

# 南方开元沪深 300 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

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及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、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

### §1 重要提示及目录

- 1.1 重要提示
- 1.2 目录

### §2 基金简介

- 2.1 基金基本情况
- 2.2 基金产品说明
- 2.3 基金管理人和基金托管人
- 2.4 信息披露方式
- 2.5 其他相关资料

### §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
- 3.2 基金净值表现

### §4 管理人报告

- 4.1 基金管理人及基金经理情况
- 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明
- 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
- 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
- 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
- 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
- 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
- 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

### §5 托管人报告

- 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明
- 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
- 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

- 6.1 资产负债表
- 6.2 利润表
- 6.3 所有者权益（基金净值）变动表
- 6.4 报表附注

### §7 投资组合报告

- 7.1 期末基金资产组合情况
- 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
- 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
- 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
- 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
- 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

- 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
- 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
- 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
- 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
- 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- 7.13 投资组合报告附注

## § 8 基金份额持有人信息

- 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
- 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
- 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

## § 9 开放式基金份额变动

## § 10 重大事件揭示

- 10.1 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
- 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
- 10.4 基金投资策略的改变
- 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
- 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
- 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
- 10.8 其他重大事件

## § 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
- 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

## § 12 备查文件目录

- 12.1 备查文件目录
- 12.2 存放地点
- 12.3 查阅方式

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	南方开元沪深 300ETF 联接

基金主代码	202015	
前端交易代码	202015	
后端交易代码	202016	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 3 月 25 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	644,213,262.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	南方 300 联接	南方 300 联接 C
下属分级基金的交易代码	202015	004342
报告期末下属分级基金的份额总额	643,669,815.93 份	543,446.59 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 300 联接”。

### 目标基金基本情况

基金名称	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159925
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 18 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013 年 4 月 11 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“南方 300”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于目标 ETF，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。
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。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% 的资产投资于目标 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、非成份股、新股、权证、债券资产、资产支持证券、

	固定收益类资产、现金资产、货币市场工具、衍生工具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。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 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属股票型联接基金，预期风险与预期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	本基金为被动式指数基金，采用指数复制法，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。基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数：沪深 300 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，主要采用指数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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	南方基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	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 300 联接	南方 300 联接 C
本期已实现收益	1,855,057.10	9,390.56
本期利润	92,222,042.21	118,876.53
加权平均基金份额本期利润	0.1410	0.2542
本期加权平均净值利润率	11.35%	1.15%
本期基金份额净值增长率	11.84%	8.58%
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	211,836,538.04	186,854.18
期末可供分配基金份额利润	0.3291	0.3438
期末基金资产净值	855,506,353.97	730,300.77
期末基金份额净值	1.3291	1.3438

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	51.55%	8.58%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方 300 联接

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	5.31	0.62	4.73	0.64	0.58	-0.02
过去三个月	6.77	0.58	5.79	0.59	0.98	-0.01
过去六个月	11.84	0.54	10.23	0.54	1.61	0.00
过去一年	19.98	0.64	15.44	0.63	4.54	0.01
过去三年	71.81	1.68	65.95	1.66	5.86	0.02
自基金合同生效 起至今	51.55	1.50	52.27	1.50	-0.72	0.00

南方 300 联接 C

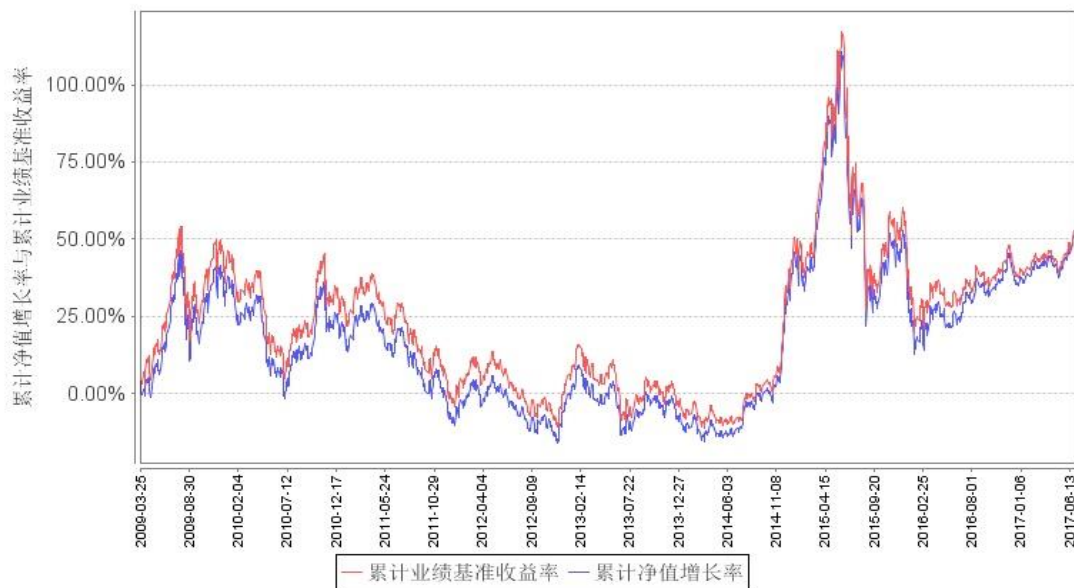
阶段	净值增长率① (%)	净值增长率 标准差② (%)	业绩比较基 准收益率③ (%)	业绩比较基 准收益率标 准差④ (%)	①—③ (%)	②—④ (%)
过去一个月	6.18	0.59	4.73	0.64	1.45	-0.05



