南方香港优选股票型证券投资基金
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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 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 境外资产托管人.....6
2.5 信息披露方式.....6
2.6 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遵规守信情况的说明.....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.....11
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遵规守信情况声明.....12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见.....12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....13
6.1 资产负债表.....13
6.2 利润表.....14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....15
6.4 报表附注.....16
§7 投资组合报告.....32
7.1 期末基金资产组合情况.....32
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....33
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....33
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....33
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....36
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....38
7.7 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.....38
7.8 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.....38
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金融衍生品投资明细.....38
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....38
7.11 投资组合报告附注.....38

§8 基金份额持有人信息.....39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....39
8.2 期末上市基金前十名持有人.....39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....39
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....40
§9 开放式基金份额变动.....40
§10 重大事件揭示.....40
10.1 基金份额持有人大会决议.....40
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.....40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....40
10.4 基金投资策略的改变.....40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....41
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.....41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....41
10.8 其他重大事件.....43
§11 备查文件目录.....44
11.1 备查文件目录.....44
11.2 存放地点.....45
11.3 查阅方式.....45

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方香港优选股票型证券投资基金
基金简称	南方香港优选股票型证券投资基金
场内简称	南方香港
基金主代码	160125
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2015 年 5 月 13 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	638,045,715.33 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	2015 年 5 月 13 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“南方香港”。

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，积极挖掘香港证券市场上的主题性投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，通过“自上而下”的分析策略对宏观经济中结构性、政策性、周期性以及突发性事件进行研判，挖掘未来经济的发展趋势及背后的驱动因素，预测可能对资本市场产生的重大影响，确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中，采用“自下而上”的策略，精选出具有持续竞争优势，且估值有吸引力的股票，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获取超额收益。
业绩比较基准	经人民币汇率调整的恒生指数收益率×95%＋人民币同期活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	林葛
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599

传真	0755-82763889	010-68121816
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	北京东城区建国门内大街69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	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	518048	100031
法定代表人	吴万善	周慕冰

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	纽约梅隆银行股份有限公司
注册地址		225 Liberty St, New York, New York 10286 USA
办公地址		225 Liberty St, New York, New York 10286 USA
邮政编码		10286

2.5 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

2.6 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	北京市西城区太平桥大街17号

§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	-37,269,744.90
本期利润	-103,526,861.83
加权平均基金份额本期利润	-0.1504

本期加权平均净值利润率	-19.40%
本期基金份额净值增长率	-13.96%
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	-330,298,677.85
期末可供分配基金份额利润	-0.5177
期末基金资产净值	498,944,068.09
期末基金份额净值	0.7820
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	-35.52%

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）。

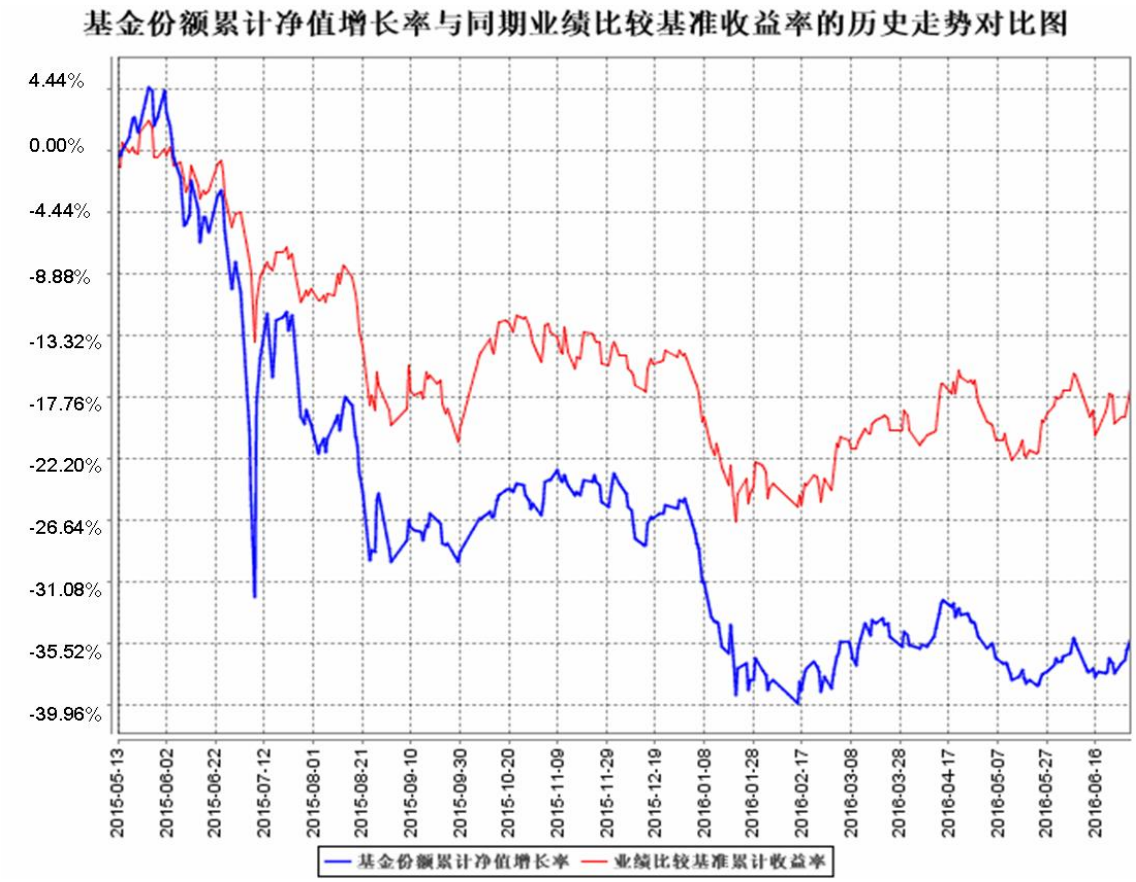
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	2.22%	1.14%	0.79%	1.34%	1.43%	-0.20%
过去三个月	-0.55%	0.94%	2.55%	1.17%	-3.10%	-0.23%
过去六个月	-13.96%	1.45%	-2.98%	1.32%	-10.98%	0.13%
过去一年	-30.27%	2.37%	-13.38%	1.44%	-16.89%	0.93%
自基金合同生效起至今	-35.52%	2.66%	-16.85%	1.41%	-18.67%	1.25%

