南方中证500信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金2017年半年度报告摘要

2017年06月30日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017年08月28日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年01月01日起至06月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方500信息ETF发起式联接	
交易代码	002900	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年8月17日	
基金管理人	南方基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	135,539,754.54份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方500信息ETF发起式联接A	南方500信息ETF发起式联接C
下属分级基金的交易代码	002900	004347
报告期末下属分级基金的份额总额	133,743,406.92份	1,796,347.62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“500信息联接”。

目标基金基本情况

基金名称	中证500信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金

基金主代码	512330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015-06-29
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015-07-20
基金管理人名称	南方基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

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“500信息ETF”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。
投资策略	本基金以目标ETF作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。本基金并不参与目标ETF的管理。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%，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。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为ETF联接基金，通过投资于目标ETF跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。

目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，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。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证500信息技术指数。
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	林葛
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	400-889-8899	95599
传真	0755-82763889	010-68121816

2.4 信息披露方式

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

§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	2017年01月01日至2017年06月30日	2017年01月01日至2017年06月30日
	南方500信息ETF发起式联接A	南方500信息ETF发起式联接C
本期已实现收益	-1,044,336.57	-3,367.69
本期利润	-2,338,813.37	14,241.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0163	0.0278
本期加权平均净值利润率	-1.78%	3.07%
本期基金份额净值增长率	-1.84%	-3.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017年06月30日）	报告期末（2017年06月30日）
期末可供分配利润	-12,530,471.53	-166,324.47
期末可供分配基金份额利润	-0.0937	-0.0926
期末基金资产净值	121,212,935.39	1,630,023.15
期末基金份额净值	0.9063	0.9074
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2017年06月30日）	报告期末（2017年06月30日）
基金份额累计净值增长率	-9.37%	-3.26%

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

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

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

4.本基金合同生效日为2016年8月17日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方500信息ETF发起式联接A

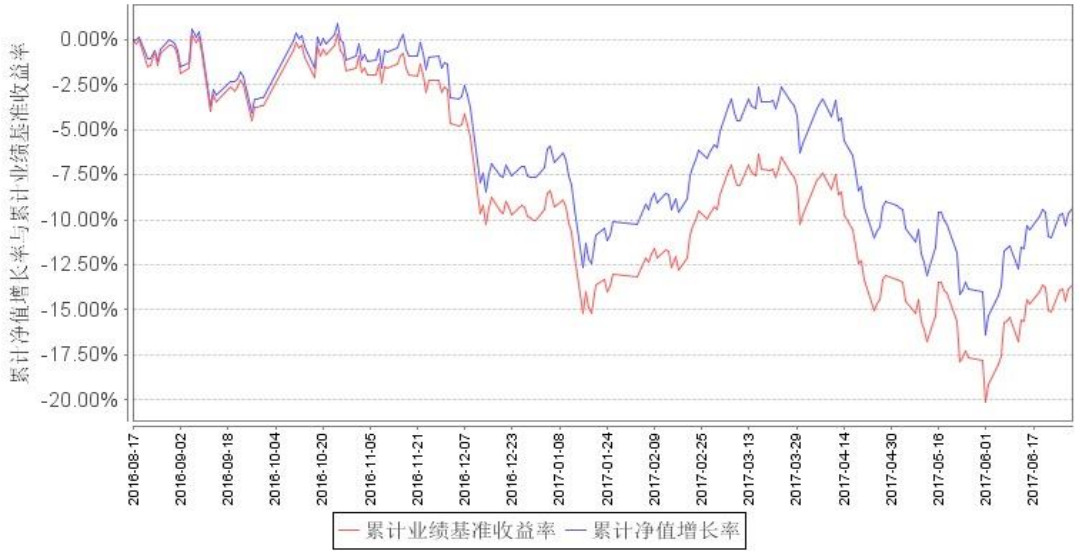
阶段	净值增长率①（%）	净值增长率标准差②（%）	业绩比较基准收益率③（%）	业绩比较基准收益率标准差④（%）	①－③（%）	②－④（%）
过去一个月	5.36	1.17	5.10	1.17	0.26	0.00
过去三个月	-3.84	1.12	-4.27	1.13	0.43	-0.01
过去六个月	-1.84	1.03	-3.99	1.04	2.15	-0.01
自基金合同生效起至今	-9.37	0.99	-13.59	1.00	4.22	-0.01

