

深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2017 年年度报告（摘要）

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 03 月 29 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 2018 年 3 月 26 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	深证成份交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方深证成份 ETF
基金主代码	159903
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 4 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
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	379,154,507.00 份
基金合同存续期	不定期
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

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	紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金, 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, 从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
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		南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	常克川	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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年1月1日-2017年12月31日）	报告期（2016年1月1日-2016年12月31日）	报告期（2015年1月1日-2015年12月31日）
本期已实现收益	-17,447,257.18	-55,815,139.01	934,216,855.43
本期利润	48,645,736.05	-114,097,089.64	442,160,825.53
加权平均基金份额本期利润	0.1156	-0.2397	0.5086
本期基金份额净值增长率	10.38%	-18.70%	15.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2017年12月31日)	报告期(2016年12月31日)	报告期(2015年12月31日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1575	-0.2701	-0.0205
期末基金资产净值	454,122,828.12	496,075,834.91	626,189,343.36
期末基金份额净值	1.1977	1.0851	1.3347

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

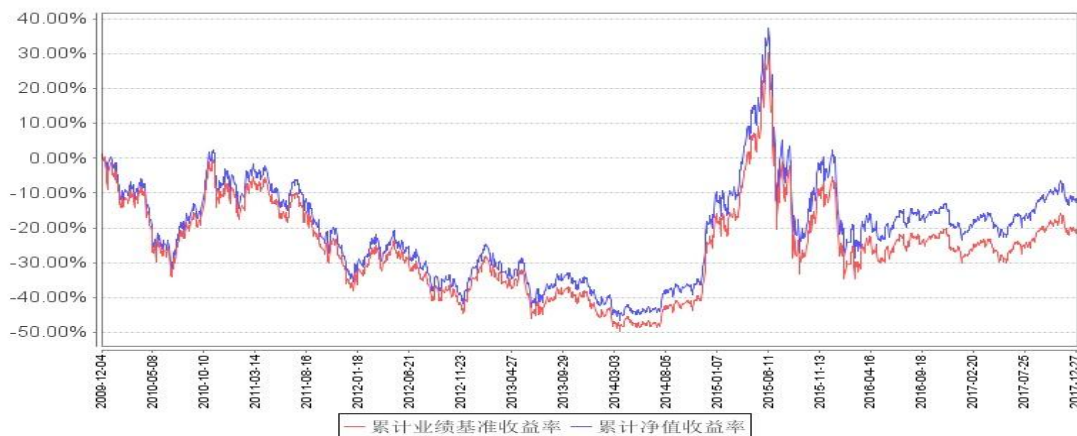
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-0.28%	0.99%	-0.42%	0.99%	0.14%	0.00%
过去六个月	5.41%	0.90%	4.85%	0.90%	0.56%	0.00%
过去一年	10.38%	0.87%	8.48%	0.87%	1.90%	0.00%
过去三年	3.52%	1.88%	0.23%	1.92%	3.29%	-0.04%

过去五年	28.59%	1.69%	21.10%	1.72%	7.49%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-11.63%	1.62%	-20.49%	1.65%	8.86%	-0.03%