3.2.2 自基金转型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：本基金转型日期为 2015 年 5 月 13 日。本基金建仓期为基金转型合同生效之日起 6 个月内。建仓期结束时，本基金各项资产配置比例达到基金合同的约定。

§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		
黄亮	本基金基金经理	2011 年 9 月 26 日	-	15 年	北京大学工商管理硕士，具有基金从业资格。曾任职于招商证券股份有限公司、天华投资有限责任公司，2005 年加入南方基金国际业务部，负责 QDII 产品设计及国际业务开拓工作，2007 年 9 月至 2009 年 5 月，担任南方全球基金经理助理；2015 年 9 月至今，任国际投资决策委员会委员；2016 年 5 月至今，担任国际业务部执行总监；2009 年 6 月至今，担任南方全球基金经理；2010 年 12 月至今，任南方金砖基金经理；2011 年 9 月至 2015 年 5 月，任南方中国中小盘基金经理；2015 年 5 月至今，任南方中国香港优选基金基金经理；2016 年 6 月至今，任南方原油基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方香港优选股票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，没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占优比也没有明显异常，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

2016 年伊始,全球资本市场在整体经济数据疲弱、对中国经济减速担忧升温以及朝鲜宣布氢弹试验成功的背景下，避险情绪迅速提升。原油、股票等风险类资产遭遇重创，黄金、美国国债等避险类资产受到追捧。1 月 21 日，欧洲央行行长德拉吉发表鸽派观点，称预计利率将维持当前或更低水平一段时间。随后美联储延迟加息、日本央行启动负利率政策、欧洲央行下调再融资利率，市场情绪得到一定提振，大宗商品价格快速上扬，全球股市多数收复了一月份的跌幅。进入第二季度，在经济数据普遍较为平淡的背景下，全球股票市场并未延续一季度下半段的反弹行情，而是呈现震荡整理的态势。英国意外退出欧盟给资本市场带来剧烈震荡，造成全球股市大幅下跌，避险类资产黄金、美元指数显著上涨，但公投结束后的一个星期随着宽松预期升温,主要股指回补了退欧当日的跌幅。

2016 年年初美联储加息预期较高,市场普遍认为年内会有 2-3 次加息，但由于全球经济增长乏力、资本市场波动加大、英国退欧等事件所带来的负面影响，加息预期逐步降温，美联储也如预期延续了较为鸽派的货币政策，上半年四次议息会议（2 月 1 日、3 月 16 日、4 月 27 日、6 月 15 日）均维持基准利率不变。值得一提的是，六月初公布的美国 5 月非农就业数据显著低于预期，使上半年末市场对 9 月份议息会议加息的判断接近零。

报告期间,MSCI 发达国家指数下跌 0.6%，MSCI 新兴市场指数上涨 5.0%,恒生指数下跌

5.1%,黄金价格上涨 24.6%，十年期美国国债、十年期日本国债及十年期德国国债收益率分别下降了 80、48 和 76 个基点。新兴市场主要国家报告期间表现较好,其中巴西圣保罗证交所指数上涨 18.9%,俄罗斯 MICEX 指数上涨 7.4%,印度 Nifty 指数上涨 4.3%。