南方500信息ETF发起式联接C

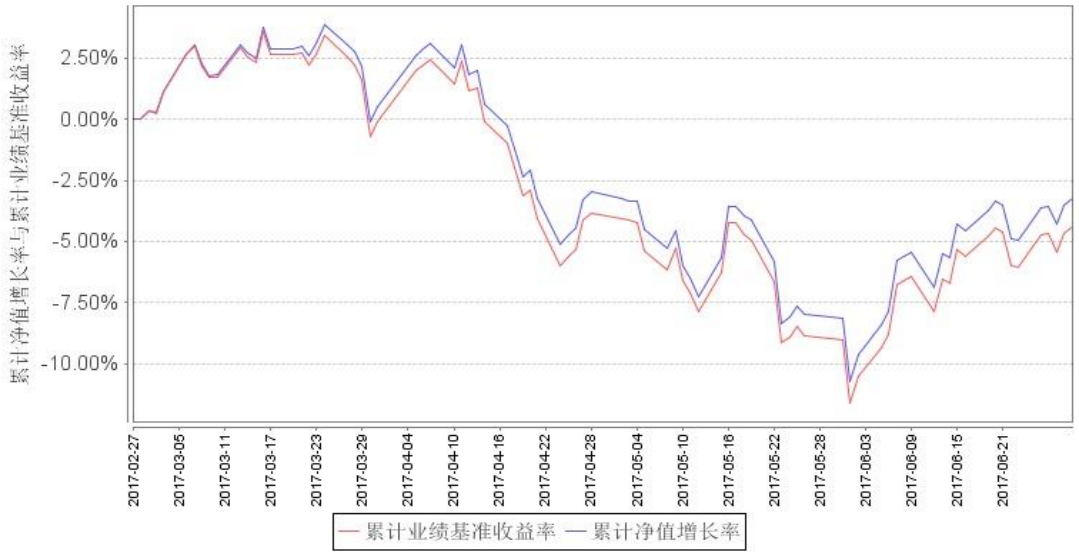
阶段	净值增长率①（%）	净值增长率标准差②（%）	业绩比较基准收益率③（%）	业绩比较基准收益率标准差④（%）	①－③（%）	②－④（%）
过去一个月	5.33	1.17	5.10	1.17	0.23	0.00
过去三个月	-3.76	1.12	-4.27	1.13	0.51	-0.01
自基金合同生效起至今	-3.26	1.04	-4.39	1.05	1.13	-0.01

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

南方500信息ETF发起式联接A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



南方500信息ETF发起式联接C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金的基金合同生效日至本报告期末不满 1 年；本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定；

2、本基金自 2017 年 2 月 28 日起增加 C 类收费模式，原有收费模式称为 A 类；

3、基金合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

§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6,500亿元，旗下管理134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		
孙伟	本基金基金经理	2016年8月17日		7	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；2017年3月至今，任南方全指证券ETF联接、南方中证全指证券ETF基金经理；2017年6月至今，任南方中证银行ETF、南方银行联接基金经理。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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《南方中证500信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》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、交易占优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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易次数为2次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数型基金成份股调整所致。

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

今年以来市场风格和行业分化明显，本报告期中证500信息指数下跌4.24%。

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A份额本报告期跟踪误差为0.50%，并取得了超越业绩基准2.15%的跟踪正偏离，较为理想地实现了投资目标。