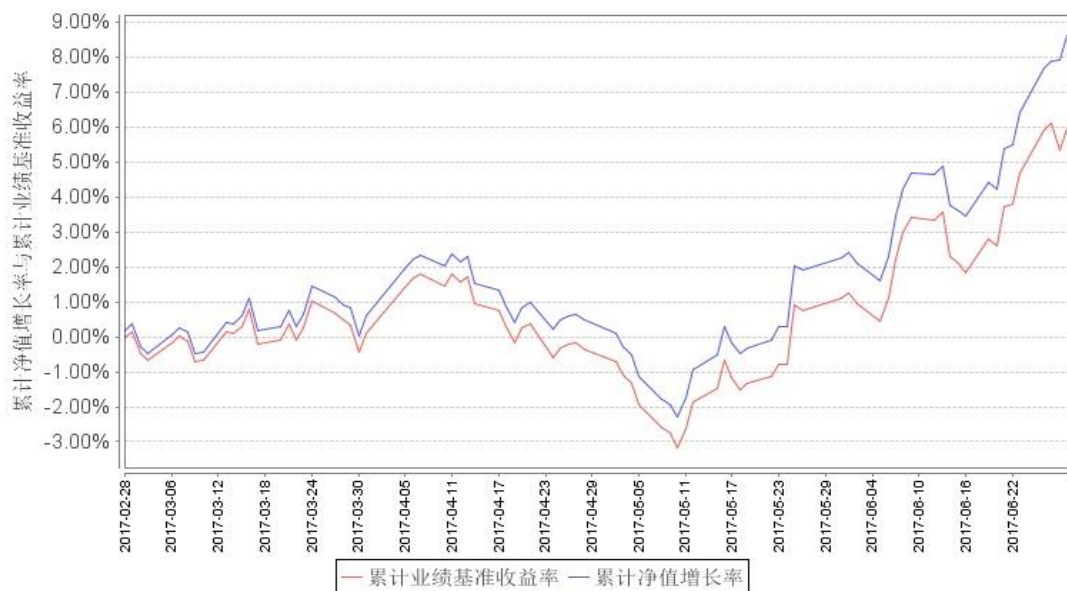
过去三个月	7.93	0.56	5.79	0.59	2.14	-0.03
自基金合同生效起至今	8.37	0.54	5.89	0.56	2.48	-0.02

### 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

南方300联接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300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



## § 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		
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 5 月 17 日		12	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有中国基金从业资格。曾先后任职于美国 Open Link Financial 公司、摩根斯坦利公司，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理，现任指数投资部、数量化投资部负责人；2013 年 5 月至 2015 年 6 月，任南方策略基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500 基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方 300 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2014 年 10 月至今，任 500

					医药基金经理；2015 年 2 月至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2016 年 12 月至今，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方开元沪深 300 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

报告期内，沪深 300 指数涨 10.78%。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（包括调出指数成份股）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 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；

6 月中，我们根据指数每半年度成份股调整进行了基金调仓，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，从实施结果来看，效果良好，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

自本基金建仓完毕至报告期末年化跟踪误差为 0.762%，较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过 4% 的投资目标。

截至报告期末，本基金 A 级份额净值为 1.3291 元，C 级份额净值为 1.3438 元。报告期内，A 级份额净值增长率为 11.84%，同期业绩基准增长率为 10.23%；C 级份额净值增长率为 8.37%，同期业绩基准增长率为 5.89%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内，经济面稳增长力度开始重新回升，地方债发行增速转正，特别是中长期信贷支持经济增长的力度加大，三四线房地产销售连续超预期，对下半年经济或有支撑。海外来看，美国经济复苏预期回落，美元指数偏弱，年内人民币贬值压力迅速减小，给国内的货币政策创造了较大的回旋空间。经济回落、通胀压力不大，将给权益市场带来一定的转机。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在

0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总经理、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，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；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。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期未有收益分配事项。

#### 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开元沪深 300 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

本报告期内南方开元沪深 300 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开元沪深 300 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，南方开元沪深 300 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开元沪深 300 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：南方开元沪深 300 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	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.4.1	15,036,686.17	2,669,859.72
结算备付金		36,569,537.01	37,153,241.20
存出保证金		1,631,980.57	56,569.00
交易性金融资产	6.4.4.2	805,428,164.08	747,653,996.36
其中：股票投资		12,029,813.94	36,826,758.59
基金投资		793,398,350.14	710,827,237.77
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	-	-
应收证券清算款		-	5,548.93
应收利息	6.4.4.5	19,957.16	8,295.73
应收股利		-	-
应收申购款		673,240.94	540,018.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		859,359,565.93	788,087,529.61
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	123.37
应付赎回款		2,892,766.70	1,029,385.01
应付管理人报酬		28,300.94	31,265.17
应付托管费		5,660.20	6,253.03
应付销售服务费		544.48	-
应付交易费用	6.4.4.7	-3,386.87	-7,552.75
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	199,025.74	284,201.54
负债合计		3,122,911.19	1,343,675.37
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.4.9	644,213,262.52	662,036,304.72
未分配利润	6.4.4.10	212,023,392.22	124,707,549.52
所有者权益合计		856,236,654.74	786,743,854.24
负债和所有者权益总计		859,359,565.93	788,087,529.61

注：报告截止日 2017 年 06 月 30 日，基金份额总额 644,213,262.52 份，其中 A 类基金份额的份额总额为 643,669,815.93 份，份额净值 1.3291 元；C 类基金份额的份额总额为 543,446.59 份，份额净值 1.3438 元。

## 6.2 利润表

会计主体：南方开元沪深 300 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	附注号	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
<b>一、收入</b>		92,805,888.06	-135,674,610.11
1. 利息收入		389,234.66	393,710.89
其中：存款利息收入	6.4.4.11	389,232.03	393,709.86
债券利息收入		2.63	1.03
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,833,451.23	-24,063,429.17

其中：股票投资收益	6.4.4.12	1,478,408.32	-623,213.58
基金投资收益	6.4.4.13	-328,456.09	-20,239,621.68
债券投资收益	6.4.4.14	510.37	408.87
资产支持证券投资 收益	6.4.4.14.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.4.15	-	-
衍生工具收益	6.4.4.16	505,260.00	-3,293,760.00
股利收益	6.4.4.17	177,728.63	92,757.22
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.4.18	90,476,471.08	-112,186,967.82
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.4.19	106,731.09	182,075.99
<b>减：二、费用</b>		464,969.32	771,113.94
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	173,918.41	205,041.82
2. 托管费	6.4.7.2.2	34,783.74	41,008.32
3. 销售服务费	6.4.7.2.3	772.85	-
4. 交易费用	6.4.4.20	66,923.22	326,038.82
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 其他费用	6.4.4.21	188,571.10	199,024.98
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		92,340,918.74	-136,445,724.05
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		92,340,918.74	-136,445,724.05