港股市场方面,恒生指数一月份大幅下挫,之后五个月震荡回升,收复了一月份的大部分跌幅。港股通 5 月以来持续大幅净流入,截止至 6 月底港股通总投资额度可用余额仅剩余 579 亿元，累计使用额度占总额度比例达到 76.8%。行业方面，能源板块及原材料板块表现较好,分别跑赢恒生指数 17.7%和 14.1%；综合板块及金融板块则大幅跑输恒生指数 11.5%和 8.5%。

上半年，港股市场跟随全球主要股票市场一起出现了较大幅度的震荡，在资产配置上，本基金维持了较为均衡的仓位水平。在投资策略上遵循先优选行业，再配置个股，其次注意持仓成本的原则。对金融、工业行业进行了较高比例的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期份额净值增长率为 -13.96%，同期业绩比较基准增长率为 -2.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年二季度的英国退欧公投将对全球政治经济走势带来深远影响，并衍生出卡梅隆辞职后的英国大选、英国与欧盟就退欧问题的磋商、欧盟是否会进一步瓦解、欧洲银行体系系统性风险是否会爆发等一系列问题。展望 2016 年下半年，全球经济缺乏新的增长点，日本参议院大选后的货币政策安排将成为新的不确定因素。未来港股市场仍将会受到海外和中国双层因素的影响，虽然下半年海外市场不确定因素繁多，考虑到当前港股的估值水平以及未来深港通等事件型因素的影响，我们整体对于香港市场并不悲观，并将择机买入受益的行业和个股。

未来本基金投资团队将密切关注市场变化趋势，谨慎勤勉、恪尽职守，为投资者追求稳定持续的回报。

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，组成人员包括副总裁、总裁助理兼权益投资总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等。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

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；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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，南方基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《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

本托管人认为，南方基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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： 南方香港优选股票型证券投资基金
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
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	86,458,698.64	92,117,883.62
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	410,851,954.98	805,481,696.94
其中：股票投资		410,851,954.98	805,481,696.94
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	6.4.7.3	76.92	791.70
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,616.24	1,862.71
应收股利		5,578,624.42	-
应收申购款		486,762.44	103,816.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		503,379,733.64	897,706,051.55
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2016 年 6 月 30 日**	**上年度末 2015 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	57,840,326.05

应付赎回款		3,427,267.09	2,233,005.49
应付管理人报酬		641,223.43	1,133,874.86
应付托管费		120,229.38	212,601.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	246,945.65	421,583.55
负债合计		4,435,665.55	61,841,391.48
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	638,045,715.33	919,612,440.01
未分配利润	6.4.7.10	-139,101,647.24	-83,747,779.94
所有者权益合计		498,944,068.09	835,864,660.07
负债和所有者权益总计		503,379,733.64	897,706,051.55

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7820 元，基金份额总额 638,045,715.33 份。

6.2 利润表

会计主体：南方香港优选股票型证券投资基金
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 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-96,261,664.21	-172,858,254.73
1.利息收入		583,110.38	99,911.27
其中：存款利息收入	6.4.7.11	33,906.90	99,911.27
债券利息收入		549,203.48	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-35,436,564.01	30,032,872.11
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-43,375,213.79	5,352,929.00
基金投资收益	6.4.7.13	-	539,737.54
债券投资收益	6.4.7.14	642,624.00	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-

衍生工具收益	6.4.7.16	-	679,736.21
股利收益	6.4.7.17	7,296,025.78	23,460,469.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-66,257,116.93	-209,419,233.65
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		4,520,148.72	5,788,618.69
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	328,757.63	639,576.85
减：二、费用		7,265,197.62	11,751,686.00
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	4,264,101.08	5,388,504.30
2．托管费	6.4.10.2.2	799,518.91	1,010,344.53
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.20	1,926,770.50	5,275,108.21
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．其他费用	6.4.7.21	274,807.13	77,728.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-103,526,861.83	-184,609,940.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-103,526,861.83	-184,609,940.73

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方香港优选股票型证券投资基金
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）	919,612,440.01	-83,747,779.94	835,864,660.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-103,526,861.83	-103,526,861.83
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）	-281,566,724.68	48,172,994.53	-233,393,730.15
其中：1.基金申购款	45,381,600.95	-10,499,837.73	34,881,763.22

2.基金赎回款	-326,948,325.63	58,672,832.26	-268,275,493.37
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）	638,045,715.33	-139,101,647.24	498,944,068.09