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

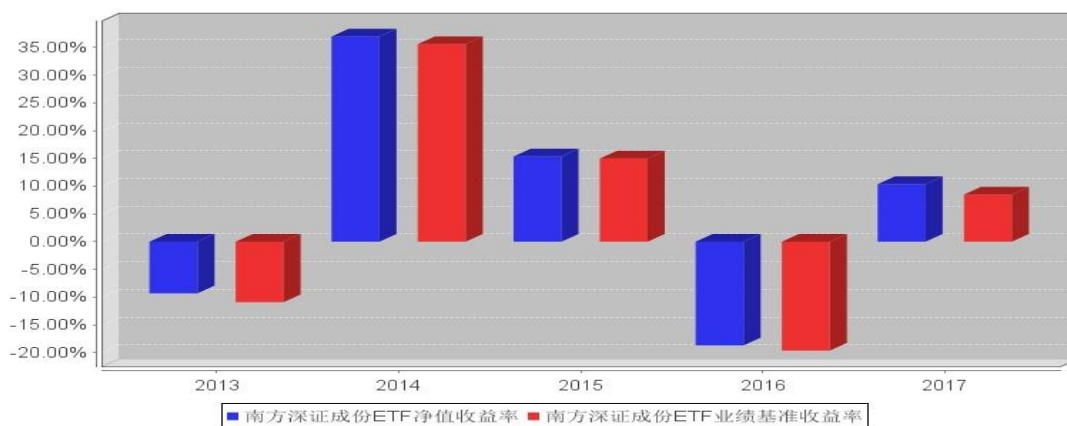
南方深证成份ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金合同中关于基金投资比例的约定，本基金将全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现，正常情况下，本基金的指数化投资比例不低于基金资产净值的 95%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方深证成份ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司，注册资本金 3 亿元人民币。目前股权结构：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% 及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，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超 7,200 亿元，旗下管理 153 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、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《深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

深证成指本报告期上涨 8.48%。

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、ETF 现金流精算系统等，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 ETF 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）大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- （2）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偏离；
- （3）根据指数半年度成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期跟踪误差和正偏离分别为 0.25% 和 1.9%，理想地完成了投资目标。积极参与网下新股申购对基金超越业绩基准收益贡献明显。

截至报告期末，本基金份额净值为 1.1977 元，报告期内，份额净值增长率为 10.38%，同期业绩基准增长率为 8.48%。

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

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年，宏观层面，预计经济增长仍将保持良好韧性，在人民币对美元汇率持续走强、通胀较为温和的大背景下，利率上行空间不大，对权益市场的边际负面影响亦较为有限。市场层面，在市场成熟度提升趋势下，预计基本面优秀和估值具有安全边际的公司将继续受到投资者青睐；但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 月高点至本报告期末，指数估值已跌去一半以上，市盈率已处于扩容后的历史低位。展望 2018 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。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。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：当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。基金管理人对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益分配每年最多 12 次，每次基金收益分配比例不低于基金收益分配基准日可供分配利润的 5%。基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；本基金收益分配采取现金分红方式；《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；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，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.9 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，本基金托管人在对深证成份交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，深证成份交易型开放式指数证券投资基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在深证成份交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、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，深证成份交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2017 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本基金 2017 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2018)第 22812 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	561,384.51	2,147,311.06
结算备付金	11,643.54	27,406.12
存出保证金	2,607.93	2,033.39
交易性金融资产	454,182,128.03	494,995,095.82
其中：股票投资	453,742,328.03	494,995,095.82
基金投资	-	-
债券投资	439,800.00	-
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	-	-
应收证券清算款	-	-

应收利息	136.89	352.85
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	454,757,900.90	497,172,199.24
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017年12月31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	-	320,757.72
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	192,179.60	213,273.78
应付托管费	38,435.93	42,654.75
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	457.25	35,005.30
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	404,000.00	484,672.78
负债合计	635,072.78	1,096,364.33
所有者权益:		
实收基金	513,855,468.07	619,566,268.78
未分配利润	-59,732,639.95	-123,490,433.87
所有者权益合计	454,122,828.12	496,075,834.91
负债和所有者权益总计	454,757,900.90	497,172,199.24

注:报告截止日 2017 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.1977 元, 基金份额总额 379,154,507.00 份。

7.2 利润表

会计主体: 深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年 12月31日	2016年1月1日至2016年 12月31日
一、收入	52,203,709.19	-110,125,376.67
1.利息收入	11,355.39	28,733.44
其中: 存款利息收入	11,149.71	28,436.02
债券利息收入	97.73	72.42