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方开元沪深 300 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）	662,036,304.72	124,707,549.52	786,743,854.24
二、本期经营活动 产生的基金净值 变动数（本期净利 润）	-	92,340,918.74	92,340,918.74



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)	-17,823,042.20	-5,025,076.04	-22,848,118.24
其中: 1. 基金申购款	90,922,988.91	22,241,651.56	113,164,640.47
2. 基金赎回款	-108,746,031.11	-27,266,727.60	-136,012,758.71
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)	644,213,262.52	212,023,392.22	856,236,654.74
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)	754,684,759.42	220,644,232.25	975,328,991.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-136,445,724.05	-136,445,724.05
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)	24,204,499.61	-208,971.19	23,995,528.42
其中: 1. 基金申购款	182,168,715.41	12,834,042.11	195,002,757.52
2. 基金赎回款	-157,964,215.80	-13,043,013.30	-171,007,229.10
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)	778,889,259.03	83,989,537.01	862,878,796.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

杨小松

基金管理人负责人

徐超

主管会计工作负责人

徐超

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

### 6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.2.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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	15,036,686.17
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	15,036,686.17

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

##### 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	11,331,027.93	12,029,813.94	698,786.01
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	749,895,606.88	793,398,350.14	43,502,743.26
其他	-	-	-
合计	761,226,634.81	805,428,164.08	44,201,529.27

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

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
权益衍生工具	7,402,740.00	-	-	-
-	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	7,402,740.00	-	-	-

#### 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

注：无。

##### 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	1,945.07
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	18,002.55
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	9.54
合计	19,957.16

## 6.4.4.6 其他资产

注：无。

## 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	-3,386.87
银行间市场应付交易费用	-
合计	-3,386.87

## 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	10,586.64
预提费用	188,439.10
其他	-
应付指数使用费	-
应退替代款	-
可退替代款	-
合计	199,025.74

## 6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 南方 300 联接

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	662,036,304.72	662,036,304.72
本期申购	88,934,411.41	88,934,411.41
本期赎回（以“-”号填列）	-107,300,900.20	-107,300,900.20
-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	643,669,815.93	643,669,815.93
-----	----------------	----------------

## 南方 300 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	1,988,577.50	1,988,577.50
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,445,130.91	-1,445,130.91
-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	543,446.59	543,446.59

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 300 联接			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	510,202,567.90	-385,495,018.38	124,707,549.52
本期利润	1,855,057.10	90,366,985.11	92,222,042.21
本期基金份额交易产生的变动数	-14,174,472.19	9,081,418.50	-5,093,053.69
其中：基金申购款	68,613,611.85	-46,893,231.78	21,720,380.07
基金赎回款	-82,788,084.04	55,974,650.28	-26,813,433.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	497,883,152.81	-286,046,614.77	211,836,538.04
南方 300 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	9,390.56	109,485.97	118,876.53
本期基金份额交易产生的变动数	418,759.61	-350,781.96	67,977.65

其中：基金申购款	1,540,379.92	-1,019,108.43	521,271.49
基金赎回款	-1,121,620.31	668,326.47	-453,293.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	428,150.17	-241,295.99	186,854.18

#### 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	26,064.59
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	361,802.19
其他	1,365.25
合计	389,232.03

#### 6.4.4.12 股票投资收益

##### 6.4.4.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,541,401.69
股票投资收益——申购差价收入	-62,993.37
合计	1,478,408.32

##### 6.4.4.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	50,760,711.41
减：卖出股票成本总额	49,219,309.72
买卖股票差价收入	1,541,401.69

## 6.4.4.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日
申购基金份额对价总额	8,261,200.00
减：现金支付申购款总额	-2,882.39
减：申购股票成本总额	8,327,075.76
申购差价收入	-62,993.37

## 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	14,066,469.35
减：卖出/赎回基金成本总额	14,394,925.44
基金投资收益	-328,456.09

## 6.4.4.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年6月 30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	30,513.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	30,000.00
减：应收利息总额	2.63
买卖债券差价收入	510.37

## 6.4.4.15 贵金属投资收益

注：无。

## 6.4.4.16 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2017年1月1日至 2017年6月30日
股指期货-投资收益	505,260.00

## 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	177,728.63
基金投资产生的股利收益	-
合计	177,728.63

#### 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	90,219,671.08
股票投资	1,514,833.27
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	88,704,837.81
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	256,800.00
权证投资	-
期货	256,800.00
其他	-
合计	90,476,471.08

#### 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	77,398.53
补差费归资产	29,332.56
合计	106,731.09

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费补差两部分构成，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	64,448.69
银行间市场交易费用	-
中金所交易费用	2,474.53
合计	66,923.22

## 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	39,671.58
信息披露费	148,767.52
银行费用	132.00
合计	188,571.10

## 6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.5.1 或有事项

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
南方开元沪深 300 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		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	21,288,745.31	31.35	62,573,609.35	27.49

#### 6.4.7.1.2 基金交易

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	占当期基金 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金 成交总额的比例 (%)
华泰证券	22,656,125.44	100.00	259,268,723.17	100.00

#### 6.4.7.1.3 权证交易

注：无。

#### 6.4.7.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	2,129.27	31.36	937.54	27.68
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	54,043.80	28.40	1,136,890.37	61.44

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	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	173,918.41	205,041.82
其中：支付销售机构的客户维护费	214,850.42	381,173.11

注：南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的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管理公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.5% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = (前一日基金资产净值 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 0.5% / 当年天数。

### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	34,783.74	41,008.32

注：南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的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工商银行的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.1% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = (前一日基金资产净值 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 0.1% / 当年天数。

### 6.4.7.2.3 销售服务费

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 300 联接	南方 300 联接 C	合计

南方基金	-	770.79	770.79
合计	-	770.79	770.79
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方 300 联接	南方 300 联接 C	合计
南方基金	-	-	-
合计	-	-	-

#### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用自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 300 联接	南方 300 联接 C
基金合同生效日(2009 年 3 月 25 日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	35,833,870.85	-
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	35,833,870.85	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	5.5624%	-%
项目	上年度可比期间 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 06 月 30 日
	南方 300 联接	南方 300 联接 C