项目	上年度可比期间 2015 年 5 月 13 日(基金合同生效日)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）	2,292,367,534.76	487,651,662.18	2,780,019,196.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-184,609,940.73	-184,609,940.73
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）	-201,474,709.94	-49,172,544.53	-250,647,254.47
其中：1.基金申购款	218,326,329.15	44,284,757.52	262,611,086.67
2.基金赎回款	-419,801,039.09	-93,457,302.05	-513,258,341.14
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）	2,090,892,824.82	253,869,176.92	2,344,762,001.74

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

6.4.1.1 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。

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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)对基金通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(3)基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(4)目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。

(5)目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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	86,458,698.64
定期存款	-
其他存款	-
合计：	86,458,698.64

注：货币资金中包括以下外币余额：

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	外币金额	汇率	折合人民币
港元	80,270,390.26	0.85467	68,604,694.44
美元	26,869.31	6.6312	178,175.77
合计			68,782,870.21

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		462,021,457.16	410,851,954.98	-51,169,502.18
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		462,021,457.16	410,851,954.98	-51,169,502.18

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

单位： 人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	76.92	-	
配股权证	-	76.92	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	76.92	-	

6.4.4.4 买入返售金融资产

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	3,616.24
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	-
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	-
合计	3,616.24

6.4.4.6 其他资产

注：无余额。

6.4.4.7 应付交易费用

注：无余额。

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	9,204.41
预提费用	237,741.24
合计	246,945.65

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	919,612,440.01	919,612,440.01
本期申购	45,381,600.95	45,381,600.95
本期赎回(以"-"号填列)	-326,948,325.63	-326,948,325.63
本期末	638,045,715.33	638,045,715.33

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	-432,188,683.82	348,440,903.88	-83,747,779.94
本期利润	-37,269,744.90	-66,257,116.93	-103,526,861.83
本期基金份额交易产生的变动数	139,159,750.87	-90,986,756.34	48,172,994.53
其中：基金申购款	-23,496,148.18	12,996,310.45	-10,499,837.73
基金赎回款	162,655,899.05	-103,983,066.79	58,672,832.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-330,298,677.85	191,197,030.61	-139,101,647.24

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	33,791.72
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	-
其他	115.18
合计	33,906.90

6.4.4.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	617,070,951.16
减：卖出股票成本总额	660,446,164.95
买卖股票差价收入	-43,375,213.79

6.4.4.13 基金投资收益

注：无。

6.4.4.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	63,089,645.88
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	60,846,811.20
减：应收利息总额	1,600,210.68
买卖债券差价收入	642,624.00

6.4.4.14.1 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.4.15 贵金属投资收益

注：无。

6.4.4.16 衍生工具收益

注：无。

6.4.4.17 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	7,296,025.78
基金投资产生的股利收益	-
合计	-

6.4.4.18 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	-66,256,402.15
——股票投资	-66,256,402.15
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-714.78
——权证投资	-714.78
3.其他	-
合计	-66,257,116.93

6.4.4.19 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	328,757.63
合计	328,757.63

注：本基金场内部分的赎回费率为 0.50%，场外部分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。

6.4.4.20 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	1,926,770.50
银行间市场交易费用	-
合计	1,926,770.50

6.4.4.21 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	49,726.04
信息披露费	149,179.94

银行汇划费	180.00
账户维护费	9,000.00
上市年费	29,835.26
其他（美元）	36,370.17
指数使用费	515.72
其他（港币）	-
其他（人民币）	-
合计	274,807.13

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
纽约梅隆银行股份有限公司(“纽约梅隆银行”)	境外资产托管人
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

注：关联方与基金进行的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

无。

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	上年度可比期间 2015 年 5 月 13 日(基金合同

	2016 年 6 月 30 日	生效日)至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,264,101.08	5,388,504.30
其中：支付销售机构的客户维护费	713,830.09	547,329.57

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.6%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 1.6% / 当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	799,518.91	1,010,344.53

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.3%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 0.3% / 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

份额单位：份

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 5 月 13 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2015 年 5 月 13 日）持有的基金份额	76,156,433.48	76,156,433.48
期初持有的基金份额	56,151,933.26	76,156,433.48
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	6,381,933.26	20,004,500.22
期末持有的基金份额	49,770,000.00	56,151,933.26
期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.8000%	6.1100%

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 5 月 13 日(基金合同生效日)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
中国农业银行	17,779,099.40	33,791.72	46,891,932.59	99,911.27
纽约梅隆银行	68,679,599.24	-	324,614,026.53	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国农业银行和境外资产托管人纽约梅隆银行保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 利润分配情况

