

南方君选灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：中信银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 02 月 03 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息	42

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	42
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	44
§11 备查文件目录.....	47
11.1 备查文件目录.....	47
11.2 存放地点.....	47
11.3 查阅方式.....	47

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方君选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	南方君选灵活配置混合
基金主代码	001536
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 2 月 3 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	203,171,526.01 份
基金合同存续期	不定期

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“南方君选”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，根据对上市公司的业绩质量、成长性与投资价值的权衡与精选，以为投资人获取长期稳定的绝对收益为投资目标。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	人民币一年期定期存款利率（税后）+5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	方韡
	联系电话	0755-82763888	010-89936330
	电子邮箱	manager@southernfund.com	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		400-889-8899	95558
传真		0755-82763889	010-65550832

注册地址	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京市东城区朝阳门北大街 9 号
办公地址	深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层	北京市东城区朝阳门北大街 9 号
邮政编码	518048	100027
法定代表人	吴万善	常振明

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 2 月 3 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,422,750.83
本期利润	7,037,947.87
加权平均基金份额本期利润	0.0247
本期加权平均净值利润率	2.45%
本期基金份额净值增长率	2.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	3,005,562.81
期末可供分配基金份额利润	0.0148
期末基金资产净值	207,666,221.98
期末基金份额净值	1.022
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	2.20%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣

除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

4. 本基金自基金合同生效日 (2016 年 2 月 3 日) 至报告期末不满半年。

3.2 基金净值表现

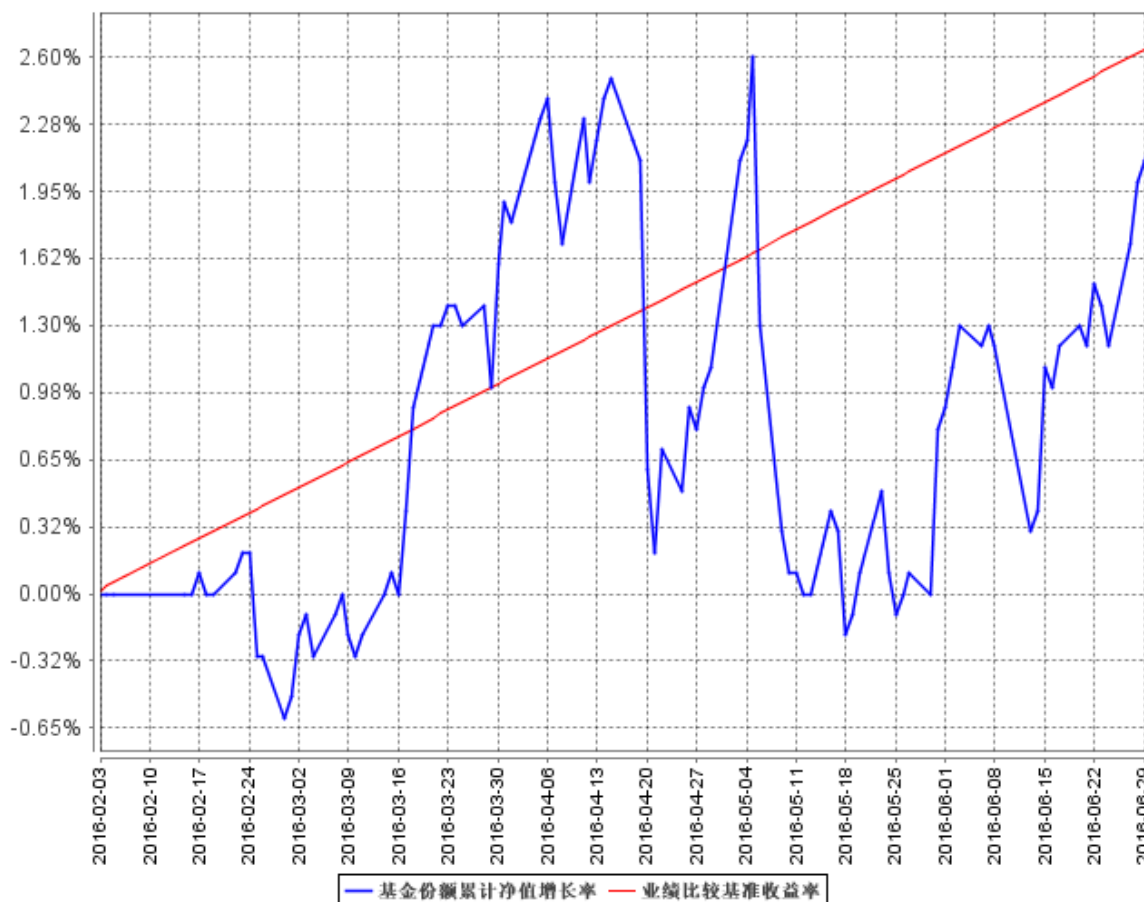
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.39%	0.31%	0.52%	0.02%	0.87%	0.29%
过去三个月	0.29%	0.43%	1.60%	0.02%	-1.31%	0.41%
自基金合同生效起至今	2.20%	0.37%	2.65%	0.02%	-0.45%	0.35%

