

南方深证成份交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 08 月 28 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 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。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	366,623,595.05 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	深成联接 A	深成联接 C
下属分级基金的交易代码	202017	004345
报告期末下属分级基金的份额总额	365,160,024.49 份	1,463,570.56 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“深成联接”。

目标基金基本情况

基金主代码	159,903
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。

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。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
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95588
传真	0755-82763889	010-66105798

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
	深成联接 A	深成联接 C
本期已实现收益	329.21	108.29
本期利润	13,886,151.18	78,922.45
加权平均基金份额本期利润	0.0374	0.1228
本期基金份额净值增长率	4.42%	2.19%
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）
期末可供分配基金份额利润	-0.1335	-0.1335
期末基金资产净值	316,419,929.85	1,268,185.13
期末基金份额净值	0.8665	0.8665

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。

3.2 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

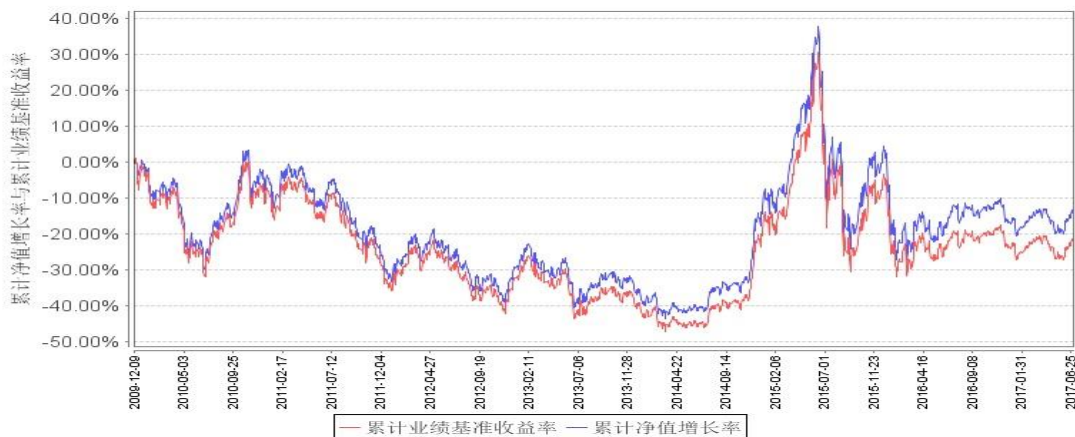
深成联接 A						
阶段	净值增长率① (%)	净值增长率标准差② (%)	业绩比较基准收益率③ (%)	业绩比较基准收益率标准差④ (%)	①-③ (%)	②-④ (%)
过去一个月	6.70	0.79	6.40	0.79	0.30	0.00
过去三个月	1.62	0.83	0.93	0.83	0.69	0.00
过去六个月	4.42	0.79	3.32	0.79	1.10	0.00
过去一年	2.36	0.84	0.42	0.84	1.94	0.00
过去三年	45.00	1.85	41.88	1.87	3.12	-0.02
自基金合同生效起至今	-13.35	1.59	-21.42	1.60	8.07	-0.01

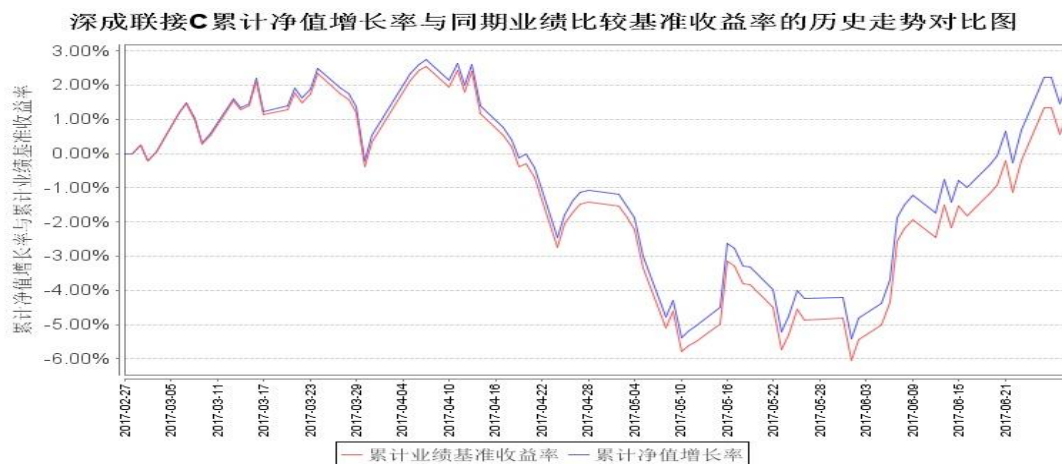
深成联接 C						
阶段	净值增长率① (%)	净值增长率标准差② (%)	业绩比较基准收益率③ (%)	业绩比较基准收益率标准差④ (%)	①-③ (%)	②-④ (%)
过去一个月	6.67	0.78	6.40	0.79	0.27	-0.01
过去三个月	1.64	0.83	0.93	0.83	0.71	0.00
自基金合同生效起至今	2.19	0.78	1.28	0.78	0.91	0.00