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

无。

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
1228 HK	奇峰国际	2014 年 11 月 20 日	重大事项	-	-	-	110,000	32,822.22	0.94	-
1638 HK	佳兆业集团	2015 年 3 月 30 日	重大事项	1.33	-	-	46,000	56,117.33	61,331.12	-
1698 HK	博士蛙国际	2012 年 3 月 15 日	重大事项	0.14	-	-	44,000	74,335.78	6,242.51	-
2468	创益太阳	2012 年	重大事	0.13	-	-	39,000	44,553.94	5,133.15	-

HK	能	6 月 20 日	项							
67 HK	旭光高新	2014 年 3 月 25 日	重要事项未公告	0.01	-	-	118,000	134,203.06	1,008.51	-
691 HK	中国山水水泥集团	2015 年 4 月 15 日	重大事项	4.45	-	-	2,409,000	11,591,834.35	10,726,869.16	-
773 HK	中国金属再生资源	2013 年 1 月 28 日	分拆出售	1.06	-	-	50,000	291,930.06	52,989.54	-

注：1、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。

2、期末估值单价采用 2016 年 6 月 30 日即期汇率将港币折算为人民币，复牌开盘单价采用复牌日的即期汇率将港币折算为人民币。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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

本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理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“风险和收益相匹配”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控管理部负责，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。

6.4.10.2 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农业银行及境外资产托管人纽约梅隆银行 ，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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资。

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

基金所持证券在证券交易所上市，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，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过参与证券借贷交易和正回购交易融入短期资金应对流动性需求，所有已售出而未回购证券总市值不得超过本基金总资产的 50%。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

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	86,458,698.64	-	-	-	86,458,698.64
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	410,851,954.98	410,851,954.98
衍生金融资产	-	-	-	76.92	76.92
买入返售金融资产	-	-	-		
应收证券清算款	-	-	-	-	-

应收利息	-	-	-	3,616.24	3,616.24
应收股利	-	-	-	5,578,624.42	5,578,624.42
应收申购款	-	-	-	486,762.44	486,762.44
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	86,458,698.64	-	-	416,921,035.00	503,379,733.64
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,427,267.09	3,427,267.09
应付管理人报酬	-	-	-	641,223.43	641,223.43
应付托管费	-	-	-	120,229.38	120,229.38
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	246,945.65	246,945.65
负债总计	-	-	-	4,435,665.55	4,435,665.55
利率敏感度缺口	86,458,698.64	-	-	412,485,369.45	498,944,068.09
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	92,117,883.62	-	-	-	92,117,883.62
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	805,481,696.94	805,481,696.94
衍生金融资产	-	-	-	791.70	791.70
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	1,862.71	1,862.71
应收申购款	-	-	-	103,816.58	103,816.58
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	92,117,883.62	-	-	805,588,167.93	897,706,051.55
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	57,840,326.05	57,840,326.05
应付赎回款	-	-	-	2,233,005.49	2,233,005.49
应付管理人报酬	-	-	-	1,133,874.86	1,133,874.86
应付托管费	-	-	-	212,601.53	212,601.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	421,583.55	421,583.55
负债总计	-	-	-	61,841,391.48	61,841,391.48
利率敏感度缺口	92,117,883.62	-	-	743,746,776.45	835,864,660.07

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。

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.10.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	178,175.77	68,604,694.44	17,675,828.43	86,458,698.64
交易性金融资产	-	410,851,954.98		410,851,954.98
衍生金融资产	-	76.92		76.92
应收股利	-	5,578,624.42		5,578,624.42
应收利息	-	0.26	3,615.98	3,616.24
应收申购款			486,762.44	486,762.44
资产合计	178,175.77	485,035,351.02	18,166,206.85	503,379,733.64
以外币计价的负债				
应付赎回款			3,427,267.09	3,427,267.09
应付管理人报酬			641,223.43	641,223.43
应付托管费			120,229.38	120,229.38
其它负债			246,945.65	246,945.65
负债合计			4,435,665.55	4,435,665.55
资产负债表外汇风险敞口净额	178,175.77	485,035,351.02	13,730,541.30	498,944,068.09
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日			

	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	186,278.08	76,982,287.63	14,949,317.91	92,117,883.62
交易性金融资产	-	805,481,696.94		805,481,696.94
衍生金融资产	-	791.70		791.70
应收利息	-	0.28	1,862.43	1,862.71
应收申购款	-	-	103,816.58	103,816.58
资产合计	186,278.08	882,464,776.55	15,054,996.92	897,706,051.55
应付证券清算款	-	57,840,326.05	-	57,840,326.05
应付赎回款	-	-	2,233,005.49	2,233,005.49
应付管理人报酬	-	-	1,133,874.86	1,133,874.86
应付托管费	-	-	212,601.53	212,601.53
其它负债	-	-	421,583.55	421,583.55
负债合计	-	57,840,326.05	4,001,065.43	61,841,391.48
资产负债表外汇风险敞口净额	186,278.08	824,624,450.50	11,053,931.49	835,864,660.07