注: 本基金的业绩比较基准为中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率 (税后) + 5%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金合同生效日至本报告期末不满一年，本基金建仓期为六个月，至本报告期末，建仓期尚未结束。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

南方基金总部设在深圳，注册资本3亿元人民币。股东结构为：华泰证券股份有限公司（45%）；深圳市投资控股有限公司（30%）；厦门国际信托有限公司（15%）；兴业证券股份有限公司（10%）。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司一

一南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 5,600 亿元，旗下管理 96 只开放式基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
茅炜	本基金基金经理、研究部总监	2016 年 2 月 3 日	-	8 年	上海财经大学保险学学士，具有基金从业资格。曾任职于东方人寿保险公司及生命人寿保险公司，担任保险精算员，在国金证券研究所任职期间，担任保险及金融行业研究员。2009 年加入南方基金，任研究部保险及金融行业研究员；2012 年 3 月至今，历任研究部总监助理、副总监、执行总监，现任研究部总监；2012 年 10 月至 2016 年 1 月，兼任专户投资管理部投资经理；2016 年 2 月至今，任南方君选基金经理，任境内权益投资决策委员会委员。

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，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方君选灵活配置混合型证券投资基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年各主要指数都出现了一定幅度的下跌，其中上证指数收于2929点，下跌17.2%，深成指收于10489点，跌幅17.2%，其中主要的下跌来自于一季度或者说是一月份也不为过，此后市场出现了底部企稳的迹象，在资产荒的大背景下，估值合理并有一定增长的蓝筹股，以及有较高分红收益率的个股、行业、板块都出现了一定的上涨。

权益资产：

操作层面，君选自二月份成立以来，仓位逐步上升到20%左右，虽在放开赎回后在指数大幅下跌时遇到了巨额赎回，净值出现了较大的回撤，但所幸仓位仍没有到高位，且所选择的个股随后出现了较为明显的反弹，因此净值虽有回撤，但很快回到了“水面”以上。在净值安全垫仍较为有限的情况下，保持20%的仓位，其主要原因还是在于已知的利空我们认为大部分已经体现在股价之中。在结构上，目前市场的趋势热点变动太快，因此难以实现中期持股的超额收益，而加快持仓的变动仍然是短期获利的主要方式。

稳定收益资产：

作为以绝对收益为目标的产品，在安全垫有限的情况下，稳定收益类资产仍然是配置的一个主要方向，在这类资产的配置上，我们做对了一件事就是回避信用债，但同时也错失了利率曲线进一步平坦化的机会，错失了类似 30 年期国债的投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金净值增长率为 2.20%，同期业绩比较基准收益率为 2.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

