深证成份交易型开放式指数证券投资基金 2016年年度报告摘要

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2017年3月30日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本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2016年1月1日起至2016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	深成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	457,154,507.00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相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近的风险收益特征。

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	鞠文革	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

2.4 信息披露方式

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	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	-55,815,139.01	934,216,855.43	-37,319,349.33
本期利润	-114,097,089.64	442,160,825.53	585,708,008.88
加权平均基金份额本期利润	-0.2397	0.5086	0.2872
本期基金份额净值增长率	-18.70%	15.36%	36.99%
3.1.2?期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2701	-0.0205	-0.3621
期末基金资产净值	496,075,834.91	626,189,343.36	1,840,641,926.17
期末基金份额净值	1.0851	1.3347	1.1570

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)。

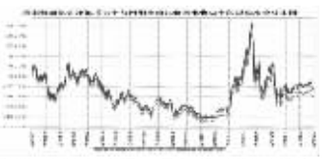
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

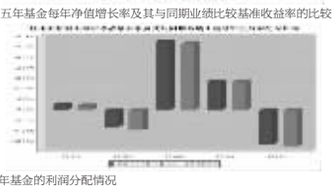
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.62%	0.85%	-3.69%	0.85%	0.07%	0.00%
过去六个月	-2.91%	0.93%	-2.98%	0.93%	0.07%	0.00%
过去一年	-18.70%	1.76%	-19.64%	1.80%	0.94%	-0.04%
过去三年	28.48%	1.95%	25.31%	1.99%	3.17%	-0.04%
过去五年	19.73%	1.76%	14.11%	1.79%	5.62%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-19.93%	1.70%	-26.70%	1.73%	6.77%	-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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

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。

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

截至报告期末,南方基金管理有限公司(不含子公司)管理资产规模近6,500亿元,旗下管理116只开放式基金,多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柯晓	本基金基金经理	2013年4月22日	2016年11月25日	19年	美国纽约大学工商管理硕士,具有基金从业资格。曾先后担任美国美林证券公司助理副总裁、招商证券首席产品策略师。2006年加入南方基金,现任资产配置部副总监、FOF投资决策委员会委员兼秘书;2010年8月至2016年11月,任小康ETF及南方小康基金经理;2013年4月至2016年11月,任南方深成及南方深成ETF的基金经理;2013年5月至2016年11月,任南方上证380ETF及联接基金的基金经理;2015年7月至2016年11月,任南方互联基金的基金经理。
孙伟	本基金基金经理	2016年8月19日	-	6年	管理学学士,具有基金从业资格、金融分析师(CFA)资格、注册会计师(CPA)资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010年2月加入南方基金,历任量化策略部基金会计、数量化投资部量化投资研究员;2014年12月至2015年5月,担任南方恒生ETF的基金经理助理;2015年5月至2016年7月,任南方500工业ETF、南方500原材料ETF基金经理;2015年7月至今,任改革基金、高铁基金、500信息基金经理;2016年5月至今,任南方创业板ETF、南方创业板ETF联接基金经理;2016年8月至今,任500信息联接、深成ETF、南方深成基金经理。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析,对本报告期内,两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次,是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致,相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”、“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

本基金本年度跟踪误差和正偏离分别为0.69%和0.94%,理想地完成了投资目标。

截至报告期末,本基金份额净值为1.0851元,报告期内,份额净值增长率为-18.70%,同期业绩基准增长率为-19.64%。

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

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内,本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展情况,不断推动完善相关制度流程的建立、健全,及时贯彻落实新的监管要求,并开展了互联网金融相关业务风险自查、信息技术专项自查等多项内控自查工作,进一步完善了公司的内控体系;对公司投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务开展了定期或专项稽核,检查业务开展的合规性和制度执行的有效性,推动公司合规、内控体系的健全完善;采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作,加强对日常投资运作的管理和监控,持续完善投资合规风控制度流程和系统,积极配合各类新产品、新业务,重点加强内幕交易防控以及对高风险品种和业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实,有效确保投研交易业务的合规开展;针对新出台的法律法规和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,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2016年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本基金2016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(2017)第21503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:2016年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产:		
银行存款	2,147,311.06	11,558,730.82
结算备付金	27,406.12	65,058.20
存出保证金	2,033.39	89,389.80
交易性金融资产	494,995,095.82	624,978,907.28
其中:股票投资	494,995,095.82	624,978,907.28
基金投资	-	-
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	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	352.85	2,399.97
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	497,172,199.24	636,694,486.07
负债和所有者权益	**本期末 2016年12月31日**	**上年度末 2015年12月31日**
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	320,767.72	9,927,903.35
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	213,273.78	272,948.92
应付托管费	42,654.75	54,589.77
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	35,005.30	9,051.96
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	484,672.78	240,648.71
负债合计	1,096,364.33	10,505,142.71
所有者权益:		
实收基金	619,566,288.78	635,829,468.86
未分配利润	-123,490,433.87	-9,640,125.50
所有者权益合计	496,075,834.91	626,189,343.36
负债和所有者权益总计	497,172,199.24	636,694,486.07

