**南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金(原开元证券投资基金转型)**

**2013年半年度报告**

**2013年6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：2013年8月27日**

1. 重要提示及目录
   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2013年8月20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。

开元证券投资基金份额持有人大会于2013年1月4日审议通过了《关于开元证券投资基金转型有关事项的议案》，同意将开元证券投资基金变更为南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金。基金管理人已收到中国证券监督管理委员会《关于核准开元证券投资基金基金份额持有人大会有关转型基金运作方式决议的批复》（证监许可 [2013] 61号），《南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》已于2013年2月18日生效。

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。

原开元证券投资基金本报告期自2013年1月1日起至2月17日止，南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金本报告期自2013年2月18日（基金合同生效日）起至6月30日止。

## 1.2 目录

[§1 重要提示及目录 2](#_Toc365029480)

[1.1 重要提示 2](#_Toc365029481)

[1.2 目录 3](#_Toc365029482)

[§2 基金简介 5](#_Toc365029483)

[2.1 基金基本情况（转型前） 5](#_Toc365029484)

[2.1 基金基本情况（转型后） 5](#_Toc365029485)

[2.2 基金产品说明（转型前） 5](#_Toc365029486)

[2.2 基金产品说明（转型后） 5](#_Toc365029487)

[2.3 基金管理人和基金托管人 6](#_Toc365029488)

[2.4 信息披露方式 6](#_Toc365029489)

[2.5 其他相关资料 7](#_Toc365029490)

[§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 7](#_Toc365029491)

[3.1 主要会计数据和财务指标 7](#_Toc365029492)

[3.2 基金净值表现（转型前） 8](#_Toc365029493)

[3.2 基金净值表现（转型后） 9](#_Toc365029494)

[§4 管理人报告 10](#_Toc365029495)

[4.1 基金管理人及基金经理情况 10](#_Toc365029496)

[4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12](#_Toc365029497)

[4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12](#_Toc365029498)

[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 13](#_Toc365029499)

[4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13](#_Toc365029500)

[4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14](#_Toc365029501)

[4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14](#_Toc365029502)

[§5 托管人报告 15](#_Toc365029503)

[5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15](#_Toc365029504)

[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 15](#_Toc365029505)

[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 15](#_Toc365029506)

[§6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型前) 16](#_Toc365029507)

[6.1 资产负债表(转型前) 16](#_Toc365029508)

[6.2 利润表 17](#_Toc365029509)

[6.3 所有者权益（基金净值）变动表 18](#_Toc365029510)

[6.4 报表附注 19](#_Toc365029511)

[§6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型后) 33](#_Toc365029512)

[6.1 资产负债表（转型后） 33](#_Toc365029513)

[6.2 利润表 34](#_Toc365029514)

[6.3 所有者权益（基金净值）变动表 35](#_Toc365029515)

[6.4 报表附注 36](#_Toc365029516)

[§7 投资组合报告(转型前) 55](#_Toc365029517)

[7.1 期末基金资产组合情况 55](#_Toc365029518)

[7.2 期末按行业分类的股票投资组合 56](#_Toc365029519)

[7.3 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 56](#_Toc365029520)

[7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 64](#_Toc365029521)

[7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 66](#_Toc365029522)

[7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 66](#_Toc365029523)

[7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 66](#_Toc365029524)

[7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 66](#_Toc365029525)

[7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 66](#_Toc365029526)

[7.10 投资组合报告附注 66](#_Toc365029527)

[§7 投资组合报告(转型后) 67](#_Toc365029528)

[7.1 期末基金资产组合情况 67](#_Toc365029529)

[7.2 期末按行业分类的股票投资组合 68](#_Toc365029530)

[7.3 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(转型后) 68](#_Toc365029531)

[7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 76](#_Toc365029532)

[7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 78](#_Toc365029533)

[7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 78](#_Toc365029534)

[7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 78](#_Toc365029535)

[7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 78](#_Toc365029536)

[7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 78](#_Toc365029537)

[7.10 投资组合报告附注 79](#_Toc365029538)

[§8 基金份额持有人信息(转型前) 79](#_Toc365029539)

[8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 79](#_Toc365029540)

[8.2 期末上市基金前十名持有人 80](#_Toc365029541)

[8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 80](#_Toc365029542)

[§8 基金份额持有人信息(转型后) 80](#_Toc365029543)

[8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 80](#_Toc365029544)

[8.2 期末上市基金前十名持有人 81](#_Toc365029545)

[8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 81](#_Toc365029546)

[§9 开放式基金份额变动 81](#_Toc365029547)

[§10 重大事件揭示 82](#_Toc365029548)

[10.1 基金份额持有人大会决议 82](#_Toc365029549)

[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 82](#_Toc365029550)

[10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 82](#_Toc365029551)

[10.4 基金投资策略的改变 82](#_Toc365029552)

[10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 82](#_Toc365029553)

[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 82](#_Toc365029554)

[10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后) 83](#_Toc365029555)

[10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前) 85](#_Toc365029556)

[10.8 其他重大事件（转型后） 86](#_Toc365029557)

[10.8 其他重大事件（转型前） 87](#_Toc365029558)

[§11 备查文件目录 88](#_Toc365029559)

[11.1 备查文件目录 88](#_Toc365029560)

[11.2 存放地点 88](#_Toc365029561)

[11.3 查阅方式 88](#_Toc365029562)

1. 基金简介
   1. 基金基本情况（转型前）

|  |  |
| --- | --- |
| 基金名称 | 开元证券投资基金 |
| 基金简称 | 南方开元封闭 |
| 基金主代码 | 184688 |
| 基金运作方式 | 契约型封闭式 |
| 基金合同生效日 | 1998年3月27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 | 2,000,000,000.00份 |
| 基金合同存续期 | 15年 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 1998年4月7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“基金开元”。

* 1. 基金基本情况（转型后）

|  |  |
| --- | --- |
| 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 |
| 基金简称 | 南方开元沪深300ETF |
| 基金主代码 | 159925 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式(ETF) |
| 基金合同生效日 | 2013年2月18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 | 2,313,199,451.00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 | 2013年4月11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“南方300”。

* 1. 基金产品说明（转型前）

|  |  |
| --- | --- |
| 投资目标 | 本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。 |
| 投资策略 | 本基金坚持投资于经济增长中的领先行业，以及行业内相对价值较高的股票，并根据不同股票相对价值的变化动态调整组合，力求使基金净值平稳、持续增长。 |

* 1. 基金产品说明（转型后）

|  |  |
| --- | --- |
| 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。 |

* 1. 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 | 赵会军 |
| 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 | | 深圳市福田中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层 | 北京市西城区复兴门内大街55号 |
| 办公地址 | | 深圳市福田中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层 | 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 | | 吴万善 | 姜建清 |

* 1. 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 |

* 1. 其他相关资料

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 名称 | 办公地址 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京西城区太平桥大街17号 |

1. 主要财务指标和基金净值表现
   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(2013年1月1日- 2013年6月30日) | |
| 转型前 | 转型后 |
| 本期已实现收益 | -269,163,704.51 | -151,505,589.24 |
| 本期利润 | 104,699,245.78 | -439,513,879.42 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0523 | -0.1841 |
| 本期加权平均净值利润率 | 5.90% | -19.60% |
| 本期基金份额净值增长率 | 5.98% | -19.68% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末( 2013年6月30日 ) | |
| 期末可供分配利润 | -250,130,485.88 | -674,090,881.64 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1251 | -0.2914 |
| 期末基金资产净值 | 1,853,841,542.50 | 1,964,360,207.82 |
| 期末基金份额净值 | 0.9269 | 0.8492 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末( 2013年6月30日 ) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 523.87% | -19.68% |

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。

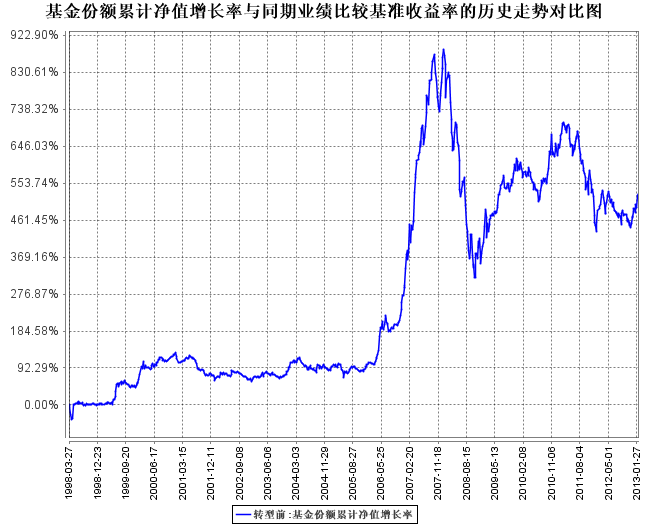
3.期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4. 本基金已于2013年3月11日对原开元证券投资基金退市时的基金份额进行了折算，基金折算比例为1:0.876726296。

* 1. 基金净值表现（转型前）
     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

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 转型前 | | | | | | |
| 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 |
| 过去一个月 | 8.09% | 2.41% | - | - | - | - |
| 过去三个月 | 14.36% | 2.01% | - | - | - | - |
| 过去六个月 | 9.58% | 2.19% | - | - | - | - |
| 过去一年 | 4.18% | 2.07% | - | - | - | - |
| 过去三年 | -7.96% | 2.37% | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 523.87% | 3.51% | - | - | - | - |

* + 1. 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

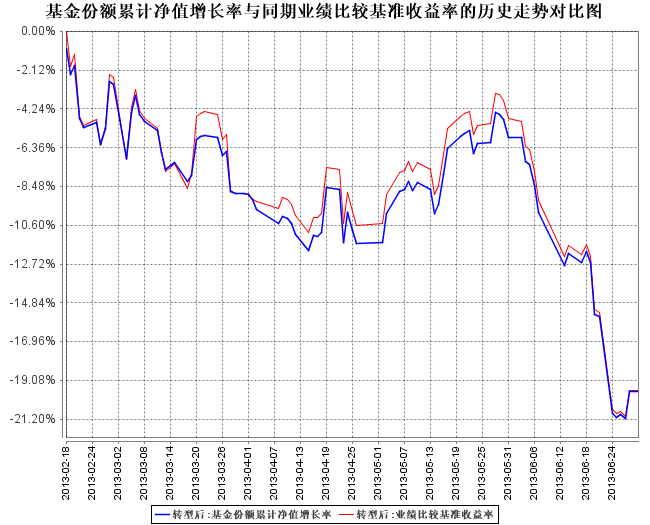


注：本基金建仓期为三个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

* 1. 基金净值表现（转型后）
     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

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 转型后 | | | | | | |
| 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 |
| 过去一个月 | -14.73% | 1.86% | -15.57% | 1.86% | 0.84% | 0.00% |
| 过去三个月 | -11.86% | 1.44% | -11.80% | 1.45% | -0.06% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -19.68% | 1.43% | -19.61% | 1.54% | -0.07% | -0.11% |

* + 1. 自基金转型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



注：1、本基金转型日期为2013年2月18日，截止报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一年。

2、本基金合同中关于基金投资比例的约定：在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为3个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

1. 管理人报告
   1. 基金管理人及基金经理情况
      1. 基金管理人及其管理基金的经验

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[1998]4号文批准，由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000年，经中国证监会证监基金字[2000]78号文批准进行了增资扩股，注册资本达到1亿元人民币。2005年，经中国证监会证监基金字[2005]201号文批准进行增资扩股，注册资本达1.5亿元人民币。2010年，经证监许可[2010]1073号文核准深圳市机场（集团）有限公司将其持有的30%股权转让给深圳市投资控股有限公司。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%。公司在北京、上海、合肥等地设有分公司，在香港设有子公司--南方东英资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理资产规模超过2,000亿元，旗下管理42只开放式基金，1只封闭式基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

* + 1. 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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 |
| 汪澂 | 本基金基金经理、公司投资部副总监 | 2006年3月16日 | 2013年2月17日 | 13 | 女，注册金融分析师（CFA），工商管理硕士，具有基金从业资格。1999年加入南方基金，先后担任研究员、基金经理助理、投资部副总监，2002年4月-2006年3月，任隆元基金经理；2005年8月-2006年3月，任金元基金经理；2006年3月至2013年2月，任开元基金经理；2008年4月至今，任隆元基金经理。 |

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。

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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 |
| 潘海宁 | 本基金的基金经理、数量化投资部副总监 | 2013年2月18日 | 2013年4月21日 | 12 | 会计学学士，具有基金从业资格。曾先后任职于兴业证券股份有限公司、富国基金管理有限公司。2003年3月加入南方基金，历任行业研究员、基金开元基金经理助理、投资部总监助理、数量化投资部副总监等职务。2009年3月至2013年4月，任南方300指数基金经理；2009年12月至2013年4月，任南方深成ETF及联接基金基金经理；2011年2月至2013年4月，任南方500基金经理；2013年2月至2013年4月，任南方500ETF基金经理；2013年2月至2013年4月，任南方开元沪深300ETF基金经理。 |
| 杨德龙 | 本基金基金经理 | 2013年4月22日 | - | 6 | 北京大学经济学硕士、清华大学工学学士，具有基金从业资格。2006年加入南方基金，担任研究部高级行业研究员、首席策略分析师；2010年8月至2013年4月，任小康ETF及南方小康基金经理；2011年9月至今，任南方上证380ETF及联接基金基金经理；2013年3月至今，任南方策略基金经理；2013年4月至今，任南方300基金经理；2013年4月至今，任南方开元沪深300ETF基金经理。 |
| 罗文杰 | 本基金基金经理 | 2013年5月17日 | - | 8 | 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，任南方基金数量化投资部基金经理助理；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；2013年5月至今，任南方策略基金经理。 |

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。

* 1. 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，本基金管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《开元证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责作为管理和运用基金资产的目标原则，在控制风险的基础上，力争为基金持有人谋求最大利益。

2013年2月25日至3月11日，本基金在集中申购期间因接受永泰能源（证券代码“600157”）超比例换购而给部分基金份额持有人造成了一定的损失。基金管理人第一时间对由此而造成损失的本基金相关基金份额持有人以现金的方式进行了补偿，并于2013年4月22日发布了基金经理变更公告。根据中国证监会《关于对南方基金管理有限公司采取责令整改等措施的决定》，基金管理人积极开展了自查整改工作，进一步强化基金投资运作环节的风险控制措施，完善了内控制度和流程管理。

除此之外，本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。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。

* 1. 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
     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。

* + 1. 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。

* 1. 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
     1. 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，我国经济增长力度仍然偏弱，但预计在较宽松的资金面支撑下，经济大幅衰退的可能性不高。同期沪深300下跌12.78%。

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”、“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 个别长期停牌证券，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

③ 6月底前后，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 联接基金在成立之后， 部分股票资产逐步换购为目标ETF基金过程中对ETF产生的微小偏离，对此我们通过科学的换购与交易策略争取跟踪误差最小化。

* + 1. 报告期内基金的业绩表现

自本基金上市以来至报告期末年化跟踪误差为0.627％，较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过2％的投资目标。

截至报告期末，本基金份额净值为0.8492元，2013年2月18日至2013年6月30日基金份额净值增长率为-19.68%，同期业绩基准增长率为-19.61%。

* 1. 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内方面，经济有继续下滑风险。 7月汇丰中国制造业PMI预览值降至47.7，创11个月以来新低，比6月的48.2又降低了0.5。下半年经济仍将保持低迷状态，而政策方面却没有任何松动。在经济增长压力增大的同时，政府高层连续表态，大规模刺激政策不会出台。财政部长楼继伟表示，中国政府不会再次推出大规模经济刺激政策。新华社表示，中国经济增速低于7%是不允许的，鉴于上半年增速7.6%，下半年增速不会低于7%，全年完成7%压力不大，因此，政府对经济下滑的容忍度是变高了。不过，在投资方面仍有一些稳经济的措施出台。

总体而言，当前看不到政策出现大规模放松，经济可能将继续下行。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。

* 1. 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，组成人员包括督察长、数量化投资部总监、监察稽核总监及基金会计负责人等。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。同时，根据基金管理公司制订的相关制度，负责估值工作决策和执行的机构成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

* 1. 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

**转型后：**

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。基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；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，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定。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。

**转型前：**

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：基金收益分配采取现金方式，每年至少一次；基金年度收益分配比例不得低于基金年度已实现收益的90%；基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；基金投资当年亏损，则不进行收益分配；每一基金份额享有同等分配权。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金不符合基金合同约定的收益分配条件，未有收益分配事项。

1. 托管人报告
   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（原开元证券投资基金转型）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。

* 1. 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，除永泰能源超比例换购外不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作基本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未进行利润分配。