- (1) “资产荒”这个说法虽然不严谨，但不可否认的是，几乎没有投资者经历过目前这种全球央行持续放水的大环境，而且我们还要注意到，由于需求不振，持续放水居然没有带来通胀，而是一派通缩的景象，我们确实担心当这种情形逆转时，将会面临怎样的情景，只是目前看不到逆转的迹象。
- (2) A 股市场目前的整体估值处于中高水平，同时面对着极其宽松的流动性和管理层对市场

的高度呵护。自从 30 年期国债收益率大幅下行后，有很多股票的分红收益率又显得有吸引力，还有一些行业长期增长的趋势仍在，看长做短似乎是不得已的策略。

- (3) 通胀危险比较小，中国真实利率还处在一个比较高的水平，货币政策马上转向的可能性较低。经济增长方面确实缺少新的增长点，但在财政托底和结构性调整的大背景下，L 型仍然是值得期待的。
- (4) 市场目前暂时处在存量博弈的状态，随着名义利率的持续下降，银行理财资金、社保、保险等大机构的再投资和新增资金配置需求增加，而固定收益的名义利率较低，持续投资的价值不大，蓝筹股一季报反应，盈利情况改善、估值较低，比较容易吸纳低风险资金，这部分资金推动股票市场上涨，形成赚钱效应，带动股票市场持续上升。

未来投资思路：

我们的持仓仍以估值水平不高且业绩质量优秀的公司为主，“资产荒”的大背景下，这些股票将是最直接的受益板块，成为保险、银行和产业资本追逐的重要标的，在理财产品收益率显著下降的背景下，它们的估值水平仍有体系性提升的空间。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总经理、研究部总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

同一类别每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，基金托管人在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，南方基金管理有限公司在本基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由南方基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关本基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方君选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	3,986,730.23
结算备付金		309,305.49
存出保证金		192,677.35
交易性金融资产	6.4.7.2	198,587,730.54

其中：股票投资		42,781,252.14
基金投资		-
债券投资		155,806,478.40
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
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		7,201,379.15
应收利息	6.4.7.5	3,206,757.24
应收股利		-
应收申购款		985.22
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	30.27
资产总计		213,485,595.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		5,084,630.64
应付管理人报酬		266,179.57
应付托管费		44,363.26
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	272,726.91
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	151,473.13
负债合计		5,819,373.51
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	203,171,526.01
未分配利润	6.4.7.10	4,494,695.97
所有者权益合计		207,666,221.98
负债和所有者权益总计		213,485,595.49

注：本基金自基金合同生效日（2016年2月3日）至报告期末不满一年，无上年度对比数据。

6.2 利润表

会计主体：南方君选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年2月3日(基金合同 生效日)至2016年6月30日
一、收入		9,943,734.06
1.利息收入		2,131,767.58
其中：存款利息收入	6.4.7.11	106,698.20
债券利息收入		1,534,951.27
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		490,118.11
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,694,319.43
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,597,046.39
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	6,875.41
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	90,397.63
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,615,197.04
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	502,450.01
减：二、费用		2,905,786.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,750,907.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	291,817.94
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	709,011.43
5. 利息支出		7,990.42
其中：卖出回购金融资产支出		7,990.42
6. 其他费用	6.4.7.19	146,059.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,037,947.87
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,037,947.87

注：本基金自基金合同生效日（2016年2月3日）至报告期末不满一年，无上年度对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方君选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日
----	-------------------------------------

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	7,037,947.87	7,037,947.87
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)	203,171,526.01	-2,543,251.90	200,628,274.11
其中: 1.基金申购款	348,747,767.93	29,665.16	348,777,433.09
2.基金赎回款	-145,576,241.92	-2,572,917.06	-148,149,158.98
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)	203,171,526.01	4,494,695.97	207,666,221.98

注: 本基金自基金合同生效日(2016年2月3日)至报告期末不满一年, 无上年度对比数据。

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:

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

南方君选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1247号《关于准予南方君选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方君选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集346,637,158.50元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第140号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方君选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年2月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为346,775,019.34份,其中认购资金利息折合137,860.84份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《南方君选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产净值的 5%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：人民币一年期定期存款利率（税后）+5%