资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	107.95	225.00
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-13,903,099.81	-51,781,686.02
其中：股票投资收益	-19,173,633.39	-57,375,722.54
基金投资收益	-	-
债券投资收益	9,880.68	25,566.59
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	5,260,652.90	5,568,469.93
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	66,092,993.23	-58,281,950.63
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	2,460.38	-90,473.46
减：二、费用	3,557,973.14	3,971,712.97
1. 管理人报酬	2,397,311.14	2,629,978.52
2. 托管费	479,462.18	525,995.64
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	66,733.82	175,746.65
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	614,466.00	639,992.16
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	48,645,736.05	-114,097,089.64
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	48,645,736.05	-114,097,089.64

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：深证成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	619,566,268.78	-123,490,433.87	496,075,834.91

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	48,645,736.05	48,645,736.05
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)	-105,710,800.71	15,112,057.87	-90,598,742.84
其中：1.基金申购款	12,197,400.07	-2,009,999.03	10,187,401.04
2.基金赎回款	-117,908,200.78	17,122,056.90	-100,786,143.88
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)	513,855,468.07	-59,732,639.95	454,122,828.12
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	635,829,468.86	-9,640,125.50	626,189,343.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-114,097,089.64	-114,097,089.64
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)	-16,263,200.08	246,781.27	-16,016,418.81
其中：1.基金申购款	130,105,600.85	-27,179,038.26	102,926,562.59
2.基金赎回款	-146,368,800.93	27,425,819.53	-118,942,981.40
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权	619,566,268.78	-123,490,433.87	496,075,834.91

益（基金净值）			
---------	--	--	--

注:-

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>杨小松</u>	<u>徐超</u>	<u>徐超</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

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

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.2 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。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司
南方深证成份 ETF 联接基金	本基金的基金管理人管理的其他基金

注:1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》，公司名称由“南方基金管理有限公司”变更为“南方基金管理股份有限公司”，公司股权结构等事项未发生变化，并已于 2018 年 1 月 4 日在深圳市市场监督管理局完成相应变更登记手续。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华泰证券	96,987,936.49	100.00	87,707,375.71	33.79

7.4.4.1.2 权证交易

注:无。

7.4.4.1.3 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12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
华泰证券	9,658.82	100.00	457.25	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日 至 2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
华泰证券	8,769.47	33.79	8,769.47	25.05

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

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

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,397,311.14
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注: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 0.50% 的年费率计提，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 X 0.50% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	479,462.18	525,995.64

注: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 0.10% 的年费率计提, 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 X 0.10% / 当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:无。

7.4.4.4.2 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

关联方名称	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
南方深证成份 ETF联接基金	237,321,432.00	62.59	273,321,432.00	59.79

注:南方深证成份 ETF 联接基金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。

7.4.4.5 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	561,384.51	9,747.05	2,147,311.06	26,147.46

注:本基金由基金托管人中国工商银行保管的银行存款, 按银行约定利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 利润分配情况

注:无。

7.4.6 期末(2017年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002466	天齐锂业	2017-12-26	2018-01-03	新股未上市	11.06	53.21	6,507	71,967.42	346,237.47	-
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
128024	宁行转债	2017-12-05	2018-01-12	新债未上市	100.00	100.00	3,075	307,500.00	307,500.00	-
128028	赣锋转债	2017-12-21	2018-01-19	新债未上市	100.00	100.00	437	43,700.00	43,700.00	-
123004	铁汉转债	2017-12-18	2018-01-26	新债未上市	100.00	100.00	433	43,300.00	43,300.00	-
128029	太阳转债	2017-12-22	2018-01-16	新债未上市	100.00	100.00	383	38,300.00	38,300.00	-
128027	崇达转债	2017-12-15	2018-01-22	新债未上市	100.00	100.00	70	7,000.00	7,000.00	-

7.4.6.2 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
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