6.4.10.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除港币和美元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）
	港币和美元均相对人民币升值 5%	增加约 2426	增加约 4,124
	港币和美元均相对人民币贬值 5%	减少约 2426	减少约 4,124

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，采用“自上而下”的策略，通过通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整各类资产的比例，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。

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(普通股、优先股)的基金资产占基金资产总值的比例为 80%-95%；其余基金资产投资于存托凭证、房地产信托凭证、公募基金、金融衍生产品、结构性投资产品、货币市场工具、其它固定收益产品以及相关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具，其占基金资产总值的比例为 5%-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。

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	410,851,954.98	82.34	805,481,696.94	96.37
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	76.92	0.00	791.70	0.00
其他	-	-	-	-
合计	410,852,031.90	82.34	805,482,488.64	96.37

6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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.业绩比较基准上升 5%	增加约 2,399.00	增加约 5,476.00
	2.业绩比较基准下降 5%	减少约 2,399.00	减少约 5,476.00

§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	410,851,954.98	81.62
	其中：普通股	410,851,954.98	81.62
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	76.92	0.00
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	76.92	0.00
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	86,458,698.64	17.18
8	其他各项资产	6,069,003.10	1.21
9	合计	503,379,733.64	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
中国香港	410,851,954.98	82.34
合计	410,851,954.98	82.34

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
通讯	4,545,989.73	0.91
非必需消费品	6,242.51	0.00
必需消费品	13,030,298.82	2.61
能源	5,133.15	0.00
金融	187,355,424.26	37.55

保健	-	-
工业	113,978,791.20	22.84
材料	91,930,075.31	18.42
科技	-	-
公用事业	-	-
合计	410,851,954.98	82.34

注：本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	China Overseas Property Holdings Limited	中海物业集团有限公司	2669 HK	香港交易所	中国	42,000,000	40,921,599.60	8.20
2	CITIC Limited	中国中信股份有限公司	267 HK	香港交易所	中国	4,000,000	38,562,710.40	7.73
3	China Overseas Land And Investment Ltd.	中国海外发展有限公司	688 HK	香港交易所	中国	1,770,000	37,062,764.55	7.43
4	Luoyang Glass Company Limited	洛阳玻璃股份有限公司	1108 HK	香港交易所	中国	9,000,000	35,998,700.40	7.21
5	CRRC Corporation Limited	中国中车股份有限公司	1766 HK	香港交易所	中国	6,000,000	35,434,618.20	7.10
6	China Energy Engineering Corporation Limited	中国能源建设股份有限公司	3996 HK	香港交易所	中国	31,700,000	34,679,089.92	6.95
7	China Vanke CO.,LTD.	万科企业股份有限公司	2202 HK	香港交易所	中国	2,300,000	29,879,263.20	5.99

8	First Tractor Company Limited	第一拖拉机股份有限公司	38 HK	香港交易所	中国	8,000,000	27,212,692.80	5.45
9	Jiangxi Copper Company Limited	江西铜业股份有限公司	358 HK	香港交易所	中国	3,000,000	22,127,406.30	4.43
10	Evergrande Real Estate Group Limited	恒大地产集团有限公司	3333 HK	香港交易所	中国	5,000,000	20,298,412.50	4.07
11	Beijing Capital International Airport Company Limited	北京首都国际机场股份有限公司	694 HK	香港交易所	中国	2,000,000	14,358,456.00	2.88
12	Zhaojin Mining Industry Company Limited	招金矿业股份有限公司	1818 HK	香港交易所	中国	2,000,000	13,999,494.60	2.81
13	LOccitane International S.A.	LOccitane International S.A.	973 HK	香港交易所	中国	962,500	13,030,298.82	2.61
14	China Shanshui Cement Group Limited	中国山水水泥集团有限公司	691 HK	香港交易所	中国	2,409,000	10,726,869.16	2.15
15	Sinopec Shanghai Petrochemical Company Limited	中国石化上海石油化工股份有限公司	338 HK	香港交易所	中国	3,000,000	9,076,595.40	1.82
16	China Citic Bank Corporation Limited	中信银行股份有限公司	998 HK	香港交易所	中国	2,000,000	8,050,991.40	1.61
17	Citic Securities Company Limited	中信证券股份有限公司	6030 HK	香港交易所	中国	500,000	7,264,695.00	1.46
18	Ping An Insurance	中国平安保险(集团)	2318 HK	香港交易所	中国	180,000	5,253,656.49	1.05