注：本基金 2017 年 2 月 20 日发布公告，增加 C 类收费模式，原收费模式称为 A 类。

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

深成联接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





注：本基金 2017 年 2 月 23 日新增 C 类份额。

§ 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 19 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、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

深证成指本报告期上涨 3.46%。

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 A 份额本报告期跟踪误差为 0.70%，并取得了超越业绩基准 1.10% 的跟踪正偏离，较为理想地完成了投资目标。

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 0.8665 元，份额净值增长率为 4.42%，同期业绩基准增长率为 3.32%；本基金 C 份额净值为 0.8665 元，报告期内，份额净值增长率为 2.19%，同期业绩基准增长率为 1.28%。

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。

深证成指于 15 年 5 月正式扩容，成分股由 40 只增至 500 只，在传统支柱产业外更全面纳入新兴成长行业公司。自 15 年 6 月市盈率达到 57 倍高点至 17 年 8 月初，指数估值已跌去一半左右，28 倍的最新市盈率已处于扩容后的历史低位。展望下半年，深证成指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。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，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。

4.8 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 2017 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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	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	15,744,970.92	16,664,396.75
结算备付金	942,189.83	38.82
存出保证金	3,860.83	3,114.56
交易性金融资产	301,687,473.19	297,700,966.53
其中：股票投资	1,365,462.15	1,092,548.52
基金投资	300,322,011.04	296,608,418.01
债券投资	-	-

资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	14,000,000.00	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	881.87	1,691.73
应收股利	-	-
应收申购款	38,055.17	32,373.04
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	28,436.06
资产总计	332,417,431.81	314,431,017.49
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017年6月30日	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	14,000,596.66	196,708.11
应付赎回款	536,816.07	129,571.84
应付管理人报酬	8,402.31	8,933.44
应付托管费	1,680.46	1,786.70
应付销售服务费	413.59	-
应付交易费用	1,077.15	2,811.34
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	180,330.59	355,232.78
负债合计	14,729,316.83	695,044.21
所有者权益:		
实收基金	366,623,595.05	378,088,340.31
未分配利润	-48,935,480.07	-64,352,367.03
所有者权益合计	317,688,114.98	313,735,973.28
负债和所有者权益总计	332,417,431.81	314,431,017.49

注：1、报告截止日 2017 年 06 月 30 日，基金份额总额 366,623,595.05 份，其中 A 类基金份额总额 365,160,024.49 份，基金份额净值 0.8665 元，C 类基金份额总额 1,463,570.56 份，基金份额净值 0.8665 元。

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：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	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 6月30日
一、收入	14,218,618.37	-62,410,779.86
1. 利息收入	189,194.32	77,757.78
其中：存款利息收入	32,172.42	77,757.70
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	157,021.90	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	51,794.20	-836,964.01
其中：股票投资收益	116,202.55	-485,423.24
基金投资收益	-94,991.30	-365,424.53
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	30,582.95	13,883.76
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	13,964,636.13	-61,670,605.29
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	12,993.72	19,031.66
减：二、费用	253,544.74	255,664.14
1. 管理人报酬	46,451.37	57,471.21
2. 托管费	9,290.27	11,494.25
3. 销售服务费	708.37	-
4. 交易费用	18,462.43	6,393.15
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	178,632.30	180,305.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	13,965,073.63	-62,666,444.00
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	13,965,073.63	-62,666,444.00

