

# 南方策略优化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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
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.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	11
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表.....	11
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
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>47</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	50
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>52</b>
11.1 备查文件目录.....	52
11.2 存放地点.....	53
11.3 查阅方式.....	53

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方策略优化混合型证券投资基金
基金简称	南方策略优化混合
基金主代码	202019
前端交易代码	202019
后端交易代码	202020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 3 月 30 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	382,061,621.87 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“南方策略”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化手段优化投资策略，在积极把握证券市场及相关行业发展趋势的前提下精选优势个股进行投资，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金投资策略包含资产配置、行业配置和个股选择等三个层面。基金管理人在综合分析经济周期、财政政策、市场环境等因素的基础上，采用定量和定性相结合的思路确定本基金的资产配置。针对本基金的行业配置策略，基金管理人开发了基于 lack-Litterman 模型的“南方量化行业配置模型”。在行业配置的基础上，进一步使用“南方多因子量化选股模型”，依据基本面、价值面、市场面和流动性等因素对股票进行综合评分，精选各行业具有超额收益能力或潜力的优势个股，构建本基金的股票组合。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数+20%×上证国债指数
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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	张燕
	联系电话	0755-82763888	0755-83199084
	电子邮箱	manager@southernfund.com	yan_zhang@cmbchina.com

客户服务电话	400-889-8899	95555
传真	0755-82763889	0755-83195201
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	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
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	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518048	518040
法定代表人	吴万善	李建红

## 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	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
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 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	18,991,041.14
本期利润	-27,911,353.01
加权平均基金份额本期利润	-0.0818
本期加权平均净值利润率	-6.26%
本期基金份额净值增长率	-6.63%
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	156,444,675.37
期末可供分配基金份额利润	0.4095
期末基金资产净值	538,506,297.24
期末基金份额净值	1.409
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	43.70%
-------------	--------

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

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

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

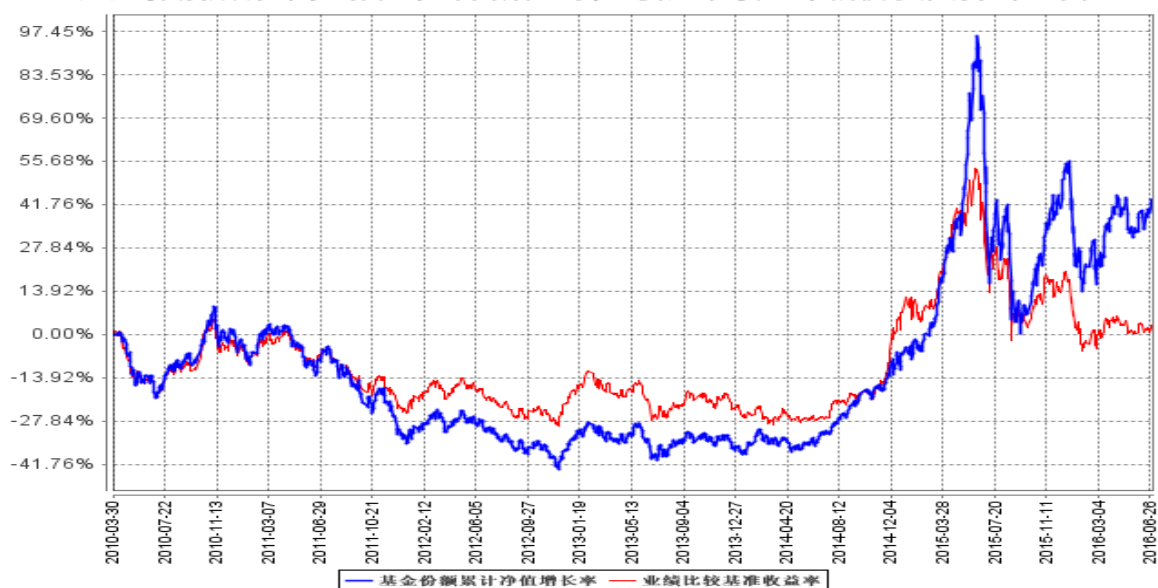
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.53%	1.33%	-0.32%	0.78%	4.85%	0.55%
过去三个月	4.53%	1.37%	-1.42%	0.81%	5.95%	0.56%
过去六个月	-6.63%	2.24%	-11.93%	1.47%	5.30%	0.77%
过去一年	-6.50%	2.52%	-22.77%	1.84%	16.27%	0.68%
过去三年	136.01%	1.87%	39.74%	1.47%	96.27%	0.40%
自基金合同生效起至今	43.70%	1.61%	2.87%	1.31%	40.83%	0.30%

### 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



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 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		
雷俊	本基金基金经理	2015 年 6 月 16 日	-	8 年	北京大学智能科学系硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金，历任信息技术部投研系统研发员、数量化投资部高级研究员，现任数量化投资部总监助理；2014 年 12 月至 2016 年 4 月，任南方恒生 ETF 基金经理；2015 年 4 月至 2016 年 4 月，任南方中证 500 工业 ETF、南方中证 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 6 月至 2016 年 7 月，任改革基金、高铁基金、南方 500 信息基金经理；2015 年 4 月至今，任大数据 100 基金经理；2015 年 6 月至今，任南方策略优化、大数据 300、南方量化成长的基金经理。
杨德龙	本基金基金经理	2013 年 3 月 15 日	2016 年 3 月 4 日	10 年	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 2016 年 3 月，任南方上证 380ETF 及联



					接基金基金经理；2013 年 3 月至 2016 年 3 月，任南方策略基金经理；2013 年 4 月至 2016 年 3 月，任南方 300 基金经理；2013 年 4 月至 2016 年 3 月，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2014 年 12 月至 2016 年 3 月，任南方恒生 ETF 基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，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《南方策略优化混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合同单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

### 4.3.2 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

A 股上半年在开年大幅下跌一个月后，市场开始止跌反弹，之后市场在一个窄区间内反复震荡，市场资金存量博弈明显。

报告期内本基金采用量化多因子模型选股，重点集中在具有相对优势的价值和成长股之间进行投资。本基金充分发挥量化选股的优势，运用多个量化策略投资，分散投资风险和平衡风险暴露，行业涨跌波动剧烈时在同类基金产品中表现稳健，后续产品运作仍将量化策略为主，力争获取超越市场表现。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.409 元；报告期内，基金份额净值增长率为-6.63%，同期业绩基准增长率为-11.93%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体来看，未来 A 股市场结构性牛市的动力仍在，上涨逻辑是利率不断下行和资产配置荒。一是整个经济中利率水平仍在下降，上半年万亿级的理财领域收益率降低非常明显；二是宽松货币政策逻辑未改变，在房地产高企、国内投资工具有限的情况下，部分高风险收益偏好的投资者会在大类资产配置上逐渐倾向于权益类资产。展望下半年，A 股将有不错的投资机会。