300104	乐视网	2017-04-17	重大资产重组	15.33	2018-1-24	13.8	165,286	4,144,334.29	2,533,834.38	-
002739	万达电影	2017-07-04	重大资产重组	52.04		-	31,100	2,636,911.29	1,618,444.00	-
000540	中天金融	2017-08-21	重大资产重组	7.35		-	188,400	1,876,431.39	1,384,740.00	-
300156	神雾环保	2017-07-17	重大资产重组	24.16	2018-1-17	21.74	38,883	638,880.34	939,413.28	-
002470	金正大	2017-10-25	重大事项	9.15	2018-2-9	8.24	99,900	1,002,289.79	914,085.00	-
002366	台海核电	2017-12-06	重大资产重组	26.45		-	34,460	1,019,189.36	911,467.00	-
300383	光环新网	2017-11-07	拟披露重大事项	13.19	2018-3-19	14.51	63,600	1,119,190.23	838,884.00	-
000930	中粮生化	2017-10-24	重大资产重组	13.34		-	60,100	969,966.76	801,734.00	-
002075	沙钢股份	2016-09-19	重大资产重组	16.12		-	46,900	472,910.27	756,028.00	-
002168	深圳惠程	2017-12-19	拟披露重大事项	13.76		-	54,000	707,655.48	743,040.00	-
000566	海南海药	2017-11-22	重大资产重组	12.89		-	57,034	938,109.69	735,168.26	-
000547	航天发展	2017-10-30	重大事项	10.83		-	67,000	1,351,782.24	725,610.00	-
000006	深振业A	2017-09-11	重大资产重组	9.85	2018-3-8	8.87	66,200	777,531.08	652,070.00	-
300159	新研股份	2017-11-23	重大资产重组	10.40	2018-3-22	9.36	61,000	923,811.37	634,400.00	-
000592	平潭发展	2017-08-09	重大资产重组	5.75	2018-1-29	5.7	102,600	1,128,789.64	589,950.00	-
002004	华邦健康	2017-12-14	重大事项	6.73	2018-3-14	7.3	87,600	1,157,134.99	589,548.00	-
000926	福星股份	2017-12-26	重大事项	10.89	2018-1-10	11.98	53,900	687,763.16	586,971.00	-
000031	中粮地产	2017-07-24	重大资产重组	8.00		-	72,941	997,997.50	583,528.00	-
000939	凯迪生态	2017-11-16	重大资产重组	4.99		-	114,800	824,299.91	572,852.00	-
000979	中弘股份	2017-09-07	重大资产重组	1.94	2018-2-14	1.75	292,716	859,697.03	567,869.04	-
300090	盛运环	2017-12	重大资	9.24		-	57,208	635,269.28	528,601.92	-

	保	-01	产重组								
002512	达华智能	2017-12-06	拟披露重大事项	18.07	2018-3-6	16.26	27,600	498,178.40	498,732.00	-	
000806	银河生物	2017-07-18	重大资产重组	10.76	2018-1-18	10.01	43,300	1,018,085.78	465,908.00	-	
300134	大富科技	2017-12-18	拟披露重大事项	16.45	2018-3-19	14.81	27,169	814,738.51	446,930.05	-	
000034	神州数码	2017-09-29	重大资产重组	21.60		-	20,385	452,757.75	440,316.00	-	
000156	华数传媒	2017-12-26	重大事项	11.40		-	33,500	957,271.87	381,900.00	-	
000766	通化金马	2017-11-24	重大资产重组	13.60		-	27,871	490,135.91	379,045.60	-	
002130	沃尔核材	2017-12-25	重大事项	5.76	2018-1-10	6.15	64,800	660,656.52	373,248.00	-	
300010	立思辰	2017-11-17	拟披露重大事项	11.17	2018-2-22	10.05	30,400	776,317.80	339,568.00	-	
000693	*ST 华泽	2016-03-01	重大事项	12.50	2018-3-21	11.88	25,500	466,489.64	318,750.00	-	
002358	森源电气	2017-12-07	重大资产重组	14.86	2018-3-7	15.05	20,100	408,114.34	298,686.00	-	
300116	坚瑞沃能	2017-12-18	重大资产重组	7.62		-	38,900	353,410.67	296,418.00	-	
300216	千山药机	2017-12-25	重大事项	15.95	2018-1-18	14.36	17,800	834,594.00	283,910.00	-	
000615	京汉股份	2017-12-26	重大事项	9.76	2018-1-10	10.74	26,500	370,984.56	258,640.00	-	
002625	光启技术	2017-12-20	重大事项	28.07	2018-1-4	30.88	9,200	426,966.71	258,244.00	-	
300292	吴通控股	2017-12-04	重大资产重组	5.67	2018-3-5	5.72	41,600	358,473.44	235,872.00	-	
300364	中文在线	2017-12-28	拟披露重大事项	9.23	2018-1-5	10	25,264	522,184.11	233,186.72	-	
000564	供销大集	2017-11-28	重大资产重组	4.78		-	32,800	213,466.22	156,784.00	-	
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项	41.55	2018-1-2	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-	
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项	35.26	2018-1-2	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-	