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：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）	378,088,340.31	-64,352,367.03	313,735,973.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	13,965,073.63	13,965,073.63
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）	-11,464,745.26	1,451,813.33	-10,012,931.93
其中：1. 基金申购款	18,085,557.80	-3,126,150.11	14,959,407.69
2. 基金赎回款	-29,550,303.06	4,577,963.44	-24,972,339.62
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）	366,623,595.05	-48,935,480.07	317,688,114.98
项目	上年度可比期间 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（本期净利润）	-	-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

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 基金基本情况

6.4.2 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。

6.4.3 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.3.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.3.2 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。

6.4.3.3 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。

6.4.4 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。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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

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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 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		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	18,969,041.48	100.00	14,366,725.58	100.00

6.4.6.1.2 权证交易

注：无。

6.4.6.1.3 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	1,897.58	100.00	1,077.15	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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

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。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 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	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	46,451.37	57,471.21
其中：支付销售机构的客户维护费	73,238.20	152,983.15

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。

6.4.6.2.2 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	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,290.27	11,494.25

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。

6.4.6.2.3 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		
	深成联接 A	深成联接 C	合计
南方基金	-	708.37	708.37
合计	-	708.37	708.37

支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提,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,C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.40%。销售服务费的计算公式为:
日销售服务费 = 前一日对应类别基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注: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。

6.4.6.4.2 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。

6.4.6.5 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	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	15,744,970.92	25,732.74	19,108,568.25	77,216.51

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。

6.4.6.6 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。

6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 264,321,432.00 份目标 ETF 基金份额(2016 年 12 月 31 日 270,321,432 份)，占其份额的比例为 62.02%(2015 年 12 月 31 日：59.13%)。

6.4.7 期末本基金持有的流通受限证券

6.4.7.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.7.2 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
002075	沙钢股份	2016-09-19	重大资产重组	16.12		-	3,300	51,722.00	53,196.00	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.27		-	6,300	52,113.51	52,101.00	-
300088	长信科技	2016-09-12	重大资产重组	15.75		-	3,100	47,493.15	48,825.00	-
002426	胜利精密	2017-01-16	拟披露重大事项	7.68		-	3,250	25,374.79	24,960.00	-
002168	深圳惠程	2017-01-23	重大资产重组	16.99		-	1,300	21,884.90	22,087.00	-
002049	紫光国芯	2017-02-20	重大资产重组	30.82	2017-07-17	27.74	600	18,528.00	18,492.00	-
002025	航天电器	2016-09-12	重大事项	24.95	2017-07-04	22.46	600	14,893.60	14,970.00	-
300134	大富科技	2017-02-09	重大资产重组	23.36		-	600	14,016.00	14,016.00	-
000503	海虹控股	2017-05-11	重大资产重组	24.93		-	500	14,631.12	12,465.00	-
300367	东方	2016-12	重大资	20.00	2017-0	18.01	600	12,024.00	12,000.00	-