## 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，本基金的收益分配原则为：本基金收益分配应遵循下列原则：每一基金份额享有同等分配权；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；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，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多 12 次，每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；.基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。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，本报告期末未有收益分配事项。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

无。

## **§5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

托管人声明，在本报告期内，基金托管人—招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### **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**

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §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：南方策略优化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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.4.1	46,462,014.58	50,937,223.20
结算备付金		2,741,265.65	1,268,641.46
存出保证金		130,310.54	174,806.74
交易性金融资产	6.4.4.2	495,206,911.76	400,981,001.22
其中：股票投资		495,206,911.76	400,981,001.22
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		410,503.25	1,656,947.62
应收利息	6.4.4.5	11,284.36	10,949.21
应收股利		-	-
应收申购款		130,178.78	4,176,860.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		545,092,468.92	459,206,430.34
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,177,040.92	1,798,295.30
应付管理人报酬		654,557.45	537,210.43
应付托管费		109,092.90	89,535.08
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	1,239,168.98	3,458,858.14
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	406,311.43	357,314.57
负债合计		6,586,171.68	6,241,213.52
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.4.9	382,061,621.87	300,223,083.71
未分配利润	6.4.4.10	156,444,675.37	152,742,133.11
所有者权益合计		538,506,297.24	452,965,216.82
负债和所有者权益总计		545,092,468.92	459,206,430.34

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.409 元，基金份额总额 382,061,621.87 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方策略优化混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-20,992,586.36	282,524,335.85
1.利息收入		195,126.02	467,110.96
其中：存款利息收入	6.4.4.11	195,125.14	195,458.95
债券利息收入		0.88	1,020.42
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	270,631.59
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		25,601,950.17	409,427,432.66
其中：股票投资收益	6.4.4.12	23,427,721.62	407,195,677.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	1,990.32	407,507.25
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.4.14	-	-
股利收益	6.4.4.15	2,172,238.23	1,824,248.26
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.16	-46,902,394.15	-127,818,635.27
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	112,731.60	448,427.50
<b>减：二、费用</b>		6,918,766.65	11,249,228.39
1. 管理人报酬	6.4.7.2.1	3,311,514.04	4,630,700.89

2. 托管费	6.4.7.2.2	551,918.94	771,783.59
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.4.18	2,865,742.71	5,663,416.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.4.19	189,590.96	183,327.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-27,911,353.01	271,275,107.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-27,911,353.01	271,275,107.46

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方策略优化混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	300,223,083.71	152,742,133.11	452,965,216.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-27,911,353.01	-27,911,353.01
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）	81,838,538.16	31,613,895.27	113,452,433.43
其中：1.基金申购款	161,726,395.51	56,315,535.42	218,041,930.93
2.基金赎回款	-79,887,857.35	-24,701,640.15	-104,589,497.50
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）	382,061,621.87	156,444,675.37	538,506,297.24
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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)	737,168,481.26	-52,373,063.29	684,795,417.97
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	271,275,107.46	271,275,107.46
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)	-354,913,851.69	-25,101,230.13	-380,015,081.82
其中：1.基金申购款	252,112,818.25	116,097,095.88	368,209,914.13
2.基金赎回款	-607,026,669.94	-141,198,326.01	-748,224,995.95
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)	382,254,629.57	193,800,814.04	576,055,443.61

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

徐超

徐超

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

### 6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.2.2 会计估计变更的说明

本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.2.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

### 6.4.4 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	46,462,014.58
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-



其他存款	-
合计:	46,462,014.58

#### 6.4.4.2 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	485,755,682.35	495,206,911.76	9,451,229.41
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	485,755,682.35	495,206,911.76	9,451,229.41

#### 6.4.4.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 6.4.4.4 买入返售金融资产

##### 6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	9,992.16
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	1,233.60
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	58.60
合计	11,284.36

#### 6.4.4.6 其他资产

注：无。

#### 6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,239,168.98
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,239,168.98

#### 6.4.4.8 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	27,296.23
预提费用	379,015.20
合计	406,311.43

#### 6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	300,223,083.71	300,223,083.71
本期申购	161,726,395.51	161,726,395.51
本期赎回(以“-”号填列)	-79,887,857.35	-79,887,857.35
本期末	382,061,621.87	382,061,621.87

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	112,359,112.58	40,383,020.53	152,742,133.11
本期利润	18,991,041.14	-46,902,394.15	-27,911,353.01
本期基金份额交易产生的变动数	32,470,963.68	-857,068.41	31,613,895.27
其中：基金申购款	63,964,632.84	-7,649,097.42	56,315,535.42
基金赎回款	-31,493,669.16	6,792,029.01	-24,701,640.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	163,821,117.40	-7,376,442.03	156,444,675.37

#### 6.4.4.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	178,481.20
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	12,936.36
其他	3,707.58
合计	195,125.14

#### 6.4.4.12 股票投资收益

##### 6.4.4.12.1 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1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	911,224,876.60
减：卖出股票成本总额	887,797,154.98
买卖股票差价收入	23,427,721.62

#### 6.4.4.13 债券投资收益

##### 6.4.4.13.1 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1月1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	13,991.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	12,000.00

本总额	
减：应收利息总额	0.88
买卖债券差价收入	1,990.32

#### 6.4.4.14 衍生工具收益

注：无。

#### 6.4.4.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,172,238.23
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,172,238.23

#### 6.4.4.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-46,902,394.15
——股票投资	-46,902,394.15
——债券投资	-
——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	-46,902,394.15

#### 6.4.4.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	86,103.63
转换费	26,627.97
合计	112,731.60

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归

入转出基金的基金资产。

#### 6.4.4.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	2,865,742.71
银行间市场交易费用	-
合计	2,865,742.71

#### 6.4.4.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	1,575.76
账户维护费	9,000.00
合计	189,590.96

### 6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.5.1 或有事项

无。

#### 6.4.5.2 资产负债表日后事项

无。

### 6.4.6 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司（“南方基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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。

## 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	269,351,173.69	13.89%	566,990,218.34	15.62%

#### 6.4.7.1.2 权证交易

注：无。

#### 6.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年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	245,459.63	13.77%	245,459.63	19.81%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	501,737.29	15.45%	1,272,500.16	27.41%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。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。

### 6.4.7.2 关联方报酬

#### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,311,514.04	4,630,700.89
其中：支付销售机构的客户维护费	817,141.02	1,291,542.98

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。

#### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	551,918.94	771,783.59

注：支付基金托管人招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。

#### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

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

注：无。

#### 6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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
招商银行	46,462,014.58	178,481.20	71,233,820.19	159,535.14

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

## 6.4.8 利润分配情况

### 6.4.8.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：无。

## 6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 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	4,383	56,891.34	56,891.34	-
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	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。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。

### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600203	福日电子	2016年6月30日	重大事项未公告	13.80	2016年7月1日	13.25	286,126	3,365,363.43	3,948,538.80	-
300353	东土科技	2016年6月23日	重大事项未公告	22.09	-	-	154,500	2,669,345.20	3,412,905.00	-



300239	东宝生物	2016年6月7日	重大事项未公告	8.29	2016年8月22日	8.2	348,102	2,579,928.34	2,885,765.58	-
300345	红宇新材	2016年6月21日	重大事项未公告	10.46	2016年7月19日	11.46	265,000	2,828,939.25	2,771,900.00	-
000551	创元科技	2016年6月7日	重大事项未公告	9.18	2016年7月7日	10.10	297,900	2,787,428.85	2,734,722.00	-
002686	亿利达	2016年4月20日	重大事项未公告	13.54	2016年7月14日	14.89	201,100	2,516,396.80	2,722,894.00	-
000002	万科A	2015年12月21日	重大事项未公告	18.20	2016年7月4日	21.99	137,300	1,997,711.00	2,498,860.00	-
000004	国农科技	2016年3月24日	重大事项未公告	36.83	-	-	60,800	1,722,482.00	2,239,264.00	-
000968	*ST 煤气	2015年12月24日	重大事项未公告	8.71	2016年7月7日	9.06	254,038	1,862,287.35	2,212,670.98	-
300080	易成新能	2016年5月19日	重大事项未公告	7.76	-	-	263,300	2,339,660.14	2,043,208.00	-
300225	金力泰	2016年3月22日	重大事项未公告	7.12	2016年7月8日	7.58	282,300	1,770,475.00	2,009,976.00	-
000757	浩物股份	2016年3月29日	重大事项未公告	10.56	-	-	186,559	1,861,651.56	1,970,063.04	-
300265	通光线缆	2016年3月24日	重大事项未公告	12.38	2016年7月21日	12.55	151,444	1,925,528.06	1,874,876.72	-
000524	岭南控股	2016年4月5日	重大事项未公告	13.08	-	-	141,263	1,769,757.24	1,847,720.04	-
300184	力源信息	2016年3月4日	重大事项未公告	11.03	-	-	166,600	2,276,063.40	1,837,598.00	-
600796	钱江生化	2016年5月31日	重大事项未公告	9.80	-	-	184,700	2,188,602.00	1,810,060.00	-

000610	西安旅游	2016 年 4 月 11 日	重大事项 未公告	12.85	2016 年 7 月 25 日	14.14	118,500	1,501,209.15	1,522,725.00	-
002465	海格通信	2016 年 6 月 13 日	重大事项 未公告	12.44	-	-	77,900	918,711.09	969,076.00	-
601611	中国核建	2016 年 6 月 30 日	重大事项 未公告	20.92	2016 年 7 月 1 日	23.01	13,109	45,488.23	274,240.28	-
300356	光一科技	2016 年 5 月 26 日	重大事项 未公告	48.44	2016 年 8 月 10 日	44.27	4,500	209,234.00	217,980.00	-
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	重大事项 未公告	8.29	-	-	23,400	210,872.00	193,986.00	-
300223	北京君正	2016 年 6 月 3 日	重大事项 未公告	44.00	-	-	3,300	104,152.46	145,200.00	-
300242	明家联合	2016 年 5 月 9 日	重大事项 未公告	34.99	2016 年 8 月 12 日	36.69	3,700	134,965.80	129,463.00	-
000975	银泰资源	2016 年 4 月 19 日	重大事项 未公告	14.39	-	-	7,300	98,888.00	105,047.00	-
300110	华仁药业	2016 年 1 月 27 日	重大事项 未公告	9.53	2016 年 7 月 12 日	10.48	9,700	147,035.13	92,441.00	-
002349	精华制药	2016 年 1 月 4 日	重大事项 未公告	21.51	2016 年 7 月 18 日	23.16	4,200	92,866.17	90,342.00	-
300038	梅泰诺	2015 年 12 月 16 日	重大事项 未公告	50.58	-	-	1,700	55,385.80	85,986.00	-
002331	皖通科技	2016 年 4 月 18 日	重大事项 未公告	16.54	2016 年 7 月 11 日	15.31	2,880	44,740.00	47,635.20	-
300332	天壕环境	2016 年 4 月 11 日	重大事项 未公告	9.37	2016 年 7 月 29 日	9.91	5,000	47,978.64	46,850.00	-
600511	国药股份	2016 年 2 月 18 日	重大事项 未公告	27.42	2016 年 8 月 4 日	30.16	1,600	40,901.00	43,872.00	-
300292	吴通控股	2016	重大事项	33.26	2016	36.48	1,300	40,728.36	43,238.00	-

		年 1 月 25 日	未公告		年 7 月 20 日					
002120	新海股份	2016 年 5 月 23 日	重大事项 未公告	20.48	2016 年 7 月 15 日	22.53	2,100	43,728.00	43,008.00	-
300298	三诺生物	2016 年 3 月 21 日	重大事项 未公告	20.96	2016 年 8 月 4 日	23.06	260	5,140.00	5,449.60	-

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。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

### 6.4.10 金融工具风险及管理

#### 6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金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、风险策略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控策略部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工

具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.10.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行，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。于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资(2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.10.3 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每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金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，因此除附注 6.4.9 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。

#### 6.4.10.4 市场风险

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

##### 6.4.10.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.10.4.1.1 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	46,462,014.58	-	-	-	46,462,014.58
结算备付金	2,741,265.65	-	-	-	2,741,265.65
存出保证金	130,310.54	-	-	-	130,310.54
交易性金融资产	-	-	-	495,206,911.76	495,206,911.76
应收证券清算款	-	-	-	410,503.25	410,503.25
应收利息	-	-	-	11,284.36	11,284.36

应收申购款	61,733.21	-	-	68,445.57	130,178.78
资产总计	49,395,323.98	-	-	495,697,144.94	545,092,468.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,177,040.92	4,177,040.92
应付管理人报酬	-	-	-	654,557.45	654,557.45
应付托管费	-	-	-	109,092.90	109,092.90
应付交易费用	-	-	-	1,239,168.98	1,239,168.98
其他负债	-	-	-	406,311.43	406,311.43
负债总计	-	-	-	6,586,171.68	6,586,171.68
利率敏感度缺口	49,395,323.98	-	-	489,110,973.26	538,506,297.24
上年度末 2015 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	50,937,223.20	-	-	-	50,937,223.20
结算备付金	1,268,641.46	-	-	-	1,268,641.46
存出保证金	174,806.74	-	-	-	174,806.74
交易性金融资产	-	-	-	400,981,001.22	400,981,001.22
应收证券清算款	-	-	-	1,656,947.62	1,656,947.62
应收利息	-	-	-	10,949.21	10,949.21
应收申购款	194,428.62	-	-	3,982,432.27	4,176,860.89
资产总计	52,575,100.02	-	-	406,631,330.32	459,206,430.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,798,295.30	1,798,295.30
应付管理人报酬	-	-	-	537,210.43	537,210.43
应付托管费	-	-	-	89,535.08	89,535.08
应付交易费用	-	-	-	3,458,858.14	3,458,858.14
其他负债	-	-	-	357,314.57	357,314.57
负债总计	-	-	-	6,241,213.52	6,241,213.52
利率敏感度缺口	52,575,100.02	-	-	400,390,116.80	452,965,216.82