截至报告期末，本基金A份额净值为0.9063元，报告期内，份额净值增长率为-1.84%，同期业绩基准增长率为-3.99%；本基金C份额净值为0.9074元，报告期内，份额净值增长率为-3.26%，同期业绩基准增长率为-4.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济增长仍将面临较大压力。7 月的全国金融工作会议明确释放了去经济杠杆，加强监管和坚定稳健货币政策的信号。美联储相对较快地启动缩表，年内第三次加息概率有所提升，或将对人民币汇率造成一定压力。随着大盘蓝筹和中小成长走势的分化加剧，新的估值平衡正在重建中。

当前我国面临经济发展的“新常态”，信息产业作为引领中国制造2025和互联网+的龙头，承担着“培育发展新动力，拓展发展新空间”的重要责任，代表了中国新经济发展的方向。

中证500一级行业指数系列于13年11月发布，500信息指数是其中成长性良好、历史表现优秀的行业指数，兼具中证500的中盘蓝筹属性和信息技术行业的新兴成长特性。自指数发布至17年7月末，500信息历史平均周市盈率为67倍，最低市盈率42倍出现在14年5月。自15年6月市盈率达到159倍高点至17年8月初，指数估值已跌去七成以上，最新市盈率已逼近历史最低水平。展望下半年，500信息指数有望在估值及业绩间找到新的平衡点。

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、权益研究部总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等等。其中，超过三分之二以上的人员具有10年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人、登记机构可在法律法规允许的前提下，按照监管部门要求履行适当程序后，经与基金托管人协商一致酌情调整以上基金收益分配原则，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理有限公司2017年1月1日至2017年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为， 南方基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本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

本托管人认为，南方基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：南方中证500信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.4.1	2,695,611.29	7,774,586.21
结算备付金		375,479.56	-
存出保证金		4,967.90	30,503.89
交易性金融资产	6.4.4.2	116,574,144.00	131,541,853.00
其中：股票投资		389,373.00	4,651,201.00
基金投资		116,184,771.00	126,890,652.00
债券投资		-	-
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	5,000,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.4.5	-1,040.67	1,215.87
应收股利		-	-
应收申购款		17,285.53	7,014.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	13,015.80	76,197.40
资产总计		124,679,463.41	139,431,371.22
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2017年6月30日**	**上年度末 2016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		997,627.95	-
应付赎回款		642,534.78	120,294.78
应付管理人报酬		2,817.87	4,833.39
应付托管费		563.57	966.69
应付销售服务费		245.89	-
应付交易费用	6.4.4.7	1,764.53	1,649.04
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	190,950.28	125,461.75
负债合计		1,836,504.87	253,205.65
所有者权益：			
实收基金	6.4.4.9	135,539,754.54	150,743,156.12
未分配利润	6.4.4.10	-12,696,796.00	-11,564,990.55
所有者权益合计		122,842,958.54	139,178,165.57
负债和所有者权益总计		124,679,463.41	139,431,371.22

注：1.报告截止日2017年6月30日，基金份额总额135,539,754.54份，其中A类基金份额总额为133,743,406.92份，基金份额净值0.9063元；C类基金份额总额为1,796,347.62份，基金份额净值0.9074元。

2.本财务报表上年度的实际编制期间为2016年8月17日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间。

6.2 利润表

会计主体：南方中证500信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

本报告期：2017年1月1日 至 2017年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017年1月1日 至 2017年6月30日
一、收入		-2,104,159.19
1.利息收入		75,087.01
其中：存款利息收入	6.4.4.11	15,568.33
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		59,518.68
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-931,721.97
其中：股票投资收益	6.4.4.12	-130,939.08
基金投资收益		-803,401.44
债券投资收益	6.4.4.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.4.14	-
衍生工具收益	6.4.4.15	-

股利收益	6.4.4.16	2,618.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.17	-1,276,867.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.18	29,343.27
减：二、费用		220,412.57
1．管理人报酬	6.4.7.2.1	20,836.67
2．托管费	6.4.7.2.2	4,167.37
3．销售服务费		614.88
4．交易费用	6.4.4.19	12,892.94
5．利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6．其他费用	6.4.4.20	181,900.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,324,571.76
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,324,571.76