基金合同生效日(2009年3月25日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	35,833,870.85	-
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	35,833,870.85	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.6006%%	-%

注:本基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同和更新的招募说明书的有关规定以及与券商约定的席位佣金费率支付。

#### 6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:无。

#### 6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 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
中国工商银行股份有限公司	15,036,686.17	26,064.59	5,550,084.29	146,022.97

#### 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2017年6月30日,本基金持有520,944,419.00份目标ETF基金份额,占其总份额的比例为71.83%。

#### 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
601989	中国重工	2017-05-31	重大资产重组	6.21	-	-	26,900	192,606.97	167,049.00	-
601088	中国神华	2017-06-05	重要事项未公告	22.29	-	-	5,800	102,956.40	129,282.00	-
600795	国电电力	2017-06-05	重大资产重组	3.60	-	-	34,600	112,989.60	124,560.00	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.27	-	-	13,200	109,164.00	109,164.00	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大资产重组	14.59	-	-	6,800	109,765.57	99,212.00	-
600050	中国联通	2017-04-05	重要事项未公告	6.85	2017-08-21	8.22	13,700	95,379.21	93,845.00	-
000100	TCL集团	2017-04-21	重大事项	3.43	2017-07-26	3.72	18,700	65,386.03	64,141.00	-
600100	XD同方股	2017-04-21	重大资产重组	14.12	-	-	4,500	63,070.48	63,540.00	-
601919	中远海控	2017-05-17	重大资产重组	5.35	2017-07-26	5.89	11,200	62,399.58	59,920.00	-
002426	胜利精密	2017-01-16	拟披露重大事项	7.68	-	-	7,700	68,478.58	59,136.00	-
300104	乐视网	2017-04-17	重大资产	30.68	-	-	1,900	66,315.06	58,292.00	-

			重组								
002049	紫光 国芯	2017- 02-20	重大 资产 重组	30.82	2017- 07-17	27.74	1,800	56,579.86	55,476.00		-
002252	上海 莱士	2017- 04-21	重大 事项	20.24	-	-	2,500	51,282.91	50,600.00		-
601727	上海 电气	2017- 06-22	重要 公告	7.57	2017- 07-03	7.54	6,500	54,255.52	49,205.00		-
600654	*ST中 安	2017- 06-07	重大 资产 重组	13.48	-	-	3,600	62,644.00	48,528.00		-
000503	海虹 控股	2017- 05-11	重大 资产 重组	24.93	-	-	1,800	75,989.38	44,874.00		-
600959	江苏 有线	2017- 06-19	重要 事项 未公 告	10.57	-	-	3,200	33,658.21	33,824.00		-
600666	奥瑞 德	2017- 04-27	重大 资产 重组	17.40	-	-	1,920	33,558.63	33,408.00		-
601872	XD招 商轮	2017- 05-02	重要 事项 未公 告	5.16	-	-	5,400	28,330.28	27,864.00		-
601608	中信 重工	2017- 04-19	重要 事项 未公 告	5.54	2017- 07-26	5.26	2,100	11,560.55	11,634.00		-

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。

#### 6.4.9.3 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

注：无。



## 6.4.10 金融工具风险及管理

### 6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为完全被动式指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资的金融工具主要包括基金投资及股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”的风险收益目标。

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

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

### 6.4.10.2 信用风险

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

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

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

行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.10.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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，所持股票均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.8 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，其余金融资产均能以合理价格适时变现。

#### 6.4.10.4 市场风险

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

##### 6.4.10.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。 本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计

息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

#### 6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,036,686.17	-	-	-	15,036,686.17
结算备付金	36,569,537.01	-	-	-	36,569,537.01
存出保证金	23,477.17	-	-	1,608,503.40	1,631,980.57
交易性金融资产	-	-	-	805,428,164.08	805,428,164.08
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	19,957.16	19,957.16
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	205,048.46	-	-	468,192.48	673,240.94
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	51,834,748.81	-	-	807,524,817.12	859,359,565.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,892,766.70	2,892,766.70
应付管理人报酬	-	-	-	28,300.94	28,300.94
应付托管费	-	-	-	5,660.20	5,660.20
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	544.48	544.48
应付交易费用	-	-	-	-3,386.87	-3,386.87
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	199,025.74	199,025.74
负债总计	-	-	-	3,122,911.19	3,122,911.19
利率敏感度缺口	51,834,748.81	-	-	804,401,905.93	856,236,654.74
上年度末 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	2,669,859.72	-	-	-	2,669,859.72
结算备付金	37,153,241.20	-	-	-	37,153,241.20
存出保证金	56,569.00	-	-	-	56,569.00
交易性金融资产	-	-	-	747,653,996.36	747,653,996.36
应收证券清算款	-	-	-	5,548.93	5,548.93
应收利息	-	-	-	8,295.73	8,295.73
应收申购款	348,487.64	-	-	191,531.03	540,018.67
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	40,228,157.56	-	-	747,859,372.05	788,087,529.61
负债					
应付证券清算款		-	-	123.37	123.37
应付赎回款		-	-	1,029,385.01	1,029,385.01
应付管理人报酬		-	-	31,265.17	31,265.17
应付托管费		-	-	6,253.03	6,253.03
应付交易费用		-	-	-7,552.75	-7,552.75
其他负债		-	-	284,201.54	284,201.54
负债总计		-	-	1,343,675.37	1,343,675.37
利率敏感度缺口	40,228,157.56	-	-	746,515,696.68	786,743,854.24

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

#### 6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2016 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(2016 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.10.4.2 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 份额以及证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.10.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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	12,029,813.94	1.41	36,826,758.59	4.68
交易性金融资产-基金投资	793,398,350.14	92.66	710,827,237.77	90.35
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	805,428,164.08	94.07	747,653,996.36	95.03

注：交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标 ETF 份额。

#### 6.4.10.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	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（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
分析	业绩比较基准（附注 7.4.1）上升 5%	42,660,000.00	39,190,000.00
	业绩比较基准（附注 7.4.1）下降 5%	-42,660,000.00	-39,190,000.00