	网力	-15	产重组		7-03						
300364	中文 在线	2017-02 -13	重大资 产重组	37.28		-	300	11,184.00	11,184.00	-	
300104	乐视 网	2017-04 -17	重大资 产重组	30.68		-	300	9,504.78	9,204.00	-	
002642	荣之 联	2017-04 -10	重大事 项	25.06	2017-0 7-07	22.54	300	7,305.60	7,518.00	-	
002505	大康 农业	2017-03 -13	重大资 产重组	3.50		-	2,100	7,388.89	7,350.00	-	
000034	神州 数码	2017-03 -21	重大资 产重组	24.45	2017-0 7-18	22.01	300	7,143.00	7,335.00	-	
002600	江粉 磁材	2017-02 -27	重大资 产重组	11.46		-	600	6,876.00	6,876.00	-	
000100	TCL集 团	2017-04 -21	重大事 项	3.43	2017-0 7-26	3.72	2,000	7,069.30	6,860.00	-	
300271	华宇 软件	2017-06 -22	拟披露 重大事 项	16.59	2017-0 7-04	16.80	400	6,527.10	6,636.00	-	
002128	露天 煤业	2017-03 -17	重大资 产重组	8.70		-	700	6,339.20	6,090.00	-	
002013	中航 机电	2017-05 -12	重大事 项	10.24	2017-0 8-02	11.36	550	5,870.44	5,632.00	-	
000656	金科 股份	2017-05 -05	重大资 产重组	6.54	2017-0 7-05	5.92	800	5,156.04	5,232.00	-	
300098	高新 兴	2017-06 -22	拟披露 重大事 项	12.90	2017-0 7-03	13.18	400	4,796.07	5,160.00	-	
000887	中鼎 股份	2017-04 -27	重大资 产重组	22.09	2017-0 7-14	19.88	200	4,573.22	4,418.00	-	
300413	快乐 购	2017-04 -05	重大资 产重组	20.29		-	200	4,277.33	4,058.00	-	
002681	奋达 科技	2017-06 -22	重大事 项	12.59	2017-0 7-03	12.70	300	4,018.30	3,777.00	-	
002625	龙生 股份	2017-04 -13	重大资 产重组	36.36		-	100	3,628.50	3,636.00	-	
002358	森源 电气	2017-05 -12	重大资 产重组	17.02	2017-0 7-12	16.68	200	3,594.66	3,404.00	-	
002252	上海 莱士	2017-04 -21	重大事 项	20.24		-	160	3,233.80	3,238.40	-	
002610	爱康 科技	2017-05 -12	重大事 项	2.44	2017-0 8-02	2.44	1,200	3,246.03	2,928.00	-	
000693	ST华 泽	2016-03 -01	重大事 项	12.50		-	200	2,500.00	2,500.00	-	

002143	印纪传媒	2017-04-18	重大资产重组	24.93				100	3,144.50	2,493.00	-
300267	尔康制药	2017-05-10	重大事项	11.46				200	2,448.44	2,292.00	-
002619	巨龙管业	2017-05-24	重大资产重组	6.37				340	2,856.94	2,165.80	-
300075	数字政通	2017-06-29	重大事项	20.94	2017-07-17	18.86		100	2,240.59	2,094.00	-
002399	海普瑞	2017-04-28	重大事项	20.23				100	2,072.00	2,023.00	-
300291	华录百纳	2017-04-19	重大资产重组	20.02				100	2,020.17	2,002.00	-
300085	银之杰	2017-06-30	重大事项	18.50	2017-07-07	18.88		100	1,920.50	1,850.00	-
000099	中信海直	2017-05-04	重大资产重组	11.26				100	1,170.67	1,126.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：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 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	1,365,462.15	0.41
	其中：股票	1,365,462.15	0.41
2	基金投资	300,322,011.04	-
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	14,000,000.00	4.21
	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	16,687,160.75	5.02
-	-	-	-
-	其他各项资产	42,797.87	0.01
-	合计	332,417,431.81	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	32,850.00	0.01
B	采矿业	17,509.00	0.01
C	制造业	895,810.82	0.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,756.00	-
E	建筑业	21,808.70	0.01
F	批发和零售业	35,864.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	6,000.00	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	142,477.97	0.04
J	金融业	65,065.00	0.02
K	房地产业	54,064.00	0.02
L	租赁和商务服务业	18,471.86	0.01
M	科学研究和技术服务业	926.00	-
N	水利、环境和公共设施管理业	20,380.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,129.00	-
R	文化、体育和娱乐业	26,761.00	0.01
S	综合	2,588.80	-
	合计	1,365,462.15	0.43

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前十名股票投资明细

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	002075	沙钢股份	3,300	53,196.00	0.02
2	002129	中环股份	6,300	52,101.00	0.02
3	300088	长信科技	3,100	48,825.00	0.02
4	000651	格力电器	800	32,936.00	0.01
5	000333	美的集团	700	30,128.00	0.01
6	002426	胜利精密	3,250	24,960.00	0.01
7	002168	深圳惠程	1,300	22,087.00	0.01
8	002415	海康威视	600	19,380.00	0.01

9	002049	紫光国芯	600	18,492.00	0.01
10	000725	京东方 A	4,400	18,304.00	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> 的半年度报告正文。