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证500信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

本报告期：2017年1月1日 至 2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日 至 2017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）	150,743,156.12	-11,564,990.55	139,178,165.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-2,324,571.76	-2,324,571.76
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）	-15,203,401.58	1,192,766.31	-14,010,635.27
其中：1.基金申购款	10,323,550.32	-931,968.80	9,391,581.52
2.基金赎回款	-25,526,951.90	2,124,735.11	-23,402,216.79
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）	135,539,754.54	-12,696,796.00	122,842,958.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

杨小松	徐超	徐超
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 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

(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 2017年6月30日
活期存款	2,695,611.29
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
存款期限1个月以内	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	2,695,611.29

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		375,502.22	389,373.00	13,870.78
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		128,739,917.10	116,184,771.00	-12,555,146.10
其他		-	-	-

合计	129,115,419.32	116,574,144.00	-12,541,275.32

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。

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.4.4 买入返售金融资产

6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	5,000,000.00	-
合计	5,000,000.00	-

6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	386.71
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	152.01
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-1,581.37
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.98
合计	-1,040.67

6.4.4.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	-
上海_可收退补款	13,015.80
合计	-

6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,764.53
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,764.53

6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,421.58
预提费用	188,528.70
合计	190,950.28

6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

南方500信息ETF发起式联接A

项目	本期 2017年1月1日 至 2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	150,743,156.12	150,743,156.12
本期申购	7,647,831.58	7,647,831.58
本期赎回（以“-”号填列）	-24,647,580.78	-24,647,580.78
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-

本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	133,743,406.92	133,743,406.92

南方500信息ETF发起式联接C

项目	本期 2017年1月1日 至 2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	2,675,718.74	2,675,718.74
本期赎回（以“-”号填列）	-879,371.12	-879,371.12
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,796,347.62	1,796,347.62

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

南方500信息ETF发起式联接A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-501,027.71	-11,063,962.84	-11,564,990.55
本期利润	-1,044,336.57	-1,294,476.80	-2,338,813.37
本期基金份额交易产生的变动数	103,420.44	1,269,911.95	1,373,332.39
其中：基金申购款	-43,857.38	-640,402.33	-684,259.71
基金赎回款	147,277.82	1,910,314.28	2,057,592.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,441,943.84	-11,088,527.69	-12,530,471.53
南方500信息ETF发起式联接C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-3,367.69	17,609.30	14,241.61
本期基金份额交易产生的变动数	-14,000.48	-166,565.60	-180,566.08
其中：基金申购款	-19,398.92	-228,310.17	-247,709.09
基金赎回款	5,398.44	61,744.57	67,143.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-17,368.17	-148,956.30	-166,324.47

6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日 至 2017年6月30日
活期存款利息收入	13,187.04
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	2,164.50
其他	216.79
合计	15,568.33

6.4.4.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日 至 2017年6月30日
卖出股票成交总额	10,267,880.63
减：卖出股票成本总额	10,398,819.71
买卖股票差价收入	-130,939.08

6.4.4.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日 至 2017年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	8,407,612.60
减：卖出/赎回基金成本总额	9,211,014.04
基金投资收益	-803,401.44

6.4.4.14 债券投资收益

6.4.4.14.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.4.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.4.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.4.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.4.14.5 资产支持证券投资收益

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 2017年1月1日 至 2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,618.55
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,618.55

6.4.4.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日 至 2017年6月30日
1.交易性金融资产	-1,276,867.50
股票投资	217,999.46
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-1,494,866.96
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-

合计	-1,276,867.50

6.4.4.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日 至 2017年6月30日
基金赎回费收入	24,247.74
补差费归资产	5,095.53
合计	29,343.27

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。 2.本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 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 2017年1月1日 至 2017年6月30日
交易所市场交易费用	12,892.94
银行间市场交易费用	-
合计	12,892.94