#### 6.4.11 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	12,029,813.94	1.40
	其中:股票	12,029,813.94	1.40
2	基金投资	793,398,350.14	92.32
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	51,606,223.18	6.01
-	-	-	-
-	其他各项资产	2,325,178.67	0.27
-	合计	859,359,565.93	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	27,979.00	-
B	采矿业	445,057.00	0.05
C	制造业	4,508,631.53	0.53

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	383,149.00	0.04
E	建筑业	521,313.78	0.06
F	批发和零售业	238,322.30	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	375,893.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	703,646.25	0.08
J	金融业	3,857,895.76	0.45
K	房地产业	594,846.26	0.07
L	租赁和商务服务业	96,292.00	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	93,041.15	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	22,100.00	-
R	文化、体育和娱乐业	129,535.91	0.02
S	综合	32,111.00	-
	合计	12,029,813.94	1.40

## 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	601318	中国平安	11,700	580,437.00	0.07
2	600036	招商银行	11,100	265,401.00	0.03
3	600519	贵州茅台	500	235,925.00	0.03
4	601166	兴业银行	13,400	225,924.00	0.03
5	000651	格力电器	5,200	214,084.00	0.03
6	000333	美的集团	4,900	210,896.00	0.02
7	600016	民生银行	25,500	209,610.00	0.02
8	000002	万科A	7,400	184,778.00	0.02
9	601328	交通银行	29,600	182,336.00	0.02
10	601989	中国重工	26,900	167,049.00	0.02
11	601668	中国建筑	16,200	156,816.00	0.02
12	600000	浦发银行	12,120	153,318.00	0.02
13	601288	农业银行	41,300	145,376.00	0.02
14	600030	中信证券	8,500	144,670.00	0.02
15	600887	伊利股份	6,496	140,248.64	0.02
16	600104	上汽集团	4,220	131,031.00	0.02

17	601088	中国神华	5,800	129,282.00	0.02
18	002415	海康威视	4,000	129,200.00	0.02
19	600837	海通证券	8,700	129,195.00	0.02
20	600795	国电电力	34,600	124,560.00	0.01
21	601398	工商银行	23,300	122,325.00	0.01
22	601169	北京银行	13,100	120,127.00	0.01
23	601601	中国太保	3,400	115,158.00	0.01
24	000858	五粮液	2,000	111,320.00	0.01
25	600900	长江电力	7,100	109,198.00	0.01
26	002129	中环股份	13,200	109,164.00	0.01
27	000725	京东方 A	25,600	106,496.00	0.01
28	601766	中国中车	10,500	106,260.00	0.01
29	600485	信威集团	6,800	99,212.00	0.01
30	601211	国泰君安	4,800	98,448.00	0.01
31	600050	中国联通	13,700	93,845.00	0.01
32	600276	恒瑞医药	1,820	92,073.80	0.01
33	000001	平安银行	9,200	86,388.00	0.01
34	601988	中国银行	22,700	83,990.00	0.01
35	600048	保利地产	7,600	75,772.00	0.01
36	601818	光大银行	17,200	69,660.00	0.01
37	600518	康美药业	3,200	69,568.00	0.01
38	601390	中国中铁	8,000	69,360.00	0.01
39	600028	中国石化	11,300	67,009.00	0.01
40	600015	华夏银行	6,960	64,171.20	0.01
41	000100	TCL 集团	18,700	64,141.00	0.01
42	600019	宝钢股份	9,504	63,771.84	0.01
43	600100	XD 同方股	4,500	63,540.00	0.01
44	601688	华泰证券	3,500	62,650.00	0.01
45	601919	中远海控	11,200	59,920.00	0.01
46	000063	中兴通讯	2,500	59,350.00	0.01
47	002426	胜利精密	7,700	59,136.00	0.01
48	601186	中国铁建	4,900	58,947.00	0.01
49	002450	康得新	2,600	58,552.00	0.01
50	300104	乐视网	1,900	58,292.00	0.01
51	000538	云南白药	600	56,310.00	0.01
52	002049	紫光国芯	1,800	55,476.00	0.01
53	000776	广发证券	3,200	55,200.00	0.01
54	601006	大秦铁路	6,400	53,696.00	0.01
55	001979	招商蛇口	2,500	53,400.00	0.01
56	002304	洋河股份	600	52,086.00	0.01
57	600703	三安光电	2,600	51,220.00	0.01
58	002252	上海莱士	2,500	50,600.00	0.01



59	600690	青岛海尔	3,300	49,665.00	0.01
60	601727	上海电气	6,500	49,205.00	0.01
61	601628	中国人寿	1,800	48,564.00	0.01
62	600654	*ST 中安	3,600	48,528.00	0.01
63	600585	海螺水泥	2,100	47,733.00	0.01
64	600958	东方证券	3,400	47,294.00	0.01
65	601336	新华保险	900	46,260.00	0.01
66	002024	苏宁云商	4,000	45,000.00	0.01
67	000503	海虹控股	1,800	44,874.00	0.01
68	601939	建设银行	7,200	44,280.00	0.01
69	601009	南京银行	3,900	43,719.00	0.01
70	601901	方正证券	4,400	43,692.00	0.01
71	600340	华夏幸福	1,300	43,654.00	0.01
72	000423	东阿阿胶	600	43,134.00	0.01
73	600309	万华化学	1,460	41,814.40	0.00
74	600999	招商证券	2,400	41,328.00	0.00
75	600741	华域汽车	1,700	41,208.00	0.00
76	600089	特变电工	3,985	41,165.05	0.00
77	002142	宁波银行	2,100	40,530.00	0.00
78	601857	中国石油	5,200	39,988.00	0.00
79	002230	科大讯飞	1,000	39,900.00	0.00
80	600660	福耀玻璃	1,500	39,060.00	0.00
81	601985	中国核电	5,000	39,050.00	0.00
82	601669	中国电建	4,900	38,808.00	0.00
83	601899	紫金矿业	11,200	38,416.00	0.00
84	601377	兴业证券	5,100	37,893.00	0.00
85	600009	上海机场	1,000	37,310.00	0.00
86	300070	碧水源	1,971	36,759.15	0.00
87	002241	歌尔股份	1,900	36,632.00	0.00
88	000166	申万宏源	6,500	36,400.00	0.00
89	002456	欧菲光	2,000	36,340.00	0.00
90	000568	泸州老窖	700	35,406.00	0.00
91	000069	华侨城 A	3,500	35,210.00	0.00
92	600886	国投电力	4,400	34,760.00	0.00
93	601607	上海医药	1,200	34,656.00	0.00
94	002736	国信证券	2,600	34,450.00	0.00
95	000338	潍柴动力	2,600	34,320.00	0.00
96	002236	大华股份	1,500	34,215.00	0.00
97	000783	长江证券	3,600	34,092.00	0.00
98	600196	复星医药	1,100	34,089.00	0.00
99	600959	江苏有线	3,200	33,824.00	0.00
100	600068	葛洲坝	3,000	33,720.00	0.00