	(Group) Company Of China,Ltd.	股份有限公司						
19	China Mobile Limited	中国移动有限公司	941 HK	香港交易所	中国	60,000	4,545,989.73	0.91
20	China Shipping Development Company Limited	中海发展股份有限公司	1138 HK	香港交易所	中国	600,000	2,240,944.74	0.45
21	Kaisa Group Holdings Ltd.	佳兆业集团控股有限公司	1638 HK	香港交易所	中国	46,000	61,331.12	0.01
22	China Metal Recycling (Holdings) Limited	中国金属再生资源(控股)有限公司	773 HK	香港交易所	中国	50,000	52,989.54	0.01
23	Boshiwa Internationa l Holding Limited	博士蛙国际控股有限公司	1698 HK	香港交易所	中国	44,000	6,242.51	0.00
24	Trony Solar Holdings Company Limited	创益太阳能控股有限公司	2468 HK	香港交易所	中国	39,000	5,133.15	0.00
25	China Lumena New Materials Corp.	中国旭光高新材料集团有限公司	67 HK	香港交易所	中国	118,000	1,008.51	0.00
26	Superb Summit Internationa l Group Limited	奇峰国际集团有限公司	1228 HK	香港交易所	中国	110,000	0.94	0.00

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	China Overseas Land And	688 HK	48,816,037.79	5.84

	Investment Ltd.			
2	Ping An Insurance (Group) Company Of China,Ltd.	2318 HK	41,421,142.32	4.96
3	China Mobile Limited	941 HK	37,828,949.04	4.53
4	CITIC Limited	267 HK	31,474,458.88	3.77
5	CNOOC Limited	883 HK	29,257,406.89	3.50
6	Evergrande Real Estate Group Limited	3333 HK	24,453,696.83	2.93
7	Citic Securities Company Limited	6030 HK	24,238,458.28	2.90
8	Hong Kong Exchanges And Clearing Limited	388 HK	23,267,757.30	2.78
9	China Citic Bank Corporation Limited	998 HK	14,868,303.37	1.78
10	CRRC Corporation Limited	1766 HK	12,470,268.61	1.49
11	China Taiping Insurance Holdings Company Limited	966 HK	12,355,538.09	1.48
12	Zhaojin Mining Industry Company Limited	1818 HK	10,690,454.42	1.28
13	Zijin Mining Group Co.,Ltd.	2899 HK	10,230,698.88	1.22
14	Sinopec Shanghai Petrochemical Company Limited	338 HK	8,131,687.68	0.97
15	China Shipping Development Company Limited	1138 HK	2,567,966.76	0.31

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	China Merchants Bank Co.,Ltd.	3968 HK	59,803,632.05	7.15
2	Dalian Port (PDA) Company Limited	2880 HK	59,061,265.14	7.07
3	Ck Hutchison Holdings Limited	1 HK	53,495,864.68	6.40
4	CITIC Limited	267 HK	51,183,705.79	6.12
5	China Overseas Land And Investment Ltd.	688 HK	47,380,600.01	5.67
6	Dalian Wanda Commercial Properties Co.,ltd.	3699 HK	35,455,470.92	4.24

7	Ping An Insurance (Group) Company Of China,Ltd.	2318 HK	33,974,806.07	4.06
8	China Mobile Limited	941 HK	33,233,623.94	3.98
9	CNOOC Limited	883 HK	29,950,381.18	3.58
10	CRRC Corporation Limited	1766 HK	29,214,773.12	3.50
11	China Construction Bank Corporation	939 HK	25,931,484.92	3.10
12	Hong Kong Exchanges And Clearing Limited	388 HK	22,374,784.73	2.68
13	China Taiping Insurance Holdings Company Limited	966 HK	21,238,943.63	2.54
14	Citic Securities Company Limited	6030 HK	19,539,316.49	2.34
15	Chongqing Rural Commercial Bank Co., Ltd.	3618 HK	18,905,196.74	2.26
16	Longfor Properties Co., Ltd.	960 HK	17,782,648.27	2.13
17	Shanghai Electric Group Company Limited	2727 HK	10,300,854.19	1.23
18	Zijin Mining Group Co.,Ltd.	2899 HK	8,708,329.37	1.04
19	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co.,ltd.	2607 HK	8,285,276.84	0.99
20	Sinopec Oilfield Service Corporation	1033 HK	7,929,817.90	0.95

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	392,919,636.34
卖出收入（成交）总额	678,560,386.35

注：买入成本和卖出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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	权证投资_配股权证	巨腾配股权证	76.92	0.00

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.11.2 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。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	5,578,624.42
4	应收利息	3,616.24
5	应收申购款	486,762.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,069,003.10