6.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（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（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方君选灵活配置混合型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、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年半年度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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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 2016 年 2 月 3 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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(主要为权证投资)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其他各类应收款项等。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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 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，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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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 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。

6.4.4.7 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。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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，其处置价格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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

拟宣告的分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，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。

(3) 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。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	3,986,730.23
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-

其他存款	-
合计:	3,986,730.23

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	39,994,836.09	42,781,252.14	2,786,416.05
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	155,977,697.41	155,806,478.40
	银行间市场	-	-
	合计	155,977,697.41	155,806,478.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	195,972,533.50	198,587,730.54	2,615,197.04

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	2,420.51
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	139.10
应收债券利息	3,204,110.93
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	
应收黄金合约拆借孳息	
其他	86.70
合计	3,206,757.24

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	30.27
待摊费用	-
合计	30.27

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	272,726.91
银行间市场应付交易费用	-
合计	272,726.91

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12,764.56
预提费用	138,708.57
合计	151,473.13

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	346,775,019.34	346,775,019.34
本期申购	1,972,748.59	1,972,748.59

本期赎回(以“-”号填列)	-145,576,241.92	-145,576,241.92
- 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	203,171,526.01	203,171,526.01

注：1. 申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2016 年 1 月 11 日至 2016 年 1 月 29 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 346,637,158.50 元。根据《南方君选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 137,860.84 元在本基金成立后，折算为 137,860.84 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 本基金自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购赎回，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

6.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,422,750.83	2,615,197.04	7,037,947.87
本期基金份额交易产生的变动数	-1,417,188.02	-1,126,063.88	-2,543,251.90
其中：基金申购款	19,549.87	10,115.29	29,665.16
基金赎回款	-1,436,737.89	-1,136,179.17	-2,572,917.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,005,562.81	1,489,133.16	4,494,695.97

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 2 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	91,733.64
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	14,279.56
其他	685.00
合计	106,698.20

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至 2016年6月30日
卖出股票成交总额	224,633,589.22
减：卖出股票成本总额	220,036,542.83
买卖股票差价收入	4,597,046.39

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年 6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	22,885,603.45
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	22,511,124.59
减：应收利息总额	367,603.45
买卖债券差价收入	6,875.41

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 衍生工具收益

注：无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年 6月30日
股票投资产生的股利收益	90,397.63
基金投资产生的股利收益	-
合计	90,397.63

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至 2016年6月30日
1. 交易性金融资产	2,615,197.04
——股票投资	2,786,416.05
——债券投资	-171,219.01
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	2,615,197.04

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至 2016年6月30日
基金赎回费收入	502,392.68
转换费	57.33
合计	502,450.01

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至 2016年6月30日
交易所市场交易费用	709,011.43
银行间市场交易费用	-
合计	709,011.43

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至 2016年6月30日

审计费用	26,846.82
信息披露费	111,861.75
其他	400.00
银行汇划费	6,950.46
合计	146,059.03

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、基金销售机构
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华泰证券	484,171,433.30	100.00%

注：本基金自基金合同生效日(2016年2月3日)至报告期末不满一年，无上年度对比数据。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
华泰证券	198,488,822.00	100.00%

注：本基金自基金合同生效日（2016年2月3日）至报告期末不满一年，无上年度对比数据。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
华泰证券	1,341,500,000.00	100.00%

注：本基金自基金合同生效日（2016年2月3日）至报告期末不满一年，无上年度对比数据。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	441,225.19	100.00%	272,726.91	100.00%

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

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

3. 本基金自基金合同生效日（2016年2月3日）至报告期末不满一年，无上年度对比数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,750,907.37

其中：支付销售机构的客户维护费	365,543.93
-----------------	------------

注：1. 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 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

2. 本基金自基金合同生效日（2016 年 2 月 3 日）至报告期末不满一年，无上年度对比数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	291,817.94