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

#### 6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.4.3 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。本基金的投资组合中，股票占基金资产的 60%-95%；债券等固定收益类工具及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5-40%；权证占基金资产的 0-3%。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。

##### 6.4.10.4.3.1 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		上年度末 2015 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	495,206,911.76	91.96	400,981,001.22	88.52
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	495,206,911.76	91.96	400,981,001.22	88.52

##### 6.4.10.4.3.2 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）	上年度末（2015年12月31日）
		1. 沪深 300 指数上升 5%	3,103
2. 沪深 300 指数下降 5%	-3,103	-2,280	

## §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	495,206,911.76	90.85
	其中：股票	495,206,911.76	90.85
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	49,203,280.23	9.03
7	其他各项资产	682,276.93	0.13
8	合计	545,092,468.92	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	8,702,194.20	1.62
B	采矿业	8,751,827.98	1.63
C	制造业	280,998,573.91	52.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,258,831.70	2.83
E	建筑业	13,721,606.02	2.55



F	批发和零售业	52,352,838.86	9.72
G	交通运输、仓储和邮政业	10,931,345.00	2.03
H	住宿和餐饮业	7,610,800.61	1.41
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,598,678.60	1.97
J	金融业	36,065,520.68	6.70
K	房地产业	19,882,869.20	3.69
L	租赁和商务服务业	3,596,482.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	3,078,334.10	0.57
N	水利、环境和公共设施管理业	11,140,896.66	2.07
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	4,084,903.24	0.76
S	综合	8,431,209.00	1.57
	合计	495,206,911.76	91.96

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

### 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	601166	兴业银行	446,200	6,800,088.00	1.26
2	601328	交通银行	1,079,700	6,078,711.00	1.13
3	601169	北京银行	461,200	4,782,644.00	0.89
4	601398	工商银行	988,700	4,389,828.00	0.82
5	600203	福日电子	286,126	3,948,538.80	0.73
6	601015	陕西黑猫	303,100	3,506,867.00	0.65
7	300303	聚飞光电	364,300	3,464,493.00	0.64
8	300353	东土科技	154,500	3,412,905.00	0.63
9	002495	佳隆股份	443,223	3,368,494.80	0.63
10	002545	东方铁塔	374,800	3,343,216.00	0.62
11	601579	会稽山	235,579	3,331,087.06	0.62
12	002255	海陆重工	385,196	3,316,537.56	0.62

13	300042	朗科科技	96,800	3,299,912.00	0.61
14	002369	卓翼科技	289,600	3,258,000.00	0.61
15	600892	大晟文化	50,400	3,241,728.00	0.60
16	002087	新野纺织	410,800	3,241,212.00	0.60
17	600714	金瑞矿业	253,800	3,223,260.00	0.60
18	600131	岷江水电	312,968	3,192,273.60	0.59
19	600379	宝光股份	162,000	3,170,340.00	0.59
20	601988	中国银行	983,200	3,156,072.00	0.59
21	600189	吉林森工	275,900	3,125,947.00	0.58
22	000521	美菱电器	517,100	3,118,113.00	0.58
23	600104	上汽集团	153,400	3,112,486.00	0.58
24	300270	中威电子	182,700	3,111,381.00	0.58
25	600345	长江通信	147,100	3,108,223.00	0.58
26	002380	科远股份	90,300	3,099,999.00	0.58
27	002671	龙泉股份	250,900	3,098,615.00	0.58
28	300249	依米康	313,600	3,098,368.00	0.58
29	600698	湖南天雁	520,300	3,080,176.00	0.57
30	300301	长方集团	363,200	3,076,304.00	0.57
31	600681	百川能源	283,361	3,071,633.24	0.57
32	002374	丽鹏股份	448,100	3,069,485.00	0.57
33	000609	绵世股份	238,600	3,061,238.00	0.57
34	002696	百洋股份	158,200	3,027,948.00	0.56
35	600483	福能股份	266,000	3,019,100.00	0.56
36	002302	西部建设	417,700	3,015,794.00	0.56
37	600356	恒丰纸业	281,780	3,015,046.00	0.56
38	600854	春兰股份	401,000	2,995,470.00	0.56
39	600311	荣华实业	480,400	2,992,892.00	0.56
40	002578	闽发铝业	316,700	2,986,481.00	0.55
41	002404	嘉欣丝绸	378,300	2,984,787.00	0.55
42	600784	鲁银投资	338,100	2,978,661.00	0.55
43	000756	新华制药	275,800	2,959,334.00	0.55
44	002692	远程电缆	360,583	2,956,780.60	0.55
45	000564	西安民生	307,900	2,955,840.00	0.55
46	002105	信隆实业	299,900	2,933,022.00	0.54
47	600078	澄星股份	453,000	2,930,910.00	0.54
48	600746	江苏索普	297,700	2,926,391.00	0.54
49	600814	杭州解百	276,100	2,923,899.00	0.54
50	002478	常宝股份	259,500	2,916,780.00	0.54
51	300138	晨光生物	174,435	2,913,064.50	0.54

