5	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
6	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
7	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
8	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
9	关于南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金增设 H 类基金份额并修改基金合同的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 30 日
10	南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书（更新）摘要（2016 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 7 月 15 日
11	南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书（更新）（2015 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 14 日
12	南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书（更新）摘要（2015 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 14 日

13	南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书（更新） （2016 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 8 月 30 日
14	南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书（更新） （2016 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 7 月 15 日

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方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。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路 6 号免税商务大厦 31-33 楼

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>