注：1. 支付基金托管人中信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。

2. 本基金自基金合同生效日（2016 年 2 月 3 日）至报告期末不满一年，无上年度对比数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行	3,986,730.23	91,733.64

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金自基金合同生效日（2016 年 2 月 3 日）至报告期末不满一年，无上年度对比数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	1,753	22,753.94	22,753.94	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

002313	日海通讯	2016年6月20日	重大事项停牌	13.59	2016年7月4日	14.95	99,349	1,307,457.86	1,350,152.91	-
300282	汇冠股份	2016年4月22日	重大事项停牌	35.25	2016年7月26日	36.78	16,800	557,492.00	592,200.00	-
002355	兴民钢圈	2016年5月12日	重大事项停牌	19.35	-	-	21,600	423,424.00	417,960.00	-
600146	商赢环球	2016年6月15日	重大事项停牌	24.42	-	-	15,700	350,731.98	383,394.00	-
601611	中国核建	2016年6月30日	重大事项停牌	20.92	2016年7月1日	23.01	6,050	20,993.50	126,566.00	-

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，根据对上市公司的业绩质量、成长性与投资价值的权衡与精选，以为投资人获取长期稳定的绝对收益为投资目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程

中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中信银行，因而与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。

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。

6.4.13.3 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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放申赎期间对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制

因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券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的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 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，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。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。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资及资产支持证券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	3,986,730.23	-	-	-	3,986,730.23
结算备付金	309,305.49	-	-	-	309,305.49
存出保证金	192,677.35	-	-	-	192,677.35
交易性金融资产	155,806,478.40	-	-	42,781,252.14	198,587,730.54
应收证券清算款	-	-	-	7,201,379.15	7,201,379.15
应收利息	-	-	-	3,206,757.24	3,206,757.24
应收申购款	-	-	-	985.22	985.22
其他资产	-	-	-	30.27	30.27
资产总计	160,295,191.47	-	-	53,190,404.02	213,485,595.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,084,630.64	5,084,630.64
应付管理人报酬	-	-	-	266,179.57	266,179.57
应付托管费	-	-	-	44,363.26	44,363.26
应付交易费用	-	-	-	272,726.91	272,726.91
其他负债	-	-	-	151,473.13	151,473.13
负债总计	-	-	-	5,819,373.51	5,819,373.51
利率敏感度缺口	160,295,191.47	-	-	47,371,030.51	207,666,221.98

注：1. 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。

2. 于 2015 年 12 月 31 日，本基金尚未成立，无上年末对比数据。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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（2016年6月30日）
	市场利率下降 25 个基点	增加约 6
	市场利率上升 25 个基点	减少约 6

注：于 2015 年 12 月 31 日，本基金尚未成立，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产净值的 5%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 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	42,781,252.14	20.60
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	42,781,252.14	20.60

注：本基金自基金合同生效日（2016 年 2 月 3 日）至报告期末不满一年，无上年度对比数据。

6.4.13.4.3.2 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（2016 年 6 月 30 日）

	1. 沪深 300 指数上升 5%	增加约 136
	2. 沪深 300 指数下降 5%	减少约 136

注：于 2015 年 12 月 31 日，本基金尚未成立，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	42,781,252.14	20.04
	其中：股票	42,781,252.14	20.04
2	固定收益投资	155,806,478.40	72.98
	其中：债券	155,806,478.40	72.98
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,296,035.72	2.01
7	其他各项资产	10,601,829.23	4.97
8	合计	213,485,595.49	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	2,145,456.00	1.03
C	制造业	23,652,590.74	11.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,102,904.00	0.53
E	建筑业	4,081,746.00	1.97
F	批发和零售业	217,050.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,020,881.30	2.42
J	金融业	1,301,520.00	0.63
K	房地产业	2,347,522.00	1.13
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,049,749.10	0.99
N	水利、环境和公共设施管理业	861,833.00	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	42,781,252.14	20.60