52	000613	大东海 A	209,413	2,908,746.57	0.54
53	000419	通程控股	399,500	2,908,360.00	0.54
54	000591	太阳能	192,086	2,898,577.74	0.54
55	600051	宁波联合	281,200	2,890,736.00	0.54
56	000985	大庆华科	116,696	2,885,892.08	0.54
57	300239	东宝生物	348,102	2,885,765.58	0.54
58	002160	常铝股份	329,400	2,885,544.00	0.54
59	000026	飞亚达 A	251,400	2,873,502.00	0.53
60	300280	南通锻压	101,200	2,872,056.00	0.53
61	002607	亚夏汽车	249,500	2,866,755.00	0.53
62	002327	富安娜	336,600	2,864,466.00	0.53
63	600706	曲江文旅	159,900	2,859,012.00	0.53
64	600178	东安动力	327,555	2,856,279.60	0.53
65	601007	金陵饭店	227,800	2,854,334.00	0.53
66	002166	莱茵生物	249,500	2,851,785.00	0.53
67	600222	太龙药业	357,600	2,850,072.00	0.53
68	002119	康强电子	139,200	2,848,032.00	0.53
69	601177	杭齿前进	288,050	2,840,173.00	0.53
70	600371	万向德农	175,251	2,839,066.20	0.53
71	603123	翠微股份	334,636	2,837,713.28	0.53
72	300087	荃银高科	248,700	2,835,180.00	0.53
73	002564	天沃科技	367,500	2,829,750.00	0.53
74	600981	汇鸿集团	335,065	2,824,597.95	0.52
75	300237	美晨科技	299,700	2,823,174.00	0.52
76	600128	弘业股份	219,900	2,821,317.00	0.52
77	300129	泰胜风能	402,409	2,816,863.00	0.52
78	002060	粤水电	408,900	2,809,143.00	0.52
79	000906	物产中拓	236,600	2,808,442.00	0.52
80	600505	西昌电力	314,408	2,804,519.36	0.52
81	603003	龙宇燃油	146,200	2,801,192.00	0.52
82	600355	精伦电子	371,200	2,795,136.00	0.52
83	000753	漳州发展	625,169	2,794,505.43	0.52
84	300150	世纪瑞尔	257,900	2,793,057.00	0.52
85	600810	神马股份	373,900	2,793,033.00	0.52
86	300172	中电环保	303,241	2,792,849.61	0.52
87	600644	乐山电力	341,400	2,792,652.00	0.52
88	600512	腾达建设	680,300	2,789,230.00	0.52
89	000782	美达股份	308,400	2,787,936.00	0.52
90	002132	恒星科技	633,450	2,787,180.00	0.52

91	000001	平安银行	320,257	2,786,235.90	0.52
92	000430	张家界	245,043	2,781,238.05	0.52
93	002614	蒙发利	231,000	2,774,310.00	0.52
94	300345	红宇新材	265,000	2,771,900.00	0.51
95	601996	丰林集团	362,200	2,770,830.00	0.51
96	600791	京能置业	398,100	2,766,795.00	0.51
97	000548	湖南投资	356,500	2,766,440.00	0.51
98	600679	上海凤凰	185,000	2,758,350.00	0.51
99	000429	粤高速 A	501,500	2,758,250.00	0.51
100	000789	万年青	446,300	2,758,134.00	0.51
101	600159	大龙地产	590,500	2,757,635.00	0.51
102	603558	健盛集团	146,132	2,757,510.84	0.51
103	300019	硅宝科技	153,200	2,756,068.00	0.51
104	603333	明星电缆	371,100	2,753,562.00	0.51
105	300272	开能环保	178,100	2,748,083.00	0.51
106	600889	南京化纤	254,700	2,745,666.00	0.51
107	601818	光大银行	730,100	2,745,176.00	0.51
108	000554	泰山石油	318,800	2,741,680.00	0.51
109	000698	沈阳化工	418,900	2,739,606.00	0.51
110	601226	华电重工	298,400	2,736,328.00	0.51
111	000551	创元科技	297,900	2,734,722.00	0.51
112	002392	北京利尔	551,300	2,723,422.00	0.51
113	002686	亿利达	201,100	2,722,894.00	0.51
114	601989	中国重工	429,600	2,719,368.00	0.50
115	002459	天业通联	165,130	2,718,039.80	0.50
116	600082	海泰发展	469,400	2,717,826.00	0.50
117	601008	连云港	572,200	2,712,228.00	0.50
118	002143	印纪传媒	115,500	2,706,165.00	0.50
119	000420	吉林化纤	404,400	2,701,392.00	0.50
120	600279	重庆港九	377,900	2,694,427.00	0.50
121	600127	金健米业	432,500	2,685,825.00	0.50
122	600615	丰华股份	150,100	2,685,289.00	0.50
123	600117	西宁特钢	529,900	2,665,397.00	0.49
124	000858	五粮液	80,300	2,612,159.00	0.49
125	000560	昆百大 A	287,100	2,578,158.00	0.48
126	000725	京东方 A	1,112,200	2,569,182.00	0.48
127	000002	万科 A	137,300	2,498,860.00	0.46
128	600015	华夏银行	247,659	2,449,347.51	0.45
129	000004	国农科技	60,800	2,239,264.00	0.42

130	000968	*ST 煤气	254,038	2,212,670.98	0.41
131	600248	延长化建	358,160	2,184,776.00	0.41
132	600637	东方明珠	87,900	2,133,333.00	0.40
133	300080	易成新能	263,300	2,043,208.00	0.38
134	300225	金力泰	282,300	2,009,976.00	0.37
135	000757	浩物股份	186,559	1,970,063.04	0.37
136	002304	洋河股份	27,200	1,956,224.00	0.36
137	002524	光正集团	240,650	1,884,289.50	0.35
138	300265	通光线缆	151,444	1,874,876.72	0.35
139	000524	岭南控股	141,263	1,847,720.04	0.34
140	300184	力源信息	166,600	1,837,598.00	0.34
141	600796	钱江生化	184,700	1,810,060.00	0.34
142	002415	海康威视	81,350	1,745,771.00	0.32
143	000610	西安旅游	118,500	1,522,725.00	0.28
144	002142	宁波银行	84,800	1,253,344.00	0.23
145	600703	三安光电	55,500	1,108,335.00	0.21
146	600690	青岛海尔	119,600	1,062,048.00	0.20
147	002236	大华股份	79,900	1,046,690.00	0.19
148	000768	中航飞机	50,100	986,469.00	0.18
149	600340	华夏幸福	40,100	977,638.00	0.18
150	002465	海格通信	77,900	969,076.00	0.18
151	000069	华侨城 A	149,800	958,720.00	0.18
152	002563	森马服饰	83,500	904,305.00	0.17
153	000895	双汇发展	42,100	879,048.00	0.16
154	601607	上海医药	48,200	870,010.00	0.16
155	601009	南京银行	90,293	847,851.27	0.16
156	002456	欧菲光	28,300	834,850.00	0.16
157	600007	中国国贸	41,023	828,664.60	0.15
158	002008	大族激光	35,300	806,252.00	0.15
159	300315	掌趣科技	76,300	800,387.00	0.15
160	600741	华域汽车	57,100	799,971.00	0.15
161	000623	吉林敖东	31,200	778,440.00	0.14
162	601998	中信银行	136,900	776,223.00	0.14
163	000963	华东医药	11,400	768,360.00	0.14
164	601888	中国国旅	17,300	760,854.00	0.14
165	300408	三环集团	39,900	716,604.00	0.13
166	002032	苏泊尔	20,800	716,560.00	0.13
167	600068	XD 葛洲坝	121,700	708,294.00	0.13
168	300003	乐普医疗	38,200	696,768.00	0.13