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集中申购期间出现过接受永泰能源超比例换购的情况，南方基金管理有限公司在规定时间内及时对投资组合进行了调整，因此而给相关基金份额持有人造成的损失已足额补偿。

* 1. 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南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金2013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。

1. 半年度财务会计报告（未经审计）(转型前)
   1. 资产负债表(转型前)

会计主体：开元证券投资基金

报告截止日： 2013年2月17日

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **资 产** | **附注号** | **报告期初至转型前** | **上年度末**  **2012年12月31日** |
| **资 产：** |  |  |  |
| 银行存款 | 6.4.4.1 | 83,625,051.69 | 8,947,911.67 |
| 结算备付金 |  | 12,072,100.47 | 36,636.36 |
| 存出保证金 |  | 290,579.90 | 401,309.63 |
| 交易性金融资产 | 6.4.4.2 | 1,481,119,624.43 | 1,741,647,418.21 |
| 其中：股票投资 |  | 1,393,067,624.43 | 1,335,461,010.61 |
| 基金投资 |  | - | - |
| 债券投资 |  | 88,052,000.00 | 406,186,407.60 |
| 资产支持证券投资 |  | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.4.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.4.4 | 350,000,000.00 | - |
| 应收证券清算款 |  | - | - |
| 应收利息 | 6.4.4.5 | 2,784,418.79 | 4,342,642.37 |
| 应收股利 |  | - | - |
| 应收申购款 |  | - | - |
| 其他资产 | 6.4.4.6 | - | - |
| 资产总计 |  | 1,929,891,775.28 | 1,755,375,918.24 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **报告期初至转型前** | **上年度末**  **2012年12月31日** |
| **负 债：** |  |  |  |
| 短期借款 |  | - | - |
| 交易性金融负债 |  | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.4.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 |  | - | - |
| 应付证券清算款 |  | 70,000,000.00 | 1,205,982.10 |
| 应付赎回款 |  | - | - |
| 应付管理人报酬 |  | 1,291,395.91 | 2,114,894.31 |
| 应付托管费 |  | 215,232.64 | 352,482.36 |
| 应付销售服务费 |  | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.4.7 | 2,350,054.15 | 159,262.75 |
| 应交税费 |  | - | - |
| 应付利息 |  | - | - |
| 应付利润 |  | - | - |
| 其他负债 |  | 2,193,550.08 | 2,401,000.00 |
| 负债合计 |  | 76,050,232.78 | 6,233,621.52 |
| **所有者权益：** |  |  |  |
| 实收基金 | 6.4.4.8 | 2,000,000,000.00 | 2,000,000,000.00 |
| 未分配利润 | 6.4.4.9 | -146,158,457.50 | -250,857,703.28 |
| 所有者权益合计 |  | 1,853,841,542.50 | 1,749,142,296.72 |
| 负债和所有者权益总计 |  | 1,929,891,775.28 | 1,755,375,918.24 |

注：报告截止日2013年2月17日（基金合同失效前日），基金份额净值0.9269，基金份额总额2,000,000,000.00份。

* 1. 利润表

会计主体：开元证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年2月17日

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **项 目** | **附注号** | **本期**  **2013年1月1日至2013年2月17日** | **上年度可比期间**  **2012年1月1日至2012年6月30日** |
| **一、收入** |  | 112,681,918.29 | 126,853,908.97 |
| 1.利息收入 |  | 1,502,649.73 | 6,435,721.35 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.4.11 | 87,313.06 | 114,686.16 |
| 债券利息收入 |  | 1,030,363.71 | 6,321,035.19 |
| 资产支持证券利息收入 |  | - | - |
| 买入返售金融资产收入 |  | 384,972.96 | - |
| 其他利息收入 |  | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |  | -262,683,681.73 | -64,081,830.93 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.4.12 | -266,188,131.28 | -71,046,417.82 |
| 基金投资收益 |  | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.4.13 | 3,504,449.55 | 438,070.00 |
| 资产支持证券投资收益 |  | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.4.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.4.15 | - | 6,526,516.89 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.4.16 | 373,862,950.29 | 184,500,018.55 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） |  | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.4.17 | - | - |
| **减：二、费用** |  | 7,982,672.51 | 18,178,453.09 |
| 1．管理人报酬 | 6.4.7.2.1 | 3,529,353.31 | 13,251,381.40 |
| 2．托管费 | 6.4.7.2.2 | 588,225.54 | 2,208,563.55 |
| 3．销售服务费 |  | - | - |
| 4．交易费用 | 6.4.4.18 | 3,731,797.23 | 2,142,126.64 |
| 5．利息支出 |  | - | 339,405.17 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 |  | - | 339,405.17 |
| 6．其他费用 | 6.4.4.19 | 133,296.43 | 236,976.33 |
| **三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）** |  | 104,699,245.78 | 108,675,455.88 |
| 减：所得税费用 |  | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** |  | 104,699,245.78 | 108,675,455.88 |

* 1. 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：开元证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年2月17日

单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **项目** | **本期**  **2013年1月1日至2013年2月17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） | 2,000,000,000.00 | -250,857,703.28 | 1,749,142,296.72 | |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 104,699,245.78 | 104,699,245.78 | |
| 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） | - | - | - | |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - | |
| 2.基金赎回款 | - | - | - | |
| 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） | 2,000,000,000.00 | -146,158,457.50 | 1,853,841,542.50 | |
| **项目** | **上年度可比期间**  **2012年1月1日至2012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） | 2,000,000,000.00 | -380,275,731.17 | | 1,619,724,268.83 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 108,675,455.88 | | 108,675,455.88 |
| 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） | - | - | | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | | - |
| 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） | 2,000,000,000.00 | -271,600,275.29 | | 1,728,399,724.71 |

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\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_邓见梁\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_邓见梁\_\_\_\_

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

* 1. 报表附注
     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

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。

* + 1. 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
       1. 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

* + - 1. 会计估计变更的说明

本报告期无会计估计变更。

* + - 1. 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错。

* + 1. 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。

(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，股权的股息、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，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时代扣代缴个人所得税，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，暂减按25%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。

* + 1. 重要财务报表项目的说明
       1. 银行存款

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期末  2013年2月17日 |
| 活期存款 | 83,625,051.69 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限1-3个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 83,625,051.69 |

* + - 1. 交易性金融资产

单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 项目 | | 本期末  2013年2月17日 | | |
| 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 1,289,093,344.85 | 1,393,067,624.43 | 103,974,279.58 |
| 债券 | 交易所市场 | 8,025,401.20 | 8,040,000.00 | 14,598.80 |
| 银行间市场 | 80,028,850.00 | 80,012,000.00 | -16,850.00 |
|  | 合计 | 88,054,251.20 | 88,052,000.00 | -2,251.20 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 1,377,147,596.05 | 1,481,119,624.43 | 103,972,028.38 |

* + - 1. 衍生金融资产/负债

无余额。

* + - 1. 买入返售金融资产
         1. 各项买入返售金融资产期末余额

单位: 人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期末  2013年2月17日 | |
| 账面余额 | 其中；买断式逆回购 |
| 买入返售证券 | 350,000,000.00 | - |
| 合计 | 350,000,000.00 | - |

* + - * 1. 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

* + - 1. 应收利息

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期末  2013年2月17日 |
| 应收活期存款利息 | 84,435.53 |
| 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 | 8,055.74 |
| 应收债券利息 | 2,306,629.12 |
| 应收买入返售证券利息 | 384,972.96 |
| 应收申购款利息 | - |
| 其他 | 325.44 |
| 合计 | 2,784,418.79 |

* + - 1. 其他资产

无余额。

* + - 1. 应付交易费用

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期末  2013年2月17日 |
| 交易所市场应付交易费用 | 2,348,379.15 |
| 银行间市场应付交易费用 | 1,675.00 |
| 合计 | 2,350,054.15 |

* + - 1. 其他负债

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期末  2013年2月17日 |
| 应付券商交易单元保证金 | 1,750,000.00 |
| 应付赎回费 | - |
| 预提费用 | 443,550.08 |
| 合计 | 2,193,550.08 |

* + - 1. 实收基金

金额单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年1月1日至2013年2月17日 | |
| 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 2,000,000,000.00 | 2,000,000,000.00 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| - 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 | 2,000,000,000.00 | 2,000,000,000.00 |

* + - 1. 未分配利润

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 19,033,218.63 | -269,890,921.91 | -250,857,703.28 |
| 本期利润 | -269,163,704.51 | 373,862,950.29 | 104,699,245.78 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -250,130,485.88 | 103,972,028.38 | -146,158,457.50 |

* + - 1. 存款利息收入

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年1月1日至2013年2月17日 |
| 活期存款利息收入 | 78,948.38 |
| 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 | 8,039.24 |
| 其他 | 325.44 |
| 合计 | 87,313.06 |

* + - 1. 股票投资收益
         1. 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年1月1日至2013年2月17日 |
| 卖出股票成交总额 | 1,235,171,223.01 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,501,359,354.29 |
| 买卖股票差价收入 | -266,188,131.28 |

* + - 1. 债券投资收益

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年1月1日至2013年2月17日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交金额 | 565,702,066.80 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 554,243,280.00 |
| 应收利息总额 | 7,954,337.25 |
| 债券投资收益 | 3,504,449.55 |

* + - * 1. 资产支持证券投资收益

无。

* + - 1. 衍生工具收益

无。

* + - 1. 股利收益

无。

* + - 1. 公允价值变动收益

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目名称 | 本期  2013年1月1日至2013年2月17日 |
| 1.交易性金融资产 | 373,862,950.29 |
| ——股票投资 | 376,716,977.89 |
| ——债券投资 | -2,854,027.60 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 合计 | 373,862,950.29 |

* + - 1. 其他收入

无。

* + - 1. 交易费用

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年1月1日至2013年2月17日 |
| 交易所市场交易费用 | 3,730,122.23 |
| 银行间市场交易费用 | 1,675.00 |
| 合计 | 3,731,797.23 |

* + - 1. 其他费用

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年1月1日至2013年2月17日 |
| 审计费用 | 12,098.40 |
| 信息披露费 | 39,451.68 |
| 其他 | 80,000.00 |
| 银行汇划费 | 1,746.35 |
| 合计 | 133,296.43 |

* + 1. 或有事项、资产负债表日后事项的说明
       1. 或有事项

无。

* + - 1. 资产负债表日后事项

无。

* + 1. 关联方关系
       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。

* + - 1. 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 |
| 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、基金代销机构 |
| 陕西省国际信托股份有限公司(“陕西信托”) | 基金发起人 |
| 厦门国际信托有限公司(“厦门信托”) | 基金发起人、基金管理人的股东 |

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。

* + 1. 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
       1. 通过关联方交易单元进行的交易
          1. 股票交易

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 关联方名称 | 本期  2013年1月1日至2013年2月17日 | | 上年度可比期间  2012年1月1日至2012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 | 28,603,819.06 | 1.18% | 238,563,672.78 | 17.52% |

* + - * 1. 权证交易

无。

* + - * 1. 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 关联方名称 | 本期  2013年1月1日至2013年2月17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 | 25,311.71 | 1.16% | 25,311.71 | 1.08% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间  2012年1月1日至2012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 | 202,759.71 | 17.58% | 74,589.82 | 11.72% |

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、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。

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。

* + - 1. 关联方报酬
         1. 基金管理费

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年1月1日至2013年2月17日 | 上年度可比期间  2012年1月1日至2012年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 3,529,353.31 | 13,251,381.40 |
| 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公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%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 1.5% / 当年天数。

* + - * 1. 基金托管费

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年1月1日至2013年2月17日 | 上年度可比期间  2012年1月1日至2012年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 588,225.54 | 2,208,563.55 |

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0.25%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 0.25% / 当年天数。

* + - 1. 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 本期  2013年1月1日至2013年2月17日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的  各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国工商银行 | 10,280,682.62 | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间  2012年1月1日至2012年6月30日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的  各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国工商银行 | - | - | - | - | - | - |

* + - 1. 各关联方投资本基金的情况
         1. 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年1月1日至2013年2月17日 | 上年度可比期间  2012年1月1日至2012年6月30日 |
| 期初持有的基金份额 | 50,686,168.00 | 50,686,168.00 |
| 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 | 50,686,168.00 | 50,686,168.00 |
| 期末持有的基金份额  占基金总份额比例 | 2.53% | 2.53% |

* + - * 1. 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  2013年2月17日 | | 上年度末  2012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 |
| 陕西信托 | 6,000,000.00 | 0.30% | 6,000,000.00 | 0.30% |
| 厦门信托 | 6,000,000.00 | 0.30% | 6,000,000.00 | 0.30% |

* + - 1. 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  2013年1月1日至2013年2月17日 | | 上年度可比期间  2012年1月1日至2012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 |
| 活期存款 | 83,625,051.69 | 78,948.38 | 5,041,446.68 | 105,731.78 |

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。

* + - 1. 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

* + - 1. 其他关联交易事项的说明

无。

* + 1. 利润分配情况
       1. 利润分配情况——非货币市场基金

无。

* + 1. 期末（2013年2月17日）本基金持有的流通受限证券
       1. 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

* + - 1. 期末持有的暂时停牌股票

无。

* + - 1. 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
         1. 银行间市场债券正回购

无。

* + - * 1. 交易所市场债券正回购

无。

* + 1. 金融工具风险及管理
       1. 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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相对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“相对收益高、风险适中”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。

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。

* + - 1. 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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。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。于2013年2月17日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的其他债券(2012年12月31日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为2.97%)。

* + - 1. 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

* + - 1. 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。

* + - * 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、债券投资等。

利率风险敞口

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 本期末  2013年2月17日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 |  |  |  |  |  |
| 银行存款 | 83,625,051.69 | - | - | - | 83,625,051.69 |
| 结算备付金 | 12,072,100.47 | - | - | - | 12,072,100.47 |
| 存出保证金 | 290,579.90 | - | - | - | 290,579.90 |
| 交易性金融资产 | 88,052,000.00 | - | - | 1,393,067,624.43 | 1,481,119,624.43 |
| 买入返售金融资产 | 350,000,000.00 | - | - | - | 350,000,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 2,784,418.79 | 2,784,418.79 |
| 资产总计 | 534,039,732.06 | - | - | 1,395,852,043.22 | 1,929,891,775.28 |
| 负债 |  |  |  |  |  |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 70,000,000.00 | 70,000,000.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,291,395.91 | 1,291,395.91 |
| 应付托管费 | - | - | - | 215,232.64 | 215,232.64 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 2,350,054.15 | 2,350,054.15 |
| 其他负债 | - | - | - | 2,193,550.08 | 2,193,550.08 |
| 负债总计 | - | - | - | 76,050,232.78 | 76,050,232.78 |
| 利率敏感度缺口 | 534,039,732.06 | - | - | 1,319,801,810.44 | 1,853,841,542.50 |
| 上年度末  2012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 | 8,947,911.67 | - | - | - | 8,947,911.67 |
| 结算备付金 | 36,636.36 | - | - | - | 36,636.36 |
| 存出保证金 | - | - | - | 401,309.63 | 401,309.63 |
| 交易性金融资产 | 354,204,000.00 | - | 51,982,407.60 | 1,335,461,010.61 | 1,741,647,418.21 |
| 应收利息 | - | - | - | 4,342,642.37 | 4,342,642.37 |
| 资产总计 | 363,188,548.03 | - | 51,982,407.60 | 1,340,204,962.61 | 1,755,375,918.24 |
| 负债 |  |  |  |  |  |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 1,205,982.10 | 1,205,982.10 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 2,114,894.31 | 2,114,894.31 |
| 应付托管费 | - | - | - | 352,482.36 | 352,482.36 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 159,262.75 | 159,262.75 |
| 其他负债 | - | - | - | 2,401,000.00 | 2,401,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 6,233,621.52 | 6,233,621.52 |
| 利率敏感度缺口 | 363,188,548.03 | - | 51,982,407.60 | 1,333,971,341.09 | 1,749,142,296.72 |

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。

利率风险的敏感性分析

于2013 年2月17日，本基金持有交易性债券投资的市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2012年12月31日：同)。

* + - * 1. 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

* + - * 1. 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的20%。此外，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，包括VaR(Value at Risk)指标等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。

其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 项目 | 本期末  2013年2月17日 | | 上年度末  2012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 | 1,393,067,624.43 | 75.14 | 1,335,461,010.61 | 76.35 |
| 交易性金融资产－基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产－债券投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产－权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 1,393,067,624.43 | 75.14 | 1,335,461,010.61 | 76.35 |