101	300059	东方财富	2,800	33,656.00	0.00
102	600666	奥瑞德	1,920	33,408.00	0.00
103	300072	三聚环保	900	33,345.00	0.00
104	600031	三一重工	4,100	33,333.00	0.00
105	600029	南方航空	3,800	33,060.00	0.00
106	002466	天齐锂业	600	32,610.00	0.00
107	600010	包钢股份	14,780	32,368.20	0.00
108	601600	中国铝业	7,100	32,092.00	0.00
109	601788	光大证券	2,100	31,353.00	0.00
110	002008	大族激光	900	31,176.00	0.00
111	600066	宇通客车	1,400	30,758.00	0.00
112	600606	绿地控股	3,900	30,498.00	0.00
113	600637	东方明珠	1,400	30,338.00	0.00
114	000625	长安汽车	2,100	30,282.00	0.00
115	601888	中国国旅	1,000	30,140.00	0.00
116	002594	比亚迪	600	29,970.00	0.00
117	601099	太平洋	7,400	29,748.00	0.00
118	601555	东吴证券	2,600	29,198.00	0.00
119	600535	天士力	700	29,078.00	0.00
120	601618	中国中冶	5,800	29,058.00	0.00
121	601933	永辉超市	4,100	29,028.00	0.00
122	000839	中信国安	2,900	28,971.00	0.00
123	600406	国电南瑞	1,600	28,240.00	0.00
124	300124	汇川技术	1,100	28,094.00	0.00
125	000413	东旭光电	2,500	28,050.00	0.00
126	601872	XD 招商轮	5,400	27,864.00	0.00
127	600522	中天科技	2,300	27,715.00	0.00
128	000768	中航飞机	1,500	27,660.00	0.00
129	600383	金地集团	2,400	27,528.00	0.00
130	600893	航发动力	1,000	27,300.00	0.00
131	600705	中航资本	4,800	27,120.00	0.00
132	002673	西部证券	1,898	26,989.56	0.00
133	600109	国金证券	2,300	26,956.00	0.00
134	600816	安信信托	1,960	26,636.40	0.00
135	002475	立讯精密	900	26,316.00	0.00
136	002202	金风科技	1,700	26,299.00	0.00
137	000895	双汇发展	1,100	26,125.00	0.00
138	600111	北方稀土	2,300	26,059.00	0.00
139	002739	万达院线	500	25,485.00	0.00
140	601800	中国交建	1,600	25,424.00	0.00
141	000963	华东医药	500	24,850.00	0.00
142	600271	航天信息	1,200	24,768.00	0.00

143	600023	浙能电力	4,400	24,024.00	0.00
144	601018	宁波港	4,200	23,730.00	0.00
145	600674	川投能源	2,400	23,568.00	0.00
146	600739	辽宁成大	1,300	23,439.00	0.00
147	300024	机器人	1,200	23,400.00	0.00
148	600570	恒生电子	500	23,340.00	0.00
149	601992	金隅股份	3,600	23,292.00	0.00
150	600177	雅戈尔	2,300	23,276.00	0.00
151	600547	山东黄金	800	23,144.00	0.00
152	600352	浙江龙盛	2,400	22,872.00	0.00
153	600221	海航控股	7,100	22,862.00	0.00
154	601225	陕西煤业	3,200	22,624.00	0.00
155	000728	国元证券	1,850	22,607.00	0.00
156	000793	华闻传媒	2,200	22,264.00	0.00
157	600018	上港集团	3,500	22,190.00	0.00
158	002044	美年健康	1,300	22,100.00	0.00
159	002007	华兰生物	600	21,900.00	0.00
160	002065	东华软件	1,000	21,790.00	0.00
161	000623	吉林敖东	950	21,745.50	0.00
162	002508	老板电器	500	21,740.00	0.00
163	600804	鹏博士	1,200	21,300.00	0.00
164	603993	洛阳钼业	4,200	21,252.00	0.00
165	000157	中联重科	4,700	21,103.00	0.00
166	600115	东方航空	3,100	21,080.00	0.00
167	000826	启迪桑德	600	21,072.00	0.00
168	600415	小商品城	2,900	20,996.00	0.00
169	600085	同仁堂	600	20,976.00	0.00
170	000540	中天城投	3,000	20,850.00	0.00
171	601998	中信银行	3,300	20,757.00	0.00
172	600208	新湖中宝	4,600	20,700.00	0.00
173	601198	东兴证券	1,200	20,688.00	0.00
174	601111	中国国航	2,100	20,475.00	0.00
175	600820	隧道股份	2,000	20,200.00	0.00
176	002310	东方园林	1,200	20,064.00	0.00
177	600153	建发股份	1,500	19,395.00	0.00
178	002465	海格通信	1,800	19,332.00	0.00
179	000630	铜陵有色	6,800	19,312.00	0.00
180	000709	河钢股份	4,600	19,274.00	0.00
181	000060	中金岭南	1,700	19,040.00	0.00
182	002074	国轩高科	600	18,930.00	0.00
183	600157	永泰能源	5,300	18,921.00	0.00
184	600663	陆家嘴	800	18,912.00	0.00