169	000046	泛海控股	68,800	695,568.00	0.13
170	600718	东软集团	37,850	693,412.00	0.13
171	300144	宋城演艺	27,200	677,552.00	0.13
172	000792	盐湖股份	31,000	654,100.00	0.12
173	002475	立讯精密	32,553	639,666.45	0.12
174	000413	东旭光电	73,700	633,083.00	0.12
175	600685	中船防务	24,500	621,320.00	0.12
176	000661	长春高新	5,700	608,076.00	0.11
177	600879	航天电子	36,900	574,902.00	0.11
178	601098	中南传媒	31,600	572,276.00	0.11
179	000540	中天城投	91,400	569,422.00	0.11
180	600839	四川长虹	126,200	557,804.00	0.10
181	300002	神州泰岳	49,600	527,744.00	0.10
182	600332	白云山	21,400	527,296.00	0.10
183	601238	广汽集团	21,900	514,431.00	0.10
184	300133	华策影视	32,920	512,564.40	0.10
185	300207	欣旺达	19,700	505,699.00	0.09
186	600487	亨通光电	39,100	491,878.00	0.09
187	600373	中文传媒	23,300	483,475.00	0.09
188	002156	通富微电	34,060	480,246.00	0.09
189	600208	新湖中宝	111,300	470,799.00	0.09
190	002185	华天科技	36,270	461,717.10	0.09
191	002626	金达威	27,400	461,690.00	0.09
192	600845	宝信软件	20,500	457,355.00	0.08
193	300296	利亚德	14,076	445,646.16	0.08
194	601216	君正集团	59,500	444,465.00	0.08
195	000656	金科股份	112,100	428,222.00	0.08
196	600602	云赛智联	40,100	423,456.00	0.08
197	000400	许继电气	27,400	423,056.00	0.08
198	002699	美盛文化	12,400	414,036.00	0.08
199	002589	瑞康医药	13,400	411,514.00	0.08
200	002557	洽洽食品	22,000	410,080.00	0.08
201	300287	飞利信	30,300	406,020.00	0.08
202	002410	广联达	28,300	404,690.00	0.08
203	000999	华润三九	16,700	404,474.00	0.08
204	002013	中航机电	29,850	402,378.00	0.07
205	600240	华业资本	39,200	392,784.00	0.07
206	601566	九牧王	25,400	392,176.00	0.07
207	002519	银河电子	17,300	387,866.00	0.07

208	002308	威创股份	23,500	386,105.00	0.07
209	000860	顺鑫农业	15,900	378,102.00	0.07
210	002042	华孚色纺	36,400	376,376.00	0.07
211	000733	振华科技	16,700	375,750.00	0.07
212	002425	凯撒股份	17,000	374,000.00	0.07
213	002146	荣盛发展	55,600	373,632.00	0.07
214	600325	华发股份	33,000	365,310.00	0.07
215	000028	国药一致	5,600	364,560.00	0.07
216	300115	长盈精密	17,540	361,324.00	0.07
217	300182	捷成股份	21,000	359,310.00	0.07
218	000883	湖北能源	77,300	357,899.00	0.07
219	002217	合力泰	23,100	353,430.00	0.07
220	600702	沱牌舍得	13,900	350,836.00	0.07
221	000863	三湘股份	37,900	348,680.00	0.06
222	300252	金信诺	10,300	341,239.00	0.06
223	603288	海天味业	11,000	334,400.00	0.06
224	601928	凤凰传媒	31,600	333,064.00	0.06
225	002376	新北洋	24,500	327,320.00	0.06
226	300327	中颖电子	6,100	325,923.00	0.06
227	300034	钢研高纳	14,670	324,207.00	0.06
228	300012	华测检测	26,000	321,880.00	0.06
229	002511	中顺洁柔	18,700	318,461.00	0.06
230	600622	嘉宝集团	22,500	309,375.00	0.06
231	300310	宜通世纪	8,000	305,520.00	0.06
232	300083	劲胜精密	36,900	304,794.00	0.06
233	002079	苏州固锔	26,900	300,473.00	0.06
234	000732	泰禾集团	15,100	293,544.00	0.05
235	603369	今世缘	21,700	291,214.00	0.05
236	002195	二三四五	23,600	290,044.00	0.05
237	600872	中炬高新	23,400	288,756.00	0.05
238	002368	太极股份	8,000	284,240.00	0.05
239	300114	中航电测	9,500	283,100.00	0.05
240	002436	兴森科技	12,400	282,596.00	0.05
241	300026	红日药业	16,100	279,979.00	0.05
242	300339	润和软件	7,800	279,552.00	0.05
243	000488	晨鸣纸业	34,900	277,106.00	0.05
244	002370	亚太药业	9,300	274,350.00	0.05
245	601611	中国核建	13,109	274,240.28	0.05
246	600246	万通地产	53,400	272,340.00	0.05

247	600267	海正药业	22,300	270,945.00	0.05
248	002655	共达电声	16,700	269,705.00	0.05
249	000418	小天鹅 A	8,200	267,484.00	0.05
250	002393	力生制药	7,100	267,386.00	0.05
251	300183	东软载波	10,000	265,000.00	0.05
252	002338	奥普光电	4,297	264,050.65	0.05
253	300048	合康变频	22,400	263,424.00	0.05
254	002056	横店东磁	15,400	261,800.00	0.05
255	300202	聚龙股份	10,800	261,468.00	0.05
256	002520	日发精机	17,550	259,038.00	0.05
257	002020	京新药业	20,800	257,296.00	0.05
258	002390	信邦制药	27,700	255,948.00	0.05
259	300065	海兰信	6,600	255,288.00	0.05
260	600765	中航重机	17,400	253,692.00	0.05
261	000926	福星股份	21,500	252,195.00	0.05
262	600707	彩虹股份	21,300	251,340.00	0.05
263	600183	生益科技	27,000	250,290.00	0.05
264	600517	置信电气	26,200	249,162.00	0.05
265	002329	皇氏集团	16,600	248,834.00	0.05
266	000810	创维数字	13,700	247,559.00	0.05
267	002025	航天电器	10,000	246,900.00	0.05
268	002016	世荣兆业	29,500	243,670.00	0.05
269	300148	天舟文化	15,840	240,926.40	0.04
270	002484	江海股份	15,600	237,900.00	0.04
271	300269	联建光电	9,100	236,418.00	0.04
272	600197	伊力特	15,700	236,128.00	0.04
273	300082	奥克股份	30,300	236,037.00	0.04
274	000513	丽珠集团	5,100	235,161.00	0.04
275	600533	栖霞建设	46,600	234,864.00	0.04
276	300007	汉威电子	8,300	231,736.00	0.04
277	000541	佛山照明	22,300	229,467.00	0.04
278	300219	鸿利光电	14,700	229,026.00	0.04
279	000908	景峰医药	18,920	228,553.60	0.04
280	600563	法拉电子	5,000	227,600.00	0.04
281	002218	拓日新能	22,300	227,460.00	0.04
282	002103	广博股份	11,250	227,362.50	0.04
283	000965	天保基建	38,400	227,328.00	0.04
284	002003	伟星股份	14,500	226,635.00	0.04
285	000888	峨眉山 A	18,800	226,352.00	0.04