其他价格风险的敏感性分析

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 假设 | 除沪深300指数以外的其他市场变量保持不变 | | |
|  | | |
| 分析 | 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：人民币万元） | |
| 本期末（ 2013年2月17日 ） | 本期末（ 2012年12月31日 ） |
| 沪深300指数上升5% | 增加约6,210 | 增加约6,141 |
| 沪深300指数下降5% | 减少约6,210 | 减少约6,141 |

1. 半年度财务会计报告（未经审计）(转型后)
   1. 资产负债表（转型后）

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

报告截止日： 2013年6月30日

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **资 产** | **附注号** | **报告期末** |
| **资 产：** |  |  |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 15,642,188.69 |
| 结算备付金 |  | 319,721.16 |
| 存出保证金 |  | 1,092,057.36 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,944,788,220.95 |
| 其中：股票投资 |  | 1,944,788,220.95 |
| 基金投资 |  | - |
| 债券投资 |  | - |
| 资产支持证券投资 |  | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - |
| 应收证券清算款 |  | 4,302,466.26 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 2,816.74 |
| 应收股利 |  | 5,569,430.78 |
| 应收申购款 |  | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - |
| 资产总计 |  | 1,971,716,901.94 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **报告期末** |
| **负 债：** |  |  |
| 短期借款 |  | - |
| 交易性金融负债 |  | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 |  | - |
| 应付证券清算款 |  | 3,101,368.02 |
| 应付赎回款 |  | - |
| 应付管理人报酬 |  | 617,101.24 |
| 应付托管费 |  | 123,420.23 |
| 应付销售服务费 |  | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 1,378,309.46 |
| 应交税费 |  | - |
| 应付利息 |  | - |
| 应付利润 |  | - |
| 其他负债 |  | 2,136,495.17 |
| 负债合计 | 6.4.7.8 | 7,356,694.12 |
| **所有者权益：** |  |  |
| 实收基金 |  | 2,638,451,089.46 |
| 未分配利润 | 6.4.7.9 | -674,090,881.64 |
| 所有者权益合计 |  | 1,964,360,207.82 |
| 负债和所有者权益总计 |  | 1,971,716,901.94 |

注：1. 报告截止日2013年6月30日，基金份额净值0.8492元，基金份额总额2,313,199,451.00份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2013年2月18日(基金合同生效日)至2013年6月30日。

* 1. 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

本报告期：2013年2月18日至2013年6月30日

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **项 目** | **附注号** | **本期**  **2013年2月18日（基金合同生效日）至2013年6月30日** |
| **一、收入** |  | -428,969,533.76 |
| 1.利息收入 |  | 668,853.67 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 618,093.53 |
| 债券利息收入 |  | 18,455.40 |
| 资产支持证券利息收入 |  | - |
| 买入返售金融资产收入 |  | 32,304.74 |
| 其他利息收入 |  | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |  | -141,632,563.21 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -161,962,169.87 |
| 基金投资收益 |  | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 426,559.76 |
| 资产支持证券投资收益 |  | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 19,903,046.90 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -288,008,290.18 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） |  | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 2,465.96 |
| **减：二、费用** |  | 10,544,345.66 |
| 1．管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 4,137,194.48 |
| 2．托管费 | 6.4.10.2.2 | 827,438.91 |
| 3．销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - |
| 4．交易费用 | 6.4.7.18 | 4,904,793.31 |
| 5．利息支出 |  | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 |  | - |
| 6．其他费用 | 6.4.7.19 | 674,918.96 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** |  | -439,513,879.42 |
| 减：所得税费用 |  | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** |  | -439,513,879.42 |

* 1. 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

本报告期：2013年2月18日至2013年6月30日

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **项目** | **本期**  **2013年2月18日（基金合同生效日）至2013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） | 2,000,000,000.00 | -146,158,457.50 | 1,853,841,542.50 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -439,513,879.42 | -439,513,879.42 |
| 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） | 638,451,089.46 | -88,418,544.72 | 550,032,544.74 |
| 其中：1.基金申购款 | 3,435,219,033.06 | -556,696,971.33 | 2,878,522,061.73 |
| 2.基金赎回款（以“-”号填列） | -2,796,767,943.60 | 468,278,426.61 | -2,328,489,516.99 |
| 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） | 2,638,451,089.46 | -674,090,881.64 | 1,964,360,207.82 |

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\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_邓见梁\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_邓见梁\_\_\_\_

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

* 1. 报表附注
     1. 基金基本情况

南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金是根据原开元证券投资基金 (以下简称“基金开元”)基金份额持有人大会2013年1月4日决议通过的《关于开元证券投资基金转型有关事项的议案》，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2013年1月28日证监许可 [2013] 61号《关于核准开元证券投资基金基金份额持有人大会有关转型基金运作方式决议的批复》，由原基金开元而来。

原基金开元由南方证券有限公司(后更名为南方证券股份有限公司)、广西信托投资公司和厦门国际信托投资有限公司三家发起人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其他有关规定和《开元证券投资基金基金契约》(后更名为《开元证券投资基金基金合同》)发起，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[1998]6号文批准，于1998年3月27日募集成立。运作方式为契约型封闭式，存续期15年，发行规模为20亿份基金份额。基金开元经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[1998]65号文审核同意，于1998年4月7日在深交所挂牌交易。根据深交所深证上[2013]55号文同意，原基金开元于2013年2月18日终止上市。自2013年2月18日起，原基金开元转型成为交易型开放式基金，并更名为南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)。原《开元证券投资基金基金合同》失效，《南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为交易型开放式基金，存续期间不定。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据基金开元份额持有人大会后续安排，本基金自2013年2月25日起开放集中申购。根据《南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金集中申购期基金份额发售公告》的相关规定，经普华永道中天会计师事务所验资，本基金最终确认的有效净申购金额（含集中申购股票市值）为2,205,676,990元人民币，折合基金份额2,205,676,990份。有效申购申请确认金额产生的银行利息共计72,390.65元人民币，折合基金份额69,869份，尾差部分直接归入基金财产。

根据中国证券监督管理委员会《关于核准开元证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》、《南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金集中申购份额发售公告》的相关规定，本基金管理人以2013年3月11日为基金份额折算基准日对投资人持有的原基金开元基金份额进行了折算，折算后原基金开元变更登记为南方开元沪深300ETF基金份额，基金份额折算基准日（2013年3月11日）折算前基金份额净值为0.8767元，按1：0.876726296折算比例将原基金开元的基金份额进行了折算，折算后基金份额净值为1.0000元，折算后基金份额采用截位法保留到整数位，所产生的误差归入基金财产，折算后的原基金开元基金份额总额由20亿份调整为1,753,452,592份。经深交所深证上【2013】111号文审核同意，本基金3,959,199,451份基金份额于2013年4月11日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为标的指数：沪深300指数。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于2013年8月27日批准报出。

* + 1. 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则－基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

* + 1. 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013年2月18日(基金合同生效日)至2013年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2013年6月30日的财务状况以及 2013年2月18日(基金合同生效日)至2013年6月30日止期间 的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

* + 1. 重要会计政策和会计估计
       1. 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2013年2月18日(基金合同生效日)至2013年6月30日。

* + - 1. 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

* + - 1. 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括和各类应付款项等。

* + - 1. 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

* + - 1. 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

* + - 1. 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

* + - 1. 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购、赎回以及配对转换引起的实收基金变动分别于基金申购确认日、基金赎回确认日及基金配对转换确认日认列。

* + - 1. 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

* + - 1. 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

* + - 1. 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

* + - 1. 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。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，基金管理人可进行收益分配。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。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。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

* + - 1. 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

* + - 1. 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

* + 1. 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
       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。

* + - 1. 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。

* + - 1. 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。

* + 1. 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。

(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，股权的股息、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，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时代扣代缴个人所得税，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，暂减按25%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。

* + 1. 重要财务报表项目的说明
       1. 银行存款

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期末  2013年6月30日 |
| 活期存款 | 15,642,188.69 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限1-3个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 15,642,188.69 |

* + - 1. 交易性金融资产

单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 项目 | | 本期末  2013年6月30日 | | |
| 成本 | 公允价值 | 估值增值 |
| 股票 | | 2,128,824,482.75 | 1,944,788,220.95 | -184,036,261.80 |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| 银行间市场 | - | - | - |
| 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 2,128,824,482.75 | 1,944,788,220.95 | -184,036,261.80 |

* + - 1. 衍生金融资产/负债

无余额。

* + - 1. 买入返售金融资产
         1. 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

* + - * 1. 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

* + - 1. 应收利息

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期末  2013年6月30日 |
| 应收活期存款利息 | 1,555.03 |
| 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 | 819.45 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 其他 | 442.26 |
| 合计 | 2,816.74 |

* + - 1. 其他资产

无余额。

* + - 1. 应付交易费用

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期末  2013年6月30日 |
| 交易所市场应付交易费用 | 1,378,309.46 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 1,378,309.46 |

* + - 1. 其他负债

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期末  2013年6月30日 |
| 应付券商交易单元保证金 | 1,500,000.00 |
| 应付赎回费 | - |
| 预提费用 | 389,787.18 |
| 指数使用费 | 246,707.99 |
| 合计 | 2,136,495.17 |

* + - 1. 实收基金

金额单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年2月18日至2013年6月30日 | |
| 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 2,000,000,000.00 | 2,000,000,000.00 |
| - 基金份额折算调整 | -246,547,408.00 | - |
| - 未领取红利份额折算调整 | - | - |
| - 集中申购募集资金本金及利息 | 2,205,746,859.00 | 2,515,889,929.46 |
| - 基金拆分和集中申购完成后 | - | - |
| 本期申购 | 806,000,000.00 | 919,329,103.60 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,452,000,000.00 | -2,796,767,943.60 |
| 本期末 | 2,313,199,451.00 | 2,638,451,089.46 |

注： 1. 原开元证券投资基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为1,853,841,542.50元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。

2.本基金管理人以2013年3月11日为基金份额折算基准日对投资人持有的原基金开元基金份额进行了折算，折算后原基金开元将变更登记为南方开元沪深300ETF基金份额。经本基金基金管理人计算并经本基金基金托管人中国工商银行股份有限公司确认，基金份额折算基准日（2013年3月11日）折算前基金份额净值为0.8767元，本基金管理人按照1：0.876726296折算比例将原基金开元的基金份额进行了折算，折算后基金份额净值为1.0000元，折算后基金份额采用截位法保留到整数位，所产生的误差归入基金财产，折算后的原基金开元基金份额总额由20亿份调整为1,753,452,592份。经中国证券登记结算有限责任公司变更登记后，南方开元沪深300ETF基金份额总额变更为3,959,199,451份。

3. 本基金自2013年2月25日起开放集中申购。根据《南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金集中申购期基金份额发售公告》的相关规定，经普华永道中天会计师事务所验资，本基金最终确认的有效净申购金额（含集中申购股票市值）为2,205,676,990元人民币，折合基金份额2,205,676,990份。有效申购申请确认金额产生的银行利息共计72,390.65元人民币，折合基金份额69,869份，尾差部分直接归入基金财产。

* + - 1. 未分配利润

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 基金合同生效日 | -250,130,485.88 | 103,972,028.38 | -146,158,457.50 |
| 本期利润 | -151,505,589.24 | -288,008,290.18 | -439,513,879.42 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -25,533,383.18 | -62,885,161.54 | -88,418,544.72 |
| 其中：基金申购款 | -464,268,048.50 | -92,428,922.83 | -556,696,971.33 |
| 基金赎回款 | 438,734,665.32 | 29,543,761.29 | 468,278,426.61 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -427,169,458.30 | -246,921,423.34 | -674,090,881.64 |

* + - 1. 存款利息收入

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年2月18日至2013年6月30日 |
| 活期存款利息收入 | 565,212.99 |
| 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 | 49,073.43 |
| 其他 | 3,807.11 |
| 合计 | 618,093.53 |

* + - 1. 股票投资收益
         1. 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年2月18日至2013年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -95,909,127.53 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | -66,053,042.34 |
| 合计 | -161,962,169.87 |

* + - * 1. 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年2月18日至2013年6月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 1,121,815,060.57 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,217,724,188.10 |
| 买卖股票差价收入 | -95,909,127.53 |

* + - * 1. 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年2月18日至2013年6月30日 |
| 赎回基金份额对价总额 | 2,358,033,278.28 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 20,511,809.99 |
| 减：赎回股票成本总额 | 2,403,574,510.63 |
| 赎回差价收入 | -66,053,042.34 |

* + - 1. 债券投资收益

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年2月18日至2013年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交金额 | 98,166,895.48 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 95,415,251.20 |
| 应收利息总额 | 2,325,084.52 |
| 债券投资收益 | 426,559.76 |

* + - * 1. 资产支持证券投资收益

无。

* + - 1. 衍生工具收益

无。

* + - 1. 股利收益

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年2月18日至2013年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 19,903,046.90 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 19,903,046.90 |

* + - 1. 公允价值变动收益

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目名称 | 本期  2013年2月18日至2013年6月30日 |
| 1.交易性金融资产 | -288,008,290.18 |
| ——股票投资 | -288,010,541.38 |
| ——债券投资 | 2,251.20 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 合计 | -288,008,290.18 |

* + - 1. 其他收入

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年2月18日至2013年6月30日 |
| 替代损益 | -55.69 |
| 其他 | 2,521.65 |
| 合计 | 2,465.96 |

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

* + - 1. 交易费用

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年2月18日至2013年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 4,904,793.31 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 4,904,793.31 |

* + - 1. 其他费用

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年2月18日至2013年6月30日 |
| 审计费用 | 33,522.65 |
| 信息披露费 | 109,314.03 |
| 持有人大会会务费 | 10,000.00 |
| 上市年费 | 75,000.00 |
| 银行汇划费 | 473.87 |
| 账户维护费 | 4,500.00 |
| 指数使用费 | 246,707.99 |
| 其他 | 195,400.42 |
| 合计 | 674,918.96 |

* + 1. 或有事项、资产负债表日后事项的说明
       1. 或有事项

无。

* + - 1. 资产负债表日后事项

无。

* + 1. 关联方关系
       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。

* + - 1. 本报告期各关联方

|  |  |
| --- | --- |
| 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、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 |
| 兴业证券股份有限公司(“兴业证券”) | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 厦门国际信托有限公司(“厦门信托”) | 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 |
| 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金（南方300联接） | 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。

* + 1. 本报告期间的关联方交易
       1. 通过关联方交易单元进行的交易
          1. 股票交易

无。

* + - * 1. 权证交易

无。

* + - * 1. 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 关联方名称 | 本期  2013年2月18日至2013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 | - | - | 25,311.71 | 1.84% |

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、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。

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。

* + - 1. 关联方报酬
         1. 基金管理费

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年2月18日至2013年6月30日 |
| 当期应支付的管理费 | 4,137,194.48 |
| 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管理有限公司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。

* + - * 1. 基金托管费

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年2月18日至2013年6月30日 |
| 当期应支付的托管费 | 827,438.91 |

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。

* + - 1. 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

* + - 1. 各关联方投资本基金的情况
         1. 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2013年2月18日至2013年6月30日 |
| 基金合同生效日(2013年2月18日)持有的基金份额 | 50,686,168.00 |
| 期间申购/买入总份额 | - |
| 期间因拆分增加的份额 | -6,248,272.00 |
| 期间赎回/卖出总份额 | - |
| 期末持有的基金份额 | 44,437,896.00 |
| 期末持有的基金份额  占基金总份额比例 | 1.92% |

* + - * 1. 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  2013年6月30日 | |
| 持有的  基金份额 | 持有的基金份额  占基金总份额的比例 |
| 华泰证券 | 41,756,295.00 | 1.81% |
| 南方300联接 | 864,409,669.00 | 37.37% |

* + - 1. 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  2013年2月18日至2013年6月30日 | |
| 期末余额 | 当期利息收入 |
| 活期存款 | 15,642,188.69 | 565,212.99 |

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。

* + - 1. 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

* + - 1. 其他关联交易事项的说明

无。

* + 1. 利润分配情况
       1. 利润分配情况——非货币市场基金

无。

* + 1. 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券
       1. 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

* + - 1. 期末持有的暂时停牌股票

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 |
| 000999 | 华润三九 | 2013年6月3日 | 重大事项未公告 | 29.60 | 2013年8月19日 | 26.51 | 152,701.00 | 4,415,513.37 | 4,519,949.60 | - |
| 600598 | 北大荒 | 2013年5月27日 | 重大事项未公告 | 8.35 | 2013年7月19日 | 8.35 | 315,671.00 | 2,819,113.42 | 2,635,852.85 | - |
| 601918 | 国投新集 | 2013年5月16日 | 重大事项未公告 | 7.55 | 2013年8月23日 | 5.05 | 234,260.00 | 2,027,547.66 | 1,768,663.00 | - |
| 601989 | 中国重工 | 2013年5月17日 | 重大事项未公告 | 4.52 | 未知 | 未知 | 1,900,718.00 | 9,213,170.06 | 8,591,245.36 | - |