注:本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌
的股票, 该类股票将在所公布事项的重大影响消除后, 经交易所批准复牌。

7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注:无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	453,742,328.03	99.78
	其中: 股票	453,742,328.03	99.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	439,800.00	0.10
	其中: 债券	439,800.00	0.10
	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	573,028.05	0.13
8	其他各项资产	2,744.82	0.00
9	合计	454,757,900.90	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值, 而 5.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资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	10,928,613.50	2.41
B	采矿业	4,428,256.80	0.98
C	制造业	282,533,803.88	62.22
D	电力、热力、燃气 及水生产和供应业	6,321,611.20	1.39
E	建筑业	8,630,576.96	1.90
F	批发和零售业	11,543,533.33	2.54
G	交通运输、仓储和 邮政业	2,656,154.22	0.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和 信息技术服务业	45,115,530.87	9.93
J	金融业	29,121,303.29	6.41
K	房地产业	23,794,895.97	5.24

L	租赁和商务服务业	6,675,982.46	1.47
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,825,503.17	1.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,093,048.92	0.90
R	文化、体育和娱乐业	7,904,993.94	1.74
S	综合	1,197,952.72	0.26
	合计	452,771,761.23	99.70

8.2.2 报告期末积极投资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	318,750.00	0.07
C	制造业	617,704.25	0.14
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.01
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	970,566.80	0.21

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 期末指数投资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	000333	美的集团	296,807	16,452,012.01	3.62
2	000651	格力电器	322,140	14,077,518.00	3.10
3	000858	五粮液	125,141	9,996,263.08	2.20
4	000725	京东方A	1,713,842	9,923,145.18	2.18
5	000002	万科A	274,858	8,537,089.48	1.88
6	002415	海康威视	216,781	8,454,459.00	1.86
7	000001	平安银行	571,212	7,597,119.60	1.67
8	300498	温氏股份	257,124	6,145,263.60	1.35
9	000063	中兴通讯	161,633	5,876,975.88	1.29
10	002304	洋河股份	37,961	4,365,515.00	0.96

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。

8.3.2 期末积极投资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	000693	*ST 华泽	25,500	318,750.00	0.07
2	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.06
3	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.04
4	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.01
5	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.01
6	300730	科创信息	821	34,112.55	0.01
7	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.01
8	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.00
9	002923	润都股份	954	16,227.54	0.00
10	300684	中石科技	827	11,528.38	0.00