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

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	300431	暴风科技	46,500	3,371,250.00	1.62
2	600151	航天机电	234,554	2,650,460.20	1.28
3	000985	大庆华科	102,100	2,524,933.00	1.22
4	002539	新都化工	157,000	2,400,530.00	1.16
5	600708	光明地产	279,800	2,347,522.00	1.13
6	002511	中顺洁柔	128,753	2,192,663.59	1.06
7	000426	兴业矿业	285,300	2,145,456.00	1.03
8	300404	博济医药	56,900	2,029,623.00	0.98
9	600463	空港股份	145,900	1,914,208.00	0.92
10	600519	贵州茅台	5,205	1,519,443.60	0.73
11	600681	百川能源	138,300	1,499,172.00	0.72
12	002313	日海通讯	99,349	1,350,152.91	0.65
13	000423	东阿阿胶	25,300	1,336,599.00	0.64
14	000783	长江证券	112,200	1,301,520.00	0.63
15	300449	汉邦高科	20,900	1,194,226.00	0.58
16	000858	五粮液	35,387	1,151,139.11	0.55
17	300335	迪森股份	66,400	1,102,904.00	0.53

18	300289	利德曼	69,100	1,033,736.00	0.50
19	002609	捷顺科技	58,300	1,025,497.00	0.49
20	000035	中国天楹	121,900	861,833.00	0.42
21	002216	三全食品	87,500	752,500.00	0.36
22	600978	宜华生活	61,100	680,654.00	0.33
23	300282	汇冠股份	16,800	592,200.00	0.29
24	300025	华星创业	40,000	573,600.00	0.28
25	300115	长盈精密	26,560	547,136.00	0.26
26	002659	中泰桥梁	30,000	541,800.00	0.26
27	002402	和而泰	18,100	489,605.00	0.24
28	002355	兴民钢圈	21,600	417,960.00	0.20
29	300160	秀强股份	32,246	415,006.02	0.20
30	601689	拓普集团	12,200	401,990.00	0.19
31	600146	商赢环球	15,700	383,394.00	0.18
32	000951	中国重汽	32,800	313,568.00	0.15
33	002508	老板电器	7,400	272,098.00	0.13
34	603766	隆鑫通用	10,900	220,398.00	0.11
35	603368	柳州医药	2,500	217,050.00	0.10
36	600666	奥瑞德	4,900	170,324.00	0.08
37	603737	三棵树	1,239	143,823.12	0.07
38	300516	久之洋	818	143,289.06	0.07
39	601611	中国核建	6,050	126,566.00	0.06
40	601127	小康股份	3,213	76,694.31	0.04
41	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.04
42	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.03
43	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.02
44	300518	盛讯达	880	41,228.00	0.02
45	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
46	603958	哈森股份	1,673	24,258.50	0.01
47	601966	玲珑轮胎	1,753	22,753.94	0.01
48	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
49	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.01
50	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
51	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	002539	新都化工	8,216,682.04	3.96
2	002108	沧州明珠	6,557,539.20	3.16
3	002335	科华恒盛	6,275,424.00	3.02
4	600075	新疆天业	6,234,301.20	3.00
5	002370	亚太药业	5,058,794.00	2.44
6	300404	博济医药	4,940,005.50	2.38
7	000815	美利纸业	4,919,178.40	2.37
8	600151	航天机电	4,863,965.81	2.34
9	600886	国投电力	4,798,795.00	2.31
10	300440	运达科技	4,371,664.00	2.11
11	601139	深圳燃气	4,094,344.92	1.97
12	000858	五粮液	3,727,098.00	1.79
13	000985	大庆华科	3,704,621.00	1.78
14	002313	日海通讯	3,653,961.00	1.76
15	601199	江南水务	3,620,626.00	1.74
16	600386	北巴传媒	3,597,470.00	1.73
17	603118	共进股份	3,542,606.00	1.71
18	600406	国电南瑞	3,487,462.93	1.68
19	300211	亿通科技	3,397,846.00	1.64
20	600730	中国高科	3,160,710.08	1.52