注：本基金截至2013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。

* + - 1. 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
         1. 银行间市场债券正回购

无。

* + - * 1. 交易所市场债券正回购

无。

* + 1. 金融工具风险及管理
       1. 风险管理政策和组织架构

本基金为交易型开放式指数基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现。本基金投资的金融工具主要为股票投资等。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。

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。

* + - 1. 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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。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。于2013年6月30日，本基金未持有债券投资。

* + - 1. 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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

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。本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注6.4.12.2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。

* + - 1. 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。

* + - * 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、结算备付金等。

利率风险敞口

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 本期末  2013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 | 15,642,188.69 | - | - | - | 15,642,188.69 |
| 结算备付金 | 319,721.16 | - | - | - | 319,721.16 |
| 存出保证金 | 1,092,057.36 | - | - | - | 1,092,057.36 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 1,944,788,220.95 | 1,944,788,220.95 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 4,302,466.26 | 4,302,466.26 |
| 应收利息 | - | - | - | 2,816.74 | 2,816.74 |
| 应收股利 | - | - | - | 5,569,430.78 | 5,569,430.78 |
| 资产总计 | 17,053,967.21 | - | - | 1,954,662,934.73 | 1,971,716,901.94 |
| 负债 |  |  |  |  |  |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 3,101,368.02 | 3,101,368.02 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 617,101.24 | 617,101.24 |
| 应付托管费 | - | - | - | 123,420.23 | 123,420.23 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 1,378,309.46 | 1,378,309.46 |
| 其他负债 | - | - | - | 2,136,495.17 | 2,136,495.17 |
| 负债总计 | - | - | - | 7,356,694.12 | 7,356,694.12 |
| 利率敏感度缺口 | 17,053,967.21 | - | - | 1,947,306,240.61 | 1,964,360,207.82 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

利率风险的敏感性分析

于 2013 年6月30日，本基金未持有的交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

* + - * 1. 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

* + - * 1. 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的20%。此外，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，包括VaR(Value at Risk)指标等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。

其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期末  2013年6月30日 | |
| 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产-股票投资 | 1,944,788,220.95 | 99.00 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - |
| 交易性金融资产－债券投资 | - | - |
| 衍生金融资产－权证投资 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 1,944,788,220.95 | 99.00 |

其他价格风险的敏感性分析

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 假设 | 除沪深300指数以外的其他市场变量保持不变 | |
|  | |
| 分析 | 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：人民币万元） |
| 本期末（ 2013年6月30日 ） |
| 沪深300指数上升5% | 增加约9,822 |
| 沪深300指数下降5% | 减少约9,822 |

1. 投资组合报告(转型前)
   1. 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
| 1 | 权益投资 | 1,393,067,624.43 | 72.18 |
|  | 其中：股票 | 1,393,067,624.43 | 72.18 |
| 2 | 固定收益投资 | 88,052,000.00 | 4.56 |
|  | 其中：债券 | 88,052,000.00 | 4.56 |
|  | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 350,000,000.00 | 18.14 |
|  | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 95,697,152.16 | 4.96 |
| 6 | 其他资产 | 3,074,998.69 | 0.16 |
| 7 | 合计 | 1,929,891,775.28 | 100.00 |

* 1. 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 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 | 8,095,405.80 | 0.44 |
| B | 采矿业 | 144,161,838.57 | 7.78 |
| C | 制造业 | 474,094,603.64 | 25.57 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 34,984,758.88 | 1.89 |
| E | 建筑业 | 50,955,859.44 | 2.75 |
| F | 批发和零售业 | 33,808,802.92 | 1.82 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 32,462,961.73 | 1.75 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 23,383,269.71 | 1.26 |
| J | 金融业 | 488,049,616.08 | 26.33 |
| K | 房地产业 | 73,598,535.20 | 3.97 |
| L | 租赁和商务服务业 | 8,132,404.72 | 0.44 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 6,287,280.50 | 0.34 |
| 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 | 1,451,748.11 | 0.08 |
| S | 综合 | 13,600,539.13 | 0.73 |
|  | 合计 | 1,393,067,624.43 | 75.14 |