6.4.4.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日 至 2017年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,767.52
银行手续费	2,349.59
银行费用	1,030.82
合计	181,900.71

注:1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

2.本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 25%归入转出基金的基金资产。

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.6 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中证 500 信息技术指数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。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日 至 2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
华泰证券	9,211,263.53	66.20

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

注：无。

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 2017年1月1日 至 2017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	921.16	66.20	399.14	22.62

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 2017年1月1日 至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	20,836.67
其中：支付销售机构的客户维护费	102,367.44

注：本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费，支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数，则取零)的0.50%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：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)X0.50%/当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日 至 2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,167.37

注：本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费，支付基金托管人中国农业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 0.10%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝(前一日基金资产净值前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产)X0.10%/当年天数。

6.4.7.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017年1月1日 至 2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方500信息ETF发起式联接A	南方500信息ETF发起式联接C	合计
南方基金	-	507.07	507.07
合计	-	507.07	507.07

注：本基金自2017年2月28日起增加C类收费模式，原有收费模式称为A类；支付C类基金份额销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给南方基金，再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：日销售服务费＝前一日 C 类基金份额基金资产净值 X0.40%/当年天数。

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：本基金本报告期内无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

份额单位：份

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
	南方500信息ETF发起式联接A	南方500信息ETF发起式联接C
基金合同生效日（2016年8月17日）持有的基金份额	30,006,916.66	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	30,006,916.66	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	22.1388%	-%

6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：于本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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 2017年1月1日 至 2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	2,695,611.29	13,187.04

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

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146,310,000.00份目标ETF基金份额，占其份额的比例为82.11%

6.4.8 利润分配情况

6.4.8.1 利润分配情况

注：无。

6.4.9 期末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

注：无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位： 人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600289	亿阳通信	2017-05-10	重大事项	10.94	2017-08-18	12.03	5,900	67,580.00	64,546.00	-
600460	士兰微	2017-05-12	重大事项	6.07	2017-08-15	6.68	6,000	36,466.00	36,420.00	-

注:本基金截至2017年6月30日止持有以上因股票交易异常波动而实施暂时停牌的股票，该股票在核查后，经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《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》的规定：(1)金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2)纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3)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。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1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。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 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	389,373.00	0.31
	其中：股票	389,373.00	0.31
2	基金投资	116,184,771.00	93.19
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	5,000,000.00	4.01
	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	3,071,090.85	2.46
8	其他各项资产	34,228.56	0.03
	合计	124,679,463.41	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	194,526.70	0.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,983.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	190,863.30	0.16
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	389,373.00	0.32

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600289	XD亿阳信	5,900	64,546.00	0.05
2	600460	士兰微	6,000	36,420.00	0.03
3	000050	深天马A	500	10,285.00	0.01
4	002405	四维图新	500	9,880.00	0.01
5	000997	新大陆	400	9,076.00	0.01
6	000066	长城电脑	1,000	9,010.00	0.01
7	300115	长盈精密	300	8,754.00	0.01
8	600584	长电科技	500	8,025.00	0.01
9	600260	凯乐科技	300	7,602.00	0.01
10	300296	利亚德	400	7,520.00	0.01

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于http://www.nffund.com的年度报告正文。

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名的股票投资明细

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	000066	长城电脑	192,889.00	0.14
2	002405	四维图新	126,548.00	0.09
3	300296	利亚德	124,566.00	0.09
4	300115	长盈精密	123,491.75	0.09
5	000997	新大陆	107,647.00	0.08
6	002635	安洁科技	104,186.00	0.07

7	600584	长电科技	103,904.00	0.07
8	002179	中航光电	95,666.00	0.07
9	300113	顺网科技	94,102.94	0.07
10	002439	启明星辰	93,450.00	0.07
11	000970	中科三环	91,144.00	0.07
12	000727	华东科技	90,714.00	0.07
13	002410	广联达	90,452.00	0.06
14	300324	旋极信息	89,908.00	0.06
15	002273	水晶光电	87,467.00	0.06
16	000988	华工科技	70,746.00	0.05
17	002217	合力泰	68,046.00	0.05
18	002268	卫士通	64,925.00	0.05
19	002373	千方科技	63,132.00	0.05
20	002261	拓维信息	61,761.00	0.04