286	002096	南岭民爆	15,000	223,500.00	0.04
287	002111	威海广泰	8,500	223,465.00	0.04
288	002090	金智科技	7,500	220,275.00	0.04
289	600998	九州通	12,500	218,875.00	0.04
290	002151	北斗星通	6,500	218,790.00	0.04
291	300356	光一科技	4,500	217,980.00	0.04
292	300157	恒泰艾普	20,200	217,958.00	0.04
293	300031	宝通科技	8,500	216,920.00	0.04
294	002695	煌上煌	4,300	216,548.00	0.04
295	600460	士兰微	27,100	214,903.00	0.04
296	600823	世茂股份	31,640	214,835.60	0.04
297	002528	英飞拓	24,180	214,718.40	0.04
298	603678	火炬电子	2,800	213,416.00	0.04
299	002371	七星电子	5,100	213,282.00	0.04
300	000967	盈峰环境	9,600	213,024.00	0.04
301	002585	双星新材	19,800	210,276.00	0.04
302	000040	宝安地产	17,800	208,972.00	0.04
303	600353	旭光股份	25,200	208,404.00	0.04
304	000422	湖北宜化	33,700	205,907.00	0.04
305	000869	张裕 A	5,100	204,918.00	0.04
306	601999	出版传媒	21,337	203,128.24	0.04
307	300256	星星科技	11,200	202,944.00	0.04
308	000620	新华联	22,100	202,215.00	0.04
309	300198	纳川股份	12,500	201,125.00	0.04
310	000701	厦门信达	11,400	200,982.00	0.04
311	600716	凤凰股份	26,900	200,136.00	0.04
312	002394	联发股份	13,100	197,810.00	0.04
313	600529	山东药玻	11,227	197,707.47	0.04
314	600684	珠江实业	26,300	197,513.00	0.04
315	600809	山西汾酒	8,900	197,402.00	0.04
316	600983	惠而浦	15,900	197,160.00	0.04
317	601218	吉鑫科技	37,200	194,928.00	0.04
318	300209	天泽信息	7,700	194,425.00	0.04
319	600479	千金药业	11,500	194,235.00	0.04
320	002129	中环股份	23,400	193,986.00	0.04
321	600337	美克家居	14,900	193,849.00	0.04
322	002503	搜于特	15,600	193,752.00	0.04
323	002383	合众思壮	5,400	193,482.00	0.04
324	000596	古井贡酒	4,000	191,800.00	0.04

325	603368	柳州医药	2,200	191,004.00	0.04
326	600239	云南城投	40,300	186,992.00	0.03
327	600619	海立股份	15,300	184,365.00	0.03
328	600616	金枫酒业	18,000	183,960.00	0.03
329	300086	康芝药业	15,900	182,850.00	0.03
330	300232	洲明科技	11,500	182,275.00	0.03
331	600273	嘉化能源	20,400	181,764.00	0.03
332	600757	长江传媒	21,600	181,224.00	0.03
333	300158	振东制药	11,100	179,265.00	0.03
334	300127	银河磁体	6,996	178,258.08	0.03
335	600059	古越龙山	17,300	178,017.00	0.03
336	600075	新疆天业	15,400	177,254.00	0.03
337	601127	小康股份	7,381	176,184.47	0.03
338	600419	天润乳业	3,200	172,448.00	0.03
339	000032	深桑达 A	11,160	170,636.40	0.03
340	002449	国星光电	12,800	169,856.00	0.03
341	002029	七匹狼	16,700	169,505.00	0.03
342	601233	桐昆股份	15,600	169,416.00	0.03
343	002463	沪电股份	31,400	165,792.00	0.03
344	603328	依顿电子	5,600	165,424.00	0.03
345	000971	高升控股	6,600	164,472.00	0.03
346	600819	耀皮玻璃	25,800	160,734.00	0.03
347	002661	克明面业	9,700	159,177.00	0.03
348	300076	GQY 视讯	13,600	158,712.00	0.03
349	600551	时代出版	7,900	157,684.00	0.03
350	300200	高盟新材	9,600	156,480.00	0.03
351	600825	新华传媒	19,600	155,820.00	0.03
352	600657	信达地产	31,100	154,878.00	0.03
353	603020	爱普股份	6,700	153,363.00	0.03
354	002264	新华都	17,800	152,190.00	0.03
355	000919	金陵药业	11,500	150,535.00	0.03
356	300102	乾照光电	16,400	148,912.00	0.03
357	002133	广宇集团	23,100	148,764.00	0.03
358	300194	福安药业	6,800	147,220.00	0.03
359	000669	金鸿能源	8,800	146,960.00	0.03
360	300223	北京君正	3,300	145,200.00	0.03
361	600781	辅仁药业	8,300	144,669.00	0.03
362	300018	中元华电	11,000	139,810.00	0.03
363	000030	富奥股份	19,300	138,381.00	0.03

364	601231	环旭电子	12,900	138,030.00	0.03
365	300397	天和防务	4,000	136,000.00	0.03
366	300395	菲利华	5,050	135,239.00	0.03
367	002420	毅昌股份	15,400	133,980.00	0.02
368	600141	兴发集团	11,400	131,328.00	0.02
369	002674	兴业科技	8,500	130,305.00	0.02
370	300242	明家联合	3,700	129,463.00	0.02
371	603008	喜临门	7,400	127,206.00	0.02
372	603806	福斯特	2,400	125,256.00	0.02
373	600429	三元股份	15,900	124,497.00	0.02
374	002351	漫步者	9,600	124,416.00	0.02
375	000153	丰原药业	11,900	122,689.00	0.02
376	300403	地尔汉宇	2,200	122,254.00	0.02
377	002279	久其软件	5,500	121,990.00	0.02
378	000716	黑芝麻	17,800	120,328.00	0.02
379	300218	安利股份	7,400	113,886.00	0.02
380	002419	天虹商场	9,400	112,424.00	0.02
381	000975	银泰资源	7,300	105,047.00	0.02
382	300230	永利股份	3,600	104,688.00	0.02
383	002216	三全食品	11,700	100,620.00	0.02
384	300317	珈伟股份	2,900	95,700.00	0.02
385	000156	华数传媒	5,000	92,750.00	0.02
386	300241	瑞丰光电	5,600	92,456.00	0.02
387	300110	华仁药业	9,700	92,441.00	0.02
388	002349	精华制药	4,200	90,342.00	0.02
389	300038	梅泰诺	1,700	85,986.00	0.02
390	300447	全信股份	1,800	80,406.00	0.01
391	002705	新宝股份	5,070	79,193.40	0.01
392	300211	亿通科技	5,700	78,261.00	0.01
393	300286	安科瑞	2,600	77,194.00	0.01
394	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.01
395	300389	艾比森	3,009	73,931.13	0.01
396	002637	赞宇科技	5,600	70,280.00	0.01
397	603366	日出东方	8,300	69,720.00	0.01
398	002088	鲁阳节能	4,400	68,464.00	0.01
399	300319	麦捷科技	2,300	66,286.00	0.01
400	603001	奥康国际	3,000	63,780.00	0.01
401	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.01
402	002719	麦趣尔	1,300	63,154.00	0.01