* 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 | 占基金资产净值比例（%） |
| 1 | 600016 | 民生银行 | 5,556,403 | 58,453,359.56 | 3.15 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 3,476,550 | 48,810,762.00 | 2.63 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 824,158 | 42,765,558.62 | 2.31 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 1,874,724 | 36,744,590.40 | 1.98 |
| 5 | 600000 | 浦发银行 | 2,753,167 | 31,220,913.78 | 1.68 |
| 6 | 601328 | 交通银行 | 5,499,509 | 29,037,407.52 | 1.57 |
| 7 | 600837 | 海通证券 | 1,990,625 | 26,415,593.75 | 1.42 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 1,694,159 | 26,259,464.50 | 1.42 |
| 9 | 000002 | 万科A | 2,147,900 | 25,839,237.00 | 1.39 |
| 10 | 601088 | 中国神华 | 811,287 | 20,152,369.08 | 1.09 |
| 11 | 601288 | 农业银行 | 6,192,340 | 19,196,254.00 | 1.04 |
| 12 | 600519 | 贵州茅台 | 102,115 | 19,183,323.90 | 1.03 |
| 13 | 000651 | 格力电器 | 591,911 | 17,585,675.81 | 0.95 |
| 14 | 601601 | 中国太保 | 773,255 | 17,158,528.45 | 0.93 |
| 15 | 601939 | 建设银行 | 3,306,909 | 16,203,854.10 | 0.87 |
| 16 | 600104 | 上汽集团 | 813,711 | 15,021,105.06 | 0.81 |
| 17 | 601668 | 中国建筑 | 3,689,895 | 14,980,973.70 | 0.81 |
| 18 | 601988 | 中国银行 | 4,612,605 | 14,252,949.45 | 0.77 |
| 19 | 600048 | 保利地产 | 1,053,511 | 13,727,248.33 | 0.74 |
| 20 | 000001 | 平安银行 | 630,220 | 13,077,065.00 | 0.71 |
| 21 | 601169 | 北京银行 | 1,298,881 | 12,716,044.99 | 0.69 |
| 22 | 600111 | 包钢稀土 | 357,499 | 12,237,190.77 | 0.66 |
| 23 | 000776 | 广发证券 | 728,042 | 12,201,983.92 | 0.66 |
| 24 | 600547 | 山东黄金 | 316,450 | 12,151,680.00 | 0.66 |
| 25 | 000858 | 五粮液 | 466,864 | 12,096,446.24 | 0.65 |
| 26 | 000157 | 中联重科 | 1,140,105 | 11,537,862.60 | 0.62 |
| 27 | 600887 | 伊利股份 | 393,223 | 11,324,822.40 | 0.61 |
| 28 | 601818 | 光大银行 | 2,984,011 | 10,682,759.38 | 0.58 |
| 29 | 601006 | 大秦铁路 | 1,462,838 | 10,649,460.64 | 0.57 |
| 30 | 601857 | 中国石油 | 1,131,851 | 10,560,169.83 | 0.57 |
| 31 | 600585 | 海螺水泥 | 491,906 | 10,467,759.68 | 0.56 |
| 32 | 600015 | 华夏银行 | 842,532 | 9,958,728.24 | 0.54 |
| 33 | 600031 | 三一重工 | 747,167 | 9,376,945.85 | 0.51 |
| 34 | 600900 | 长江电力 | 1,217,679 | 9,315,244.35 | 0.50 |
| 35 | 600999 | 招商证券 | 674,555 | 9,173,948.00 | 0.49 |
| 36 | 600489 | 中金黄金 | 543,000 | 9,089,820.00 | 0.49 |
| 37 | 600256 | 广汇能源 | 517,238 | 9,051,665.00 | 0.49 |
| 38 | 600383 | 金地集团 | 1,099,979 | 8,722,833.47 | 0.47 |
| 39 | 601788 | 光大证券 | 519,562 | 8,302,600.76 | 0.45 |
| 40 | 600739 | 辽宁成大 | 468,731 | 7,963,739.69 | 0.43 |
| 41 | 002024 | 苏宁电器 | 1,089,736 | 7,933,278.08 | 0.43 |
| 42 | 600050 | 中国联通 | 2,085,659 | 7,800,364.66 | 0.42 |
| 43 | 601628 | 中国人寿 | 368,997 | 7,424,219.64 | 0.40 |
| 44 | 600028 | 中国石化 | 1,043,597 | 7,336,486.91 | 0.40 |
| 45 | 000630 | 铜陵有色 | 366,995 | 7,218,791.65 | 0.39 |
| 46 | 600011 | 华能国际 | 1,033,142 | 7,015,034.18 | 0.38 |
| 47 | 601899 | 紫金矿业 | 1,707,807 | 6,677,525.37 | 0.36 |
| 48 | 000538 | 云南白药 | 85,393 | 6,625,642.87 | 0.36 |
| 49 | 002304 | 洋河股份 | 79,792 | 6,601,990.08 | 0.36 |
| 50 | 600019 | 宝钢股份 | 1,263,625 | 6,545,577.50 | 0.35 |
| 51 | 000783 | 长江证券 | 594,431 | 6,532,796.69 | 0.35 |
| 52 | 600518 | 康美药业 | 378,588 | 6,435,996.00 | 0.35 |
| 53 | 601808 | 中海油服 | 369,917 | 6,414,360.78 | 0.35 |
| 54 | 000423 | 东阿阿胶 | 128,732 | 6,359,360.80 | 0.34 |
| 55 | 000338 | 潍柴动力 | 223,405 | 6,313,425.30 | 0.34 |
| 56 | 000069 | 华侨城Ａ | 894,350 | 6,287,280.50 | 0.34 |
| 57 | 600795 | 国电电力 | 2,177,400 | 6,096,720.00 | 0.33 |
| 58 | 601989 | 中国重工 | 1,131,218 | 5,984,143.22 | 0.32 |
| 59 | 000895 | 双汇发展 | 81,179 | 5,869,241.70 | 0.32 |
| 60 | 000983 | 西山煤电 | 408,047 | 5,810,589.28 | 0.31 |
| 61 | 600362 | 江西铜业 | 204,400 | 5,557,636.00 | 0.30 |
| 62 | 600690 | 青岛海尔 | 396,285 | 5,540,064.30 | 0.30 |
| 63 | 000568 | 泸州老窖 | 171,921 | 5,461,930.17 | 0.29 |
| 64 | 601699 | 潞安环能 | 226,337 | 5,452,458.33 | 0.29 |
| 65 | 600089 | 特变电工 | 648,326 | 5,212,541.04 | 0.28 |
| 66 | 601009 | 南京银行 | 511,294 | 5,199,859.98 | 0.28 |
| 67 | 000063 | 中兴通讯 | 483,943 | 5,139,474.66 | 0.28 |
| 68 | 000100 | TCL集团 | 2,085,100 | 5,108,495.00 | 0.28 |
| 69 | 601299 | 中国北车 | 1,014,132 | 4,999,670.76 | 0.27 |
| 70 | 600276 | 恒瑞医药 | 152,070 | 4,984,854.60 | 0.27 |
| 71 | 600315 | 上海家化 | 77,220 | 4,904,242.20 | 0.26 |
| 72 | 600309 | 烟台万华 | 265,997 | 4,726,766.69 | 0.25 |
| 73 | 600348 | 阳泉煤业 | 288,565 | 4,723,809.05 | 0.25 |
| 74 | 000024 | 招商地产 | 169,435 | 4,618,798.10 | 0.25 |
| 75 | 601186 | 中国铁建 | 757,260 | 4,581,423.00 | 0.25 |
| 76 | 600535 | 天士力 | 76,176 | 4,570,560.00 | 0.25 |
| 77 | 000792 | 盐湖股份 | 156,499 | 4,541,600.98 | 0.24 |
| 78 | 601766 | 中国南车 | 881,731 | 4,479,193.48 | 0.24 |
| 79 | 000629 | 攀钢钒钛 | 1,056,477 | 4,363,250.01 | 0.24 |
| 80 | 000625 | 长安汽车 | 462,522 | 4,352,332.02 | 0.23 |
| 81 | 600583 | 海油工程 | 651,459 | 4,338,716.94 | 0.23 |
| 82 | 600150 | 中国船舶 | 180,439 | 4,298,056.98 | 0.23 |
| 83 | 000402 | 金融街 | 595,692 | 4,229,413.20 | 0.23 |
| 84 | 000581 | 威孚高科 | 97,291 | 4,213,673.21 | 0.23 |
| 85 | 601390 | 中国中铁 | 1,261,422 | 4,137,464.16 | 0.22 |
| 86 | 601117 | 中国化学 | 485,489 | 4,102,382.05 | 0.22 |
| 87 | 600406 | 国电南瑞 | 232,597 | 4,065,795.56 | 0.22 |
| 88 | 000425 | 徐工机械 | 304,505 | 4,056,006.60 | 0.22 |
| 89 | 002422 | 科伦药业 | 59,016 | 4,030,792.80 | 0.22 |
| 90 | 000623 | 吉林敖东 | 176,081 | 4,011,125.18 | 0.22 |
| 91 | 000060 | 中金岭南 | 355,243 | 4,007,141.04 | 0.22 |
| 92 | 601168 | 西部矿业 | 468,967 | 3,967,460.82 | 0.21 |
| 93 | 601669 | 中国水电 | 944,582 | 3,948,352.76 | 0.21 |
| 94 | 600123 | 兰花科创 | 168,666 | 3,843,898.14 | 0.21 |
| 95 | 000768 | 中航飞机 | 326,469 | 3,757,658.19 | 0.20 |
| 96 | 601600 | 中国铝业 | 707,024 | 3,747,227.20 | 0.20 |
| 97 | 601111 | 中国国航 | 614,727 | 3,725,245.62 | 0.20 |
| 98 | 601898 | 中煤能源 | 450,300 | 3,705,969.00 | 0.20 |
| 99 | 000970 | 中科三环 | 104,840 | 3,695,610.00 | 0.20 |
| 100 | 600066 | 宇通客车 | 121,482 | 3,622,593.24 | 0.20 |
| 101 | 600029 | 南方航空 | 863,770 | 3,576,007.80 | 0.19 |
| 102 | 000725 | 京东方Ａ | 1,498,488 | 3,521,446.80 | 0.19 |
| 103 | 002236 | 大华股份 | 68,611 | 3,497,102.67 | 0.19 |
| 104 | 600085 | 同仁堂 | 160,182 | 3,411,876.60 | 0.18 |
| 105 | 002142 | 宁波银行 | 283,731 | 3,345,188.49 | 0.18 |
| 106 | 601998 | 中信银行 | 677,010 | 3,330,889.20 | 0.18 |
| 107 | 600010 | 包钢股份 | 632,099 | 3,299,556.78 | 0.18 |
| 108 | 600009 | 上海机场 | 237,066 | 3,198,020.34 | 0.17 |
| 109 | 002081 | 金螳螂 | 76,499 | 3,188,478.32 | 0.17 |
| 110 | 002241 | 歌尔声学 | 83,374 | 3,186,554.28 | 0.17 |
| 111 | 600642 | 申能股份 | 697,954 | 3,161,731.62 | 0.17 |
| 112 | 600196 | 复星医药 | 281,100 | 3,156,753.00 | 0.17 |
| 113 | 000562 | 宏源证券 | 146,638 | 3,140,985.96 | 0.17 |
| 114 | 600100 | 同方股份 | 391,200 | 3,090,480.00 | 0.17 |
| 115 | 601958 | 金钼股份 | 238,095 | 3,083,330.25 | 0.17 |
| 116 | 002415 | 海康威视 | 98,782 | 3,074,095.84 | 0.17 |
| 117 | 600660 | 福耀玻璃 | 344,925 | 3,069,832.50 | 0.17 |
| 118 | 600068 | 葛洲坝 | 514,826 | 3,037,473.40 | 0.16 |
| 119 | 000709 | 河北钢铁 | 1,044,899 | 3,009,309.12 | 0.16 |
| 120 | 600600 | 青岛啤酒 | 85,592 | 2,996,575.92 | 0.16 |
| 121 | 601607 | 上海医药 | 236,580 | 2,990,371.20 | 0.16 |
| 122 | 000937 | 冀中能源 | 170,695 | 2,966,679.10 | 0.16 |
| 123 | 600369 | 西南证券 | 285,607 | 2,964,600.66 | 0.16 |
| 124 | 600005 | 武钢股份 | 993,198 | 2,959,730.04 | 0.16 |
| 125 | 601633 | 长城汽车 | 98,831 | 2,951,093.66 | 0.16 |
| 126 | 000728 | 国元证券 | 241,543 | 2,932,332.02 | 0.16 |
| 127 | 002038 | 双鹭药业 | 56,212 | 2,894,355.88 | 0.16 |
| 128 | 002353 | 杰瑞股份 | 44,813 | 2,876,546.47 | 0.16 |
| 129 | 600177 | 雅戈尔 | 328,580 | 2,868,503.40 | 0.15 |
| 130 | 600143 | 金发科技 | 453,621 | 2,866,884.72 | 0.15 |
| 131 | 600549 | 厦门钨业 | 67,100 | 2,822,897.00 | 0.15 |
| 132 | 600188 | 兖州煤业 | 145,628 | 2,820,814.36 | 0.15 |
| 133 | 000999 | 华润三九 | 96,257 | 2,819,367.53 | 0.15 |
| 134 | 000878 | 云南铜业 | 174,259 | 2,782,916.23 | 0.15 |
| 135 | 600881 | 亚泰集团 | 466,059 | 2,763,729.87 | 0.15 |
| 136 | 000012 | 南玻A | 322,952 | 2,748,321.52 | 0.15 |
| 137 | 600741 | 华域汽车 | 254,178 | 2,742,580.62 | 0.15 |
| 138 | 601992 | 金隅股份 | 306,424 | 2,733,302.08 | 0.15 |
| 139 | 002155 | 辰州矿业 | 131,951 | 2,695,758.93 | 0.15 |
| 140 | 601618 | 中国中冶 | 1,198,400 | 2,684,416.00 | 0.14 |
| 141 | 600694 | 大商股份 | 72,215 | 2,679,176.50 | 0.14 |
| 142 | 601666 | 平煤股份 | 290,415 | 2,671,818.00 | 0.14 |
| 143 | 000960 | 锡业股份 | 111,506 | 2,653,842.80 | 0.14 |
| 144 | 600497 | 驰宏锌锗 | 161,183 | 2,646,624.86 | 0.14 |
| 145 | 600166 | 福田汽车 | 345,552 | 2,633,106.24 | 0.14 |
| 146 | 000039 | 中集集团 | 181,766 | 2,606,524.44 | 0.14 |
| 147 | 000009 | 中国宝安 | 268,223 | 2,545,436.27 | 0.14 |
| 148 | 600208 | 新湖中宝 | 615,764 | 2,530,790.04 | 0.14 |
| 149 | 000061 | 农产品 | 403,037 | 2,523,011.62 | 0.14 |
| 150 | 002146 | 荣盛发展 | 184,134 | 2,506,063.74 | 0.14 |
| 151 | 601018 | 宁波港 | 944,659 | 2,503,346.35 | 0.14 |
| 152 | 600153 | 建发股份 | 330,329 | 2,484,074.08 | 0.13 |
| 153 | 600875 | 东方电气 | 163,689 | 2,406,228.30 | 0.13 |
| 154 | 002385 | 大北农 | 98,622 | 2,356,079.58 | 0.13 |
| 155 | 600637 | 百视通 | 137,019 | 2,355,356.61 | 0.13 |
| 156 | 600108 | 亚盛集团 | 335,233 | 2,343,278.67 | 0.13 |
| 157 | 600415 | 小商品城 | 334,751 | 2,336,561.98 | 0.13 |
| 158 | 600340 | 华夏幸福 | 86,818 | 2,328,458.76 | 0.13 |
| 159 | 600703 | 三安光电 | 177,660 | 2,322,016.20 | 0.13 |
| 160 | 600157 | 永泰能源 | 173,906 | 2,312,949.80 | 0.12 |
| 161 | 002310 | 东方园林 | 29,674 | 2,284,898.00 | 0.12 |
| 162 | 000758 | 中色股份 | 113,117 | 2,273,651.70 | 0.12 |
| 163 | 600809 | 山西汾酒 | 63,920 | 2,250,623.20 | 0.12 |
| 164 | 601717 | 郑煤机 | 203,355 | 2,245,039.20 | 0.12 |
| 165 | 600649 | 城投控股 | 367,450 | 2,241,445.00 | 0.12 |
| 166 | 600352 | 浙江龙盛 | 252,802 | 2,239,825.72 | 0.12 |
| 167 | 002106 | 莱宝高科 | 103,358 | 2,237,700.70 | 0.12 |
| 168 | 002202 | 金风科技 | 377,903 | 2,229,627.70 | 0.12 |
| 169 | 600804 | 鹏博士 | 329,274 | 2,206,135.80 | 0.12 |
| 170 | 000422 | 湖北宜化 | 176,672 | 2,183,665.92 | 0.12 |
| 171 | 600271 | 航天信息 | 136,300 | 2,179,437.00 | 0.12 |
| 172 | 600674 | 川投能源 | 242,650 | 2,178,997.00 | 0.12 |
| 173 | 600655 | 豫园商城 | 282,800 | 2,166,248.00 | 0.12 |
| 174 | 600062 | 华润双鹤 | 84,333 | 2,133,624.90 | 0.12 |
| 175 | 600863 | 内蒙华电 | 271,721 | 2,116,706.59 | 0.11 |
| 176 | 601333 | 广深铁路 | 695,235 | 2,113,514.40 | 0.11 |
| 177 | 000825 | 太钢不锈 | 560,498 | 2,113,077.46 | 0.11 |
| 178 | 600115 | 东方航空 | 574,238 | 2,107,453.46 | 0.11 |
| 179 | 600376 | 首开股份 | 183,801 | 2,106,359.46 | 0.11 |
| 180 | 600219 | 南山铝业 | 285,407 | 2,106,303.66 | 0.11 |
| 181 | 000401 | 冀东水泥 | 132,646 | 2,097,133.26 | 0.11 |
| 182 | 000528 | 柳工 | 193,714 | 2,080,488.36 | 0.11 |
| 183 | 600395 | 盘江股份 | 122,070 | 2,072,748.60 | 0.11 |
| 184 | 600886 | 国投电力 | 346,402 | 2,057,627.88 | 0.11 |
| 185 | 002570 | 贝因美 | 62,907 | 2,018,685.63 | 0.11 |
| 186 | 600267 | 海正药业 | 124,022 | 2,007,916.18 | 0.11 |
| 187 | 000933 | 神火股份 | 233,805 | 1,987,342.50 | 0.11 |
| 188 | 600839 | 四川长虹 | 908,400 | 1,962,144.00 | 0.11 |
| 189 | 002594 | 比亚迪 | 76,746 | 1,951,650.78 | 0.11 |
| 190 | 601901 | 方正证券 | 311,299 | 1,948,731.74 | 0.11 |
| 191 | 000750 | 国海证券 | 132,300 | 1,931,580.00 | 0.10 |
| 192 | 601888 | 中国国旅 | 64,874 | 1,925,460.32 | 0.10 |
| 193 | 600718 | 东软集团 | 211,431 | 1,921,907.79 | 0.10 |
| 194 | 600893 | 航空动力 | 133,992 | 1,906,706.16 | 0.10 |
| 195 | 601106 | 中国一重 | 643,347 | 1,904,307.12 | 0.10 |
| 196 | 000876 | 新希望 | 128,270 | 1,898,396.00 | 0.10 |
| 197 | 600058 | 五矿发展 | 105,500 | 1,886,340.00 | 0.10 |
| 198 | 600027 | 华电国际 | 438,346 | 1,867,353.96 | 0.10 |
| 199 | 000800 | 一汽轿车 | 200,125 | 1,847,153.75 | 0.10 |
| 200 | 000729 | 燕京啤酒 | 310,319 | 1,846,398.05 | 0.10 |
| 201 | 601118 | 海南橡胶 | 290,102 | 1,839,246.68 | 0.10 |
| 202 | 600316 | 洪都航空 | 105,865 | 1,836,757.75 | 0.10 |
| 203 | 000046 | 泛海建设 | 336,300 | 1,836,198.00 | 0.10 |
| 204 | 000898 | 鞍钢股份 | 453,855 | 1,829,035.65 | 0.10 |
| 205 | 002092 | 中泰化学 | 227,149 | 1,785,391.14 | 0.10 |
| 206 | 600109 | 国金证券 | 93,040 | 1,776,133.60 | 0.10 |
| 207 | 601101 | 昊华能源 | 118,101 | 1,762,066.92 | 0.10 |
| 208 | 601001 | 大同煤业 | 164,661 | 1,751,993.04 | 0.09 |
| 209 | 600118 | 中国卫星 | 112,719 | 1,750,526.07 | 0.09 |
| 210 | 600827 | 友谊股份 | 189,737 | 1,747,477.77 | 0.09 |
| 211 | 600125 | 铁龙物流 | 224,818 | 1,742,339.50 | 0.09 |
| 212 | 002007 | 华兰生物 | 70,828 | 1,733,869.44 | 0.09 |
| 213 | 600160 | 巨化股份 | 174,300 | 1,727,313.00 | 0.09 |
| 214 | 600971 | 恒源煤电 | 122,953 | 1,702,899.05 | 0.09 |
| 215 | 600259 | 广晟有色 | 30,693 | 1,697,936.76 | 0.09 |
| 216 | 002001 | 新和成 | 89,283 | 1,696,377.00 | 0.09 |
| 217 | 600516 | 方大炭素 | 157,275 | 1,693,851.75 | 0.09 |
| 218 | 002375 | 亚厦股份 | 62,493 | 1,664,188.59 | 0.09 |
| 219 | 600997 | 开滦股份 | 151,757 | 1,638,975.60 | 0.09 |
| 220 | 601179 | 中国西电 | 428,692 | 1,633,316.52 | 0.09 |
| 221 | 600372 | 中航电子 | 66,599 | 1,596,378.03 | 0.09 |
| 222 | 600169 | 太原重工 | 417,329 | 1,569,157.04 | 0.08 |
| 223 | 600664 | 哈药股份 | 235,878 | 1,568,588.70 | 0.08 |
| 224 | 601800 | 中国交建 | 286,473 | 1,567,007.31 | 0.08 |
| 225 | 601866 | 中海集运 | 585,403 | 1,557,171.98 | 0.08 |
| 226 | 000778 | 新兴铸管 | 235,758 | 1,530,069.42 | 0.08 |
| 227 | 601918 | 国投新集 | 136,560 | 1,529,472.00 | 0.08 |
| 228 | 000839 | 中信国安 | 231,444 | 1,511,329.32 | 0.08 |
| 229 | 600266 | 北京城建 | 109,398 | 1,508,598.42 | 0.08 |
| 230 | 601933 | 永辉超市 | 56,585 | 1,493,844.00 | 0.08 |
| 231 | 600779 | 水井坊 | 84,129 | 1,475,622.66 | 0.08 |
| 232 | 600582 | 天地科技 | 119,467 | 1,469,444.10 | 0.08 |
| 233 | 000686 | 东北证券 | 72,214 | 1,467,388.48 | 0.08 |
| 234 | 600216 | 浙江医药 | 63,914 | 1,461,074.04 | 0.08 |
| 235 | 601928 | 凤凰传媒 | 187,807 | 1,451,748.11 | 0.08 |
| 236 | 600096 | 云天化 | 102,381 | 1,448,691.15 | 0.08 |
| 237 | 000869 | 张裕A | 33,466 | 1,438,703.34 | 0.08 |
| 238 | 002073 | 软控股份 | 146,097 | 1,431,750.60 | 0.08 |
| 239 | 600598 | 北大荒 | 173,367 | 1,430,277.75 | 0.08 |
| 240 | 600331 | 宏达股份 | 203,114 | 1,425,860.28 | 0.08 |
| 241 | 000969 | 安泰科技 | 127,348 | 1,407,195.40 | 0.08 |
| 242 | 000718 | 苏宁环球 | 201,016 | 1,403,091.68 | 0.08 |
| 243 | 002128 | 露天煤业 | 97,884 | 1,390,931.64 | 0.08 |
| 244 | 600859 | 王府井 | 56,914 | 1,388,701.60 | 0.07 |
| 245 | 600432 | 吉恩镍业 | 99,767 | 1,386,761.30 | 0.07 |
| 246 | 600170 | 上海建工 | 170,699 | 1,384,368.89 | 0.07 |
| 247 | 601555 | 东吴证券 | 147,600 | 1,360,872.00 | 0.07 |
| 248 | 600498 | 烽火通信 | 59,369 | 1,351,238.44 | 0.07 |
| 249 | 002344 | 海宁皮城 | 41,204 | 1,347,370.80 | 0.07 |
| 250 | 000807 | 云铝股份 | 227,111 | 1,335,412.68 | 0.07 |
| 251 | 600895 | 张江高科 | 190,492 | 1,331,539.08 | 0.07 |
| 252 | 002299 | 圣农发展 | 112,051 | 1,306,514.66 | 0.07 |
| 253 | 600528 | 中铁二局 | 179,506 | 1,294,238.26 | 0.07 |
| 254 | 600221 | 海南航空 | 290,631 | 1,290,401.64 | 0.07 |
| 255 | 600970 | 中材国际 | 107,588 | 1,289,980.12 | 0.07 |
| 256 | 002405 | 四维图新 | 99,269 | 1,225,972.15 | 0.07 |
| 257 | 600588 | 用友软件 | 117,662 | 1,210,741.98 | 0.07 |
| 258 | 600508 | 上海能源 | 71,101 | 1,202,317.91 | 0.06 |
| 259 | 000059 | 辽通化工 | 147,654 | 1,176,802.38 | 0.06 |
| 260 | 002069 | 獐子岛 | 69,922 | 1,176,088.04 | 0.06 |
| 261 | 600770 | 综艺股份 | 190,185 | 1,175,343.30 | 0.06 |
| 262 | 601369 | 陕鼓动力 | 120,931 | 1,164,565.53 | 0.06 |
| 263 | 600550 | 天威保变 | 168,925 | 1,148,690.00 | 0.06 |
| 264 | 600132 | 重庆啤酒 | 71,426 | 1,132,816.36 | 0.06 |
| 265 | 601336 | 新华保险 | 38,960 | 1,128,671.20 | 0.06 |
| 266 | 600873 | 梅花集团 | 199,800 | 1,100,898.00 | 0.06 |
| 267 | 600037 | 歌华有线 | 156,436 | 1,085,665.84 | 0.06 |
| 268 | 002431 | 棕榈园林 | 38,300 | 1,083,507.00 | 0.06 |
| 269 | 600546 | 山煤国际 | 48,800 | 1,075,552.00 | 0.06 |
| 270 | 600022 | 山东钢铁 | 474,942 | 1,068,619.50 | 0.06 |
| 271 | 000559 | 万向钱潮 | 196,001 | 1,066,245.44 | 0.06 |
| 272 | 000961 | 中南建设 | 86,160 | 1,016,688.00 | 0.05 |
| 273 | 600456 | 宝钛股份 | 52,850 | 1,005,207.00 | 0.05 |
| 274 | 000780 | 平庄能源 | 99,827 | 991,282.11 | 0.05 |
| 275 | 002673 | 西部证券 | 60,000 | 933,000.00 | 0.05 |
| 276 | 000596 | 古井贡酒 | 28,270 | 902,378.40 | 0.05 |
| 277 | 000968 | 煤气化 | 64,046 | 892,801.24 | 0.05 |
| 278 | 002122 | 天马股份 | 148,566 | 870,596.76 | 0.05 |
| 279 | 002399 | 海普瑞 | 39,820 | 788,436.00 | 0.04 |
| 280 | 002603 | 以岭药业 | 27,543 | 677,833.23 | 0.04 |
| 281 | 600783 | 鲁信创投 | 55,713 | 671,898.78 | 0.04 |
| 282 | 601216 | 内蒙君正 | 96,003 | 664,340.76 | 0.04 |
| 283 | 601233 | 桐昆股份 | 72,177 | 633,714.06 | 0.03 |
| 284 | 002378 | 章源钨业 | 21,516 | 564,795.00 | 0.03 |
| 285 | 601238 | 广汽集团 | 53,245 | 371,117.65 | 0.02 |