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	002108	沧州明珠	7,951,302.00	3.83
2	600075	新疆天业	6,216,498.81	2.99
3	002335	科华恒盛	5,819,859.12	2.80
4	002539	新都化工	5,355,656.93	2.58

5	600886	国投电力	4,915,480.00	2.37
6	002370	亚太药业	4,767,219.70	2.30
7	000815	美利纸业	4,759,402.40	2.29
8	601139	深圳燃气	4,113,988.30	1.98
9	600386	北巴传媒	3,993,553.61	1.92
10	300440	运达科技	3,865,778.00	1.86
11	603118	共进股份	3,686,422.48	1.78
12	600406	国电南瑞	3,509,672.42	1.69
13	601199	江南水务	3,424,730.90	1.65
14	002188	巴士在线	3,152,334.41	1.52
15	000858	五粮液	3,082,382.42	1.48
16	600775	南京熊猫	2,926,332.00	1.41
17	300211	亿通科技	2,908,572.67	1.40
18	002313	日海通讯	2,723,008.40	1.31
19	300404	博济医药	2,689,485.00	1.30
20	002364	中恒电气	2,649,217.07	1.28

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	260,031,378.92
卖出股票收入（成交）总额	224,633,589.22

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	155,806,478.40	75.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	155,806,478.40	75.03
----	----	----------------	-------

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019520	15 国债 20	621,880	62,150,687.20	29.93
2	019518	15 国债 18	545,770	54,571,542.30	26.28
3	019515	15 国债 15	263,830	26,380,361.70	12.70
4	019419	14 国债 19	126,760	12,703,887.20	6.12

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	192,677.35
2	应收证券清算款	7,201,379.15
3	应收股利	-
4	应收利息	3,206,757.24
5	应收申购款	985.22
6	其他应收款	30.27
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,601,829.23

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未存在流通受限的股票。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
2,733	74,340.11	270,750.99	0.13%	202,900,775.02	99.87%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	7,006,525.56	3.4486%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年2月3日）基金份额总额	346,775,019.34
本报告期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,972,748.59
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	145,576,241.92
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）	-
本报告期末基金份额总额	203,171,526.01

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	484,171,433.30	100.00%	441,225.19	100.00%	-

注：交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
华泰证券	198,488,822.00	100.00%	1,341,500,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于京东电子交易平台实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月30日
2	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月30日
3	南方基金关于旗下部分基金增加余杭农村商业银行代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月23日
4	南方基金关于旗下部分基金增加泰隆银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月3日
5	南方基金关于旗下部分基金增加宁波银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月2日
6	南方基金关于旗下部分基金增加汇成基金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年5月13日
7	南方基金关于旗下部分基金增加天津银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年5月10日

8	南方基金关于旗下部分基金增加徽商银行和广东南粤银行为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 20 日
9	南方基金关于旗下部分基金增加徽商期货为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 18 日
10	关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 12 日
11	南方君选灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 4 月 6 日
12	南方基金关于旗下部分基金增加鼎信汇金为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 9 日
13	南方基金关于旗下部分基金增加好买基金、厦门鑫鼎盛为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 24 日
14	南方基金关于临时暂停电子直销实时赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 2 月 4 日
15	南方基金管理有限公司电子交易赎回转认/申购业务规则	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 27 日
16	南方基金关于旗下部分基金增加中证金牛为代销机构及开通相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 26 日
17	南方君选灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售时间的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 26 日
18	南方基金关于南方君选基金增加浦发银行、陆金所资管为代销机	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 18 日

	构的公告		
19	南方基金关于电子直销平台通过货币基金定投其他基金费率为 0 的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 15 日
20	南方基金关于南方君选基金增加上海银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 15 日
21	南方基金关于南方君选基金增加中投证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 12 日

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方君选灵活配置混合型证券投资基金的文件
- 2、《南方君选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《南方君选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告

11.2 存放地点

深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层

11.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>