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.0851元,基金份额总额457,154,507.00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:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一.收入	-110,125,376.67	451,801,123.34
1.利息收入	28,733.44	122,845.89
其中:存款利息收入	28,436.02	122,845.89
债券利息收入	72.42	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	225.00	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-51,781,686.02	941,524,073.40
其中:股票投资收益	-57,375,722.54	932,945,506.96
基金投资收益	-	-
债券投资收益	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	5,568,469.93	8,578,566.44
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-58,281,950.63	-492,056,029.90
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-90,473.46	2,210,233.95
减:二.费用	3,971,712.97	9,640,297.81
1. 管理人报酬	2,629,978.52	5,774,059.84
2. 托管费	525,995.64	1,154,812.01
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	175,746.65	1,913,386.39
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	639,992.16	798,039.57
三.利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-114,097,089.64	442,160,825.53
减:所得税费用	-	-
四.净利润(净亏损以“-”号填列)	-114,097,089.64	442,160,825.53

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:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	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.期末所有者权益(基金净值)	619,566,268.78	-123,490,433.87	496,075,834.91

项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	2,156,032,099.57	-315,390,173.40	1,840,641,926.17
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	442,160,825.53	442,160,825.53
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)	-1,520,202,630.71	-136,410,777.63	-1,656,613,408.34
其中:1.基金申购款	3,033,899,980.41	160,441,746.43	3,194,341,726.84
2.基金赎回款	-4,554,102,611.12	-296,852,524.06	-4,850,955,135.18
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)	635,829,468.86	-9,640,125.50	626,189,343.36

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.3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

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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的转让收入免征增值税。

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

(3)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
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、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
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司
南方深证成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“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

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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	87,707,375.71	33.79%	2,374,986.00	0.09%

7.4.4.1.2 权证交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 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%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	2,101.62	0.55%	-	-

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,629,978.52	5,774,059.84
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0.5%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 0.5% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	525,995.64	1,154,812.01

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0.1%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 0.1% / 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:本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 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:本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015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	273,321,432.00	59.7900%	276,321,432.00	58.9000%

注:南方深证成份ETF联接基金和华泰证券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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,147,311.06	26,147.46	11,558,730.82	98,950.55

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 利润分配情况

注:本基金本报告期内无利润分配。

7.4.6 期末(2016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
300683	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股未上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
002340	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002338	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股未上市	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
300686	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股未上市	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股未上市	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。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
000166	申万宏源	2016年12月21日	重大事项	6.25	2017年1月26日	6.29	566,869	5,046,901.87	3,542,931.25	-
300104	乐视网	2016年12月7日	重大事项	35.80	2017年1月16日	36.88	94,893	4,858,439.10	3,397,169.40	-
000540	中天城投	2016年11月28日	重大事项	6.93	2017年1月3日	7.00	244,600	2,463,081.02	1,695,078.00	-
000887	中鼎股份	2016年11月18日	重大事项	25.94	2017年2月15日	23.99	54,500	1,517,244.20	1,413,730.00	-
000750	国海证券	2016年12月15日	重大事项	6.97	2017年1月20日	6.27	196,150	1,896,286.46	1,367,165.50	-
300008	长信科技	2016年9月12日	重大事项	15.80	-	-	85,402	1,117,802.04	1,349,351.60	-
000748	长城信息	2016年11月1日	重大事项	20.31	-	-	62,400	1,859,618.96	1,267,344.00	注1
002400	省广股份	2016年11月28日	重大事项	13.79	-	-	85,720	1,646,083.31	1,182,078.80	-
000516	国际医学	2016年12月5日	重大事项	7.90	-	-	136,700	1,216,540.71	1,079,930.00	-
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事项	8.27	-	-	129,420	2,280,813.30	1,070,303.40	-
002075	沙钢股份	2016年9月19日	重大事项	16.12	-	-	65,800	654,139.91	1,060,696.00	-
000547	航天发展	2016年4月19日	重大事项	15.36	2017年1月3日	16.90	64,900	1,378,192.55	996,864.00	-
000050	深天马A	2016年9月12日	重大事项	18.82	2017年3月23日	20.70	52,900	1,116,591.87	995,578.00	-
000697	炼石有色	2016年11月17日	重大事项	23.51	-	-	38,100	748,388.66	895,731.00	-
002491	通鼎互联	2016年12月22日	重大事项	15.54	2017年1月3日	15.89	51,600	942,226.26	801,864.00	-
000727	华东科技	2016年11月17日	重大事项	3.37	2017年2月15日	3.47	237,400	841,824.39	800,038.00	-
002602	世纪华通	2016年12月15日	重大事项	46.89	2017年1月9日	50.00	16,500	318,719.70	773,685.00	-
300271	华宇软件	2016年12月19日	重大事项	17.45	-	-	42,040	964,208.16	733,598.00	-
300367	东方网力	2016年12月15日	重大事项	20.04	-	-	36,600	973,372.64	733,464.00	-
000563	陕国投A	2016年10月14日	重大事项	7.48	2017年1月18日	6.73	91,000	595,125.70	680,680.00	-
002440	闰土股份	2016年10月21日	重大事项	16.34	2017年1月12日	15.22	38,604	761,738.20	630,789.36	-
000829	天音控股	2016年9月29日	重大事项	11.28	-	-	55,100	875,723.20