* 1. 报告期内股票投资组合的重大变动
     1. 累计买入金额超出期末基金资产净值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 | 占期末基金资产净值比例（％） |
| 1 | 600036 | 招商银行 | 47,236,039.79 | 2.70 |
| 2 | 600016 | 民生银行 | 45,591,228.06 | 2.61 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 38,127,318.37 | 2.18 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 32,075,001.34 | 1.83 |
| 5 | 600000 | 浦发银行 | 27,993,510.21 | 1.60 |
| 6 | 601328 | 交通银行 | 27,594,392.80 | 1.58 |
| 7 | 000002 | 万科A | 25,617,427.60 | 1.46 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 22,315,525.15 | 1.28 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 21,255,036.20 | 1.22 |
| 10 | 601088 | 中国神华 | 20,252,511.67 | 1.16 |
| 11 | 600837 | 海通证券 | 20,115,776.04 | 1.15 |
| 12 | 601288 | 农业银行 | 17,663,980.36 | 1.01 |
| 13 | 601601 | 中国太保 | 17,204,952.68 | 0.98 |
| 14 | 601939 | 建设银行 | 15,459,022.75 | 0.88 |
| 15 | 000651 | 格力电器 | 15,418,847.18 | 0.88 |
| 16 | 600048 | 保利地产 | 14,595,059.36 | 0.83 |
| 17 | 601668 | 中国建筑 | 14,221,491.89 | 0.81 |
| 18 | 600104 | 上汽集团 | 13,870,751.30 | 0.79 |
| 19 | 601988 | 中国银行 | 13,621,357.19 | 0.78 |
| 20 | 600111 | 包钢稀土 | 13,113,807.67 | 0.75 |

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。

* + 1. 累计卖出金额超出期末基金资产净值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 | 占期末基金资产净值比例（％） |
| 1 | 601989 | 中国重工 | 127,865,113.06 | 7.31 |
| 2 | 601766 | 中国南车 | 120,722,978.99 | 6.90 |
| 3 | 600598 | 北大荒 | 106,632,710.45 | 6.10 |
| 4 | 600547 | 山东黄金 | 101,786,380.90 | 5.82 |
| 5 | 601919 | 中国远洋 | 93,432,979.72 | 5.34 |
| 6 | 600489 | 中金黄金 | 84,511,716.11 | 4.83 |
| 7 | 600150 | 中国船舶 | 78,784,897.20 | 4.50 |
| 8 | 601299 | 中国北车 | 77,065,273.71 | 4.41 |
| 9 | 600583 | 海油工程 | 74,526,652.48 | 4.26 |
| 10 | 600863 | 内蒙华电 | 69,825,017.44 | 3.99 |
| 11 | 600739 | 辽宁成大 | 68,170,042.65 | 3.90 |
| 12 | 601899 | 紫金矿业 | 56,697,142.40 | 3.24 |
| 13 | 600072 | 中船股份 | 39,065,726.45 | 2.23 |
| 14 | 601808 | 中海油服 | 37,644,319.22 | 2.15 |
| 15 | 000983 | 西山煤电 | 23,216,115.61 | 1.33 |
| 16 | 000630 | 铜陵有色 | 18,729,018.94 | 1.07 |
| 17 | 600362 | 江西铜业 | 14,774,332.04 | 0.84 |
| 18 | 600058 | 五矿发展 | 13,722,645.74 | 0.78 |
| 19 | 600808 | 马钢股份 | 13,713,923.20 | 0.78 |
| 20 | 002155 | 辰州矿业 | 8,467,987.80 | 0.48 |

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。

* + 1. 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 | 1,182,248,990.22 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,235,171,223.01 |

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。

* 1. 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 | 28,046,000.00 | 1.51 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 60,006,000.00 | 3.24 |
|  | 其中：政策性金融债 | 60,006,000.00 | 3.24 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 88,052,000.00 | 4.75 |

* 1. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 | 030201 | 03国开01 | 400,000 | 40,004,000.00 | 2.16 |
| 2 | 060001 | 06国债01 | 200,000 | 20,006,000.00 | 1.08 |
| 3 | 070228 | 07国开28 | 200,000 | 20,002,000.00 | 1.08 |
| 4 | 010308 | 03国债⑻ | 80,000 | 8,040,000.00 | 0.43 |

注：除以上债券外，本基金本报告期末未持有其他债券。

* 1. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

* 1. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

* 1. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

* 1. 投资组合报告附注

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。



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。

* + 1. 其他资产构成

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 序号 | 名称 | 金额 |
| 1 | 存出保证金 | 290,579.90 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,784,418.79 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,074,998.69 |

* + 1. 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

* + 1. 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

1. 投资组合报告(转型后)
   1. 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
| 1 | 权益投资 | 1,944,788,220.95 | 98.63 |
|  | 其中：股票 | 1,944,788,220.95 | 98.63 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
|  | 其中：债券 | - | - |
|  | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
|  | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 15,961,909.85 | 0.81 |
| 6 | 其他资产 | 10,966,771.14 | 0.56 |
| 7 | 合计 | 1,971,716,901.94 | 100.00 |

* 1. 期末按行业分类的股票投资组合
     1. 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 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 | 11,595,827.67 | 0.59 |
| B | 采矿业 | 145,508,254.46 | 7.41 |
| C | 制造业 | 691,048,994.79 | 35.18 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 62,647,802.49 | 3.19 |
| E | 建筑业 | 78,514,300.86 | 4.00 |
| F | 批发和零售业 | 51,162,363.81 | 2.60 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 41,689,499.76 | 2.12 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 40,587,462.14 | 2.07 |
| J | 金融业 | 656,931,714.75 | 33.44 |
| K | 房地产业 | 110,611,326.06 | 5.63 |
| L | 租赁和商务服务业 | 12,342,658.18 | 0.63 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 11,624,536.90 | 0.59 |
| 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 | 5,254,266.14 | 0.27 |
| S | 综合 | 25,269,212.94 | 1.29 |
|  | 合计 | 1,944,788,220.95 | 99.00 |