403	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
404	300393	中来股份	1,650	60,522.00	0.01
405	000719	大地传媒	5,720	60,403.20	0.01
406	300279	和晶科技	1,200	56,988.00	0.01
407	601966	玲珑轮胎	4,383	56,891.34	0.01
408	300062	中能电气	2,200	53,306.00	0.01
409	300412	迦南科技	1,400	49,840.00	0.01
410	603688	石英股份	2,300	47,886.00	0.01
411	002331	皖通科技	2,880	47,635.20	0.01
412	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.01
413	300332	天壕环境	5,000	46,850.00	0.01
414	002745	木林森	1,300	44,187.00	0.01
415	600511	国药股份	1,600	43,872.00	0.01
416	300292	吴通控股	1,300	43,238.00	0.01
417	002120	新海股份	2,100	43,008.00	0.01
418	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.01
419	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
420	300305	裕兴股份	1,700	23,562.00	0.00
421	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
422	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
423	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
424	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
425	300298	三诺生物	260	5,449.60	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

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	600016	民生银行	12,436,891.97	2.75
2	600000	浦发银行	7,391,431.56	1.63
3	600814	杭州解百	6,722,177.00	1.48
4	601166	兴业银行	5,747,752.21	1.27
5	601318	中国平安	5,722,932.99	1.26
6	002545	东方铁塔	5,256,712.37	1.16
7	002060	粤水电	5,199,541.32	1.15
8	002392	北京利尔	5,193,374.00	1.15

9	000521	美菱电器	5,112,279.61	1.13
10	002495	佳隆股份	5,049,062.52	1.11
11	000782	美达股份	5,011,150.94	1.11
12	600371	万向德农	5,002,615.68	1.10
13	601328	交通银行	4,965,540.00	1.10
14	300303	聚飞光电	4,919,316.34	1.09
15	601226	华电重工	4,815,544.01	1.06
16	600698	湖南天雁	4,708,720.10	1.04
17	600248	延长化建	4,695,938.04	1.04
18	600854	春兰股份	4,685,576.50	1.03
19	000753	漳州发展	4,656,616.29	1.03
20	000560	昆百大A	4,644,209.00	1.03

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

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

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	600016	民生银行	12,614,858.56	2.78
2	600000	浦发银行	7,632,549.88	1.69
3	600891	秋林集团	6,310,743.46	1.39
4	000056	皇庭国际	6,234,609.53	1.38
5	300320	海达股份	6,122,421.37	1.35
6	601318	中国平安	5,868,337.00	1.30
7	002150	通润装备	5,356,002.49	1.18
8	002295	精艺股份	5,321,004.00	1.17
9	002220	天宝股份	5,283,243.80	1.17
10	600493	凤竹纺织	5,110,798.04	1.13
11	002397	梦洁股份	5,076,188.00	1.12
12	002600	江粉磁材	5,020,381.00	1.11
13	601288	农业银行	4,945,490.26	1.09
14	002495	佳隆股份	4,669,918.23	1.03
15	600647	同达创业	4,658,510.26	1.03
16	600475	华光股份	4,621,539.26	1.02
17	002613	北玻股份	4,525,261.11	1.00
18	002328	新朋股份	4,519,070.15	1.00

19	000407	胜利股份	4,486,454.49	0.99
20	002100	天康生物	4,392,070.71	0.97

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	1,028,925,459.67
卖出股票收入（成交）总额	911,224,876.60

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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投资。

### 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：本基金本报告期内未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 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的备选股票库。

### 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	130,310.54
2	应收证券清算款	410,503.25
3	应收股利	-
4	应收利息	11,284.36
5	应收申购款	130,178.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	682,276.93

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600203	福日电子	3,948,538.80	0.73	重大事项临时停牌
2	300353	东土科技	3,412,905.00	0.63	重大事项临时停牌

## §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
16,915	22,587.15	91,953,659.73	24.07%	290,107,962.14	75.93%

**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	158,136.39	0.0414%

**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	0
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（2010年3月30日）基金份额总额	2,173,254,149.88
本报告期期初基金份额总额	300,223,083.71
本报告期基金总申购份额	161,726,395.51
减：本报告期基金总赎回份额	79,887,857.35
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	382,061,621.87

**§10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

本报告期内，基金管理人没有发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。



**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期内本基金投资策略未改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	1	873,234,754.11	45.05%	795,784.92	44.64%	-
中投证券	1	516,958,812.75	26.67%	481,442.11	27.01%	-
银河证券	1	279,024,157.70	14.39%	259,856.45	14.58%	-
华泰证券	2	269,351,173.69	13.89%	245,459.63	13.77%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

注：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**

- a、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- b、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；
- c、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- d、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交易单元：

- a、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；
- b、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；
- c、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
广发证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	13,991.20	100.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

**10.8 其他重大事件**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方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
2	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
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	中国证券报、上海证券报、证券	2016年6月23日

	业务的公告	时报	
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
6	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 5 月 10 日
7	南方基金关于旗下部分基金增加潍坊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 26 日
8	南方基金关于旗下部分基金增加德州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 15 日
9	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
10	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 31 日
11	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
12	关于南方策略优化混合型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	2016 年 3 月 5 日
13	关于公司旗下基金调整停牌股票估值	中国证券报、上	2016 年 2 月

	方法的提示性公告	海证券报、证券时报	18 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	南方基金关于旗下部分基金增加陆金所资管、唐鼎耀华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 1 日
16	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 28 日
17	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
18	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
19	南方基金关于旗下部分基金增加昆仑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 1 月 26 日
20	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
21	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 12 日
22	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 8 日

23	南方基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 7 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 7 日
24	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 5 日
25	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 5 日
26	南方基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 4 日
27	南方基金管理有限公司关于在 2016 年 1 月 4 日指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 4 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策略优化混合型证券投资基金的文件。
- 2、南方策略优化混合型证券投资基金基金合同。
- 3、南方策略优化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>