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名的股票投资明细

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	600584	长电科技	550,605.00	0.40
2	600260	凯乐科技	306,697.00	0.22
3	000066	长城电脑	304,617.13	0.22
4	603019	中科曙光	295,057.00	0.21
5	002405	四维图新	280,266.00	0.20
6	600183	生益科技	275,891.00	0.20
7	300115	长盈精密	259,867.40	0.19
8	300296	利亚德	258,554.51	0.19
9	600410	华胜天成	257,476.00	0.18
10	601231	环旭电子	256,374.00	0.18
11	600601	方正科技	230,678.00	0.17
12	000997	新大陆	219,347.00	0.16
13	002439	启明星辰	216,025.01	0.16
14	600651	飞乐音响	206,918.00	0.15
15	002179	中航光电	206,224.00	0.15
16	300113	顺网科技	202,344.66	0.15
17	000970	中科三环	201,818.00	0.15
18	300324	旋极信息	197,859.20	0.14
19	600536	中国软件	193,959.00	0.14
20	002273	水晶光电	193,916.82	0.14

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	3,693,874.25
卖出股票收入（成交）总额	10,267,880.63

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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 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。

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	南方中证500信息技术ETF	股票型	交易型开发式	南方基金管理有限公司	116,184,771.00	94.58

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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受到调查以及处罚情况的说明

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	4,967.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-1,040.67
5	应收申购款	17,285.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	13,015.80
	合计	34,228.56

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 股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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	600289	亿阳通信	64,546.00	0.05	重大事项
2	600460	士兰微	36,420.00	0.03	重大事项

§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

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构					
			机构投资者		个人投资者		-	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
南方500信息ETF发起式联接A	4,119	32,469.87	30,333,764.37	22.68	103,409,642.55	77.32	-	-
南方500信息ETF发起式联接C	36	49,898.55	-	-	1,796,347.62	100.00	-	-
合计	4,155	32,620.88	30,333,764.37	22.38	105,205,990.17	77.62	-	-

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方500信息ETF发起式联接A	884.31	0.0007
	南方500信息ETF发起式联接C	1,572.96	0.0876
	合计	2,457.27	0.0018

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的

分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	份额级别	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	南方500信息ETF发起式联接A	-
	南方500信息ETF发起式联接C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	南方500信息ETF发起式联接A	0-10
	南方500信息ETF发起式联接C	-
	合计	0-10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	30,006,916.66	22.14	10,000,000.00	7.38	自合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	30,006,916.66	22.14	10,000,000.00	7.38	自合同生效之日起不少于3年

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方500信息ETF发起式联接A	南方500信息ETF发起式联接C
基金合同生效日（2016年8月17日）基金份额总额	189,486,112.63	-
本报告期期初基金份额总额	150,743,156.12	-

本报告期基金总申购份额	7,647,831.58	2,675,718.74
减：本报告期基金总赎回份额	24,647,580.78	879,371.12
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	133,743,406.92	1,796,347.62

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

南方基金管理有限公司第七届董事会第二次会议已于2017年1月23日审议通过了《公司关于聘任公司副总经理、督察长和财务负责人的议案》，秦长奎因任期届满，工作调整的原因不再担任公司副总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	

华泰证券	1	9,211,263.53	66.20	921.16	66.20	-
国泰君安	1	4,703,061.35	33.80	470.32	33.80	-

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

A：选择标准

1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；

2、公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；

3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；

4、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程　公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；

2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；

3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

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（%）
国泰君安	-	-	359,100,000.00	100.00	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20170101-20170630	30,006,916.66	-	-	30,006,916.66	22.14
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。