* + 1. 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资。

* 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(转型后)
     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 | 占基金资产净值比例（％） |
| 1 | 600016 | 民生银行 | 9,522,080 | 81,604,225.60 | 4.15 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 5,957,853 | 69,111,094.80 | 3.52 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 1,412,461 | 49,097,144.36 | 2.50 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 3,212,697 | 47,451,534.69 | 2.42 |
| 5 | 000002 | 万科A | 4,080,771 | 40,195,594.35 | 2.05 |
| 6 | 600000 | 浦发银行 | 4,718,105 | 39,065,909.40 | 1.99 |
| 7 | 600519 | 贵州茅台 | 175,106 | 33,685,141.22 | 1.71 |
| 8 | 600837 | 海通证券 | 3,411,340 | 31,998,369.20 | 1.63 |
| 9 | 600030 | 中信证券 | 2,903,322 | 29,410,651.86 | 1.50 |
| 10 | 601328 | 交通银行 | 6,618,609 | 26,937,738.63 | 1.37 |
| 11 | 601398 | 工商银行 | 6,555,968 | 26,354,991.36 | 1.34 |
| 12 | 601288 | XD农业银 | 10,519,740 | 25,878,560.40 | 1.32 |
| 13 | 000651 | 格力电器 | 1,014,418 | 25,421,315.08 | 1.29 |
| 14 | 601088 | 中国神华 | 1,390,356 | 23,552,630.64 | 1.20 |
| 15 | 601601 | 中国太保 | 1,325,156 | 21,109,735.08 | 1.07 |
| 16 | 601668 | 中国建筑 | 6,323,410 | 20,677,550.70 | 1.05 |
| 17 | 601818 | 光大银行 | 6,818,335 | 19,704,988.15 | 1.00 |
| 18 | 600887 | 伊利股份 | 597,524 | 18,690,550.72 | 0.95 |
| 19 | 600104 | 上汽集团 | 1,394,417 | 18,420,248.57 | 0.94 |
| 20 | 600048 | 保利地产 | 1,805,500 | 17,892,505.00 | 0.91 |
| 21 | 601169 | 北京银行 | 2,225,839 | 17,739,936.83 | 0.90 |
| 22 | 600256 | 广汇能源 | 1,329,570 | 17,231,227.20 | 0.88 |
| 23 | 000001 | 平安银行 | 1,727,836 | 17,226,524.92 | 0.88 |
| 24 | 601939 | 建设银行 | 4,044,305 | 16,783,865.75 | 0.85 |
| 25 | 000858 | 五粮液 | 800,110 | 16,034,204.40 | 0.82 |
| 26 | 601006 | 大秦铁路 | 2,506,924 | 14,891,128.56 | 0.76 |
| 27 | 000776 | 广发证券 | 1,247,714 | 13,824,671.12 | 0.70 |
| 28 | 600999 | 招商证券 | 1,323,855 | 13,768,092.00 | 0.70 |
| 29 | 600900 | 长江电力 | 1,985,388 | 13,738,884.96 | 0.70 |
| 30 | 600015 | 华夏银行 | 1,443,806 | 13,023,130.12 | 0.66 |
| 31 | 600383 | 金地集团 | 1,885,009 | 12,931,161.74 | 0.66 |
| 32 | 600111 | 包钢稀土 | 612,574 | 12,784,419.38 | 0.65 |
| 33 | 600518 | 康美药业 | 648,826 | 12,476,923.98 | 0.64 |
| 34 | 000538 | 云南白药 | 146,358 | 12,295,535.58 | 0.63 |
| 35 | 600585 | 海螺水泥 | 843,041 | 11,279,888.58 | 0.57 |
| 36 | 601857 | 中国石油 | 1,470,557 | 11,190,938.77 | 0.57 |
| 37 | 600050 | 中国联通 | 3,528,259 | 11,008,168.08 | 0.56 |
| 38 | 000895 | 双汇发展 | 278,304 | 10,698,005.76 | 0.54 |
| 39 | 000527 | 美的电器 | 856,000 | 10,631,520.00 | 0.54 |
| 40 | 000063 | 中兴通讯 | 829,327 | 10,573,919.25 | 0.54 |
| 41 | 600535 | 天士力 | 261,288 | 10,229,425.20 | 0.52 |
| 42 | 000157 | 中联重科 | 1,851,994 | 10,056,327.42 | 0.51 |
| 43 | 600547 | 山东黄金 | 312,379 | 10,036,737.27 | 0.51 |
| 44 | 600028 | 中国石化 | 2,325,118 | 9,718,993.24 | 0.49 |
| 45 | 600406 | 国电南瑞 | 650,883 | 9,717,683.19 | 0.49 |
| 46 | 600031 | 三一重工 | 1,284,351 | 9,645,476.01 | 0.49 |
| 47 | 000783 | 长江证券 | 1,204,452 | 9,527,215.32 | 0.49 |
| 48 | 600011 | 华能国际 | 1,770,558 | 9,454,779.72 | 0.48 |
| 49 | 002024 | 苏宁云商 | 1,867,466 | 9,356,004.66 | 0.48 |
| 50 | 002241 | 歌尔声学 | 257,374 | 9,340,102.46 | 0.48 |
| 51 | 600089 | 特变电工 | 1,111,015 | 8,943,670.75 | 0.46 |
| 52 | 600315 | 上海家化 | 198,423 | 8,927,050.77 | 0.45 |
| 53 | 601628 | 中国人寿 | 632,328 | 8,656,570.32 | 0.44 |
| 54 | 601989 | 中国重工 | 1,900,718 | 8,591,245.36 | 0.44 |
| 55 | 000423 | 东阿阿胶 | 220,604 | 8,532,962.72 | 0.43 |
| 56 | 600795 | 国电电力 | 3,631,700 | 8,280,276.00 | 0.42 |
| 57 | 600019 | 宝钢股份 | 2,083,154 | 8,186,795.22 | 0.42 |
| 58 | 000100 | TCL集团 | 3,573,200 | 8,111,164.00 | 0.41 |
| 59 | 601899 | 紫金矿业 | 3,331,107 | 7,928,034.66 | 0.40 |
| 60 | 000069 | 华侨城Ａ | 1,532,650 | 7,923,800.50 | 0.40 |
| 61 | 601117 | 中国化学 | 831,860 | 7,919,307.20 | 0.40 |
| 62 | 601788 | 光大证券 | 764,926 | 7,802,245.20 | 0.40 |
| 63 | 600276 | 恒瑞医药 | 286,673 | 7,556,700.28 | 0.38 |
| 64 | 600739 | 辽宁成大 | 575,314 | 7,548,119.68 | 0.38 |
| 65 | 600332 | 广州药业 | 218,470 | 7,484,782.20 | 0.38 |
| 66 | 600690 | 青岛海尔 | 681,893 | 7,439,452.63 | 0.38 |
| 67 | 002304 | 洋河股份 | 136,624 | 7,418,683.20 | 0.38 |
| 68 | 002236 | 大华股份 | 193,306 | 7,390,088.38 | 0.38 |
| 69 | 601009 | 南京银行 | 876,151 | 7,385,952.93 | 0.38 |
| 70 | 601988 | 中国银行 | 2,722,805 | 7,378,801.55 | 0.38 |
| 71 | 000625 | 长安汽车 | 792,695 | 7,364,136.55 | 0.37 |
| 72 | 600309 | 万华化学 | 455,797 | 7,301,867.94 | 0.37 |
| 73 | 601766 | 中国南车 | 1,986,196 | 7,150,305.60 | 0.36 |
| 74 | 601901 | 方正证券 | 1,285,752 | 7,110,208.56 | 0.36 |
| 75 | 000024 | 招商地产 | 290,488 | 7,053,048.64 | 0.36 |
| 76 | 002081 | 金螳螂 | 247,377 | 7,042,823.19 | 0.36 |
| 77 | 000568 | 泸州老窖 | 294,715 | 7,008,322.70 | 0.36 |
| 78 | 002353 | 杰瑞股份 | 100,728 | 6,950,232.00 | 0.35 |
| 79 | 600066 | 宇通客车 | 374,589 | 6,866,216.37 | 0.35 |
| 80 | 000725 | 京东方Ａ | 3,081,488 | 6,840,903.36 | 0.35 |
| 81 | 002038 | 双鹭药业 | 115,523 | 6,769,647.80 | 0.34 |
| 82 | 000338 | 潍柴动力 | 382,829 | 6,642,083.15 | 0.34 |
| 83 | 002450 | 康得新 | 236,631 | 6,620,935.38 | 0.34 |
| 84 | 600637 | 百视通 | 234,745 | 6,572,860.00 | 0.33 |
| 85 | 601299 | 中国北车 | 1,740,227 | 6,543,253.52 | 0.33 |
| 86 | 601336 | 新华保险 | 263,707 | 6,516,199.97 | 0.33 |
| 87 | 601991 | 大唐发电 | 1,263,978 | 6,496,846.92 | 0.33 |
| 88 | 600085 | 同仁堂 | 274,433 | 6,004,594.04 | 0.31 |
| 89 | 601633 | 长城汽车 | 169,154 | 5,991,434.68 | 0.31 |
| 90 | 002415 | 海康威视 | 169,332 | 5,984,192.88 | 0.30 |
| 91 | 600703 | 三安光电 | 304,376 | 5,977,944.64 | 0.30 |
| 92 | 600804 | 鹏博士 | 564,231 | 5,975,206.29 | 0.30 |
| 93 | 601377 | 兴业证券 | 657,648 | 5,971,443.84 | 0.30 |
| 94 | 002594 | 比亚迪 | 197,412 | 5,904,592.92 | 0.30 |
| 95 | 600489 | 中金黄金 | 620,361 | 5,763,153.69 | 0.29 |
| 96 | 600600 | 青岛啤酒 | 146,684 | 5,571,058.32 | 0.28 |
| 97 | 000581 | 威孚高科 | 166,768 | 5,568,383.52 | 0.28 |
| 98 | 600010 | 包钢股份 | 1,349,405 | 5,532,560.50 | 0.28 |
| 99 | 600362 | 江西铜业 | 349,981 | 5,508,700.94 | 0.28 |
| 100 | 601186 | 中国铁建 | 1,297,748 | 5,450,541.60 | 0.28 |
| 101 | 000983 | 西山煤电 | 664,254 | 5,420,312.64 | 0.28 |
| 102 | 002422 | 科伦药业 | 101,127 | 5,391,080.37 | 0.27 |
| 103 | 600583 | 海油工程 | 819,859 | 5,304,487.73 | 0.27 |
| 104 | 601390 | 中国中铁 | 2,161,622 | 5,274,357.68 | 0.27 |
| 105 | 002142 | 宁波银行 | 607,878 | 5,148,726.66 | 0.26 |
| 106 | 000012 | 南玻A | 553,428 | 5,130,277.56 | 0.26 |
| 107 | 000402 | 金融街 | 1,020,890 | 5,114,658.90 | 0.26 |
| 108 | 000009 | 中国宝安 | 459,813 | 5,057,943.00 | 0.26 |
| 109 | 600196 | 复星医药 | 481,700 | 5,048,216.00 | 0.26 |
| 110 | 600252 | 中恒集团 | 362,890 | 5,036,913.20 | 0.26 |
| 111 | 000768 | 中航飞机 | 559,345 | 4,978,170.50 | 0.25 |
| 112 | 600009 | 上海机场 | 406,209 | 4,842,011.28 | 0.25 |
| 113 | 600340 | 华夏幸福 | 148,763 | 4,840,748.02 | 0.25 |
| 114 | 000970 | 中科三环 | 359,206 | 4,684,046.24 | 0.24 |
| 115 | 601669 | 中国水电 | 1,618,782 | 4,662,092.16 | 0.24 |
| 116 | 601699 | 潞安环能 | 387,980 | 4,640,240.80 | 0.24 |
| 117 | 600100 | 同方股份 | 670,363 | 4,598,690.18 | 0.23 |
| 118 | 600348 | 阳泉煤业 | 506,932 | 4,582,665.28 | 0.23 |
| 119 | 000792 | 盐湖股份 | 268,245 | 4,544,070.30 | 0.23 |
| 120 | 000999 | 华润三九 | 152,701 | 4,519,949.60 | 0.23 |
| 121 | 002570 | 贝因美 | 161,654 | 4,518,229.30 | 0.23 |
| 122 | 002146 | 荣盛发展 | 315,602 | 4,453,144.22 | 0.23 |
| 123 | 000562 | 宏源证券 | 502,388 | 4,415,990.52 | 0.22 |
| 124 | 000623 | 吉林敖东 | 301,664 | 4,398,261.12 | 0.22 |
| 125 | 600649 | 城投控股 | 629,750 | 4,357,870.00 | 0.22 |
| 126 | 601168 | 西部矿业 | 803,646 | 4,347,724.86 | 0.22 |
| 127 | 601607 | 上海医药 | 405,380 | 4,309,189.40 | 0.22 |
| 128 | 601998 | 中信银行 | 1,160,297 | 4,304,701.87 | 0.22 |
| 129 | 600886 | 国投电力 | 1,263,654 | 4,271,150.52 | 0.22 |
| 130 | 000629 | 攀钢钒钛 | 1,810,598 | 4,254,905.30 | 0.22 |
| 131 | 600660 | 福耀玻璃 | 591,110 | 4,250,080.90 | 0.22 |
| 132 | 600674 | 川投能源 | 415,786 | 4,228,543.62 | 0.22 |
| 133 | 000800 | 一汽轿车 | 343,003 | 4,218,936.90 | 0.21 |
| 134 | 600029 | 南方航空 | 1,480,266 | 4,174,350.12 | 0.21 |
| 135 | 002375 | 亚厦股份 | 133,986 | 4,126,768.80 | 0.21 |
| 136 | 600352 | 浙江龙盛 | 439,629 | 4,123,720.02 | 0.21 |
| 137 | 000425 | 徐工机械 | 521,725 | 4,095,541.25 | 0.21 |
| 138 | 000060 | 中金岭南 | 608,763 | 4,030,011.06 | 0.21 |
| 139 | 601800 | 中国交建 | 990,392 | 4,011,087.60 | 0.20 |
| 140 | 002310 | 东方园林 | 102,220 | 3,914,003.80 | 0.20 |
| 141 | 600549 | 厦门钨业 | 143,747 | 3,838,044.90 | 0.20 |
| 142 | 601600 | 中国铝业 | 1,211,624 | 3,816,615.60 | 0.19 |
| 143 | 600005 | 武钢股份 | 1,702,098 | 3,812,699.52 | 0.19 |
| 144 | 600893 | 航空动力 | 229,692 | 3,785,324.16 | 0.19 |
| 145 | 601898 | 中煤能源 | 771,634 | 3,773,290.26 | 0.19 |
| 146 | 600150 | 中国船舶 | 232,424 | 3,758,296.08 | 0.19 |
| 147 | 000039 | 中集集团 | 363,510 | 3,755,058.30 | 0.19 |
| 148 | 600369 | 西南证券 | 489,543 | 3,754,794.81 | 0.19 |
| 149 | 600108 | 亚盛集团 | 574,475 | 3,745,577.00 | 0.19 |
| 150 | 600832 | 东方明珠 | 671,640 | 3,700,736.40 | 0.19 |
| 151 | 000963 | 华东医药 | 91,519 | 3,647,032.15 | 0.19 |
| 152 | 600642 | 申能股份 | 959,472 | 3,645,993.60 | 0.19 |
| 153 | 002344 | 海宁皮城 | 188,852 | 3,608,961.72 | 0.18 |
| 154 | 600694 | 大商股份 | 123,832 | 3,582,459.76 | 0.18 |
| 155 | 600153 | 建发股份 | 566,053 | 3,560,473.37 | 0.18 |
| 156 | 601808 | 中海油服 | 249,610 | 3,517,004.90 | 0.18 |
| 157 | 000728 | 国元证券 | 413,972 | 3,502,203.12 | 0.18 |
| 158 | 002202 | 金风科技 | 647,588 | 3,490,499.32 | 0.18 |
| 159 | 002385 | 大北农 | 338,085 | 3,489,037.20 | 0.18 |
| 160 | 600123 | 兰花科创 | 275,004 | 3,478,800.60 | 0.18 |
| 161 | 600068 | 葛洲坝 | 882,115 | 3,475,533.10 | 0.18 |
| 162 | 601555 | 东吴证券 | 505,879 | 3,465,271.15 | 0.18 |
| 163 | 600177 | 雅戈尔 | 563,213 | 3,441,231.43 | 0.18 |
| 164 | 600060 | 海信电器 | 330,468 | 3,433,562.52 | 0.17 |
| 165 | 600497 | 驰宏锌锗 | 351,468 | 3,426,813.00 | 0.17 |
| 166 | 600741 | 华域汽车 | 435,594 | 3,397,633.20 | 0.17 |
| 167 | 000729 | 燕京啤酒 | 591,699 | 3,378,601.29 | 0.17 |
| 168 | 600498 | 烽火通信 | 203,530 | 3,354,174.40 | 0.17 |
| 169 | 000709 | 河北钢铁 | 1,790,599 | 3,312,608.15 | 0.17 |
| 170 | 601618 | 中国中冶 | 2,053,673 | 3,306,413.53 | 0.17 |
| 171 | 601018 | 宁波港 | 1,618,759 | 3,269,893.18 | 0.17 |
| 172 | 600208 | 新湖中宝 | 1,055,364 | 3,261,074.76 | 0.17 |
| 173 | 601888 | 中国国旅 | 111,341 | 3,251,157.20 | 0.17 |
| 174 | 601958 | 金钼股份 | 408,093 | 3,236,177.49 | 0.16 |
| 175 | 000630 | 铜陵有色 | 299,601 | 3,229,698.78 | 0.16 |
| 176 | 600143 | 金发科技 | 666,286 | 3,218,161.38 | 0.16 |
| 177 | 600655 | 豫园商城 | 484,718 | 3,155,514.18 | 0.16 |
| 178 | 600881 | 亚泰集团 | 798,708 | 3,106,974.12 | 0.16 |
| 179 | 600271 | 航天信息 | 233,592 | 3,088,086.24 | 0.16 |
| 180 | 600863 | 内蒙华电 | 544,055 | 3,073,910.75 | 0.16 |
| 181 | 601111 | 中国国航 | 718,487 | 3,046,384.88 | 0.16 |
| 182 | 601933 | 永辉超市 | 258,939 | 3,021,818.13 | 0.15 |
| 183 | 600166 | 福田汽车 | 592,254 | 3,020,495.40 | 0.15 |
| 184 | 600718 | 东软集团 | 362,215 | 2,948,430.10 | 0.15 |
| 185 | 600516 | 方大炭素 | 362,327 | 2,934,848.70 | 0.15 |
| 186 | 600415 | 小商品城 | 573,701 | 2,902,927.06 | 0.15 |
| 187 | 000878 | 云南铜业 | 298,521 | 2,895,653.70 | 0.15 |
| 188 | 600875 | 东方电气 | 280,525 | 2,895,018.00 | 0.15 |
| 189 | 600062 | XD华润双 | 144,588 | 2,894,651.76 | 0.15 |
| 190 | 000876 | 新希望 | 293,040 | 2,886,444.00 | 0.15 |
| 191 | 600316 | 洪都航空 | 181,365 | 2,829,294.00 | 0.14 |
| 192 | 000046 | 泛海建设 | 576,363 | 2,812,651.44 | 0.14 |
| 193 | 600839 | 四川长虹 | 1,556,800 | 2,786,672.00 | 0.14 |
| 194 | 600811 | 东方集团 | 562,100 | 2,771,153.00 | 0.14 |
| 195 | 600115 | 东方航空 | 1,072,624 | 2,745,917.44 | 0.14 |
| 196 | 002007 | 华兰生物 | 121,448 | 2,742,295.84 | 0.14 |
| 197 | 601333 | 广深铁路 | 1,191,335 | 2,740,070.50 | 0.14 |
| 198 | 002106 | 莱宝高科 | 178,492 | 2,739,852.20 | 0.14 |
| 199 | 600118 | 中国卫星 | 193,188 | 2,739,405.84 | 0.14 |
| 200 | 601928 | 凤凰传媒 | 321,854 | 2,706,792.14 | 0.14 |
| 201 | 600267 | 海正药业 | 212,359 | 2,701,206.48 | 0.14 |
| 202 | 600809 | 山西汾酒 | 109,520 | 2,683,240.00 | 0.14 |
| 203 | 600598 | 北大荒 | 315,671 | 2,635,852.85 | 0.13 |
| 204 | 601992 | 金隅股份 | 525,138 | 2,625,690.00 | 0.13 |
| 205 | 600376 | 首开股份 | 472,602 | 2,622,941.10 | 0.13 |
| 206 | 601238 | 广汽集团 | 355,931 | 2,619,652.16 | 0.13 |
| 207 | 600157 | 永泰能源 | 447,079 | 2,615,412.15 | 0.13 |
| 208 | 601666 | 平煤股份 | 497,665 | 2,587,858.00 | 0.13 |
| 209 | 000937 | 冀中能源 | 292,514 | 2,582,898.62 | 0.13 |
| 210 | 000061 | 农产品 | 429,220 | 2,579,612.20 | 0.13 |
| 211 | 000839 | 中信国安 | 396,556 | 2,557,786.20 | 0.13 |
| 212 | 000758 | 中色股份 | 249,081 | 2,523,190.53 | 0.13 |
| 213 | 000422 | 湖北宜化 | 372,756 | 2,516,103.00 | 0.13 |
| 214 | 600546 | 山煤国际 | 208,948 | 2,473,944.32 | 0.13 |
| 215 | 600664 | 哈药股份 | 404,178 | 2,400,817.32 | 0.12 |
| 216 | 002500 | 山西证券 | 404,683 | 2,395,723.36 | 0.12 |
| 217 | 002294 | 信立泰 | 82,679 | 2,392,730.26 | 0.12 |
| 218 | 600372 | 中航电子 | 114,080 | 2,389,976.00 | 0.12 |
| 219 | 000960 | 锡业股份 | 194,102 | 2,368,044.40 | 0.12 |
| 220 | 600027 | 华电国际 | 751,183 | 2,366,226.45 | 0.12 |
| 221 | 002155 | 辰州矿业 | 293,989 | 2,363,671.56 | 0.12 |
| 222 | 600188 | 兖州煤业 | 249,568 | 2,345,939.20 | 0.12 |
| 223 | 000750 | 国海证券 | 226,661 | 2,339,141.52 | 0.12 |
| 224 | 600219 | 南山铝业 | 489,214 | 2,294,413.66 | 0.12 |
| 225 | 002001 | 新和成 | 152,990 | 2,255,072.60 | 0.11 |
| 226 | 600216 | 浙江医药 | 109,679 | 2,250,613.08 | 0.11 |
| 227 | 002051 | 中工国际 | 80,596 | 2,246,210.52 | 0.11 |
| 228 | 600827 | 友谊股份 | 325,233 | 2,234,350.71 | 0.11 |
| 229 | 601106 | 中国一重 | 1,102,447 | 2,226,942.94 | 0.11 |
| 230 | 601717 | 郑煤机 | 348,493 | 2,178,081.25 | 0.11 |
| 231 | 000528 | 柳工 | 332,072 | 2,158,468.00 | 0.11 |
| 232 | 601098 | 中南传媒 | 227,180 | 2,112,774.00 | 0.11 |
| 233 | 601099 | 太平洋 | 418,236 | 2,099,544.72 | 0.11 |
| 234 | 601158 | 重庆水务 | 404,700 | 2,084,205.00 | 0.11 |
| 235 | 601118 | 海南橡胶 | 497,122 | 2,058,085.08 | 0.10 |
| 236 | 600125 | 铁龙物流 | 385,236 | 2,041,750.80 | 0.10 |
| 237 | 000718 | 苏宁环球 | 344,493 | 2,025,618.84 | 0.10 |
| 238 | 600221 | 海南航空 | 995,962 | 2,011,843.24 | 0.10 |
| 239 | 000686 | 东北证券 | 123,794 | 2,010,414.56 | 0.10 |
| 240 | 600170 | 上海建工 | 292,499 | 2,000,693.16 | 0.10 |
| 241 | 000778 | 新兴铸管 | 404,040 | 1,983,836.40 | 0.10 |
| 242 | 002092 | 中泰化学 | 389,345 | 1,977,872.60 | 0.10 |
| 243 | 600058 | 五矿发展 | 180,790 | 1,970,611.00 | 0.10 |
| 244 | 601258 | 庞大集团 | 331,568 | 1,959,566.88 | 0.10 |
| 245 | 000869 | 张裕A | 57,372 | 1,958,680.08 | 0.10 |
| 246 | 600259 | 广晟有色 | 52,532 | 1,931,601.64 | 0.10 |
| 247 | 601866 | 中海集运 | 1,003,203 | 1,926,149.76 | 0.10 |
| 248 | 600266 | 北京城建 | 187,472 | 1,917,838.56 | 0.10 |
| 249 | 600395 | 盘江股份 | 209,320 | 1,915,278.00 | 0.10 |
| 250 | 600109 | 国金证券 | 163,695 | 1,882,492.50 | 0.10 |
| 251 | 000401 | 冀东水泥 | 227,192 | 1,867,518.24 | 0.10 |
| 252 | 600132 | 重庆啤酒 | 122,426 | 1,840,062.78 | 0.09 |
| 253 | 600588 | 用友软件 | 202,162 | 1,807,328.28 | 0.09 |
| 254 | 000933 | 神火股份 | 400,605 | 1,786,698.30 | 0.09 |
| 255 | 601918 | 国投新集 | 234,260 | 1,768,663.00 | 0.09 |
| 256 | 600160 | 巨化股份 | 298,642 | 1,741,082.86 | 0.09 |
| 257 | 002299 | 圣农发展 | 191,951 | 1,735,237.04 | 0.09 |
| 258 | 600895 | 张江高科 | 326,457 | 1,730,222.10 | 0.09 |
| 259 | 600403 | 大有能源 | 202,101 | 1,721,900.52 | 0.09 |
| 260 | 600970 | 中材国际 | 184,342 | 1,695,946.40 | 0.09 |
| 261 | 000969 | 安泰科技 | 218,239 | 1,693,534.64 | 0.09 |
| 262 | 600096 | 云天化 | 211,080 | 1,686,529.20 | 0.09 |
| 263 | 000027 | 深圳能源 | 334,205 | 1,681,051.15 | 0.09 |
| 264 | 600169 | 太原重工 | 715,329 | 1,666,716.57 | 0.08 |
| 265 | 600779 | 水井坊 | 144,129 | 1,651,718.34 | 0.08 |
| 266 | 600971 | 恒源煤电 | 210,790 | 1,623,083.00 | 0.08 |
| 267 | 601001 | 大同煤业 | 282,263 | 1,617,366.99 | 0.08 |
| 268 | 601101 | 昊华能源 | 202,301 | 1,604,246.93 | 0.08 |
| 269 | 600550 | 天威保变 | 289,363 | 1,579,921.98 | 0.08 |
| 270 | 600859 | 王府井 | 97,587 | 1,572,126.57 | 0.08 |
| 271 | 600432 | 吉恩镍业 | 170,974 | 1,489,183.54 | 0.08 |
| 272 | 600528 | 中铁二局 | 307,607 | 1,488,817.88 | 0.08 |
| 273 | 601139 | 深圳燃气 | 167,001 | 1,484,638.89 | 0.08 |
| 274 | 600997 | 开滦股份 | 260,257 | 1,483,464.90 | 0.08 |
| 275 | 002431 | 棕榈园林 | 77,731 | 1,473,779.76 | 0.08 |
| 276 | 002128 | 露天煤业 | 167,777 | 1,466,370.98 | 0.07 |
| 277 | 000807 | 云铝股份 | 389,308 | 1,448,225.76 | 0.07 |
| 278 | 000961 | 中南建设 | 147,681 | 1,444,320.18 | 0.07 |
| 279 | 002069 | 獐子岛 | 119,922 | 1,421,075.70 | 0.07 |
| 280 | 000539 | 粤电力Ａ | 312,774 | 1,413,738.48 | 0.07 |
| 281 | 601369 | 陕鼓动力 | 207,204 | 1,398,627.00 | 0.07 |
| 282 | 600582 | 天地科技 | 204,717 | 1,314,283.14 | 0.07 |
| 283 | 000703 | 恒逸石化 | 145,866 | 1,255,906.26 | 0.06 |
| 284 | 600783 | 鲁信创投 | 94,113 | 1,249,820.64 | 0.06 |
| 285 | 002399 | 海普瑞 | 67,475 | 1,201,055.00 | 0.06 |
| 286 | 600508 | 上海能源 | 121,852 | 1,184,401.44 | 0.06 |
| 287 | 002673 | 西部证券 | 101,200 | 1,172,908.00 | 0.06 |
| 288 | 000059 | 辽通化工 | 253,054 | 1,146,334.62 | 0.06 |
| 289 | 000656 | 金科股份 | 97,711 | 1,132,470.49 | 0.06 |
| 290 | 002603 | 以岭药业 | 46,598 | 1,060,570.48 | 0.05 |
| 291 | 600873 | 梅花集团 | 262,110 | 1,040,576.70 | 0.05 |
| 292 | 000596 | 古井贡酒 | 48,541 | 1,013,536.08 | 0.05 |
| 293 | 000780 | 平庄能源 | 171,021 | 918,382.77 | 0.05 |
| 294 | 002269 | 美邦服饰 | 84,764 | 749,313.76 | 0.04 |
| 295 | 002378 | 章源钨业 | 36,067 | 672,649.55 | 0.03 |
| 296 | 603993 | 洛阳钼业 | 84,340 | 565,078.00 | 0.03 |
| 297 | 000156 | 华数传媒 | 27,000 | 434,700.00 | 0.02 |
| 298 | 000883 | 湖北能源 | 88,521 | 427,556.43 | 0.02 |