185	000876	新希望	2,300	18,906.00	0.00
186	002081	金螳螂	1,700	18,666.00	0.00
187	600061	国投安信	1,200	18,660.00	0.00
188	000009	中国宝安	2,300	18,607.00	0.00
189	600362	江西铜业	1,100	18,546.00	0.00
190	600682	南京新百	500	18,450.00	0.00
191	600436	片仔癀	300	18,312.00	0.00
192	600170	上海建工	4,729	18,064.78	0.00
193	600489	中金黄金	1,800	18,054.00	0.00
194	300017	网宿科技	1,495	18,044.65	0.00
195	002027	分众传媒	1,300	17,888.00	0.00
196	601229	上海银行	700	17,878.00	0.00
197	002146	荣盛发展	1,800	17,766.00	0.00
198	601216	君正集团	3,600	17,604.00	0.00
199	000750	国海证券	3,200	17,600.00	0.00
200	300168	万达信息	1,200	17,460.00	0.00
201	600332	白云山	600	17,424.00	0.00
202	601633	长城汽车	1,300	17,277.00	0.00
203	002500	山西证券	1,800	17,244.00	0.00
204	300315	掌趣科技	2,100	17,136.00	0.00
205	600008	首创股份	2,600	17,108.00	0.00
206	600297	广汇汽车	2,260	17,017.80	0.00
207	000425	徐工机械	4,500	16,875.00	0.00
208	600369	西南证券	3,000	16,830.00	0.00
209	600118	中国卫星	600	16,704.00	0.00
210	601155	新城控股	900	16,686.00	0.00
211	601333	广深铁路	3,600	16,272.00	0.00
212	600150	中国船舶	700	16,009.00	0.00
213	000559	万向钱潮	1,480	15,717.60	0.00
214	000402	金融街	1,300	15,236.00	0.00
215	600498	烽火通信	600	15,210.00	0.00
216	600688	上海石化	2,300	15,203.00	0.00
217	002195	二三四五	2,120	15,158.00	0.00
218	000792	盐湖股份	1,450	15,152.50	0.00
219	000686	东北证券	1,500	15,075.00	0.00
220	600583	海油工程	2,400	14,976.00	0.00
221	000983	西山煤电	1,700	14,909.00	0.00
222	601117	中国化学	2,100	14,679.00	0.00
223	300144	宋城演艺	700	14,609.00	0.00
224	300027	华谊兄弟	1,799	14,553.91	0.00
225	002411	必康股份	500	14,460.00	0.00
226	600373	中文传媒	600	14,106.00	0.00

227	600256	广汇能源	3,400	14,076.00	0.00
228	600718	东软集团	900	13,995.00	0.00
229	600649	城投控股	1,326	13,936.26	0.00
230	002385	大北农	2,200	13,838.00	0.00
231	002183	怡亚通	1,600	13,808.00	0.00
232	600588	用友网络	800	13,696.00	0.00
233	000917	电广传媒	1,200	13,560.00	0.00
234	600895	张江高科	800	13,504.00	0.00
235	600704	物产中大	1,850	13,486.50	0.00
236	000415	渤海金控	2,000	13,460.00	0.00
237	000008	神州高铁	1,800	13,104.00	0.00
238	600827	XD 百联股	800	13,000.00	0.00
239	600074	保千里	1,000	12,810.00	0.00
240	002470	金正大	1,700	12,801.00	0.00
241	002555	三七互娱	500	12,785.00	0.00
242	600376	首开股份	1,100	12,584.00	0.00
243	300033	同花顺	200	12,442.00	0.00
244	601718	际华集团	1,400	12,306.00	0.00
245	601866	中远海发	3,400	12,240.00	0.00
246	600060	海信电器	800	12,136.00	0.00
247	600909	华安证券	1,200	12,108.00	0.00
248	600919	江苏银行	1,300	12,077.00	0.00
249	000959	首钢股份	1,700	11,883.00	0.00
250	601608	中信重工	2,100	11,634.00	0.00
251	600977	中国电影	600	11,232.00	0.00
252	601997	贵阳银行	700	11,067.00	0.00
253	600685	中船防务	400	10,952.00	0.00
254	002714	牧原股份	400	10,888.00	0.00
255	600021	上海电力	900	10,881.00	0.00
256	002602	世纪华通	300	10,878.00	0.00
257	600549	厦门钨业	500	10,745.00	0.00
258	002352	鼎泰新材	200	10,632.00	0.00
259	000627	天茂集团	1,300	10,504.00	0.00
260	000156	华数传媒	700	10,437.00	0.00
261	600372	中航电子	600	10,422.00	0.00
262	000977	浪潮信息	600	10,392.00	0.00
263	600737	中粮糖业	1,100	10,384.00	0.00
264	600037	歌华有线	700	10,192.00	0.00
265	002292	奥飞娱乐	600	10,140.00	0.00
266	600482	中国动力	400	10,116.00	0.00
267	601877	正泰电器	500	10,045.00	0.00
268	002152	广电运通	1,200	9,972.00	0.00

269	000671	阳光城	1,700	9,894.00	0.00
270	002131	利欧股份	3,000	9,870.00	0.00
271	000738	中航动控	500	9,785.00	0.00
272	601118	海南橡胶	1,700	9,656.00	0.00
273	002174	游族网络	300	9,528.00	0.00
274	601881	中国银河	800	9,488.00	0.00
275	002424	贵州百灵	500	9,430.00	0.00
276	000718	苏宁环球	1,600	9,376.00	0.00
277	600038	中直股份	200	9,154.00	0.00
278	000961	中南建设	1,400	9,128.00	0.00
279	002153	石基信息	400	9,092.00	0.00
280	300251	光线传媒	1,100	9,009.00	0.00
281	600446	金证股份	500	8,790.00	0.00
282	601958	金钼股份	1,200	8,604.00	0.00
283	601611	中国核建	700	8,379.00	0.00
284	002558	世纪游轮	180	8,319.60	0.00
285	601375	中原证券	800	8,048.00	0.00
286	601163	三角轮胎	300	7,890.00	0.00
287	300133	华策影视	700	7,840.00	0.00
288	600233	圆通速递	400	7,836.00	0.00
289	600871	石化油服	2,300	7,682.00	0.00
290	002299	圣农发展	500	7,435.00	0.00
291	600926	杭州银行	500	7,425.00	0.00
292	603858	步长制药	100	7,164.00	0.00
293	601966	玲珑轮胎	300	6,729.00	0.00
294	601021	春秋航空	200	6,726.00	0.00
295	000555	神州信息	400	6,680.00	0.00
296	600188	兖州煤业	500	6,120.00	0.00
297	000938	紫光股份	100	6,112.00	0.00
298	002839	张家港行	300	4,716.00	0.00
299	002797	第一创业	460	4,236.60	0.00
300	601127	小康股份	200	3,990.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