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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
13,436	47,487.77	62,367,866.98	9.77%	575,677,848.35	90.23%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	嘉兴卓凯投资有限公司－卓凯一号	7,375,544.00	4.48%
2	贺凡	5,399,254.00	3.28%
3	黎晓曦	3,500,334.00	2.13%
4	王新军	2,709,956.00	1.65%
5	顾群辉	2,666,501.00	1.62%
6	刁淑春	2,400,000.00	1.46%
7	肖潇	2,154,000.00	1.31%
8	陈宇杰	2,050,000.00	1.25%
9	融通资本－广州农村商业银行－广州农村商业银行股份有限公司	1,914,900.00	1.16%
10	刘松艳	1,804,500.00	1.10%

8.3 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	3,964,807.80	0.6214%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 13 日）基金份额总额	2,081,778,750.71
本报告期期初基金份额总额	919,612,440.01
本报告期基金总申购份额	45,381,600.95
减:本报告期基金总赎回份额	326,948,325.63
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	638,045,715.33

§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	
Morgan Stanley Asia Limited	-	259,873,756.39	27.38%	156,014.42	16.37%	-
China Merchants Securities(HK)Co Ltd	-	178,991,091.32	18.86%	196,084.20	20.58%	-
Haitong International Securities Co.,Ltd	-	121,775,041.71	12.83%	121,775.05	12.78%	-
First Shanghai Securities Ltd.	-	114,521,672.92	12.07%	137,425.79	14.42%	-
Credit Suisse(Hong Kong) Limited	-	101,147,265.37	10.66%	121,376.72	12.74%	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	70,078,201.89	7.38%	84,093.85	8.82%	-
BNP Paribas Corporate & Investment Banking	-	63,338,252.91	6.67%	93,093.77	9.77%	-
CMB International Securities Limited	-	22,374,784.72	2.36%	22,374.79	2.35%	-
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	7,175,476.97	0.76%	8,610.57	0.90%	-
CITIC Securities International Company Limited	-	5,444,475.22	0.57%	5,444.48	0.57%	-
Goldman Sachs (Asia)L.L.C	-	4,421,108.38	0.47%	6,631.66	0.70%	-
NOBROKER	-	2,648.49	0.00%	-	-	-
BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific)Limited	-	-	-	-	-	-

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants Securities(HK)Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Co.,Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
First Shanghai Securities Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse(Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas Corporate & Investment Banking	-	-	-	-	-	-	-	-
CMB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs (Asia)L.L.C	28,945,500.00	23.66%	-	-	-	-	-	-
NOBROKER	-	-	-	-	-	-	-	-

BOCI Securities Limited	61,489,435.20	50.26%	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific)Limited	31,901,311.20	26.08%	-	-	-	-	-	-

注：券商选择标准和程序：

为保障公司境外证券投资的顺利开展，规范券商选择及交易量分配标准与原则，基金管理人明确了券商选择、考核及交易量的分配等流程。

A. 券商的选择

券商的交易及清算执行能力、研究实力和提供的研究服务等，这是选择券商以及分配交易量最主要的原则和标准，包括以下几个方面：

交易及清算执行能力。主要指券商是否对投资指令进行了有效的执行、能否取得较高质量的成交结果以及成交以后的清算完成情况。衡量交易执行能力的指标主要有：是否完成交易、成交的及时性、成交价格、对市场的影响、清算系统的能力与清算时效性等；

研究机构的实力和水平。主要是指券商能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告，报告内容是否详实，投资建议是否准确；

提供研究服务的质量。主要指券商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。

其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

B. 券商交易量分仓

公司将定期根据交易执行能力、研究机构的实力和水平、提供专业服务的质量等标准对交易券商进行打分考核，并根据考核结果拟定下期的交易量分配。

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
2	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
3	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
4	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

5	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
6	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
7	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
8	关于南方香港优选股票型证券投资基金 2016 年 3 月 25 日和 28 日暂停申购、赎回和定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 3 月 22 日
9	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
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	南方基金关于旗下部分基金增加江苏银行和南充市商业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 27 日
12	南方基金关于旗下部分基金增加钱景财富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 1 日
13	南方基金关于旗下部分基金增加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 6 月 6 日
14	南方基金关于旗下部分基金增加积木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 6 月 20 日
15	关于南方香港优选股票型证券投资基金 2016 年 7 月 1 日暂停申购、赎回和定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 6 月 28 日
16	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

§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中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)的文件

2、《南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)基金合同》

3、《南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)托管协议》

4、《南方香港优选股票型证券投资基金基金合同》

5、《南方香港优选股票型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上披露的各项公告

11.2 存放地点

深圳市福田中心区福华一路 6 号免税商务大厦 31-33 楼

11.3 查阅方式

网站：http://www.nffund.com