* + 1. 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所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资。

* 1. 报告期内股票投资组合的重大变动
     1. 累计买入金额超出期末基金资产净值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 | 600157 | 永泰能源 | 201,641,656.90 | 10.27 |
| 2 | 600266 | 北京城建 | 190,875,056.27 | 9.72 |
| 3 | 002106 | 莱宝高科 | 149,704,582.09 | 7.62 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 113,469,433.10 | 5.78 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 104,652,597.54 | 5.33 |
| 6 | 601179 | 中国西电 | 98,043,222.81 | 4.99 |
| 7 | 601106 | 中国一重 | 96,719,078.54 | 4.92 |
| 8 | 600036 | 招商银行 | 90,464,005.53 | 4.61 |
| 9 | 601166 | 兴业银行 | 69,816,744.21 | 3.55 |
| 10 | 600125 | 铁龙物流 | 59,446,726.29 | 3.03 |
| 11 | 600000 | 浦发银行 | 58,364,271.66 | 2.97 |
| 12 | 601398 | 工商银行 | 57,153,438.90 | 2.91 |
| 13 | 000002 | 万科A | 55,638,108.78 | 2.83 |
| 14 | 002344 | 海宁皮城 | 53,309,197.54 | 2.71 |
| 15 | 600519 | 贵州茅台 | 44,855,693.36 | 2.28 |
| 16 | 600030 | 中信证券 | 44,296,510.69 | 2.26 |
| 17 | 601328 | 交通银行 | 43,503,521.16 | 2.21 |
| 18 | 600837 | 海通证券 | 43,483,553.22 | 2.21 |
| 19 | 600352 | 浙江龙盛 | 36,249,443.22 | 1.85 |
| 20 | 601088 | 中国神华 | 35,788,767.82 | 1.82 |

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。

* + 1. 累计卖出金额超出期末基金资产净值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 | 600266 | 北京城建 | 171,891,567.99 | 8.75 |
| 2 | 600157 | 永泰能源 | 148,209,291.41 | 7.54 |
| 3 | 002106 | 莱宝高科 | 144,484,223.34 | 7.36 |
| 4 | 601179 | 中国西电 | 91,085,330.66 | 4.64 |
| 5 | 601106 | 中国一重 | 88,572,575.76 | 4.51 |
| 6 | 600125 | 铁龙物流 | 49,492,378.57 | 2.52 |
| 7 | 002344 | 海宁皮城 | 49,277,579.67 | 2.51 |
| 8 | 601318 | 中国平安 | 37,541,504.39 | 1.91 |
| 9 | 600352 | 浙江龙盛 | 33,979,743.98 | 1.73 |
| 10 | 601333 | 广深铁路 | 26,011,754.36 | 1.32 |
| 11 | 601669 | 中国水电 | 16,994,640.44 | 0.87 |
| 12 | 601216 | 内蒙君正 | 12,235,493.82 | 0.62 |
| 13 | 601988 | 中国银行 | 10,060,400.66 | 0.51 |
| 14 | 000581 | 威孚高科 | 9,432,315.08 | 0.48 |
| 15 | 002236 | 大华股份 | 8,394,186.24 | 0.43 |
| 16 | 601328 | 交通银行 | 8,324,861.24 | 0.42 |
| 17 | 000970 | 中科三环 | 6,861,597.07 | 0.35 |
| 18 | 600489 | 中金黄金 | 5,566,128.22 | 0.28 |
| 19 | 601939 | 建设银行 | 5,180,391.05 | 0.26 |
| 20 | 000783 | 长江证券 | 4,700,959.90 | 0.24 |

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。

* + 1. 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 | 2,552,217,946.82 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,121,815,060.57 |

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。

* 1. 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

* 1. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

* 1. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

* 1. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

* 1. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
     1. 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

* + 1. 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。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。

* 1. 投资组合报告附注

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。

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。

* + 1. 其他资产构成

单位：人民币元

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 序号 | 名称 | 金额 |
| 1 | 存出保证金 | 1,092,057.36 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,302,466.26 |
| 3 | 应收股利 | 5,569,430.78 |
| 4 | 应收利息 | 2,816.74 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 10,966,771.14 |

* + 1. 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

* + 1. 末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

1. 基金份额持有人信息(转型前)
   1. 期末基金份额持有人户数及持有人结构

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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 |
| 47,308 | 42,276.00 | 1,166,119,510.00 | 58.31% | 833,880,490.00 | 41.69% |

* 1. 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 | 中国人寿保险股份有限公司 | 199,999,972 | 10.00% |
| 2 | 中国人寿保险（集团）公司 | 192,472,930 | 9.62% |
| 3 | 太平人寿保险有限公司 | 89,221,378 | 4.46% |
| 4 | 招商证券股份有限公司 | 79,954,044 | 4.00% |
| 5 | 中国太平洋人寿保险股份有限公司－传统－普通保险产品 | 70,279,726 | 3.51% |
| 6 | 幸福人寿保险股份有限公司-分红 | 61,833,581 | 3.09% |
| 7 | 泰康人寿保险股份有限公司－分红－个人分红-019L-FH002深 | 59,809,554 | 2.99% |
| 8 | 南方基金管理有限公司 | 50,686,168 | 2.53% |
| 9 | 中国人寿资产管理有限公司 | 40,046,817 | 2.00% |
| 10 | 泰康资产管理有限责任公司－开泰－稳健增值投资产品 | 39,999,608 | 2.00% |

* 1. 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额；本只基金的基金经理未持有本基金份额。

1. 基金份额持有人信息(转型后)
   1. 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 | | 中国工商银行－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 | |
| 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 |
| 47,281 | 48,924.50 | 1,622,853,455.00 | 70.16% | 690,345,996.00 | 29.84% | 864,409,669.00 | 37.37% |

注：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－南方开元沪深300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。

* 1. 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 | 中国华电集团资本控股有限公司 | 199,999,800.00 | 8.65% |
| 2 | 中国人民财产保险股份有限公司－传统－普通保险产品 | 100,020,110.00 | 4.32% |
| 3 | 中国太平洋人寿保险股份有限公司－传统－普通保险产品 | 61,616,084.00 | 2.66% |
| 4 | 泰康人寿保险股份有限公司－分红－个人分红-019L-FH002深 | 52,436,609.00 | 2.27% |
| 5 | 西南证券股份有限公司 | 50,001,458.00 | 2.16% |
| 6 | 南方基金管理有限公司 | 44,437,896.00 | 1.92% |
| 7 | 华泰证券股份有限公司 | 41,377,228.00 | 1.79% |
| 8 | 中国太平洋财产保险－传统－普通保险产品-013C-CT001深 | 30,882,726.00 | 1.34% |
| 9 | 宝钢集团有限公司 | 29,019,640.00 | 1.26% |
| 10 | 太平人寿保险有限公司 | 26,301,789.00 | 1.14% |
|  | 中国工商银行－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 | 864,409,669.00 | 37.37% |

* 1. 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金份额，本基金基金经理未持有本基金份额。

1. 开放式基金份额变动

单位：份

|  |  |
| --- | --- |
| 基金合同生效日（2013年2月18日）基金份额总额 | 2,000,000,000.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 3,011,746,859.00 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 2,452,000,000.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -246,547,408.00 |
| 报告期期末基金份额总额 | 2,313,199,451.00 |

1. 重大事件揭示
   1. 基金份额持有人大会决议

|  |
| --- |
| 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金是根据原开元证券投资基金 (以下简称“基金开元”)基金份额持有人大会2013年1月4日决议通过的《关于开元证券投资基金转型有关事项的议案》，同意将开元证券投资基金变更为南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金。 |

* 1. 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

|  |
| --- |
| 经中国证监会基金部【2013】13号文函复，基金管理人于2013年1月5日发布公告，自2013年1月1日起，高良玉不再担任公司总经理职务，由董事长吴万善代为履行公司总经理职务。  经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】 1087 号文核准，基金管理人于2013年8月22日发布公告，自2013年8月22日起，杨小松转任公司总经理职务，不再担任公司督察长职务；由鲍文革担任公司督察长职务。  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。 |

* 1. 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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。 |

* 1. 基金投资策略的改变

|  |
| --- |
| 根据开元证券投资基金持有人大会决议，本基金投资策略修改为：“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”。 |

* 1. 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。 |

* 1. 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

|  |
| --- |
| 因基金管理人管理的南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金（“开元300ETF”）在集中申购期超过沪深300指数自然权重大比例接受停牌的永泰能源股票换购，然后在建仓期大比例卖出超过沪深300自然权重的部分股票，致使基金资产受到较大损失，2013年4月19日中国证监会向公司下发了《关于对南方基金管理有限公司采取责令整改等措施的决定》（【2013】18号）的行政监管措施决定书，认为基金管理人在开元300ETF投资过程中未能履行谨慎勤勉义务，内部控制方面存在内部控制制度建设薄弱，缺乏ETF募集期股票换购的相关制度规定；合规及风控管理未能覆盖ETF基金投资环节；关于永泰能源的相关决策未能留痕等。鉴于上述情况，按照《证券投资基金管理公司管理办法》第七十五条的规定，中国证监会责令公司进行为期3个月的整改，在整改期间暂停受理和审核公司所有新产品和新业务申请。  基金管理人于2013年4月24日发布了《南方开元沪深300ETF基金持有人补偿公告》，对开元300ETF超比例接受永泰能源股票换购给相关基金份额持有人造成的经济损失进行了补偿, 实际补偿金额为47,996,008.62元。  同时，基金管理人就公司内部管理、合规及风险控制制度建设、ETF募集及投资管理程序方面的问题进行了一一整改, 并向中国证监会及其深圳监管局提交了整改报告, 目前已完成整改工作、经监管部门现场检查并验收合格。  除上述情况外，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。 |

* 1. 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后)
     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 |
| 海通证券 | 1 | 1,175,216,684.96 | 31.99% | 1,069,906.85 | 32.23% | - |
| 光大证券 | 1 | 1,308,958,081.20 | 35.63% | 1,191,680.12 | 35.90% | - |
| 银河证券 | 1 | 572,894,756.44 | 15.59% | 506,959.91 | 15.27% | - |
| 华创证券 | 1 | 332,922,338.31 | 9.06% | 294,604.27 | 8.88% | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | 122,854,544.15 | 3.34% | 111,846.96 | 3.37% | 本期新增交易单元 |
| 东北证券 | 1 | 65,598,473.10 | 1.79% | 58,047.94 | 1.75% | 本期新增交易单元 |
| 东吴证券 | 1 | 53,102,680.48 | 1.45% | 48,345.41 | 1.46% | - |
| 齐鲁证券 | 1 | 27,221,123.54 | 0.74% | 24,088.01 | 0.73% | - |
| 国信证券 | 1 | 11,353,035.86 | 0.31% | 10,336.11 | 0.31% | - |
| 中信证券 | 1 | 3,911,289.35 | 0.11% | 3,560.92 | 0.11% | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 南京证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 红塔证券 | 1 | - | - | - | - | - |

* + 1. 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 | |
| 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 |
| 海通证券 | 8,141,430.08 | 51.05% | - | - | - | - |
| 光大证券 | 7,806,465.40 | 48.95% | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 齐鲁证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 南京证券 | - | - | - | - | - | - |
| 红塔证券 | - | - | - | - | - | - |

* 1. 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)
     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 |
| 海通证券 | 1 | 866,166,775.37 | 35.83% | 788,555.18 | 35.99% | - |
| 光大证券 | 1 | 680,088,692.18 | 28.13% | 619,153.29 | 28.25% | - |
| 招商证券 | 1 | 273,177,250.07 | 11.30% | 248,607.86 | 11.35% | - |
| 中信证券 | 1 | 229,518,847.56 | 9.49% | 208,942.07 | 9.54% | - |
| 红塔证券 | 1 | 154,217,624.02 | 6.38% | 136,467.04 | 6.23% | - |
| 银河证券 | 1 | 116,897,182.23 | 4.84% | 103,442.23 | 4.72% | - |
| 华创证券 | 1 | 68,750,022.74 | 2.84% | 60,837.02 | 2.78% | - |
| 华泰证券 | 1 | 28,603,819.06 | 1.18% | 25,311.71 | 1.16% | - |
| 南京证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 齐鲁证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 1 | - | - | - | - | - |

* + 1. 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 | |
| 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 |
| 海通证券 | - | - | 350,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 91,882,970.32 | 89.64% | - | - | - | - |
| 中信证券 | 10,620,210.40 | 10.36% | - | - | - | - |
| 红塔证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 南京证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 齐鲁证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |

* 1. 其他重大事件（转型后）

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 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集中申购期基金份额发售公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年2月20日 |
| 2 | 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金上网发售提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年2月25日 |
| 3 | 南方基金关于旗下部分基金增加东兴证券为代销机构及开通转换业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年3月1日 |
| 4 | 关于南方开元沪深300交易型开放式指数基金集中申购时间的提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年3月7日 |
| 5 | 关于南方开元沪深300ETF基金集中申购结果和原基金开元份额折算结果的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年3月18日 |
| 6 | 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金开放申购赎回业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年4月8日 |
| 7 | 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年4月8日 |
| 8 | 关于南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金调整申购赎回代理券商的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年4月11日 |
| 9 | 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年4月11日 |
| 10 | 公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年4月20日 |
| 11 | 关于南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金变更基金经理的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年4月22日 |
| 12 | 南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金补偿公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年4月24日 |
| 13 | 关于注意防范冒用南方基金名义进行的非法证券活动的提示 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年5月10日 |
| 14 | 关于南方开元沪深300交易型开放式指数证券投资基金变更基金经理的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年5月18日 |
| 15 | 关于冒用我司客服热线4008898899套取投资者个人信息的提示 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年6月20日 |

* 1. 其他重大事件（转型前）

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
| 1 | 基金行业高级管理人员变更公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年1月5日 |
| 2 | 关于开元证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年1月7日 |
| 3 | 关于注意防范冒用南方基金名义进行非法证券活动的提示 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年1月30日 |
| 4 | 开元证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年1月30日 |
| 5 | 开元证券投资基金终止上市公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年2月4日 |
| 6 | 开元证券投资基金终止上市的提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013年2月7日 |

1. 备查文件目录
   1. 备查文件目录

1、中国证监会批准设立开元证券投资基金的文件。

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托管协议》

4、《开元证券投资基金基金合同》

5、《开元证券投资基金托管协议》

6、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。

7、报告期内在选定报刊披露的各项公告。

* 1. 存放地点

深圳市福田中心区福华1路6号免税商务大厦31至33楼

* 1. 查阅方式

公司网站：http://www.nffund.com