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	000333	美的集团	153,662.00	0.05
2	000651	格力电器	143,972.00	0.05
3	300498	温氏股份	95,794.00	0.03
4	000725	京东方 A	92,363.20	0.03
5	000858	五粮液	83,280.00	0.03
6	000002	万科 A	82,688.00	0.03
7	002415	海康威视	75,159.00	0.02
8	000001	平安银行	74,899.00	0.02
9	002304	洋河股份	50,215.00	0.02
10	000776	广发证券	50,125.00	0.02
11	002450	康得新	46,850.00	0.01
12	000063	中兴通讯	41,815.00	0.01
13	002024	苏宁云商	39,110.00	0.01
14	000538	云南白药	34,786.00	0.01
15	000783	长江证券	33,142.00	0.01
16	001979	招商蛇口	31,840.00	0.01
17	000166	申万宏源	29,471.00	0.01
18	002594	比亚迪	29,226.00	0.01
19	000568	泸州老窖	27,735.00	0.01
20	000423	东阿阿胶	25,880.00	0.01

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	000333	美的集团	409,252.00	0.13
2	000651	格力电器	379,940.00	0.12
3	300498	温氏股份	252,453.00	0.08
4	000725	京东方 A	229,382.00	0.07

5	000002	万科 A	227,337.00	0.07
6	000858	五粮液	214,188.00	0.07
7	000001	平安银行	200,392.00	0.06
8	002415	海康威视	173,811.00	0.06
9	000538	云南白药	167,509.00	0.05
10	000776	广发证券	134,569.00	0.04
11	002304	洋河股份	127,798.00	0.04
12	002450	康得新	116,459.00	0.04
13	000063	中兴通讯	109,403.00	0.03
14	002024	苏宁云商	105,564.00	0.03
15	001979	招商蛇口	95,983.14	0.03
16	000166	申万宏源	92,567.65	0.03
17	000783	长江证券	89,105.00	0.03
18	000568	泸州老窖	82,447.00	0.03
19	000423	东阿阿胶	81,807.00	0.03
20	300059	东方财富	81,800.00	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。

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	4,433,048.11
卖出股票收入（成交）总额	14,557,229.03

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	深成 ETF	ETF	交易型开放式	南方基金管理有限公司	300,322,011.04	94.53

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除广发证券(000776)，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。根据 2016 年 11 月 28 日广发证券股份有限公司（下称广发证券，股票代码：000776）《广发证券股份有限公司关于收到中国证券监督管理委员会的公告》，广发证券于近日收到了《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（【2016】128 号），依据《证券公司监督管理条例》相关规定，对广发证券责令改正，给予警告，没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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	3,860.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	881.87
5	应收申购款	38,055.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	合计	42,797.87

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	002075	沙钢股份	53,196.00	0.02	重大资产重组
2	002129	中环股份	52,101.00	0.02	重大事项
3	300088	长信科技	48,825.00	0.02	重大资产重组
4	002426	胜利精密	24,960.00	0.01	拟披露重大事项
5	002168	深圳惠程	22,087.00	0.01	重大资产重组
6	002049	紫光国芯	18,492.00	0.01	重大资产重组

§ 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 (%)
深成联接 A	14,155	25,797.25	416,922.15	0.11	364,743,102.34	99.89	-	-
深成联接 C	15	97,571.37	-	-	1,463,570.56	100.00	-	-
合计	14,170	25,873.22	416,922.15	0.11	366,206,672.90	99.89	-	-

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	深成联接 A	294,279.12	0.0800

员持有本基金	深成联接 C	11.76	0.0000
	合计	294,290.88	0.0800

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	深成联接 A	-
	深成联接 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	深成联接 A	0~10
	深成联接 C	-
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	深成联接 A	深成联接 C
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	378,088,340.31	-
本报告期基金总申购份额	16,466,517.49	1,619,040.31
减：本报告期基金总赎回份额	29,394,833.31	155,469.75
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	365,160,024.49	1,463,570.56

§ 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	3	18,969,041.48	100.00	1,897.58	100.00	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问

题的通知》（证监基金字[2007]48 号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 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。