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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002558	巨人网络	1,377,519.13	0.28
2	002797	第一创业	1,225,905.00	0.25
3	002027	分众传媒	990,134.30	0.20
4	300145	中金环境	807,573.52	0.16
5	000418	小天鹅 A	791,653.00	0.16
6	002127	南极电商	735,541.00	0.15
7	002354	天神娱乐	711,779.24	0.14
8	000933	神火股份	696,962.82	0.14
9	002408	齐翔腾达	689,957.00	0.14
10	300450	先导智能	675,437.00	0.14
11	000877	天山股份	659,995.00	0.13
12	002601	龙鳞佰利	659,476.00	0.13
13	002280	联络互动	628,088.00	0.13
14	002389	南洋科技	622,650.00	0.13
15	002352	顺丰控股	617,864.00	0.12
16	002506	协鑫集成	589,141.00	0.12
17	002434	万里扬	582,150.00	0.12
18	002608	江苏国信	573,151.00	0.12
19	002302	西部建设	562,988.00	0.11
20	002252	上海莱士	544,033.99	0.11

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	960,868.00	0.19
2	000651	格力电器	764,333.00	0.15
3	000002	万科 A	529,413.00	0.11
4	000566	海南海药	505,355.00	0.10
5	002024	苏宁易购	470,910.00	0.09
6	300012	华测检测	448,595.00	0.09
7	002121	科陆电子	443,815.50	0.09
8	002463	沪电股份	442,012.00	0.09
9	000725	京东方 A	439,986.00	0.09
10	002031	巨轮智能	438,651.00	0.09
11	300096	易联众	438,010.00	0.09
12	002663	普邦股份	435,305.00	0.09
13	000733	振华科技	430,347.00	0.09
14	000650	仁和药业	429,943.27	0.09

15	300238	冠昊生物	427,236.00	0.09
16	002156	通富微电	418,809.00	0.08
17	300005	探路者	408,240.00	0.08
18	002071	长城影视	405,314.00	0.08
19	300147	香雪制药	401,817.60	0.08
20	002005	德豪润达	401,063.00	0.08

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	51,824,917.05
卖出股票收入(成交)总额	49,724,780.68

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	439,800.00	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	439,800.00	0.10

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128024	宁行转债	3,075	307,500.00	0.07
2	128028	赣锋转债	437	43,700.00	0.01
3	123004	铁汉转债	433	43,300.00	0.01
4	128029	太阳转债	383	38,300.00	0.01
5	128027	崇达转债	70	7,000.00	0.00

8.7 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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1**

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

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	2,607.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	136.89
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,744.82

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1、期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

2、期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
5,380	70,474.82	241,752,622.00	63.76	137,401,885.00	36.24

注: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。

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
中国工商银行股份有限公司—南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	237,321,432.00	62.59

注：9.1.1 机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行—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“持有份额”和“占总份额比例”数据。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	刘素坚	1,845,018.00	0.49
2	耿力扬	1,500,000.00	0.40
3	邬海滨	1,475,867.00	0.39
4	凌燕	1,475,778.00	0.39
5	杨悦文	1,418,265.00	0.37
6	高宝泉	1,378,600.00	0.36
7	刘春霞	1,344,657.00	0.35
8	王勇	1,200,000.00	0.32
9	章斌	1,151,301.00	0.30
10	屠文斌	1,129,300.00	0.30
	中国工商银行股份有限公司—南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金	237,321,432.00	62.59

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注:本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年12月4日）基金份额总额	4,127,538,537.00
本报告期期初基金份额总额	457,154,507.00
本报告期基金总申购份额	9,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	87,000,000.00
本报告期期末基金份额总额	379,154,507.00

§ 11 重大事件揭示**11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2017年1月23日南方基金管理有限公司第七届董事会第二次会议，审议通过秦长奎因任期届满，工作调整的原因不再担任公司副总经理职务。

2017年12月8日南方基金管理股份有限公司（筹）第一届董事会第一次会议，审议通过聘任史博担任公司副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 54,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 7 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	3	96,987,936.49	100.00%	9,658.82	100.00%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	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。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
本基金联接基金	1	20170101-20171231	273,321,432.00	3,000,000.00	39,000,000.00	237,321,432.00	62.59
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。