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	601318	中国平安	735,134.00	0.09
2	600519	贵州茅台	359,784.00	0.05
3	600036	招商银行	358,686.00	0.05
4	600016	民生银行	358,090.00	0.05

5	601166	兴业银行	346,383.00	0.04
6	601328	交通银行	300,550.00	0.04
7	000333	美的集团	274,743.00	0.03
8	000651	格力电器	274,238.00	0.03
9	601668	中国建筑	262,154.00	0.03
10	000002	万科 A	256,643.00	0.03
11	600000	浦发银行	244,785.00	0.03
12	600030	中信证券	232,757.00	0.03
13	601288	农业银行	230,176.00	0.03
14	600837	海通证券	221,086.00	0.03
15	600887	伊利股份	207,312.00	0.03
16	601169	北京银行	205,506.00	0.03
17	601766	中国中车	202,830.00	0.03
18	600104	上汽集团	192,313.00	0.02
19	601398	工商银行	188,788.00	0.02
20	600900	长江电力	163,070.00	0.02

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

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	601318	中国平安	2,316,832.16	0.29
2	601166	兴业银行	1,132,766.00	0.14
3	600036	招商银行	1,110,940.32	0.14
4	600016	民生银行	1,072,724.00	0.14
5	600519	贵州茅台	1,055,106.00	0.13
6	601328	交通银行	895,139.00	0.11
7	000333	美的集团	854,051.00	0.11
8	000651	格力电器	811,184.00	0.10
9	000002	万科 A	771,019.41	0.10
10	600000	浦发银行	746,189.80	0.09
11	601668	中国建筑	723,739.00	0.09
12	600030	中信证券	685,834.00	0.09
13	601288	农业银行	673,495.00	0.09
14	600837	海通证券	653,433.00	0.08
15	600887	伊利股份	615,615.00	0.08
16	601169	北京银行	613,482.00	0.08
17	000538	云南白药	567,583.00	0.07
18	601398	工商银行	552,147.00	0.07

19	601766	中国中车	523,884.00	0.07
20	600104	上汽集团	483,515.00	0.06

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	17,143,415.56
卖出股票收入（成交）总额	50,760,711.41

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投资。

### 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投资。

### 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	南方开元沪深 300ETF	股票型	交易型开放式	南方基金管理有限公司	793,398,350.14	92.66

### 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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1707	IF1707	7	7,659,540.0	256,800.00	-



			0	
公允价值变动总额合计（元）				256,800.00
股指期货投资本期收益（元）				505,260.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）				256,800.00

### 7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，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，利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票和目标 ETF 仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪标的指数的目的。

### 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	1,631,980.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,957.16
5	应收申购款	673,240.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	2,325,178.67

#### 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	601989	中国重工	167,049.00	0.02	重大资产重组

### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 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 (%)
南方开元沪深 300ETF 联接	41,009	15,695.82	44,349,488.95	6.89	599,320,326.98	93.11	-	-
南方 300 联接 C	60	9,057.44	-	-	543,446.59	100.00	-	-
合计	41,069	15,686.12	44,349,488.95	6.88	599,863,773.57	93.12	-	-

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 300 联接	3,433,811.90	0.5335
	南方 300 联接 C	169.39	0.0312

	合计	3,433,981.29	0.5531
--	----	--------------	--------

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 300 联接	>100
	南方 300 联接 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持 有本开放式基金	南方 300 联接	0~10
	南方 300 联接 C	0~10
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方 300 联接	南方 300 联接 C
基金合同生效日 (2009 年 3 月 25 日) 基金份额总额	1,580,754,997.47	-
本报告期期初基金份 额总额	662,036,304.72	-
本报告期基金总申购 份额	88,934,411.41	1,988,577.50
减：本报告期基金总 赎回份额	107,300,900.20	1,445,130.91
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	643,669,815.93	543,446.59

## § 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 (%)	
中投证券	1	46,607,690.37	68.65	4,661.07	68.64	-
华泰证券	2	21,288	31.35	2,129.27	31.36	-

		, 745.31				
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-

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 (%)
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	22,656,125.44	100.00
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	60,509.71	100.00	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方开元沪深 300 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（2017 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 6 月 21 日
2	南方开元沪深 300 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）（2017 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 6 月 21 日
3	南方基金管理有限公司关	中国证券报、上海证券	2017 年 6 月 12 日

	于调整旗下部分基金最低申购金额限制的公告	报、证券时报	
4	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 5 月 11 日
5	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 5 月 9 日
6	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 24 日
7	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 23 日
8	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 20 日
9	南方基金关于旗下部分基金增加大河财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 6 日
10	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 5 日
11	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2016 年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 30 日
12	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2016 年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 30 日
13	南方基金关于旗下部分基金增加华夏财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 15 日
14	南方基金关于旗下部分基金增加萧山农商银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 6 日
15	南方基金关于继续开展直销柜台部分指数型基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 1 日
16	南方基金关于旗下部分基	中国证券报、上海证券	2017 年 2 月 23 日

	金增加中原银行为代销机构及开通相关业务的公告	报、证券时报	
17	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 2 月 23 日
18	南方开元沪深 300 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	2017 年 2 月 20 日
19	南方开元沪深 300 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	2017 年 2 月 20 日
20	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 C 类份额开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 2 月 20 日
21	关于南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金增加 C 类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	2017 年 2 月 20 日
22	南方基金关于旗下部分基金增加植信基金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 2 月 15 日
23	南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 19 日
24	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 13 日
25	南方基金关于旗下部分基金增加肯特瑞财富为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 11 日
26	南方基金关于旗下部分基金增加金斧子为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 6 日



## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准南方沪深 300 转型为南方开元沪深 300 联接基金的文件。
- 2、《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》。
- 3、《南方开元沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》。
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

### 11.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层。

### 11.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>